



UBS (Lux) ストラテジー・ファンド

ーイールド(米ドル)

クラスP-acc受益証券

クラス(日本円・ヘッジ)P-acc受益証券

ーグロース(米ドル)

クラスP-acc受益証券

クラス(日本円・ヘッジ)P-acc受益証券

ルクセンブルグ籍オープンエンド契約型追加型外国投資信託

運用報告書 (全体版)

作成対象期間 第27期
(2017年2月1日～2018年1月31日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

UBS(Lux)ストラテジー・ファンド(以下「ファンド」といいます。)は、このたび、第27期の決算を行いました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

管理会社

UBSファンド・マネジメント(ルクセンブルグ)エス・エイ

代行協会員

UBS証券株式会社

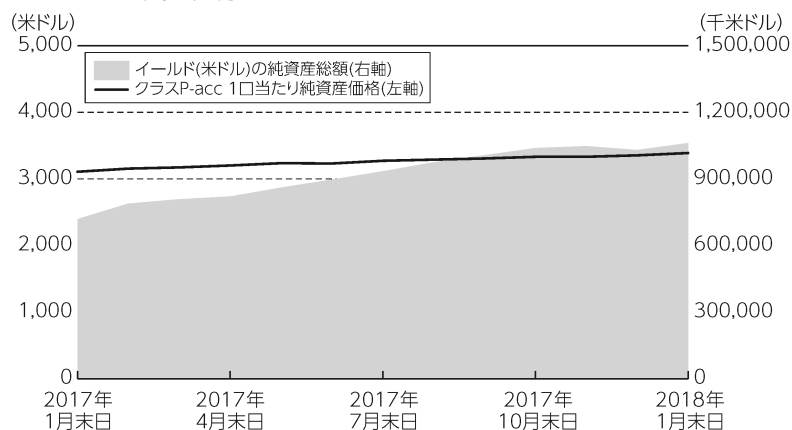
I. 運用の経過等

(1) 当期の運用の経過および今後の運用方針

■当期の1口当たり純資産価格等の推移について

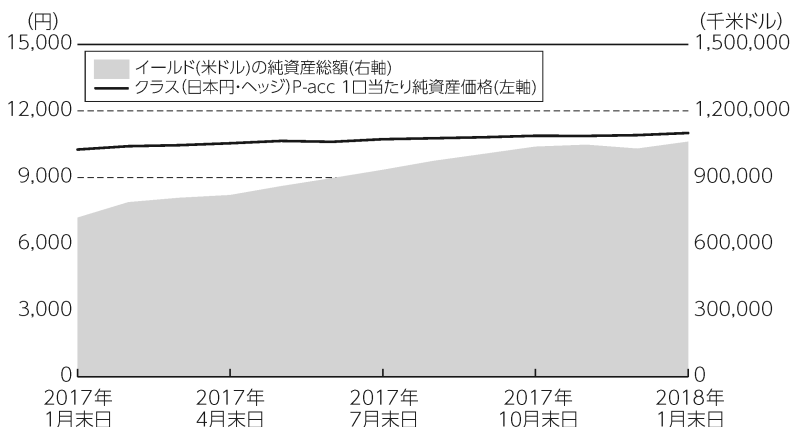
イールド(米ドル)

クラスP-acc受益証券



第26期末の1口当たり純資産価格	3,107.54米ドル
第27期末の1口当たり純資産価格	3,388.62米ドル
騰落率	9.05%

クラス(日本円・ヘッジ)P-acc受益証券



第26期末の1口当たり純資産価格	10,262円
第27期末の1口当たり純資産価格	11,006円
騰落率	7.25%

(注1) 騰落率は、税引前の分配金を分配時に再投資したものとみなして算出しています。以下、同じです。

(注2) 日本においては、現在、「イールド(米ドル)」および「グロース(米ドル)」(以下、個別にまたは総称して「サブ・ファンド」といいます。)のクラスP-acc受益証券およびクラス(日本円・ヘッジ)P-acc受益証券を販売しています。

(注3) クラス(日本円・ヘッジ)P-acc受益証券は、2017年6月6日に設定されました。クラス(日本円・ヘッジ)P-acc受益証券の第26期中の騰落率は、当初発行価格(10,000円)を基準に算出しています。以下、同じです。

(注4) 各サブ・ファンドのクラスP-acc受益証券およびクラス(日本円・ヘッジ)P-acc受益証券については、分配金の支払いを行っていません。

(注5) サブ・ファンドの購入価額により課税条件は異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。以下、同じです。

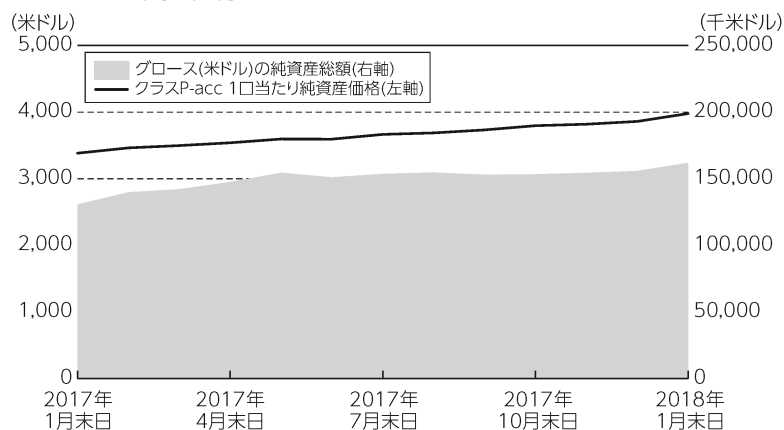
(注6) サブ・ファンドにベンチマークは設定されていません。以下、同じです。

1口当たり純資産価格の主な変動要因

後記「投資環境およびポートフォリオについて」の〈ポートフォリオ〉をご参照ください。

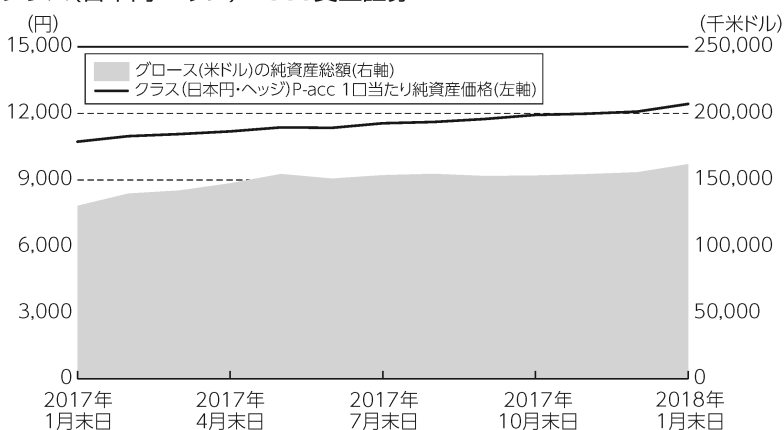
グロス(米ドル)

クラスP-acc受益証券



第26期末の1口当たり純資産価格	3,383.29米ドル
第27期末の1口当たり純資産価格	3,978.13米ドル
騰落率	17.58%

クラス(日本円・ヘッジ)P-acc受益証券



第26期末の1口当たり純資産価格	10,727円
第27期末の1口当たり純資産価格	12,426円
騰落率	15.84%

1口当たり純資産価格の主な変動要因

後記「投資環境およびポートフォリオについて」の<ポートフォリオ>をご参照ください。

■分配金について

該当事項はありません。

■投資環境およびポートフォリオについて

イールド（米ドル）

<投資環境>

当期は地政学上のイベントや選挙に大きく左右される展開でした。特に、フランス大統領選が近づくにつれて金融市場で短期的な不透明感が強まりました。第3四半期には米朝の威嚇合戦から警戒感が強まり、市場が再び下げ圧力を受けました。一方、市場は間もなく回復しました。第4四半期にはトランプ大統領が税制改革法案の具体案を示したことで株式市場が湧き立ちました。2017年のマクロ経済情勢は良好で、当期下期にさらに勢いが強まりました。このような強気の市場環境により株価が上昇しました。当期の米国国債利回りは大半の年限で概ね横ばいで推移しました。

<ポートフォリオ>

当サブ・ファンドは、当期、プラスのリターンを収めました。特に、ハイイールド債や株式等の高リスクの投資対象が、1口当たり純資産価格を押し上げました。

グロース（米ドル）

<投資環境>

当期は地政学上のイベントや選挙に大きく左右される展開でした。特に、フランス大統領選が近づくにつれて金融市場で短期的な不透明感が強まりました。第3四半期には米朝の威嚇合戦から警戒感が強まり、市場が再び下げ圧力を受けました。一方、市場は間もなく回復しました。第4四半期にはトランプ大統領が税制改革法案の具体案を示したことで株式市場が湧き立ちました。2017年のマクロ経済情勢は良好で、当期下期にさらに勢いが強まりました。このような強気の市場環境により株価が上昇しました。当期の米国国債利回りは大半の年限で概ね横ばいで推移しました。

<ポートフォリオ>

当サブ・ファンドは、当期、プラスのリターンを収めました。特に、ハイイールド債や株式等の高リスクの投資対象が、1口当たり純資産価格を押し上げました。

■投資の対象とする有価証券の主な銘柄

当期末現在における有価証券の主な銘柄については、後記「Ⅲ. ファンドの経理状況（3）投資有価証券明細表等」をご参照ください。

■今後の運用方針

イールド（米ドル）

投資方針および投資手法を変更する予定はありません。

グロース（米ドル）

投資方針および投資手法を変更する予定はありません。

(2) 費用の明細

サブ・ファンド	上限定率報酬料率	その他の費用（当期）
イールド（米ドル）	年率 1.440%	0.048%
グローブ（米ドル）	年率 1.800%	0.044%

上限定率報酬は、各サブ・ファンドの管理事務、ポートフォリオ運用および販売に関して、ならびに保管受託銀行のすべての職務の対価として、各サブ・ファンド資産から支払われます。

その他の費用には、資産の売買のための各サブ・ファンドの資産の管理に関する一切の追加費用、各サブ・ファンドの設立、変更、清算および合併に関する費用、その他の報酬および費用や各サブ・ファンドの収益および資産に課せられる一切の税金（ルクセンブルグの年次税）等が含まれます。

（注）報酬については、目論見書に定められている料率または金額を記しています。「その他の費用（当期）」には運用状況等により変動するものや実費となる費用が含まれます。便宜上、その他の費用（当期）の金額を各サブ・ファンドの当期末の純資産総額で除して100を乗じた比率を表示していますが、実際の比率とは異なります。

Ⅱ. 直近10期の運用実績

(1) 純資産の推移

下記各会計年度末および第27会計年度中における各月末の純資産の推移は次のとおりです。

(注1) アメリカ合衆国ドル(以下「米ドル」といいます。)の円貨換算は、2018年5月31日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=108.70円)によります。

(注2) ファンドは、ルクセンブルグ法に基づいて設定されていますが、サブ・ファンドの受益証券は、米ドル建てのため以下の金額表示は別段の記載がない限り米ドルをもって行います。

(注3) 本書の中で金額および比率を表示する場合、四捨五入してあります。したがって、合計の数字が一致しない場合があります。また、円貨への換算は、それに対応する数字につき所定の換算率で単純計算のうえ、必要な場合四捨五入してあります。したがって、本書中の同一の情報につき異なった円貨表示がなされている場合があります。

(イールド(米ドル))

	純資産総額		1口当たりの純資産価格		
	千米ドル	百万円	受益証券の クラス	米ドル	円
第18会計年度末 (2009年1月31日)	328,683	35,728	P-a-c-c	2,185.38	237,551
第19会計年度末 (2010年1月31日)	328,713	35,731	P-a-c-c	2,441.97	265,442
第20会計年度末 (2011年1月31日)	327,195	35,566	P-a-c-c	2,597.06	282,300
第21会計年度末 (2012年1月31日)	304,507	33,100	P-a-c-c	2,632.53	286,156
第22会計年度末 (2013年1月31日)	331,008	35,981	P-a-c-c	2,750.29	298,957
第23会計年度末 (2014年1月31日)	486,350	52,866	P-a-c-c	2,836.21	308,296
第24会計年度末 (2015年1月31日)	667,100	72,514	P-a-c-c	3,009.79	327,164
第25会計年度末 (2016年1月31日)	614,299	66,774	P-a-c-c	2,890.07	314,151
第26会計年度末 (2017年1月31日)	719,205	78,178	P-a-c-c	3,107.54	337,790
			(日本円・ヘッジ) P-a-c-c	10,262円	
第27会計年度末 (2018年1月31日)	1,061,339	115,368	P-a-c-c	3,388.62	368,343
			(日本円・ヘッジ) P-a-c-c	11,006円	
2017年2月末日	788,732	85,735	P-a-c-c	3,154.41	342,884
			(日本円・ヘッジ) P-a-c-c	10,411円	
3月末日	808,450	87,879	P-a-c-c	3,172.54	344,855
			(日本円・ヘッジ) P-a-c-c	10,457円	
4月末日	820,912	89,233	P-a-c-c	3,201.38	347,990
			(日本円・ヘッジ) P-a-c-c	10,544円	

	純資産総額		1口当たりの純資産価格		
	千米ドル	百万円	受益証券の クラス	米ドル	円
5月末日	860,835	93,573	P-a-c-c	3,236.07	351,761
			(日本円・ヘッジ) P-a-c-c	10,649円	
6月末日	896,944	97,498	P-a-c-c	3,231.37	351,250
			(日本円・ヘッジ) P-a-c-c	10,609円	
7月末日	934,351	101,564	P-a-c-c	3,271.86	355,651
			(日本円・ヘッジ) P-a-c-c	10,726円	
8月末日	974,758	105,956	P-a-c-c	3,289.46	357,564
			(日本円・ヘッジ) P-a-c-c	10,770円	
9月末日	1,006,633	109,421	P-a-c-c	3,306.70	359,438
			(日本円・ヘッジ) P-a-c-c	10,816円	
10月末日	1,038,900	112,928	P-a-c-c	3,331.56	362,141
			(日本円・ヘッジ) P-a-c-c	10,881円	
11月末日	1,047,528	113,866	P-a-c-c	3,332.17	362,207
			(日本円・ヘッジ) P-a-c-c	10,874円	
12月末日	1,030,141	111,976	P-a-c-c	3,353.64	364,541
			(日本円・ヘッジ) P-a-c-c	10,910円	
2018年1月末日	1,061,339	115,368	P-a-c-c	3,388.62	368,343
			(日本円・ヘッジ) P-a-c-c	11,006円	

(注1) 本サブ・ファンドは、1991年9月13日から運用を開始しました。

(注2) クラス(日本円・ヘッジ) P-a-c-c 受益証券は、2016年6月6日に設定されました。

(注3) 2008年4月以降の各取引日に使用された1口当たりの純資産価格は、純資産価格の調整の結果、上記および財務書類に記載の価格と異なる場合があります。以下同じです。

(注4) 「1口当たりの純資産価格」は日本で販売されるクラスのみ記載しています。以下同じです。

(グロース (米ドル))

	純資産総額		1口当たりの純資産価格		
	千米ドル	百万円	受益証券の クラス	米ドル	円
第18会計年度末 (2009年1月31日)	93,082	10,118	P - a c c	1,772.78	192,701
第19会計年度末 (2010年1月31日)	92,098	10,011	P - a c c	2,232.68	242,692
第20会計年度末 (2011年1月31日)	90,955	9,887	P - a c c	2,512.85	273,147
第21会計年度末 (2012年1月31日)	77,753	8,452	P - a c c	2,470.40	268,532
第22会計年度末 (2013年1月31日)	76,194	8,282	P - a c c	2,694.22	292,862
第23会計年度末 (2014年1月31日)	88,627	9,634	P - a c c	2,941.65	319,757
第24会計年度末 (2015年1月31日)	109,110	11,860	P - a c c	3,174.82	345,103
第25会計年度末 (2016年1月31日)	124,535	13,537	P - a c c	2,986.89	324,675
第26会計年度末 (2017年1月31日)	130,621	14,199	P - a c c	3,383.29	367,764
			(日本円・ヘッジ) P - a c c	10,727円	
第27会計年度末 (2018年1月31日)	161,876	17,596	P - a c c	3,978.13	432,423
			(日本円・ヘッジ) P - a c c	12,426円	
2017年2月末日	139,811	15,197	P - a c c	3,462.80	376,406
			(日本円・ヘッジ) P - a c c	10,975円	
3月末日	142,103	15,447	P - a c c	3,497.65	380,195
			(日本円・ヘッジ) P - a c c	11,069円	
4月末日	147,494	16,033	P - a c c	3,539.22	384,713
			(日本円・ヘッジ) P - a c c	11,190円	
5月末日	154,475	16,791	P - a c c	3,595.75	390,858
			(日本円・ヘッジ) P - a c c	11,370円	
6月末日	151,034	16,417	P - a c c	3,594.12	390,681
			(日本円・ヘッジ) P - a c c	11,350円	
7月末日	153,591	16,695	P - a c c	3,665.27	398,415
			(日本円・ヘッジ) P - a c c	11,556円	
8月末日	154,614	16,807	P - a c c	3,687.61	400,843
			(日本円・ヘッジ) P - a c c	11,614円	

	純資産総額		1口当たりの純資産価格		
	千米ドル	百万円	受益証券の クラス	米ドル	円
9月末日	152,984	16,629	P-a-c-c	3,732.58	405,731
			(日本円・ヘッジ) P-a-c-c		11,747円
10月末日	153,355	16,670	P-a-c-c	3,796.16	412,643
			(日本円・ヘッジ) P-a-c-c		11,931円
11月末日	154,374	16,780	P-a-c-c	3,818.23	415,042
			(日本円・ヘッジ) P-a-c-c		11,986円
12月末日	155,801	16,936	P-a-c-c	3,860.16	419,599
			(日本円・ヘッジ) P-a-c-c		12,081円
2018年1月末日	161,876	17,596	P-a-c-c	3,978.13	432,423
			(日本円・ヘッジ) P-a-c-c		12,426円

(注1) 本サブ・ファンドは、1991年9月13日から運用を開始しました。

(注2) クラス(日本円・ヘッジ) P-a-c-c 受益証券は、2016年6月6日に設定されました。

(2) 分配の推移

該当事項はありません。

(3) 販売及び買戻しの実績

下記会計年度における販売および買戻しの実績ならびに下記会計年度末日現在の発行済口数は次のとおりです。

(イールド (米ドル))

	受益証券のクラス	販売口数	買戻し口数	発行済口数
第18会計年度	P - a c c	7,540.899 (0)	35,210.819 (0)	131,075.934 (0)
第19会計年度	P - a c c	16,273.121 (0)	29,072.662 (0)	118,276.393 (0)
第20会計年度	P - a c c	23,460.705 (0)	31,823.661 (0)	109,913.437 (0)
第21会計年度	P - a c c	14,331.469 (0)	23,365.962 (0)	100,878.944 (0)
第22会計年度	P - a c c	21,947.977 (0)	18,429.427 (0)	104,397.494 (0)
第23会計年度	P - a c c	61,876.909 (0)	18,224.731 (0)	148,049.672 (0)
第24会計年度	P - a c c	68,481.207 (0)	32,701.166 (0)	183,829.713 (0)
第25会計年度	P - a c c	34,060.365 (0)	45,635.732 (0)	172,254.346 (0)
第26会計年度	P - a c c	54,884.074 (1,761)	59,364.155 (0)	167,774.265 (1,801)
	(日本円・ヘッジ) P - a c c	104,936 (63,460)	0 (0)	104,936 (63,460)
第27会計年度	P - a c c	82,496.049 (1,418.698)	47,495.315 (0)	202,774.999 (3,219.698)
	(日本円・ヘッジ) P - a c c	263,996.053 (191,296.506)	66,027.455 (48,800)	302,904.598 (205,956.506)

(注1) () 内の数字は本邦内における販売、買戻しならびに発行済口数であり、受渡し日を基準として算出しています。一方、() の上段の数字は約定日を基準として算出しています。以下同じです。

(注2) クラス (日本円・ヘッジ) P - a c c 受益証券は、2016年6月6日に設定されました。以下同じです。

(注3) 第26会計年度中に、クラス P - a c c 受益証券40口が海外から移管されました。

(グロース (米ドル))

	受益証券のクラス	販売口数	買戻し口数	発行済口数
第18会計年度	P - a c c	3,193.488 (0)	15,390.021 (0)	52,506.071 (0)
第19会計年度	P - a c c	3,193.694 (0)	14,449.569 (0)	41,250.196 (0)
第20会計年度	P - a c c	1,920.408 (0)	6,974.777 (0)	36,195.827 (0)
第21会計年度	P - a c c	2,074.714 (0)	6,796.664 (0)	31,473.877 (0)
第22会計年度	P - a c c	2,535.439 (0)	5,728.813 (0)	28,280.503 (0)
第23会計年度	P - a c c	7,957.208 (0)	6,109.401 (0)	30,128.310 (0)
第24会計年度	P - a c c	10,266.267 (0)	6,073.226 (0)	34,321.351 (0)
第25会計年度	P - a c c	16,514.335 (0)	9,963.544 (0)	40,872.142 (0)
第26会計年度	P - a c c	11,384.566 (47)	16,920.359 (0)	35,336.349 (47)
	(日本円・ヘッジ) P - a c c	17,768.153 (12,900)	0 (0)	17,768.153 (12,900)
第27会計年度	P - a c c	7,799.139 (624.243)	8,170.182 (0)	34,965.306 (671.243)
	(日本円・ヘッジ) P - a c c	59,913.512 (8,339.446)	1,228.153 (0)	76,453.512 (21,239.446)

Ⅲ. ファンドの経理状況

財務諸表

- a. ファンドの直近会計年度の日本語の財務書類は、ルクセンブルグにおける法令に準拠して作成された原文の財務書類を翻訳したものである。これは「特定有価証券の内容等の開示に関する内閣府令」に基づき、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第131条第5項ただし書の規定の適用によるものである（ただし、円換算部分を除く。）。
- b. 原文の財務書類は、UBS (Lux) ストラテジー・ファンドおよびすべてのサブ・ファンドにつき一括して作成されている。本書において原文の財務書類については、関係するサブ・ファンドに関連する部分のみを記載し、日本語の作成にあたっては関係するサブ・ファンドに関連する部分のみを翻訳している。ただし、「財務書類に対する注記」については、原文は全文を記載し、日本語はイールド（米ドル）およびグロース（米ドル）に関連する部分のみを翻訳している。
- c. ファンドの原文の財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）であるアーンスト・アンド・ヤング・ソシエテ・アノニムから監査証明に相当すると認められる証明を受けており、当該監査証明に相当すると認められる証明に係る監査報告書に相当するもの（訳文を含む。）が当該財務書類に添付されている。
- d. ファンドの原文の財務書類は、ユーロおよび米ドルで表示されている。日本語の財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円による金額は、2018年5月31日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1ユーロ=126.73円、1米ドル=108.70円）で換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

独立監査人の報告書

U B S (Lux) ストラテジー・ファンドの受益者各位
ルクセンブルグ、L-1855、J. F ケネディ通り33A番

意見

我々は、U B S (Lux) ストラテジー・ファンド（以下「ファンド」という。）およびその各サブ・ファンドの、2018年1月31日現在の純資産計算書、投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表ならびに同日に終了した年度の運用計算書、純資産変動計算書ならびに重要な会計方針の概要を含む財務書類に対する注記で構成される財務書類を監査した。

我々の意見では、添付の財務書類は、財務書類の作成および表示に関するルクセンブルグの法令上の要件に準拠して、ファンドの2018年1月31日現在の財務状態、ならびに同日に終了した年度の運用実績および純資産の変動について真実かつ公正に表示しているものと認める。

意見の根拠

我々は、監査業務に関する2016年7月23日法（以下「2016年7月23日法」という。）およびルクセンブルグの金融監督委員会（以下「C S S F」という。）が採用した国際監査基準（以下「I S A s」という。）に準拠して監査を行った。当該法および基準の下での我々の責任については、「財務書類の監査に関する公認企業監査人 (Réviseur d'entreprises agréé) の責任」の項において詳述されている。我々はまた、財務書類に対する我々の監査に関する倫理上の要件と共にルクセンブルグのC S S Fが採用した国際会計士倫理基準審議会の職業会計士の倫理規程（「I E S B A規定」）に従ってファンドから独立した立場にあり、かかる倫理上の要件に基づき他の倫理的な義務も果たしている。我々は、我々が入手した監査証拠が監査意見表明のための基礎を得るのに十分かつ適切であると判断している。

その他の情報

ファンドの取締役会は、年次報告書に含まれる情報で構成されるその他の情報（財務書類およびそれに対する公認企業監査人 (Réviseur d'entreprises agréé) の我々の報告書は含まれない。）に関して責任を負う。

財務書類に対する我々の意見は、その他の情報を対象としておらず、我々は、その他の情報に対していかなる形式の結論の保証も表明しない。

財務書類の監査に関する我々の責任は、その他の情報を精読し、当該情報が、財務書類または我々が監査で入手した知識と著しく矛盾していないか、もしくは重要な虚偽表示があると思われるかについて検討することである。我々が実施した調査に基づき、当該情報に重要な虚偽表示があるという結論に達した場合、我々はその事実を報告する義務がある。この点に関し、我々に報告すべき事項はない。

財務書類に対するファンドの取締役会および統治責任者の責任

ファンドの取締役会は、財務書類の作成および表示に関するルクセンブルグの法令上の要件に準拠して当財務書類の作成および公正な表示、ならびに不正または誤謬のいずれに起因するかを問わず、重要な虚偽表示がない財務書類を作成するために必要であるとファンドの取締役会が決定する内部統制に関して責任を負う。

財務書類の作成において、ファンドの取締役会は、ファンドが継続企業として存続する能力を評価し、それが適用される場合には、ファンドの取締役会がファンドの清算もしくは運用の中止を意図している、または現実的にそれ以外の選択肢がない場合を除き、継続企業的前提に関する事象を適宜開示し、継続企業の会計基準を使用する責任を負う。

財務書類の監査に関する公認企業監査人 (Réviseur d'entreprises agréé) の責任

我々の目的は、不正または誤謬のいずれに起因するかを問わず、財務書類に全体として重要な虚偽表示がないかどうかにつき合理的な保証を得ること、および監査意見を含む公認企業監査人 (Réviseur d'entreprises agréé) の報告書を発行することである。合理的な保証は高度な水準の保証ではあるが、2016年7月23日法およびルクセンブルグのC S S Fが採用したI S A sに準拠して行われる監査が、重要な虚偽表示を常に発見することを保証するものではない。虚偽表示は不正または誤謬により生じることがあり、単独でまたは全体として、当該財務書類に基づく利用者の経済的意思決定に影響を及ぼすことが合理的に予想される場合に、重要とみなされる。

2016年7月23日法およびルクセンブルグのC S S Fが採用したI S A sに準拠した監査の一環として、監査中、我々は専門的判断を下し、職業的懐疑心を保っている。

また、以下も実行する。

- ・ 不正または誤謬のいずれに起因するかを問わず、財務書類の重要な虚偽表示のリスクを認識および評価し、それらのリスクに対応する監査手続を策定および実行し、我々の意見表明のための基礎として十分かつ適切な監査証拠を得る。不正による重要な虚偽表示は共謀、偽造、意図的な削除、不正表示または内部統制の無効化によることがあるため、誤謬による重要な虚偽表示に比べて、見逃すリスクはより高い。
- ・ ファンドの内部統制の有効性についての意見を表明するためではなく、状況に適した監査手続を策定するために、監査に関する内部統制についての知識を得る。
- ・ 使用される会計方針の適切性ならびにファンドの取締役会が行った会計上の見積りおよび関連する開示の合理性を評価する。
- ・ ファンドの取締役会が継続企業的前提の会計基準を採用した適切性および、入手した監査証拠に基づき、ファンドが継続企業として存続する能力に重大な疑義を生じさせる可能性のある事象または状況に関連する重要な不確実性の有無について結論を下す。重要な不確実性が存在するという結論に達した場合、我々は、公認企業監査人 (Réviseur d'entreprises agréé) の我々の報告書において、財務書類における関連する開示に対して注意喚起し、当該開示が不十分であった場合は、監査意見を修正する義務がある。我々の結論は、公認企業監査人 (Réviseur d'entreprises agréé) の我々の報告書の日付までに入手した監査証拠に基づく。しかし、将来の事象または状況が、ファンドが継続企業として存続しなくなる原因となることがある。
- ・ 開示を含む財務書類の全体的な表示、構成および内容について、また、財務書類が、適正表示を実現する方法で対象となる取引および事象を表しているかについて評価する。

我々は統治責任者に、特に、計画した監査の範囲および実施時期、ならびに我々が監査中に特定した内部統制における重大な不備を含む重大な監査所見に関して報告する。

ルクセンブルグ、2018年5月28日

アーンスト・アンド・ヤング・
ソシエテ・アノニム
公認の監査法人

[署名]

N. ファバー

Independent auditor's report

To the Unitholders of

UBS (Lux) Strategy Fund
33A, avenue J.F. Kennedy
L-1855 Luxembourg

Opinion

We have audited the financial statements of UBS (Lux) Strategy Fund (the "Fund") and of each of its subfunds, which comprise the statement of net assets and the statement of investments in securities and other net assets as at 31 January 2018, and the statement of operations and the statement of changes in net assets for the year then ended, and the notes to the financial statements, including a summary of significant accounting policies.

In our opinion, the accompanying financial statements give a true and fair view of the financial position of the Fund and of each of its subfunds as at 31 January 2018, and of the results of their operations and changes in their net assets for the year then ended in accordance with Luxembourg legal and regulatory requirements relating to the preparation and presentation of the financial statements.

Basis for Opinion

We conducted our audit in accordance with the Law of 23 July 2016 on the audit profession (the "Law of 23 July 2016") and with International Standards on Auditing ("ISAs") as adopted for Luxembourg by the "Commission de Surveillance du Secteur Financier" ("CSSF"). Our responsibilities under those Law and standards are further described in the "responsibilities of the "réviseur d'entreprises agréé" for the audit of the financial statements" section of our report. We are also independent of the Fund in accordance with the International Ethics Standards Board for Accountants' Code of Ethics for Professional Accountants ("IESBA Code") as adopted for Luxembourg by the CSSF together with the ethical requirements that are relevant to our audit of the financial statements, and have fulfilled our other ethical responsibilities under those ethical requirements. We believe that the audit evidence we have obtained is sufficient and appropriate to provide a basis for our opinion.

Other information

The Board of Directors of the Fund is responsible for the other information. The other information comprises the information included in the annual report but does not include the financial statements and our report of the "réviseur d'entreprises agréé" thereon.

Our opinion on the financial statements does not cover the other information and we do not express any form of assurance conclusion thereon.

In connection with our audit of the financial statements, our responsibility is to read the other information and, in doing so, consider whether the other information is materially inconsistent with the financial statements or our knowledge obtained in the audit or otherwise appears to be materially misstated. If, based on the work we have performed, we conclude that there is a material misstatement of this other information, we are required to report this fact. We have nothing to report in this regard.

Responsibilities of the Board of Directors of the Fund and those charged with governance for the financial statements

The Board of Directors of the Fund is responsible for the preparation and fair presentation of these financial statements in accordance with Luxembourg legal and regulatory requirements relating to the preparation and presentation of the financial statements, and for such internal control as the Board of Directors of the Fund determines is necessary to enable the preparation of financial statements that are free from material misstatement, whether due to fraud or error.

In preparing the financial statements, the Board of Directors of the Fund is responsible for assessing the Fund's ability to continue as a going concern, disclosing, as applicable, matters related to going concern and using the going concern basis of accounting unless the Board of Directors of the Fund either intends to liquidate the Fund or to cease operations, or has no realistic alternative but to do so.

Responsibilities of the “réviseur d’entreprises agréé” for the audit of the financial statements

Our objectives are to obtain reasonable assurance about whether the financial statements as a whole are free from material misstatement, whether due to fraud or error, and to issue a report of the “réviseur d’entreprises agréé” that includes our opinion. Reasonable assurance is a high level of assurance, but is not a guarantee that an audit conducted in accordance with the Law of 23 July 2016 and with ISAs as adopted for Luxembourg by the CSSF will always detect a material misstatement when it exists. Misstatements can arise from fraud or error and are considered material if, individually or in the aggregate, they could reasonably be expected to influence the economic decisions of users taken on the basis of these financial statements.

As part of an audit in accordance with the Law of 23 July 2016 and with ISAs as adopted for Luxembourg by the CSSF, we exercise professional judgment and maintain professional skepticism throughout the audit. We also:

- Identify and assess the risks of material misstatement of the financial statements, whether due to fraud or error, design and perform audit procedures responsive to those risks, and obtain audit evidence that is sufficient and appropriate to provide a basis for our opinion. The risk of not detecting a material misstatement resulting from fraud is higher than for one resulting from error, as fraud may involve collusion, forgery, intentional omissions, misrepresentations, or the override of internal control.
- Obtain an understanding of internal control relevant to the audit in order to design audit procedures that are appropriate in the circumstances, but not for the purpose of expressing an opinion on the effectiveness of the Fund’s internal control.
- Evaluate the appropriateness of accounting policies used and the reasonableness of accounting estimates and related disclosures made by the Board of Directors of the Fund.

- Conclude on the appropriateness of Board of Directors of the Fund use of the going concern basis of accounting and, based on the audit evidence obtained, whether a material uncertainty exists related to events or conditions that may cast significant doubt on the Fund’s ability to continue as a going concern. If we conclude that a material uncertainty exists, we are required to draw attention in our report of the “réviseur d’entreprises agréé” to the related disclosures in the financial statements or, if such disclosures are inadequate, to modify our opinion. Our conclusions are based on the audit evidence obtained up to the date of our report of the “réviseur d’entreprises agréé”. However, future events or conditions may cause the Fund to cease to continue as a going concern.
- Evaluate the overall presentation, structure and content of the financial statements, including the disclosures, and whether the financial statements represent the underlying transactions and events in a manner that achieves fair presentation.

We communicate with those charged with governance regarding, among other matters, the planned scope and timing of the audit and significant audit findings, including any significant deficiencies in internal control that we identify during our audit.

Luxembourg, 28 May 2018

ERNST & YOUNG
Société Anonyme
Cabinet de révision agréé

N. Faber

Bericht des Réviseur d'entreprises agréé

An die Anteilscheininhaber

UBS (Lux) Strategy Fund
33A, avenue J.F. Kennedy
L-1855 Luxemburg

Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresabschluss des UBS (Lux) Strategy Fund (der «Fonds») und für jeden seiner Teilfonds bestehend aus der Nettovermögensaufstellung und der Aufstellung der Wertpapierbestände und anderer Nettovermögenswerte zum 31. Januar 2018 sowie der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr sowie dem Anhang mit einer Zusammenfassung bedeutsamer Rechnungslegungsmethoden - geprüft.

Nach unserer Beurteilung vermittelt der beigefügte Jahresabschluss in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen betreffend die Aufstellung und Darstellung des Jahresabschlusses ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens- und Finanzlage des Fonds und für jeden seiner Teilfonds zum 31. Januar 2018 sowie der Ertragslage und der Entwicklung des Nettofondsvermögens für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr.

Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir führten unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz über die Prüfungstätigkeit (das «Gesetz vom 23. Juli 2016») und nach den für Luxemburg von der Commission de Surveillance du Secteur Financier («CSSF») angenommenen internationalen Prüfungsstandards («ISA») durch. Unsere Verantwortung gemäss diesem Gesetz und diesen Standards wird im Abschnitt «Verantwortung des Réviseur d'entreprises agréé für die Jahresabschlussprüfung» weitergehend beschrieben. Wir sind unabhängig von dem Fonds in Übereinstimmung mit dem für Luxemburg von der CSSF angenommenen «International Ethics Standards Board for Accountants' Code of Ethics for Professional Accountants» («IESBA Code») zusammen mit den beruflichen Verhaltensanforderungen, welche wir im Rahmen der Jahresabschlussprüfung einzuhalten haben und haben alle sonstigen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Verhaltensanforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen.

UBS (Lux) Strategy Fund
Jahresbericht per 31. Januar 2018

Sonstige Informationen

Der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft des Fonds ist verantwortlich für die sonstigen Informationen. Die sonstigen Informationen beinhalten die Informationen, welche im Jahresbericht enthalten sind, jedoch beinhalten sie nicht den Jahresabschluss oder unseren Bericht des Réviseur d'entreprises agréé zu diesem Jahresabschluss.

Unser Prüfungsurteil zum Jahresabschluss deckt nicht die sonstigen Informationen ab und wir geben keinerlei Sicherheit jedweder Art auf diese Informationen.

Im Zusammenhang mit der Prüfung des Jahresabschlusses besteht unsere Verantwortung darin, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu beurteilen, ob eine wesentliche Unstimmigkeit zwischen diesen und dem Jahresabschluss oder mit den bei der Abschlussprüfung gewonnenen Erkenntnissen besteht oder auch ansonsten die sonstigen Informationen wesentlich falsch dargestellt erscheinen. Sollten wir auf Basis der von uns durchgeführten Arbeiten schlussfolgern, dass sonstige Informationen wesentliche falsche Darstellungen enthalten, sind wir verpflichtet, diesen Sachverhalt zu berichten. Wir haben diesbezüglich nichts zu berichten.

Verantwortung des Verwaltungsrats der Verwaltungsgesellschaft des Fonds und der für die Überwachung Verantwortlichen für den Jahresabschluss

Der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft des Fonds ist verantwortlich für die Aufstellung und sachgerechte Gesamtdarstellung des Jahresabschlusses in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen zur Aufstellung und Darstellung des Jahresabschlusses und für die internen Kontrollen, die der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft des Fonds als notwendig erachtet, um die Aufstellung des Jahresabschlusses zu ermöglichen, der frei von wesentlichen - beabsichtigten oder unbeabsichtigten - falschen Darstellungen ist.

Bei der Aufstellung des Jahresabschlusses ist der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft des Fonds verantwortlich für die Beurteilung der Fähigkeit des Fonds zur Fortführung der Unternehmenstätigkeit und - sofern einschlägig - Angaben zu Sachverhalten zu machen, die im Zusammenhang mit der Fortführung der Unternehmenstätigkeit stehen, und die Annahme der Unternehmenstätigkeit als Rechnungslegungsgrundsatz zu nutzen, sofern der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft des Fonds nicht beabsichtigt den Fonds zu liquidieren,

die Geschäftstätigkeit einzustellen oder keine andere realistische Alternative mehr hat, als so zu handeln.

Verantwortung des Réviseur d'entreprises agréé für die Jahresabschlussprüfung

Die Zielsetzung unserer Prüfung ist es, eine hinreichende Sicherheit zu erlangen, ob der Jahresabschluss als Ganzes frei von wesentlichen - beabsichtigten oder unbeabsichtigten - falschen Darstellungen ist und darüber einen Bericht des Réviseur d'entreprises agréé, welcher unser Prüfungsurteil enthält, zu erteilen. Hinreichende Sicherheit entspricht einem hohen Grad an Sicherheit, ist aber keine Garantie dafür, dass eine Prüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und nach den für Luxemburg von der CSSF angenommenen ISAs stets eine wesentliche falsche Darstellung, falls vorhanden, aufdeckt. Falsche Darstellungen können entweder aus Unrichtigkeiten oder aus Verstößen resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn vernünftigerweise davon ausgegangen werden kann, dass diese individuell oder insgesamt, die auf der Grundlage dieses Jahresabschlusses getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.

Im Rahmen einer Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und nach den für Luxemburg von der CSSF angenommenen ISAs üben wir unser pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus:

- Identifizieren und beurteilen wir das Risiko von wesentlichen falschen Darstellungen im Jahresabschluss aus Unrichtigkeiten oder Verstößen, planen und führen Prüfungshandlungen durch als Antwort auf diese Risiken und erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und angemessen sind, um als Grundlage für das Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist bei Verstößen höher als bei Unrichtigkeiten, da Verstöße betrügerisches Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Angaben bzw. das Ausserkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- Gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des internen Kontrollsystems des Fonds abzugeben.
- Beurteilen wir die Angemessenheit der von Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft des Fonds angewandten Bilanzierungsmethoden, der rechnungslegungsrelevanten Schätzungen und den entsprechenden Anhangangaben.
- Schlussfolgern wir über die Angemessenheit der Anwendung des Rechnungslegungsgrundsatzes der Fortführung der Unternehmenstätigkeit durch den Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft des Fonds sowie auf der Grundlage der erlangten Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fähigkeit des Fonds zur Fortführung der Unternehmenstätigkeit aufwerfen könnten. Sollten wir schlussfolgern, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet im Bericht des Réviseur d'entreprises agréé auf die dazugehörigen Anhangangaben zum Jahresabschluss hinzuweisen oder, falls die Angaben unangemessen sind, das Prüfungsurteil zu modifizieren. Diese Schlussfolgerungen basieren auf der Grundlage der bis zum Datum des Berichts des Réviseur d'entreprises agréé erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass der Fonds seine Unternehmenstätigkeit nicht mehr fortführen kann.
- Beurteilen wir die Gesamtdarstellung, den Aufbau und den Inhalt des Jahresabschlusses einschliesslich der Anhangangaben und beurteilen, ob dieser die zugrundeliegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse sachgerecht darstellt.

Wir kommunizieren mit den für die Überwachung Verantwortlichen, unter anderem den geplanten Prüfungsumfang und Zeitraum sowie wesentliche Prüfungsfeststellungen einschliesslich wesentlicher Schwächen im internen Kontrollsystem, welche wir im Rahmen der Prüfung identifizieren.

Luxemburg, 28. Mai 2018

ERNST & YOUNG
Société Anonyme
Cabinet de révision agréé



N. Faber

(1) 貸借対照表

UBS (Lux) ストラテジー・ファンド

連結純資産計算書

	ユーロ	千 円
	2018年1月31日現在	
資産		
投資有価証券、取得原価	7,646,347,377.83	969,021,603
投資有価証券、未実現評価(損)益	1,043,226,720.30	132,208,122
投資有価証券合計(注1)	8,689,574,098.13	1,101,229,725
現金預金、要求払預金および貯蓄預金	81,543,385.03	10,333,993
その他の流動資産(委託証拠金)	49,277,547.33	6,244,944
有価証券売却未収金(注1)	2,951,232.72	374,010
発行受益証券未収金	13,466,115.22	1,706,561
有価証券に係る未収利息	14,822,857.56	1,878,501
流動資産に係る未収利息	372.99	47
未収分配金	501,970.21	63,615
その他の未収金	49,262.65	6,243
その他の資産	166,559.10	21,108
金融先物に係る未実現(損)益(注1)	(937,880.78)	(118,858)
先渡為替契約に係る未実現(損)益(注1)	111,248,577.22	14,098,532
資産合計	8,962,664,097.38	1,135,838,421
負債		
当座借越	(17,037.65)	(2,159)
当座借越に係る未払利息	(441.23)	(56)
有価証券購入未払金(注1)	(11,090,925.46)	(1,405,553)
買戻受益証券未払金	(16,834,943.34)	(2,133,492)
報酬引当金(注2)	(5,858,390.03)	(742,434)
年次税引当金(注3)	(160,203.64)	(20,303)
その他の手数料および報酬引当金(注2)	(216,149.48)	(27,393)
引当金合計	(6,234,743.15)	(790,129)
負債合計	(34,178,090.83)	(4,331,389)
期末現在純資産額	8,928,486,006.55	1,131,507,032

注記は、財務書類と不可分のものである。

(2) 損益計算書

UBS (Lux) ストラテジー・ファンド

連結運用計算書

	ユーロ	千 円
	自2017年2月1日 至2018年1月31日	
収益		
流動資産に係る利息	355,318.07	45,029
有価証券に係る利息	46,405,466.42	5,880,965
分配金	32,033,298.05	4,059,580
スワップに係る受取利息 (注1)	2,278,613.45	288,769
貸付有価証券に係る収益 (注12)	2,851,426.10	361,361
その他の収益 (注4)	1,666,719.84	211,223
収益合計	85,590,841.93	10,846,927
費用		
スワップに係る支払利息 (注1)	(130,021.59)	(16,478)
報酬 (注2)	(128,743,924.33)	(16,315,718)
年次税 (注3)	(1,990,497.90)	(252,256)
貸付有価証券に係るコスト (注12)	(1,140,570.38)	(144,544)
その他の手数料および報酬 (注2)	(1,096,566.29)	(138,968)
現金および当座借越に係る利息	(556,721.25)	(70,553)
費用合計	(133,658,301.74)	(16,938,517)
投資に係る純 (損) 益	(48,067,459.81)	(6,091,589)
実現 (損) 益 (注1)		
オプション無し時価評価有価証券に係る 実現 (損) 益	340,236,816.09	43,118,212
利回り評価有価証券および短期金融商品に係る 実現 (損) 益	39,003.87	4,943
金融先物に係る実現 (損) 益	3,632,981.75	460,408
先渡為替契約に係る実現 (損) 益	109,593,455.19	13,888,779
スワップに係る実現 (損) 益	4,139,555.83	524,606
外国為替に係る実現 (損) 益	(1,006,573.92)	(127,563)
実現 (損) 益合計	456,635,238.81	57,869,384
当期実現純 (損) 益	408,567,779.00	51,777,795
未実現評価 (損) 益の変動 (注1)		
オプション無し時価評価有価証券に係る 未実現評価 (損) 益	230,022,367.52	29,150,735
利回り評価有価証券および短期金融商品に係る 未実現評価 (損) 益	(146,764.84)	(18,600)
金融先物に係る未実現評価 (損) 益	(2,452,031.28)	(310,746)
先渡為替契約に係る未実現評価 (損) 益	75,404,485.34	9,556,010
スワップに係る未実現評価 (損) 益	(3,624,461.55)	(459,328)
未実現評価 (損) 益の変動合計	299,203,595.19	37,918,072
運用の結果による純資産の純増 (減)	707,771,374.19	89,695,866

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・ファンドーイールド (米ドル)

3年度の比較

	ISIN	2018年1月31日	2017年1月31日	2016年1月31日
純資産額 (米ドル)		1,061,338,723.11	719,205,149.17	614,299,334.76
クラスK-1-a c c	LU0939686977			
発行済受益証券口数		9.9000	5.5000	7.2000
1口当たり純資産価格 (米ドル)		6,212,888.94	5,666,824.31	5,241,674.79
1口当たり発行および買戻価格 (米ドル) ¹		6,212,888.94	5,666,824.31	5,241,674.79
クラス (日本円・ヘッジ) K-1-a c c ²	LU1610875996			
発行済受益証券口数		9.3000	—	—
1口当たり純資産価格 (円)		519,048,875	—	—
1口当たり発行および買戻価格 (円) ¹		519,048,875	—	—
クラスP-4%-m d i s t ³	LU1417001382			
発行済受益証券口数		116,186.0690	66,993.9190	—
1口当たり純資産価格 (米ドル)		1,062.81	1,014.68	—
1口当たり発行および買戻価格 (米ドル) ¹		1,062.81	1,014.68	—
クラスP-a c c	LU0033043885			
発行済受益証券口数		202,774.9990	167,774.2650	172,254.3460
1口当たり純資産価格 (米ドル)		3,388.62	3,107.54	2,890.07
1口当たり発行および買戻価格 (米ドル) ¹		3,388.62	3,107.54	2,890.07
クラス (英ポンド・ヘッジ) P-a c c ⁴	LU1634239799			
発行済受益証券口数		14,142.5180	—	—
1口当たり純資産価格 (英ポンド)		1,035.87	—	—
1口当たり発行および買戻価格 (英ポンド) ¹		1,035.87	—	—
クラス (日本円・ヘッジ) P-a c c ⁵	LU1410364910			
発行済受益証券口数		302,904.5980	104,936.0000	—
1口当たり純資産価格 (円)		11,006	10,262	—
1口当たり発行および買戻価格 (円) ¹		11,006	10,262	—
クラスP-d i s t	LU0033041590			
発行済受益証券口数		37,862.7490	43,616.7640	52,283.4230
1口当たり純資産価格 (米ドル)		1,550.28	1,439.22	1,360.53
1口当たり発行および買戻価格 (米ドル) ¹		1,550.28	1,439.22	1,360.53
クラスQ-a c c	LU0941351925			
発行済受益証券口数		220,937.2500	185,294.2090	61,362.6390
1口当たり純資産価格 (米ドル)		122.40	111.59	103.17
1口当たり発行および買戻価格 (米ドル) ¹		122.40	111.59	103.17
クラスQ-d i s t	LU1240800539			
発行済受益証券口数		71,031.4920	55,139.3320	13,059.3780
1口当たり純資産価格 (米ドル)		110.96	102.98	97.14
1口当たり発行および買戻価格 (米ドル) ¹		110.96	102.98	97.14

¹ 注記1を参照のこと。

² 初回純資産価格計算日：2017年5月29日

³ 初回純資産価格計算日：2016年6月2日

⁴ 初回純資産価格計算日：2017年7月12日

⁵ 初回純資産価格計算日：2016年6月7日

パフォーマンス

	通貨	2017年/2018年	2016年/2017年	2015年/2016年
クラスK-1-a c c	米ドル	9.6%	8.1%	-3.5%
クラス (日本円・ヘッジ) K-1-a c c ¹	日本円	—	—	—
クラスP-4%-m d i s t	米ドル	9.0%	—	—
クラスP-a c c	米ドル	9.0%	7.5%	-4.0%
クラス (英ポンド・ヘッジ) P-a c c ¹	英ポンド	—	—	—
クラス (日本円・ヘッジ) P-a c c	日本円	7.3%	—	—
クラスP-d i s t	米ドル	9.0%	7.5%	-4.0%
クラスQ-a c c	米ドル	9.7%	8.2%	-3.3%
クラスQ-d i s t	米ドル	9.7%	8.2%	—

¹ 最近運用を開始したため、パフォーマンスの計算に関するデータはない。

過去の実績は、現在または将来のパフォーマンスの指標にはならない。

実績データは、受益証券の発行および買戻しの時に請求される手数料および費用を考慮していない。

実績データは、監査の対象ではなかった。

本サブ・ファンドはベンチマークを有していない。

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・ファンドーイールド (米ドル)

投資有価証券の構成

通貨別分類 (対純資産割合 (%))

米ドル	96.56
ユーロ	0.56
日本円	0.41
英ポンド	0.30
カナダ・ドル	0.15
スイス・フラン	0.14
豪ドル	0.12
香港ドル	0.06
スウェーデン・クローネ	0.05
デンマーク・クローネ	0.03
シンガポール・ドル	0.02
ノルウェー・クローネ	0.01
合計	98.41

商品別分類 (対純資産割合 (%))

投資信託、オープン・エンド型	66.50
固定利付米国中期国債	11.59
固定利付ノート	5.91
無記名株	4.32
変動利付米国中期国債	3.98
固定利付債券	3.81
固定利付ミディアム・ターム・ノート	1.99
記名株式	0.26
その他の株式	0.03
優先株式	0.01
預託証券	0.01
合計	98.41

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・ファンドーイールド (米ドル)

純資産計算書

	米ドル	千円
	2018年1月31日現在	
資産		
投資有価証券、取得原価	945,880,765.49	102,817,239
投資有価証券、未実現評価(損)益	98,599,914.90	10,717,811
投資有価証券合計(注1)	1,044,480,680.39	113,535,050
現金預金、要求払預金および貯蓄預金	9,657,299.65	1,049,748
その他の流動資産(委託証拠金)	6,028,120.54	655,257
発行受益証券未収金	1,443,189.92	156,875
有価証券に係る未収利息	1,587,254.55	172,535
未収分配金	34,620.87	3,763
その他の未収金	4,677.21	508
金融先物に係る未実現(損)益(注1)	349,373.49	37,977
先渡為替契約に係る未実現(損)益(注1)	(1,371,800.13)	(149,115)
資産合計	1,062,213,416.49	115,462,598
負債		
買戻受益証券未払金	(210,796.07)	(22,914)
報酬引当金(注2)	(632,791.51)	(68,784)
年次税引当金(注3)	(15,740.21)	(1,711)
その他の手数料および報酬引当金(注2)	(15,365.59)	(1,670)
引当金合計	(663,897.31)	(72,166)
負債合計	(874,693.38)	(95,079)
期末現在純資産額	1,061,338,723.11	115,367,519

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・ファンド・イールド (米ドル)

運用計算書

	米ドル	千円
	自2017年2月1日	至2018年1月31日
収益		
流動資産に係る利息	72,804.34	7,914
有価証券に係る利息	5,602,845.61	609,029
分配金	1,790,065.18	194,580
スワップに係る受取利息 (注1)	203,509.18	22,121
貸付有価証券に係る収益 (注12)	324,587.84	35,283
その他の収益 (注4)	567,766.15	61,716
収益合計	8,561,578.30	930,644
費用		
スワップに係る支払利息 (注1)	(11,807.76)	(1,284)
報酬 (注2)	(12,792,771.07)	(1,390,574)
年次税 (注3)	(181,722.37)	(19,753)
貸付有価証券に係るコスト (注12)	(129,835.13)	(14,113)
その他の手数料および報酬 (注2)	(133,514.46)	(14,513)
現金および当座借越に係る利息	(52,297.57)	(5,685)
費用合計	(13,301,948.36)	(1,445,922)
投資に係る純 (損) 益	(4,740,370.06)	(515,278)
実現 (損) 益 (注1)		
オプション無し時価評価有価証券に係る 実現 (損) 益	21,054,351.65	2,288,608
金融先物に係る実現 (損) 益	1,533,990.28	166,745
先渡為替契約に係る実現 (損) 益	(1,178,623.16)	(128,116)
スワップに係る実現 (損) 益	496,875.50	54,010
外国為替に係る実現 (損) 益	18,530.09	2,014
実現 (損) 益合計	21,925,124.36	2,383,261
当期実現純 (損) 益	17,184,754.30	1,867,983
未実現評価 (損) 益の変動 (注1)		
オプション無し時価評価有価証券に係る 未実現評価 (損) 益	63,783,349.02	6,933,250
金融先物に係る未実現評価 (損) 益	225,861.20	24,551
先渡為替契約に係る未実現評価 (損) 益	557,634.90	60,615
スワップに係る未実現評価 (損) 益	(454,969.17)	(49,455)
未実現評価 (損) 益の変動合計	64,111,875.95	6,968,961
運用の結果による純資産の純増 (減)	81,296,630.25	8,836,944

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・ファンド・イールド (米ドル)

純資産変動計算書

	米ドル	千円
	自2017年2月1日 至2018年1月31日	
期首現在純資産額	719,205,149.17	78,177,600
受益証券発行	495,488,966.87	53,859,651
受益証券買戻し	(229,884,140.65)	(24,988,406)
受益証券発行 (買戻し) 純額合計	265,604,826.22	28,871,245
支払分配金	(4,767,882.53)	(518,269)
純投資 (損) 益	(4,740,370.06)	(515,278)
実現 (損) 益合計	21,925,124.36	2,383,261
未実現評価 (損) 益の変動合計	64,111,875.95	6,968,961
運用の結果による純資産の純増 (減)	81,296,630.25	8,836,944
期末現在純資産額	1,061,338,723.11	115,367,519

発行済受益証券口数の変動

	自2017年2月1日 至2018年1月31日	
クラス	K-1-a-c-c	
期首現在発行済受益証券口数	5.5000	
発行受益証券口数	5.7000	
買戻受益証券口数	(1.3000)	
期末現在発行済受益証券口数	9.9000	
クラス	(日本円・ヘッジ) K-1-a-c-c	
期首現在発行済受益証券口数	0.0000	
発行受益証券口数	9.7000	
買戻受益証券口数	(0.4000)	
期末現在発行済受益証券口数	9.3000	
クラス	P-4%-mdist	
期首現在発行済受益証券口数	66,993.9190	
発行受益証券口数	79,381.3110	
買戻受益証券口数	(30,189.1610)	
期末現在発行済受益証券口数	116,186.0690	
クラス	P-a-c-c	
期首現在発行済受益証券口数	167,774.2650	
発行受益証券口数	82,496.0490	
買戻受益証券口数	(47,495.3150)	
期末現在発行済受益証券口数	202,774.9990	
クラス	(英ポンド・ヘッジ) P-a-c-c	
期首現在発行済受益証券口数	0.0000	
発行受益証券口数	14,142.5180	
買戻受益証券口数	0.0000	
期末現在発行済受益証券口数	14,142.5180	

クラス	(日本円・ヘッジ) P - a c c
期首現在発行済受益証券口数	104,936.0000
発行受益証券口数	263,996.0530
買戻受益証券口数	(66,027.4550)
期末現在発行済受益証券口数	302,904.5980

クラス	P - d i s t
期首現在発行済受益証券口数	43,616.7640
発行受益証券口数	7,432.7470
買戻受益証券口数	(13,186.7620)
期末現在発行済受益証券口数	37,862.7490

クラス	Q - a c c
期首現在発行済受益証券口数	185,294.2090
発行受益証券口数	80,470.3060
買戻受益証券口数	(44,827.2650)
期末現在発行済受益証券口数	220,937.2500

クラス	Q - d i s t
期首現在発行済受益証券口数	55,139.3320
発行受益証券口数	30,926.0000
買戻受益証券口数	(15,033.8400)
期末現在発行済受益証券口数	71,031.4920

年間分配金

UBS (Lux)					
ストラテジー・ファンダー					
イールド (米ドル)	権利落ち日	支払日	通貨	1口当たり金額	円
クラス P - d i s t	2017年4月3日	2017年4月6日	米ドル	17.90	1,946
クラス Q - d i s t	2017年4月3日	2017年4月6日	米ドル	1.87	203

月間分配金

UBS (Lux)					
ストラテジー・ファンダー					
イールド (米ドル)	権利落ち日	支払日	通貨	1口当たり金額	円
クラス P - 4% - m d i s t	2017年2月10日	2017年2月15日	米ドル	3.38	367
クラス P - 4% - m d i s t	2017年3月10日	2017年3月15日	米ドル	3.42	372
クラス P - 4% - m d i s t	2017年4月10日	2017年4月13日	米ドル	3.42	372
クラス P - 4% - m d i s t	2017年5月11日	2017年5月16日	米ドル	3.44	374
クラス P - 4% - m d i s t	2017年6月13日	2017年6月16日	米ドル	3.48	378
クラス P - 4% - m d i s t	2017年7月10日	2017年7月13日	米ドル	3.45	375
クラス P - 4% - m d i s t	2017年8月10日	2017年8月16日	米ドル	3.49	379
クラス P - 4% - m d i s t	2017年9月11日	2017年9月14日	米ドル	3.49	379
クラス P - 4% - m d i s t	2017年10月10日	2017年10月13日	米ドル	3.50	380
クラス P - 4% - m d i s t	2017年11月10日	2017年11月15日	米ドル	3.51	382
クラス P - 4% - m d i s t	2017年12月11日	2017年12月14日	米ドル	3.50	380
クラス P - 4% - m d i s t	2018年1月10日	2018年1月16日	米ドル	3.51	382

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・ファンドーイールド (米ドル)

2018年1月31日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 割合 (%)
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
無記名株			
アルゼンチン			
USD MERCADOLIBRE INC COM STK USD0.001	100.00	38 710.00	0.00
アルゼンチン合計		38 710.00	0.00
オーストラリア			
AUD AGL ENERGY NPV	721.00	13 684.97	0.00
AUD AMCOR LIMITED NPV	1 519.00	17 908.95	0.00
AUD AMP LIMITED NPV (POST RECON)	1 914.00	8 136.77	0.00
AUD APA GROUP NPV	1 505.00	9 822.51	0.00
AUD ARISTOCRAT LEISURE NPV	422.00	8 166.98	0.00
AUD ASX LTD NPV	212.00	9 397.05	0.00
AUD AURIZON HOLDINGS NPV	3 049.00	11 554.58	0.00
AUD AUST & NZ BANK GRP NPV	3 266.00	75 583.91	0.01
AUD BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD NPV	893.00	8 467.58	0.00
AUD BHP BILLITON LTD NPV	3 710.00	90 726.01	0.01
AUD BK OF QUEENSLAND NPV	1 338.00	13 423.89	0.00
AUD BORAL LIMITED NPV	1 890.00	12 243.42	0.00
AUD BRAMBLES LTD NPV	1 783.00	14 293.46	0.00
AUD CHALLENGER LIMITED NPV	802.00	8 858.08	0.00
AUD CIMIC GROUP LTD NPV	131.00	5 000.48	0.00
AUD CMNWLTH BK OF AUST NPV	1 887.00	120 513.22	0.01
AUD COCA-COLA AMATIL NPV	651.00	4 417.49	0.00
AUD COMPUTERSHARE LTD NPV (POST REC)	571.00	7 721.53	0.00
AUD CROWN RESORTS LTD NPV	661.00	7 091.99	0.00
AUD CSL NPV	497.00	58 926.11	0.01
AUD DEXUS NPV (STAPLED)	2 945.00	22 726.32	0.00
AUD FORTESCUE METALS G NPV	1 274.00	5 116.84	0.00
AUD GOODMAN GROUP (STAPLED SECURITY)	3 390.00	22 207.47	0.00
AUD INCITEC PIVOT NPV	1 803.00	5 445.72	0.00
AUD INSURANCE AUST GRP NPV	2 733.00	16 022.46	0.00
AUD LEND LEASE GROUP NPV	845.00	10 838.34	0.00
AUD MACQUARIE GP LTD NPV	279.00	23 299.16	0.00
AUD NATL AUSTRALIA BK NPV	2 964.00	69 914.88	0.01
AUD NEWCREST MINING NPV	1 405.00	25 791.63	0.00
AUD ORICA LIMITED NPV	550.00	8 550.96	0.00
AUD ORIGIN ENERGY NPV	3 346.00	25 306.02	0.00
AUD QBE INS GROUP NPV	1 649.00	14 394.29	0.00
AUD RAMSAY HEALTH CARE NPV	25.00	1 383.66	0.00
AUD RIO TINTO LIMITED NPV	453.00	28 189.87	0.01
AUD SANTOS LIMITED NPV	3 195.00	13 194.47	0.00
AUD SCENTRE GROUP NPV STAPLED UNIT	8 430.00	28 328.70	0.01
AUD SEEK LIMITED NPV	752.00	11 904.62	0.00
AUD SONIC HEALTHCARE NPV	516.00	9 965.27	0.00
AUD SOUTH32 LTD NPV	4 869.00	15 061.01	0.00
GBP SOUTH32 LTD NPV	3 072.00	9 532.14	0.00
AUD STOCKLAND NPV (STAPLED)	5 144.00	17 577.79	0.00
AUD SUNCORP GROUP	1 507.00	16 669.21	0.00
AUD SYDNEY AIRPORT NPV (STAPLED SECURITY)	3 077.00	16 967.80	0.00
AUD TELSTRA CORP NPV	3 888.00	11 554.29	0.00
AUD TRANSURBAN GROUP STAPLED UNITS NPV	4 591.00	44 685.10	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 割合 (%)
AUD TREASURY WINE ESTA NPV	777.00	10 771.49	0.00
AUD VICINITY CENTRES NPV (STAPLED SECURITY)	7 298.00	15 896.70	0.00
AUD WESFARMERS LTD NPV	1 229.00	43 598.96	0.01
AUD WESTFIELD CORP NPV STAPLED UNITS	2 195.00	16 245.45	0.00
AUD WESTPAC BKG CORP NPV	3 732.00	93 560.72	0.01
AUD WOODSIDE PETROLEUM NPV	1 210.00	32 450.89	0.01
AUD WOOLWORTHS GRP LTD NPV	1 449.00	31 621.18	0.01
オーストラリア合計		1 224 712.39	0.12
オーストリア			
EUR ANDRITZ AG NPV (BR)	147.00	8 848.61	0.00
EUR ERSTE GROUP BK AG NPV	551.00	27 820.13	0.01
EUR OMV AG NPV (VAR)	186.00	12 016.45	0.00
EUR VOESTALPINE AG NPV	179.00	11 657.88	0.00
オーストリア合計		60 343.07	0.01
ベルギー			
EUR AGEAS NPV (POST SPLIT)	267.00	14 149.45	0.00
EUR ANHEUSER-BUSCH IN NPV	919.00	104 341.10	0.01
EUR COLRUYT SA NPV	109.00	6 052.02	0.00
EUR GPE BRUXELLES LAM NPV	87.00	10 283.12	0.00
EUR KBC GROUP NV NPV	208.00	20 055.58	0.01
EUR PROXIMUS SA NPV	196.00	6 631.58	0.00
EUR SOLVAY SA NPV	94.00	13 648.06	0.00
EUR UCB NPV	138.00	12 068.33	0.00
EUR UMICORE NPV	262.00	13 825.73	0.00
ベルギー合計		201 054.97	0.02
バミューダ			
USD ARCH CAPITAL GROUP COM USD0.01	147.00	13 368.18	0.00
USD AXIS CAPITAL HLDGS COM USD0.0125	200.00	10 106.00	0.00
USD EVEREST RE GROUP COM USD0.01	100.00	22 980.00	0.01
USD MARVELL TECH GROUP COM USD0.002	500.00	11 665.00	0.00
USD RENAISSANCE RE HLG COM USD1	100.00	12 714.00	0.00
USD XL GROUP LTD COM USD0.01	302.00	11 125.68	0.00
バミューダ合計		81 958.86	0.01
カナダ			
CAD AGNICO EAGLE MINES LTD COM	281.00	13 327.95	0.00
CAD ALIMENTATION COUCHE TARD INC SUB VTG SH	475.00	24 914.41	0.00
CAD ALTAGAS LTD COM NPV	325.00	7 303.46	0.00
CAD ARC RESOURCES COM NPV	800.00	8 822.59	0.00
CAD ATCO LTD CL 1 NON VTG	300.00	10 876.64	0.00
CAD BANK MONTREAL QUE COM	724.00	59 797.79	0.01
CAD BANK NOVA SCOTIA HALIFAX COM	1 376.00	91 654.82	0.01
CAD BARRICK GOLD CORP COM NPV	1 246.00	17 966.12	0.00
CAD BCE INC COM NEW	25.00	1 172.11	0.00
CAD BLACKBERRY LTD NPV	400.00	5 086.20	0.00
CAD BOMBARDIER INC CLASS' B' SUB-VTG NPV	1 500.00	4 254.80	0.00
CAD BROOKFIELD ASSET M LTD VTG SHS NPV CL' A'	1 028.00	43 136.03	0.01
CAD CAE INC COM	460.00	8 511.23	0.00
CAD CAMECO CORP COM	910.00	8 396.47	0.00
CAD CAN PACIFIC RYS COM NPV	200.00	37 125.97	0.01
CAD CANADIAN NAT RES LTD COM	1 215.00	41 584.42	0.01
CAD CANADIAN NATL RY CO COM	859.00	69 022.47	0.01
CAD CANADIAN TIRE LTD CL A	49.00	6 854.85	0.00
CAD CANADIAN UTILS LTD CL A	403.00	11 960.08	0.00
CAD CDN IMPERIAL BK OF COMMERCE COM	429.00	42 611.52	0.01
CAD CENOVUS ENERGY INC COM NPV	1 115.00	10 660.59	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
CAD CGI GROUP INC 'A' SUB-VTG NPV	232.00	13 312.79	0.00
CAD CI FINANCIAL CORP COM NPV	271.00	6 540.58	0.00
CAD CRESCENT POINT EN COM NPV	424.00	3 352.33	0.00
CAD DOLLARAMA INC COM NPV	200.00	27 416.55	0.00
CAD ELEMENT FLEET MGMT COM NPV	200.00	1 353.06	0.00
CAD EMPIRE LTD CL A	630.00	12 221.54	0.00
CAD ENBRIDGE INC COM NPV	1 031.00	37 841.57	0.01
USD ENBRIDGE INC COM NPV	781.00	28 608.03	0.01
CAD ENCANA CORP COM NPV	1 332.00	16 513.61	0.00
CAD FAIRFAX FINL HLDGS LTD SUB VTG	37.00	19 512.57	0.00
CAD FIRST QUANTUM MINERALS LTD COM	1 284.00	19 194.33	0.00
CAD FORTIS INC COM NPV	470.00	16 649.31	0.00
CAD FRANCO NEVADA CORP COM NPV	295.00	22 614.62	0.00
CAD GILDAN ACTIVEWEAR INC COM	400.00	13 638.18	0.00
CAD GOLDCORP INC COM NPV	816.00	11 712.73	0.00
CAD GREAT WEST LIFE CO INC COM	352.00	9 978.86	0.00
CAD HUSKY ENERGY INC COM	765.00	11 242.57	0.00
CAD IMPERIAL OIL LTD COM NEW	300.00	9 455.92	0.00
CAD INDUSTRIAL ALLNCE INS FIN SRVC COM	100.00	4 800.10	0.00
CAD INTACT FINL CORP COM NPV	177.00	14 878.76	0.00
CAD INTER PIPELINE LTD COM NPV	700.00	13 453.97	0.00
CAD KEYERA CORPORATION COM NPV	521.00	14 697.65	0.00
CAD KINROSS GOLD CORP COM NPV	900.00	3 917.35	0.00
CAD LOBLAW COS LTD COM	256.00	13 903.31	0.00
USD LULULEMON ATHLETIC COM STK USD0.01	116.00	9 072.36	0.00
CAD MAGNA INTL INC COM NPV	434.00	24 854.58	0.00
CAD MANULIFE FINL CORP COM	2 323.00	49 419.49	0.01
CAD METHANEX CORP COM	200.00	12 656.80	0.00
CAD METRO INC CL A SUB	300.00	10 064.80	0.00
CAD NATL BK OF CANADA COM NPV	350.00	18 212.50	0.00
CAD NUTRIEN LTD NPV	701.66	36 803.05	0.01
CAD ONEX CORP SUB VTG	262.00	19 672.69	0.00
CAD OPEN TEXT CO COM NPV	532.00	18 264.53	0.00
CAD PEMBINA PIPELINE C COM NPV	532.00	18 182.14	0.00
CAD POWER CORP CDA COM	438.00	11 206.60	0.00
CAD POWER FINANCIAL CORP COM	296.00	8 186.23	0.00
CAD RESTAURANT BRANDS COM NPV	100.00	6 056.16	0.00
USD RESTAURANT BRANDS COM NPV	160.00	9 662.40	0.00
CAD ROGERS COMMS INC CLASS' B' COM CAD1.62478	428.00	20 942.12	0.00
CAD ROYAL BK OF CANADA COM NPV	1 708.00	146 624.74	0.02
CAD SAPUTO INC COM	400.00	13 801.20	0.00
CAD SEVEN GENERATIONS COM NPV 'WI'	300.00	4 193.67	0.00
CAD SHAW COMMUNICATIONS INC CL B CONV	561.00	12 277.66	0.00
CAD SNC-LAVALIN GROUP INC COM	200.00	8 869.87	0.00
CAD SUN LIFE FINL INC COM	576.00	25 056.95	0.00
CAD SUNCOR ENERGY INC COM NPV 'NEW'	1 883.00	68 391.80	0.01
CAD TECK RESOURCES LTD CLASS' B' SUB-VTG COM NPV	423.00	12 315.74	0.00
CAD TORONTO-DOMINION COM NPV	2 104.00	128 313.39	0.01
CAD TOURMALINE OIL CP COM NPV	100.00	1 619.59	0.00
CAD TRANSCANADA CORP COM NPV	952.00	43 943.24	0.01
CAD VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL INC COM NPV	432.00	8 021.32	0.00
CAD VERMILION ENERGY I COM NPV	250.00	9 475.49	0.00
USD WASTE CONNECTIONS COM NPV (POST REV SPLT)	228.00	16 374.96	0.00
CAD WHEATON PRECIOUS M COM NPV	347.00	7 515.01	0.00
カナダ合計		1 651 901.89	0.16

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
デンマーク			
DKK A. P. MOELLER-MAERSK SER' B' DKK1000	8.00	14 328.28	0.00
DKK CARLSBERG SER' B' DKK20	228.00	29 378.73	0.01
DKK CHR. HANSEN HLDG DKK10	239.00	20 962.81	0.00
DKK DANSKE BANK A/S DKK10	928.00	37 823.98	0.01
DKK DSV DKK1	76.00	6 271.63	0.00
DKK GENMAB AS DKK1 (BEARER)	32.00	5 881.29	0.00
DKK ISS A/S DKK1	407.00	15 934.74	0.00
DKK NOVO-NORDISK AS DKK0.2 SER' B'	2 338.00	130 475.91	0.01
DKK NOVOZYMES A/S SER' B' DKK2 (POST CONS)	221.00	12 299.97	0.00
DKK ORSTED A/S DKK10	168.00	10 236.01	0.00
DKK PANDORA A/S DKK1	104.00	9 894.81	0.00
DKK TDC A/S DKK1	1 120.00	7 500.79	0.00
DKK VESTAS WIND SYSTEM DKK1	232.00	15 882.96	0.00
デンマーク合計		316 871.91	0.03
フィンランド			
EUR ELISA CORPORATION EURO.50	137.00	5 847.08	0.00
EUR FORTUM OYJ EUR3.40	147.00	3 198.29	0.00
EUR KONE CORPORATION NPV ORD 'B'	350.00	20 100.18	0.00
EUR METSO OYJ NPV	137.00	4 804.30	0.00
EUR NESTE OIL OYJ NPV	423.00	29 340.70	0.00
EUR NOKIA OYJ NPV	7 056.00	34 078.88	0.01
EUR NOKIAN RENKAAT OYJ NPV	153.00	7 753.60	0.00
EUR ORION CORP SER' B' NPV	122.00	4 909.00	0.00
EUR SAMPO OYJ SER' A' NPV	509.00	29 656.24	0.01
EUR STORA ENSO OYJ NPV SER' R'	673.00	11 586.55	0.00
EUR UPM-KYMMENE CORP NPV	613.00	20 725.32	0.00
EUR WARTSILA OYJ ABP SER' B' EUR3.50	182.00	12 483.56	0.00
フィンランド合計		184 483.70	0.02
フランス			
EUR ACCOR EUR3	173.00	9 881.35	0.00
EUR ADP EUR3	118.00	24 592.85	0.00
EUR AIR LIQUIDE(L') EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)	522.00	70 588.06	0.01
EUR AIRBUS GROUP NV EUR1	656.00	75 592.11	0.01
EUR ARKEMA EUR10	88.00	11 280.52	0.00
EUR ATOS SE EUR1	112.00	17 719.55	0.00
EUR AXA EUR2.29	2 270.00	74 923.95	0.01
EUR BNP PARIBAS EUR2	1 250.00	103 708.69	0.01
EUR BOUYGUES EUR1	240.00	13 385.33	0.00
EUR BUREAU VERITAS EURO.12	295.00	8 676.59	0.00
EUR CAPGEMINI EUR8	193.00	25 713.96	0.00
EUR CARREFOUR EUR2.50	432.00	10 373.11	0.00
EUR CASINO GUICH-PERR EUR1.53	77.00	4 517.00	0.00
EUR CIE DE ST-GOBAIN EUR4	527.00	30 734.53	0.00
EUR CREDIT AGRICOLE SA EUR3	956.00	18 072.47	0.00
EUR DANONE EURO.25	680.00	58 840.26	0.01
EUR DASSAULT SYSTEMES EURO.50	152.00	17 587.20	0.00
EUR EDENRED EUR2	404.00	13 090.39	0.00
EUR EDF EURO.5	251.00	3 462.97	0.00
EUR EIFFAGE EUR4	45.00	5 474.70	0.00
EUR ENGIE EUR1	1 822.00	31 731.20	0.00
EUR ESSILOR INTL EURO.18	306.00	43 609.22	0.00
EUR EUTELSAT COMMUNICA EUR1	156.00	3 443.65	0.00
EUR HERMES INTL NPV	35.00	19 411.28	0.00
EUR ICADE NPV	152.00	16 530.60	0.00
EUR ILIAD NPV	38.00	9 865.34	0.00
EUR KERING EUR4	91.00	46 229.53	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
EUR KLEPIERRE EUR1.40	325.00	14 895.12	0.00
EUR L' OREAL EURO.20	310.00	70 710.02	0.01
EUR LEGRAND SA EUR4	494.00	41 244.14	0.00
EUR LVMH MOET HENNESSY EUR0.30	337.00	106 045.96	0.01
EUR NATIXIS EUR1.6	1 625.00	14 846.54	0.00
EUR ORANGE EUR4	2 452.00	44 428.85	0.00
EUR PERNOD RICARD EUR1.55	334.00	53 383.13	0.02
EUR PEUGEOT SA EUR1	638.00	14 377.72	0.00
EUR PUBLICIS GROUPE SA EUR0.40	221.00	15 329.30	0.00
EUR RENAULT SA EUR3.81	192.00	21 184.53	0.00
EUR REXEL EUR5	615.00	11 124.30	0.00
EUR SAFRAN EUR0.20	441.00	49 960.23	0.01
EUR SANOFI EUR2	1 338.00	118 543.78	0.01
EUR SCHNEIDER ELECTRIC EUR8	625.00	58 768.26	0.01
EUR SCOR SE EUR7.876972 (POST CONS)	171.00	7 679.49	0.00
EUR SOC GENERALE EUR1.25	906.00	52 882.87	0.01
EUR SODEXO EUR4	91.00	11 716.09	0.00
EUR SUEZ EUR4	336.00	5 027.05	0.00
EUR THALES EUR3	147.00	16 547.20	0.00
EUR TOTAL EUR2.5	2 658.00	154 417.98	0.02
EUR UNIBAIL-RODAMCO EUR5	98.00	25 222.45	0.00
EUR VALEO EUR1 (POST SUBD)	360.00	28 477.85	0.00
EUR VEOLIA ENVIRONNEME EUR5	370.00	9 352.22	0.00
EUR VINCI EUR2.50	551.00	59 717.52	0.01
EUR VIVENDI SA EUR5.50	1 793.00	52 780.67	0.00
EUR WENDEL EUR4	64.00	11 967.17	0.00
EUR ZODIAC AEROSPACE	383.00	11 942.37	0.00
フランス合計		1 851 609.22	0.17
ドイツ			
EUR BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG EUR1	349.00	39 985.50	0.01
EUR BEIERSDORF AG NPV	117.00	13 919.39	0.00
EUR COMMERZBANK AG NPV	1 256.00	20 744.29	0.00
EUR CONTINENTAL AG ORD NPV	104.00	31 314.17	0.01
EUR COVESTRO AG NPV	241.00	27 794.90	0.00
EUR DEUTSCHE WOHNEN AG NPV (BR)	261.00	11 835.12	0.00
EUR FRESENIUS MED CARE NPV	240.00	27 805.14	0.00
EUR FRESENIUS SE & CO. KGAA NPV	440.00	38 632.20	0.01
EUR GEA GROUP AG NPV	208.00	10 372.41	0.00
EUR HEIDELBERGCEMENT NPV	157.00	17 070.46	0.00
EUR HENKEL AG & CO KGAA	241.00	30 262.76	0.00
EUR HUGO BOSS AG NPV (REGD)	66.00	6 082.60	0.00
EUR INNOGY SE NPV	175.00	6 692.79	0.00
EUR KION GROUP AG NPV	59.00	5 433.06	0.00
EUR LINDE AG NPV (ASD 24/10/2017)	224.00	54 860.84	0.01
EUR MAN SE ORD NPV	122.00	14 559.83	0.00
EUR MERCK KGAA NPV	194.00	21 272.28	0.00
EUR METRO WHOLESALE & NPV	125.00	2 725.08	0.00
EUR SAP AG ORD NPV	1 117.00	126 390.19	0.01
EUR SYMRISE AG NPV (BR)	111.00	9 314.42	0.00
EUR THYSSENKRUPP AG NPV	354.00	11 174.83	0.00
EUR VOLKSWAGEN AG ORD NPV	62.00	13 786.72	0.00
ドイツ合計		542 028.98	0.05

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
香港			
HKD AIA GROUP LTD NPV	14 800.00	126 779.56	0.01
HKD BOC HONG KONG HLDG HKD5	3 000.00	15 323.25	0.00
HKD CK ASSET HOLDINGS HKD1	2 736.00	26 113.11	0.00
HKD CK HUTCHISON HLDGS HKD1.0	3 236.00	43 690.31	0.01
HKD CLP HOLDINGS HKD5	3 500.00	35 731.87	0.00
HKD GALAXY ENTERTAINME HKD0.10	4 000.00	35 441.00	0.00
HKD HANG LUNG PROP HKD1	7 000.00	18 525.98	0.00
HKD HANG SENG BANK HKD5	1 700.00	40 470.76	0.01
HKD HENDERSON LAND DEV HKD2	1 474.00	10 308.55	0.00
HKD HONG KONG EXCHANGE HKD1	1 518.00	57 525.80	0.01
USD HONGKONG LAND HLD ORD USD0.10(SINGAPORE REG)	200.00	1 440.00	0.00
HKD HONGKONG&CHINA GAS HKD0.25	10 862.00	21 469.99	0.00
USD JARDINE MATHESON COM USD0.25(BERMUDA REG)	100.00	6 348.00	0.00
HKD LI & FUNG HKD0.0125	6 000.00	3 060.82	0.00
HKD MTR CORP HKD1	3 500.00	20 047.43	0.00
HKD NEW WORLD DEVEL CO HKD1	8 078.00	13 075.26	0.00
HKD POWER ASSETS HOLDINGS LTD HKD1	1 500.00	13 338.32	0.00
HKD SINO LAND CO HKD1	4 961.00	9 146.34	0.00
HKD SUN HUNG KAI PROP NPV	3 054.00	53 064.15	0.01
HKD SWIRE PACIFIC 'A' HKD0.60	2 000.00	20 009.08	0.00
HKD THE LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4 500.00	39 813.59	0.01
HKD WHARF REAL ESTATE HKD0.1	2 000.00	13 820.97	0.00
HKD WHARF(HLDGS) HKD1	2 000.00	8 195.41	0.00
HKD WHEELLOCK & COMPANY HKD0.50	2 000.00	15 662.06	0.00
香港合計		648 401.61	0.06
アイルランド			
USD ACCENTURE PLC SHS CL A 'NEW'	707.00	113 614.90	0.01
USD ALKERMES PLC COM USD0.01	73.00	4 173.41	0.00
EUR CRH ORD EURO.32	1 181.00	44 019.22	0.00
GBP DCC ORD EURO.25	69.00	7 265.89	0.00
USD EATON CORP PLC COM USD0.01	677.00	56 847.69	0.01
GBP EXPERIAN ORD USD0.10	900.00	20 771.88	0.00
EUR PADDY POWER BETFAI ORD EURO.09	43.00	5 003.18	0.00
USD PENTAIR PLC COM USD0.01	143.00	10 224.50	0.00
USD SEAGATE TECH PLC COM USD0.00001	400.00	22 080.00	0.00
GBP SHIRE ORD GBP0.05	1 029.00	48 690.96	0.01
USD WEATHERFORD INTL.COM USD0.001	249.00	981.06	0.00
アイルランド合計		333 672.69	0.03
イスラエル			
ILS BANK HAPOALIM B.M. ILS1	47.00	352.83	0.00
ILS BEZEQ ISRAEL TELCM ILS1	7 392.00	12 236.54	0.00
ILS BK LEUMI LE ISRAEL ILS1	2 295.00	14 153.21	0.00
USD CHECK POINT SFTWRE ORD ILS0.01	112.00	11 581.92	0.00
ILS ICL-ISRAEL CHEM ILS1	1 534.00	6 482.20	0.00
ILS NICE SYSTEMS ILS1	54.00	4 943.78	0.00
イスラエル合計		49 750.48	0.00
イタリア			
EUR ASSIC GENERALI SPA EUR1	1 397.00	27 792.79	0.00
EUR ATLANTIA SPA EUR1	379.00	12 596.68	0.00
EUR ENEL EUR1	8 922.00	56 795.51	0.01
EUR ENI SPA EUR1	3 513.00	63 395.37	0.01
EUR FERRARI NV EURO.01(NEW)	49.00	5 862.45	0.00
EUR INTESA SANPAOLO	17 722.00	69 774.93	0.01
EUR LEONARDO SPA EUR4.40	817.00	9 892.80	0.00
EUR LUXOTTICA GROUP EURO.06	178.00	11 486.31	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 割合 （%）
EUR MEDIOBANCA SPA EURO.5	646.00	7 880.15	0.00
EUR PRYSMIAN SPA EURO.10	349.00	12 321.29	0.00
EUR SAIPEM NPV(POST CONS)	365.00	1 714.68	0.00
EUR SNAM EUR1	4 095.00	19 992.18	0.00
EUR TELECOM ITALIA SPA EURO.55	12 483.00	11 277.36	0.00
EUR TERNA SPA ORD EURO.22	1 570.00	9 481.85	0.00
EUR UNICREDIT SPA NPV (POST REV SPLIT)	2 306.00	50 978.93	0.00
イタリア合計		371 243.28	0.03
日本			
JPY イオン	800.00	13 613.67	0.00
JPY イオンフィナンシャルサービス	300.00	7 478.36	0.00
JPY イオンモール	220.00	4 839.17	0.00
JPY アイシン精機	300.00	17 507.21	0.00
JPY 味の素	400.00	7 585.54	0.00
JPY アマダ	400.00	5 921.85	0.00
JPY 旭硝子	200.00	8 776.51	0.00
JPY アサヒグループホールディングス	500.00	25 152.31	0.00
JPY 旭化成	2 000.00	26 100.50	0.00
JPY アステラス製薬	2 500.00	32 980.62	0.01
JPY パンダイナムコホールディングス	400.00	13 045.67	0.00
JPY ベネッセホールディングス	100.00	3 756.13	0.00
JPY ブリヂストン	800.00	38 887.82	0.01
JPY ブラザー工業	400.00	10 227.66	0.00
JPY キヤノン	1 200.00	47 810.91	0.01
JPY カシオ計算機	500.00	7 580.96	0.00
JPY 東海旅客鉄道	200.00	37 836.10	0.01
JPY 千葉銀行	2 000.00	17 296.50	0.00
JPY 中部電力	1 500.00	18 819.57	0.00
JPY 中外製薬	400.00	21 144.24	0.00
JPY 中国電力	600.00	6 634.60	0.00
JPY コンコルディア・フィナンシャルグループ	1 000.00	6 055.61	0.00
JPY クレディセゾン	200.00	3 633.37	0.00
JPY 大日本印刷	500.00	11 130.96	0.00
JPY 第一生命ホールディングス	1 200.00	25 125.74	0.00
JPY 第一三共	700.00	23 535.34	0.00
JPY ダイキン工業	300.00	35 990.11	0.01
JPY 大和ハウス工業	1 000.00	39 439.33	0.01
JPY 大和証券グループ本社	2 000.00	14 331.91	0.00
JPY デンソー	500.00	31 253.72	0.01
JPY 電通	200.00	8 950.58	0.00
JPY 東日本旅客鉄道	400.00	39 741.65	0.01
JPY エーザイ	300.00	17 125.19	0.00
JPY 電源開発	100.00	2 835.42	0.00
JPY ファナック	200.00	54 005.77	0.01
JPY ファーストリテイリング	100.00	44 606.29	0.01
JPY 富士フイルムホールディングス	700.00	26 870.05	0.00
JPY 富士通	2 000.00	14 729.51	0.00
JPY 阪急阪神ホールディングス	600.00	24 158.31	0.00
JPY ヒロセ電機	105.00	15 727.63	0.00
JPY 久光製薬	100.00	6 870.96	0.00
JPY 日立化成	300.00	7 648.76	0.00
JPY 日立建機	200.00	8 950.57	0.00
JPY 日立製作所	7 000.00	55 561.36	0.01
JPY 本田技研工業	1 900.00	66 597.04	0.01
JPY HOYA	500.00	25 509.60	0.00
JPY ヒューリック	600.00	7 596.54	0.00
JPY IHI	300.00	10 031.61	0.00
JPY 国際石油開発帝石	1 100.00	14 299.85	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
JPY 三越伊勢丹ホールディングス	800.00	9 564.38	0.00
JPY いすゞ自動車	700.00	11 793.32	0.00
JPY 伊藤忠商事	1 600.00	31 353.58	0.01
JPY J. フロント リテイリング	200.00	3 657.18	0.00
JPY 日本取引所グループ	800.00	14 372.22	0.00
JPY ゆうちょ銀行	1 300.00	17 542.94	0.00
JPY 日本郵政	300.00	3 578.40	0.00
JPY ジャパンリアルエステイト投資法人	2.00	10 278.96	0.00
JPY 日本リートファンド投資法人	4.00	7 970.32	0.00
JPY 日本たばこ産業	1 300.00	43 017.73	0.01
JPY JFEホールディングス	1 000.00	23 713.98	0.00
JPY JSR	300.00	7 101.83	0.00
JPY ジェイテクト	500.00	8 904.77	0.00
JPY J X T Gホールディングス	900.00	5 967.84	0.00
JPY 鹿島建設	3 000.00	29 655.08	0.00
JPY 関西電力	700.00	8 679.86	0.00
JPY 関西ペイント	300.00	7 406.90	0.00
JPY 花王	600.00	41 572.08	0.01
JPY KDDI	2 200.00	55 486.24	0.01
JPY 京浜急行電鉄	500.00	9 848.38	0.00
JPY 京王電鉄	200.00	9 491.09	0.00
JPY キーエンス	100.00	60 858.41	0.01
JPY キリンホールディングス	1 000.00	24 927.85	0.00
JPY 小松製作所	1 000.00	38 798.04	0.01
JPY コナミホールディングス	200.00	11 433.28	0.00
JPY コニカミノルタ	500.00	4 974.58	0.00
JPY クボタ	1 200.00	24 372.68	0.00
JPY クラレ	800.00	14 951.22	0.00
JPY 京セラ	400.00	26 571.39	0.00
JPY 協和発酵キリン	800.00	15 647.47	0.00
JPY 九州電力	600.00	6 563.14	0.00
JPY LIXILグループ	300.00	8 423.80	0.00
JPY エムスリー	400.00	14 621.41	0.00
JPY マキタ	200.00	9 417.80	0.00
JPY 丸紅	2 000.00	14 991.53	0.00
JPY マツダ	1 000.00	14 012.18	0.00
JPY メディパルホールディングス	400.00	7 827.40	0.00
JPY 明治ホールディングス	200.00	16 728.51	0.00
JPY ミスミグループ本社	300.00	9 028.45	0.00
JPY 三菱ケミカルホールディングス	2 000.00	21 703.08	0.00
JPY 三菱商事	1 700.00	47 501.26	0.01
JPY 三菱電機	2 200.00	40 158.49	0.01
JPY 三菱地所	1 000.00	19 133.34	0.00
JPY 三菱ガス化学	300.00	8 465.03	0.00
JPY 三菱重工業	500.00	18 789.79	0.00
JPY 三菱自動車工業	800.00	5 929.18	0.00
JPY 田辺三菱製薬	600.00	12 263.30	0.00
JPY 三菱UFJフィナンシャル・グループ	14 800.00	111 289.82	0.01
JPY 三菱UFJリース	2 400.00	15 478.91	0.00
JPY 三井物産	2 000.00	35 069.40	0.01
JPY 三井不動産	1 000.00	26 178.37	0.00
JPY 商船三井	100.00	3 582.06	0.00
JPY みずほフィナンシャルグループ	28 900.00	54 355.46	0.01
JPY MS&ADインシュアランス グループ ホールディングス	600.00	20 398.52	0.00
JPY 村田製作所	200.00	29 517.66	0.00
JPY 日本碍子	300.00	6 106.91	0.00
JPY 日本特殊陶業	200.00	5 260.41	0.00
JPY 日本電産	300.00	47 959.32	0.01
JPY ニコン	500.00	9 697.22	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
JPY 任天堂	100.00	43 946.68	0.01
JPY 日本ビルファンド投資法人	2.00	10 718.70	0.00
JPY 日本通運	300.00	21 547.34	0.00
JPY 日本ペイントホールディングス	200.00	7 154.96	0.00
JPY 新日鐵住金	1 420.00	36 145.57	0.01
JPY 日本電信電話	800.00	38 044.98	0.01
JPY 日産自動車	2 900.00	30 911.55	0.00
JPY 日清製粉グループ本社	603.00	12 081.54	0.00
JPY ニトリホールディングス	100.00	15 926.89	0.00
JPY 日東電工	200.00	18 274.93	0.00
JPY NOK	200.00	4 652.10	0.00
JPY 野村ホールディングス	4 000.00	25 926.43	0.00
JPY 野村不動産マスターファンド投資法人	4.00	5 570.06	0.00
JPY 野村不動産ホールディングス	200.00	4 785.85	0.00
JPY 野村総合研究所	100.00	4 598.96	0.00
JPY 日本精工	1 000.00	16 453.67	0.00
JPY エヌ・ティ・ティ・データ	2 000.00	23 507.86	0.00
JPY NTTドコモ	1 700.00	42 120.38	0.01
JPY 大林組	700.00	8 413.72	0.00
JPY 小田急電鉄	500.00	10 993.54	0.00
JPY オリンパス	300.00	11 529.48	0.00
JPY オムロン	200.00	12 477.67	0.00
JPY 小野薬品工業	500.00	12 342.54	0.00
JPY オリエンタルランド	200.00	19 531.86	0.00
JPY オリックス	1 500.00	27 964.82	0.00
JPY 大阪ガス	800.00	15 852.69	0.00
JPY 大塚ホールディングス	300.00	13 318.68	0.00
JPY パナソニック	2 200.00	32 630.66	0.01
JPY 楽天	2 200.00	19 868.63	0.00
JPY リクルートホールディングス	1 500.00	36 539.78	0.01
JPY ルネサスエレクトロニクス	500.00	5 876.96	0.00
JPY りそなホールディングス	3 100.00	18 667.31	0.00
JPY リコー	1 000.00	9 820.90	0.00
JPY ローム	200.00	21 932.11	0.00
JPY SANKYO	100.00	3 243.09	0.00
JPY 参天製薬	1 000.00	16 316.25	0.00
JPY SBIホールディングス	170.00	4 110.03	0.00
JPY セコム	300.00	22 927.03	0.00
JPY セガサミーホールディングス	200.00	2 790.53	0.00
JPY セイコーエプソン	300.00	7 274.98	0.00
JPY 積水化学工業	300.00	5 716.64	0.00
JPY 積水ハウス	200.00	3 660.85	0.00
JPY セブン&アイ・ホールディングス	900.00	36 987.77	0.01
JPY 島津製作所	300.00	7 560.81	0.00
JPY シマノ	100.00	14 291.60	0.00
JPY 清水建設	1 000.00	10 233.15	0.00
JPY 信越化学工業	400.00	45 476.62	0.01
JPY 塩野義製薬	400.00	22 122.67	0.00
JPY 資生堂	500.00	25 656.18	0.00
JPY 静岡銀行	1 000.00	10 636.25	0.00
JPY 昭和シェル石油	500.00	7 086.25	0.00
JPY SMC	100.00	49 031.19	0.01
JPY ソフトバンクグループ	1 100.00	90 495.17	0.01
JPY SOMP Oホールディングス	450.00	17 999.17	0.00
JPY ソニー	1 500.00	71 581.70	0.01
JPY ソニーフィナンシャルホールディングス	200.00	3 653.52	0.00
JPY スタンレー電気	400.00	16 215.47	0.00
JPY SUBARU	700.00	23 201.87	0.00
JPY 住友化学	3 000.00	21 987.08	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
JPY 住友商事	1 400.00	24 099.67	0.00
JPY 住友電気工業	900.00	15 340.11	0.00
JPY 三井住友フィナンシャルグループ	1 600.00	71 501.99	0.01
JPY 三井住友トラスト・ホールディングス	400.00	16 589.25	0.00
JPY 住友ゴム工業	300.00	5 818.33	0.00
JPY サントリー食品インターナショナル	300.00	14 319.09	0.00
JPY スルガ銀行	200.00	4 034.63	0.00
JPY スズキ	400.00	22 822.59	0.00
JPY シスメックス	200.00	15 684.12	0.00
JPY T&Dホールディングス	700.00	12 460.26	0.00
JPY 大成建設	400.00	20 338.05	0.00
JPY 武田薬品工業	800.00	47 015.71	0.01
JPY TDK	200.00	18 414.18	0.00
JPY 帝人	200.00	4 417.57	0.00
JPY テルモ	400.00	19 568.50	0.00
JPY THK	300.00	12 422.70	0.00
JPY 東武鉄道	600.00	20 145.66	0.00
JPY 東宝	300.00	10 141.54	0.00
JPY 東北電力	400.00	5 155.97	0.00
JPY 東京海上ホールディングス	800.00	37 671.20	0.01
JPY 東京電力	800.00	3 239.43	0.00
JPY 東京エレクトロン	200.00	37 487.98	0.01
JPY 東京ガス	600.00	14 253.13	0.00
JPY 東京建物	500.00	8 020.70	0.00
JPY 東京急行電鉄	500.00	8 355.09	0.00
JPY 東急不動産ホールディングス	900.00	7 090.83	0.00
JPY 凸版印刷	1 000.00	9 390.32	0.00
JPY 東レ	2 000.00	19 879.99	0.00
JPY 東芝	8 000.00	22 793.28	0.00
JPY TOTO	200.00	11 414.96	0.00
JPY 東洋製罐グループホールディングス	300.00	4 837.16	0.00
JPY 豊田自動織機	200.00	12 990.70	0.00
JPY トヨタ自動車	3 130.00	214 487.65	0.02
JPY 豊田通商	500.00	20 200.63	0.00
JPY トレンドマイクロ	100.00	5 386.84	0.00
JPY ユニ・チャーム	600.00	16 023.09	0.00
JPY ユナイテッド・アーバン投資法人	6.00	9 481.93	0.00
JPY ユー・エス・エス	500.00	11 130.96	0.00
JPY 西日本旅客鉄道	100.00	7 490.27	0.00
JPY ヤフー	1 700.00	8 176.45	0.00
JPY ヤクルト本社	200.00	16 710.18	0.00
JPY ヤマダ電機	1 000.00	5 927.35	0.00
JPY ヤマハ	300.00	12 353.99	0.00
JPY ヤマハ発動機	400.00	13 265.54	0.00
JPY ヤマトホールディングス	500.00	12 880.77	0.00
JPY 安川電機	300.00	15 445.93	0.00
JPY 横河電機	500.00	10 608.77	0.00
日本合計		4 356 923.14	0.41
ジャージー島			
GBP FERGUSON PLC ORD GBP0.108030303	368.00	28 447.37	0.00
GBP GLENCORE XSTRATA ORD USD0.01	14 392.00	82 621.82	0.01
GBP RANDGOLD RESOURCES ORD USD0.05	123.00	12 394.27	0.00
ジャージー島合計		123 463.46	0.01
ルクセンブルグ			
EUR ARCELORMITTAL NPV (POST STOCK SPLIT)	679.00	24 720.39	0.00
EUR EUROFINS SCIENTIFI EURO.10	13.00	8 502.24	0.00
ルクセンブルグ合計		33 222.63	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
マカオ			
HKD SANDS CHINA LTD USD0.01 REG' S'	4 400.00	26 215.09	0.00
HKD WYNN MACAU LTD HKD0.10	2 000.00	7 057.51	0.00
マカオ合計		33 272.60	0.00
オランダ			
EUR AEGON NV EURO.12	1 827.00	12 536.13	0.00
USD AERCAP HOLDINGS NV	100.00	5 410.00	0.00
EUR AKZO NOBEL NV EUR2	206.00	19 354.62	0.00
EUR ALTICE NV EURO.01 (COMMON SHARES A)	416.00	4 485.82	0.00
EUR ASML HOLDING NV EURO.09	449.00	91 284.57	0.01
EUR CNH INDUSTRIAL NV COM EURO.01	755.00	11 206.56	0.00
EUR EXOR NV EURO.01	152.00	11 781.61	0.00
EUR FIAT CHRYSLER AUTO EURO.01	1 105.00	26 790.49	0.00
EUR HEINEKEN HOLDING EUR1.6	136.00	14 485.58	0.00
EUR HEINEKEN NV EUR1.60	236.00	26 624.37	0.00
EUR ING GROEP N.V. EURO.01	4 560.00	89 924.21	0.01
EUR KON KPN NV EURO.24	5 572.00	19 574.52	0.00
EUR KONINKLIJKE AHOLD EURO.01	1 575.00	35 258.15	0.01
EUR KONINKLIJKE BOSKAL EURO.01	213.00	8 528.18	0.00
EUR KONINKLIJKE DSM NV EUR1.5	175.00	18 142.48	0.00
EUR KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20	1 040.00	42 572.76	0.00
EUR NN GROUP N.V. EURO.12	608.00	28 781.81	0.01
USD NXP SEMICONDUCTORS EURO.20	337.00	40 547.84	0.01
EUR QIAGEN NV EURO.01	544.00	18 256.91	0.00
EUR RELX NV EURO.07	1 536.00	34 279.85	0.01
GBP ROYAL DUTCH SHELL 'B' SHS EURO.07 (UK LIST)	4 425.00	157 062.58	0.01
GBP ROYAL DUTCH SHELL PLC 'A' SHS EURO.07	5 513.00	193 054.14	0.02
USD SENSATA TECHNOLOGI COM EURO.01	200.00	11 250.00	0.00
EUR STMICROELECTRONICS EUR1.04	608.00	14 565.11	0.00
EUR VOPAK(KON) EURO.50	79.00	3 581.29	0.00
EUR WOLTERS KLUWER EURO.12	326.00	17 312.66	0.00
オランダ合計		956 652.24	0.09
ニュージーランド			
NZD AUCLAND INTL NPV	467.00	2 313.97	0.00
NZD FLETCHER BUILDING NPV	2 373.00	13 716.37	0.00
NZD SPARK NEW ZEALAND NPV	3 098.00	8 231.26	0.00
ニュージーランド合計		24 261.60	0.00
ノルウェー			
NOK DNB ASA NOK10	1 321.00	26 914.58	0.00
NOK MARINE HARVEST ASA NOK7.50	890.00	15 472.36	0.00
NOK NORSK HYDRO ASA NOK3.6666	2 055.00	15 045.14	0.00
NOK ORKLA ASA NOK1.25	873.00	9 123.15	0.00
NOK STATOIL ASA NOK2.50	1 009.00	23 659.84	0.00
NOK TELENOR ASA ORD NOK6	1 304.00	30 662.17	0.01
ノルウェー合計		120 877.24	0.01
パプアニューギニア			
AUD OIL SEARCH LTD PGK0.10	2 833.00	17 365.74	0.00
パプアニューギニア合計		17 365.74	0.00
ポルトガル			
EUR GALP ENERGIA EUR1-B	467.00	8 941.73	0.00
EUR JERONIMO MARTINS EUR5	438.00	9 360.43	0.00
ポルトガル合計		18 302.16	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
シンガポール			
USD BROADCOM LIMITED COM NPV	460.00	114 093.80	0.01
SGD CAPITALAND SGD1	6 000.00	17 598.53	0.00
SGD CITY DEVELOPMENTS SGD0.50	1 000.00	10 128.32	0.00
SGD DBS GROUP HLDGS SGD1	2 362.00	47 629.70	0.01
USD FLEX LTD COM USD0.01	900.00	16 209.00	0.00
SGD KEPPEL CORP NPV	3 100.00	20 529.33	0.00
SGD OVERSEA-CHINESE BK NPV	5 853.00	57 805.75	0.01
SGD SEMBCORP INDUSTRIE SGD0.25 (POST REORG)	2 000.00	5 194.01	0.00
SGD SINGAPORE AIRLINES NPV	1 000.00	8 638.86	0.00
SGD SINGAPORE EXCHANGE SGD0.01	1 000.00	6 263.37	0.00
SGD SINGAPORE PRESS HD SGD0.20	3 000.00	6 049.50	0.00
SGD SINGAPORE TELECOMM NPV (POST RE-ORG)	11 000.00	29 743.35	0.00
SGD UTD O/S BANK SGD1	1 501.00	31 448.54	0.00
シンガポール合計		371 332.06	0.03
南アフリカ			
GBP MEDICLINIC INTERNA ORD GBP0.10	574.00	4 874.69	0.00
GBP MONDI ORD EURO.20	312.00	8 327.87	0.00
南アフリカ合計		13 202.56	0.00
スペイン			
EUR ABERTIS INFRAESTR EUR3 SERIE A	622.00	15 125.20	0.00
EUR ACS ACTIVIDADES CO EURO.5	203.00	8 158.14	0.00
EUR AENA SME S.A. EUR10	136.00	29 725.09	0.00
EUR AMADEUS IT GROUP EURO.01	477.00	37 127.04	0.00
EUR BANKIA S.A. EUR1 (POST CONS)	1 448.00	7 359.69	0.00
EUR BCO DE SABADELL EURO.125	2 875.00	6 855.05	0.00
EUR CAIXABANK SA EUR1	4 173.00	22 597.94	0.00
EUR ENAGAS SA EUR1.50	275.00	7 519.66	0.00
EUR ENDESA SA EUR1.2	404.00	9 109.42	0.00
EUR FERROVIAL SA EURO.2	791.00	18 205.05	0.00
EUR GAS NATURAL SDG EUR1	408.00	9 456.29	0.00
EUR GRIFOLS SA EURO.25 (CLASS A) POST SUBD	434.00	14 008.38	0.00
EUR IBERDROLA SA EURO.75 (POST SUBDIVISION)	5 841.00	47 718.80	0.01
EUR INDITEX EURO.03 (POST SUBD)	1 351.00	48 588.45	0.01
EUR INTL CONS AIRLINE ORD EURO.50	1 543.00	14 070.45	0.00
EUR RED ELECTRICA CORP EURO.5	544.00	11 568.13	0.00
EUR REPSOL SA EUR1	940.00	17 746.58	0.00
EUR TELEFONICA SA EUR1	5 170.00	53 153.67	0.02
スペイン合計		378 093.03	0.04
スウェーデン			
SEK ALFA LAVAL AB NPV	373.00	9 815.91	0.00
SEK ASSA ABLOY SER' B' NPV (POST SPLIT)	1 177.00	26 148.90	0.00
SEK ATLAS COPCO AB SER' A' NPV (POST SPLIT)	1 159.00	54 522.95	0.01
SEK ATLAS COPCO AB SER' B' NPV (POST SPLIT)	419.00	17 539.91	0.00
USD AUTOLIV INC COM	157.00	23 896.97	0.00
SEK BOLIDEN AB NPV (POST SPLIT)	215.00	7 823.16	0.00
SEK ELECTROLUX AB SER' B' NPV (POST SPLIT)	335.00	11 865.43	0.00
SEK ERICSSON SER' B' NPV	2 657.00	17 116.84	0.00
SEK ESSITY AB SER' B' NPV	604.00	18 148.07	0.00
SEK GETINGE AB SER' B' NPV	312.00	4 286.05	0.00
SEK HENNES & MAURITZ SER' B' NPV	1 152.00	20 436.65	0.00
SEK HEXAGON AB SER' B' NPV	306.00	18 283.25	0.00
SEK INVESTOR AB SER' B' NPV	374.00	18 336.93	0.00
SEK KINNEVIK INV AB SER' B' NPV (POST SPLIT)	240.00	8 781.72	0.00
SEK NORDEA BANK AB ORD NPV (SEK QUOTE)	4 186.00	51 823.37	0.01
SEK SANDVIK AB NPV (POST SPLIT)	865.00	17 086.35	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
SEK SECURITAS SER' B' NPV	454.00	8 430.31	0.00
SEK SKAND ENSKILDA BKN SER' A' NPV	2 279.00	28 881.74	0.01
SEK SKANSKA AB SER' B' NPV	454.00	9 256.87	0.00
SEK SKF AB SER' B' NPV	827.00	20 505.22	0.00
SEK SVENSKA HANDELSBKN SER' A' NPV (P/S)	2 288.00	33 397.31	0.01
SEK SWEDBANK AB SER' A' NPV	996.00	25 538.79	0.00
SEK SWEDISH MATCH NPV	250.00	10 159.78	0.00
SEK TELE2 AB SHS	390.00	4 893.81	0.00
SEK TELIASONERA AB NPV	2 482.00	12 497.69	0.00
SEK VOLVO AB SER' B' NPV (POST SPLIT)	2 176.00	44 561.67	0.01
スウェーデン合計		524 035.65	0.05
スイス			
CHF PARGESA HLDGS SA CHF20(BR) (POST SUBD)	54.00	4 931.80	0.00
CHF SIKA AG CHF0.60 (BR)	3.00	26 027.32	0.00
CHF SWATCH GROUP CHF2.25(BR)	34.00	15 599.18	0.00
CHF SWISS RE AG CHF0.10	365.00	36 044.54	0.01
CHF VIFOR PHARMA AG CHF0.01	110.00	16 211.27	0.00
スイス合計		98 814.11	0.01
イギリス			
GBP 3I GROUP ORD GBP0.738636	1 212.00	16 052.91	0.00
GBP ADMIRAL GROUP ORD GBP0.001	258.00	6 780.11	0.00
GBP ANGLO AMERICAN USD0.54945	1 954.00	47 476.62	0.01
GBP ANTOFAGASTA ORD GBP0.05	1 002.00	13 265.76	0.00
USD AON PLC COM USD0.01 CL A	303.00	43 077.51	0.01
USD APTIV PLC COM USD0.01	297.00	28 179.36	0.00
GBP ASHTEAD GROUP ORD GBP0.10	498.00	14 907.21	0.00
GBP ASSOC BRIT FOODS ORD GBP0.0568	413.00	16 051.09	0.00
GBP ASTRAZENCA ORD USD0.25	1 434.00	99 646.47	0.01
GBP AUTO TRADER GROUP ORD GBP0.01	1 003.00	5 136.16	0.00
GBP AVIVA ORD GBP0.25	5 643.00	41 182.40	0.01
GBP BAE SYSTEMS ORD GBP0.025	3 021.00	25 518.32	0.00
GBP BARCLAYS ORD GBP0.25	19 507.00	55 463.22	0.01
GBP BARRATT DEVEL ORD GBP0.10	997.00	8 296.87	0.00
GBP BHP BILLITON PLC USD0.50	2 364.00	52 577.40	0.01
GBP BP ORD USD0.25	21 541.00	153 498.85	0.02
GBP BRIT AMER TOBACCO ORD GBP0.25	2 124.00	145 554.72	0.02
GBP BRITISH LAND CO PLC REIT	1 342.00	12 759.50	0.00
GBP BT GROUP ORD GBP0.05	9 679.00	35 160.20	0.01
GBP BUNZL ORD GBP0.32142857	491.00	14 383.47	0.00
GBP BURBERRY GROUP ORD GBP0.0005	406.00	9 116.39	0.00
GBP CAPITA PLC ORD GBP0.02066666	672.00	1 744.00	0.00
GBP CARNIVAL PLC ORD USD1.66	288.00	20 354.65	0.00
GBP CENTRICA ORD GBP0.061728395	8 493.00	16 117.39	0.00
GBP COBHAM ORD GBP0.025	3 554.00	6 608.07	0.00
EUR COCA-COLA EUROPEAN ORD GBP0.01	511.00	20 586.94	0.00
GBP COMPASS GROUP ORD GBP0.1105	1 618.00	34 110.50	0.00
GBP CRODA INTL ORD GBP0.10357143	207.00	13 199.30	0.00
GBP DIAGEO ORD GBP0.28 101/108	3 011.00	108 436.40	0.01
GBP DIRECT LINE INSURA ORD GBP 0.109090909	3 391.00	17 808.28	0.00
GBP EASYJET ORD GBP0.27285714	498.00	11 755.80	0.00
GBP G4S ORD GBP0.25	1 687.00	6 820.35	0.00
GBP GKN ORD GBP0.50	3 554.00	21 368.16	0.00
GBP GLAXOSMITHKLINE ORD GBP0.25	5 597.00	105 093.46	0.01
GBP HAMMERSON PLC REIT	1 529.00	10 719.37	0.00
GBP HARGREAVES LANSLOW ORD GBP0.004 (WI)	536.00	14 158.21	0.00
GBP HSBC HLDGS ORD USD0.50(UK REG)	23 677.00	252 894.46	0.03
USD IHS MARKIT LTD COM	462.00	22 051.26	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)	
GBP	IMI ORD GBPO.2857	308.00	5 820.91	0.00
GBP	IMPERIAL BRANDS PL GBPO.10	1 053.00	43 402.69	0.01
GBP	INTERCONTL HOTELS ORD GBPO.1980952380937	234.00	15 679.64	0.00
GBP	INTERTEK GROUP ORD GBPO.01	211.00	15 074.64	0.00
GBP	INVESTEC ORD GBPO.0002	1 252.00	9 738.82	0.00
GBP	ITV ORD GBPO.10	8 108.00	19 255.07	0.00
GBP	JOHNSON MATTHEY ORD GBP1.109245	211.00	10 381.82	0.00
GBP	KINGFISHER ORD GBPO.157142857	1 693.00	8 354.13	0.00
GBP	LAND SECURITIES GP ORD GBPO.106666666	803.00	11 439.61	0.00
GBP	LEGAL & GENERAL GP ORD GBPO.025	9 450.00	36 364.24	0.01
USD	LIBERTY GLOBAL INC USD0.01 A	446.00	16 671.48	0.00
USD	LIBERTY GLOBAL INC USD0.01 C	689.00	24 638.64	0.00
GBP	LLOYDS BANKING GP ORD GBPO.1	73 370.00	72 523.82	0.01
GBP	LONDON STOCK EXCH ORD GBPO.06918604	568.00	31 719.34	0.00
GBP	MARKS & SPENCER GP ORD GBPO.25	1 801.00	7 716.63	0.00
GBP	MEGGITT ORD GBPO.05	764.00	5 043.29	0.00
GBP	MERLIN ENTERTAINME ORD GBPO.01 (WI)	535.00	2 499.98	0.00
USD	MICHAEL KORS HOLDI COM NPV	44.00	2 904.00	0.00
GBP	MORRISON(W)SUPRMKT ORD GBPO.10	1 362.00	4 299.77	0.00
GBP	NATIONAL GRID ORD GBPO.12431289	3 689.00	42 214.09	0.01
GBP	NEXT ORD GBPO.10	178.00	12 889.12	0.00
GBP	OLD MUTUAL PLC ORD GBPO.114285714(POST CON)	5 829.00	19 379.98	0.00
GBP	PEARSON ORD GBPO.25	1 406.00	13 871.86	0.00
GBP	PERSIMMON ORD GBPO.10	145.00	5 159.06	0.00
GBP	PRUDENTIAL ORD GBPO.05	2 927.00	79 334.21	0.01
GBP	RECKITT BENCK GRP ORD GBPO.10	697.00	67 429.22	0.01
GBP	RELX PLC GBPO.1444	1 371.00	30 375.24	0.00
GBP	RIO TINTO ORD GBPO.10	1 453.00	81 037.88	0.01
GBP	ROLLS-ROYCE HLDGS ORD GBPO.20	2 484.00	30 802.29	0.00
GBP	ROYAL BK SCOT GRP ORD GBP1 (POST CONS)	3 770.00	15 423.97	0.00
GBP	ROYAL MAIL PLC ORD GBPO.01 (WI)	968.00	6 462.88	0.00
GBP	RSA INSURANCE GRP ORD GBP1.00	1 064.00	9 374.92	0.00
GBP	SAGE GROUP GBPO.01051948	1 490.00	15 874.46	0.00
GBP	SAINSBURY(J) ORD GBPO.28571428	1 622.00	5 824.08	0.00
GBP	SCHROEDERS VTG SHS GBP1	210.00	11 109.05	0.00
GBP	SEVERN TRENT ORD GBPO.9789	286.00	7 945.01	0.00
GBP	SKY PLC ORD GBPO.50	950.00	14 306.53	0.00
GBP	SMITH & NEPHEW ORD USD0.20	626.00	11 296.68	0.00
GBP	SSE PLC ORD GBPO.50	1 116.00	20 702.52	0.00
GBP	STANDARD CHARTERED ORD USD0.50	3 435.00	40 035.34	0.01
GBP	STD LIFE ABERDEEN ORD GBPO.1222222	1 949.00	11 793.06	0.00
GBP	TAYLOR WIMPEY ORD GBPO.01	6 288.00	17 043.17	0.00
USD	TECHNIPFMC PLC COM USD1	289.00	9 380.94	0.00
GBP	TESCO ORD GBPO.05	12 025.00	35 739.32	0.01
GBP	TRAVIS PERKINS ORD GBPO.10	303.00	6 293.03	0.00
GBP	UNILEVER PLC ORD GBPO.031111	1 491.00	84 811.06	0.01
GBP	UNITED UTILITIES G ORD GBPO.05	770.00	8 080.94	0.00
GBP	VODAFONE GROUP ORD USD0.2095238(POST CONS)	31 262.00	99 848.46	0.01
GBP	WEIR GROUP ORD GBPO.125	237.00	7 444.90	0.00
GBP	WHITBREAD ORD GBPO.76797385	223.00	12 307.32	0.00
USD	WILLIS TOWERS WATS COM USD0.000304635	191.00	30 649.77	0.00
GBP	WPP PLC ORD GBPO.10	1 762.00	32 022.23	0.00
イギリス合計			2 767 702.25	0.27

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 割合 (%)
アメリカ合衆国			
USD 3M CO COM	693.00	173 596.50	0.02
USD ABBOTT LABS COM	1 968.00	122 330.88	0.01
USD ABBVIE INC COM USD0.01	1 870.00	209 851.40	0.02
USD ACTIVISION BLIZZAR COM STK USD0.000001	657.00	48 703.41	0.01
USD ACUITY BRANDS INC COM STK USD0.01	58.00	8 957.52	0.00
USD ADOBE SYSTEMS INC COM USD0.0001	576.00	115 061.76	0.01
USD ADVANCE AUTO PARTS INC COM	100.00	11 699.00	0.00
USD AES CORP COM	1 573.00	18 183.88	0.00
USD AETNA INC COM USD0.01	405.00	75 662.10	0.01
USD AFFILIATED MNGRS COM USD0.01	39.00	7 785.57	0.00
USD AFLAC INC COM USD0.10	449.00	39 601.80	0.01
USD AGCO CORP COM USD0.01	100.00	7 262.00	0.00
USD AGILENT TECHNOLOGIES INC COM	313.00	22 983.59	0.00
USD AGNC INV CORP COM USD0.01	400.00	7 516.00	0.00
USD AIR PRODS & CHEMS COM USD1	237.00	39 903.69	0.01
USD AKAMAI TECHNOLOGIES INC COM	200.00	13 398.00	0.00
USD ALBEMARLE CORP COM USD0.01	100.00	11 159.00	0.00
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQ INC COM	159.00	20 622.30	0.00
USD ALEXION PHARMACEUT COM USD0.0001	266.00	31 739.12	0.00
USD ALIGN TECHNOLOGY INC COM	78.00	20 436.00	0.00
USD ALLERGAN PLC COM USD0.0001	461.00	83 099.86	0.01
USD ALLIANCE DATA SYST COM USD0.01	56.00	14 372.96	0.00
USD ALLIANT ENERGY CORP COM	246.00	9 778.50	0.00
USD ALLSTATE CORP COM	413.00	40 792.01	0.01
USD ALLY FINANCIAL INC COM USD0.01	367.00	10 925.59	0.00
USD ALPHABET INC CAP STK USD0.001 CL C	360.00	421 178.40	0.04
USD ALPHABET INC CAP STK USD0.001 CL A	343.00	405 501.46	0.04
USD ALTRIA GROUP INC COM USD0.333333	2 259.00	158 898.06	0.02
USD AMAZON COM INC COM USD0.01	471.00	683 369.19	0.07
USD AMER ELEC PWR INC COM USD6.50	535.00	36 797.30	0.01
USD AMER EXPRESS CO COM USD0.20	863.00	85 782.20	0.01
USD AMER INTL GRP COM USD2.50	1 212.00	77 471.04	0.01
USD AMER TOWER CORP COM NEW USD0.01	459.00	67 794.30	0.01
USD AMEREN CORP COM	309.00	17 498.67	0.00
USD AMERICAN AIRLINES COM USD1	136.00	7 387.52	0.00
USD AMERICAN WATER WOR COM STK USD0.01	210.00	17 465.70	0.00
USD AMERIPRISE FINL INC COM	191.00	32 221.70	0.00
USD AMERISOURCEBERGEN COM STK USD0.01	300.00	29 901.00	0.00
USD AMETEK INC COM USD0.01	231.00	17 625.30	0.00
USD AMGEN INC COM USD0.0001	870.00	161 863.50	0.02
USD AMPHENOL CORP NEW CL A	277.00	25 697.29	0.00
USD ANADARKO PETROLEUM COM USD0.10	618.00	37 110.90	0.00
USD ANALOG DEVICES INC COM	433.00	39 784.04	0.01
USD ANDEAVOR COM USD0.1666	200.00	21 632.00	0.00
USD ANNALY CAPITAL MAN COM USD0.01	1 866.00	19 667.64	0.00
USD ANSYS INC COM	77.00	12 447.05	0.00
USD ANTERO RES CORP USD0.01	107.00	2 079.01	0.00
USD ANTHEM INC COM USD0.01	316.00	78 320.60	0.01
USD APACHE CORP COM USD0.625	314.00	14 089.18	0.00
USD APPLE INC COM NPV	6 275.00	1 050 623.25	0.10
USD APPLIED MATLS INC COM	1 253.00	67 198.39	0.01
USD ARAMARK COM USD0.01	400.00	18 324.00	0.00
USD ARCHER DANIELS MIDLAND CO COM	670.00	28 776.50	0.00
USD ARCONIC INC COM USD1.00	655.00	19 689.30	0.00
USD ARROW ELECTRS INC COM	100.00	8 134.00	0.00
USD ASSURANT INC COM	100.00	9 148.00	0.00
USD AT&T INC COM USD1	7 215.00	270 201.75	0.03
USD ATMOS ENERGY CORP COM	200.00	16 580.00	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD AUTO DATA PROCESS COM USD0.10	503.00	62 185.89	0.01
USD AUTODESK INC COM USD0.01	216.00	24 973.92	0.00
USD AUTONATION INC COM	44.00	2 649.68	0.00
USD AUTOZONE INC COM USD0.01	46.00	35 210.24	0.01
USD AVALONBAY COMMUNI COM USD0.01	218.00	37 147.20	0.01
USD AVERY DENNISON CORP COM	71.00	8 710.28	0.00
USD AVNET INC COM	100.00	4 250.00	0.00
USD AXALTA COATING SYS COM USD1.00	183.00	5 764.50	0.00
USD BAKER HUGHES A GE COM USD0.0001 CL A	443.00	14 242.45	0.00
USD BALL CORP COM NPV	154.00	5 895.12	0.00
USD BAXTER INTL INC COM USD1	513.00	36 951.39	0.01
USD BB&T CORP COM USD5	916.00	50 554.04	0.01
USD BECTON DICKINSON COM USD1	369.00	89 644.86	0.01
USD BERKLEY(WR)CORP COM USD0.20	100.00	7 298.00	0.00
USD BERKSHIRE HATHAWAY CLASS' B' COM USD0.0033	1 397.00	299 488.86	0.03
USD BEST BUY CO INC COM USD0.10	320.00	23 379.20	0.00
USD BIOGEN INC COM STK USD0.0005	256.00	89 039.36	0.01
USD BIOMARIN PHARMA COM USD0.001	162.00	14 617.26	0.00
USD BK OF AMERICA CORP COM USD0.01	11 951.00	382 432.00	0.04
USD BK OF NY MELLON CP COM STK USD0.01	1 182.00	67 019.40	0.01
USD BLACKROCK INC COM STK USD0.01	163.00	91 573.40	0.01
USD BLOCK(H&R)INC COM NPV	72.00	1 910.88	0.00
USD BOEING CO COM USD5	680.00	240 971.60	0.02
USD BORG WARNER INC COM	156.00	8 776.56	0.00
USD BOSTON PPTYS INC COM USD0.01	227.00	28 082.17	0.00
USD BOSTON SCIENTIFIC COM USD0.01	1 568.00	43 841.28	0.01
USD BRIGHTHOUSE FINL I COM USD0.01 WI	97.00	6 233.22	0.00
USD BRISTOL-MYRS SQUIB COM STK USD0.10	1 930.00	120 818.00	0.01
USD BRIXMOR PROPERTY G COM USD0.01	554.00	8 991.42	0.00
USD BROADRIDGE FIN SOL COM STK USD0.01	225.00	21 692.25	0.00
USD BROWN FORMAN CORP CL B	344.00	23 839.20	0.00
USD BUNGE LIMITED COM USD0.01	208.00	16 521.44	0.00
USD CA INC COM USD0.10	324.00	11 615.40	0.00
USD CABOT OIL & GAS CO COM USD0.10	202.00	5 322.70	0.00
USD CADENCE DESIGN SYS COM USD0.01	190.00	8 523.40	0.00
USD CAMPBELL SOUP CO CAP USD0.0375	210.00	9 775.50	0.00
USD CAPITAL ONE FINL COM USD0.01	567.00	58 945.32	0.01
USD CARDINAL HEALTH INC COM	340.00	24 408.60	0.00
USD CARMAX INC COM USD0.50	216.00	15 415.92	0.00
USD CARNIVAL CORP COM USD0.01(PAIRED STOCK)	394.00	28 214.34	0.00
USD CATERPILLAR INC DEL COM	648.00	105 481.44	0.01
USD CBRE GROUP INC CLASS 'A' USD0.01	377.00	17 225.13	0.00
USD CBS CORP NEW CL B	452.00	26 039.72	0.00
USD CDK GLOBAL INC COM USD0.01	111.00	7 913.19	0.00
USD CDW CORP COM USD0.01	150.00	11 218.50	0.00
USD CELANESE CORP COM SERIES 'A' USD0.0001	200.00	21 632.00	0.00
USD CELGENE CORP COM USD0.01	896.00	90 639.36	0.01
USD CENTENE CORP DEL COM	300.00	32 172.00	0.01
USD CENTERPOINT ENERGY INC COM	411.00	11 581.98	0.00
USD CENTURYLINK INC COM	549.00	9 777.69	0.00
USD CERNER CORP COM	295.00	20 393.35	0.00
USD CF INDS HLDGS INC COM	315.00	13 368.60	0.00
USD CH ROBINSON WORLDW COM USD0.1	90.00	8 231.40	0.00
USD CHARTER COMMUN INC COM USD0.001 CLASS 'A'	263.00	99 216.75	0.01
USD CHENIERE ENERGY INC COM NEW	200.00	11 312.00	0.00
USD CHEVRON CORP COM USD0.75	2 187.00	274 140.45	0.03
USD CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC CL A	61.00	19 810.36	0.00
USD CHURCH & DWIGHT INC COM	266.00	12 994.10	0.00
USD CIGNA CORP COM USD0.25	317.00	66 046.95	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD CIMAREX ENERGY CO COM USD0.01	100.00	11 220.00	0.00
USD CINCINNATI FINL CORP COM	231.00	17 763.90	0.00
USD CINTAS CORP COM	100.00	16 845.00	0.00
USD CISCO SYSTEMS COM USD0.001	5 806.00	241 181.24	0.02
USD CIT GROUP INC COM NEW USD0.01	154.00	7 806.26	0.00
USD CITIGROUP INC COM USD0.01	3 361.00	263 771.28	0.03
USD CITIZENS FINL GP COM USD0.01	575.00	26 392.50	0.00
USD CITRIX SYSTEMS INC COM USD0.001	200.00	18 552.00	0.00
USD CLOROX CO DEL COM	134.00	18 986.46	0.00
USD CME GROUP INC COM STK USD0.01 CLASS' A'	397.00	60 931.56	0.01
USD CMS ENERGY CORP COM	279.00	12 485.25	0.00
USD COCA-COLA CO COM USD0.25	4 769.00	226 956.71	0.02
USD COGNIZANT TECHNOLO COM CL' A' USD0.01	673.00	52 480.54	0.01
USD COLGATE-PALMOLIVE COM USD1	948.00	70 379.52	0.01
USD COLONY NORTHSTAR COM USD0.001 CL A	1 200.00	10 776.00	0.00
USD COMCAST CORP COM CLS' A' USD0.01	5 688.00	241 910.64	0.02
USD COMERICA INC COM	136.00	12 949.92	0.00
USD CONAGRA BRANDS IN COM USD5	436.00	16 568.00	0.00
USD CONCHO RES INC COM STK USD0.001	242.00	38 100.48	0.01
USD CONOCOPHILLIPS COM USD0.01	1 404.00	82 569.24	0.01
USD CONSOLIDATED EDISON INC COM	318.00	25 554.48	0.00
USD CONSTELLATION BRDS CLASS' A' COM USD0.01	289.00	63 426.83	0.01
USD CONTINENTAL RES IN COM STK USD0.01	146.00	8 107.38	0.00
USD COOPER COS INC COM USD0.10	100.00	24 467.00	0.00
USD CORNING INC COM USD0.50	1 143.00	35 684.46	0.01
USD COSTCO WHSL CORP NEW COM	527.00	102 696.49	0.01
USD COTY INC COM USD0.01 CL 'A'	900.00	17 649.00	0.00
USD CROWN CASTLE INTL COM USD0.01	343.00	38 680.11	0.01
USD CROWN HOLDINGS INC COM USD5	242.00	14 048.10	0.00
USD CSX CORP COM USD1	1 064.00	60 403.28	0.01
USD CUMMINS INC COM	181.00	34 028.00	0.00
USD CVS HEALTH CORP COM STK USD0.01	1 241.00	97 654.29	0.01
USD D R HORTON INC COM	408.00	20 012.40	0.00
USD DANAHER CORP COM USD0.01	677.00	68 566.56	0.01
USD DARDEN RESTAURANTS INC COM	143.00	13 706.55	0.00
USD DAVITA INC COM USD0.001	200.00	15 608.00	0.00
USD DEERE & CO COM USD1	303.00	50 425.26	0.01
USD DELL TECHNOLOGIES COM USD0.01 CL V	326.00	23 374.20	0.00
USD DELTA AIRLINES INC COM USD0.0001	111.00	6 301.47	0.00
USD DENTSPLY SIRONA IN COM NPV	391.00	23 776.71	0.00
USD DEVON ENERGY CORP NEW COM	514.00	21 264.18	0.00
USD DIAMONDBACK ENERGY COM USD0.01	200.00	25 100.00	0.00
USD DIGITAL REALTY TRU COM STK USD0.01	157.00	17 576.15	0.00
USD DISCOVER FINL SVCS COM STK USD0.01	439.00	35 032.20	0.01
USD DISCOVERY COMMUNIC COM CL A USD0.01	150.00	3 760.50	0.00
USD DISCOVERY COMMUNIC COM CL C USD0.01	450.00	10 737.00	0.00
USD DISH NETWORK CORPO CLASS' A' COM USD0.01	444.00	20 823.60	0.00
USD DOLLAR GENERAL CP COM USD0.875	314.00	32 379.68	0.00
USD DOLLAR TREE INC	324.00	37 260.00	0.01
USD DOMINION ENERGY IN COM STK NPV	698.00	53 355.12	0.02
USD DOMINOS PIZZA INC COM USD0.01	100.00	21 685.00	0.00
USD DOVER CORP COM	200.00	21 242.00	0.00
USD DOWDUPONT INC COM USD0.01	2 550.00	192 729.00	0.02
USD DR PEPPER SNAPPLE COM STK USD0.01	203.00	24 228.05	0.00
USD DTE ENERGY CO COM	193.00	20 388.52	0.00
USD DUKE ENERGY CORP COM USD0.001 (POST REV SPLT)	777.00	60 994.50	0.01
USD DUKE REALTY CORP COM USD0.01	537.00	14 182.17	0.00
USD DXC TECHNOLOGY CO COM USD0.01	420.00	41 811.00	0.01
USD E TRADE FINANCIAL COM USD0.01	267.00	14 070.90	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD EASTMAN CHEM CO COM	200.00	19 836.00	0.00
USD EATON VANCE CORP COM NON VTG	100.00	5 780.00	0.00
USD EBAY INC COM USDO.001	1 229.00	49 872.82	0.01
USD ECOLAB INC COM	354.00	48 738.72	0.01
USD EDISON INTL COM	356.00	22 260.68	0.00
USD EDWARDS LIFESCIENCES CORP COM	228.00	28 860.24	0.00
USD ELECTRONIC ARTS INC COM	335.00	42 531.60	0.01
USD ELI LILLY AND CO COM NPV	1 147.00	93 423.15	0.01
USD EMERSON ELEC CO COM	704.00	50 849.92	0.01
USD ENTERGY CORP NEW COM	232.00	18 256.08	0.00
USD ENVISION HEALTHCAR COM USDO.01	200.00	7 198.00	0.00
USD EOG RESOURCES INC COM USDO.01	653.00	75 095.00	0.01
USD EQT CORPORATION	247.00	13 409.63	0.00
USD EQUIFAX INC COM	148.00	18 489.64	0.00
USD EQUINIX INC COM USDO.001 NEW	104.00	47 339.76	0.01
USD EQUITY RESIDENTIAL SBI USDO.01	364.00	22 426.04	0.00
USD ESSEX PROP TRUST COM USDO.0001	68.00	15 842.64	0.00
USD ESTEE LAUDER COS CLASS' A' COM USDO.01	216.00	29 151.36	0.00
USD EVERSOURCE ENERGY COM USD5	318.00	20 062.62	0.00
USD EXELON CORP COM NPV	1 065.00	41 013.15	0.00
USD EXPEDIA INC COM USDO.001 (POST-SPLIT)	133.00	17 025.33	0.00
USD EXPEDTRS INTL WASH COM USDO.01	200.00	12 990.00	0.00
USD EXPRESS SCRIPTS HL COM USDO.01	730.00	57 801.40	0.01
USD EXTRA SPACE STORAG COM USDO.01	38.00	3 172.24	0.00
USD EXXON MOBIL CORP COM NPV	4 847.00	423 143.10	0.04
USD F M C CORP COM NEW	200.00	18 266.00	0.00
USD F5 NETWORK INC COM STK NPV	97.00	14 020.38	0.00
USD FACEBOOK INC COM USDO.000006 CL 'A'	2 706.00	505 724.34	0.05
USD FASTENAL CO COM	376.00	20 664.96	0.00
USD FEDERAL REALTY INVT TR SH BEN INT NEW	81.00	9 784.80	0.00
USD FEDEX CORP COM USDO.10	298.00	78 219.04	0.01
USD FIDELITY NATL FINL FNF GROUP COM USDO.0001	325.00	12 668.50	0.00
USD FIDELITY NATL INF COM STK USDO.01	324.00	33 164.64	0.00
USD FIFTH THIRD BANCORP COM	1 141.00	37 767.10	0.01
USD FIRST REPUBLIC BAN COM USDO.01	200.00	17 910.00	0.00
USD FIRSTENERGY CORP COM USDO.10	358.00	11 778.20	0.00
USD FISERV INC COM USDO.01	239.00	33 660.76	0.00
USD FLEETCOR TECHNOLOG COM STK USDO.001	100.00	21 250.00	0.00
USD FLIR SYS INC COM	303.00	15 516.63	0.00
USD FLOWSERVE CORP COM	300.00	13 596.00	0.00
USD FLUOR CORP NEW COM	216.00	13 111.20	0.00
USD FORD MOTOR CO COM STK USDO.01	4 974.00	54 564.78	0.01
USD FORTINET INC COM USDO.001	170.00	7 826.80	0.00
USD FORTIVE CORP COM USDO.01	421.00	32 004.42	0.00
USD FORTUNE BRANDS HOME USDO.01 WI	261.00	18 512.73	0.00
USD FRANKLIN RES INC COM	361.00	15 310.01	0.00
USD FREEPORT-MCMORAN COM STK USDO.10	1 508.00	29 406.00	0.00
USD GALLAGHER ARTHUR J & CO COM	116.00	7 925.12	0.00
USD GAP INC DEL COM	432.00	14 359.68	0.00
USD GARTNER INC COM	200.00	27 748.00	0.00
USD GEN DYNAMICS CORP COM USD1	307.00	68 301.36	0.01
USD GEN ELEC CO COM USDO.06	10 461.00	169 154.37	0.02
USD GENERAL MLS INC COM	647.00	37 843.03	0.01
USD GENERAL MOTORS CO COM USDO.01	1 528.00	64 802.48	0.01
USD GENUINE PARTS CO COM STK USD1	262.00	27 266.34	0.00
USD GGP INC COM USDO.01	578.00	13 311.34	0.00
USD GILEAD SCIENCES COM USDO.001	1 510.00	126 538.00	0.01
USD GLOBAL PAYMENTS COM NPV	250.00	27 945.00	0.00
USD GOLDMAN SACHS GRP COM USDO.01	419.00	112 245.91	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD GOODYEAR TIRE&RUBR COM NPV	234.00	8 147.88	0.00
USD GRACE W R & CO DEL NEW COM	200.00	14 764.00	0.00
USD GRAINGER W W INC COM	53.00	14 291.98	0.00
USD HALLIBURTON COM STK USD2.50	864.00	46 396.80	0.01
USD HANESBRANDS INC COM	700.00	15 204.00	0.00
USD HARLEY DAVIDSON INC COM	191.00	9 255.86	0.00
USD HARRIS CORP COM STK USD1	123.00	19 603.74	0.00
USD HARTFORD FINL SVCS COM USD0.01	556.00	32 670.56	0.00
USD HASBRO INC COM	136.00	12 861.52	0.00
USD HCA HEALTHCARE INC COM USD0.01	323.00	32 674.68	0.00
USD HCP INC COM USD1	452.00	10 884.16	0.00
USD HELMERICH & PAYNE INC COM	255.00	18 367.65	0.00
USD HERSHEY CO COM	191.00	21 073.03	0.00
USD HESS CORPORATION COM USD1	240.00	12 122.40	0.00
USD HEWLETT PACKARD EN COM USD0.01	1 921.00	31 504.40	0.01
USD HILTON WORLDWIDE H COM USD0.01	55.00	4 710.75	0.00
USD HOLLYFRONTIER CORP COM USD0.01	199.00	9 544.04	0.00
USD HOLOGIC INC COM USD0.01	265.00	11 315.50	0.00
USD HOME DEPOT INC COM USD0.05	1 429.00	287 086.10	0.03
USD HONEYWELL INTL INC COM	824.00	131 568.08	0.01
USD HORMEL FOODS CORP COM USD0.0586	400.00	13 732.00	0.00
USD HOST HOTELS & RESO COM STK USD0.01	764.00	15 860.64	0.00
USD HP INC COM USD0.01	1 961.00	45 730.52	0.01
USD HUMANA INC COM USD0.166	178.00	50 165.74	0.01
USD HUNT J B TRANS SVCS INC COM	100.00	12 083.00	0.00
USD HUNTINGTON BANCSHARES INC COM	1 363.00	22 053.34	0.00
USD IDEXX LABORATORIES COM USD0.10	109.00	20 387.36	0.00
USD ILLINOIS TOOL WKS COM NPV	355.00	61 652.85	0.01
USD ILLUMINA INC COM USD0.01	196.00	45 597.44	0.01
USD INCYTE CORPORATION COM USD0.001	200.00	18 058.00	0.00
USD INGERSOLL-RAND PLC SHS USD1	257.00	24 319.91	0.00
USD INGREDION INC COM USD0.01	100.00	14 364.00	0.00
USD INTEL CORP COM USD0.001	5 498.00	264 673.72	0.02
USD INTERCONTINENTAL E COM USD0.01	674.00	49 768.16	0.01
USD INTERNATIONAL FLAVORS&FRAGRANC COM	157.00	23 597.10	0.00
USD INTERPUBLIC GROUP COM USD0.10	600.00	13 134.00	0.00
USD INTL BUSINESS MCHN COM USD0.20	1 045.00	171 066.50	0.02
USD INTL PAPER CO COM	396.00	24 892.56	0.00
USD INTUIT INC COM USD0.01	347.00	58 261.30	0.01
USD INTUITIVE SURGICAL COM USD0.001	150.00	64 750.50	0.01
USD INVESCO LTD COM STK USD0.20	568.00	20 521.84	0.00
USD IQVIA HOLDINGS INC COM USD0.01	181.00	18 496.39	0.00
USD IRON MTN INC NEW COM NPV	182.00	6 375.46	0.00
USD JACOBS ENG GROUP COM USD1	97.00	6 737.62	0.00
USD JOHNSON & JOHNSON COM USD1	3 209.00	443 451.71	0.04
USD JOHNSON CTLS INTL COM USD0.01	1 058.00	41 399.54	0.01
USD JONES LANG LASALLE INC COM	100.00	15 635.00	0.00
USD JP MORGAN CHASE & COM USD1	4 244.00	490 903.48	0.05
USD JUNIPER NETWORKS COM USD0.00001	881.00	23 038.15	0.00
USD KANSAS CITY STHN I COM USD0.01	124.00	14 028.12	0.00
USD KELLOGG CO COM USD0.25	262.00	17 844.82	0.00
USD KEYCORP NEW COM	1 697.00	36 315.80	0.00
USD KIMBERLY CLARK CORP COM	405.00	47 385.00	0.01
USD KIMCO REALTY COM USD0.01	328.00	5 218.48	0.00
USD KINDER MORGAN INC USD0.01	2 208.00	39 699.84	0.01
USD KLA-TENCOR CORP COM USD0.001	166.00	18 226.80	0.00
USD KOHLS CORPORATION COM USD0.01	261.00	16 904.97	0.00
USD KRAFT HEINZ CO COM USD0.01	699.00	54 794.61	0.01
USD KROGER CO COM USD1	1 057.00	32 090.52	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD L BRANDS INC COM USD0.50	239.00	11 971.51	0.00
USD LAB CORP AMER HLDG COM USD0.1	129.00	22 510.50	0.00
USD LAM RESEARCH CORP COM USD0.001	172.00	32 941.44	0.01
USD LAS VEGAS SANDS CORP COM	500.00	38 760.00	0.01
USD LEAR CORP COM USD0.01	129.00	24 915.06	0.00
USD LEGGETT & PLATT IN COM USD0.01	173.00	8 046.23	0.00
USD LENNAR CORP CL B	6.00	303.84	0.00
USD LENNAR CORP COM CL' A' USD0.10	300.00	18 798.00	0.00
USD LEUCADIA NATL CORP COM	687.00	18 597.09	0.00
USD LIBERTY BROADBAND COM USD0.01 CL 'C'	57.00	5 446.35	0.00
USD LIBERTY INTERACTIVE CORP COM SER A	344.00	9 662.96	0.00
USD LIBERTY MEDIA CORP COM USD0.01 SER A SIRIUSXM	100.00	4 501.00	0.00
USD LIBERTY MEDIA CORP COM USD0.01 SER C SIRIUSXM	200.00	8 962.00	0.00
USD LINCOLN NATL CORP COM NPV	257.00	21 279.60	0.00
USD LKQ CORP COM	300.00	12 609.00	0.00
USD LOCKHEED MARTIN CORP COM	310.00	110 003.50	0.01
USD LOEWS CORP COM	377.00	19 472.05	0.00
USD LOWE' S COS INC COM USD0.50	1 002.00	104 939.46	0.01
USD LYONDELLBASELL IND COM USD0.01	388.00	46 497.92	0.01
USD M & T BANK CORP COM USD0.50	261.00	49 793.58	0.01
USD MACERICH CO COM USD0.01	149.00	9 620.93	0.00
USD MACQUARIE INFR LLC LIMITED LIABILITY INTEREST	200.00	13 270.00	0.00
USD MACY' S INC COM STK USD0.01	209.00	5 423.55	0.00
USD MANPOWER GROUP COM USD0.01	89.00	11 693.71	0.00
USD MARATHON OIL CORP COM USD1	1 109.00	20 172.71	0.00
USD MARATHON PETROLEUM COM USD0.01	603.00	41 769.81	0.00
USD MARRIOTT INTL INC COM USD0.01 CLASS 'A'	371.00	54 663.14	0.01
USD MARSH & MCLENNAN COM USD1	559.00	46 687.68	0.01
USD MARTIN MARIETTA M. COM USD0.01	71.00	16 200.07	0.00
USD MASCO CORP COM	327.00	14 603.82	0.00
USD MASTERCARD INC COM USD0.0001 CLASS 'A'	1 098.00	185 562.00	0.02
USD MATTEL INC COM USD1	610.00	9 662.40	0.00
USD MAXIM INTEGRATED COM USD0.001	332.00	20 252.00	0.00
USD MCCORMICK & CO INC COM N/VTG NPV	136.00	14 792.72	0.00
USD MCDONALD' S CORP COM USD0.01	990.00	169 428.60	0.02
USD MCKESSON CORP COM USD0.01	265.00	44 753.20	0.00
USD MEDTRONIC PLC USD0.0001	1 593.00	136 822.77	0.01
USD MERCK & CO INC COM USD0.50	3 182.00	188 533.50	0.02
USD METLIFE INC COM USD0.01	1 067.00	51 290.69	0.01
USD MGM RESORTS INTL COM STK USD0.01	1 047.00	38 163.15	0.01
USD MICROCHIP TECHNLY COM USD0.001	227.00	21 614.94	0.00
USD MICRON TECHNOLOGY COM USD0.10	1 482.00	64 793.04	0.01
USD MICROSOFT CORP COM USD0.0000125	8 610.00	818 036.10	0.08
USD MID-AMER APARTMENT COM STK USD0.01	136.00	12 970.32	0.00
USD MOHAWK INDS COM USD0.01	94.00	26 419.64	0.00
USD MOLSON COORS BREWI CLASS 'B' USD0.01	216.00	18 148.32	0.00
USD MONDELEZ INTL INC COM USD0.01	1 790.00	79 476.00	0.01
USD MONSANTO COM STK USD0.01	499.00	60 778.20	0.01
USD MONSTER BEV CORP USD0.005(NEW)	317.00	21 628.91	0.00
USD MOODYS CORP COM USD0.01	195.00	31 549.05	0.00
USD MORGAN STANLEY COM STK USD0.01	1 598.00	90 366.90	0.01
USD MOSAIC CO COM USD0.01	217.00	5 924.10	0.00
USD MOTOROLA SOLUTIONS INCCOM USD0.01	136.00	13 526.56	0.00
USD MSCI INC COM STK USS0.01	69.00	9 606.87	0.00
USD MYLAN NV EURO.01	601.00	25 752.85	0.00
USD NASDAQ INC COM STK USD0.01	100.00	8 091.00	0.00
USD NATIONAL OILWELL VARCO INC COM	615.00	22 558.20	0.00
USD NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	133.00	5 277.44	0.00
USD NETAPP INC COM USD0.001	295.00	18 142.50	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD NETFLIX INC COM USD0.001	496.00	134 068.80	0.01
USD NEW YORK CMNTY BANCORP INC COM	281.00	3 978.96	0.00
USD NEWELL BRANDS INC COM USD1	631.00	16 683.64	0.00
USD NEWFIELD EXPL CO COM	62.00	1 962.92	0.00
USD NEWMONT MINING CP COM USD1.60	612.00	24 792.12	0.00
USD NEWS CORP NEW COM USD0.01 CL' A'	325.00	5 560.75	0.00
USD NEXTERA ENERGY INC COM USD0.01	549.00	86 972.58	0.01
USD NIELSEN HLDGS PLC COM EURO.07	301.00	11 260.41	0.00
USD NIKE INC CLASS' B' COM NPV	1 564.00	106 696.08	0.01
USD NISOURCE INC COM NPV	568.00	14 018.24	0.00
USD NOBLE ENERGY INC COM USD0.01	422.00	12 879.44	0.00
USD NORDSTROM INC COM NPV	329.00	16 222.99	0.00
USD NORFOLK STHN CORP COM USD1	346.00	52 204.48	0.01
USD NORTHERN TRUST CP COM USD1.666	256.00	26 979.84	0.00
USD NORTHROP GRUMMAN COM USD1	201.00	68 446.53	0.01
USD NORWEGIAN CRUISE L COM USD0.001	141.00	8 564.34	0.00
USD NUCOR CORP COM	339.00	22 699.44	0.00
USD NVIDIA CORP COM USD0.001	620.00	152 396.00	0.02
USD OCCIDENTAL PETRLM COM USD0.20	863.00	64 699.11	0.01
USD OGE ENERGY CORP COM USD0.01	200.00	6 440.00	0.00
USD OMNICOM GROUP INC COM USD0.15	238.00	18 242.70	0.00
USD ONEOK INC	209.00	12 301.74	0.00
USD ORACLE CORP COM USD0.01	3 557.00	183 505.63	0.02
USD OREILLY AUTO NEW COM USD0.01	116.00	30 704.04	0.00
USD PACCAR INC COM STK USD1	401.00	29 898.56	0.00
USD PACKAGING CORP AMER COM	200.00	25 126.00	0.00
USD PALO ALTO NETWORKS COM USD0.0001	134.00	21 154.58	0.00
USD PARKER-HANNIFIN COM STK USD0.50	136.00	27 393.12	0.00
USD PARSLEY ENERGY INC COM USD0.01 CL' A'	203.00	4 790.80	0.00
USD PATTERSON COMPANIES INC COM	100.00	3 589.00	0.00
USD PAYCHEX INC COM	303.00	20 679.75	0.00
USD PAYPAL HOLDINGS IN COM USD0.0001	1 241.00	105 882.12	0.01
USD PEOPLE' S UNITED FINANCIAL INC COM STK USD0.01	576.00	11 329.92	0.00
USD PEPSICO INC CAP USD0.016666	1 701.00	204 630.30	0.02
USD PERRIGO CO LTD COM EURO.001	169.00	15 314.78	0.00
USD PFIZER INC COM USD0.05	7 177.00	265 836.08	0.04
USD PG&E CORP COM	587.00	24 906.41	0.00
USD PHILIP MORRIS INTL COM STK NPV 'WI'	1 796.00	192 585.08	0.02
USD PHILLIPS 66 COM USD0.01	521.00	53 350.40	0.01
USD PINNACLE WEST CAP CORP COM	100.00	7 995.00	0.00
USD PIONEER NATURAL RE COM STK USD0.01	201.00	36 764.91	0.00
USD PNC FINANCIAL SVCS COM USD5	571.00	90 229.42	0.01
USD POLARIS INDS INC COM	100.00	11 301.00	0.00
USD PPG INDS INC COM	282.00	33 481.86	0.00
USD PPL CORP COM USD0.01	739.00	23 551.93	0.00
USD PRAXAIR INC COM USD0.01	308.00	49 738.92	0.01
USD PRICELINE.COM INC COM USD0.008	59.00	112 810.95	0.01
USD PRINCIPAL FINL GP COM USD0.01	305.00	20 618.00	0.00
USD PROCTER & GAMBLE COM NPV	3 008.00	259 710.72	0.02
USD PROGRESSIVE CP(OH) COM USD1	633.00	34 245.30	0.00
USD PROLOGIS INC COM USD0.01	524.00	34 117.64	0.00
USD PRUDENTIAL FINL COM USD0.01	512.00	60 835.84	0.01
USD PUBLIC STORAGE COM USD0.10	181.00	35 432.56	0.00
USD PUBLIC SVC ENTERPRISE GROUP COM	526.00	27 283.62	0.00
USD PULTE GROUP INC COM USD0.01	537.00	17 092.71	0.00
USD PVH CORP COM USD1	100.00	15 508.00	0.00
USD QORVO INC COM USD 0.0001	116.00	8 325.32	0.00
USD QUALCOMM INC COM USD0.0001	1 701.00	116 093.25	0.01
USD QUEST DIAGNOSTICS INC COM	246.00	26 031.72	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD RALPH LAUREN CORP CLASS 'A' COM USD0.01	100.00	11 431.00	0.00
USD RANGE RES CORP COM USD0.01	206.00	2 935.50	0.00
USD RAYMOND JAMES FINANCIAL INC COM	200.00	19 278.00	0.00
USD RAYTHEON CO COM NEW	342.00	71 457.48	0.01
USD REALTY INCOME CORP	234.00	12 446.46	0.00
USD RED HAT INC COM	411.00	53 997.18	0.01
USD REGENCY CENTERS COM USD0.01	95.00	5 976.45	0.00
USD REGENERON PHARMACEUTICALS COM	120.00	43 998.00	0.01
USD REGIONS FINANCIAL CORP NEW COM	900.00	17 307.00	0.00
USD REPUBLIC SERVICES COM USD0.01	217.00	14 929.60	0.00
USD RESMED INC COM USD0.004	200.00	20 158.00	0.00
USD ROBERT HALF INTL COM USD0.001	100.00	5 788.00	0.00
USD ROCKWELL AUTOMATIO COM USD1	137.00	27 028.73	0.00
USD ROCKWELL COLLINS INC COM	144.00	19 942.56	0.00
USD ROPER TECHNOLOGIES COM USD0.01	198.00	55 556.82	0.01
USD ROSS STORES INC COM USD0.01	481.00	39 629.59	0.00
USD ROYAL CARIBBEAN COM USD0.01	197.00	26 309.35	0.00
USD S&P GLOBAL INC COM USD1	299.00	54 148.90	0.01
USD SABRE CORP COM USD0.01	500.00	10 385.00	0.00
USD SALESFORCE.COM INC COM USD0.001	719.00	81 901.29	0.01
USD SBA COMMUNICATIONS COM USD0.01 CL A	120.00	20 940.00	0.00
USD SCANA CORP NEW COM	299.00	12 151.36	0.00
USD SCHEIN HENRY INC COM	200.00	15 136.00	0.00
USD SCHLUMBERGER COM USD0.01	1 557.00	114 564.06	0.01
USD SCHWAB(CHARLES)CP COM USD0.01	1 338.00	71 368.92	0.01
USD SCRIPPS NETWORKS I COM USD0.01 CL A	105.00	9 238.95	0.00
USD SEALED AIR CORP NEW COM	200.00	9 470.00	0.00
USD SEATTLE GENETICS I COM USD0.001	111.00	5 805.30	0.00
USD SEI INVESTMENT COM USD0.01	269.00	20 215.35	0.00
USD SEMPRA ENERGY COM NPV	372.00	39 811.44	0.01
USD SERVICENOW INC COM USD0.001	200.00	29 774.00	0.00
USD SHERWIN-WILLIAMS COM USD1	100.00	41 711.00	0.01
USD SIMON PROP GROUP COM USD0.0001	342.00	55 872.54	0.01
USD SKYWORKS SOLUTIONS INC COM	220.00	21 386.20	0.00
USD SMITH A O COM	173.00	11 552.94	0.00
USD SMUCKER(JM)CO COM NPV	130.00	16 495.70	0.00
USD SNAP-ON INC COM USD1	94.00	16 103.14	0.00
USD SOUTHERN CO COM	1 090.00	49 169.90	0.01
USD SOUTHWEST AIRLINES COM USD1	186.00	11 308.80	0.00
USD SPLUNK INC COM USD0.001	108.00	9 975.96	0.00
USD SPRINT CORPORATION COM USD0.01	668.00	3 560.44	0.00
USD STANLEY BLACK & DE COM USD2.50	169.00	28 092.87	0.00
USD STARBUCKS CORP COM USD0.001	1 690.00	96 008.90	0.01
USD STATE STREET CORP COM STK USD1	438.00	48 254.46	0.01
USD STERICYCLE INC COM	100.00	7 536.00	0.00
USD STRYKER CORP COM USD0.10	390.00	64 108.20	0.01
USD SUNTRUST BKS INC COM	550.00	38 885.00	0.00
USD SYMANTEC CORP COM	689.00	18 761.47	0.00
USD SYNCHRONY FINANCIA COM USD0.001	938.00	37 219.84	0.00
USD SYNOPSIS INC COM USD0.01	200.00	18 522.00	0.00
USD SYSCO CORP COM USD1	600.00	37 722.00	0.00
USD T ROWE PRICE GROUP COM USD0.20	267.00	29 805.21	0.00
USD T-MOBILE US INC COM USD0.0001	400.00	26 040.00	0.00
USD TAPESTRY INC COM USD0.01	473.00	22 249.92	0.00
USD TARGA RESOURCES CO COM USD0.001	89.00	4 272.00	0.00
USD TARGET CORP COM STK USD0.0833	619.00	46 561.18	0.01
USD TD AMERITRADE HLDG COM USD0.01	409.00	22 818.11	0.00
USD TESLA INC COM USD0.001	148.00	52 437.88	0.00
USD TEXAS INSTRUMENTS COM USD1	1 131.00	124 036.77	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD THERMO FISHER SCIE COM USD1	460.00	103 090.60	0.01
CAD THOMSON-REUTERS CO COM NPV	263.00	11 410.92	0.00
USD TIFFANY & CO NEW COM	261.00	27 835.65	0.00
USD TIME WARNER INC COM USD0.01	896.00	85 433.60	0.01
USD TJX COS INC COM USD1	734.00	58 954.88	0.01
USD TOLL BROS INC COM USD0.01	82.00	3 819.56	0.00
USD TORCHMARK CORP COM	65.00	5 905.25	0.00
USD TOTAL SYSTEM SVCS COM STK USD0.10	213.00	18 927.18	0.00
USD TRACTOR SUPPLY CO COM	200.00	15 250.00	0.00
USD TRANSDIGM GROUP INC COM	56.00	17 746.96	0.00
USD TRAVELERS CO INC COM NPV	330.00	49 473.60	0.00
USD TRIMBLE INC COM NPV	300.00	13 230.00	0.00
USD TRIPADVISOR INC COM USD0.001	100.00	3 467.00	0.00
USD TWENTY-FIRST CENTU COM USD0.01 CL' A'	1 230.00	45 387.00	0.01
USD TWENTY-FIRST CENTU COM USD0.01 CL' B'	514.00	18 755.86	0.00
USD TWITTER INC COM USD0.000005	900.00	23 229.00	0.00
USD TYSON FOODS INC CL A	320.00	24 355.20	0.00
USD UDR INC	351.00	12 822.03	0.00
USD UGI CORP NEW COM	300.00	13 731.00	0.00
USD ULTA BEAUTY INC COM STK USD0.01	55.00	12 215.50	0.00
USD UNDER ARMOUR INC COM STK USD0.000333 CL A	200.00	2 772.00	0.00
USD UNDER ARMOUR INC COM STK USD0.000333 CL C	201.00	2 582.85	0.00
USD UNION PACIFIC CORP COM USD2.50	962.00	128 427.00	0.01
USD UNITED CONTINENTAL COM USD0.01	112.00	7 595.84	0.00
USD UNITED PARCEL SERVICE INC CL B	773.00	98 418.36	0.01
USD UNITED RENTALS INC COM	200.00	36 222.00	0.01
USD UNITEDHEALTH GRP COM USD0.01	1 102.00	260 931.56	0.02
USD UNIVERSAL HEALTH S CLASS' B' COM USD0.01	99.00	12 028.50	0.00
USD UNUM GROUP COM USD0.10	272.00	14 467.68	0.00
USD US BANCORP COM USD0.01	1 982.00	113 251.48	0.01
USD UTD TECHNOLOGIES COM USD1	905.00	124 899.05	0.01
USD UTD THERAPEUTIC COM USD0.01	100.00	12 900.00	0.00
USD VALERO ENERGY CORP NEW COM	527.00	50 576.19	0.01
USD VENTAS INC COM USD0.25	351.00	19 645.47	0.00
USD VEREIT INC COM USD0.001	1 092.00	7 862.40	0.00
USD VERISIGN INC COM	200.00	22 984.00	0.00
USD VERISK ANALYTICS I CL A USD0.001	187.00	18 709.35	0.00
USD VERIZON COMMUN COM USD0.10	4 759.00	257 319.13	0.02
USD VERTEX PHARMACEUTI COM USD0.01	367.00	61 241.29	0.01
USD VF CORP COM NPV	373.00	30 265.22	0.00
USD VIACOM INC NEW CL' B' NON-VTG USD0.001	319.00	10 660.98	0.00
USD VISA INC COM STK USD0.0001	2 152.00	267 342.96	0.03
USD VMWARE INC COM STK USD0.01 CLASS 'A'	110.00	13 616.90	0.00
USD VORNADO REALTY TR COM USD0.04	150.00	10 752.00	0.00
USD VOYA FINL INC COM USD0.01	231.00	11 991.21	0.00
USD VULCAN MATERIALS COM STK USD1	162.00	21 934.80	0.00
USD WABCO HOLDINGS INC COM STK USD0.01	93.00	14 358.27	0.00
USD WABTEC CORP COM	59.00	4 781.36	0.00
USD WALGREENS BOOTS AL COM USD0.01	1 071.00	80 603.46	0.01
USD WALMART INC COM USD0.10	1 816.00	193 585.60	0.02
USD WALT DISNEY CO.DISNEY COM USD0.01	1 746.00	189 737.82	0.02
USD WASTE MGMT INC DEL COM	481.00	42 534.83	0.01
USD WATERS CORP COM	100.00	21 561.00	0.00
USD WEC ENERGY GROUP COM USD0.01	321.00	20 640.30	0.00
USD WELLS FARGO & CO COM USD1 2/3	5 582.00	367 183.96	0.04
USD WELLTOWER INC COM USD1	345.00	20 689.65	0.00
USD WESTAR ENERGY INC COM	300.00	15 498.00	0.00
USD WESTERN DIGITAL CORP COM	319.00	28 384.62	0.00
USD WESTERN UN CO COM	587.00	12 203.73	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD WESTROCK CO COM USD0.01	434.00	28 917.42	0.00
USD WEYERHAEUSER CO COM USD1.25	763.00	28 643.02	0.00
USD WHIRLPOOL CORP COM	100.00	18 142.00	0.00
USD WILLIAMS COS INC COM USD1	928.00	29 129.92	0.00
USD WORKDAY INC COM USD0.001	100.00	11 989.00	0.00
USD WORLDPAY INC COM USD0.00001 CL A	182.00	14 616.42	0.00
GBP WORLDPAY INC COM USD0.00001 CL A	289.97	23 297.72	0.00
USD WYNDHAM WORLDWIDE CORP COM	131.00	16 261.03	0.00
USD WYNN RESORTS LTD COM	100.00	16 559.00	0.00
USD XCEL ENERGY INC COM	506.00	23 093.84	0.00
USD XEROX CORP COM USD1(POST REV SPLT)	300.00	10 239.00	0.00
USD XILINX INC COM USD0.01	279.00	20 372.58	0.00
USD XYLEM INC COM USD0.01 WI	195.00	14 090.70	0.00
USD YUM BRANDS INC COM	385.00	32 567.15	0.00
USD ZAYO GROUP HOLDING COM USD0.001	199.00	7 303.30	0.00
USD ZILLOW GROUP INC COM USD0.0001 CLASS C WI	145.00	6 446.70	0.00
USD ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC COM USD0.01	227.00	28 856.24	0.00
USD ZOETIS INC COM USD0.01 CL 'A'	491.00	37 674.43	0.01
アメリカ合衆国合計		28 483 124.13	2.69
無記名株合計		45 877 387.65	4.32
参加証書			
スイス			
CHF LINDT & SPRUENGLI PTG CERT CHF10	3.00	18 814.54	0.00
CHF SCHINDLER-HLDG AG PTG CERT CHF0.10(POST-SUBD)	25.00	6 276.89	0.00
スイス合計		25 091.43	0.00
参加証書合計		25 091.43	0.00
その他の株式			
オランダ			
EUR UNILEVER NV CVA EURO.16	1 851.00	107 569.45	0.01
オランダ合計		107 569.45	0.01
スイス			
CHF ROCHE HLDGS AG GENUSSSCHEINE NPV	787.00	194 252.53	0.02
スイス合計		194 252.53	0.02
アメリカ合衆国			
USD CAMDEN PROP TST SBI USD0.01	93.00	8 050.08	0.00
アメリカ合衆国合計		8 050.08	0.00
その他の株式合計		309 872.06	0.03
優先株式			
ドイツ			
EUR FUCHS PETROLUB SE NON-VTG PRF NPV	284.00	15 566.89	0.00
EUR HENKEL AG&CO.KGAA NON-VTG PRF NPV	224.00	31 420.80	0.00
EUR PORSCHE AUTO HL SE NON VTG PRF NPV	195.00	18 073.34	0.00
EUR VOLKSWAGEN AG NON VTG PRF NPV	219.00	48 294.46	0.01
ドイツ合計		113 355.49	0.01
優先株式合計		113 355.49	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
記名株式			
フランス			
EUR LAGARDERE SCA EUR6.10 (REGD)	250.00	7 823.31	0.00
EUR MICHELIN (CGDE) EUR2	181.00	29 041.92	0.00
フランス合計		36 865.23	0.00
ドイツ			
EUR ADIDAS AG NPV (REGD)	233.00	54 365.65	0.01
EUR ALLIANZ SE NPV (REGD) (VINKULIERT)	541.00	137 148.98	0.01
EUR BASF SE NPV	1 021.00	119 966.62	0.01
EUR BAYER AG NPV (REGD)	997.00	130 932.98	0.01
EUR BRENTAG AG	202.00	13 140.72	0.00
EUR DAIMLER AG ORD NPV (REGD)	1 067.00	98 003.04	0.01
EUR DEUTSCHE BANK AG NPV (REGD)	2 407.00	44 360.11	0.01
EUR DEUTSCHE BOERSE AG NPV (REGD)	213.00	27 423.38	0.00
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA ORD NPV (REGD) (VINK)	233.00	8 342.07	0.00
EUR DEUTSCHE POST AG NPV (REGD)	1 143.00	54 207.58	0.01
EUR DEUTSCHE TELEKOM NPV (REGD)	4 132.00	72 707.58	0.01
EUR E.ON SE NPV	2 919.00	30 759.83	0.00
EUR EVONIK INDUSTRIES NPV	133.00	5 268.78	0.00
EUR HANNOVER RUECKVERS ORD NPV (REGD)	96.00	13 167.08	0.00
EUR INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)	1 278.00	37 270.32	0.01
EUR K&S AG NPV	133.00	3 747.79	0.00
EUR MUENCHENER RUECKVE NPV (REGD)	235.00	55 491.00	0.01
EUR OSRAM LICHT AG NPV	54.00	4 733.15	0.00
EUR PROSIEBENSATI MED. NPV	294.00	11 276.85	0.00
EUR SIEMENS AG NPV (REGD)	900.00	136 962.74	0.01
GBP TUI AG NPV (REGD)	372.00	8 427.01	0.00
EUR UNITED INTERNET AG NPV (REGD)	215.00	15 721.99	0.00
EUR VONOVIA SE NPV	309.00	15 285.84	0.00
ドイツ合計		1 098 711.09	0.11
日本			
JPY 浜松ホトニクス	500.00	18 459.99	0.00
日本合計		18 459.99	0.00
ルクセンブルグ			
EUR TENARIS S.A. USD1	961.00	16 790.26	0.00
ルクセンブルグ合計		16 790.26	0.00
ポルトガル			
EUR EDP ENERGIAS PORTU EUR1 (REGD)	2 139.00	7 538.32	0.00
ポルトガル合計		7 538.32	0.00
スペイン			
EUR BANCO SANTANDER SA EURO.50 (REGD)	18 558.00	138 318.75	0.01
EUR BANKINTER SA EURO.3 (REGD)	1 049.00	12 103.51	0.00
EUR BBVA (BILB-VIZ-ARG) EURO.49	7 957.00	75 017.30	0.01
EUR MAPFRE SA EURO.10	3 639.00	12 969.73	0.00
スペイン合計		238 409.29	0.02
スイス			
CHF ABB LTD CHF0.12 (REGD)	1 992.00	55 607.14	0.01
CHF ADECCO GROUP AG CHF0.1 (REGD)	117.00	9 640.92	0.00
CHF BALOISE-HLDGS CHF0.1 (REGD)	139.00	22 772.91	0.00
USD CHUBB LIMITED ORD CHF24.15	557.00	86 975.55	0.01
GBP COCA-COLA HBC AG ORD CHF6.70	303.00	10 194.65	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
CHF CREDIT SUISSE GRP CHF0.04(REGD)	2 827.00	54 618.03	0.01
CHF DUFREY AG CHF5 (REGD)	42.00	6 537.65	0.00
CHF EMS-CHEMIE HLDG AG CHF0.01(REGD) (POST RECON)	14.00	10 301.20	0.00
USD GARMIN LTD COM CHF10.00	100.00	6 294.00	0.00
CHF GEBERIT CHF0.10(REGD)	24.00	11 385.54	0.00
CHF GIVAUDAN AG CHF10	9.00	21 686.75	0.00
CHF JULIUS BAER GRUPPE CHF0.02 (REGD)	158.00	10 860.80	0.00
CHF KUEHNE&NAGEL INTL CHF1(REGD) (POST-SUBD)	57.00	10 479.02	0.00
CHF LAFARGEHOLCIM LTD CHF2 (REGD)	383.00	23 484.29	0.00
EUR LAFARGEHOLCIM LTD CHF2 (REGD)	321.00	19 742.36	0.00
CHF LONZA GROUP AG CHF1(REGD)	90.00	25 065.62	0.00
CHF NESTLE SA CHF0.10(REGD)	3 760.00	325 278.83	0.03
CHF NOVARTIS AG CHF0.50(REGD)	2 594.00	234 955.68	0.02
CHF PARTNERS GROUP HLG CHF0.01 (REGD)	35.00	27 240.21	0.00
CHF RICHEMONT(CIE FIN) CHF1.00 (REG) SER 'A'	625.00	60 052.71	0.01
CHF SCHINDLER-HLDG AG CHF0.1(REGD) (POST-SUBD)	89.00	21 694.71	0.00
CHF SGS LTD CHF1(REGD)	7.00	18 847.89	0.00
CHF SONOVA HOLDING AG	96.00	15 500.86	0.00
CHF SWATCH GROUP CHF0.45(REGD)	68.00	5 884.90	0.00
CHF SWISS LIFE HLDG CHF5.1(REGD)	41.00	15 414.69	0.00
CHF SWISS PRIME SITE CHF15.3 (REGD)	43.00	4 163.08	0.00
CHF SWISSCOM AG CHF1(REGD)	34.00	18 594.66	0.00
USD TE CONNECTIVITY LT COM CHF0.57	456.00	46 753.68	0.01
CHF UBS GROUP CHF0.10 (REGD)	4 321.00	87 851.66	0.01
CHF ZURICH INSURANCE GRP CHF0.10	162.00	53 308.73	0.02
スイス合計		1 321 188.72	0.13
記名株式合計		2 737 962.90	0.26
預託証券			
イスラエル			
USD TEVA PHARMA IND ADR(CNV 1 ORD ILS0.10)	1 074.00	21 920.34	0.00
イスラエル合計		21 920.34	0.00
ルクセンブルグ			
SEK MILLICOM INTL CELL SDR EACH REP 1 USD1.50	81.00	6 058.63	0.00
EUR SES S.A. FDR EACH REP 1 'A' NPV	317.00	4 963.93	0.00
ルクセンブルグ合計		11 022.56	0.00
オランダ			
EUR ABN AMRO GROUP NV DR EACH REP SHS	355.00	12 068.76	0.00
オランダ合計		12 068.76	0.00
イギリス			
USD BRITISH AMERN TOB PLC SPONSORED ADR	518.00	35 268.03	0.01
USD MICRO FOCUS INTL SPON ADR EACH REP 1 ORD SHS	263.00	7 953.12	0.00
イギリス合計		43 221.15	0.01
預託証券合計		88 232.81	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
投資ファンド、クローズド・エンド型			
シンガポール			
SGD CAPITALAND MALL TRUST	5 000.00	8 020.16	0.00
シンガポール合計		8 020.16	0.00
アメリカ合衆国			
USD LIBERTY PPTY TST SBI USD0.001	232.00	9 607.12	0.00
USD SL GREEN REALTY CORPORATION	92.00	9 247.84	0.00
アメリカ合衆国合計		18 854.96	0.00
投資ファンド、クローズド・エンド型合計		26 875.12	0.00
新株引受権			
スペイン			
EUR ACS ACTIVIDADES DE CONST Y SER SA RIGHTS 05.02.18	203.00	106.72	0.00
スペイン合計		106.72	0.00
新株引受権合計		106.72	0.00
固定利付ノート			
米ドル			
USD ALPHABET INC 1.99800% 16-15.08.26	2 315 000.00	2 130 212.07	0.20
USD ANHEUSER-BUSCH INBEV FINANCE INC 3.65000% 16-01.02.26	1 725 000.00	1 745 762.10	0.17
USD APPLE INC 2.40000% 13-03.05.23	2 100 000.00	2 043 027.00	0.19
USD APPLE INC 2.90000% 17-12.09.27	3 375 000.00	3 258 113.62	0.31
USD APPLE INC 3.00000% 17-09.02.24	1 525 000.00	1 519 795.18	0.14
USD APPLE INC 3.25000% 16-23.02.26	525 000.00	524 260.80	0.05
USD APPLE INC 3.45000% 14-06.05.24	2 710 000.00	2 763 720.33	0.26
USD BERKSHIRE HATHAWAY INC 2.75000% 16-15.03.23	1 800 000.00	1 790 211.60	0.17
USD BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 2.00000% 12-23.10.22	2 400 000.00	2 317 884.00	0.22
USD CHEVRON CORP 2.89500% 17-03.03.24	1 150 000.00	1 139 686.80	0.11
USD CHEVRON CORP 3.19100% 13-24.06.23	1 550 000.00	1 567 899.40	0.15
USD CONOCOPHILLIPS CO 3.35000% 14-15.11.24	600 000.00	610 649.40	0.06
USD CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 4.37500% 12-15.06.22	725 000.00	766 651.25	0.07
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.00000% 16-15.03.21	2 100 000.00	2 070 169.50	0.20
USD EXXON MOBIL CORP 2.72600% 16-01.03.23	1 925 000.00	1 913 097.73	0.18
USD FREDDIE MAC 6.25000% 02-15.07.32	850 000.00	1 158 305.20	0.11
USD INTEL CORP 2.87500% 17-11.05.24	700 000.00	693 921.90	0.07
USD JOHNSON & JOHNSON 3.37500% 13-05.12.23	1 675 000.00	1 725 243.30	0.16
USD KOREA RESOURCES CORP-REG-S 3.00000% 17-24.04.22	1 200 000.00	1 177 095.48	0.11
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.12500% 13-17.01.23	3 500 000.00	3 407 313.00	0.32
USD KUWAIT INTERNATIONAL GOVT BOND-REG-S 3.50000% 17-20.03.27	2 800 000.00	2 786 000.00	0.26
USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 2.00000% 15-13.01.25	1 600 000.00	1 515 988.81	0.14
USD MICROSOFT CORP 2.65000% 15-03.11.22	2 375 000.00	2 364 191.38	0.22
USD MICROSOFT CORP 2.87500% 17-06.02.24	975 000.00	968 693.70	0.09
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 2.40000% 12-21.09.22	2 300 000.00	2 265 274.60	0.21
USD ORACLE CORP 2.65000% 16-15.07.26	1 250 000.00	1 188 593.75	0.11
USD PROCTER & GAMBLE CO 1.85000% 16-02.02.21	375 000.00	367 397.62	0.03
USD QATAR, STATE OF-REG-S 2.37500% 16-02.06.21	2 000 000.00	1 945 000.00	0.18
USD TEXAS INSTRUMENTS INC 1.85000% 16-15.05.22	575 000.00	555 501.18	0.05
USD TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.70000% 13-15.01.24	2 225 000.00	2 309 494.37	0.22
USD VISA INC 2.75000% 17-15.09.27	435 000.00	418 978.52	0.04
USD WAL-MART STORES INC 2.55000% 13-11.04.23	1 775 000.00	1 754 521.82	0.17
USD WELLS FARGO CO 3.50000% 12-08.03.22	2 650 000.00	2 699 777.60	0.26
米ドル合計		55 462 433.01	5.23
固定利付ノート合計		55 462 433.01	5.23

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
固定利付メディアム・ターム・ノート			
米ドル			
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.00000% 15-22.01.25	2 175 000.00	2 068 983.98	0.20
USD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GRP/NY 2.30000% 16-01.06.21	1 700 000.00	1 670 284.00	0.16
USD BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN NV-REG-S 2.50000% 13-23.01.23	1 050 000.00	1 034 145.00	0.10
USD BANK OF AMERICA CORP 3.24800% 16-21.10.27	1 125 000.00	1 099 017.00	0.10
USD CAISSE D' AMOR DE LA DETTE SOCIALE-REG-S 3.37500% 14-20.03.24	1 775 000.00	1 823 013.75	0.17
USD HENKEL AG & CO KGAA-REG-S 1.50000% 16-13.09.19	780 000.00	770 491.80	0.07
USD MDC-GMTN B.V-REG-S 3.00000% 17-19.04.24	2 100 000.00	2 044 875.00	0.19
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 2.37500% 17-18.01.22	2 300 000.00	2 269 640.00	0.21
USD NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CORP-REG-S 2.60000% 17-28.09.22	1 075 000.00	1 050 476.03	0.10
USD SP POWERASSETS LTD-REG-S 3.25000% 15-24.11.25	1 550 000.00	1 549 349.00	0.15
USD TORONTO-DOMINION BANK 2.50000% 15-14.12.20	1 170 000.00	1 166 203.35	0.11
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 2.60000% 17-11.01.22	2 000 000.00	1 987 374.00	0.19
米ドル合計		18 533 852.91	1.75
固定利付メディアム・ターム・ノート合計		18 533 852.91	1.75
固定利付債券			
米ドル			
USD AFRICAN DEVELOPMENT BANK 7.37500% 93-06.04.23	1 800 000.00	2 164 806.00	0.20
USD BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN NV-REG-S 2.62500% 14-28.04.21	3 500 000.00	3 502 415.00	0.33
USD BANK OF NOVA SCOTIA 1.85000% 15-14.04.20	2 550 000.00	2 513 858.85	0.24
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 3.25000% 14-29.01.24	3 250 000.00	3 332 657.25	0.31
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.87500% 15-10.02.25	3 000 000.00	2 819 592.00	0.26
USD ING BANK NV-REG-S 2.62500% 12-05.12.22	1 650 000.00	1 624 862.25	0.15
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 3.87500% 10-14.02.20	1 350 000.00	1 391 697.45	0.13
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 3.00000% 14-21.02.24	3 325 000.00	3 367 902.48	0.32
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT 2.50000% 15-29.07.25	3 750 000.00	3 669 150.00	0.34
USD ITALY, REPUBLIC OF 6.87500% 93-27.09.23	475 000.00	558 647.50	0.05
USD KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 3.25000% 14-10.07.24	4 175 000.00	4 116 728.69	0.39
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.50000% 14-20.11.24	2 775 000.00	2 716 794.38	0.26
USD MICROSOFT CORP 2.40000% 16-08.08.26	2 775 000.00	2 611 713.45	0.25
USD MORGAN STANLEY 5.50000% 10-24.07.20	1 550 000.00	1 652 083.00	0.16
USD ONTARIO, PROVINCE OF 3.20000% 14-16.05.24	2 100 000.00	2 124 185.70	0.20
USD ONTARIO, PROVINCE OF 2.40000% 17-08.02.22	1 800 000.00	1 774 589.40	0.17
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 3.75000% 15-15.07.25	500 000.00	516 344.50	0.05
米ドル合計		40 458 027.90	3.81
固定利付債券合計		40 458 027.90	3.81
固定利付米国中期国債			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 6.25000% 99-15.05.30	2 300 000.00	3 140 399.30	0.30
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 15-31.01.22	1 250 000.00	1 205 273.75	0.11
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.87500% 15-15.10.18	14 250 000.00	14 157 047.25	1.33
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.62500% 10-15.11.20	20 625 000.00	20 810 295.00	1.96
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 11-31.08.18	6 000 000.00	5 991 798.00	0.56
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.12500% 16-31.07.21	13 500 000.00	12 930 462.00	1.22
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 17-15.02.27	5 250 000.00	5 052 101.25	0.48
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.50000% 13-15.08.23	9 000 000.00	8 966 952.00	0.85
米ドル合計		72 254 328.55	6.81
固定利付米国中期国債合計		72 254 328.55	6.81

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
変動利付米国中期国債			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.375%/CPI LINKED 04-15.01.25	2 600 000.00	3 829 205.12	0.36
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.125%/CPI LINKED 11-15.01.21	2 595 000.00	2 996 285.02	0.28
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 12-15.01.22	1 655 000.00	1 784 715.84	0.17
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI LINKED 17-15.01.27	3 000 000.00	3 001 485.60	0.28
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.625%/CPI LINKED 14-15.01.24	2 200 000.00	2 343 198.70	0.22
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 14-15.04.19	2 215 000.00	2 329 916.41	0.22
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.250%/CPI LINKED 15-15.01.25	2 200 000.00	2 244 861.20	0.21
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 15-15.04.20	6 300 000.00	6 606 707.70	0.62
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.625%/CPI LINKED 16-15.01.26	6 350 000.00	6 611 277.87	0.62
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 12-15.07.22	1 885 000.00	2 002 560.86	0.19
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 13-15.01.23	1 900 000.00	1 997 897.28	0.19
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI INDEX 13-15.04.18	1 435 000.00	1 533 546.56	0.15
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI INDEX 13-15.07.23	2 200 000.00	2 327 170.26	0.22
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI LINKED 15-15.07.25	2 600 000.00	2 676 286.06	0.25
米ドル合計		42 285 114.48	3.98
変動利付米国中期国債合計		42 285 114.48	3.98
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券 および短期金融商品合計		278 172 641.03	26.21
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
固定利付ノート			
米ドル			
USD CHEVRON CORP 1.71800% 13-24.06.18	600 000.00	599 736.00	0.06
USD GENERAL ELECTRIC CO 2.70000% 12-09.10.22	5 125 000.00	5 028 814.00	0.47
USD HSBC HOLDINGS PLC 4.87500% 11-14.01.22	1 150 000.00	1 224 353.25	0.11
USD SCENTRE GROUP TRUST 1 / 2-REG-S 3.75000% 17-23.03.27	400 000.00	398 000.00	0.04
米ドル合計		7 250 903.25	0.68
固定利付ノート合計		7 250 903.25	0.68
固定利付メディアム・ターム・ノート			
米ドル			
USD FREDDIE MAC 2.37500% 12-13.01.22	2 600 000.00	2 594 358.00	0.24
米ドル合計		2 594 358.00	0.24
固定利付メディアム・ターム・ノート合計		2 594 358.00	0.24
固定利付米国中期国債			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.62500% 14-31.08.19	22 100 000.00	21 942 891.10	2.07
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 12-15.05.22	29 600 000.00	28 740 919.20	2.71
米ドル合計		50 683 810.30	4.78
固定利付米国中期国債合計		50 683 810.30	4.78
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券 および短期金融商品合計		60 529 071.55	5.70

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 割合 (%)
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されていない 譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
無記名株			
カナダ			
CAD TELUS CORPORATION COM NPV	419.00	15 766.51	0.00
カナダ合計		15 766.51	0.00
無記名株合計			
		15 766.51	0.00
新株引受権			
イタリア			
EUR UNICREDIT SPA RIGHTS 21.02.18	2 306.00	11.47	0.00
イタリア合計		11.47	0.00
新株引受権合計			
		11.47	0.00
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されていない 譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計			
		15 777.98	0.00
2010年12月17日のルクセンブルグ投信法第41条(1) e) に準拠した投資信託/その他の投資信託			
投資ファンド、オープン・エンド型			
アイルランド			
USD UBS (IRL) INVESTOR SELECTION PLC - GLOB EMER MKT OPP-I-X USD	38 357.00	10 002 354.89	0.94
アイルランド合計		10 002 354.89	0.94
ルクセンブルグ			
USD UBS (LUX) BD SICAV - EMER ECO LOC CUR BD U-X-ACC	1 542.00	16 266 372.96	1.53
USD UBS (LUX) BOND SICAV-SHORT TERM USD CORPORATES (USD) U-X-ACC	7 030.00	71 320 896.60	6.72
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD CORPORATES U-X-ACC	5 281.00	55 878 155.38	5.27
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD U-X-ACC	1 763.00	31 615 350.10	2.98
USD UBS (LUX) BOND SICAV - EMERGING ECONOMIES CORP (USD)-I-X-DIS	194 934.00	20 875 482.06	1.97
USD UBS (LUX) BOND SICAV USD INVEST GRADE CORP USD U X ACC	16 377.00	169 729 754.07	15.99
USD UBS (LUX) EMERGING ECONOMIES FUND-GLOBAL BONDS (USD)-U-X ACC	2 461.00	31 423 106.23	2.96
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - USA GRWTH (USD)-U-X-ACC	182.00	6 383 615.42	0.60
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - GLB EM OPP (USD)-U-X-ACC	215.00	6 822 629.40	0.64
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - USA ENHANCED (USD) U-X-ACC	1 112.00	25 163 625.92	2.37
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV-GLOBAL QUANTITATIVE (USD) U-X-ACC	7 721.00	120 783 926.76	11.38
USD UBS (LUX) INST FUND-KEY SEL. GLOBAL EQUITY FA-USD	3 811.00	91 160 796.84	8.59
USD UBS (LUX) INST SICAV - EMERG. MARKETS EQUITY PASSIVE XA USD	15 548.00	2 153 398.00	0.20
USD UBS (LUX) INSTITUTIONAL SICAV - E MARKETS EQUITY PASS FA USD	1 852.00	27 572 020.40	2.60
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD U-X-ACC	1 755.00	18 611 704.80	1.76
ルクセンブルグ合計		695 760 834.94	65.56
投資ファンド、オープン・エンド型合計			
		705 763 189.83	66.50
2010年12月17日のルクセンブルグ投信法第41条(1) e) に準拠した 投資信託/その他の投資信託合計			
		705 763 189.83	66.50
投資有価証券合計			
		1 044 480 680.39	98.41

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)			
派生商品						
公認の証券取引所に上場されている派生商品						
指数に係る金融先物						
CHF	SWISS MARKET INDEX FUTURE 16.03.18	105.00	20 752.97	0.00		
EUR	EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 16.03.18	974.00	187 228.64	0.02		
GBP	FTSE 100 INDEX FUTURE 16.03.18	225.00	388 701.40	0.04		
CAD	S&P/TSX 60 INDEX FUTURE 15.03.18	-55.00	59 877.23	0.00		
USD	S&P500 EMINI FUTURE 16.03.18	33.00	46 895.00	0.00		
JPY	NIKKEI 225 (OSE) INDEX FUTURE 08.03.18	-87.00	-325 444.18	-0.03		
AUD	SPI 200 INDEX FUTURE 15.03.18	-133.00	-25 446.90	0.00		
HKD	HANG SENG INDEX FUTURE 27.02.18	-10.00	-3 190.67	0.00		
指数に係る金融先物合計			349 373.49	0.03		
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計			349 373.49	0.03		
派生商品合計			349 373.49	0.03		
先渡為替契約						
先渡為替契約（購入／売却）						
USD	1 914 195.00	AUD	2 500 000.00	23.3.2018	-109 921.40	-0.01
INR	127 300 000.00	USD	1 964 309.13	23.3.2018	26 010.02	0.00
RUB	116 800 000.00	USD	1 970 726.74	23.3.2018	92 406.04	0.01
USD	1 980 562.87	NOK	16 500 000.00	23.3.2018	-172 201.00	-0.02
USD	1 998 953.02	TWD	59 500 000.00	23.3.2018	-52 022.73	-0.01
RUB	116 800 000.00	USD	1 971 059.28	23.3.2018	92 073.50	0.01
USD	2 000 628.60	HUF	529 600 000.00	23.3.2018	-134 224.20	-0.01
USD	1 979 217.49	NOK	16 500 000.00	23.3.2018	-173 546.38	-0.02
USD	1 914 447.50	AUD	2 500 000.00	23.3.2018	-109 668.90	-0.01
INR	127 300 000.00	USD	1 966 050.49	23.3.2018	24 268.66	0.00
USD	1 999 470.69	HUF	529 600 000.00	23.3.2018	-135 382.11	-0.01
USD	1 998 801.87	TWD	59 500 000.00	23.3.2018	-52 173.88	0.00
BRL	6 600 000.00	USD	1 991 225.34	23.3.2018	81 938.39	0.01
BRL	6 600 000.00	USD	1 993 288.05	23.3.2018	79 875.68	0.01
TRY	7 700 000.00	USD	1 954 202.63	23.3.2018	68 618.30	0.01
TRY	7 700 000.00	USD	1 950 964.90	23.3.2018	71 856.03	0.01
USD	13 574 035.53	JPY	1 511 681 968.00	22.2.2018	-289 668.02	-0.03
SEK	76 988 797.96	USD	9 415 360.22	22.2.2018	399 406.68	0.04
USD	760 698.17	SGD	1 014 000.00	22.2.2018	-14 123.86	0.00
USD	1 076 199.77	DKK	6 680 000.00	22.2.2018	-43 440.02	0.00
USD	1 442 567.55	AUD	1 842 183.12	22.2.2018	-48 998.12	0.00
USD	10 970 287.20	NOK	88 373 858.22	22.2.2018	-549 183.59	-0.05
USD	2 292 471.23	HKD	17 920 000.00	22.2.2018	238.47	0.00
USD	8 260 559.00	GBP	6 100 000.00	22.2.2018	-420 341.10	-0.04
CAD	3 170 918.20	USD	2 548 041.75	22.2.2018	37 161.68	0.00
USD	2 732 522.09	CHF	2 662 965.74	22.2.2018	-136 396.48	-0.01
USD	15 723 840.35	EUR	13 078 612.50	22.2.2018	-589 355.56	-0.06
USD	64 038.19	HKD	500 000.00	12.4.2018	6.95	0.00
USD	51 172.92	HKD	400 000.00	22.2.2018	7.01	0.00
USD	2 314 725.00	HKD	18 077 000.00	12.4.2018	-260.42	0.00
USD	234 463.40	SGD	310 000.00	12.4.2018	-2 678.68	0.00
USD	11 483 421.46	GBP	8 330 000.00	12.4.2018	-394 220.57	-0.04
USD	2 583 707.72	AUD	3 254 921.33	12.4.2018	-51 617.46	-0.01
USD	13 726 625.52	JPY	1 512 683 741.00	12.4.2018	-188 069.27	-0.02

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
先渡為替契約（続き）			
先渡為替契約（購入／売却）			
CAD	484 397.45 USD	389 646.05	12.4.2018 5 512.17 0.00
USD	11 240 015.59 NOK	88 514 010.04	12.4.2018 -316 114.67 -0.03
USD	3 794 716.18 CHF	3 642 931.32	12.4.2018 -145 369.97 -0.01
SEK	77 159 077.33 USD	9 640 475.36	12.4.2018 229 604.18 0.02
USD	18 652 060.72 EUR	15 205 393.38	12.4.2018 -376 735.17 -0.04
USD	1 051 417.79 DKK	6 380 000.00	12.4.2018 -21 687.06 0.00
JPY	8 172 598 900.00 USD	73 552 603.09	22.2.2018 1 398 670.24 0.13
GBP	14 524 600.00 USD	20 127 435.40	22.2.2018 542 499.28 0.05
GBP	400 000.00 USD	555 703.20	22.2.2018 13 536.15 0.00
EUR	300 000.00 USD	367 733.40	22.2.2018 6 462.16 0.00
GBP	300 000.00 USD	417 572.40	12.4.2018 10 193.82 0.00
EUR	110 000.00 USD	135 283.72	12.4.2018 2 375.83 0.00
CAD	3 200 000.00 USD	2 571 966.85	22.2.2018 36 946.55 0.00
SEK	42 200 000.00 USD	5 272 911.92	22.2.2018 106 872.86 0.01
SEK	42 200 000.00 USD	5 270 308.11	22.2.2018 109 476.67 0.01
USD	5 234 493.86 NOK	41 100 000.00	22.2.2018 -122 862.48 -0.01
USD	5 235 893.57 NOK	41 100 000.00	22.2.2018 -121 462.77 -0.01
USD	1 882 482.95 NOK	14 800 000.00	23.3.2018 -48 481.01 0.00
TRY	7 200 000.00 USD	1 859 060.50	23.3.2018 32 408.42 0.00
RUB	106 900 000.00 USD	1 875 856.95	23.3.2018 12 404.13 0.00
USD	1 882 482.95 NOK	14 800 000.00	23.3.2018 -48 481.01 0.00
USD	1 888 145.62 HUF	476 000 000.00	23.3.2018 -30 642.02 0.00
USD	1 837 626.40 AUD	2 300 000.00	23.3.2018 -24 560.68 0.00
TRY	7 200 000.00 USD	1 860 421.37	23.3.2018 31 047.55 0.00
CAD	3 200 000.00 USD	2 573 971.51	22.2.2018 34 941.89 0.00
CAD	3 100 000.00 USD	2 495 112.40	12.4.2018 33 783.00 0.00
RUB	106 900 000.00 USD	1 876 022.73	23.3.2018 12 238.35 0.00
USD	1 837 626.40 AUD	2 300 000.00	23.3.2018 -24 560.68 0.00
CAD	3 100 000.00 USD	2 493 167.92	12.4.2018 35 727.48 0.00
SEK	42 100 000.00 USD	5 275 966.24	12.4.2018 109 405.94 0.01
USD	1 891 082.40 HUF	476 000 000.00	23.3.2018 -27 705.24 0.00
SEK	42 100 000.00 USD	5 278 581.19	12.4.2018 106 790.99 0.01
USD	5 243 501.31 NOK	41 100 000.00	12.4.2018 -122 394.48 -0.01
USD	5 242 098.87 NOK	41 100 000.00	12.4.2018 -123 796.92 -0.01
USD	239 988.60 AUD	300 000.00	22.2.2018 -2 913.26 0.00
USD	319 942.40 AUD	400 000.00	12.4.2018 -3 914.91 0.00
USD	1 916 957.67 TWD	55 800 000.00	23.3.2018 -6 478.41 0.00
AUD	5 000.00 USD	3 997.95	12.4.2018 50.27 0.00
INR	120 700 000.00 USD	1 881 436.75	23.3.2018 5 692.25 0.00
INR	120 700 000.00 USD	1 883 927.00	23.3.2018 3 202.00 0.00
USD	1 916 925.86 TWD	55 800 000.00	23.3.2018 -6 510.22 0.00
USD	799 426.55 EUR	650 000.00	12.4.2018 -14 016.22 0.00
GBP	500 000.00 USD	695 700.50	22.2.2018 15 848.69 0.00
USD	735 509.40 EUR	600 000.00	22.2.2018 -12 881.73 0.00
USD	909 923.44 SEK	7 300 000.00	22.2.2018 -20 702.84 0.00
USD	925 509.38 SEK	7 400 000.00	12.4.2018 -21 088.11 0.00
GBP	420 000.00 USD	585 512.34	12.4.2018 13 360.37 0.00
BRL	6 100 000.00 USD	1 889 820.38	23.3.2018 26 285.49 0.00
BRL	6 100 000.00 USD	1 886 848.48	23.3.2018 29 257.39 0.00
USD	550 164.96 JPY	60 000 000.00	12.4.2018 -1 755.88 0.00
USD	548 510.25 JPY	60 000 000.00	22.2.2018 -1 752.46 0.00
USD	428 502.30 GBP	300 000.00	22.2.2018 1 572.79 0.00
USD	686 903.52 GBP	480 000.00	12.4.2018 2 477.57 0.00
USD	115 274.27 HKD	900 000.00	12.4.2018 18.04 0.00
USD	115 155.19 HKD	900 000.00	22.2.2018 31.89 0.00
先渡為替契約（購入／売却）合計			-1 371 800.13 -0.13
銀行預金、要求払預金および貯蓄預金ならびにその他の流動資産			15 685 420.19 1.48
その他の資産および負債			2 195 049.17 0.21
純資産合計			1 061 338 723.11 100.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・ファンド・グロース (米ドル)

3年度の比較

	ISIN	2018年1月31日	2017年1月31日	2016年1月31日
純資産額 (米ドル)		161,875,887.93	130,620,895.23	124,535,278.13
クラスF-a-c-c	LU1317082466			
発行済受益証券口数		27,913.8710	23,639.6900	240.2770
1口当たり純資産価格 (米ドル)		137.38	115.56	100.74
1口当たり発行および買戻価格 (米ドル) ¹		137.59	115.56	100.74
クラスP-a-c-c	LU0033040865			
発行済受益証券口数		34,965.3060	35,336.3490	40,872.1420
1口当たり純資産価格 (米ドル)		3,978.13	3,383.29	2,986.89
1口当たり発行および買戻価格 (米ドル) ¹		3,984.10	3,383.29	2,986.89
クラス (日本円・ヘッジ) P-a-c-c ²	LU1410364837			
発行済受益証券口数		76,453.5120	17,768.1530	—
1口当たり純資産価格 (円)		12,426	10,727	—
1口当たり発行および買戻価格 (円) ¹		12,445	10,727	—
クラスQ-a-c-c	LU0941351685			
発行済受益証券口数		73,391.7800	56,397.2490	23,548.2680
1口当たり純資産価格 (米ドル)		139.54	117.79	103.21
1口当たり発行および買戻価格 (米ドル) ¹		139.75	117.79	103.21

¹ 注記1を参照のこと。

² 初回純資産価格計算日：2016年6月7日

パフォーマンス

	通貨	2017年/2018年	2016年/2017年	2015年/2016年
クラスF-a-c-c	米ドル	19.1%	14.7%	—
クラスP-a-c-c	米ドル	17.8%	13.3%	-5.9%
クラス (日本円・ヘッジ) P-a-c-c	日本円	16.0%	—	—
クラスQ-a-c-c	米ドル	18.6%	14.1%	-5.1%

過去の実績は、現在または将来のパフォーマンスの指標にはならない。

実績データは、受益証券の発行および買戻しの時に請求される手数料および費用を考慮していない。

実績データは、監査の対象ではなかった。

本サブ・ファンドはベンチマークを有していない。

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・ファンド・グロース (米ドル)

投資有価証券の構成

通貨別分類 (対純資産割合 (%))

米ドル	90.11
ユーロ	2.63
日本円	1.95
英ポンド	1.35
カナダ・ドル	0.72
スイス・フラン	0.65
豪ドル	0.55
スウェーデン・クローネ	0.23
香港ドル	0.22
デンマーク・クローネ	0.15
シンガポール・ドル	0.08
ノルウェー・クローネ	0.06
イスラエル・シケル	0.02
ニュージーランド・ドル	0.01
合計	<u>98.73</u>

商品別分類 (対純資産割合 (%))

投資信託、オープン・エンド型	67.31
無記名株	20.09
固定利付米国中期国債	3.65
変動利付米国中期国債	1.86
固定利付ノート	1.53
米国短期国債、ゼロ・クーポン	1.54
記名株式	1.21
固定利付債券	0.90
固定利付ミディアム・ターム・ノート	0.38
その他の株式	0.15
預託証券	0.05
優先株式	0.04
投資信託、クローズド・エンド型	0.01
参加証券	0.01
合計	<u>98.73</u>

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・ファンド・グロース (米ドル)

純資産計算書

	米ドル	千円
	2018年1月31日現在	
資産		
投資有価証券、取得原価	126,822,932.53	13,785,653
投資有価証券、未実現評価(損)益	32,996,165.31	3,586,683
投資有価証券合計(注1)	159,819,097.84	17,372,336
現金預金、要求払預金および貯蓄預金	1,882,553.39	204,634
その他の流動資産(委託証拠金)	1,113,048.04	120,988
発行受益証券未収金	20,908.75	2,273
有価証券に係る未収利息	57,940.01	6,298
流動資産に係る未収利息	16.37	2
未収分配金	23,425.02	2,546
その他の未収金	2,115.08	230
金融先物に係る未実現(損)益(注1)	170,859.85	18,572
先渡為替契約に係る未実現(損)益(注1)	(912,724.61)	(99,213)
資産合計	162,177,239.74	17,628,666
負債		
買戻受益証券未払金	(171,049.53)	(18,593)
報酬引当金(注2)	(123,184.54)	(13,390)
年次税引当金(注3)	(2,394.12)	(260)
その他の手数料および報酬引当金(注2)	(4,723.62)	(513)
引当金合計	(130,302.28)	(14,164)
負債合計	(301,351.81)	(32,757)
期末現在純資産額	161,875,887.93	17,595,909

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・ファンド・グロース (米ドル)

運用計算書

	米ドル	千円
	自2017年2月1日	至2018年1月31日
収益		
流動資産に係る利息	10,444.72	1,135
有価証券に係る利息	232,103.20	25,230
分配金	468,185.76	50,892
スワップに係る受取利息 (注1)	37,001.68	4,022
貸付有価証券に係る収益 (注12)	31,980.17	3,476
その他の収益 (注4)	47,192.82	5,130
収益合計	826,908.35	89,885
費用		
スワップに係る支払利息 (注1)	(2,145.50)	(233)
報酬 (注2)	(2,611,255.00)	(283,843)
年次税 (注3)	(26,782.98)	(2,911)
貸付有価証券に係るコスト (注12)	(12,792.07)	(1,390)
その他の手数料および報酬 (注2)	(21,522.43)	(2,339)
現金および当座借越に係る利息	(8,224.20)	(894)
費用合計	(2,682,722.18)	(291,612)
投資に係る純 (損) 益	(1,855,813.83)	(201,727)
実現 (損) 益 (注1)		
オプション無し時価評価有価証券に係る 実現 (損) 益	9,814,050.07	1,066,787
利回り評価有価証券および短期金融商品に係る 実現 (損) 益	12,388.87	1,347
金融先物に係る実現 (損) 益	(13,187.65)	(1,433)
先渡為替契約に係る実現 (損) 益	(1,506,284.16)	(163,733)
スワップに係る実現 (損) 益	90,372.79	9,824
外国為替に係る実現 (損) 益	20,024.76	2,177
実現 (損) 益合計	8,417,364.68	914,968
当期実現純 (損) 益	6,561,550.85	713,241
未実現評価 (損) 益の変動 (注1)		
オプション無し時価評価有価証券に係る 未実現評価 (損) 益	18,414,134.14	2,001,616
利回り評価有価証券および短期金融商品に係る 未実現評価 (損) 益	5,263.47	572
金融先物に係る未実現評価 (損) 益	137,723.38	14,971
先渡為替契約に係る未実現評価 (損) 益	(438,834.84)	(47,701)
スワップに係る未実現評価 (損) 益	(82,721.67)	(8,992)
未実現評価 (損) 益の変動合計	18,035,564.48	1,960,466
運用の結果による純資産の純増 (減)	24,597,115.33	2,673,706

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・ファンド・グロース (米ドル)

純資産変動計算書

	米ドル	千円
	自2017年2月1日 至2018年1月31日	
期首現在純資産額	130,620,895.23	14,198,491
受益証券発行	38,361,182.04	4,169,860
受益証券買戻し	(31,703,304.67)	(3,446,149)
受益証券発行(買戻し)純額合計	6,657,877.37	723,711
純投資(損)益	(1,855,813.83)	(201,727)
実現(損)益合計	8,417,364.68	914,968
未実現評価(損)益の変動合計	18,035,564.48	1,960,466
運用の結果による純資産の純増(減)	24,597,115.33	2,673,706
期末現在純資産額	161,875,887.93	17,595,909

発行済受益証券口数の変動

	自2017年2月1日 至2018年1月31日	
クラス		F - a c c
期首現在発行済受益証券口数		23,639.6900
発行受益証券口数		4,274.1810
買戻受益証券口数		0.0000
期末現在発行済受益証券口数		27,913.8710
クラス		P - a c c
期首現在発行済受益証券口数		35,336.3490
発行受益証券口数		7,799.1390
買戻受益証券口数		(8,170.1820)
期末現在発行済受益証券口数		34,965.3060
クラス	(日本円・ヘッジ)	P - a c c
期首現在発行済受益証券口数		17,768.1530
発行受益証券口数		59,913.5120
買戻受益証券口数		(1,228.1530)
期末現在発行済受益証券口数		76,453.5120
クラス		Q - a c c
期首現在発行済受益証券口数		56,397.2490
発行受益証券口数		29,072.5800
買戻受益証券口数		(12,078.0490)
期末現在発行済受益証券口数		73,391.7800

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・ファンドーグロース (米ドル)

2018年1月31日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 割合 (%)
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
無記名株			
アルゼンチン			
USD MERCADOLIBRE INC COM STK USD0.001	31.00	12 000.10	0.01
アルゼンチン合計		12 000.10	0.01
オーストラリア			
AUD AGL ENERGY NPV	424.00	8 047.75	0.01
AUD AMCOR LIMITED NPV	1 173.00	13 829.62	0.01
AUD AMP LIMITED NPV (POST RECON)	807.00	3 430.71	0.00
AUD APA GROUP NPV	1 080.00	7 048.71	0.00
AUD ARISTOCRAT LEISURE NPV	314.00	6 076.85	0.00
AUD ASX LTD NPV	153.00	6 781.83	0.00
AUD AUST & NZ BANK GRP NPV	2 636.00	61 004.04	0.04
AUD BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD NPV	427.00	4 048.89	0.00
AUD BHP BILLITON LTD NPV	2 891.00	70 697.81	0.04
AUD BK OF QUEENSLAND NPV	648.00	6 501.26	0.00
AUD BLUESCOPE STEEL NPV	903.00	10 602.46	0.01
AUD BORAL LIMITED NPV	1 660.00	10 753.48	0.01
AUD BRAMBLES LTD NPV	1 289.00	10 333.30	0.01
AUD CALTEX AUSTRALIA NPV	211.00	5 940.71	0.00
AUD CHALLENGER LIMITED NPV	1 099.00	12 138.44	0.01
AUD CIMIC GROUP LTD NPV	94.00	3 588.13	0.00
AUD CMNWLTH BK OF AUST NPV	1 527.00	97 521.83	0.06
AUD COCA-COLA AMATIL NPV	396.00	2 687.14	0.00
AUD COCHLEAR LTD NPV	96.00	13 504.30	0.01
AUD COMPUTERSHARE LTD NPV (POST REC)	413.00	5 584.93	0.00
AUD CROWN RESORTS LTD NPV	368.00	3 948.34	0.00
AUD CSL NPV	431.00	51 100.91	0.03
AUD DEXUS NPV (STAPLED)	1 308.00	10 093.73	0.01
AUD FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD NPV	67.00	2 768.54	0.00
AUD FORTESCUE METALS G NPV	916.00	3 678.99	0.00
AUD GOODMAN GROUP (STAPLED SECURITY)	1 456.00	9 538.08	0.01
AUD INCITEC PIVOT NPV	1 297.00	3 917.42	0.00
AUD INSURANCE AUST GRP NPV	1 873.00	10 980.63	0.01
AUD LEND LEASE GROUP NPV	435.00	5 579.50	0.00
AUD MACQUARIE GP LTD NPV	353.00	29 478.86	0.02
AUD NATL AUSTRALIA BK NPV	2 438.00	57 507.59	0.04
AUD NEWCREST MINING NPV	444.00	8 150.52	0.02
AUD ORICA LIMITED NPV	256.00	3 980.08	0.00
AUD ORIGIN ENERGY NPV	1 036.00	7 835.34	0.00
AUD QBE INS GROUP NPV	773.00	6 747.60	0.00
AUD RAMSAY HEALTH CARE NPV	107.00	5 922.07	0.00
AUD REA GROUP LIMITED NPV	54.00	3 220.46	0.00
AUD RIO TINTO LIMITED NPV	389.00	24 207.19	0.02
AUD SANTOS LIMITED NPV	934.00	3 857.16	0.00
AUD SCENTRE GROUP NPV STAPLED UNIT	3 990.00	13 408.25	0.01
AUD SEEK LIMITED NPV	272.00	4 305.93	0.00
AUD SONIC HEALTHCARE NPV	283.00	5 465.45	0.00
AUD SOUTH32 LTD NPV	2 095.00	6 480.35	0.00
GBP SOUTH32 LTD NPV	1 100.00	3 413.20	0.00
AUD SUNCORP GROUP	943.00	10 430.70	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 割合 （%）
AUD SYDNEY AIRPORT NPV (STAPLED SECURITY)	1 635.00	9 016.04	0.01
AUD TELSTRA CORP NPV	2 795.00	8 306.13	0.01
AUD TRANSURBAN GROUP STAPLED UNITS NPV	2 383.00	23 194.20	0.01
AUD TREASURY WINE ESTA NPV	422.00	5 850.15	0.00
AUD WESFARMERS LTD NPV	1 077.00	38 206.73	0.02
AUD WESTFIELD CORP NPV STAPLED UNITS	1 240.00	9 177.38	0.01
AUD WESTPAC BKG CORP NPV	2 993.00	75 034.09	0.05
AUD WOODSIDE PETROLEUM NPV	950.00	25 477.97	0.02
AUD WOOLWORTHS GRP LTD NPV	1 285.00	28 042.25	0.02
オーストラリア合計		878 444.02	0.54
オーストリア			
EUR ANDRITZ AG NPV (BR)	72.00	4 334.01	0.00
EUR ERSTE GROUP BK AG NPV	345.00	17 419.14	0.01
EUR OMV AG NPV (VAR)	77.00	4 974.55	0.00
EUR VOESTALPINE AG NPV	96.00	6 252.27	0.01
オーストリア合計		32 979.97	0.02
ベルギー			
EUR AGEAS NPV (POST SPLIT)	97.00	5 140.44	0.00
EUR ANHEUSER-BUSCH IN NPV	684.00	77 659.76	0.05
EUR COLRUYT SA NPV	78.00	4 330.80	0.00
EUR GPE BRUXELLES LAM NPV	63.00	7 446.40	0.00
EUR KBC GROUP NV NPV	270.00	26 033.68	0.02
EUR PROXIMUS SA NPV	98.00	3 315.79	0.00
EUR SOLVAY SA NPV	107.00	15 535.56	0.01
EUR TELENET GRP HLDG NPV	70.00	5 402.19	0.00
EUR UCB NPV	130.00	11 368.71	0.01
EUR UMICORE NPV	196.00	10 342.91	0.01
ベルギー合計		166 576.24	0.10
バミューダ			
USD ARCH CAPITAL GROUP COM USD0.01	100.00	9 094.00	0.01
USD AXIS CAPITAL HLDGS COM USD0.0125	100.00	5 053.00	0.00
USD MARVELL TECH GROUP COM USD0.002	300.00	6 999.00	0.00
USD RENAISSANCE RE HLG COM USD1	52.00	6 611.28	0.00
USD XL GROUP LTD COM USD0.01	200.00	7 368.00	0.01
バミューダ合計		35 125.28	0.02
カナダ			
CAD AGNICO EAGLE MINES LTD COM	334.00	15 841.76	0.01
CAD ALIMENTATION COUCHE TARD INC SUB VTG SH	341.00	17 885.93	0.01
CAD ALTAGAS LTD COM NPV	100.00	2 247.22	0.00
CAD ARC RESOURCES COM NPV	164.00	1 808.63	0.00
CAD BANK MONTREAL QUE COM	502.00	41 462.00	0.03
CAD BANK NOVA SCOTIA HALIFAX COM	971.00	64 677.93	0.04
CAD BARRICK GOLD CORP COM NPV	1 015.00	14 635.33	0.01
CAD BCE INC COM NEW	87.00	4 078.93	0.00
CAD BLACKBERRY LTD NPV	300.00	3 814.65	0.00
CAD BOMBARDIER INC CLASS' B' SUB-VTG NPV	1 100.00	3 120.19	0.00
CAD BROOKFIELD ASSET M LTD VTG SHS NPV CL' A'	801.00	33 610.86	0.02
CAD CAE INC COM	322.00	5 957.86	0.00
CAD CAMECO CORP COM	187.00	1 725.43	0.00
CAD CAN PACIFIC RYS COM NPV	112.00	20 790.54	0.01
CAD CANADIAN NAT RES LTD COM	1 076.00	36 827.03	0.02
CAD CANADIAN NATL RY CO COM	659.00	52 952.05	0.03
CAD CANADIAN TIRE LTD CL A	46.00	6 435.16	0.01
CAD CANADIAN UTILS LTD CL A	119.00	3 531.64	0.00
CAD CDN IMPERIAL BK OF COMMERCE COM	384.00	38 141.78	0.02

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 割合 （%）
CAD CENOVUS ENERGY INC COM NPV	951.00	9 092.58	0.01
CAD CGI GROUP INC 'A' SUB-VTG NPV	112.00	6 426.87	0.01
CAD CI FINANCIAL CORP COM NPV	139.00	3 354.76	0.00
CAD CRESCENT POINT EN COM NPV	195.00	1 541.75	0.00
CAD DOLLARAMA INC COM NPV	100.00	13 708.28	0.01
CAD ELEMENT FLEET MGMT COM NPV	600.00	4 059.18	0.00
CAD ENBRIDGE INC COM NPV	999.00	36 667.05	0.02
USD ENBRIDGE INC COM NPV	416.00	15 238.08	0.01
CAD ENCANA CORP COM NPV	411.00	5 095.42	0.00
CAD FAIRFAX FINL HLDGS LTD SUB VTG	13.00	6 855.77	0.01
CAD FINNING INTL INC COM NEW	156.00	4 306.74	0.00
CAD FIRST QUANTUM MINERALS LTD COM	321.00	4 798.58	0.00
CAD FORTIS INC COM NPV	402.00	14 240.47	0.01
CAD FRANCO NEVADA CORP COM NPV	222.00	17 018.46	0.01
CAD GILDAN ACTIVEWEAR INC COM	200.00	6 819.09	0.01
CAD GOLDCORP INC COM NPV	705.00	10 119.45	0.01
CAD GREAT WEST LIFECO INC COM	167.00	4 734.29	0.00
CAD HUSKY ENERGY INC COM	204.00	2 998.02	0.00
CAD HYDRO ONE INC COM NPV	400.00	7 241.31	0.01
CAD IGM FINANCIAL INC COM	72.00	2 578.11	0.00
CAD IMPERIAL OIL LTD COM NEW	321.00	10 117.84	0.01
CAD INDUSTRIAL ALLNCE INS FIN SRVC COM	111.00	5 328.11	0.00
CAD INTACT FINL CORP COM NPV	187.00	15 719.37	0.01
CAD INTER PIPELINE LTD COM NPV	200.00	3 843.99	0.00
CAD KEYERA CORPORATION COM NPV	200.00	5 642.09	0.00
CAD KINROSS GOLD CORP COM NPV	666.00	2 898.84	0.00
CAD LOBLAW COS LTD COM	143.00	7 766.30	0.01
USD LULULEMON ATHLETIC COM STK USD0.01	89.00	6 960.69	0.01
CAD MAGNA INTL INC COM NPV	248.00	14 202.62	0.01
CAD MANULIFE FINL CORP COM	1 460.00	31 060.03	0.02
CAD METHANEX CORP COM	100.00	6 328.40	0.00
CAD METRO INC CL A SUB	135.00	4 529.16	0.00
CAD NATL BK OF CANADA COM NPV	391.00	20 345.96	0.01
CAD NUTRIEN LTD NPV	621.57	32 602.22	0.02
CAD ONEX CORP SUB VTG	100.00	7 508.66	0.01
CAD OPEN TEXT CO COM NPV	200.00	6 866.37	0.01
CAD PEMBINA PIPELINE C COM NPV	501.00	17 122.66	0.01
CAD POWER CORP CDA COM	213.00	5 449.79	0.00
CAD POWER FINANCIAL CORP COM	195.00	5 392.96	0.00
CAD RESTAURANT BRANDS COM NPV	200.00	12 112.32	0.01
USD RESTAURANT BRANDS COM NPV	50.00	3 019.50	0.00
CAD ROGERS COMMS INC CLASS' B' COM CAD1.62478	409.00	20 012.45	0.01
CAD ROYAL BK OF CANADA COM NPV	1 162.00	99 752.90	0.06
CAD SAPUTO INC COM	200.00	6 900.60	0.01
CAD SEVEN GENERATIONS COM NPV 'WI'	300.00	4 193.67	0.00
CAD SHAW COMMUNICATIONS INC CL B CONV	266.00	5 821.49	0.00
CAD SHOPIFY INC COM NPV CL A	100.00	12 800.26	0.01
CAD SNC-LAVALIN GROUP INC COM	100.00	4 434.94	0.00
CAD SUN LIFE FINL INC COM	646.00	28 102.06	0.02
CAD SUNCOR ENERGY INC COM NPV 'NEW'	1 398.00	50 776.28	0.03
CAD TECK RESOURCES LTD CLASS' B' SUB-VTG COM NPV	382.00	11 122.01	0.01
CAD TORONTO-DOMINION COM NPV	1 497.00	91 295.22	0.06
CAD TRANSCANADA CORP COM NPV	756.00	34 896.10	0.02
CAD VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL INC COM NPV	183.00	3 397.92	0.00
USD WASTE CONNECTIONS COM NPV (POST REV SPLT)	291.00	20 899.62	0.01
CAD WESTON GEORGE LTD COM	115.00	10 097.24	0.01
CAD WHEATON PRECIOUS M COM NPV	606.00	13 124.20	0.01
カナダ合計		1 188 884.02	0.73

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
デンマーク			
DKK A. P. MOELLER-MAERSK SER' B' DKK1000	5.00	8 955.17	0.01
DKK A. P. MOLLER-MAERSK 'A' DKK1000	3.00	5 147.13	0.00
DKK CARLSBERG SER' B' DKK20	71.00	9 148.64	0.01
DKK CHR. HANSEN HLDG DKK10	106.00	9 297.31	0.01
DKK COLOPLAST DKK1 B	61.00	5 438.15	0.00
DKK DANSKE BANK A/S DKK10	690.00	28 123.43	0.02
DKK DSV DKK1	127.00	10 480.23	0.01
DKK GENMAB AS DKK1 (BEARER)	48.00	8 821.93	0.00
DKK ISS A/S DKK1	291.00	11 393.14	0.01
DKK NOVO-NORDISK AS DKK0.2 SER' B'	1 556.00	86 835.12	0.05
DKK NOVOZYMES A/S SER' B' DKK2 (POST CONS)	295.00	16 418.52	0.01
DKK ORSTED A/S DKK10	202.00	12 307.59	0.01
DKK PANDORA A/S DKK1	74.00	7 040.54	0.00
DKK TDC A/S DKK1	457.00	3 060.59	0.00
DKK VESTAS WIND SYSTEM DKK1	155.00	10 611.46	0.01
DKK WILLIAM DEMANT HOL DKK0.20	255.00	8 084.26	0.00
デンマーク合計		241 163.21	0.15
フィンランド			
EUR ELISA CORPORATION EURO.50	163.00	6 956.74	0.00
EUR FORTUM OYJ EUR3.40	187.00	4 068.57	0.00
EUR KONE CORPORATION NPV ORD 'B'	360.00	20 674.47	0.01
EUR NESTE OIL OYJ NPV	173.00	11 999.86	0.01
EUR NOKIA OYJ NPV	5 708.00	27 568.35	0.02
EUR NOKIAN RENKAAT OYJ NPV	91.00	4 611.62	0.00
EUR ORION CORP SER' B' NPV	59.00	2 374.02	0.00
EUR SAMPO OYJ SER' A' NPV	403.00	23 480.28	0.01
EUR STORA ENSO OYJ NPV SER' R'	649.00	11 173.36	0.01
EUR UPM-KYMMENE CORP NPV	365.00	12 340.52	0.01
EUR WARTSILA OYJ ABP SER' B' EUR3.50	130.00	8 916.83	0.01
フィンランド合計		134 164.62	0.08
フランス			
EUR ACCOR EUR3	124.00	7 082.59	0.00
EUR AIR LIQUIDE(L') EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)	328.00	44 354.18	0.03
EUR AIRBUS GROUP NV EUR1	486.00	56 002.69	0.03
EUR ALSTOM EUR7.00	96.00	4 227.58	0.00
EUR AMUNDI EUR2.5 (AIW)	116.00	10 982.53	0.01
EUR ARKEMA EUR10	46.00	5 896.63	0.00
EUR ATOS SE EUR1	111.00	17 561.34	0.01
EUR AXA EUR2.29	1 585.00	52 314.75	0.03
EUR BNP PARIBAS EUR2	916.00	75 997.73	0.05
EUR BOLLORE EURO.16	1 856.00	10 820.68	0.01
EUR BOUYGUES EUR1	135.00	7 529.25	0.00
EUR BUREAU VERITAS EURO.12	142.00	4 176.53	0.00
EUR CAPGEMINI EUR8	171.00	22 782.84	0.01
EUR CARREFOUR EUR2.50	342.00	8 212.05	0.01
EUR CASINO GUICH-PERR EUR1.53	37.00	2 170.51	0.00
EUR CIE DE ST-GOBAIN EUR4	488.00	28 460.06	0.02
EUR CREDIT AGRICOLE SA EUR3	527.00	9 962.55	0.01
EUR DANONE EURO.25	431.00	37 294.34	0.02
EUR DASSAULT SYSTEMES EURO.50	70.00	8 099.37	0.02
EUR EDENRED EUR2	175.00	5 670.34	0.00
EUR EDF EURO.5	181.00	2 497.21	0.00
EUR EIFFAGE EUR4	96.00	11 679.35	0.01
EUR ENGIE EUR1	1 289.00	22 448.69	0.01
EUR ESSILOR INTL EURO.18	135.00	19 239.36	0.01
EUR EUTELSAT COMMUNICA EUR1	111.00	2 450.29	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
EUR FAURECIA EUR7	129.00	11 631.59	0.01
EUR GPE EUROTUNNEL SE EURO.40	386.00	5 433.71	0.00
EUR HERMES INTL NPV	28.00	15 529.02	0.01
EUR ILIAD NPV	25.00	6 490.36	0.00
EUR INGENICO GROUP EUR1	55.00	6 282.94	0.00
EUR KERING EUR4	64.00	32 513.08	0.02
EUR KLEPIERRE EUR1.40	239.00	10 953.64	0.01
EUR L' OREAL EURO.20	177.00	40 373.14	0.03
EUR LEGRAND SA EUR4	294.00	24 546.11	0.02
EUR LVMH MOET HENNESSY EURO.30	224.00	70 487.52	0.04
EUR NATIXIS EUR1.6	590.00	5 390.44	0.00
EUR ORANGE EUR4	1 654.00	29 969.54	0.02
EUR PERNOD RICARD EUR1.55	123.00	19 659.06	0.01
EUR PEUGEOT SA EUR1	414.00	9 329.75	0.01
EUR PUBLICIS GROUPE SA EURO.40	260.00	18 034.47	0.01
EUR RENAULT SA EUR3.81	214.00	23 611.92	0.01
EUR REXEL EUR5	171.00	3 093.10	0.00
EUR SAFRAN EURO.20	234.00	26 509.51	0.02
EUR SANOFI EUR2	932.00	82 573.09	0.05
EUR SCHNEIDER ELECTRIC EUR8	474.00	44 569.85	0.03
EUR SCOR SE EUR7.876972 (POST CONS)	184.00	8 263.31	0.01
EUR SOC GENERALE EUR1.25	734.00	42 843.30	0.03
EUR SODEXO EUR4	51.00	6 566.16	0.00
EUR SUEZ EUR4	241.00	3 605.71	0.00
EUR TELEPERFORMANCE EUR2.50	70.00	10 647.43	0.01
EUR THALES EUR3	105.00	11 819.43	0.01
EUR TOTAL EUR2.5	1 849.00	107 418.68	0.07
EUR UNIBAIL-RODAMCO EUR5	108.00	27 796.17	0.02
EUR VALEO EUR1 (POST SUBD)	260.00	20 567.33	0.01
EUR VEOLIA ENVIRONNEME EUR5	253.00	6 394.90	0.00
EUR VINCI EUR2.50	420.00	45 519.71	0.03
EUR VIVENDI SA EUR5.50	770.00	22 666.55	0.01
EUR ZODIAC AEROSPACE	215.00	6 703.94	0.00
フランス合計		1 285 707.90	0.79
ドイツ			
EUR BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG EUR1	314.00	35 975.49	0.02
EUR BEIERSDORF AG NPV	59.00	7 019.18	0.00
EUR COMMERZBANK AG NPV	863.00	14 253.44	0.01
EUR CONTINENTAL AG ORD NPV	107.00	32 217.46	0.02
EUR COVESTRO AG NPV	98.00	11 302.49	0.01
EUR DEUTSCHE WOHNEN AG NPV (BR)	232.00	10 520.11	0.01
EUR FRAPORT AG NPV	52.00	6 169.55	0.00
EUR FRESENIUS MED CARE NPV	234.00	27 110.01	0.02
EUR FRESENIUS SE & CO.KGAA NPV	388.00	34 066.58	0.02
EUR GEA GROUP AG NPV	278.00	13 863.13	0.01
EUR HEIDELBERGCEMENT NPV	181.00	19 679.96	0.01
EUR HENKEL AG & CO KGAA	43.00	5 399.58	0.00
EUR HUGO BOSS AG NPV (REGD)	56.00	5 160.99	0.00
EUR INNOGY SE NPV	259.00	9 905.33	0.01
EUR KION GROUP AG NPV	31.00	2 854.66	0.00
EUR LANXESS AG NPV	68.00	5 948.41	0.00
EUR LINDE AG NPV (ASD 24/10/2017)	152.00	37 227.00	0.02
EUR MAN SE ORD NPV	34.00	4 057.66	0.00
EUR MERCK KGAA NPV	163.00	17 873.10	0.01
EUR METRO WHOLESALE & NPV	90.00	1 962.06	0.00
EUR RWE AG (NEU) NPV	738.00	14 820.14	0.01
EUR SAP AG ORD NPV	819.00	92 671.06	0.06
EUR SYMRISE AG NPV (BR)	109.00	9 146.60	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
EUR THYSSENKRUPP AG NPV	463.00	14 615.66	0.01
EUR UNIPER SE NPV	319.00	9 549.38	0.01
EUR VOLKSWAGEN AG ORD NPV	27.00	6 003.89	0.00
EUR WIRECARD AG NPV	91.00	11 370.33	0.01
EUR ZALANDO SE NPV	187.00	10 990.83	0.01
ドイツ合計		471 734.08	0.29
香港			
HKD AIA GROUP LTD NPV	9 200.00	78 808.92	0.05
HKD ASM PACIFIC TECH HKD0.10	700.00	9 558.33	0.01
HKD BOC HONG KONG HLDG HKD5	2 500.00	12 769.37	0.01
HKD CK ASSET HOLDINGS HKD1	1 684.00	16 072.54	0.01
HKD CK HUTCHISON HLDGS HKD1.0	1 684.00	22 736.24	0.01
HKD CK INFRASTRUCTURE HKD1	1 000.00	8 905.00	0.01
HKD CLP HOLDINGS HKD5	1 000.00	10 209.10	0.01
HKD GALAXY ENTERTAINME HKD0.10	1 000.00	8 860.25	0.01
HKD HANG LUNG PROP HKD1	3 000.00	7 939.70	0.00
HKD HANG SENG BANK HKD5	500.00	11 903.16	0.01
HKD HENDERSON LAND DEV HKD2	1 339.00	9 364.41	0.01
HKD HONG KONG EXCHANGE HKD1	865.00	32 779.86	0.02
USD HONGKONG LAND HLD ORD USD0.10(SINGAPORE REG)	1 000.00	7 200.00	0.00
HKD HONGKONG&CHINA GAS HKD0.25	5 764.00	11 393.21	0.01
USD JARDINE MATHESON COM USD0.25(BERMUDA REG)	300.00	19 044.00	0.01
USD JARDINE STRATEGIC ORD USD0.05(BERMUDA REG)	300.00	11 940.00	0.01
HKD LI & FUNG HKD0.0125	2 000.00	1 020.27	0.00
HKD MTR CORP HKD1	1 533.00	8 780.78	0.01
HKD NEW WORLD DEVEL CO HKD1	5 380.00	8 708.21	0.00
HKD POWER ASSETS HOLDINGS LTD HKD1	1 500.00	13 338.32	0.01
HKD SINO LAND CO HKD1	2 655.00	4 894.89	0.00
HKD SJM HOLDINGS LTD. HKD1.00	2 000.00	1 999.63	0.00
HKD SUN HUNG KAI PROP NPV	1 047.00	18 191.93	0.01
HKD SWIRE PACIFIC 'A' HKD0.60	500.00	5 002.27	0.00
HKD TECHTRONIC INDUSTR HKD0.1	1 500.00	9 991.75	0.01
HKD THE LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2 000.00	17 694.93	0.01
HKD WHARF REAL ESTATE HKD0.1	1 000.00	6 910.48	0.00
HKD WHARF (HLDGS) HKD1	1 000.00	4 097.71	0.00
HKD WHEELLOCK & COMPANY HKD0.50	1 000.00	7 831.03	0.00
香港合計		387 946.29	0.24
アイルランド			
USD ACCENTURE PLC SHS CL A 'NEW'	508.00	81 635.60	0.05
USD ALKERMES PLC COM USD0.01	100.00	5 717.00	0.00
USD ALLEGION PLC CIM USD0.01	150.00	12 916.50	0.01
EUR BANK OF IRELAND GR EUR1	588.00	5 757.46	0.00
EUR CRH ORD EURO.32	467.00	17 406.42	0.01
GBP DCC ORD EURO.25	83.00	8 740.13	0.01
USD EATON CORP PLC COM USD0.01	403.00	33 839.91	0.02
GBP EXPERIAN ORD USD0.10	682.00	15 740.47	0.01
EUR PADDY POWER BETFAI ORD EURO.09	21.00	2 443.41	0.00
USD PENTAIR PLC COM USD0.01	162.00	11 583.00	0.01
USD SEAGATE TECH PLC COM USD0.00001	181.00	9 991.20	0.01
GBP SHIRE ORD GBP0.05	771.00	36 482.74	0.02
アイルランド合計		242 253.84	0.15
イスラエル			
ILS BANK HAPOALIM B. M. ILS1	799.00	5 998.18	0.00
ILS BEZEQ ISRAEL TELCM ILS1	2 427.00	4 017.60	0.00
ILS BK LEUMI LE ISRAEL ILS1	1 087.00	6 703.50	0.00
USD CHECK POINT SFTWRE ORD ILS0.01	79.00	8 169.39	0.01
ILS NICE SYSTEMS ILS1	113.00	10 345.33	0.01
イスラエル合計		35 234.00	0.02

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
イタリア			
EUR ASSIC GENERALI SPA EUR1	1 146.00	22 799.24	0.01
EUR ATLANTIA SPA EUR1	240.00	7 976.79	0.01
EUR ENEL EUR1	4 640.00	29 537.23	0.02
EUR ENI SPA EUR1	1 481.00	26 726.03	0.02
EUR FERRARI NV EURO.01 (NEW)	60.00	7 178.51	0.00
EUR INTESA SANPAOLO	9 021.00	35 517.42	0.02
EUR LEONARDO SPA EUR4.40	384.00	4 649.74	0.00
EUR LUXOTTICA GROUP EURO.06	214.00	13 809.39	0.01
EUR MEDIOBANCA SPA EURO.5	395.00	4 818.36	0.00
EUR PRYSMIAN SPA EURO.10	306.00	10 803.19	0.01
EUR RECORDATI EURO.125	236.00	10 780.87	0.01
EUR SNAM EUR1	1 899.00	9 271.10	0.01
EUR TELECOM ITALIA SPA EURO.55	8 925.00	8 063.00	0.01
EUR TERNA SPA ORD EURO.22	1 129.00	6 818.48	0.00
EUR UNICREDIT SPA NPV (POST REV SPLIT)	1 778.00	39 306.39	0.02
イタリア合計		238 055.74	0.15
日本			
JPY イオン	400.00	6 806.83	0.00
JPY イオンフィナンシャルサービス	100.00	2 492.79	0.00
JPY イオンモール	220.00	4 839.17	0.00
JPY アイシン精機	100.00	5 835.74	0.00
JPY 味の素	400.00	7 585.54	0.00
JPY アルフレッサ ホールディングス	400.00	9 743.94	0.01
JPY アルプス電気	100.00	2 876.64	0.00
JPY アマダ	700.00	10 363.24	0.01
JPY A N Aホールディングス	200.00	8 135.22	0.02
JPY アサヒグループホールディングス	400.00	20 121.85	0.01
JPY 旭化成	1 000.00	13 050.25	0.01
JPY アステラス製薬	2 200.00	29 022.95	0.02
JPY バンダイナムコホールディングス	100.00	3 261.42	0.00
JPY ベネッセホールディングス	100.00	3 756.13	0.00
JPY ブリヂストン	700.00	34 026.84	0.02
JPY ブラザー工業	300.00	7 670.74	0.00
JPY キヤノン	800.00	31 873.94	0.02
JPY 東海旅客鉄道	100.00	18 918.05	0.01
JPY 中部電力	400.00	5 018.55	0.00
JPY 中外製薬	100.00	5 286.06	0.00
JPY 中国電力	300.00	3 317.30	0.00
JPY コンコルディア・フィナンシャルグループ	1 000.00	6 055.61	0.00
JPY クレディセゾン	200.00	3 633.37	0.00
JPY 大日本印刷	400.00	8 904.77	0.01
JPY 第一生命ホールディングス	900.00	18 844.30	0.01
JPY ダイセル	100.00	1 211.12	0.00
JPY 第一三共	400.00	13 448.77	0.01
JPY ダイキン工業	200.00	23 993.40	0.01
JPY 大東建託	100.00	17 465.99	0.01
JPY 大和ハウス工業	400.00	15 775.73	0.01
JPY 大和証券グループ本社	1 000.00	7 165.96	0.00
JPY デンソー	400.00	25 002.98	0.02
JPY 電通	100.00	4 475.29	0.00
JPY 東日本旅客鉄道	200.00	19 870.83	0.01
JPY エーザイ	200.00	11 416.79	0.01
JPY ユニー・ファミリーマートホールディングス	100.00	6 687.74	0.00
JPY ファナック	200.00	54 005.77	0.03
JPY ファーストリテイリング	100.00	44 606.29	0.03
JPY 富士フイルムホールディングス	300.00	11 515.73	0.01
JPY 富士通	2 000.00	14 729.51	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
JPY 阪急阪神ホールディングス	200.00	8 052.77	0.00
JPY 日野自動車	300.00	3 965.92	0.00
JPY 久光製薬	100.00	6 870.96	0.00
JPY 日立建機	200.00	8 950.57	0.01
JPY 日立製作所	4 000.00	31 749.35	0.02
JPY 本田技研工業	1 600.00	56 081.72	0.03
JPY HOYA	300.00	15 305.76	0.01
JPY 国際石油開発帝石	1 200.00	15 599.84	0.01
JPY 三越伊勢丹ホールディングス	400.00	4 782.19	0.00
JPY いすゞ自動車	500.00	8 423.80	0.01
JPY 伊藤忠商事	1 500.00	29 393.98	0.02
JPY J. フロント リテイリング	500.00	9 142.96	0.01
JPY 日本航空	300.00	11 304.11	0.01
JPY 日本取引所グループ	400.00	7 186.11	0.00
JPY ゆうちょ銀行	500.00	6 747.29	0.00
JPY 日本郵政	1 300.00	15 506.39	0.01
JPY 日本プライムリアルティ投資法人	2.00	7 072.51	0.00
JPY ジャパンリアルエステイト投資法人	1.00	5 139.48	0.00
JPY 日本リテールファンド投資法人	2.00	3 985.16	0.00
JPY 日本たばこ産業	800.00	26 472.45	0.02
JPY JFEホールディングス	300.00	7 114.20	0.00
JPY 日揮	100.00	2 158.40	0.00
JPY JSR	100.00	2 367.28	0.00
JPY ジェイテクト	400.00	7 123.81	0.00
JPY J X T Gホールディングス	3 300.00	21 882.09	0.01
JPY 鹿島建設	1 000.00	9 885.03	0.01
JPY カカクコム	200.00	3 501.44	0.00
JPY 関西電力	400.00	4 959.92	0.00
JPY 関西ペイント	100.00	2 468.97	0.00
JPY 花王	400.00	27 714.72	0.02
JPY KDDI	1 600.00	40 353.63	0.02
JPY 京浜急行電鉄	500.00	9 848.38	0.01
JPY 京成電鉄	200.00	6 770.19	0.00
JPY キーエンス	100.00	60 858.41	0.04
JPY キリンホールディングス	600.00	14 956.71	0.01
JPY 小松製作所	900.00	34 918.24	0.02
JPY コニカミノルタ	500.00	4 974.58	0.00
JPY コーセー	100.00	17 223.21	0.01
JPY クボタ	1 000.00	20 310.57	0.01
JPY クラレ	400.00	7 475.61	0.00
JPY 栗田工業	200.00	6 541.16	0.00
JPY 京セラ	300.00	19 928.54	0.01
JPY 協和発酵キリン	500.00	9 779.67	0.01
JPY 九州電力	300.00	3 281.57	0.00
JPY ライオン	500.00	9 371.99	0.01
JPY LIXILグループ	200.00	5 615.87	0.00
JPY マキタ	200.00	9 417.80	0.01
JPY 丸紅	1 000.00	7 495.76	0.00
JPY マツダ	700.00	9 808.53	0.01
JPY 日本マクドナルドホールディングス	200.00	8 996.38	0.01
JPY メディパルホールディングス	300.00	5 870.55	0.00
JPY 明治ホールディングス	100.00	8 364.25	0.01
JPY ミネベアミツミ	500.00	11 300.44	0.01
JPY 三菱ケミカルホールディングス	1 200.00	13 021.85	0.01
JPY 三菱商事	1 200.00	33 530.30	0.02
JPY 三菱電機	1 400.00	25 555.40	0.02
JPY 三菱地所	1 000.00	19 133.34	0.01
JPY 三菱重工業	200.00	7 515.92	0.00
JPY 三菱自動車工業	400.00	2 964.59	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
JPY 田辺三菱製薬	300.00	6 131.65	0.00
JPY 三菱UFJフィナンシャル・グループ	10 300.00	77 451.70	0.05
JPY 三井物産	1 700.00	29 808.99	0.02
JPY 三井不動産	1 000.00	26 178.37	0.02
JPY 商船三井	100.00	3 582.06	0.00
JPY みずほフィナンシャルグループ	20 700.00	38 932.80	0.02
JPY MS&ADインシュアランス グループ ホールディングス	400.00	13 599.01	0.01
JPY 村田製作所	200.00	29 517.66	0.02
JPY 名古屋鉄道	400.00	10 513.49	0.01
JPY NEC	400.00	12 056.25	0.01
JPY 日本碍子	300.00	6 106.91	0.00
JPY 日本特殊陶業	100.00	2 630.20	0.00
JPY 日本電産	200.00	31 972.88	0.02
JPY ニコン	200.00	3 878.89	0.00
JPY 任天堂	100.00	43 946.68	0.03
JPY 日本ビルファンド投資法人	1.00	5 359.35	0.00
JPY 日本プロロジスリート投資法人	3.00	6 884.71	0.00
JPY 新日鐵住金	547.00	13 923.69	0.01
JPY 日本電信電話	600.00	28 533.74	0.02
JPY 日産自動車	1 700.00	18 120.56	0.01
JPY 日清製粉グループ本社	400.00	8 014.29	0.01
JPY ニトリホールディングス	100.00	15 926.89	0.01
JPY 日東電工	100.00	9 137.47	0.01
JPY NOK	200.00	4 652.10	0.00
JPY 野村ホールディングス	2 600.00	16 852.18	0.01
JPY 野村不動産マスターファンド投資法人	5.00	6 962.58	0.00
JPY 野村不動産ホールディングス	100.00	2 392.93	0.00
JPY 日本精工	500.00	8 226.83	0.01
JPY エヌ・ティ・ティ・データ	800.00	9 403.14	0.01
JPY NTTドコモ	800.00	19 821.35	0.01
JPY 大林組	700.00	8 413.72	0.01
JPY 小田急電鉄	500.00	10 993.54	0.01
JPY オリンパス	100.00	3 843.16	0.00
JPY オムロン	100.00	6 238.83	0.00
JPY 小野薬品工業	400.00	9 874.03	0.01
JPY オリエンタルランド	200.00	19 531.86	0.01
JPY オリックス	1 400.00	26 100.50	0.02
JPY 大阪ガス	400.00	7 926.34	0.00
JPY 大塚ホールディングス	300.00	13 318.68	0.01
JPY パナソニック	2 000.00	29 664.24	0.02
JPY パーク 2 4	200.00	4 996.56	0.00
JPY パーソルホールディングス	400.00	9 956.48	0.01
JPY 楽天	700.00	6 321.84	0.00
JPY リクルートホールディングス	1 000.00	24 359.86	0.03
JPY ルネサスエレクトロニクス	200.00	2 350.79	0.00
JPY りそなホールディングス	2 000.00	12 043.42	0.01
JPY リコー	400.00	3 928.36	0.00
JPY ローム	100.00	10 966.06	0.01
JPY SANKYO	100.00	3 243.09	0.00
JPY 参天製薬	500.00	8 158.12	0.02
JPY SBIホールディングス	150.00	3 626.49	0.00
JPY セコム	200.00	15 284.69	0.01
JPY セガサミーホールディングス	100.00	1 395.26	0.00
JPY 西武ホールディングス	500.00	9 985.80	0.01
JPY セイコーエプソン	100.00	2 424.99	0.00
JPY 積水化学工業	500.00	9 527.74	0.01
JPY 積水ハウス	800.00	14 643.39	0.01
JPY セブン&アイ・ホールディングス	700.00	28 768.27	0.02
JPY 島津製作所	400.00	10 081.08	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
JPY シマノ	100.00	14 291.60	0.01
JPY 清水建設	1 000.00	10 233.15	0.01
JPY 信越化学工業	300.00	34 107.46	0.02
JPY 塩野義製薬	200.00	11 061.33	0.01
JPY 資生堂	300.00	15 393.71	0.01
JPY 昭和シェル石油	300.00	4 251.75	0.00
JPY SMC	100.00	49 031.19	0.03
JPY ソフトバンクグループ	700.00	57 587.83	0.04
JPY S O M P Oホールディングス	275.00	10 999.50	0.01
JPY ソニー	1 100.00	52 493.24	0.03
JPY ソニーフィナンシャルホールディングス	200.00	3 653.52	0.00
JPY スタンレー電気	200.00	8 107.74	0.01
JPY SUBARU	500.00	16 572.76	0.01
JPY SUMCO	400.00	10 890.93	0.01
JPY 住友化学	1 000.00	7 329.03	0.00
JPY 住友商事	1 300.00	22 378.27	0.01
JPY 住友電気工業	500.00	8 522.28	0.01
JPY 住友重機械工業	200.00	9 115.48	0.01
JPY 住友金属鉱山	300.00	14 038.75	0.01
JPY 三井住友フィナンシャルグループ	1 200.00	53 626.49	0.03
JPY 三井住友トラスト・ホールディングス	300.00	12 441.94	0.01
JPY 住友ゴム工業	100.00	1 939.44	0.00
JPY サントリー食品インターナショナル	200.00	9 546.06	0.01
JPY スルガ銀行	300.00	6 051.94	0.00
JPY スズキ	400.00	22 822.60	0.01
JPY シスメックス	100.00	7 842.06	0.00
JPY T&Dホールディングス	300.00	5 340.11	0.00
JPY 大成建設	200.00	10 169.03	0.01
JPY 武田薬品工業	700.00	41 138.75	0.03
JPY TDK	100.00	9 207.09	0.01
JPY 帝人	500.00	11 043.93	0.01
JPY テルモ	200.00	9 784.25	0.01
JPY 東宝	200.00	6 761.03	0.00
JPY 東北電力	300.00	3 866.98	0.00
JPY 東京海上ホールディングス	500.00	23 544.50	0.01
JPY 東京電力	700.00	2 834.50	0.00
JPY 東京エレクトロン	200.00	37 487.98	0.02
JPY 東京ガス	400.00	9 502.08	0.01
JPY 東京急行電鉄	500.00	8 355.09	0.01
JPY 東急不動産ホールディングス	500.00	3 939.35	0.00
JPY 凸版印刷	1 000.00	9 390.32	0.01
JPY 東レ	1 000.00	9 939.99	0.01
JPY 東芝	5 000.00	14 245.80	0.01
JPY 東ソー	400.00	9 161.28	0.01
JPY 東洋製罐グループホールディングス	200.00	3 224.77	0.00
JPY 豊田自動織機	100.00	6 495.35	0.00
JPY トヨタ自動車	2 252.00	154 321.47	0.10
JPY 豊田通商	200.00	8 080.25	0.01
JPY ツルハホールディングス	100.00	13 925.15	0.01
JPY ユニ・チャーム	300.00	8 011.54	0.00
JPY ユナイテッド・アーバン投資法人	5.00	7 901.61	0.00
JPY ユー・エス・エス	300.00	6 678.58	0.00
JPY 西日本旅客鉄道	100.00	7 490.27	0.00
JPY ヤフー	700.00	3 366.77	0.00
JPY ヤクルト本社	100.00	8 355.09	0.01
JPY ヤマハ発動機	100.00	3 316.38	0.00
JPY ヤマトホールディングス	300.00	7 728.46	0.00
JPY 安川電機	500.00	25 743.21	0.02
JPY 横河電機	300.00	6 365.26	0.00
日本合計		3 148 438.57	1.94

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
ジャージー島			
GBP FERGUSON PLC ORD GBPO.108030303	254.00	19 634.87	0.01
GBP GLENCORE XSTRATA ORD USD0.01	10 537.00	60 490.98	0.04
GBP RANDGOLD RESOURCES ORD USD0.05	62.00	6 247.52	0.00
ジャージー島合計		86 373.37	0.05
ルクセンブルグ			
EUR ARCELORMITTAL NPV (POST STOCK SPLIT)	754.00	27 450.91	0.01
EUR EUROFINS SCIENTIFI EURO.10	16.00	10 464.30	0.01
ルクセンブルグ合計		37 915.21	0.02
マカオ			
HKD SANDS CHINA LTD USD0.01 REG' S'	1 200.00	7 149.57	0.01
HKD WYNN MACAU LTD HKD0.10	1 200.00	4 234.51	0.00
マカオ合計		11 384.08	0.01
オランダ			
EUR AEGON NV EURO.12	1 805.00	12 385.17	0.01
USD AERCAP HOLDINGS NV	100.00	5 410.00	0.00
EUR AKZO NOBEL NV EUR2	282.00	26 495.16	0.02
EUR ALTICE NV EURO.01 (COMMON SHARES A)	186.00	2 005.68	0.00
EUR ASML HOLDING NV EURO.09	302.00	61 398.53	0.04
EUR CNH INDUSTRIAL NV COM EURO.01	233.00	3 458.45	0.00
EUR EXOR NV EURO.01	78.00	6 045.82	0.00
EUR FIAT CHRYSLER AUTO EURO.01	606.00	14 692.34	0.01
EUR HEINEKEN HOLDING EUR1.6	69.00	7 349.30	0.01
EUR HEINEKEN NV EUR1.60	277.00	31 249.79	0.02
EUR ING GROEP N.V. EURO.01	3 125.00	61 625.70	0.04
EUR KON KPN NV EURO.24	4 596.00	16 145.82	0.01
EUR KONINKLIJKE AHOLD EURO.01	904.00	20 237.06	0.01
EUR KONINKLIJKE DSM NV EUR1.5	218.00	22 600.35	0.01
EUR KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20	943.00	38 602.03	0.02
EUR NN GROUP N.V. EURO.12	279.00	13 207.44	0.01
USD NXP SEMICONDUCTORS EURO.20	294.00	35 374.08	0.02
EUR QIAGEN NV EURO.01	267.00	8 960.65	0.01
EUR RANDSTAD HLDGS NV EURO.10	83.00	5 881.24	0.00
EUR RELX NV EURO.07	699.00	15 600.02	0.01
GBP ROYAL DUTCH SHELL 'B' SHS EURO.07 (UK LIST)	3 012.00	106 909.04	0.07
GBP ROYAL DUTCH SHELL PLC 'A' SHS EURO.07	3 689.00	129 181.34	0.08
USD SENSATA TECHNOLOGI COM EURO.01	100.00	5 625.00	0.00
EUR STMICROELECTRONICS EUR1.04	468.00	11 211.30	0.01
EUR VOPAK (KON) EURO.50	70.00	3 173.30	0.00
EUR WOLTERS KLUWER EURO.12	374.00	19 861.76	0.01
オランダ合計		684 686.37	0.42
ニュージーランド			
NZD AUCKLAND INTL NPV	1 541.00	7 635.61	0.00
NZD FISHER & PAYKEL HE NPV	1 035.00	10 226.15	0.01
NZD SPARK NEW ZEALAND NPV	2 227.00	5 917.05	0.00
ニュージーランド合計		23 778.81	0.01
ノルウェー			
NOK DNB ASA NOK10	1 063.00	21 657.99	0.01
NOK GJENSIDIGE FORSIKR NOK2	417.00	7 898.57	0.01
NOK MARINE HARVEST ASA NOK7.50	111.00	1 929.70	0.00
NOK NORSK HYDRO ASA NOK3.6666	854.00	6 252.34	0.01
NOK ORKLA ASA NOK1.25	590.00	6 165.70	0.00
NOK STATOIL ASA NOK2.50	868.00	20 353.56	0.01
NOK TELENOR ASA ORD NOK6	852.00	20 033.87	0.01
NOK YARA INTERNATIONAL NOK1.7	147.00	7 095.02	0.01
ノルウェー合計		91 386.75	0.06

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
パプアニューギニア			
AUD OIL SEARCH LTD PGK0.10	1 527.00	9 360.22	0.01
パプアニューギニア合計		9 360.22	0.01
ポルトガル			
EUR GALP ENERGIA EUR1-B	262.00	5 016.56	0.00
EUR JERONIMO MARTINS EUR5	106.00	2 265.31	0.00
ポルトガル合計		7 281.87	0.00
シンガポール			
USD BROADCOM LIMITED COM NPV	321.00	79 617.63	0.05
SGD CITY DEVELOPMENTS SGD0.50	900.00	9 115.49	0.01
SGD DBS GROUP HLDGS SGD1	1 632.00	32 909.26	0.02
USD FLEX LTD COM USD0.01	600.00	10 806.00	0.01
SGD JARDINE CYCLE & CA SGD1	222.00	6 770.90	0.00
SGD KEPPEL CORP NPV	1 000.00	6 622.36	0.00
SGD OVERSEA-CHINESE BK NPV	3 085.00	30 468.26	0.02
SGD SINGAPORE AIRLINES NPV	1 000.00	8 638.86	0.01
SGD SINGAPORE EXCHANGE SGD0.01	1 000.00	6 263.37	0.00
SGD SINGAPORE TELECOMM NPV (POST RE-ORG)	5 000.00	13 519.71	0.01
SGD UTD O/S BANK SGD1	1 066.00	22 334.54	0.01
シンガポール合計		227 066.38	0.14
南アフリカ			
GBP MONDI ORD EURO.20	344.00	9 182.01	0.01
南アフリカ合計		9 182.01	0.01
スペイン			
EUR ABERTIS INFRAESTR EUR3 SERIE A	768.00	18 675.49	0.01
EUR ACS ACTIVIDADES CO EURO.5	145.00	5 827.24	0.00
EUR AENA SME S.A. EUR10	56.00	12 239.74	0.01
EUR AMADEUS IT GROUP EURO.01	326.00	25 374.03	0.02
EUR BANKIA S.A. EUR1 (POST CONS)	614.00	3 120.75	0.00
EUR BCO DE SABADELL EURO.125	7 475.00	17 823.13	0.01
EUR CAIXABANK SA EUR1	3 019.00	16 348.71	0.01
EUR ENAGAS SA EUR1.50	198.00	5 414.15	0.00
EUR ENDESA SA EUR1.2	461.00	10 394.66	0.01
EUR FERROVIAL SA EURO.2	707.00	16 271.77	0.01
EUR GAS NATURAL SDG EUR1	298.00	6 906.80	0.01
EUR GRIFOLS SA EURO.25 (CLASS A) POST SUBD	132.00	4 260.61	0.00
EUR IBERDROLA SA EURO.75 (POST SUBDIVISION)	5 450.00	44 524.48	0.03
EUR INDITEX EURO.03 (POST SUBD)	876.00	31 505.17	0.02
EUR INTL CONS AIRLINE ORD EURO.50	584.00	5 325.43	0.00
EUR RED ELECTRICA CORP EURO.5	316.00	6 719.72	0.00
EUR REPSOL SA EUR1	991.00	18 709.43	0.01
EUR TELEFONICA SA EUR1	4 227.00	43 458.52	0.03
スペイン合計		292 899.83	0.18
スウェーデン			
SEK ALFA LAVAL AB NPV	261.00	6 868.51	0.00
SEK ASSA ABLOY SER' B' NPV (POST SPLIT)	770.00	17 106.75	0.01
SEK ATLAS COPCO AB SER' A' NPV (POST SPLIT)	674.00	31 707.05	0.02
SEK ATLAS COPCO AB SER' B' NPV (POST SPLIT)	427.00	17 874.80	0.01
USD AUTOLIV INC COM	47.00	7 153.87	0.00
SEK BOLIDEN AB NPV (POST SPLIT)	207.00	7 532.06	0.01
SEK ELECTROLUX AB SER' B' NPV (POST SPLIT)	123.00	4 356.56	0.00
SEK ERICSSON SER' B' NPV	2 259.00	14 552.86	0.01
SEK ESSITY AB SER' B' NPV	401.00	12 048.63	0.01
SEK GETINGE AB SER' B' NPV	224.00	3 077.17	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
SEK HENNES & MAURITZ SER' B' NPV	620.00	10 998.89	0.01
SEK HEXAGON AB SER' B' NPV	338.00	20 195.23	0.01
SEK HUSQVARNA AB SER' B' NPV	882.00	9 232.67	0.01
SEK INVESTOR AB SER' B' NPV	481.00	23 583.05	0.01
SEK KINNEVIK INV AB SER' B' NPV (POST SPLIT)	106.00	3 878.59	0.00
SEK LUNDIN PETROLEUM A NPV	212.00	5 296.96	0.00
SEK NORDEA BANK AB ORD NPV(SEK QUOTE)	2 017.00	24 970.79	0.02
SEK SANDVIK AB NPV (POST SPLIT)	637.00	12 582.67	0.01
SEK SECURITAS SER' B' NPV	437.00	8 114.64	0.02
SEK SKAND ENSKILDA BKN SER' A' NPV	1 752.00	22 203.08	0.01
SEK SKANSKA AB SER' B' NPV	310.00	6 320.77	0.00
SEK SKF AB SER' B' NPV	611.00	15 149.56	0.01
SEK SVENSKA HANDELSBKN SER' A' NPV (P/S)	858.00	12 523.99	0.01
SEK SWEDBANK AB SER' A' NPV	676.00	17 333.55	0.01
SEK SWEDISH MATCH NPV	136.00	5 526.92	0.00
SEK TELE2 AB SHS	281.00	3 526.05	0.00
SEK TELIASONERA AB NPV	3 257.00	16 400.07	0.01
SEK VOLVO AB SER' B' NPV (POST SPLIT)	1 467.00	30 042.26	0.02
スウェーデン合計		370 158.00	0.23
スイス			
CHF PARGESA HLDGS SA CHF20(BR) (POST SUBD)	39.00	3 561.85	0.00
CHF SIKA AG CHF0.60 (BR)	2.00	17 351.55	0.01
CHF SWATCH GROUP CHF2.25(BR)	19.00	8 717.19	0.01
CHF SWISS RE AG CHF0.10	280.00	27 650.60	0.02
CHF VIFOR PHARMA AG CHF0.01	40.00	5 895.01	0.00
スイス合計		63 176.20	0.04
イギリス			
GBP 3I GROUP ORD GBP0.738636	872.00	11 549.62	0.01
GBP ADMIRAL GROUP ORD GBP0.001	382.00	10 038.76	0.01
GBP ANGLO AMERICAN USD0.54945	933.00	22 669.24	0.01
USD AON PLC COM USD0.01 CL A	241.00	34 262.97	0.02
USD APTIV PLC COM USD0.01	200.00	18 976.00	0.01
GBP ASHTEAD GROUP ORD GBP0.10	438.00	13 111.16	0.01
GBP ASSOC BRIT FOODS ORD GBP0.0568	287.00	11 154.15	0.01
GBP ASTRAZENECA ORD USD0.25	1 052.00	73 101.87	0.05
GBP AUTO TRADER GROUP ORD GBP0.01	105.00	537.69	0.00
GBP AVIVA ORD GBP0.25	3 360.00	24 521.15	0.02
GBP BAE SYSTEMS ORD GBP0.025	1 870.00	15 795.85	0.01
GBP BARCLAYS ORD GBP0.25	14 473.00	41 150.32	0.03
GBP BARRATT DEVEL ORD GBP0.10	709.00	5 900.18	0.00
GBP BHP BILLITON PLC USD0.50	2 014.00	44 793.10	0.03
GBP BP ORD USD0.25	15 989.00	113 935.90	0.07
GBP BRIT AMER TOBACCO ORD GBP0.25	1 644.00	112 661.00	0.07
GBP BRITISH LAND CO PLC REIT	730.00	6 940.71	0.00
GBP BT GROUP ORD GBP0.05	7 749.00	28 149.22	0.02
GBP BUNZL ORD GBP0.32142857	163.00	4 774.96	0.00
GBP BURBERRY GROUP ORD GBP0.0005	175.00	3 929.48	0.00
GBP CAPITA PLC ORD GBP0.02066666	484.00	1 256.10	0.00
GBP CARNIVAL PLC ORD USD1.66	252.00	17 810.32	0.01
GBP CENTRICA ORD GBP0.061728395	2 644.00	5 017.59	0.00
GBP COBHAM ORD GBP0.025	2 555.00	4 750.59	0.00
USD COCA-COLA EUROPEAN ORD GBP0.01	318.00	12 770.88	0.01
GBP COMPASS GROUP ORD GBP0.1105	1 011.00	21 313.80	0.01
GBP CRODA INTL ORD GBP0.10357143	99.00	6 312.71	0.00
GBP DIAGEO ORD GBP0.28 101/108	2 102.00	75 700.20	0.05
GBP DIRECT LINE INSURA ORD GBP 0.109090909	1 323.00	6 947.91	0.00
GBP G4S ORD GBP0.25	982.00	3 970.12	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)	
GBP	GKN ORD GBPO. 50	787.00	4 731.79	0.00
GBP	GLAXOSMITHKLINE ORD GBPO. 25	3 977.00	74 675.13	0.05
GBP	HAMMERSON PLC REIT	674.00	4 725.22	0.00
GBP	HSBC HLDGS ORD USD0. 50(UK REG)	16 322.00	174 335.57	0.11
USD	IHS MARKIT LTD COM	421.00	20 094.33	0.01
GBP	IMI ORD GBPO. 2857	583.00	11 018.14	0.01
GBP	IMPERIAL BRANDS PL GBPO. 10	802.00	33 056.93	0.02
GBP	INTERCONTL HOTELS ORD GBPO. 1980952380937	99.00	6 633.69	0.00
GBP	INTERTEK GROUP ORD GBPO. 01	84.00	6 001.28	0.00
GBP	INVESTEC ORD GBPO. 0002	541.00	4 208.23	0.00
GBP	ITV ORD GBPO. 10	2 633.00	6 252.91	0.00
GBP	JOHNSON MATTHEY ORD GBP1. 109245	152.00	7 478.85	0.00
GBP	KINGFISHER ORD GBPO. 157142857	2 917.00	14 393.98	0.01
GBP	LAND SECURITIES GP ORD GBPO. 1066666666	575.00	8 191.51	0.01
GBP	LEGAL & GENERAL GP ORD GBPO. 025	2 799.00	10 770.73	0.01
USD	LIBERTY GLOBAL INC USD0. 01 A	167.00	6 242.46	0.00
USD	LIBERTY GLOBAL INC USD0. 01 C	406.00	14 518.56	0.01
GBP	LLOYDS BANKING GP ORD GBPO. 1	59 631.00	58 943.28	0.04
GBP	LONDON STOCK EXCH ORD GBPO. 06918604	200.00	11 168.78	0.01
GBP	MARKS & SPENCER GP ORD GBPO. 25	2 510.00	10 754.44	0.01
GBP	MEGGITT ORD GBPO. 05	519.00	3 426.00	0.00
USD	MICHAEL KORS HOLDI COM NPV	85.00	5 610.00	0.00
GBP	MICRO FOCUS INTL ORD GBPO. 10	294.00	8 988.78	0.01
GBP	MORRISON(W) SUPRMKT ORD GBPO. 10	1 110.00	3 504.22	0.00
GBP	NATIONAL GRID ORD GBPO. 12431289	2 961.00	33 883.43	0.02
GBP	NEXT ORD GBPO. 10	52.00	3 765.36	0.00
GBP	OLD MUTUAL PLC ORD GBPO. 114285714(POST CON)	2 427.00	8 069.18	0.01
GBP	PEARSON ORD GBPO. 25	514.00	5 071.22	0.00
GBP	PERSIMMON ORD GBPO. 10	215.00	7 649.63	0.01
GBP	PRUDENTIAL ORD GBPO. 05	2 170.00	58 816.27	0.04
GBP	RECKITT BENCK GRP ORD GBPO. 10	592.00	57 271.30	0.04
GBP	RELX PLC GBPO. 1444	823.00	18 234.01	0.01
GBP	RIO TINTO ORD GBPO. 10	1 003.00	55 940.12	0.04
GBP	ROLLS-ROYCE HLDGS ORD GBPO. 20	1 073.00	13 305.50	0.01
GBP	ROYAL BK SCOT GRP ORD GBP1 (POST CONS)	2 678.00	10 956.34	0.01
GBP	ROYAL MAIL PLC ORD GBPO. 01 (WI)	1 040.00	6 943.59	0.00
GBP	RSA INSURANCE GRP ORD GBP1. 00	581.00	5 119.21	0.00
GBP	SAGE GROUP GBPO. 01051948	1 072.00	11 421.08	0.01
GBP	SAINSBURY(J) ORD GBPO. 28571428	700.00	2 513.47	0.00
GBP	SCHRODERS VTG SHS GBP1	142.00	7 511.84	0.01
GBP	SEGRO PLC ORD GBPO. 10	1 531.00	12 657.99	0.01
GBP	SEVERN TRENT ORD GBPO. 9789	142.00	3 944.72	0.00
GBP	SKY PLC ORD GBPO. 50	716.00	10 782.61	0.01
GBP	SMITH & NEPHEW ORD USD0. 20	656.00	11 838.05	0.01
GBP	SMITHS GROUP ORD GBPO. 375	486.00	11 047.49	0.01
GBP	SSE PLC ORD GBPO. 50	654.00	12 132.12	0.01
GBP	STANDARD CHARTERED ORD USD0. 50	3 149.00	36 701.97	0.02
GBP	STD LIFE ABERDEEN ORD GBPO. 1222222	2 476.00	14 981.84	0.01
GBP	TAYLOR WIMPEY ORD GBPO. 01	2 200.00	5 962.94	0.00
USD	TECHNIPFMC PLC COM USD1	112.00	3 635.52	0.00
EUR	TECHNIPFMC PLC COM USD1	148.00	4 793.65	0.00
GBP	TESCO ORD GBPO. 05	5 452.00	16 203.80	0.01
GBP	TRAVIS PERKINS ORD GBPO. 10	139.00	2 886.90	0.00
GBP	UNILEVER PLC ORD GBPO. 031111	1 013.00	57 621.47	0.04
GBP	UNITED UTILITIES G ORD GBPO. 05	554.00	5 814.08	0.00
GBP	VODAFONE GROUP ORD USD0. 2095238(POST CONS)	21 105.00	67 407.77	0.04
GBP	WEIR GROUP ORD GBPO. 125	120.00	3 769.57	0.00
GBP	WHITBREAD ORD GBPO. 76797385	174.00	9 603.02	0.01
USD	WILLIS TOWERS WATS COM USD0. 000304635	86.00	13 800.42	0.01
GBP	WPP PLC ORD GBPO. 10	794.00	14 430.00	0.01
イギリス合計			1 890 015.84	1.18

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
アメリカ合衆国			
USD 3M CO COM	487.00	121 993.50	0.08
USD ABBOTT LABS COM	1 472.00	91 499.52	0.06
USD ABBVIE INC COM USD0.01	1 316.00	147 681.52	0.09
USD ACTIVISION BLIZZAR COM STK USD0.000001	627.00	46 479.51	0.03
USD ACUITY BRANDS INC COM STK USD0.01	28.00	4 324.32	0.00
USD ADOBE SYSTEMS INC COM USD0.0001	408.00	81 502.08	0.05
USD ADVANCE AUTO PARTS INC COM	98.00	11 465.02	0.01
USD ADVANCED MICRO DEV COM USD0.01	970.00	13 327.80	0.01
USD AES CORP COM	400.00	4 624.00	0.00
USD AETNA INC COM USD0.01	299.00	55 859.18	0.03
USD AFLAC INC COM USD0.10	369.00	32 545.80	0.02
USD AGCO CORP COM USD0.01	136.00	9 876.32	0.01
USD AGILENT TECHNOLOGIES INC COM	346.00	25 406.78	0.02
USD AGNC INV CORP COM USD0.01	200.00	3 758.00	0.00
USD AIR PRODS & CHEMS COM USD1	154.00	25 928.98	0.02
USD AKAMAI TECHNOLOGIES INC COM	100.00	6 699.00	0.00
USD ALBEMARLE CORP COM USD0.01	100.00	11 159.00	0.01
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQ INC COM	71.00	9 208.70	0.01
USD ALEXION PHARMACEUT COM USD0.0001	155.00	18 494.60	0.01
USD ALIGN TECHNOLOGY INC COM	53.00	13 886.00	0.01
USD ALLERGAN PLC COM USD0.0001	283.00	51 013.58	0.03
USD ALLIANCE DATA SYST COM USD0.01	51.00	13 089.66	0.01
USD ALLIANT ENERGY CORP COM	156.00	6 201.00	0.00
USD ALLSTATE CORP COM	346.00	34 174.42	0.02
USD ALLY FINANCIAL INC COM USD0.01	300.00	8 931.00	0.01
USD ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC COM	100.00	12 998.00	0.01
USD ALPHABET INC CAP STK USD0.001 CL C	254.00	297 164.76	0.18
USD ALPHABET INC CAP STK USD0.001 CL A	241.00	284 915.02	0.18
USD ALTRIA GROUP INC COM USD0.333333	1 589.00	111 770.26	0.07
USD AMAZON COM INC COM USD0.01	334.00	484 597.26	0.30
USD AMER ELEC PWR INC COM USD6.50	421.00	28 956.38	0.02
USD AMER EXPRESS CO COM USD0.20	661.00	65 703.40	0.04
USD AMER FINL GP OHIO COM NPV	96.00	10 880.64	0.01
USD AMER INTL GRP COM USD2.50	822.00	52 542.24	0.03
USD AMER TOWER CORP COM NEW USD0.01	347.00	51 251.90	0.03
USD AMEREN CORP COM	267.00	15 120.21	0.01
USD AMERICAN AIRLINES COM USD1	59.00	3 204.88	0.00
USD AMERICAN WATER WOR COM STK USD0.01	101.00	8 400.17	0.01
USD AMERIPRISE FINL INC COM	115.00	19 400.50	0.01
USD AMERISOURCEBERGEN COM STK USD0.01	173.00	17 242.91	0.01
USD AMETEK INC COM USD0.01	256.00	19 532.80	0.01
USD AMGEN INC COM USD0.0001	606.00	112 746.30	0.07
USD AMPHENOL CORP NEW CL A	310.00	28 758.70	0.02
USD ANADARKO PETROLEUM COM USD0.10	411.00	24 680.55	0.02
USD ANALOG DEVICES INC COM	338.00	31 055.44	0.02
USD ANDEAVOR COM USD0.1666	100.00	10 816.00	0.01
USD ANNALY CAPITAL MAN COM USD0.01	500.00	5 270.00	0.00
USD ANSYS INC COM	78.00	12 608.70	0.01
USD ANTERO RES CORP USD0.01	200.00	3 886.00	0.00
USD ANTHEM INC COM USD0.01	211.00	52 296.35	0.03
USD APACHE CORP COM USD0.625	476.00	21 358.12	0.01
USD APPLE INC COM NPV	4 239.00	709 735.77	0.44
USD APPLIED MATLS INC COM	933.00	50 036.79	0.03
USD ARAMARK COM USD0.01	200.00	9 162.00	0.01
USD ARCHER DANIELS MIDLAND CO COM	587.00	25 211.65	0.02
USD ARCONIC INC COM USD1.00	276.00	8 296.56	0.00
USD ARROW ELECTRS INC COM	113.00	9 191.42	0.01
USD ASSURANT INC COM	63.00	5 763.24	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD AT&T INC COM USD1	4 994.00	187 025.30	0.12
USD ATHENE HOLDING LTD COM USD0.001 CL A	196.00	9 831.36	0.01
USD ATMOS ENERGY CORP COM	100.00	8 290.00	0.00
USD AUTO DATA PROCESS COM USD0.10	374.00	46 237.62	0.03
USD AUTODESK INC COM USD0.01	130.00	15 030.60	0.01
USD AUTONATION INC COM	107.00	6 443.54	0.00
USD AUTOZONE INC COM USD0.01	10.00	7 654.40	0.00
USD AVALONBAY COMMUNI COM USD0.01	103.00	17 551.20	0.01
USD AVERY DENNISON CORP COM	81.00	9 937.08	0.01
USD AVNET INC COM	95.00	4 037.50	0.00
USD AXALTA COATING SYS COM USD1.00	200.00	6 300.00	0.00
USD BAKER HUGHES A GE COM USD0.0001 CL A	309.00	9 934.35	0.01
USD BALL CORP COM NPV	222.00	8 498.16	0.00
USD BAXTER INTL INC COM USD1	461.00	33 205.83	0.02
USD BB&T CORP COM USD5	626.00	34 548.94	0.02
USD BECTON DICKINSON COM USD1	193.00	46 887.42	0.03
USD BERKLEY(WR)CORP COM USD0.20	100.00	7 298.00	0.00
USD BERKSHIRE HATHAWAY CLASS' B' COM USD0.0033	1 059.00	227 028.42	0.14
USD BEST BUY CO INC COM USD0.10	313.00	22 867.78	0.01
USD BIOGEN INC COM STK USD0.0005	171.00	59 475.51	0.04
USD BIOMARIN PHARMA COM USD0.001	100.00	9 023.00	0.01
USD BK OF AMERICA CORP COM USD0.01	8 194.00	262 208.00	0.16
USD BK OF NY MELLON CP COM STK USD0.01	942.00	53 411.40	0.03
USD BLACKROCK INC COM STK USD0.01	79.00	44 382.20	0.03
USD BLOCK(H&R)INC COM NPV	200.00	5 308.00	0.00
USD BOEING CO COM USD5	456.00	161 592.72	0.10
USD BORG WARNER INC COM	295.00	16 596.70	0.01
USD BOSTON PPTYS INC COM USD0.01	117.00	14 474.07	0.01
USD BOSTON SCIENTIFIC COM USD0.01	1 000.00	27 960.00	0.02
USD BRISTOL-MYRS SQUIB COM STK USD0.10	1 365.00	85 449.00	0.05
USD BRIXMOR PROPERTY G COM USD0.01	263.00	4 268.49	0.00
USD BROADRIDGE FIN SOL COM STK USD0.01	109.00	10 508.69	0.01
USD BROWN FORMAN CORP CL B	140.00	9 702.00	0.01
USD BUNGE LIMITED COM USD0.01	131.00	10 405.33	0.01
USD CA INC COM USD0.10	182.00	6 524.70	0.00
USD CABOT OIL & GAS CO COM USD0.10	497.00	13 095.95	0.01
USD CADENCE DESIGN SYS COM USD0.01	369.00	16 553.34	0.01
USD CAMPBELL SOUP CO CAP USD0.0375	91.00	4 236.05	0.00
USD CAPITAL ONE FINL COM USD0.01	426.00	44 286.96	0.03
USD CARDINAL HEALTH INC COM	343.00	24 623.97	0.01
USD CARMAX INC COM USD0.50	117.00	8 350.29	0.01
USD CARNIVAL CORP COM USD0.01(PAIRED STOCK)	363.00	25 994.43	0.02
USD CATERPILLAR INC DEL COM	491.00	79 924.98	0.05
USD CBOE GLOBAL MARKET COM USD0.01	106.00	14 245.34	0.01
USD CBRE GROUP INC CLASS 'A' USD0.01	364.00	16 631.16	0.01
USD CBS CORP NEW CL B	232.00	13 365.52	0.01
USD CDK GLOBAL INC COM USD0.01	100.00	7 129.00	0.00
USD CDW CORP COM USD0.01	100.00	7 479.00	0.00
USD CELANESE CORP COM SERIES 'A' USD0.0001	100.00	10 816.00	0.01
USD CELGENE CORP COM USD0.01	661.00	66 866.76	0.04
USD CENTENE CORP DEL COM	100.00	10 724.00	0.01
USD CENTERPOINT ENERGY INC COM	521.00	14 681.78	0.01
USD CENTURYLINK INC COM	906.00	16 135.86	0.01
USD CERNER CORP COM	198.00	13 687.74	0.01
USD CF INDS HLDGS INC COM	339.00	14 387.16	0.01
USD CH ROBINSON WORLDW COM USD0.1	100.00	9 146.00	0.01
USD CHARTER COMMUN INC COM USD0.001 CLASS 'A'	137.00	51 683.25	0.03
USD CHENIERE ENERGY INC COM NEW	100.00	5 656.00	0.00
USD CHEVRON CORP COM USD0.75	1 542.00	193 289.70	0.12

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC CL A	24.00	7 794.24	0.00
USD CHURCH & DWIGHT INC COM	154.00	7 522.90	0.00
USD CIGNA CORP COM USD0.25	213.00	44 378.55	0.03
USD CIMAREX ENERGY CO COM USD0.01	36.00	4 039.20	0.00
USD CINCINNATI FINL CORP COM	100.00	7 690.00	0.00
USD CINTAS CORP COM	44.00	7 411.80	0.00
USD CISCO SYSTEMS COM USD0.001	4 227.00	175 589.58	0.11
USD CIT GROUP INC COM NEW USD0.01	100.00	5 069.00	0.00
USD CITIGROUP INC COM USD0.01	2 254.00	176 893.92	0.11
USD CITIZENS FINL GP COM USD0.01	400.00	18 360.00	0.01
USD CITRIX SYSTEMS INC COM USD0.001	100.00	9 276.00	0.01
USD CLOROX CO DEL COM	100.00	14 169.00	0.01
USD CME GROUP INC COM STK USD0.01 CLASS' A'	274.00	42 053.52	0.03
USD CMS ENERGY CORP COM	184.00	8 234.00	0.00
USD COCA-COLA CO COM USD0.25	3 255.00	154 905.45	0.10
USD COGNEX CORP COM	200.00	12 474.00	0.01
USD COGNIZANT TECHNOLO COM CL' A' USD0.01	547.00	42 655.06	0.03
USD COLGATE-PALMOLIVE COM USD1	646.00	47 959.04	0.03
USD COLONY NORTHSTAR COM USD0.001 CL A	813.00	7 300.74	0.00
USD COMCAST CORP COM CLS' A' USD0.01	3 941.00	167 610.73	0.10
USD COMERICA INC COM	202.00	19 234.44	0.01
USD COMMSCOPE HLDG CO COM USD0.01	258.00	9 966.54	0.01
USD CONAGRA BRANDS IN COM USD5	477.00	18 126.00	0.01
USD CONCHO RES INC COM STK USD0.001	102.00	16 058.88	0.01
USD CONOCOPHILLIPS COM USD0.01	1 028.00	60 456.68	0.04
USD CONSOLIDATED EDISON INC COM	313.00	25 152.68	0.02
USD CONSTELLATION BRDS CLASS' A' COM USD0.01	124.00	27 214.28	0.02
USD CONTINENTAL RES IN COM STK USD0.01	144.00	7 996.32	0.00
USD CORNING INC COM USD0.50	708.00	22 103.76	0.01
USD COSTCO WHSL CORP NEW COM	357.00	69 568.59	0.04
USD COTY INC COM USD0.01 CL 'A'	503.00	9 863.83	0.01
USD CROWN CASTLE INTL COM USD0.01	334.00	37 665.18	0.02
USD CROWN HOLDINGS INC COM USD5	100.00	5 805.00	0.00
USD CSX CORP COM USD1	780.00	44 280.60	0.03
USD CUMMINS INC COM	153.00	28 764.00	0.02
USD CVS HEALTH CORP COM STK USD0.01	842.00	66 256.98	0.04
USD D R HORTON INC COM	368.00	18 050.40	0.01
USD DANAHER CORP COM USD0.01	533.00	53 982.24	0.03
USD DARDEN RESTAURANTS INC COM	159.00	15 240.15	0.01
USD DAVITA INC COM USD0.001	100.00	7 804.00	0.00
USD DEERE & CO COM USD1	232.00	38 609.44	0.02
USD DELL TECHNOLOGIES COM USD0.01 CL V	145.00	10 396.50	0.01
USD DELTA AIRLINES INC COM USD0.0001	107.00	6 074.39	0.00
USD DENTSPLY SIRONA IN COM NPV	250.00	15 202.50	0.01
USD DEVON ENERGY CORP NEW COM	582.00	24 077.34	0.01
USD DIGITAL REALTY TRU COM STK USD0.01	160.00	17 912.00	0.01
USD DISCOVER FINL SVCS COM STK USD0.01	384.00	30 643.20	0.02
USD DISCOVERY COMMUNIC COM CL A USD0.01	55.00	1 378.85	0.00
USD DISCOVERY COMMUNIC COM CL C USD0.01	155.00	3 698.30	0.00
USD DISH NETWORK CORPO CLASS' A' COM USD0.01	199.00	9 333.10	0.01
USD DOLLAR GENERAL CP COM USD0.875	232.00	23 923.84	0.01
USD DOLLAR TREE INC	239.00	27 485.00	0.02
USD DOMINION ENERGY IN COM STK NPV	512.00	39 137.28	0.02
USD DOMINOS PIZZA INC COM USD0.01	54.00	11 709.90	0.01
USD DOVER CORP COM	100.00	10 621.00	0.01
USD DOWDUPONT INC COM USD0.01	1 941.00	146 700.78	0.09
USD DR PEPPER SNAPPLE COM STK USD0.01	162.00	19 334.70	0.01
USD DTE ENERGY CO COM	110.00	11 620.40	0.01
USD DUKE ENERGY CORP COM USD0.001 (POST REV SPLT)	540.00	42 390.00	0.03

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD DUKE REALTY CORP COM USD0.01	280.00	7 394.80	0.00
USD DXC TECHNOLOGY CO COM USD0.01	236.00	23 493.80	0.01
USD E TRADE FINANCIAL COM USD0.01	200.00	10 540.00	0.01
USD EAST WEST BANCORP INC COM	167.00	11 006.97	0.01
USD EASTMAN CHEM CO COM	90.00	8 926.20	0.01
USD EATON VANCE CORP COM NON VTG	100.00	5 780.00	0.00
USD EBAY INC COM USD0.001	982.00	39 849.56	0.02
USD ECOLAB INC COM	205.00	28 224.40	0.02
USD EDISON INTL COM	217.00	13 569.01	0.01
USD EDWARDS LIFESCIENCES CORP COM	218.00	27 594.44	0.02
USD ELECTRONIC ARTS INC COM	292.00	37 072.32	0.02
USD ELI LILLY AND CO COM NPV	823.00	67 033.35	0.04
USD EMERSON ELEC CO COM	570.00	41 171.10	0.03
USD ENTERGY CORP NEW COM	118.00	9 285.42	0.01
USD ENVISION HEALTHCAR COM USD0.01	100.00	3 599.00	0.00
USD EOG RESOURCES INC COM USD0.01	482.00	55 430.00	0.03
USD EQT CORPORATION	275.00	14 929.75	0.01
USD EQUIFAX INC COM	59.00	7 370.87	0.00
USD EQUINIX INC COM USD0.001 NEW	43.00	19 573.17	0.01
USD EQUITY RESIDENTIAL SBI USD0.01	361.00	22 241.21	0.01
USD ESSEX PROP TRUST COM USD0.0001	46.00	10 717.08	0.01
USD ESTEE LAUDER COS CLASS' A' COM USD0.01	225.00	30 366.00	0.02
USD EVERSOURCE ENERGY COM USD5	361.00	22 775.49	0.01
USD EXELON CORP COM NPV	820.00	31 578.20	0.02
USD EXPEDIA INC COM USD0.001 (POST-SPLIT)	142.00	18 177.42	0.01
USD EXPEDTRS INTL WASH COM USD0.01	100.00	6 495.00	0.00
USD EXPRESS SCRIPTS HL COM USD0.01	544.00	43 073.92	0.03
USD EXTRA SPACE STORAG COM USD0.01	95.00	7 930.60	0.00
USD EXXON MOBIL CORP COM NPV	3 479.00	303 716.70	0.19
USD F M C CORP COM NEW	56.00	5 114.48	0.00
USD F5 NETWORK INC COM STK NPV	43.00	6 215.22	0.00
USD FACEBOOK INC COM USD0.000006 CL 'A'	1 972.00	368 547.08	0.23
USD FASTENAL CO COM	175.00	9 618.00	0.01
USD FEDERAL REALTY INVT TR SH BEN INT NEW	42.00	5 073.60	0.00
USD FEDEX CORP COM USD0.10	170.00	44 621.60	0.03
USD FIDELITY NATL FINL FNF GROUP COM USD0.0001	200.00	7 796.00	0.00
USD FIDELITY NATL INF COM STK USD0.01	317.00	32 448.12	0.02
USD FIFTH THIRD BANCORP COM	730.00	24 163.00	0.01
USD FIRST DATA CORP COM CL A	677.00	11 982.90	0.01
USD FIRST REPUBLIC BAN COM USD0.01	100.00	8 955.00	0.01
USD FIRSTENERGY CORP COM USD0.10	543.00	17 864.70	0.01
USD FISERV INC COM USD0.01	200.00	28 168.00	0.02
USD FLEETCOR TECHNOLOG COM STK USD0.001	64.00	13 600.00	0.01
USD FLIR SYS INC COM	100.00	5 121.00	0.00
USD FLOWSERVE CORP COM	66.00	2 991.12	0.00
USD FLUOR CORP NEW COM	100.00	6 070.00	0.00
USD FORD MOTOR CO COM STK USD0.01	2 510.00	27 534.70	0.02
USD FORTINET INC COM USD0.001	200.00	9 208.00	0.01
USD FORTIVE CORP COM USD0.01	200.00	15 204.00	0.01
USD FORTUNE BRANDS HOME USD0.01 WI	139.00	9 859.27	0.01
USD FRANKLIN RES INC COM	426.00	18 066.66	0.01
USD FREEPORT-MCMORAN COM STK USD0.10	1 198.00	23 361.00	0.01
USD GALLAGHER ARTHUR J & CO COM	164.00	11 204.48	0.01
USD GAP INC DEL COM	104.00	3 456.96	0.00
USD GARTNER INC COM	100.00	13 874.00	0.01
USD GEN DYNAMICS CORP COM USD1	184.00	40 936.32	0.03
USD GEN ELEC CO COM USD0.06	7 127.00	115 243.59	0.07
USD GENERAL MLS INC COM	565.00	33 046.85	0.02
USD GENERAL MOTORS CO COM USD0.01	1 120.00	47 499.20	0.03

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD GENUINE PARTS CO COM STK USD1	100.00	10 407.00	0.01
USD GGP INC COM USD0.01	443.00	10 202.29	0.01
USD GILEAD SCIENCES COM USD0.001	1 111.00	93 101.80	0.06
USD GLOBAL PAYMENTS COM NPV	100.00	11 178.00	0.01
USD GOLDMAN SACHS GRP COM USD0.01	306.00	81 974.34	0.05
USD GOODYEAR TIRE&RUBR COM NPV	200.00	6 964.00	0.00
USD GRACE W R & CO DEL NEW COM	100.00	7 382.00	0.00
USD GRAINGER W W INC COM	49.00	13 213.34	0.01
USD HALLIBURTON COM STK USD2.50	862.00	46 289.40	0.03
USD HANESBRANDS INC COM	200.00	4 344.00	0.00
USD HARLEY DAVIDSON INC COM	100.00	4 846.00	0.00
USD HARRIS CORP COM STK USD1	81.00	12 909.78	0.01
USD HARTFORD FINL SVCS COM USD0.01	240.00	14 102.40	0.01
USD HASBRO INC COM	105.00	9 929.85	0.01
USD HCA HEALTHCARE INC COM USD0.01	219.00	22 154.04	0.01
USD HCP INC COM USD1	314.00	7 561.12	0.00
USD HD SUPPLY INC COM USD0.01	260.00	10 111.40	0.01
USD HELMERICH & PAYNE INC COM	100.00	7 203.00	0.00
USD HENRY JACK & ASSOC COM USD0.01	85.00	10 596.10	0.01
USD HERSHEY CO COM	68.00	7 502.44	0.00
USD HESS CORPORATION COM USD1	180.00	9 091.80	0.01
USD HEWLETT PACKARD EN COM USD0.01	1 177.00	19 302.80	0.01
USD HILTON WORLDWIDE H COM USD0.01	133.00	11 391.45	0.01
USD HOLLYFRONTIER CORP COM USD0.01	88.00	4 220.48	0.00
USD HOLOGIC INC COM USD0.01	195.00	8 326.50	0.00
USD HOME DEPOT INC COM USD0.05	968.00	194 471.20	0.12
USD HONEYWELL INTL INC COM	584.00	93 247.28	0.06
USD HORMEL FOODS CORP COM USD0.0586	196.00	6 728.68	0.00
USD HOST HOTELS & RESO COM STK USD0.01	873.00	18 123.48	0.01
USD HP INC COM USD0.01	1 451.00	33 837.32	0.02
USD HUMANA INC COM USD0.166	90.00	25 364.70	0.02
USD HUNT J B TRANS SVCS INC COM	100.00	12 083.00	0.01
USD HUNTINGTON BANCSHARES INC COM	747.00	12 086.46	0.01
USD IDEXX LABORATORIES COM USD0.10	100.00	18 704.00	0.01
USD ILLINOIS TOOL WKS COM NPV	204.00	35 428.68	0.02
USD ILLUMINA INC COM USD0.01	81.00	18 843.84	0.01
USD INCYTE CORPORATION COM USD0.001	100.00	9 029.00	0.01
USD INGERSOLL-RAND PLC SHS USD1	184.00	17 411.92	0.01
USD INGREDION INC COM USD0.01	45.00	6 463.80	0.00
USD INTEL CORP COM USD0.001	3 811.00	183 461.54	0.11
USD INTERCONTINENTAL E COM USD0.01	552.00	40 759.68	0.03
USD INTERNATIONAL FLAVORS&FRAGRANC COM	46.00	6 913.80	0.00
USD INTERPUBLIC GROUP COM USD0.10	400.00	8 756.00	0.01
USD INTL BUSINESS MCHN COM USD0.20	735.00	120 319.50	0.07
USD INTL PAPER CO COM	414.00	26 024.04	0.02
USD INTUIT INC COM USD0.01	198.00	33 244.20	0.02
USD INTUITIVE SURGICAL COM USD0.001	72.00	31 080.24	0.02
USD INVESCO LTD COM STK USD0.20	514.00	18 570.82	0.01
USD INVITATION HOMES I COM USD0.01	500.00	11 245.00	0.01
USD IQVIA HOLDINGS INC COM USD0.01	138.00	14 102.22	0.01
USD IRON MTN INC NEW COM NPV	374.00	13 101.22	0.01
USD JACOBS ENG GROUP COM USD1	100.00	6 946.00	0.00
USD JOHNSON & JOHNSON COM USD1	2 200.00	304 018.00	0.19
USD JOHNSON CTLS INTL COM USD0.01	824.00	32 243.12	0.02
USD JP MORGAN CHASE & COM USD1	2 904.00	335 905.68	0.21
USD JUNIPER NETWORKS COM USD0.00001	200.00	5 230.00	0.00
USD KANSAS CITY STHN I COM USD0.01	48.00	5 430.24	0.00
USD KELLOGG CO COM USD0.25	170.00	11 578.70	0.01
USD KEYCORP NEW COM	1 003.00	21 464.20	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD KIMBERLY CLARK CORP COM	271.00	31 707.00	0.02
USD KIMCO REALTY COM USD0.01	300.00	4 773.00	0.00
USD KINDER MORGAN INC USD0.01	1 173.00	21 090.54	0.01
USD KLA-TENCOR CORP COM USD0.001	103.00	11 309.40	0.01
USD KNIGHT SWIFT TRANS CL A COM STK USD0.01	200.00	9 958.00	0.01
USD KOHLS CORPORATION COM USD0.01	100.00	6 477.00	0.00
USD KRAFT HEINZ CO COM USD0.01	520.00	40 762.80	0.03
USD KROGER CO COM USD1	950.00	28 842.00	0.02
USD L BRANDS INC COM USD0.50	174.00	8 715.66	0.01
USD L3 TECHNOLOGIES IN COM USD0.01	53.00	11 260.38	0.01
USD LAB CORP AMER HLDG COM USD0.1	101.00	17 624.50	0.01
USD LAM RESEARCH CORP COM USD0.001	105.00	20 109.60	0.01
USD LAS VEGAS SANDS CORP COM	369.00	28 604.88	0.02
USD LEAR CORP COM USD0.01	53.00	10 236.42	0.01
USD LEGGETT & PLATT IN COM USD0.01	100.00	4 651.00	0.00
USD LEIDOS HLDGS INC COM USD0.0001	154.00	10 256.40	0.01
USD LENNAR CORP COM CL' A' USD0.10	273.00	17 106.18	0.01
USD LEUCADIA NATL CORP COM	228.00	6 171.96	0.00
USD LIBERTY BROADBAND COM USD0.01 CL 'C'	100.00	9 555.00	0.01
USD LIBERTY INTERACTIVE CORP COM SER A	300.00	8 427.00	0.01
USD LIBERTY MEDIA CORP COM USD0.01 SER A SIRIUSXM	169.00	7 606.69	0.00
USD LIBERTY MEDIA CORP COM USD0.01 SER C SIRIUSXM	200.00	8 962.00	0.01
USD LIBERTY MEDIA CORP COM USD0.01 SER C FORMULA	300.00	11 307.00	0.01
USD LINCOLN NATL CORP COM NPV	187.00	15 483.60	0.01
USD LIVE NATION INC COM	300.00	13 518.00	0.01
USD LKQ CORP COM	200.00	8 406.00	0.01
USD LOCKHEED MARTIN CORP COM	201.00	71 324.85	0.04
USD LOEWS CORP COM	202.00	10 433.30	0.01
USD LOWE' S COS INC COM USD0.50	708.00	74 148.84	0.05
USD LYONDELLBASELL IND COM USD0.01	331.00	39 667.04	0.02
USD M & T BANK CORP COM USD0.50	110.00	20 985.80	0.01
USD MACERICH CO COM USD0.01	100.00	6 457.00	0.00
USD MACQUARIE INFR LLC LIMITED LIABILITY INTEREST	152.00	10 085.20	0.01
USD MACY' S INC COM STK USD0.01	196.00	5 086.20	0.00
USD MANPOWER GROUP COM USD0.01	37.00	4 861.43	0.00
USD MARATHON OIL CORP COM USD1	571.00	10 386.49	0.01
USD MARATHON PETROLEUM COM USD0.01	492.00	34 080.84	0.02
USD MARRIOTT INTL INC COM USD0.01 CLASS 'A'	277.00	40 813.18	0.03
USD MARSH & MCLENNAN COM USD1	474.00	39 588.48	0.02
USD MARTIN MARIETTA M. COM USD0.01	49.00	11 180.33	0.01
USD MASCO CORP COM	200.00	8 932.00	0.01
USD MASTERCARD INC COM USD0.0001 CLASS 'A'	780.00	131 820.00	0.08
USD MATTEL INC COM USD1	228.00	3 611.52	0.00
USD MAXIM INTEGRATED COM USD0.001	143.00	8 723.00	0.01
USD MCCORMICK & CO INC COM N/VTG NPV	100.00	10 877.00	0.01
USD MCDONALD' S CORP COM USD0.01	669.00	114 492.66	0.07
USD MCKESSON CORP COM USD0.01	167.00	28 202.96	0.02
USD MEDTRONIC PLC USD0.0001	1 152.00	98 945.28	0.06
USD MERCK & CO INC COM USD0.50	2 249.00	133 253.25	0.08
USD METLIFE INC COM USD0.01	797.00	38 311.79	0.02
USD MGM RESORTS INTL COM STK USD0.01	529.00	19 282.05	0.01
USD MICROCHIP TECHN LGY COM USD0.001	231.00	21 995.82	0.01
USD MICRON TECHNOLOGY COM USD0.10	903.00	39 479.16	0.02
USD MICROSOFT CORP COM USD0.0000125	6 001.00	570 155.01	0.35
USD MID-AMER APARTMENT COM STK USD0.01	80.00	7 629.60	0.00
USD MIDDLEBY CORP COM	76.00	10 355.76	0.01
USD MOHAWK INDS COM USD0.01	29.00	8 150.74	0.01
USD MOLSON COORS BREWI CLASS 'B' USD0.01	235.00	19 744.70	0.01
USD MONDELEZ INTL INC COM USD0.01	1 303.00	57 853.20	0.04

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD MONSANTO COM STK USD0.01	372.00	45 309.60	0.03
USD MONSTER BEV CORP USD0.005(NEW)	406.00	27 701.38	0.02
USD MOODYS CORP COM USD0.01	92.00	14 884.68	0.01
USD MORGAN STANLEY COM STK USD0.01	1 194.00	67 520.70	0.04
USD MOSAIC CO COM USD0.01	251.00	6 852.30	0.00
USD MOTOROLA SOLUTIONS INCCOM USD0.01	107.00	10 642.22	0.01
USD MSCI INC COM STK USS0.01	100.00	13 923.00	0.01
USD MYLAN NV EURO.01	300.00	12 855.00	0.01
USD NASDAQ INC COM STK USD0.01	100.00	8 091.00	0.00
USD NATIONAL OILWELL VARCO INC COM	250.00	9 170.00	0.01
USD NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	267.00	10 594.56	0.01
USD NETAPP INC COM USD0.001	219.00	13 468.50	0.01
USD NETFLIX INC COM USD0.001	356.00	96 226.80	0.06
USD NEW YORK CMNTY BANCORP INC COM	501.00	7 094.16	0.00
USD NEWELL BRANDS INC COM USD1	608.00	16 075.52	0.01
USD NEWFIELD EXPL CO COM	175.00	5 540.50	0.00
USD NEWMONT MINING CP COM USD1.60	431.00	17 459.81	0.01
USD NEWS CORP NEW COM USD0.01 CL' A'	123.00	2 104.53	0.00
USD NEXTERA ENERGY INC COM USD0.01	343.00	54 338.06	0.03
USD NIELSEN HLDGS PLC COM EURO.07	274.00	10 250.34	0.01
USD NIKE INC CLASS' B' COM NPV	1 106.00	75 451.32	0.05
USD NISOURCE INC COM NPV	387.00	9 551.16	0.01
USD NOBLE ENERGY INC COM USD0.01	339.00	10 346.28	0.01
USD NORDSTROM INC COM NPV	100.00	4 931.00	0.00
USD NORFOLK STHN CORP COM USD1	256.00	38 625.28	0.02
USD NORTHERN TRUST CP COM USD1.666	233.00	24 555.87	0.02
USD NORTHROP GRUMMAN COM USD1	102.00	34 734.06	0.02
USD NORWEGIAN CRUISE L COM USD0.001	100.00	6 074.00	0.00
USD NUCOR CORP COM	368.00	24 641.28	0.02
USD NVIDIA CORP COM USD0.001	489.00	120 196.20	0.07
USD OCCIDENTAL PETRLM COM USD0.20	656.00	49 180.32	0.03
USD OGE ENERGY CORP COM USD0.01	100.00	3 220.00	0.00
USD OLD DOMINION FGHT LINES INC COM	100.00	14 645.00	0.01
USD OMNICOM GROUP INC COM USD0.15	263.00	20 158.95	0.01
USD ONEOK INC	351.00	20 659.86	0.01
USD ORACLE CORP COM USD0.01	2 564.00	132 276.76	0.08
USD OREILLY AUTO NEW COM USD0.01	70.00	18 528.30	0.01
USD OWENS CORNING COM STK USD0.01	100.00	9 297.00	0.01
USD PACCAR INC COM STK USD1	357.00	26 617.92	0.02
USD PACKAGING CORP AMER COM	100.00	12 563.00	0.01
USD PALO ALTO NETWORKS COM USD0.0001	70.00	11 050.90	0.01
USD PARKER-HANNIFIN COM STK USD0.50	100.00	20 142.00	0.01
USD PARSLEY ENERGY INC COM USD0.01 CL' A'	373.00	8 802.80	0.01
USD PAYCHEX INC COM	348.00	23 751.00	0.01
USD PAYPAL HOLDINGS IN COM USD0.0001	977.00	83 357.64	0.05
USD PEOPLE' S UNITED FINANCIAL INC COM STK USD0.01	414.00	8 143.38	0.01
USD PEPSICO INC CAP USD0.016666	1 165.00	140 149.50	0.09
USD PERRIGO CO LTD COM EURO.001	120.00	10 874.40	0.01
USD PFIZER INC COM USD0.05	4 785.00	177 236.40	0.11
USD PG&E CORP COM	343.00	14 553.49	0.01
USD PHILIP MORRIS INTL COM STK NPV 'WI'	1 274.00	136 611.02	0.08
USD PHILLIPS 66 COM USD0.01	381.00	39 014.40	0.02
USD PINNACLE WEST CAP CORP COM	139.00	11 113.05	0.01
USD PIONEER NATURAL RE COM STK USD0.01	122.00	22 315.02	0.01
USD PNC FINANCIAL SVCS COM USD5	311.00	49 144.22	0.03
USD POLARIS INDS INC COM	100.00	11 301.00	0.01
USD PPG INDS INC COM	183.00	21 727.59	0.01
USD PPL CORP COM USD0.01	485.00	15 456.95	0.01
USD PRAXAIR INC COM USD0.01	189.00	30 521.61	0.02

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)	
USD	PRICELINE.COM INC COM USD0.008	32.00	61 185.60	0.04
USD	PRINCIPAL FINL GP COM USD0.01	195.00	13 182.00	0.01
USD	PROCTER & GAMBLE COM NPV	2 104.00	181 659.36	0.11
USD	PROGRESSIVE CP(OH) COM USD1	596.00	32 243.60	0.02
USD	PROLOGIS INC COM USD0.01	480.00	31 252.80	0.02
USD	PRUDENTIAL FINL COM USD0.01	377.00	44 795.14	0.03
USD	PUBLIC STORAGE COM USD0.10	106.00	20 750.56	0.01
USD	PUBLIC SVC ENTERPRISE GROUP COM	494.00	25 623.78	0.02
USD	PULTE GROUP INC COM USD0.01	160.00	5 092.80	0.00
USD	PVH CORP COM USD1	34.00	5 272.72	0.00
USD	QORVO INC COM USD 0.0001	100.00	7 177.00	0.00
USD	QUALCOMM INC COM USD0.0001	1 211.00	82 650.75	0.05
USD	QUEST DIAGNOSTICS INC COM	114.00	12 063.48	0.01
USD	RALPH LAUREN CORP CLASS 'A' COM USD0.01	27.00	3 086.37	0.00
USD	RANGE RES CORP COM USD0.01	100.00	1 425.00	0.00
USD	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC COM	100.00	9 639.00	0.01
USD	RAYTHEON CO COM NEW	231.00	48 265.14	0.03
USD	REALTY INCOME CORP	332.00	17 659.08	0.01
USD	RED HAT INC COM	191.00	25 093.58	0.02
USD	REGENCY CENTERS COM USD0.01	103.00	6 479.73	0.00
USD	REGENERON PHARMACEUTICALS COM	65.00	23 832.25	0.01
USD	REGIONS FINANCIAL CORP NEW COM	1 081.00	20 787.63	0.01
USD	REPUBLIC SERVICES COM USD0.01	200.00	13 760.00	0.01
USD	RESMED INC COM USD0.004	100.00	10 079.00	0.01
USD	ROBERT HALF INTL COM USD0.001	100.00	5 788.00	0.00
USD	ROCKWELL AUTOMATIO COM USD1	80.00	15 783.20	0.01
USD	ROCKWELL COLLINS INC COM	131.00	18 142.19	0.01
USD	ROLLINS INC COM	215.00	10 608.10	0.01
USD	ROPER TECHNOLOGIES COM USD0.01	68.00	19 080.12	0.01
USD	ROSS STORES INC COM USD0.01	319.00	26 282.41	0.02
USD	ROYAL CARIBBEAN COM USD0.01	110.00	14 690.50	0.01
USD	S&P GLOBAL INC COM USD1	203.00	36 763.30	0.02
USD	SABRE CORP COM USD0.01	200.00	4 154.00	0.00
USD	SALESFORCE.COM INC COM USD0.001	586.00	66 751.26	0.04
USD	SBA COMMUNICATIONS COM USD0.01 CL A	122.00	21 289.00	0.01
USD	SCANA CORP NEW COM	100.00	4 064.00	0.00
USD	SCHEIN HENRY INC COM	134.00	10 141.12	0.01
USD	SCHLUMBERGER COM USD0.01	1 244.00	91 533.52	0.06
USD	SCHWAB(CHARLES)CP COM USD0.01	1 066.00	56 860.44	0.03
USD	SCRIPPS NETWORKS I COM USD0.01 CL A	57.00	5 015.43	0.00
USD	SEALED AIR CORP NEW COM	128.00	6 060.80	0.00
USD	SEATTLE GENETICS I COM USD0.001	190.00	9 937.00	0.01
USD	SEI INVESTMENT COM USD0.01	120.00	9 018.00	0.01
USD	SEMPRA ENERGY COM NPV	170.00	18 193.40	0.01
USD	SERVICENOW INC COM USD0.001	100.00	14 887.00	0.01
USD	SHERWIN-WILLIAMS COM USD1	64.00	26 695.04	0.02
USD	SIMON PROP GROUP COM USD0.0001	255.00	41 659.35	0.03
USD	SKYWORKS SOLUTIONS INC COM	100.00	9 721.00	0.01
USD	SMITH A O COM	164.00	10 951.92	0.01
USD	SMUCKER(JM)CO COM NPV	94.00	11 927.66	0.01
USD	SNAP-ON INC COM USD1	50.00	8 565.50	0.01
USD	SOUTHERN CO COM	790.00	35 636.90	0.02
USD	SOUTHWEST AIRLINES COM USD1	100.00	6 080.00	0.00
USD	SPIRIT AEROSYSTEMS COM STK USD0.01 CLASS 'A'	100.00	10 236.00	0.01
USD	SPLUNK INC COM USD0.001	100.00	9 237.00	0.01
USD	SPRINT CORPORATION COM USD0.01	307.00	1 636.31	0.00
USD	SQUARE INC COM USD0.0000001 CL A	300.00	14 073.00	0.01
USD	SS&C TECH HLDGS COM USD0.01	238.00	11 966.64	0.01
USD	STANLEY BLACK & DE COM USD2.50	126.00	20 944.98	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD STARBUCKS CORP COM USD0.001	1 230.00	69 876.30	0.04
USD STATE STREET CORP COM STK USD1	335.00	36 906.95	0.02
USD STEEL DYNAMICS INC COM	247.00	11 213.80	0.01
USD STERICYCLE INC COM	61.00	4 596.96	0.00
USD STRYKER CORP COM USD0.10	265.00	43 560.70	0.03
USD SUNTRUST BKS INC COM	351.00	24 815.70	0.02
USD SYMANTEC CORP COM	436.00	11 872.28	0.01
USD SYNCHRONY FINANCA COM USD0.001	600.00	23 808.00	0.01
USD SYNOPSIS INC COM USD0.01	106.00	9 816.66	0.01
USD SYSCO CORP COM USD1	502.00	31 560.74	0.02
USD T ROWE PRICE GROUP COM USD0.20	216.00	24 112.08	0.01
USD T-MOBILE US INC COM USD0.0001	308.00	20 050.80	0.01
USD TAKE TWO INTERACTI COM USD0.01	100.00	12 667.00	0.01
USD TAPESTRY INC COM USD0.01	187.00	8 796.48	0.01
USD TARGA RESOURCES CO COM USD0.001	209.00	10 032.00	0.01
USD TARGET CORP COM STK USD0.0833	507.00	38 136.54	0.02
USD TD AMERITRADE HLDG COM USD0.01	136.00	7 587.44	0.00
USD TESLA INC COM USD0.001	107.00	37 911.17	0.02
USD TEXAS INSTRUMENTS COM USD1	748.00	82 033.16	0.05
USD THE CHEMOURS CO COM USD0.30 'WI'	200.00	10 324.00	0.01
USD THERMO FISHER SCIE COM USD1	320.00	71 715.20	0.04
CAD THOMSON-REUTERS CO COM NPV	383.00	16 617.43	0.01
USD TIFFANY & CO NEW COM	129.00	13 757.85	0.01
USD TIME WARNER INC COM USD0.01	687.00	65 505.45	0.04
USD TJX COS INC COM USD1	570.00	45 782.40	0.03
USD TOLL BROS INC COM USD0.01	115.00	5 356.70	0.00
USD TORCHMARK CORP COM	82.00	7 449.70	0.00
USD TOTAL SYSTEM SVCS COM STK USD0.10	132.00	11 729.52	0.01
USD TRACTOR SUPPLY CO COM	100.00	7 625.00	0.00
USD TRANSDIGM GROUP INC COM	32.00	10 141.12	0.01
USD TRANSUNION COM USD0.01	200.00	11 872.00	0.01
USD TRAVELERS CO INC COM NPV	257.00	38 529.44	0.02
USD TRIMBLE INC COM NPV	344.00	15 170.40	0.01
USD TRIPADVISOR INC COM USD0.001	51.00	1 768.17	0.00
USD TWENTY-FIRST CENTU COM USD0.01 CL' A'	1 045.00	38 560.50	0.02
USD TWENTY-FIRST CENTU COM USD0.01 CL' B'	370.00	13 501.30	0.01
USD TWITTER INC COM USD0.000005	500.00	12 905.00	0.01
USD TYSON FOODS INC CL A	292.00	22 224.12	0.01
USD UDR INC	175.00	6 392.75	0.00
USD UGI CORP NEW COM	200.00	9 154.00	0.01
USD ULTA BEAUTY INC COM STK USD0.01	42.00	9 328.20	0.01
USD UNDER ARMOUR INC COM STK USD0.000333 CL A	237.00	3 284.82	0.00
USD UNDER ARMOUR INC COM STK USD0.000333 CL C	201.00	2 582.85	0.00
USD UNION PACIFIC CORP COM USD2.50	653.00	87 175.50	0.05
USD UNITED CONTINENTAL COM USD0.01	46.00	3 119.72	0.00
USD UNITED PARCEL SERVICE INC CL B	544.00	69 262.08	0.04
USD UNITED RENTALS INC COM	40.00	7 244.40	0.00
USD UNITEDHEALTH GRP COM USD0.01	793.00	187 766.54	0.12
USD UNIVERSAL HEALTH S CLASS' B' COM USD0.01	46.00	5 589.00	0.00
USD UNUM GROUP COM USD0.10	172.00	9 148.68	0.01
USD US BANCORP COM USD0.01	1 426.00	81 481.64	0.05
USD UTD TECHNOLOGIES COM USD1	629.00	86 808.29	0.05
USD VALERO ENERGY CORP NEW COM	388.00	37 236.36	0.02
USD VARIAN MEDICAL SYS COM USD1	45.00	5 737.50	0.00
USD VEEVA SYSTEMS INC COM USD0.00001 CL 'A'	177.00	11 126.22	0.01
USD VENTAS INC COM USD0.25	262.00	14 664.14	0.01
USD VEREIT INC COM USD0.001	218.00	1 569.60	0.00
USD VERISIGN INC COM	100.00	11 492.00	0.01
USD VERISK ANALYTICS I CL A USD0.001	100.00	10 005.00	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD VERIZON COMMUN COM USD0.10	3 337.00	180 431.59	0.11
USD VERTEX PHARMACEUTI COM USD0.01	225.00	37 545.75	0.02
USD VF CORP COM NPV	354.00	28 723.56	0.02
USD VIACOM INC NEW CL' B' NON-VTG USD0.001	210.00	7 018.20	0.00
USD VISA INC COM STK USD0.0001	1 529.00	189 947.67	0.12
USD VISTRA ENERGY CORP COM USD0.01	600.00	11 700.00	0.01
USD VMWARE INC COM STK USD0.01 CLASS 'A'	43.00	5 322.97	0.00
USD VORNADO REALTY TR COM USD0.04	111.00	7 956.48	0.00
USD VOYA FINL INC COM USD0.01	200.00	10 382.00	0.01
USD VULCAN MATERIALS COM STK USD1	71.00	9 613.40	0.01
USD WABCO HOLDINGS INC COM STK USD0.01	50.00	7 719.50	0.00
USD WABTEC CORP COM	100.00	8 104.00	0.01
USD WALGREENS BOOTS AL COM USD0.01	755.00	56 821.30	0.03
USD WALMART INC COM USD0.10	1 228.00	130 904.80	0.08
USD WALT DISNEY CO.DISNEY COM USD0.01	1 309.00	142 249.03	0.09
USD WASTE MGMT INC DEL COM	366.00	32 365.38	0.02
USD WATERS CORP COM	40.00	8 624.40	0.01
USD WEC ENERGY GROUP COM USD0.01	235.00	15 110.50	0.01
USD WELLS FARGO & CO COM USD1 2/3	3 873.00	254 765.94	0.16
USD WELLTOWER INC COM USD1	361.00	21 649.17	0.01
USD WESTAR ENERGY INC COM	100.00	5 166.00	0.00
USD WESTERN DIGITAL CORP COM	282.00	25 092.36	0.02
USD WESTERN UN CO COM	221.00	4 594.59	0.00
USD WESTROCK CO COM USD0.01	178.00	11 860.14	0.01
USD WEYERHAEUSER CO COM USD1.25	737.00	27 666.98	0.02
USD WHIRLPOOL CORP COM	73.00	13 243.66	0.01
USD WILLIAMS COS INC COM USD1	769.00	24 138.91	0.01
USD WORKDAY INC COM USD0.001	100.00	11 989.00	0.01
USD WORLDPAY INC COM USD0.00001 CL A	100.00	8 031.00	0.00
GBP WORLDPAY INC COM USD0.00001 CL A	128.96	10 361.07	0.01
USD WYNDHAM WORLDWIDE CORP COM	54.00	6 703.02	0.00
USD WYNN RESORTS LTD COM	82.00	13 578.38	0.01
USD XCEL ENERGY INC COM	546.00	24 919.44	0.02
USD XEROX CORP COM USD1(POST REV SPLT)	175.00	5 972.75	0.00
USD XILINX INC COM USD0.01	178.00	12 997.56	0.01
USD XYLEM INC COM USD0.01 WI	100.00	7 226.00	0.00
USD YUM BRANDS INC COM	333.00	28 168.47	0.02
USD ZAYO GROUP HOLDING COM USD0.001	269.00	9 872.30	0.01
USD ZILLOW GROUP INC COM USD0.0001 CLASS C WI	200.00	8 892.00	0.00
USD ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC COM USD0.01	189.00	24 025.68	0.02
USD ZIONS BANCORP COM NPV	200.00	10 806.00	0.01
USD ZOETIS INC COM USD0.01 CL 'A'	433.00	33 224.09	0.02
アメリカ合衆国合計		20 212 515.01	12.50
無記名株合計		32 515 887.83	20.09
参加証書			
スイス			
CHF SCHINDLER-HLDG AG PTG CERT CHF0.10(POST-SUBD)	41.00	10 294.10	0.01
スイス合計		10 294.10	0.01
参加証書合計		10 294.10	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 割合 (%)
<u>その他の株式</u>			
オランダ			
EUR UNILEVER NV CVA EURO.16	1 432.00	83 219.59	0.05
オランダ合計		83 219.59	0.05
スイス			
CHF ROCHE HLDGS AG GENUSSSCHEINE NPV	579.00	142 912.60	0.09
スイス合計		142 912.60	0.09
イギリス			
GBP BERKELEY GP HLDGS ORD GBP0.05	178.00	10 038.93	0.01
イギリス合計		10 038.93	0.01
アメリカ合衆国			
USD CAMDEN PROP TST SBI USD0.01	69.00	5 972.64	0.00
アメリカ合衆国合計		5 972.64	0.00
その他の株式合計		242 143.76	0.15
<u>優先株式</u>			
ドイツ			
EUR HENKEL AG&CO. KGAA NON-VTG PRF NPV	114.00	15 990.95	0.01
EUR PORSCHE AUTO HL SE NON VTG PRF NPV	72.00	6 673.23	0.01
EUR VOLKSWAGEN AG NON VTG PRF NPV	162.00	35 724.67	0.02
ドイツ合計		58 388.85	0.04
優先株式合計		58 388.85	0.04
<u>記名株式</u>			
フランス			
EUR MICHELIN (CGDE) EUR2	122.00	19 575.22	0.01
フランス合計		19 575.22	0.01
ドイツ			
EUR ADIDAS AG NPV (REGD)	173.00	40 365.91	0.03
EUR ALLIANZ SE NPV (REGD) (VINKULIERT)	359.00	91 010.13	0.06
EUR BASF SE NPV	746.00	87 654.36	0.05
EUR BAYER AG NPV (REGD)	651.00	85 493.85	0.05
EUR BRENTAG AG	229.00	14 897.15	0.01
EUR DAIMLER AG ORD NPV (REGD)	787.00	72 285.28	0.04
EUR DEUTSCHE BANK AG NPV (REGD)	1 879.00	34 629.27	0.02
EUR DEUTSCHE BOERSE AG NPV (REGD)	206.00	26 522.14	0.02
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA ORD NPV (REGD) (VINK)	212.00	7 590.21	0.00
EUR DEUTSCHE POST AG NPV (REGD)	796.00	37 750.86	0.02
EUR DEUTSCHE TELEKOM NPV (REGD)	2 676.00	47 087.48	0.03
EUR E.ON SE NPV	1 940.00	20 443.33	0.01
EUR EVONIK INDUSTRIES NPV	288.00	11 409.08	0.01
EUR HANNOVER RUECKVERS ORD NPV (REGD)	26.00	3 566.08	0.00
EUR INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)	1 031.00	30 067.06	0.02
EUR K&S AG NPV	95.00	2 676.99	0.00
EUR MTU AERO ENGINES H NPV (REGD)	55.00	9 886.89	0.01
EUR MUENCHENER RUECKVE NPV (REGD)	117.00	27 627.43	0.02
EUR OSRAM LICHT AG NPV	141.00	12 358.79	0.01
EUR PROSIEBENSAT1 MED. NPV	215.00	8 246.68	0.01
EUR SIEMENS AG NPV (REGD)	609.00	92 678.12	0.06
GBP TUI AG NPV (REGD)	341.00	7 724.76	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
EUR UNITED INTERNET AG NPV (REGD)	97.00	7 093.18	0.00
EUR VONOVIA SE NPV	511.00	25 278.52	0.02
ドイツ合計		804 343.55	0.50
イスラエル			
ILS MIZRAHI TEFAHOT BK ILS0.01	237.00	4 630.75	0.00
イスラエル合計		4 630.75	0.00
ルクセンブルグ			
EUR TENARIS S. A. USD1	198.00	3 459.39	0.00
ルクセンブルグ合計		3 459.39	0.00
ポルトガル			
EUR EDP ENERGIAS PORTU EUR1 (REGD)	1 538.00	5 420.26	0.00
ポルトガル合計		5 420.26	0.00
スペイン			
EUR BANCO SANTANDER SA EURO.50 (REGD)	13 967.00	104 100.55	0.06
EUR BANKINTER SA EURO.3 (REGD)	926.00	10 684.31	0.01
EUR BBVA (BILB-VIZ-ARG) EURO.49	5 686.00	53 606.68	0.03
スペイン合計		168 391.54	0.10
スイス			
CHF ABB LTD CHF0.12 (REGD)	1 568.00	43 771.09	0.03
CHF ADECCO GROUP AG CHF0.1 (REGD)	91.00	7 498.49	0.00
CHF BALOISE-HLDGS CHF0.1 (REGD)	50.00	8 191.70	0.00
CHF BARRY CALLEBAUT AG CHF7.29 (REGD)	5.00	10 251.72	0.01
USD CHUBB LIMITED ORD CHF24.15	372.00	58 087.80	0.04
CHF CLARIANT CHF4.00 (REGD)	428.00	12 265.40	0.01
GBP COCA-COLA HBC AG ORD CHF6.70	315.00	10 598.40	0.01
CHF CREDIT SUISSE GRP CHF0.04 (REGD)	2 238.00	43 238.47	0.03
CHF DUFREY AG CHF5 (REGD)	57.00	8 872.53	0.01
CHF EMS-CHEMIE HLDG AG CHF0.01 (REGD) (POST RECON)	15.00	11 037.01	0.01
USD GARMIN LTD COM CHF10.00	100.00	6 294.00	0.00
CHF GEBERIT CHF0.10 (REGD)	23.00	10 911.14	0.01
CHF GIVAUDAN AG CHF10	6.00	14 457.83	0.01
CHF JULIUS BAER GRUPPE CHF0.02 (REGD)	155.00	10 654.58	0.01
CHF KUEHNE&NAGEL INTL CHF1 (REGD) (POST-SUBD)	41.00	7 537.54	0.00
CHF LAFARGEHOLCIM LTD CHF2 (REGD)	150.00	9 197.50	0.00
EUR LAFARGEHOLCIM LTD CHF2 (REGD)	160.00	9 840.43	0.01
CHF LONZA GROUP AG CHF1 (REGD)	64.00	17 824.44	0.01
CHF NESTLE SA CHF0.10 (REGD)	2 496.00	215 929.78	0.13
CHF NOVARTIS AG CHF0.50 (REGD)	1 777.00	160 954.60	0.10
CHF PARTNERS GROUP HLG CHF0.01 (REGD)	18.00	14 009.25	0.01
CHF RICHEMONT (CIE FIN) CHF1.00 (REG) SER 'A'	470.00	45 159.64	0.03
CHF SCHINDLER-HLDG AG CHF0.1 (REGD) (POST-SUBD)	45.00	10 969.23	0.01
CHF SGS LTD CHF1 (REGD)	7.00	18 847.89	0.01
CHF SONOVA HOLDING AG	51.00	8 234.83	0.00
CHF STRAUMANN HLDG CHF0.1 (REGD)	14.00	10 707.83	0.01
CHF SWATCH GROUP CHF0.45 (REGD)	49.00	4 240.59	0.00
CHF SWISS LIFE HLDG CHF5.1 (REGD)	46.00	17 294.54	0.01
CHF SWISS PRIME SITE CHF15.3 (REGD)	54.00	5 228.06	0.00
CHF SWISSCOM AG CHF1 (REGD)	15.00	8 203.53	0.00
USD TE CONNECTIVITY LT COM CHF0.57	279.00	28 605.87	0.02
CHF UBS GROUP CHF0.10 (REGD)	2 447.00	49 750.75	0.03
CHF ZURICH INSURANCE GRP CHF0.10	143.00	47 056.48	0.03
スイス合計		945 722.94	0.59
記名株式合計		1 951 543.65	1.20

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
預託証券			
香港			
USD MELCO RESORTS UNSP ARD EACH REP 3 ORD SHS	400.00	11 912.00	0.01
香港合計		11 912.00	0.01
アイルランド			
AUD JAMES HARDIE ID PLC CUFS EURO.5	330.00	5 828.01	0.00
アイルランド合計		5 828.01	0.00
イスラエル			
USD TEVA PHARMA IND ADR(CNV 1 ORD ILS0.10)	1 091.00	22 267.31	0.01
イスラエル合計		22 267.31	0.01
ルクセンブルグ			
SEK MILLICOM INTL CELL SDR EACH REP 1 USD1.50	58.00	4 338.28	0.00
EUR SES S.A. FDR EACH REP 1 'A' NPV	228.00	3 570.27	0.00
ルクセンブルグ合計		7 908.55	0.00
オランダ			
EUR ABN AMRO GROUP NV DR EACH REP SHS	360.00	12 238.75	0.01
オランダ合計		12 238.75	0.01
イギリス			
USD BRITISH AMERN TOB PLC SPONSORED ADR	261.00	17 770.19	0.01
USD MICRO FOCUS INTL SPON ADR EACH REP 1 ORD SHS	161.00	4 868.64	0.01
イギリス合計		22 638.83	0.02
預託証券合計		82 793.45	0.05
投資ファンド、クローズド・エンド型			
カナダ			
CAD RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	139.00	2 729.36	0.00
カナダ合計		2 729.36	0.00
アメリカ合衆国			
USD LIBERTY PPTY TST SBI USD0.001	119.00	4 927.79	0.00
USD SL GREEN REALTY CORPORATION	140.00	14 072.80	0.01
アメリカ合衆国合計		19 000.59	0.01
投資ファンド、クローズド・エンド型合計		21 729.95	0.01
新株引受権			
スペイン			
EUR ACS ACTIVIDADES DE CONST Y SER SA RIGHTS 05.02.18	145.00	76.23	0.00
スペイン合計		76.23	0.00
新株引受権合計		76.23	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
固定利付ノート			
米ドル			
USD ALPHABET INC 1.99800% 16-15.08.26	75 000.00	69 013.35	0.04
USD ANHEUSER-BUSCH INBEV FINANCE INC 3.65000% 16-01.02.26	75 000.00	75 902.70	0.05
USD APPLE INC 2.40000% 13-03.05.23	50 000.00	48 643.50	0.03
USD APPLE INC 2.90000% 17-12.09.27	75 000.00	72 402.53	0.04
USD APPLE INC 3.00000% 17-09.02.24	50 000.00	49 829.35	0.03
USD APPLE INC 3.25000% 16-23.02.26	50 000.00	49 929.60	0.03
USD APPLE INC 3.45000% 14-06.05.24	75 000.00	76 486.72	0.05
USD BERKSHIRE HATHAWAY INC 2.75000% 16-15.03.23	75 000.00	74 592.15	0.05
USD BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 2.00000% 12-23.10.22	150 000.00	144 867.75	0.09
USD CHEVRON CORP 2.89500% 17-03.03.24	65 000.00	64 417.08	0.04
USD CHEVRON CORP 3.19100% 13-24.06.23	25 000.00	25 288.70	0.02
USD CONOCOPHILLIPS CO 3.35000% 14-15.11.24	25 000.00	25 443.72	0.02
USD CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 4.37500% 12-15.06.22	25 000.00	26 436.25	0.02
USD EXXON MOBIL CORP 2.72600% 16-01.03.23	100 000.00	99 381.70	0.06
USD FREDDIE MAC 6.25000% 02-15.07.32	105 000.00	143 084.76	0.09
USD INTEL CORP 2.87500% 17-11.05.24	15 000.00	14 869.76	0.01
USD JOHNSON & JOHNSON 3.37500% 13-05.12.23	75 000.00	77 249.70	0.05
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.12500% 13-17.01.23	155 000.00	150 895.29	0.09
USD KUWAIT INTERNATIONAL GOVT BOND-REG-S 3.50000% 17-20.03.27	200 000.00	199 000.00	0.12
USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 2.00000% 15-13.01.25	75 000.00	71 061.98	0.04
USD MICROSOFT CORP 2.65000% 15-03.11.22	75 000.00	74 658.68	0.05
USD MICROSOFT CORP 2.87500% 17-06.02.24	25 000.00	24 838.30	0.01
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 2.40000% 12-21.09.22	100 000.00	98 490.20	0.06
USD ORACLE CORP 2.65000% 16-15.07.26	50 000.00	47 543.75	0.03
USD PROCTER & GAMBLE CO 1.85000% 16-02.02.21	50 000.00	48 986.35	0.03
USD TEXAS INSTRUMENTS INC 1.85000% 16-15.05.22	50 000.00	48 304.45	0.03
USD TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.70000% 13-15.01.24	100 000.00	103 797.50	0.06
USD VISA INC 2.75000% 17-15.09.27	15 000.00	14 447.53	0.01
USD WAL-MART STORES INC 2.55000% 13-11.04.23	100 000.00	98 846.30	0.06
USD WELLS FARGO CO 3.50000% 12-08.03.22	125 000.00	127 348.00	0.08
米ドル合計		2 246 057.65	1.39
固定利付ノート合計		2 246 057.65	1.39
固定利付メディアム・ターム・ノート			
米ドル			
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.00000% 15-22.01.25	75 000.00	71 344.28	0.05
USD BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN NV-REG-S 2.50000% 13-23.01.23	50 000.00	49 245.00	0.03
USD BANK OF AMERICA CORP 3.24800% 16-21.10.27	50 000.00	48 845.20	0.03
USD CAISSE D' AMOR DE LA DETTE SOCIALE-REG-S 3.37500% 14-20.03.24	100 000.00	102 705.00	0.06
USD HENKEL AG & CO KGAA-REG-S 1.50000% 16-13.09.19	19 000.00	18 768.39	0.01
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 2.37500% 17-18.01.22	100 000.00	98 680.00	0.06
USD NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CORP-REG-S 2.60000% 17-28.09.22	50 000.00	48 859.35	0.03
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 2.60000% 17-11.01.22	75 000.00	74 526.52	0.05
米ドル合計		512 973.74	0.32
固定利付メディアム・ターム・ノート合計		512 973.74	0.32

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
固定利付債券			
米ドル			
USD AFRICAN DEVELOPMENT BANK 7.37500% 93-06.04.23	75 000.00	90 200.25	0.05
USD BANK OF NOVA SCOTIA 1.85000% 15-14.04.20	100 000.00	98 582.70	0.06
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 3.25000% 14-29.01.24	150 000.00	153 814.95	0.09
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.87500% 15-10.02.25	125 000.00	117 483.00	0.07
USD FANNIE MAE 1.62500% 15-21.01.20	25 000.00	24 743.55	0.02
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 3.00000% 14-21.02.24	125 000.00	126 612.87	0.08
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 7.62500% 93-19.01.23	100 000.00	122 591.20	0.08
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT 2.50000% 15-29.07.25	50 000.00	48 922.00	0.03
USD ITALY, REPUBLIC OF 6.87500% 93-27.09.23	15 000.00	17 641.50	0.01
USD KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 3.25000% 14-10.07.24	200 000.00	197 208.56	0.12
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.50000% 14-20.11.24	100 000.00	97 902.50	0.06
USD MICROSOFT CORP 2.40000% 16-08.08.26	75 000.00	70 586.85	0.04
USD MORGAN STANLEY 5.50000% 10-24.07.20	100 000.00	106 586.00	0.07
USD ONTARIO, PROVINCE OF 3.20000% 14-16.05.24	125 000.00	126 439.63	0.08
USD ONTARIO, PROVINCE OF 2.40000% 17-08.02.22	25 000.00	24 647.08	0.01
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 3.75000% 15-15.07.25	25 000.00	25 817.22	0.02
米ドル合計		1 449 779.86	0.89
固定利付債券合計		1 449 779.86	0.89
固定利付米国中期国債			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.75000% 13-28.02.18	2 500 000.00	2 498 825.00	1.54
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 17-15.02.27	50 000.00	48 115.25	0.03
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.50000% 13-15.08.23	825 000.00	821 970.60	0.50
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.00000% 15-15.05.18	2 550 000.00	2 546 509.05	1.57
米ドル合計		5 915 419.90	3.64
固定利付米国中期国債合計		5 915 419.90	3.64
変動利付米国中期国債			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.375%/CPI LINKED 04-15.01.25	165 000.00	243 007.25	0.15
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.125%/CPI LINKED 11-15.01.21	220 000.00	254 020.31	0.16
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 12-15.01.22	180 000.00	194 108.07	0.12
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI LINKED 17-15.01.27	200 000.00	200 099.04	0.12
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.625%/CPI LINKED 14-15.01.24	130 000.00	138 461.75	0.09
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 14-15.04.19	190 000.00	199 857.39	0.12
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.250%/CPI LINKED 15-15.01.25	140 000.00	142 854.80	0.09
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 15-15.04.20	500 000.00	524 341.88	0.32
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.625%/CPI LINKED 16-15.01.26	520 000.00	541 395.98	0.34
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 12-15.07.22	130 000.00	138 107.65	0.09
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 13-15.01.23	130 000.00	136 698.23	0.09
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI INDEX 13-15.07.23	130 000.00	137 514.60	0.08
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI LINKED 15-15.07.25	150 000.00	154 401.12	0.10
米ドル合計		3 004 868.07	1.87
変動利付米国中期国債合計		3 004 868.07	1.87
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券 および短期金融商品合計		48 011 957.04	29.66

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
米国短期国債、ゼロ・クーポン			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 07.09.17-08.03.18	2 500 000.00	2 496 722.50	1.54
米ドル合計		2 496 722.50	1.54
米国短期国債、ゼロ・クーポン合計		2 496 722.50	1.54
固定利付ノート			
米ドル			
USD CHEVRON CORP 1.71800% 13-24.06.18	25 000.00	24 989.00	0.02
USD GENERAL ELECTRIC CO 2.70000% 12-09.10.22	175 000.00	171 715.60	0.11
USD HSBC HOLDINGS PLC 4.87500% 11-14.01.22	50 000.00	53 232.75	0.03
USD SCENTRE GROUP TRUST 1 / 2-REG-S 3.75000% 17-23.03.27	5 000.00	4 975.00	0.00
米ドル合計		254 912.35	0.16
固定利付ノート合計		254 912.35	0.16
固定利付ミディアム・ターム・ノート			
米ドル			
USD FREDDIE MAC 2.37500% 12-13.01.22	100 000.00	99 783.00	0.06
米ドル合計		99 783.00	0.06
固定利付ミディアム・ターム・ノート合計		99 783.00	0.06
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券 および短期金融商品合計		2 851 417.85	1.76
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されていない 譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
無記名株			
カナダ			
CAD TELUS CORPORATION COM NPV	119.00	4 477.84	0.00
カナダ合計		4 477.84	0.00
無記名株合計		4 477.84	0.00
新株引受権			
イタリア			
EUR UNICREDIT SPA RIGHTS 21.02.18	1 778.00	8.84	0.00
イタリア合計		8.84	0.00
新株引受権合計		8.84	0.00
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されていない 譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		4 486.68	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
2010年12月17日のルクセンブルグ投信法第41条(1) e) に準拠した投資信託/その他の投資信託			
投資ファンド、オープン・エンド型			
アイルランド			
USD UBS (IRL) INVESTOR SELECTION PLC - GLOB EMER MKT OPP-I-X USD	14 400.00	3 755 088.00	2.32
アイルランド合計		3 755 088.00	2.32
ルクセンブルグ			
USD UBS (LUX) BD SICAV - EMER ECO LOC CUR BD U-X-ACC	232.00	2 447 340.16	1.51
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD U-X-ACC	268.00	4 805 963.60	2.97
USD UBS (LUX) BOND SICAV USD INVEST GRADE CORP USD U X ACC	1 885.58	19 542 012.51	12.07
USD UBS (LUX) EMERGING ECONOMIES FUND-GLOBAL BONDS (USD)-U-X ACC	385.00	4 915 845.55	3.04
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - GLB EM OPP(USD)-U-X-ACC	116.54	3 698 087.27	2.29
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV-GLOBAL QUANTITATIVE (USD) U-X-ACC	1 936.21	30 289 170.38	18.71
USD UBS (LUX) INST FUND-KEY SEL. GLOBAL EQUITY FA-USD	1 252.00	29 948 390.88	18.50
USD UBS (LUX) INSTITUTIONAL SICAV - E MARKETS EQUITY PASS FA USD	640.00	9 528 128.00	5.89
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD U-X-ACC	2.00	21 209.92	0.01
ルクセンブルグ合計		105 196 148.27	64.99
投資ファンド、オープン・エンド型合計		108 951 236.27	67.31
2010年12月17日のルクセンブルグ投信法第41条(1) e) に準拠した投資信託/その他の投資信託合計			
		108 951 236.27	67.31
投資有価証券合計		159 819 097.84	98.73

派生商品

公認の証券取引所に上場されている派生商品

指数に係る金融先物

EUR EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 16.03.18	175.00	25 253.22	0.02
GBP FTSE 100 INDEX FUTURE 16.03.18	46.00	85 195.02	0.05
SEK OMX 30 INDEX FUTURE 16.02.18	-40.00	19 377.43	0.01
CAD S&P/TSX 60 INDEX FUTURE 15.03.18	-21.00	26 295.29	0.02
USD S&P500 EMINI FUTURE 16.03.18	14.00	45 072.50	0.03
JPY NIKKEI 225 (OSE) INDEX FUTURE 08.03.18	-8.00	-30 295.09	-0.02
AUD SPI 200 INDEX FUTURE 15.03.18	-33.00	1 556.81	0.00
HKD HANG SENG INDEX FUTURE 27.02.18	-5.00	-1 595.33	0.00
指数に係る金融先物合計		170 859.85	0.11
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		170 859.85	0.11
派生商品合計		170 859.85	0.11

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 割合 （%）
先渡為替契約			
先渡為替契約（購入／売却）			
INR	18 840 000.00	USD 290 711.58	23.3.2018 3 849.40 0.00
USD	290 957.64	AUD 380 000.00	23.3.2018 -16 708.05 -0.01
RUB	17 290 000.00	USD 291 728.30	23.3.2018 13 678.94 0.01
INR	18 840 000.00	USD 290 969.30	23.3.2018 3 591.68 0.00
USD	295 956.40	HUF 78 390 000.00	23.3.2018 -20 038.90 -0.01
USD	295 979.43	TWD 8 810 000.00	23.3.2018 -7 702.86 -0.01
TRY	1 140 000.00	USD 289 323.51	23.3.2018 10 159.07 0.01
USD	295 957.05	TWD 8 810 000.00	23.3.2018 -7 725.24 -0.01
USD	294 083.58	NOK 2 450 000.00	23.3.2018 -25 569.24 -0.02
USD	296 127.79	HUF 78 390 000.00	23.3.2018 -19 867.51 -0.01
RUB	17 290 000.00	USD 291 777.53	23.3.2018 13 629.71 0.01
USD	290 996.02	AUD 380 000.00	23.3.2018 -16 669.67 -0.01
TRY	1 140 000.00	USD 288 844.15	23.3.2018 10 638.43 0.01
USD	293 883.81	NOK 2 450 000.00	23.3.2018 -25 769.01 -0.02
BRL	980 000.00	USD 295 666.79	23.3.2018 12 166.61 0.01
BRL	980 000.00	USD 295 973.08	23.3.2018 11 860.32 0.01
USD	1 698 691.29	NOK 13 684 227.26	22.2.2018 -85 038.19 -0.05
USD	221 307.65	SGD 295 000.00	22.2.2018 -4 109.02 0.00
SEK	8 953 888.56	USD 1 095 017.57	22.2.2018 46 451.47 0.03
USD	3 148 491.75	GBP 2 325 000.00	22.2.2018 -160 211.98 -0.10
USD	842 787.38	AUD 1 076 253.71	22.2.2018 -28 626.04 -0.02
USD	4 720 507.10	JPY 525 702 577.00	22.2.2018 -100 734.96 -0.06
USD	741 982.87	HKD 5 800 000.00	22.2.2018 77.18 0.00
USD	390 686.30	DKK 2 425 000.00	22.2.2018 -15 769.76 -0.01
USD	952 473.17	CHF 928 227.96	22.2.2018 -47 543.61 -0.03
USD	612 666.59	CAD 762 434.77	22.2.2018 -8 935.37 -0.01
USD	4 608 423.31	EUR 3 833 146.45	22.2.2018 -172 731.34 -0.11
USD	6 180.91	SEK 50 000.00	22.2.2018 -193.24 0.00
USD	12 807.64	HKD 100 000.00	12.4.2018 1.39 0.00
USD	12 793.23	HKD 100 000.00	22.2.2018 1.75 0.00
USD	483 525.64	CAD 601 106.02	12.4.2018 -6 840.25 0.00
USD	3 104 268.81	GBP 2 251 816.61	12.4.2018 -106 568.12 -0.07
USD	4 751 451.20	JPY 523 613 248.00	12.4.2018 -65 099.90 -0.04
USD	1 411 703.56	CHF 1 355 236.83	12.4.2018 -54 080.28 -0.03
USD	739 861.76	HKD 5 778 000.00	12.4.2018 -83.24 0.00
SEK	8 890 331.01	USD 1 110 783.33	12.4.2018 26 455.18 0.02
USD	401 285.63	DKK 2 435 000.00	12.4.2018 -8 277.11 -0.01
USD	1 737 236.69	NOK 13 680 567.00	12.4.2018 -48 858.12 -0.03
USD	68 070.01	SGD 90 000.00	12.4.2018 -777.69 0.00
USD	7 268 624.02	EUR 5 925 473.29	12.4.2018 -146 812.00 -0.09
USD	749 212.29	AUD 943 847.88	12.4.2018 -14 967.80 -0.01
JPY	946 250 800.00	USD 8 516 560.82	22.2.2018 161 547.97 0.10
SEK	6 450 000.00	USD 805 532.87	22.2.2018 16 732.81 0.01
CAD	490 000.00	USD 394 139.39	22.2.2018 5 350.47 0.00
RUB	16 360 000.00	USD 287 106.94	23.3.2018 1 872.96 0.00
USD	801 308.28	NOK 6 290 000.00	22.2.2018 -18 588.83 -0.01
TRY	1 100 000.00	USD 284 231.04	23.3.2018 4 743.38 0.00
TRY	1 100 000.00	USD 284 023.13	23.3.2018 4 951.29 0.00
USD	289 383.28	HUF 72 840 000.00	23.3.2018 -4 239.60 0.00
USD	287 460.23	NOK 2 260 000.00	23.3.2018 -7 403.19 0.00
USD	287 628.48	AUD 360 000.00	23.3.2018 -3 844.28 0.00
SEK	6 450 000.00	USD 805 930.85	22.2.2018 16 334.83 0.01
CAD	490 000.00	USD 393 832.42	22.2.2018 5 657.44 0.00
USD	287 460.23	NOK 2 260 000.00	23.3.2018 -7 403.19 0.00
USD	801 094.07	NOK 6 290 000.00	22.2.2018 -18 803.04 -0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
先渡為替契約（続き）			
先渡為替契約（購入／売却）			
RUB	16 360 000.00	USD 287 081.57 23. 3. 2018	1 898.33 0.00
SEK	6 450 000.00	USD 808 713.75 12. 4. 2018	16 361.09 0.01
CAD	480 000.00	USD 386 038.90 12. 4. 2018	5 532.00 0.00
SEK	6 450 000.00	USD 808 313.12 12. 4. 2018	16 761.72 0.01
USD	287 628.48	AUD 360 000.00 23. 3. 2018	-3 844.28 0.00
USD	288 933.88	HUF 72 840 000.00 23. 3. 2018	-4 689.00 0.00
CAD	480 000.00	USD 386 339.98 12. 4. 2018	5 230.92 0.00
USD	802 472.58	NOK 6 290 000.00 12. 4. 2018	-18 731.42 -0.01
USD	802 257.96	NOK 6 290 000.00 12. 4. 2018	-18 946.04 -0.01
USD	31 998.48	AUD 40 000.00 22. 2. 2018	-388.43 0.00
USD	1 280.05	HKD 10 000.00 22. 2. 2018	0.90 0.00
USD	31 994.24	AUD 40 000.00 12. 4. 2018	-391.49 0.00
USD	1 281.38	HKD 10 000.00 12. 4. 2018	0.76 0.00
USD	6 399.82	HKD 50 000.00 22. 2. 2018	4.08 0.00
USD	293 383.84	TWD 8 540 000.00 23. 3. 2018	-991.50 0.00
USD	6 406.51	HKD 50 000.00 12. 4. 2018	3.39 0.00
INR	18 470 000.00	USD 287 905.02 23. 3. 2018	871.06 0.00
INR	18 470 000.00	USD 288 286.09 23. 3. 2018	489.99 0.00
USD	293 378.97	TWD 8 540 000.00 23. 3. 2018	-996.37 0.00
USD	110 326.41	EUR 90 000.00 22. 2. 2018	-1 932.26 0.00
USD	93 807.36	CHF 90 000.00 22. 2. 2018	-3 153.21 0.00
DKK	920 000.00	USD 151 540.81 22. 2. 2018	2 661.08 0.00
USD	155 808.81	SEK 1 250 000.00 22. 2. 2018	-3 545.00 0.00
USD	122 988.70	EUR 100 000.00 12. 4. 2018	-2 156.34 0.00
DKK	920 000.00	USD 152 083.59 12. 4. 2018	2 658.80 0.00
USD	156 336.05	SEK 1 250 000.00 12. 4. 2018	-3 562.17 0.00
USD	104 632.71	CHF 100 000.00 12. 4. 2018	-3 524.32 0.00
BRL	930 000.00	USD 287 667.07 23. 3. 2018	4 460.55 0.00
BRL	930 000.00	USD 288 120.15 23. 3. 2018	4 007.47 0.00
USD	19 220.20	HKD 150 000.00 12. 4. 2018	10.83 0.00
USD	19 199.82	HKD 150 000.00 22. 2. 2018	12.60 0.00
先渡為替契約（購入／売却）合計			-912 724.61 -0.56
銀行預金、要求払預金および貯蓄預金ならびにその他の流動資産			2 995 601.43 1.85
その他の資産および負債			-196 946.58 -0.13
純資産合計			161 875 887.93 100.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

財務書類に対する注記

2018年1月31日現在

注1. 重要な会計方針の概要

当財務書類は、投資信託としてルクセンブルグで一般に公認されている会計原則に従って作成されている。重要な会計方針の概要は、以下のとおりである。

a) 純資産価格の計算

各サブ・ファンドの異なるクラス受益証券1口当たりの純資産価格、発行価格、買戻価格および転換価格は、サブ・ファンドまたは受益証券クラスの勘定通貨で表示され、毎ファンド営業日に、クラス受益証券がそれぞれに帰属する各サブ・ファンドの純資産総額を当該サブ・ファンドの各クラス受益証券の受益証券口数で除することにより決定される。

本書において「営業日」とは、ルクセンブルグにおける個々の法定外休日およびサブ・ファンドが投資する主要各国の取引所の休業日またはサブ・ファンドの投資対象の50%以上を適切に評価することができない日を除く、ルクセンブルグにおける通常の銀行営業日（即ち、銀行が通常の営業時間に営業を行っている各日）をいう。

各サブ・ファンドのクラス受益証券に帰属する純資産価額の割合は、かかるクラス受益証券に課せられる手数料および各サブ・ファンドの受益証券の発行・買戻しによる変動を考慮して、各クラス受益証券の流通している受益証券とサブ・ファンドの流通している受益証券の総口数との比率により決定される。

一取引日に、サブ・ファンドのすべてのクラス受益証券の発行受益証券または買戻受益証券の総額が純資本に流入または純資本から流出した場合、各サブ・ファンドの純資産価額はそれに応じて増加または減少することがある（いわゆるシングル・スウィング・プライシング）。その際の最大の調整額は、純資産価額の2%となる。サブ・ファンドが支出する見積り取引費用および税金、ならびにサブ・ファンドが投資する資産の見積り呼値スプレッドが考慮されることになる。純変動がファンドの全受益証券の増加につながる場合、かかる調整によって純資産価額は増加する。純変動が受益証券の減少につながる場合、純資産価額は減少する。取締役会は、各サブ・ファンドの閾値を設定することができる。かかる閾値は、取引日におけるファンド資産純価額または当該サブ・ファンドの通貨の絶対額に関する純変動に基づく。純資産価額は、取引日にかかる閾値を超えた場合に調整される。

b) 評価原則

- 一 流動資産は、現金、預金、為替手形、要求払約束手形、要求払債券、前払費用、配当金ならびに宣言済または発生済で未受領の利息、いずれの形においても全額で評価が行なわれる。ただし、かかる評価額が完全には支払われないまたは受領できない可能性のある場合には、その真正価額を表すために適切と思われる控除が考慮された上で、価格が決定される。
- 一 証券取引所に上場されている有価証券、派生商品およびその他の資産は、その最終市場価格で評価される。当該有価証券、派生商品またはその他の資産が複数の証券取引所に上場されている場合、当該投資対象の主要市場である証券取引所の直近の表示価格が適用される。有価証券、派生商品およびその他の資産について、証券取引所において一般に取引されておらず、かつ市場の市価決定方法を使用する流通市場において証券ディーラー間で取引されている場合、管理会社は、

かかる価格に基づき、当該有価証券、派生商品およびその他の投資対象を評価することができる。証券取引所に上場されていない、または公認かつ公開で定期的に運営されている他の規制ある市場で取引されている有価証券、派生商品および他の投資対象は、当該市場における最終の入手可能価格で評価される。

- 証券取引所に上場されておらず、また別の規制された市場でも取引されていない、適正価格が入手できない有価証券、派生商品およびその他の投資対象は、予想売却価格に基づき誠実に決定される他の原則に従って、管理会社により評価される。
- 証券取引所に上場されていない派生商品（O T C 派生商品）の評価は、独立価格決定ソースを参照して行われる。派生商品の独立価格決定ソースが一つしか利用できない場合、入手した評価の妥当性は、派生商品が発生した裏付けとなる証書の市場価額に基づき管理会社およびその監査人に認められた評価方法によって確認される。
- 他の譲渡性のある有価証券を投資対象とする投資信託（U C I T S）および／または投資信託（U C I）の受益証券は、それらの直近純資産価格で評価される。
- 証券取引所に上場されていないまたは公開されている他の規制ある市場で取引されていない短期金融商品の価額は、関連するカーブを元に評価される。カーブに基づく評価は、金利および信用スプレッドの要素を参照する。この過程で以下の原則が適用される。各短期金融商品は、満期までの残存期間にもっとも近い金利が補間される。かかる方法により計算された金利は、原借主を反映する信用スプレッドを加算することで市場価格に転換される。借主の信用格付けが大幅に変更された場合、かかる信用スプレッドは調整が行われる。
- 外国為替取引によりヘッジされない当該サブ・ファンドの勘定通貨以外の通貨建ての証券、派生商品およびその他の資産は、当該通貨のルクセンブルグにおける中間の市場取引レート（売買価格の仲値）またはこれが提供されない場合は当該通貨を最も代表する市場におけるレートで評価される。
- 定期預金および信託投資は、これらの額面額に発生利息を付して評価される。
- スワップの価値は、外部サービス・プロバイダーにより計算され、第2次の独立した評価が他の外部サービス・プロバイダーにより提供されている。かかる計算は、イン・フローおよびアウト・フローの両方のすべてのキャッシュ・フローの純現在価値に基づくものである。特定の場合に、内部計算（ブルームバーグにより提供されたモデルおよび市場データに基づく。）および／またはブローカーの報告評価が利用される。評価方法は、各有価証券に依拠し、U B S の評価指針に従い決定される。

異常事態のため上記規則に基づく評価が実行不可能または不正確になった場合、管理会社は、純資産額の適切な評価を実行するため誠実に他の一般に認められ監査可能な評価基準を適用する権限を付与される。

異常事態においては、追加評価は一日繰り延べることができる。これらの新評価は、受益証券の爾後の発行および買戻しについて正式なものである。

c) 先渡為替契約の評価

未決済の先渡為替契約に係る未実現（損）益は、評価日の実勢先物為替レートに基づいて評価される。

d) 金融先物契約の評価

金融先物契約は、評価日に適用される入手可能な直近の公表価格に基づいて評価される。実現損益および未実現損益の変動は運用計算書に計上される。実現損益は、（最初に取得された契約が、最初に販売されるものとみなされる）先入れ先出し法に従って計算される。

e) 有価証券売却に係る実現純利益（損失）

有価証券売却に係る実現純利益（損失）は、売却投資証券の平均原価に基づいて計算されている。

f) 外貨換算

個々のサブ・ファンドの基準通貨以外の通貨建ての銀行口座、その他の純資産額および有価証券の評価額は、評価日の現行のスポット・レート終値の仲値で換算されている。個々のサブ・ファンドの通貨以外の通貨建ての収益および費用は支払日の現行のスポット・レート終値の仲値で換算されている。外国為替に係る損益は財務書類に含まれている。

個々のサブ・ファンドの基準通貨以外の通貨建ての有価証券の取得原価は、取得日の現行のスポット・レート終値の仲値で換算されている。

g) 投資有価証券取引の計上

投資有価証券取引は、取引日の翌銀行営業日に計上される。

h) 連結財務書類

ファンドの連結財務書類はユーロで設定されている。ファンドの2018年1月31日現在の連結純資産計算書および連結運用計算書の様々な項目は、決算日のユーロの為替レートに換算された各サブ・ファンドの財務書類中の対応する項目の金額に等しい。

以下の為替レートが外国為替の換算および2018年1月31日現在の連結財務書類に使用された。

為替レート

1ユーロ = 1.158049 スイス・フラン

1ユーロ = 1.245750 米ドル

i) モーゲージ・バック証券

ファンドは、その投資方針に従い、モーゲージ・バック証券に投資することができる。モーゲージ・バック証券は、証券の形態で統合された住居モーゲージの資金プールに対する参加権である。裏付であるモーゲージに関する元本および利息の支払は、元本が証券の原価を減少させるモーゲージ・バック証券の保有者に対して行われる。元本および利息の支払は、アメリカ合衆国の政府機関に類似する機関により保証される。損益は、元本の各支払に関連する各頭金の支払について計算される。

この損益は、運用計算書の証券の売却にかかる純実現損益に含まれる。さらに、モーゲージへの期前弁済は、証券の存続期間を短縮することがあり、従って、ファンドの予想利回りに影響する。

じ) 有価証券売却未収金、有価証券購入未払金

「有価証券売却未収金」の勘定には、外国為替取引からの未収金も含まれることがある。「有価証券購入未払金」の勘定には、外国為替取引からの未払金も含まれることがある。

く) 利益の認識

源泉徴収税控除後の分配金は、関連する有価証券が最初に「配当落ち」を認定した日に利益として認識される。利息収入は、日次ベースで発生する。

こ) スワップ

ファンドは、当該種類の取引を専門とする一流金融機関との間で取交わされる、金利スワップ契約、金利スワップションにかかる金利先渡契約およびクレジット・デフォルト・スワップを締結することができる。

未実現損益の変動は、運用計算書において「スワップに係る未実現評価（損）益」の変動として反映されている。手仕舞い時または満期時に発生するスワップに係る利益または損失は、運用計算書において「スワップに係る実現（損）益」として記録される。

注2. 報酬

ファンドは、各サブ・ファンドの各クラス受益証券に、各サブ・ファンドの各クラス受益証券の平均純資産額に基づいて下表のとおり計算される報酬を毎月支払う。

UBS (Lux) ストラテジー・ファンドーイールド (米ドル)

	上限年率報酬
名称に「P」が付くクラス受益証券	1.440%
名称に「N」が付くクラス受益証券	1.680%
名称に「K-1」が付くクラス受益証券	0.900%
名称に「K-X」が付くクラス受益証券	0.000%
名称に「F」が付くクラス受益証券	0.760%
名称に「Q」が付くクラス受益証券	1.050%*
名称に「I-A1」が付くクラス受益証券	0.850%
名称に「I-A2」が付くクラス受益証券	0.800%
名称に「I-A3」が付くクラス受益証券	0.760%
名称に「I-B」が付くクラス受益証券	0.065%
名称に「I-X」が付くクラス受益証券	0.000%
名称に「U-X」が付くクラス受益証券	0.000%

* 上限1.05%、実効0.85%

UBS (Lux) ストラテジー・ファンド・グロース (米ドル)

	上限年率報酬
名称に「P」が付くクラス受益証券	1.800%
名称に「N」が付くクラス受益証券	1.980%
名称に「K-1」が付くクラス受益証券	1.100%
名称に「K-X」が付くクラス受益証券	0.000%
名称に「F」が付くクラス受益証券	0.940%
名称に「Q」が付くクラス受益証券	1.250%*
名称に「I-A1」が付くクラス受益証券	1.050%
名称に「I-A2」が付くクラス受益証券	1.000%
名称に「I-A3」が付くクラス受益証券	0.940%
名称に「I-B」が付くクラス受益証券	0.065%
名称に「I-X」が付くクラス受益証券	0.000%
名称に「U-X」が付くクラス受益証券	0.000%

* 上限1.25%、実効1.05%

上記の報酬から、以下の費用が支払われる。

1. ファンドの運用、管理、ポートフォリオ管理および販売に関して（該当する場合）、また保管受託銀行のすべての職務（ファンド資産の保管および監督、決済取引の取扱いならびに英文目論見書の「保管受託銀行および主たる支払代理人」の項に記載されるその他一切の職務等）に関して、以下の条項に従ってファンドの純資産価額に基づく上限報酬がファンド資産から支払われる。当該報酬は、純資産価額の計算毎に比例按分ベースでファンド資産に対し請求され、毎月支払われる（上限報酬）。
2. 上限報酬には、ファンドに請求される以下の報酬および追加の費用は含まれない。
 - a) 資産の売買のためのファンド資産の管理に関する一切の追加の費用（市場、手数料、報酬等に合致する買呼値および売呼値のスプレッド、仲介手数料）。かかる費用は、通常、各資産の売買時点で計算される。本書の記載にかかわらず、受益証券の発行および買戻しの決済に関する資産の売買によって生じるかかる追加の費用は、販売目論見書の「純資産価額、発行、買戻しおよび転換価格」の項に記載されているシングル・スウィング・プライシングの原理の適用によりカバーされる。
 - b) ファンドの設立、変更、清算および合併に関する監督官庁への費用ならびに監督官庁およびサブ・ファンドが上場されている証券取引所に関する一切の手数料。
 - c) ファンドの設立、変更、清算および合併に関する年次監査および認可に関する監査報酬ならびにファンドの管理事務に関して監査人が提供するサービスに関して監査人に支払われるか、または法律によって許可される一切のその他の報酬。
 - d) ファンドの設立、販売国における登録、変更、清算および合併に関する法律顧問、税務顧問および公証人に対する報酬ならびに法律で明白に禁止されない限り、ファンドおよびその投資者の利益の全般的な保護に関する手数料。
 - e) ファンドの純資産価額の公表に関するコストおよび投資者に対する通知に関する一切のコスト

(翻訳コストを含む。)

f) ファンドの法的文書に関するコスト (目論見書、K I I D、年次報告書および半期報告書ならびに居住国および販売が行われる国で法的に要求されるその他の一切の文書)。

g) 外国の監督官庁へのファンドの登録に関するコスト (該当する場合、手数料、翻訳コストおよび外国の代表者または支払代理人に対する報酬を含む。)

h) ファンドによる議決権または債権者の権利の使用により発生した費用 (外部顧問報酬を含む。)

i) ファンドの名義で登録された知的財産またはファンドの利用者の権利に関するコストおよび手数料。

j) 管理会社、ポートフォリオ・マネジャーまたは保管受託銀行が投資者の利益の保護のために講じた特別措置に関して生じた一切の費用。

k) 管理会社が投資者の利益につき集団訴訟に関与する場合、管理会社は、第三者に関して生じた費用 (例えば、法律コストおよび保管受託銀行に関するコスト) をファンドの資産に対して請求することができる。さらに、管理会社は、すべての管理事務コストを請求することができる。ただし、かかるすべての管理事務コストは、証明可能かつ開示されており、ファンドの総費用率 (T E R) の開示において考慮される。

3. 管理会社は、ファンドの販売業務をカバーするために手数料を支払うことができる。

管理会社は、ファンドの販売業務をカバーするために手数料を支払うことができる。ファンドの収益および資産につき徴収されるすべての税金 (特に年次税) はファンドが負担する。

報酬制度を用いていない他のファンド・プロバイダーとの報酬規定を全般的に比較するという目的上、「上限管理報酬」は報酬の80%と定められている。

個々のサブ・ファンドに割当てられ得る費用はすべて、それらのサブ・ファンドに請求される。クラス受益証券に割当てられ得る費用は、それらのクラス受益証券に請求される。ただし、費用が複数またはすべてのサブ・ファンド/クラス受益証券にそれぞれ関連する場合には、これらの費用について当該サブ・ファンド/クラス受益証券がその純資産額に比例して負担する。

各サブ・ファンドの投資方針の規定により、他のU C I SまたはU C I T Sへ投資するサブ・ファンドについて、関連する投資ファンドおよびサブ・ファンドの両レベルで報酬が生じることがある。

以下のサブ・ファンドは、2018年1月31日現在その純資産価額の50%以上をその他のU C I T Sに投資した。

U B S (Lux) ストラテジー・ファンドーイールド (米ドル)

U B S (Lux) ストラテジー・ファンドーグロース (米ドル)

或るサブ・ファンドが保有する保有対象ファンドであるUBS-ETF MSCI EMU UCITS ETF (EUR) A-dis (年率0.18%) を除き、その他のすべての保有対象ファンドの上限報酬は年率0.00%であった。

管理会社自ら、あるいは共同経営もしくは支配または実質的な直接もしくは間接の保有を通じ、直接もしくは間接に運用している投資信託の受益証券への投資の場合、投資を行うサブ・ファンドに対して、対象ファンドの発行または買戻手数料が請求されないことがある。

管理会社が前段落の記載に従い関連ファンドの受益証券に投資する場合、投資するサブ・ファンドの実質的な報酬に満たない実質的な報酬が適用され、管理会社は、関連ファンドへの投資高における上記の減額された実質的な報酬の代わりに、サブ・ファンドが支払う管理報酬総額が常に、関

連ファンド以外のファンドに適用される販売目論見書に規定される金額を超えないようにするため、一方では投資を行うサブ・ファンドの実質的な報酬と他方では関連ファンドの実質的な報酬との間の差額を請求することができる。

サブ・ファンドの継続費用の詳細は、主要な投資家向け資料（K I I D s）に記載されている。

注3. 年次税

現在施行されている法令に従い、ファンドはルクセンブルグにおいて、各四半期末日におけるファンドの純資産総額に基づき計算され、四半期毎に支払われる年率0.05%の発行税、または、一定のクラス受益証券については、0.01%の軽減年率の年次税の対象となっている。

ルクセンブルグ法の法定条項に従い年次税を既に支払っている他の投資信託の受益証券または株式へ投資された純資産部分に関し、年次税は放棄された。

注4. その他の収益

その他の収益は主にシングル・スウィング・プライシングによる収益で構成される。

注5. 利益分配

約款第10条に従い、年次決算の終了とともに、管理会社は、各サブ・ファンドまたは受益証券クラスが分配金を支払う程度を決定する。分配金は、ファンドの純資産が法の規定が定めるファンド資産の最低額を下回るほどの金額であってはならない。分配が行われる場合、支払は会計年度の終了から4か月以内に行われる。

取締役会は、中間分配金の支払および分配金の支払停止を行う権限を有している。

分配が実際の収益を受け取る権利に対応するよう収益平準化額が計算される。

注6. 金融先物に係る契約債務

2018年1月31日現在のサブ・ファンドおよび各通貨当たりの金融先物に係る契約債務は、以下のとおり要約される。

金融先物

UBS (Lux) ストラテジー・ファンド	指数に係る金融先物 (買い)	指数に係る金融先物 (売り)
－イーロド (米ドル)	82,692,132.85 米ドル	45,061,416.52 米ドル
－グロース (米ドル)	14,710,770.78 米ドル	10,775,641.88 米ドル

注7. ソフト・コミッション・アレンジメント

2017年2月1日から2018年1月31日までの会計年度中、いかなる「ソフト・コミッション・アレンジメント」もUBS (Lux) ストラテジー・ファンドに代わって締結されておらず、「ソフト・コミッション・アレンジメント」の金額はなかった。

注8. 総経費率（TER）

当比率は、今期版のスイス・ファンズ・アンド・アセット・マネジメント・アソシエーション（S F A M A）による「TERの計算および公表に係る指針」に従って計算されており、遡及的に把握される、純資産中における、純資産が負担するすべての経常費用および手数料（運営経費）の合計の割合を表示するものである。

過去12か月におけるTER

UBS（Lux）ストラテジー・ファンド	総経費率（TER）
－イールド（米ドル）クラスK－1－a c c 受益証券	0.95%
－イールド（米ドル）クラス（日本円・ヘッジ） K－1－a c c 受益証券	0.94%
－イールド（米ドル）クラスP－4％－m d i s t 受益証券	1.53%
－イールド（米ドル）クラスP－a c c 受益証券	1.49%
－イールド（米ドル）クラス（英ポンド・ヘッジ） P－a c c 受益証券	1.48%
－イールド（米ドル）クラス（日本円・ヘッジ） P－a c c 受益証券	1.49%
－イールド（米ドル）クラスP－d i s t 受益証券	1.49%
－イールド（米ドル）クラスQ－a c c 受益証券	0.90%
－イールド（米ドル）クラスQ－d i s t 受益証券	0.90%
－グロース（米ドル）クラスF－a c c 受益証券	0.77%
－グロース（米ドル）クラスP－a c c 受益証券	1.85%
－グロース（米ドル）クラス（日本円・ヘッジ） P－a c c 受益証券	1.86%
－グロース（米ドル）クラスQ－a c c 受益証券	1.10%

取引費用および為替ヘッジに関連して発生したその他の費用は、TERに含まれない。

運用期間が12か月に満たないクラス受益証券のTERについては、年率換算されている。

注9. 取引費用

取引費用は、当期に発生したブローカー報酬、印紙税、地方税およびその他の海外手数料を含む。取引費用は、有価証券の購入および売却に係る費用に含まれる。

2018年1月31日に終了した会計年度において、ファンドにおいて発生した投資有価証券の購入および売却に関連する取引費用は、以下のとおりである。

UBS（Lux）ストラテジー・ファンド	取引費用
－イールド（米ドル）	115,650.97米ドル
－グロース（米ドル）	35,168.74米ドル

すべての取引費用が個別に特定されるわけではない。固定利付証券、先渡為替契約およびその他の派生商品契約について、取引費用は投資有価証券の売買価格に含まれる。個別に特定はされないが、これらの取引費用は各ファンドの運用成績において表示される。

注10. 取締役会によりゼロと値付けされた有価証券

UBSの評価委員会による提案に基づき、管理会社の取締役会は、以下の有価証券をゼロまたはほぼゼロと評価することを決定した。

ISIN	有価証券
PTBES0AM0007	BCO ESPIRITO SANTO EUR

注11. 準拠法、営業地域および言語

ルクセンブルグ地方裁判所は、受益者、管理会社および保管受託銀行との間のすべての法律上の紛争の管轄地である。ルクセンブルグの法律が適用される。しかし、外国の投資家からの請求に関する事項については、管理会社および／または保管受託銀行は、ファンド受益証券が売買された国の管轄に服し、代理人を選定することが出来る。

本財務書類は、ドイツ語版が正式書類であり、かかるドイツ語版のみが公認の監査人により監査された。しかし、ファンドの受益証券が売買されているその他の国の投資者に売却された受益証券の場合、管理会社および保管受託銀行は、両者およびファンドを拘束する関連言語に翻訳された承認済の翻訳を認知することができる（即ち、管理会社および保管受託銀行がこれを承認する。）。

注12. OTC派生商品および貸付有価証券

ファンドがOTC派生商品取引を締結する場合、OTCの取引相手方の信用力に関するリスクに晒されることがある。ファンドが先物契約、オプションおよびスワップ取引を締結する、またはその他のデリバティブ技法を用いる場合、特定のまたは複数の契約に基づき、OTCの取引相手方が債務を履行しない（またはできない）リスクに晒される。取引相手方リスクは、有価証券の預け入れにより軽減され得る。適用される契約に従い、ファンドが有価証券を受け取る場合、当該有価証券は、ファンドを受取人として保管受託銀行の保護管理下に置かれる。OTCの取引相手方に破産および支払不能、またはその他の信用事由が生じた場合、保管受託銀行または副保管人／コルレス銀行のネットワーク内において、有価証券に関連するファンドの権利または認識が遅延、制限または排除される可能性があり、その結果、そのような債務をカバーするために過去において利用可能であった有価証券があるにも関わらず、OTC取引の枠組みにおいて債務の履行をファンドが強いられる可能性がある。

ファンドは第三者に組入証券の一部を貸付けることができる。一般的に、貸付はクリアストリーム・インターナショナルもしくはユーロクリアのような公認の決済機関、または同種の業務を専門とする第一級の金融機関の仲介により、それらの機関が設定した方法に従ってのみ行われる。貸付有価証券の収益およびコストは、運用計算書に別個に表示される。担保は、貸付有価証券に関連して受領される。担保は、一般的に借入れられた有価証券の少なくとも時価に相当する金額の高格付け証券から構成される。

UBSヨーロッパSE ルクセンブルグ支店は、有価証券貸付代理人としての役割を担う。

OTC派生商品*

以下のサブ・ファンドが無担保で保有する店頭派生商品は、その代わりにマージン勘定を設けている。

サブ・ファンド 取引相手方	未実現（損）益	受領担保
UBS (Lux) ストラテジー・ファンド ーイールド (米ドル)		
カナディアン・インペリアル・バンク	542,499.28米ドル	0.00米ドル
HSBC	1,398,670.24米ドル	0.00米ドル
ユービーエス・エイ・ジー	-3,312,969.65米ドル	0.00米ドル
UBS (Lux) ストラテジー・ファンド ーグロース (米ドル)		
J Pモルガン	161,547.97米ドル	0.00米ドル
ユービーエス・エイ・ジー	-1,074,272.58米ドル	0.00米ドル

*公認の証券取引所に上場されている派生商品は、決済機関により保証されているため、かかる表には含まれていない。取引相手方に債務不履行が生じた場合、当該決済機関が損失にかかるリスクを負う。

貸付有価証券

	2018年1月31日現在の貸付有価証券からの 取引相手方エクスポージャー		2018年1月31日現在の 担保の内訳 (%)		
	貸付有価証券の時価	担保 (ユービーエス・ スイス・エイ・ジー)	株式	債券	現金
UBS (Lux) ストラテジー・ ファンド					
ーイールド (米ドル)	197,693,292.05米ドル	208,903,057.41米ドル	45.43	54.57	0.00
ーグロース (米ドル)	19,087,500.18米ドル	20,169,815.10米ドル	45.43	54.57	0.00

(3) 投資有価証券明細表等

「(2) 損益計算書」の「2018年1月31日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表」を参照のこと。

IV. お知らせ

- ファンドの管理事務代行会社がUBSファンド・サービスズ（ルクセンブルグ）エス・エイからノーザン・トラスト・グローバル・サービスズ・ピーエルシー ルクセンブルグ支店（旧商号：ノーザン・トラスト・グローバル・サービスズ・リミテッド ルクセンブルグ支店）に変更されました。

（変更適用日：2017年10月1日）

- 純資産価格の評価方法、販売および買戻し時における取扱いを変更するため、約款を変更しました。

（変更適用日：2018年8月3日）

- 上限定率報酬料率が以下の通りに変更されました。とりわけ、クラス（日本円・ヘッジ）P-acc受益証券について、上限定率報酬料率が引き上げられた点にご留意ください。

サブ・ファンド	上限定率報酬料率	上限定率報酬料率 名称に「ヘッジ」を含む クラス受益証券の料率
イールド（米ドル）	年率 1.440%	年率 1.490%
グロース（米ドル）	年率 1.800%	年率 1.850%

（変更適用日：2018年8月3日）

- 「営業日」の定義が以下の通りに変更されました。

「営業日」とは、ルクセンブルグの通常の銀行営業日（即ち、銀行が通常の営業時間に営業を行っている各日）をいい、12月24日および31日、個々の法定外休日ならびにサブ・ファンドが投資する主要各国の取引所の休業日またはサブ・ファンドの投資対象の50%以上を適切に評価することができない日等を除く。

（変更適用日：2018年8月3日）

- 買戻し手続等に以下の内容が追加されました。

管理会社は、ある注文日における申込みによりサブ・ファンドの純資産総額の10%超の資金が流出する場合、当該注文日における買戻注文および乗換注文の一部を執行しない権利を留保する（買戻制限）。この場合、管理会社は、買戻注文および乗換注文の一部のみを執行し、当該注文日において執行されなかった買戻注文および乗換注文の執行を通常20営業日を超えない期間で延期し、これらを優先的に取り扱うことを決定することができる。

（変更適用日：2018年8月3日）