

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 令和2年2月28日

【発行者名】 UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ  
(UBS (Lux) Strategy SICAV)

【代表者の役職氏名】 メンバー・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ  
トーマス・ローズ (Thomas Rose)  
チェアマン・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ  
トーマス・ポートマン (Thomas Portmann)

【本店の所在の場所】 ルクセンブルグ大公国、ルクセンブルグ L - 1855、  
J . F . ケネディ通り33A  
(33A avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg, Grand Duchy of  
Luxembourg)

【代理人の氏名又は名称】 弁護士 三 浦 健  
弁護士 大 西 信 治

【代理人の住所又は所在地】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング  
森・濱田松本法律事務所

【事務連絡者氏名】 弁護士 三 浦 健  
弁護士 大 西 信 治

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング  
森・濱田松本法律事務所

【電話番号】 03 ( 6212 ) 8316

【届出の対象とした募集(売出)外国投資証券に係る外国投資法人の名称】  
UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ  
- ダイナミック・インカム(米ドル)  
- フィクスト・インカム(米ドル)  
- インカム(米ドル)  
- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・  
ディフェンシブ(米ドル)  
- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・  
ミディアム(米ドル)  
- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・  
ダイナミック(米ドル)  
(UBS (Lux) Strategy SICAV  
- Dynamic Income (USD)  
- Fixed Income (USD)  
- Income (USD)  
- Systematic Allocation Portfolio Defensive (USD)  
- Systematic Allocation Portfolio Medium (USD)  
- Systematic Allocation Portfolio Dynamic (USD))

【届出の対象とした募集(売出)外国投資証券の形態及び金額】

## 記名式無額面投資証券

ダイナミック・インカム(米ドル)

クラスP - m d i s t 投資証券

クラスP - a c c 投資証券

フィクスト・インカム(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

クラス(日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券

インカム(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

上限見込額は以下のとおりである。

ダイナミック・インカム(米ドル)

クラスP - m d i s t 投資証券

10億1,390万米ドル(約1,079億円)

クラスP - a c c 投資証券

10億4,290万米ドル(約1,110億円)

フィクスト・インカム(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

24億4,940万米ドル(約2,608億円)

クラス(日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券

1,015億9,000万円

インカム(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

11億7,780万米ドル(約1,254億円)

システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

10億8,530万米ドル(約1,155億円)

システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

10億9,850万米ドル(約1,169億円)

システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

11億1,040万米ドル(約1,182億円)

(注1) 上限見込額は、便宜上、ファンドの投資証券の2019年8月末日現在の1口当たりの純資産価格に基づいて算出されている(ダイナミック・インカム(米ドル)クラスP - m d i s t 米ドル投資証券については101.39米ドルに1,000万口、クラスP - a c c 米ドル投資証券については104.29米ドルに1,000万口、フィクスト・インカム(米ドル)クラスP - a c c 投資証券については244.94米ドルに1,000万口、クラス(日本円・ヘッジ)P - a c c 投資証券については10,159円に1,000万口、インカム(米ドル)クラスP - a c c 投資証券については117.78米ドルに1,000万口、システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)クラスP - a c c 投資証券については108.53米ドルに1,000万口、システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)クラスP - a c c 投資証券については109.85米ドルに1,000万口およびシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)クラスP - a c c 投資証券については111.04米ドルに1,000万口をそれぞれ乗じて算出した金額である。 )。

(注2) 米ドルの円貨換算は、特に記載がない限り、2019年8月30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=106.46円)による。以下同じ。

【縦覧に供する場所】

該当事項なし

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出しましたので、2019年11月14日に提出した有価証券届出書(以下「原届出書」という。)の関係情報を新たな情報により更新および追加するため、また、有価証券報告書の訂正報告書を提出しましたので、原届出書の内容を訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

なお、本訂正届出書の記載事項のうち、半期報告書に係る訂正の外貨数字の円換算については、直近の為替レートをを用いておりますので、訂正前の換算レートとは異なっております。

## 2【訂正の内容】

## (1) 半期報告書に係る訂正

半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正内容は、下記のとおりです。

原届出書の下記事項については、半期報告書の記載内容と同一内容に更新または追加されます。

原届出書		半期報告書		訂正の方法
第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 1 外国投資法人の概況	(1) 主要な経営指標等の推移	1 外国投資法人の概況	(1) 主要な経営指標等の推移	追加または更新
	(5) 外国投資法人の出資総額		(2) 外国投資法人の出資総額	追加
	(6) 主要な投資主の状況		(3) 主要な投資主の状況	更新
3 投資リスク		2 外国投資法人の運用状況	(3) 投資リスク	更新
5 運用状況	(1) 投資状況		(1) 投資状況	更新
	(3) 運用実績		(2) 運用実績	追加または更新
第2 財務ハイライト情報		4 外国投資法人の経理状況	(1) 資産及び負債の状況 「純資産計算書」 「運用計算書」 「重要な会計方針の要約」 の注記	追加
第三部 外国投資法人の詳細情報 第1 外国投資法人の追加情報 2 役員状況		1 外国投資法人の概況	(4) 役員状況	更新
5 その他			(5) その他	更新
第4 関係法人の状況 1 資産運用会社の概況	(1) 名称、資本金の額及び事業の内容	3 資産運用会社の概況	(1) 名称及び資本金の額	更新
	(3) 大株主の状況		(2) 大株主の状況	更新
	(4) 役員状況		(3) 役員状況	更新
	(5) 事業内容及び営業の概況		(4) 事業内容及び営業の概況	更新
第5 外国投資法人の経理状況 1 財務諸表		4 外国投資法人の経理状況		追加
第6 販売及び買戻しの実績		5 販売及び買戻しの実績		追加

半期報告書の記載内容は以下のとおりです。(原届出書に対する訂正内容に該当しない箇所は省略します。)

[次へ](#)

## 1 外国投資法人の概況

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル) / フィクスト・インカム (米ドル) / インカム (米ドル) / システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ (米ドル) / システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル) / システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル) (以下、UBS (Lux) ストラテジー・シキャブを「本投資法人」、UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル) / フィクスト・インカム (米ドル) / インカム (米ドル) / システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ (米ドル) / システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル) / システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル) をそれぞれ「ファンド」または「サブ・ファンド」という。)の概況は以下のとおりである。

(注) ファンドにはクラス P - a c c 投資証券、クラス P - m d i s t 投資証券およびクラス (日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券以外の投資証券も存在する。クラス (日本円・ヘッジ) を含めた P - a c c 投資証券およびクラス P - m d i s t 投資証券以外の投資証券は日本で販売されていないため、以下、「投資証券」というときは、上記のクラス P - a c c 投資証券、クラス P - m d i s t 投資証券およびクラス (日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券を指すものとする。

## (1) 主要な経営指標等の推移

(ダイナミック・インカム (米ドル))

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	2019年5月末日に 終了する 会計年度末	2019年11月末日に 終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 <sup>(1)</sup>	- 2,696,078.13	23,031,370.03
(b) 経常利益金額または経常損失金額	- 2,696,078.13	23,031,370.03
(c) 当期純利益金額または当期純損失金額	- 2,696,078.13	23,031,370.03
(d) 出資総額 <sup>(2)</sup>	326,403,802.47	501,866,143.45
(e) 発行済投資口総数 (クラス P - m d i s t 投資証券)	1,276,793.625口	1,990,112.770口
(クラス P - a c c 投資証券)	369,590.500口	602,725.332口
(f) 純資産額	326,403,802.47	501,866,143.45
(g) 資産総額	326,809,163.84	514,490,856.98
(h) 1口当たり純資産価格 (クラス P - m d i s t 投資証券)	99.84	102.92
(クラス P - a c c 投資証券)	101.24	107.26
(i) 1口当たり当期純利益金額 または当期純損失金額 (クラス P - m d i s t 投資証券)	- 0.77	4.43
(クラス P - a c c 投資証券)	- 1.25	4.21
(j) 分配総額	3,289,469.20	9,162,256.65
(k) 1口当たり分配金額 (クラス P - m d i s t 投資証券)	1.44	2.79
(クラス P - a c c 投資証券)	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	99.88%	97.55%
(m) 自己資本利益率 <sup>(3)</sup> (クラス P - m d i s t 投資証券)	1.28%	7.15%
(クラス P - a c c 投資証券)	1.24%	7.26%

(1) 営業収益には投資収益および実現および未実現利益 (損失) を含めている。以下同じ。

(2) ファンドは変動資本を有する会社型投資信託であり、純資産総額を記載している。以下同じ。

- (3) 自己資本利益率は、当該会計年度の1口当たり純資産価格の前年度に対する増減の比率であるが、当該会計年度に初めて当該投資証券が発行された場合には、当初募集価格に対する増減の比率で表すものとする。以下同じ。
- (4) 「主要な経営指標等の推移(e) 発行済投資口総数、(h) 1口当たり純資産価格、(i) 1口当たり当期純利益金額または当期純損失金額、(k) 1口当たり分配金額および(m) 自己資本利益率」は、日本で販売しているクラスのみ記載している。以下同じ。
- (注1) 各取引に使用された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る(財務書類に対する注記1参照)。以下同じ。
- (注2) ダイナミック・インカム(米ドル)は2019年1月28日に運用を開始した。

## (フィクスト・インカム(米ドル))

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	2017年11月末日に 終了する 中間会計年度末	2018年5月末日 に終了する 会計年度末	2018年11月末日に 終了する 中間会計年度末	2019年5月末日 に終了する 会計年度末	2019年11月末日に 終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 <sup>(1)</sup>	- 136,154.99	- 1,707,909.65	- 4,581,042.37	4,825,480.58	2,445,729.76
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	- 136,154.99	- 1,707,909.65	- 4,581,042.37	4,825,480.58	2,445,729.76
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	- 136,154.99	- 1,707,909.65	- 4,581,042.37	4,825,480.58	2,445,729.76
(d) 出資総額 <sup>(2)</sup>	184,107,411.05	171,926,461.34	156,155,313.94	153,368,218.52	160,989,751.98
(e) 発行済投資口総数 (クラスP - a c c 投資証券)	417,963.443口	394,876.352口	375,034.422口	344,431.076口	369,527.950口
(e) 発行済投資口総数 (クラス(日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券)	855,960.485口	795,500.249口	700,557.737口	684,496.658口	675,913.442口
(f) 純資産額	184,107,411.05	171,926,461.34	156,155,313.94	153,368,218.52	160,989,751.98
(g) 資産総額	184,197,720.62	172,603,060.43	156,239,761.73	155,016,977.33	164,938,100.58
(h) 1口当たり純資産価格 (クラスP - a c c 投資証券)	232.57	228.65	227.64	239.06	244.88
(h) 1口当たり純資産価格 (クラス(日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券)	10,107円	9,823円	9,647円	9,984円	10,102円
(i) 1口当たり当期純利益金 額または当期純損失金額 (クラスP - a c c 投資証券)	1.32	- 2.79	- 1.08	10.72	5.42
(i) 1口当たり当期純利益金 額または当期純損失金額 (クラス(日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券)	- 0.89円	- 0.65円	- 5.93円	1.00円	0.34円
(j) 分配総額	なし	なし	なし	なし	なし
(k) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	99.95%	99.61%	99.95%	98.94%	97.61%
(m) 自己資本利益率 <sup>(3)</sup> (クラスP - a c c 投資証券)	3.00%	- 1.08%	- 2.12%	4.55%	7.57%
(m) 自己資本利益率 <sup>(3)</sup> (クラス(日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券)	1.35%	- 2.94%	- 4.55%	1.64%	4.72%

(注) フィクスト・インカム(米ドル)クラス(日本円・ヘッジ)P - a c c 投資証券の初回純資産価格計算日は2015年6月3日であった。

## (インカム(米ドル))

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	2017年11月末日に 終了する 中間会計年度末	2018年5月末日 に終了する 会計年度末	2018年11月末日に 終了する 中間会計年度末	2019年5月末日 に終了する 会計年度末	2019年11月末日に 終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 <sup>(1)</sup>	2,618,934.77	1,326,488.05	-1,866,369.24	3,708,775.95	4,912,568.00
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	2,618,934.77	1,326,488.05	-1,866,369.24	3,708,775.95	4,912,568.00
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	2,618,934.77	1,326,488.05	-1,866,369.24	3,708,775.95	4,912,568.00
(d) 出資総額 <sup>(2)</sup>	161,929,820.69	151,457,204.17	144,318,647.93	137,065,284.80	139,056,923.59
(e) 発行済投資口総数 (クラスP - a c c 投資証券)	755,549.577口	782,024.824口	757,626.540口	634,957.585口	613,977.915口
(f) 純資産額	161,929,820.69	151,457,204.17	144,318,647.93	137,065,284.80	139,056,923.59
(g) 資産総額	162,041,588.87	153,618,217.88	147,269,972.75	138,143,693.29	139,235,786.51
(h) 1口当たり純資産価格 (クラスP - a c c 投資証券)	112.69	111.62	110.22	114.74	118.76
(i) 1口当たり当期純利益金 額または当期純損失金額 (クラスP - a c c 投資証券)	1.84	0.73	-1.38	2.96	4.14
(j) 分配総額	228,022.79	228,022.79	74,775.91	74,775.91	134,207.94
(k) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	99.93%	98.59%	98.00%	99.22%	99.87%
(m) 自己資本利益率 <sup>(3)</sup> (クラスP - a c c 投資証券)	5.96%	0.66%	-2.19%	2.80%	7.75%

(注) インカム(米ドル)は2014年1月28日に運用を開始した。

## (システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル))

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	2017年11月末日に 終了する 中間会計年度末	2018年5月末日に 終了する 会計年度末	2018年11月末日に 終了する 中間会計年度末	2019年5月末日に 終了する 会計年度末	2019年11月末日に 終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 <sup>(1)</sup>	15,201,358.29	- 872,142.33	- 26,236,915.98	776,359.25	30,547,510.91
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	15,201,358.29	- 872,142.33	- 26,236,915.98	776,359.25	30,547,510.91
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	15,201,358.29	- 872,142.33	- 26,236,915.98	776,359.25	30,547,510.91
(d) 出資総額 <sup>(2)</sup>	671,220,817.34	922,334,114.59	909,184,772.94	1,087,131,873.23	1,187,843,431.51
(e) 発行済投資口総数 (クラスP - a c c 投資証券)	2,321,929.206口	2,735,914.992口	2,796,739.017口	3,109,847.070口	3,305,422.535口
(f) 純資産額	671,220,817.34	922,334,114.59	909,184,772.94	1,087,131,873.23	1,187,843,431.51
(g) 資産総額	677,173,541.29	927,841,959.66	914,108,658.13	1,090,530,133.34	1,192,659,119.25
(h) 1口当たり純資産価格 (クラスP - a c c 投資証券)	102.59	102.49	101.55	105.81	109.41
(i) 1口当たり当期純利益金 額 または当期純損失金額 (クラスP - a c c 投資証券)	1.78	1.43	- 0.91	2.89	3.50
(j) 分配総額	1,520,436.75	4,724,440.37	3,388,469.56	6,857,835.39	4,515,771.12
(k) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	99.12%	99.41%	99.46%	99.69%	99.60%
(m) 自己資本利益率 <sup>(3)</sup> (クラスP - a c c 投資証券)	2.59%	2.49%	- 1.01%	3.24%	7.74%

(注) システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)は2017年6月1日に運用を開始した。

## ( システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル) )

( 別段の記載がない限り金額は米ドル表示 )

	2017年11月末日に 終了する 中間会計年度末	2018年5月末日に 終了する 会計年度末	2018年11月末日に 終了する 中間会計年度末	2019年5月末日に 終了する 会計年度末	2019年11月末日に 終了する 中間会計年度末
( a ) 営業収益 <sup>(1)</sup>	46,764,100.89	26,066,162.37	- 61,236,999.30	- 20,663,473.77	90,028,031.11
( b ) 経常利益金額または 経常損失金額	46,764,100.89	26,066,162.37	- 61,236,999.30	- 20,663,473.77	90,028,031.11
( c ) 当期純利益金額または 当期純損失金額	46,764,100.89	26,066,162.37	- 61,236,999.30	- 20,663,473.77	90,028,031.11
( d ) 出資総額 <sup>(2)</sup>	1,312,409,064.14	1,848,301,354.25	1,850,506,840.95	2,120,118,601.72	2,331,541,245.56
( e ) 発行済投資口総数 ( クラス P - a c c 投資証券 )	3,706,136.554口	5,282,863.601口	5,367,267.848口	5,559,346.912口	5,898,082.209口
( f ) 純資産額	1,312,409,064.14	1,848,301,354.25	1,850,506,840.95	2,120,118,601.72	2,331,541,245.56
( g ) 資産総額	1,321,659,865.24	1,862,745,062.13	1,854,944,036.42	2,124,607,994.28	2,345,840,197.41
( h ) 1口当たり純資産価格 ( クラス P - a c c 投資証券 )	104.81	105.36	103.59	107.15	112.07
( i ) 1口当たり当期純利益金 額 または当期純損失金額 ( クラス P - a c c 投資証券 )	3.40	2.26	- 1.87	1.61	4.74
( j ) 分配総額	2,500,281.41	8,806,623.44	6,989,575.03	13,445,368.29	6,778,479.23
( k ) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
( l ) 自己資本比率	99.30%	99.22%	99.76%	99.79%	99.39%
( m ) 自己資本利益率 <sup>(3)</sup> ( クラス P - a c c 投資証券 )	4.81%	5.36%	- 1.16%	1.70%	8.19%

(注) システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル) は2017年6月1日に運用を開始した。

## ( システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル) )

( 別段の記載がない限り金額は米ドル表示 )

	2017年11月末日に 終了する 中間会計年度末	2018年5月末日に 終了する 会計年度末	2018年11月末日に 終了する 中間会計年度末	2019年5月末日に 終了する 会計年度末	2019年11月末日に 終了する 中間会計年度末
( a ) 営業収益 <sup>(1)</sup>	13,641,642.31	5,655,859.38	- 22,342,754.96	- 16,073,905.69	27,354,123.21
( b ) 経常利益金額または 経常損失金額	13,641,642.31	5,655,859.38	- 22,342,754.96	- 16,073,905.69	27,354,123.21
( c ) 当期純利益金額または 当期純損失金額	13,641,642.31	5,655,859.38	- 22,342,754.96	- 16,073,905.69	27,354,123.21
( d ) 出資総額 <sup>(2)</sup>	291,509,961.35	449,170,847.39	477,370,229.06	531,905,248.10	589,998,727.11
( e ) 発行済投資口総数 ( クラス P - a c c 投資証券 )	798,661.265口	1,224,045.589口	1,314,682.370口	1,335,014.930口	1,471,146.212口
( f ) 純資産額	291,509,961.35	449,170,847.39	477,370,229.06	531,905,248.10	589,998,727.11
( g ) 資産総額	293,602,316.14	453,211,048.78	481,826,528.54	533,623,132.20	592,698,228.35
( h ) 1口当たり純資産価格 ( クラス P - a c c 投資証券 )	106.47	107.83	105.48	108.42	114.54
( i ) 1口当たり当期純利益金 額 または当期純損失金額 ( クラス P - a c c 投資証券 )	4.59	3.26	- 2.62	0.52	5.80
( j ) 分配総額	172,789.15	605,071.06	498,177.35	955,886.60	706,571.76
( k ) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
( l ) 自己資本比率	99.29%	99.11%	99.08%	99.68%	99.54%
( m ) 自己資本利益率 <sup>(3)</sup> ( クラス P - a c c 投資証券 )	6.47%	7.83%	- 0.93%	0.55%	8.59%

(注) システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル) は2017年6月1日に運用を開始した。

## (2) 外国投資法人の出資総額

2019年12月末日現在の出資総額および発行済投資証券総数は以下のとおりである。

なお、原則として、発行可能投資口総口数には制限がない。

	出資総額		発行済投資証券総数(口)	
	米ドル	百万円		
ダイナミック・インカム(米ドル)	516,808,405.41	56,622	クラスP - m d i s t 投資証券	2,012,041.344
			クラスP - a c c 投資証 券	592,316.327
フィクスト・インカム (米ドル)	194,801,270.30	21,342	クラスP - a c c 投資証 券	365,129.008
			クラス(日本円・ヘッ ジ) P - a c c 投資証券	1,041,998.686
インカム(米ドル)	140,794,542.15	15,425	クラスP - a c c 投資証 券	609,200.428
システムティック・ア ロケーション・ポート フォリオ・ディフェン シブ(米ドル)	1,202,947,005.60	131,795	クラスP - a c c 投資証 券	3,276,564.109
システムティック・ア ロケーション・ポート フォリオ・ミディアム (米ドル)	2,368,924,866.68	259,539	クラスP - a c c 投資証 券	5,786,185.875
システムティック・ア ロケーション・ポート フォリオ・ダイナミッ ク (米ドル)	621,645,644.75	68,107	クラスP - a c c 投資証 券	1,475,728.764

(注) 米ドルの円貨換算は、便宜上、2019年12月30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=109.56円)によります。以下、別段の記載がない限り、米ドルの円換算表示はすべてこれによるものとします。

## (3) 主要な投資主の状況

1993年4月5日付ルクセンブルグ法第41条により課されるルクセンブルグ銀行機密規定(改訂済)により、当該サブ・ファンドの主要な投資主に関する情報は公開できない。

## (4) 役員 の 状況

(2019年12月末日現在)

氏 名	役 職 名	略 歴	所有株式
トーマス・ポートマン (Thomas Portmann)	取締役会長 (チェアマン・オブ・ ザ・ボード・オブ・ ディレクターズ)	ユービーエス・ファンド・マネジメ ント(スイス)エイ・ジー、バーゼ ル、マネージング・ディレクター	該当なし
アイリス・エベラルド (Iris Eberhard)	取締役会役員 (メンバー・オブ・ ザ・ボード・オブ・ ディレクターズ)	UBSアセット・マネジメント・ス イス・エイ・ジー(チューリッヒ) マネージング・ディレクター	該当なし
トーマス・ローズ (Thomas Rose)	取締役会役員 (メンバー・オブ・ ザ・ボード・オブ・ ディレクターズ)	UBSアセット・マネジメント・ スイス・エイ・ジー(チューリッ ヒ)マネージング・ディレクター	該当なし
ロバート・スティンガー (Robert Süttinger)	取締役会役員 (メンバー・オブ・ ザ・ボード・オブ・ ディレクターズ)	UBSアセット・マネジメント・ スイス・エイ・ジー(チューリッ ヒ)マネージング・ディレクター	該当なし
トビアス・ミーヤー (Tobias Meyer)	取締役会役員 (メンバー・オブ・ ザ・ボード・オブ・ ディレクターズ)	UBSアセット・マネジメント・ スイス・エイ・ジー(チューリッ ヒ)エグゼクティブ・ディレクター	該当なし

(注) 本投資法人に従業員はいない。本投資法人の独立監査法人はプライスウォーターハウスクーパース・ソシエテ・コーペラティ  
ブ(PricewaterhouseCoopers, Société coopérative)である。

## (5) その他

## a. 定款の変更

本投資法人の定款は、投資主総会で補足またはその他に変更することができる。変更は、1915年8  
月10日法の規定における定足数および過半数に関する要件に従う。

## b. 事業譲渡または事業譲受

投資法人およびそのサブ・ファンドの解散、サブ・ファンドの合併

本投資法人およびそのサブ・ファンドの解散

定足数および過半数に関する法律条件を満たす投資主総会は本投資法人を清算することができる。

本投資法人の純資産総額が所定の最低資本金の3分の2または4分の1以下になった場合、本投資  
法人の取締役会は、本投資法人を清算するか否かについて投資主総会の採決を求めなければならない。  
本投資法人が解散する場合、清算は投資主総会で指名された一名以上の清算人が実行する。投資  
主総会では清算人の職務の範囲を決定する。清算人は投資主の最善の利益にかなうように本投資法人  
の資産を売却して、サブ・ファンドの清算による正味収入を投資主の保有量に比例して当該サブ・  
ファンドまたは投資証券クラスの投資主に分配する。清算の完了時(9か月かかる可能性がある)に  
投資主に分配できない清算収入は遅滞なくルクセンブルグの供託金庫(Caisse de Consignation)に  
預託される。

定められた期間を満了したサブ・ファンドは、それぞれの期間の終了時に自動的に解散および清算  
される。

同一サブ・ファンド内で各サブ・ファンドまたは投資証券クラスの純資産総額が当該サブ・ファン  
ドまたは投資証券クラスを経済的に合理的な管理のため要求される価額またはかかる価額に達しな  
かった場合、または政治、経済もしくは金融の状況が著しく変化した場合または合理化の一環とし

て、投資主総会または本投資法人の取締役は、該当する投資証券クラスのすべての投資証券を決定が効力を生じる評価日における純資産価格にて(投資対象の実際の換金率および経費を考慮して)買い戻すことを決定することができる。

下記「本投資法人の総会または関係するサブ・ファンドの投資主総会」の項の規定が投資主総会の決定のために適宜適用される。取締役会はまた、上記に記載される規定に従いサブ・ファンドまたは投資証券クラスを解散または清算できる。投資証券の買い戻しのための投資主総会または本投資法人の取締役会の決定は、有価証券報告書「第二部 外国投資法人の詳細情報 第3 管理及び運営、3 投資主・外国投資法人債権者の権利等(1) 投資主・外国投資法人債権者の権利(f) 報告書を受領する権利」の項に記載される通り関係するサブ・ファンドの投資主に通知する。

#### 本投資法人またはサブ・ファンドと他の投資信託(「UCI」)またはそのサブ・ファンドとの合併、サブ・ファンドの合併

「合併」とは、以下の取引である。

- a) 一もしくは複数のUCITSまたは当該UCITSのサブ・ファンド、すなわち「吸収対象UCITS」が、清算なしのその解散に基づき、すべての資産および負債を別の既存のUCITSまたは当該UCITSのサブ・ファンド、すなわち「吸収UCITS」に移転し、吸収対象UCITSの投資主が見返りに吸収UCITSの投資証券および適宜、当該投資証券の純資産価格の10%を超えない支払額を受け取る取引。
- b) 二つ以上のUCITSまたは当該UCITSのサブ・ファンド、すなわち「吸収対象UCITS」が、清算なしのその解散に基づき、すべての資産および負債を設立した別のUCITSまたは当該UCITSが当該UCITSのサブ・ファンド、すなわち「吸収UCITS」に移転し、吸収対象UCITSの投資主が見返りに吸収UCITSの投資証券および適宜、当該投資証券の純資産価格の10%を超えない支払額を受け取る取引。
- c) 負債が完済されるまで存続し続ける一もしくは複数のUCITSまたは当該UCITSのサブ・ファンド、すなわち「吸収対象UCITS」が、すべての純資産を同じUCITSの別のサブ・ファンド、当該UCITSが設立した別のUCITSまたは別の既存のUCITSもしくは当該UCITSのサブ・ファンド、すなわち「吸収UCITS」に移転する取引。

合併は、2010年法に規定される状況において認められる。合併の法律上の効果は、2010年法に準拠する。

「本投資法人およびそのサブ・ファンドの解散」の項に記載される状況の下で、本投資法人の取締役会は、サブ・ファンドまたは投資証券クラスの資産を本投資法人の別の既存のサブ・ファンドもしくは投資証券クラスまたは2010年法パート 一もしくは海外UCITSに関する2010年法の規則に基づきルクセンブルグの別のUCIに配分することができる。本投資法人の取締役会は、また(必要な場合、分裂または統合により、および投資主の比例的権限に相当する金額の支払を通じ)当該サブ・ファンドまたは投資証券クラスの投資証券を別のサブ・ファンドまたは投資証券クラスの投資証券として指定変更することを決定することができる。前項の本投資法人の取締役会の権限にかかわらず、上記のサブ・ファンドを合併する決定もまた、当該サブ・ファンドの投資主総会において採択することができる。

合併の決定は有価証券報告書「第二部 外国投資法人の詳細情報 第3 管理及び運営、3 投資主・外国投資法人債権者の権利等(1) 投資主・外国投資法人債権者の権利(f) 報告書を受領する権利」の項に記載される通り投資主に通知する。決定が公告されてから30日以内に投資主は保有する投資証券の一部または全部を、有価証券報告書「第二部 外国投資法人の詳細情報 第2 手続等 2 買戻し手続等」と題する項に記載する手続に従って、買戻手数料またはその他の管理事務手数料を支払わずに、その時点の純資産価額で買い戻す権限を有する。買戻しのために提出されなかった投資証券は、交換比率が計算される日と同日に計算した関係するサブ・ファンドの純資産価格に基づい

て交換される。割当てする投資証券が集合的投資ファンド(契約型オープン投資信託)の受益証券である場合、上記の決定は割当てに賛成票を投じた投資主だけを拘束する。

本投資法人の総会または関係するサブ・ファンドの投資主総会

サブ・ファンドの清算および合併のいずれの場合についても、本投資法人の総会または関係するサブ・ファンドの投資主総会の定足数は要求されず、決定は総会に出席するまたは委任状による投資証券の単純多数によって承認されることができる。

c . 出資の状況その他の重要事項

該当事項なし。

d . 訴訟事件その他の重要事項

半期報告書提出前6か月以内において、訴訟事件その他本投資法人に重要な影響を及ぼした事実および重要な影響を及ぼすことが予想される事実はない。

[次へ](#)

## 2 外国投資法人の運用状況

## (1) 投資状況

資産別および地域別の投資状況

(ダイナミック・インカム(米ドル))

(2019年12月末日現在)

資産の種類	国・地域名	時価合計(米ドル)	投資比率 (%)
債券	アメリカ合衆国	11,882,194.72	2.29
従来型 オプション	米国	- 8,574.45	0.00
	スイス	- 525,768.99	- 0.10
	フランス	- 546,498.06	- 0.11
	イギリス	- 628,389.35	- 0.12
	小計	- 1,709,230.85	- 0.33
投資信託	ルクセンブルグ	158,765,204.33	30.54
	アイルランド	103,394,060.00	19.89
	アメリカ合衆国	914,818.30	0.18
	イギリス	23,700.00	0.00
	小計	263,097,782.63	50.61
短期金融商品	アメリカ合衆国	29,897,898.50	5.75
株式	アメリカ合衆国	123,836,040.57	23.82
	日本	17,647,218.09	3.39
	イギリス	12,473,848.41	2.40
	フランス	10,952,205.65	2.11
	ドイツ	9,149,445.89	1.76
	オーストラリア	8,621,259.18	1.66
	スペイン	6,677,682.69	1.28
	オランダ	4,676,196.70	0.90
	イタリア	3,793,958.03	0.73
	アイルランド	2,715,736.07	0.52
	フィンランド	1,616,578.67	0.31
	ベルギー	731,294.00	0.14
	スイス	676,526.13	0.13
	オーストリア	443,337.13	0.09
	ポルトガル	350,935.37	0.07
	ルクセンブルグ	157,483.95	0.03
	カナダ	122,525.53	0.02
	バミューダ	107,915.35	0.02
	ジャージー	72,370.35	0.01
	アルゼンチン	58,337.88	0.01
	パプアニューギニア	35,389.31	0.01
	南アフリカ	21,414.85	0.00
	スウェーデン	18,232.56	0.00

	マン島	10,811.51	0.00
	シンガポール	9,755.26	0.00
	アラブ首長国連邦	5,266.87	0.00
	小計	204,981,766.00	39.43
	ポートフォリオ合計	508,150,411.00	97.75
	現金・その他資産(負債控除後)	11,692,475.77	2.25
	資産総額	519,842,886.77	100.00
	負債総額	3,034,481.36	0.58
	合計 (純資産総額)	516,808,405.41 (約56,622百万円)	99.42

(注) 投資比率とは、ファンドの資産総額に対する当該資産の時価の比率をいう。以下同じ。

(フィクスト・インカム(米ドル))

(2019年12月末日現在)

資産の種類	国・地域名	時価合計(米ドル)	投資比率(%)
債券	アメリカ合衆国	55,594,197.67	28.46
	カナダ	6,862,209.74	3.51
	ドイツ	5,810,866.31	2.97
	オランダ	4,393,776.90	2.25
	韓国	3,555,867.19	1.82
	ルクセンブルグ	3,378,218.17	1.73
	フランス	2,548,008.88	1.30
	国際機関	2,430,039.60	1.24
	オーストラリア	1,937,055.50	0.99
	カタール	1,820,687.50	0.93
	クウェート	1,722,499.99	0.88
	アラブ首長国連邦	1,256,400.00	0.64
	フィリピン	1,149,986.07	0.59
	スウェーデン	1,049,699.30	0.54
	ジャージー	1,003,386.00	0.51
	イギリス	844,705.28	0.43
	シンガポール	841,824.00	0.43
	日本	686,232.70	0.35
	ノルウェー	636,881.87	0.33
	ニュージーランド	400,564.00	0.21
オーストリア	50,566.44	0.03	
	小計	97,973,673.11	50.15
投資信託	ルクセンブルグ	87,137,454.10	44.60
ポートフォリオ合計		185,111,127.21	94.75
現金・その他資産		10,260,733.90	5.25
資産総額		195,371,861.11	100.00
負債総額		570,590.81	0.29
合計 (純資産総額)		194,801,270.30 (約21,342百万円)	99.71

(インカム(米ドル))

(2019年12月末日現在)

資産の種類	国・地域名	時価合計(米ドル)	投資比率(%)
債券	アメリカ合衆国	21,290,022.31	15.05
	カナダ	2,944,376.75	2.08
	オランダ	1,870,307.47	1.32
	ドイツ	1,789,535.25	1.27
	韓国	1,540,500.00	1.09
	カタール	1,270,687.50	0.90
	オーストラリア	1,206,162.25	0.85
	フィリピン	1,163,032.39	0.82
	ルクセンブルグ	954,542.77	0.67
	クウェート	861,250.00	0.61
	国際機関	794,656.43	0.56
	イギリス	649,159.57	0.46
	シンガポール	526,140.00	0.37
	アラブ首長国連邦	418,800.00	0.30
	日本	404,478.68	0.29
	フランス	325,266.24	0.23
	ノルウェー	252,556.61	0.18
	ニュージーランド	200,282.00	0.14
	小計	38,461,756.22	27.19
	投資信託	ルクセンブルグ	88,820,507.78
アイルランド		2,794,879.88	1.98
小計		91,615,387.66	64.77
ポートフォリオ合計		130,077,143.88	91.97
現金・その他資産		11,362,184.96	8.03
資産総額		141,439,328.84	100.00
負債総額		644,786.69	0.46
合計 (純資産総額)		140,794,542.15 (約15,425百万円)	99.54

(システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル))

(2019年12月末日現在)

資産の種類	国・地域名	時価合計(米ドル)	投資比率(%)
債券	アメリカ合衆国	232,909,463.78	17.87
	カナダ	24,516,081.42	1.88
	韓国	12,770,778.13	0.98
	オーストラリア	11,002,181.75	0.84
	ドイツ	8,910,580.57	0.68
	オランダ	7,659,047.56	0.59
	国際機関	7,143,045.22	0.55
	ルクセンブルグ	6,831,743.22	0.52
	フィリピン	6,481,239.03	0.50
	フランス	5,530,297.76	0.42
	アラブ首長国連邦	4,685,325.00	0.36
	カタール	4,297,187.50	0.33
	日本	4,062,045.88	0.31
	ノルウェー	2,955,521.87	0.23
	シンガポール	2,666,522.40	0.20
	クウェート	2,583,750.00	0.20
	フィンランド	2,127,227.74	0.16
	ジャージー	1,806,094.80	0.14
	イギリス	1,588,686.59	0.12
	スウェーデン	1,304,523.97	0.10
	ケイマン諸島	1,153,968.75	0.09
	ベルギー	899,994.60	0.07
	ニュージーランド	700,987.00	0.05
	オーストリア	455,097.96	0.03
	デンマーク	424,189.10	0.03
	イギリス領ヴァージン諸島	267,352.50	0.02
	小計	355,732,934.10	27.29
投資信託	ルクセンブルグ	526,979,109.80	40.43
	アイルランド	95,515,041.25	7.33
	小計	622,494,151.05	47.76
短期金融商品	アメリカ合衆国	4,988,250.08	0.38
その他有価証券	アイルランド	47,697,170.00	3.66
株式	スイス	39,865,693.37	3.06
	フランス	22,820,908.38	1.75
	ドイツ	17,536,511.80	1.35
	オランダ	7,697,371.50	0.59
	スペイン	5,823,721.47	0.45
	イタリア	4,228,624.41	0.32
	ベルギー	2,014,991.54	0.15

	フィンランド	1,945,295.92	0.15
	イギリス	1,331,344.94	0.10
	アイルランド	1,164,779.89	0.09
	ルクセンブルグ	511,333.61	0.04
	オーストリア	470,563.80	0.04
	ポルトガル	334,511.16	0.03
	カナダ	18.60	0.00
	小計	105,745,670.39	8.11
	ポートフォリオ合計	1,136,658,175.62	87.21
	現金・その他資産(負債控除後)	166,682,783.53	12.79
	資産総額	1,303,340,959.15	100.00
	負債総額	100,393,953.55	7.70
	合計(純資産総額)	1,202,947,005.60 (約131,795百万円)	92.30

( システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル) )

( 2019年12月末日現在 )

資産の種類	国・地域名	時価合計(米ドル)	投資比率(%)
債券	アメリカ合衆国	274,261,421.95	11.17
	カナダ	29,952,730.28	1.22
	韓国	18,730,600.00	0.76
	ドイツ	14,708,831.93	0.60
	オーストラリア	14,186,903.87	0.58
	オランダ	12,269,531.48	0.50
	ルクセンブルグ	11,053,324.71	0.45
	国際機関	10,645,567.46	0.43
	フィリピン	9,104,266.22	0.37
	クウェート	6,459,375.00	0.26
	アラブ首長国連邦	5,941,725.00	0.24
	フランス	5,798,214.35	0.24
	カタール	5,078,312.50	0.21
	ノルウェー	4,898,540.45	0.20
	日本	4,784,385.81	0.19
	シンガポール	3,570,564.78	0.15
	フィンランド	2,878,319.44	0.12
	スウェーデン	2,211,602.90	0.09
	イギリス	2,164,038.26	0.09
	ケイマン諸島	1,678,500.00	0.07
	ジャージー	1,555,248.30	0.06
	ニュージーランド	1,001,410.00	0.04
	イギリス領ヴァージン諸島	721,851.75	0.03
	オーストリア	682,646.93	0.03
	ベルギー	649,996.10	0.03
	デンマーク	349,332.20	0.01
	小計	445,337,241.67	18.14
投資信託	ルクセンブルグ	847,363,288.05	34.52
	アイルランド	468,242,548.75	19.07
	イギリス	273,465.20	0.01
	カナダ	115,872.30	0.00
	小計	1,315,995,174.30	53.61
短期金融商品	アメリカ合衆国	19,953,000.30	0.81
その他有価証券	アイルランド	70,294,330.00	2.86
株式	スイス	73,737,091.08	3.00
	日本	72,846,143.31	2.97
	フランス	59,115,541.45	2.41
	カナダ	47,834,907.73	1.95
	ドイツ	45,513,178.86	1.85

イギリス	44,405,498.57	1.81
オランダ	24,691,920.72	1.01
スペイン	15,074,410.84	0.61
イタリア	10,948,070.56	0.45
ベルギー	5,286,974.61	0.22
フィンランド	5,071,572.94	0.21
アイルランド	3,683,160.30	0.15
ルクセンブルグ	1,296,110.30	0.05
オーストリア	1,179,954.82	0.05
オーストラリア	993,498.57	0.04
ポルトガル	858,019.04	0.03
ジャージー	671,081.32	0.03
アメリカ合衆国	314,736.84	0.01
南アフリカ	226,546.56	0.01
マン島	141,158.66	0.01
アラブ首長国連邦	72,144.48	0.00
小計	413,961,721.56	16.86
ポートフォリオ合計	2,265,541,467.83	92.29
現金・その他資産(負債控除後)	189,368,592.98	7.71
資産総額	2,454,910,060.81	100.00
負債総額	85,985,194.13	3.50
合計(純資産総額)	2,368,924,866.68 (約259,539百万円)	96.50

(システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル))

(2019年12月末日現在)

資産の種類	国・地域名	時価合計(米ドル)	投資比率(%)
債券	アメリカ合衆国	61,891,689.24	9.64
	カナダ	11,659,789.34	1.82
	ドイツ	6,153,709.66	0.96
	韓国	5,642,856.25	0.88
	オランダ	4,322,414.27	0.67
	ルクセンブルグ	4,193,924.92	0.65
	オーストラリア	4,157,445.62	0.65
	国際機関	3,510,344.82	0.55
	フィリピン	3,325,851.08	0.52
	フランス	2,995,667.63	0.47
	カタール	2,483,335.93	0.39
	アラブ首長国連邦	1,989,300.00	0.31
	日本	1,696,138.81	0.26
	クウェート	1,614,843.75	0.25
	シンガポール	1,554,441.19	0.24
	ノルウェー	1,274,902.19	0.20
	ジャージー	802,708.80	0.13
	フィンランド	700,750.78	0.11
	スウェーデン	652,261.97	0.10
	イギリス	416,969.43	0.06
	ニュージーランド	400,564.00	0.06
	ベルギー	399,997.60	0.06
	オーストリア	328,681.86	0.05
	イギリス領ヴァージン諸島	320,823.00	0.05
	ケイマン諸島	314,718.75	0.05
	デンマーク	224,570.70	0.03
	小計	123,028,701.59	19.16
投資信託	アイルランド	184,999,284.99	28.82
	ルクセンブルグ	97,763,986.74	15.23
	イギリス	149,866.25	0.02
	カナダ	29,489.14	0.00
	小計	282,942,627.12	44.07
短期金融商品	アメリカ合衆国	3,192,480.05	0.50
その他有価証券	アイルランド	12,228,210.00	1.90
株式	日本	31,662,266.13	4.93
	イギリス	22,751,859.08	3.54
	フランス	19,836,005.32	3.09
	スイス	19,216,323.77	2.99
	ドイツ	15,326,871.08	2.39

オーストラリア	12,734,255.10	1.98
カナダ	12,548,794.70	1.95
オランダ	9,349,861.28	1.46
スペイン	5,062,689.89	0.79
イタリア	3,713,045.57	0.58
ベルギー	1,808,442.72	0.28
フィンランド	1,694,632.81	0.26
アイルランド	1,568,401.19	0.24
ルクセンブルグ	436,898.37	0.07
オーストリア	407,410.98	0.06
ジャージー	361,848.65	0.06
ポルトガル	281,382.06	0.04
南アフリカ	125,436.54	0.02
アメリカ合衆国	83,929.82	0.01
マン島	81,794.95	0.01
パプアニューギニア	76,792.37	0.01
アラブ首長国連邦	23,338.11	0.00
小計	159,152,280.49	24.79
ポートフォリオ合計	580,544,299.25	90.43
現金・その他資産(負債控除後)	61,442,555.54	9.57
資産総額	641,986,854.79	100.00
負債総額	20,341,210.04	3.17
合計(純資産総額)	621,645,644.75 (約68,107百万円)	96.83

## (2) 運用実績

## 純資産等の推移

2019年12月末日までの1年間における各月末の総資産および純資産の推移は以下のとおりである。

## (ダイナミック・インカム (米ドル))

	資産総額		純資産総額		1口当たり純資産価格 (クラスP - m d i s t 投資証券)		1口当たり純資産価格 (クラスP - a c c 投資証券)	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円	米ドル	円
2019年1月末日	108,129.05	11,847	92,470.74	10,131	100.80	11,044	100.81	11,045
2月末日	185,196.45	20,290	168,655.12	18,478	102.35	11,213	102.35	11,213
3月末日	278,899.70	30,556	271,539.95	29,750	102.78	11,261	103.26	11,313
4月末日	324,678.41	35,572	319,138.01	34,965	103.46	11,335	104.42	11,440
5月末日	326,809.16	35,805	326,403.80	35,761	99.84	10,938	101.24	11,092
6月末日	413,738.60	45,329	360,984.91	39,550	102.45	11,224	104.45	11,444
7月末日	445,988.37	48,862	394,156.12	43,184	102.60	11,241	105.06	11,510
8月末日	465,349.16	50,984	412,137.67	45,154	101.39	11,108	104.29	11,426
9月末日	431,241.75	47,247	428,474.48	46,944	102.05	11,181	105.43	11,551
10月末日	465,405.66	50,990	459,405.61	50,332	102.58	11,239	106.44	11,662
11月末日	514,490.86	56,368	501,866.14	54,984	102.92	11,276	107.26	11,751
12月末日	519,842.89	56,954	516,808.41	56,622	104.00	11,394	108.85	11,926

(注) ダイナミック・インカム (米ドル) は2019年1月28日に運用を開始した。

## (フィクスト・インカム (米ドル))

	資産総額		純資産総額		1口当たり純資産価格 (クラスP - a c c 投資証券)		1口当たり純資産価格 (クラス(日本円・ ヘッジ)P - a c c 投資証券)
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円	円
2019年1月末日	165,332.37	18,114	164,293.51	18,000	233.21	25,550	9,826
2月末日	155,291.35	17,014	155,236.67	17,008	233.83	25,618	9,837
3月末日	156,437.46	17,139	155,951.45	17,086	236.59	25,921	9,933
4月末日	155,422.29	17,028	155,160.37	16,999	237.23	25,991	9,935
5月末日	155,016.98	16,984	153,368.22	16,803	239.06	26,191	9,984
6月末日	150,819.10	16,524	150,543.23	16,494	241.95	26,508	10,082
7月末日	151,855.17	16,637	151,572.50	16,606	242.06	26,520	10,060
8月末日	162,203.55	17,771	158,400.64	17,354	244.94	26,836	10,159
9月末日	156,135.95	17,106	155,702.11	17,059	244.27	26,762	10,109
10月末日	157,613.35	17,268	156,199.09	17,113	244.92	26,833	10,113
11月末日	164,938.10	18,071	160,989.75	17,638	244.88	26,829	10,102
12月末日	195,371.86	21,405	194,801.27	21,342	245.59	26,907	10,112

## (インカム(米ドル))

	資産総額		純資産総額		1口当たり純資産価格 (クラスP - a c c 投資証券)	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円
2019年1月末日	140,781.13	15,424	138,748.11	15,201	112.39	12,313
2月末日	139,063.57	15,236	138,394.05	15,162	113.04	12,385
3月末日	139,112.37	15,241	138,080.67	15,128	114.36	12,529
4月末日	139,269.53	15,258	138,060.88	15,126	115.16	12,617
5月末日	138,143.69	15,135	137,065.28	15,017	114.74	12,571
6月末日	140,689.07	15,414	140,322.18	15,374	116.97	12,815
7月末日	141,308.20	15,482	140,678.56	15,413	117.23	12,844
8月末日	141,367.90	15,488	140,869.36	15,434	117.78	12,904
9月末日	141,026.01	15,451	140,710.37	15,416	117.71	12,896
10月末日	141,306.68	15,482	140,257.94	15,367	118.23	12,953
11月末日	139,235.79	15,255	139,056.92	15,235	118.76	13,011
12月末日	141,439.33	15,496	140,794.54	15,425	119.77	13,122

## (システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル))

	資産総額		純資産総額		1口当たり純資産価格 (クラスP - a c c 投資証券)	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円
2019年1月末日	943,395.14	103,358	937,386.64	102,700	103.41	11,330
2月末日	971,542.73	106,442	962,822.03	105,487	104.28	11,425
3月末日	1,021,920.52	111,962	1,014,781.69	111,179	105.66	11,576
4月末日	1,087,559.86	119,153	1,070,318.42	117,264	107.18	11,743
5月末日	1,090,530.13	119,478	1,087,131.87	119,106	105.81	11,593
6月末日	1,154,829.99	126,523	1,143,772.85	125,312	108.15	11,849
7月末日	1,193,362.71	130,745	1,186,545.63	129,998	108.65	11,904
8月末日	1,252,040.91	137,174	1,202,069.20	131,699	108.53	11,891
9月末日	1,230,428.44	134,806	1,226,589.03	134,385	108.27	11,862
10月末日	1,246,296.99	136,544	1,236,514.93	135,473	108.40	11,876
11月末日	1,192,659.12	130,668	1,187,843.43	130,140	109.41	11,987
12月末日	1,303,340.96	142,794	1,202,947.01	131,795	110.69	12,127

## (システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル))

	資産総額		純資産総額		1口当たり純資産価格 (クラスP - a c c 投資証券)	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円
2019年1月末日	1,937,082.39	212,227	1,914,916.27	209,798	105.11	11,516
2月末日	1,982,890.46	217,245	1,966,536.62	215,454	106.42	11,659
3月末日	2,090,968.54	229,087	2,065,033.08	226,245	107.88	11,819
4月末日	2,179,092.38	238,741	2,136,509.19	234,076	110.23	12,077
5月末日	2,124,607.99	232,772	2,120,118.60	232,280	107.15	11,739
6月末日	2,228,485.82	244,153	2,214,386.58	242,608	110.36	12,091
7月末日	2,262,305.71	247,858	2,242,097.63	245,644	111.14	12,176
8月末日	2,312,695.27	253,379	2,234,905.91	244,856	109.85	12,035
9月末日	2,275,921.59	249,350	2,271,925.84	248,912	109.92	12,043
10月末日	2,319,008.00	254,071	2,310,034.44	253,087	110.26	12,080
11月末日	2,345,840.20	257,010	2,331,541.25	255,444	112.07	12,278
12月末日	2,454,910.06	268,960	2,368,924.87	259,539	114.00	12,490

## (システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル))

	資産総額		純資産総額		1口当たり純資産価格 (クラスP - a c c 投資証券)	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円
2019年1月末日	516,342.81	56,571	498,773.48	54,646	106.62	11,681
2月末日	518,827.13	56,843	514,191.80	56,335	108.51	11,888
3月末日	527,397.93	57,782	521,811.96	57,170	109.97	12,048
4月末日	550,724.26	60,337	538,181.74	58,963	113.24	12,407
5月末日	533,623.13	58,464	531,905.25	58,276	108.42	11,878
6月末日	574,134.78	62,902	568,089.81	62,240	112.53	12,329
7月末日	583,919.67	63,974	579,006.63	63,436	113.62	12,448
8月末日	597,123.96	65,421	582,407.93	63,809	111.04	12,166
9月末日	587,973.43	64,418	586,392.12	64,245	111.40	12,205
10月末日	587,768.24	64,396	585,853.77	64,186	111.89	12,259
11月末日	592,698.23	64,936	589,998.73	64,640	114.54	12,549
12月末日	641,986.85	70,336	621,645.64	68,107	117.11	12,831

ファンドの投資証券は、ルクセンブルグ証券取引所に上場されている。  
同取引所での実質的な取引実績はない。

## 分配の推移

2019年12月末日前1年間における各月の1口当たり分配金は以下のとおりである。

## ダイナミック・インカム(米ドル)クラスP - m d i s t 投資証券

期間	1口当たりの分配金額	
	米ドル	円
2019年2月	0.48	53
3月	0.48	53
4月	0.48	53
5月	0.54	59
6月	0.45	49
7月	0.45	49
8月	0.45	49
9月	0.45	49
10月	0.45	49
11月	0.44	48
12月	0.45	49

(注) 各月の分配金は、各月末までに宣言された金額である。

## ダイナミック・インカム(米ドル)

クラスP - a c c (米ドル) 投資証券

## フィクスト・インカム(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

クラス(日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券

## インカム(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

## システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

## システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

## システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

該当事項なし

## 自己資本利益率(収益率)の推移

2019年1月1日から2019年12月末日までの1年間の自己資本利益率(収益率)は以下のとおりである。

	収益率(%) (注)	
	ダイナミック・インカム(米ドル)	クラスP - m d i s t 投資証券
	クラスP - a c c 投資証券	8.85
フィクスト・インカム(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	6.97
	クラス(日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券	4.28

インカム(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	9.62
システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	8.48
システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	10.51
システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	12.36

(注1) 収益率(%) =  $100 \times (a - b) / b$

a = 2019年12月末日現在の1口当たり純資産価格(当該期間に支払われた分配金の合計金額を加えた額)

b = 2018年12月末日現在の1口当たり純資産価格(分配額の額)

ただし、ダイナミック・インカム(米ドル)クラスP - m d i s t 投資証券については100米ドルおよびダイナミック・インカム(米ドル)クラスP - a c c 投資証券については100米ドル

(注2) ダイナミック・インカム(米ドル)は2019年1月28日に運用を開始した。

### (3) 投資リスク

当中間計算期間において、2019年11月14日提出の有価証券報告書「第一部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 3 投資リスク」に記載される投資リスクについて、重要な変更はない。

本投資法人が将来にわたって営業活動を継続するにあたり重要な疑義を生じさせるような事象または状況、その他本投資法人の経営に重要な影響を及ぼす事象は、半期報告書提出日現在、存在しない。

[次へ](#)

## 3 資産運用会社の概況

## (1) 名称及び資本金の額

UBS ファンド・マネジメント (ルクセンブルグ) エス・エイ (管理会社)

資本金 (株主資本) の額

2019年12月末日現在の株主資本総額は、13,000,000ユーロ (約16億円)

(注) ユーロの円貨換算は、便宜上、2019年12月30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ユーロ = 122.54円) による。以下同じ。

UBS アセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー (チューリッヒ) (「投資運用会社」)

資本金 (株主資本) の額

2019年12月末日現在の株主資本総額は、500,000スイス・フラン (約5,620万円)

(注) スイスフランの円貨換算は、便宜上、2019年12月30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スイスフラン = 112.40円) による。以下同じ。

ユービーエス・スイス・エイ・ジー (チューリッヒ) (「投資運用会社」および「投資顧問会社」)

資本金 (株主資本) の額

2019年12月末日現在の株主資本総額は、1,000万スイスフラン (約11億円)

## (2) 大株主の状況

UBS ファンド・マネジメント (ルクセンブルグ) エス・エイ

(2019年12月末日現在)

名称	住所	所有株式数 (株)	比率 (%)
UBS アセット・ マネジメント・エイ・ジー (UBS Asset Management AG)	バーンホフ・シュトラセ45、CH- 8001 チューリッヒ、スイス	6,500	100

UBS アセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー (チューリッヒ)

(2019年12月末日現在)

名称	住所	所有株式数 (株)	比率 (%)
ユービーエス・エイ・ジー (UBS AG)	バーンホフ・シュトラセ45、CH- 8001 チューリッヒ、スイス	5,000,000	100

ユービーエス・スイス・エイ・ジー (チューリッヒ)

(2019年12月末日現在)

名称	住所	所有株式数 (株)	比率 (%)
ユービーエス・エイ・ジー (UBS AG)	バーンホフ・シュトラセ45、CH- 8001 チューリッヒ、スイス	100,000,000	100

## (3) 役員 の 状況

## UBS ファンド・マネジメント(ルクセンブルグ) エス・エイ

(2019年12月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有株式
アンドレ・ミュラー・ ウェグナー (André Müller-Wegner)	チェアマン	UBS アセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー、チューリッヒ、マネージング・ディレクター	該当なし
アンドレアス・シュラター (Andreas Schlatter)	ヴァイス・ チェアマン	スイス、キュッティンゲン、インディペンデント・ディレクター、数学者(博士)	該当なし
ギルバート・シントゲン (Gilbert Schintgen)	ディレクター/ ボード・メンバー	ルクセンブルグ大公国、ルクセンブルグ、ディレクター	該当なし
パスカル・キストラ (Pascal Kistler)	ディレクター/ ボード・メンバー	UBS ビジネスソリューションズ・エイ・ジー、チューリッヒ、マネージング・ディレクター	該当なし
フランチェスカ・ジリ・ プリム (Francesca Gigli Prym)	ディレクター/ ボード・メンバー	UBS ファンド・マネジメント(ルクセンブルグ) エス・エイ、チーフ・エグゼクティブ・オフィサー	該当なし

## UBS アセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)

(2019年12月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有株式
ミーダーホフ・マーカス・ ジョアンヌ (Miederhoff Markus Johannes)	ディレクター/ ボード・メンバー	2019年6月20日就任	該当なし
ウェルス・トーマス (Wels Thomas)	ディレクター/ ボード・メンバー	2019年6月20日就任	該当なし
ハインツ・トーマス・アントン (Heinzl Thomas Anton)	チェアマン	2019年6月20日就任	該当なし
フォン・シャックマン・ディ エルク・ヨアヒム (von Schuckmann Dierk Joachim)	ヴァイス・チェアマン	2019年6月20日就任	該当なし
スティラート・シャープ・イ ボンヌ・シルビア (Stillhart Sharp Yvonne Silvia)	社外インディペンデ ント・ディレクター	2019年6月20日就任	該当なし
ビョーハイム・ジェイコブ (Bjorheim Jacob)	社外インディペンデ ント・ディレクター	2019年6月20日就任	該当なし

## ユービーエス・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)

(2019年12月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有ユービーエス・グループ・エイ・ジー株式 (2018年12月31日現在)
ルーカス・ゲーヴィラー (Lukas Gähwiler)	チェアマン	2017年4月21日就任	非公開
セルジオ・ピー・エルモッティ (Sergio P. Ermotti)	ディレクター/ ボード・メンバー	2017年4月21日就任	3,473,196株
フベルト・エミル・マルクス・アケーマン (Hubert Emil Markus Acher mann)	ディレクター/ ボード・メンバー	2015年6月12日就任	非公開
ダニエル・ジェイ・クリティン (Daniel J. Crittin)	ディレクター/ ボード・メンバー	2016年4月25日就任	非公開
ガブリエラ・フーバー (Gabriela Huber)	ヴァイス・ チェアマン	2015年6月12日就任	非公開
クリスチャン・エッケハード・ブルーム (Christian Eckehard Bluhm)	ディレクター/ ボード・メンバー	2016年4月25日就任	259,745株

## (4) 事業の内容及び営業の概況

UBSファンド・マネジメント(ルクセンブルグ) エス・エイ

管理会社は、本投資法人と管理会社契約を締結し、当該契約に詳述された業務を遂行する。

2019年12月末日現在、管理会社は以下のとおり、395本の投資信託/投資法人のサブ・ファンドの管理・運用を行っている。

国別(設立国)	種類別(基本的性格)	本数	純資産額の合計(通貨別)
ルクセンブルグ	オープン・エンド型 投資信託/投資法人	360	549,900,721.82オーストラリア・ドル
			2,842,139,178.11カナダ・ドル
			12,606,831,772.86スイス・フラン
			3,478,664,563.36中国元
			871,700,713.32デンマーク・クローネ
			45,602,098,274.95ユーロ
			2,576,261,616.65英ポンド
			315,386,765.30香港ドル
			399,976,592,683.54日本円
			62,639,211.31シンガポール・ドル
			112,813,054,023.60米ドル
アイルランド	オープン・エンド型 投資信託/投資法人	35	376,100,388.99オーストラリア・ドル
			580,754,782.31スイス・フラン
			2,924,142,565.70ユーロ
			2,118,513,475.47英ポンド
			15,532,880,360.07米ドル

UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)

2019年12月末日現在、UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)は144本のサブ・ファンドを運用しており、そのうち運用資産額上位10位のサブ・ファンドは、以下のとおりである。

	名称	基本的性格	設定日	純資産総額 (ユーロ)
1	UBS(Lux)Bond Sicav - Convert Global(EUR)	変動資本を有する 投資法人	2004年11月23日	3,932,452,486
2	UBS ETF Sicav - MSCI EMU UCITS ETF	変動資本を有する 投資法人	2002年9月20日	3,245,317,737
3	UBS(Lux)Money Market Fund - USD	契約型投資信託	1988年11月29日	2,943,950,745
4	UBS(Lux)Strategy Sicav - Systematic Allocation Portfolio Medium(USD)	変動資本を有する 投資法人	2017年5月31日	2,110,400,772
5	Focused Sicav - High Grade Long Term Bond USD	変動資本を有する 投資法人	2006年10月31日	1,878,908,907
6	UBS(Lux)Money Market Fund - EUR	契約型投資信託	1989年10月11日	1,649,816,089

7	UBS(Lux)Strategy Fund - Yield(CHF)	契約型投資信託	1991年9月13日	1,600,718,126
8	UBS ETF Sicav - MSCI EMU Socially Responsible UCITS ETF	変動資本を有する投資法人	2017年12月15日	1,402,320,154
9	UBS(Lux)Strategy Fund - Balanced(CHF)	契約型投資信託	1994年7月7日	1,307,911,334
10	Focused Sicav - High Grade Bond USD	変動資本を有する投資法人	2005年9月2日	1,280,848,227

(注1) 一単位当たり純資産価格は開示していない。

(注2) 上記は管理会社から提供された情報に基づく。

ユービーエス・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)

2019年12月末日現在、ユービーエス・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)は以下の90本のサブ・ファンドを運用している。

国別(設立国)	種類別(基本的性格)	本数	純資産額の合計(通貨別)
スイス (ポートフォリオ・マネジャー)	オープン・エンド型 ファンド	4	22.7億スイスフラン
スイス (共同ポートフォリオ・マネ ジャー)	オープン・エンド型 ファンド	9	41.2億スイスフラン
ケイマン諸島 (ポートフォリオ・マネジャー)	ヘッジ・ファンド	5	85.4億スイスフラン
ルクセンブルグ (ポートフォリオ・マネジャー)	オープン・エンド型 ファンド	39	314.8億スイスフラン
ルクセンブルグ (共同ポートフォリオ・マネ ジャー)	オープン・エンド型 ファンド	31	125.1億スイスフラン
アイルランド (ポートフォリオ・マネジャー)	ヘッジ・ファンド	2	0.9億スイスフラン

(注1) 一部のファンドについては、ユービーエス・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)は、管理会社の選定およびアセット・アロケーションについてのみ責任を負っている。

(注2) 上記は管理会社から提供された情報に基づく。

[次へ](#)

#### 4 外国投資法人の経理状況

a. ファンドの日本語の中間財務書類は、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中間財務書類を翻訳したものである。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。

b. ファンドの原文の中間財務書類は、UBS (Lux) ストラテジー・シキャブおよび全てのサブ・ファンドにつき一括して作成されている。本書において、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。なお、各サブ・ファンドには下記のクラス投資証券以外のクラス投資証券も存在するが、本書においては下記のクラス投資証券に関する部分のみを抜粋して日本語に記載している。

- ダイナミック・インカム(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

クラスP - m d i s t 投資証券

- フィクスト・インカム(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

クラス(日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券

- インカム(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

クラス(日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券<sup>(注)</sup>

- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

(注) インカム(米ドル)のクラス(日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券は、2018年12月21日付で募集を停止し、また、2019年2月19日付で買戻しの受付を停止している。

c. ファンドの原文の中間財務書類は、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。)の監査を受けていない。

d. ファンドの原文の中間財務書類は、米ドルで表示されている。日本語の中間財務書類には、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、2019年12月30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米ドル=109.56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。

## (1) 資産及び負債の状況

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

## 純資産計算書

	2019年11月30日現在	
	(米ドル)	(千円)
<b>資 産</b>		
投資有価証券、取得価額	463,966,779.84	50,832,200
投資有価証券、未実現評価(損)益	23,507,951.75	2,575,531
投資有価証券合計(注1)	487,474,731.59	53,407,732
現金預金、要求払預金および預託金勘定	7,605,333.44*	833,240
有価証券売却未収金(注1)	17,232,880.64	1,888,034
発行未収金	2,004,957.25	219,663
有価証券に係る未収利息	27,338.40	2,995
配当金に係る未収金	335,916.57	36,803
その他の未収金	33,355.62	3,654
先渡為替契約に係る未実現(損)益(注1)	(204,369.01)	(22,391)
スワップに係る未実現(損)益(注1)	(19,287.52)	(2,113)
<b>資産合計</b>	<b>514,490,856.98</b>	<b>56,367,618</b>
<b>負 債</b>		
有価証券購入未払金(注1)	(8,035,551.24)	(880,375)
買戻未払金	(4,341,418.35)	(475,646)
報酬引当金(注2)	(211,695.88)	(23,193)
年次税引当金(注3)	(24,862.10)	(2,724)
その他の手数料および報酬引当金(注2)	(11,185.96)	(1,226)
引当金合計	(247,743.94)	(27,143)
<b>負債合計</b>	<b>(12,624,713.53)</b>	<b>(1,383,164)</b>
<b>期末現在純資産</b>	<b>501,866,143.45</b>	<b>54,984,455</b>

\* 2019年11月30日現在、当該金額のうち80,000米ドルについて、取引相手方であるユービーエス・エイ・ジーの担保となっている。

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - フィクスト・インカム (米ドル)

## 純資産計算書

	2019年11月30日現在	
	(米ドル)	(千円)
<b>資 産</b>		
投資有価証券、取得価額	149,983,061.54	16,432,144
投資有価証券、未実現評価(損)益	7,619,561.20	834,799
投資有価証券合計(注1)	157,602,622.74	17,266,943
現金預金、要求払預金および預託金勘定	7,227,442.07	791,839
有価証券に係る未収利息	517,167.17	56,661
先渡為替契約に係る未実現(損)益(注1)	(409,131.40)	(44,824)
<b>資産合計</b>	<b>164,938,100.58</b>	<b>18,070,618</b>
<b>負 債</b>		
当座借越に係る未払利息	(166.53)	(18)
有価証券購入未払金(注1)	(3,875,933.43)	(424,647)
報酬引当金(注2)	(63,120.29)	(6,915)
年次税引当金(注3)	(7,461.05)	(817)
その他の手数料および報酬引当金(注2)	(1,667.30)	(183)
引当金合計	(72,248.64)	(7,916)
<b>負債合計</b>	<b>(3,948,348.60)</b>	<b>(432,581)</b>
<b>期末現在純資産</b>	<b>160,989,751.98</b>	<b>17,638,037</b>

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - インカム (米ドル)

## 純資産計算書

	2019年11月30日現在	
	(米ドル)	(千円)
<b>資 産</b>		
投資有価証券、取得価額	121,502,450.99	13,311,809
投資有価証券、未実現評価(損)益	12,155,743.29	1,331,783
投資有価証券合計(注1)	133,658,194.28	14,643,592
現金預金、要求払預金および預託金勘定	4,470,329.02	489,769
その他の流動資産(マージン)	809,179.83	88,654
有価証券に係る未収利息	247,372.16	27,102
その他の未収金	22,769.09	2,495
流動資産に係る未収利息	30.46	3
金融先物に係る未実現(損)益(注1)	(64,277.63)	(7,042)
先渡為替契約に係る未実現(損)益(注1)	92,189.30	10,100
<b>資産合計</b>	<b>139,235,786.51</b>	<b>15,254,673</b>
<b>負 債</b>		
当座借越	(866.49)	(95)
当座借越に係る未払利息	(6.85)	(1)
有価証券購入未払金(注1)	(4.40)	(0)
買戻未払金	(100,000.07)	(10,956)
報酬引当金(注2)	(59,287.74)	(6,496)
年次税引当金(注3)	(4,486.71)	(492)
その他の手数料および報酬引当金(注2)	(14,210.66)	(1,557)
引当金合計	(77,985.11)	(8,544)
<b>負債合計</b>	<b>(178,862.92)</b>	<b>(19,596)</b>
<b>期末現在純資産</b>	<b>139,056,923.59</b>	<b>15,235,077</b>

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)

## 純資産計算書

	2019年11月30日現在	
	(米ドル)	(千円)
<b>資 産</b>		
投資有価証券、取得価額	1,099,555,291.45	120,467,278
投資有価証券、未実現評価(損)益	56,981,543.82	6,242,898
投資有価証券合計(注1)	1,156,536,835.27	126,710,176
現金預金、要求払預金および預託金勘定	24,553,719.37	2,690,105
その他の流動資産(マージン)	2,610,797.85	286,039
発行未収金	1,501,176.39	164,469
有価証券に係る未収利息	2,253,655.68	246,911
配当金に係る未収金	136,356.67	14,939
その他の未収金	98,855.95	10,831
金融先物に係る未実現(損)益(注1)	4,204,816.70	460,680
先渡為替契約に係る未実現(損)益(注1)	762,905.37	83,584
<b>資産合計</b>	<b>1,192,659,119.25</b>	<b>130,667,733</b>
<b>負 債</b>		
有価証券購入未払金(注1)	(2,623,049.17)	(287,381)
買戻未払金	(1,525,881.86)	(167,176)
報酬引当金(注2)	(532,493.01)	(58,340)
年次税引当金(注3)	(57,226.48)	(6,270)
その他の手数料および報酬引当金(注2)	(77,037.22)	(8,440)
引当金合計	(666,756.71)	(73,050)
<b>負債合計</b>	<b>(4,815,687.74)</b>	<b>(527,607)</b>
<b>期末現在純資産</b>	<b>1,187,843,431.51</b>	<b>130,140,126</b>

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)

## 純資産計算書

	2019年11月30日現在	
	(米ドル)	(千円)
<b>資 産</b>		
投資有価証券、取得価額	527,134,473.44	57,752,853
投資有価証券、未実現評価(損)益	46,644,302.97	5,110,350
投資有価証券合計(注1)	573,778,776.41	62,863,203
現金預金、要求払預金および預託金勘定	10,776,334.14	1,180,655
その他の流動資産(マージン)	2,980,109.98	326,501
有価証券売却未収金(注1)	93.92	10
発行未収金	196,842.84	21,566
有価証券に係る未収利息	736,735.26	80,717
配当金に係る未収金	392,803.60	43,036
その他の未収金	89,248.95	9,778
金融先物に係る未実現(損)益(注1)	3,085,259.11	338,021
先渡為替契約に係る未実現(損)益(注1)	662,024.14	72,531
<b>資産合計</b>	<b>592,698,228.35</b>	<b>64,936,018</b>
<b>負 債</b>		
当座借越	(2,249.11)	(246)
有価証券購入未払金(注1)	(1,257,373.20)	(137,758)
買戻未払金	(1,092,314.32)	(119,674)
報酬引当金(注2)	(294,152.55)	(32,227)
年次税引当金(注3)	(40,484.96)	(4,436)
その他の手数料および報酬引当金(注2)	(12,927.10)	(1,416)
引当金合計	(347,564.61)	(38,079)
<b>負債合計</b>	<b>(2,699,501.24)</b>	<b>(295,757)</b>
<b>期末現在純資産</b>	<b>589,998,727.11</b>	<b>64,640,261</b>

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

## 純資産計算書

	2019年11月30日現在	
	(米ドル)	(千円)
<b>資 産</b>		
投資有価証券、取得価額	2,104,230,831.29	230,539,530
投資有価証券、未実現評価(損)益	172,550,370.80	18,904,619
投資有価証券合計(注1)	2,276,781,202.09	249,444,149
現金預金、要求払預金および預託金勘定	41,630,754.77	4,561,065
その他の流動資産(マージン)	9,380,925.52	1,027,774
有価証券売却未収金(注1)	3,909.41	428
発行未収金	2,473,287.04	270,973
有価証券に係る未収利息	3,144,482.46	344,509
配当金に係る未収金	933,165.76	102,238
その他の未収金	250,234.45	27,416
金融先物に係る未実現(損)益(注1)	9,540,733.93	1,045,283
先渡為替契約に係る未実現(損)益(注1)	1,701,501.98	186,417
<b>資産合計</b>	<b>2,345,840,197.41</b>	<b>257,010,252</b>
<b>負 債</b>		
有価証券購入未払金(注1)	(7,365,492.55)	(806,963)
買戻未払金	(5,441,120.33)	(596,129)
報酬引当金(注2)	(1,169,005.24)	(128,076)
年次税引当金(注3)	(131,882.49)	(14,449)
その他の手数料および報酬引当金(注2)	(191,451.24)	(20,975)
引当金合計	(1,492,338.97)	(163,501)
<b>負債合計</b>	<b>(14,298,951.85)</b>	<b>(1,566,593)</b>
<b>期末現在純資産</b>	<b>2,331,541,245.56</b>	<b>255,443,659</b>

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

## 運用計算書

自2019年6月1日 至2019年11月30日

	(米ドル)	(千円)
<b>収 益</b>		
流動資産に係る利息	26,492.55	2,903
有価証券に係る利息	113,213.24	12,404
スワップに係る受取利息(注1)	124,107.98	13,597
配当金	1,300,859.54	142,522
貸付証券に係る収益(注12)	30,950.37	3,391
その他の収益(注4)	315,231.93	34,537
<b>収益合計</b>	<b>1,910,855.61</b>	<b>209,353</b>
<b>費 用</b>		
貸付証券に係るコスト(注12)	(12,380.15)	(1,356)
報酬(注2)	(2,290,712.80)	(250,970)
年次税(注3)	(65,570.13)	(7,184)
その他の手数料および報酬(注2)	(41,855.19)	(4,586)
現金および当座借越に係る利息	(1,209.24)	(132)
<b>費用合計</b>	<b>(2,411,727.51)</b>	<b>(264,229)</b>
<b>投資純(損)益</b>	<b>(500,871.90)</b>	<b>(54,876)</b>
<b>実現(損)益(注1)</b>		
無オプション市場価格証券に係る実現(損)益	(3,315,763.93)	(363,275)
オプションに係る実現(損)益	(1,451,109.71)	(158,984)
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	286,364.96	31,374
金融先物に係る実現(損)益	64,723.79	7,091
先渡為替契約に係る実現(損)益	1,459,526.94	159,906
スワップに係る実現(損)益	704,376.77	77,172
為替差(損)益	218,598.35	23,950
<b>実現(損)益合計</b>	<b>(2,033,282.83)</b>	<b>(222,766)</b>
<b>当期実現純(損)益</b>	<b>(2,534,154.73)</b>	<b>(277,642)</b>
<b>未実現評価(損)益の変動(注1)</b>		
無オプション市場価格証券に係る未実現評価(損)益	26,589,070.53	2,913,099
オプションに係る未実現評価(損)益	(209,688.30)	(22,973)
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	(30,390.14)	(3,330)
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	(811,779.26)	(88,939)
スワップに係る未実現評価(損)益	28,311.93	3,102
<b>未実現評価(損)益の変動合計</b>	<b>25,565,524.76</b>	<b>2,800,959</b>
<b>運用の結果による純資産の純増(減)</b>	<b>23,031,370.03</b>	<b>2,523,317</b>

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - フィクスト・インカム (米ドル)

## 運用計算書

自2019年6月1日 至2019年11月30日

	(米ドル)	(千円)
<b>収 益</b>		
流動資産に係る利息	8,418.46	922
有価証券に係る利息	1,021,023.63	111,863
スワップに係る受取利息(注1)	30,490.27	3,341
配当金	159,375.20	17,461
貸付証券に係る収益(注12)	16,864.18	1,848
その他の収益(注4)	24,201.22	2,651
<b>収益合計</b>	<b>1,260,372.96</b>	<b>138,086</b>
<b>費 用</b>		
スワップに係る支払利息(注1)	(488.68)	(54)
貸付証券に係るコスト(注12)	(6,745.67)	(739)
報酬(注2)	(814,437.60)	(89,230)
年次税(注3)	(21,291.40)	(2,333)
その他の手数料および報酬(注2)	(15,771.35)	(1,728)
現金および当座借越に係る利息	(358.92)	(39)
<b>費用合計</b>	<b>(859,093.62)</b>	<b>(94,122)</b>
<b>投資純(損)益</b>	<b>401,279.34</b>	<b>43,964</b>
<b>実現(損)益(注1)</b>		
無オプション市場価格証券に係る実現(損)益	658,884.59	72,187
金融先物に係る実現(損)益	(7,989.81)	(875)
先渡為替契約に係る実現(損)益	(264,271.48)	(28,954)
スワップに係る実現(損)益	120,904.11	13,246
為替差(損)益	75,106.92	8,229
<b>実現(損)益合計</b>	<b>582,634.33</b>	<b>63,833</b>
<b>当期実現純(損)益</b>	<b>983,913.67</b>	<b>107,798</b>
<b>未実現評価(損)益の変動(注1)</b>		
無オプション市場価格証券に係る未実現評価(損)益	2,830,733.84	310,135
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	4,100.80	449
金融先物に係る未実現評価(損)益	8,714.06	955
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	(1,307,794.25)	(143,282)
スワップに係る未実現評価(損)益	(73,938.36)	(8,101)
<b>未実現評価(損)益の変動合計</b>	<b>1,461,816.09</b>	<b>160,157</b>
<b>運用の結果による純資産の純増(減)</b>	<b>2,445,729.76</b>	<b>267,954</b>

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - インカム (米ドル)

## 運用計算書

自2019年6月1日 至2019年11月30日

	(米ドル)	(千円)
<b>収 益</b>		
流動資産に係る利息	12,871.93	1,410
有価証券に係る利息	588,189.57	64,442
スワップに係る受取利息(注1)	27,441.28	3,006
配当金	149,431.20	16,372
貸付証券に係る収益(注12)	12,738.98	1,396
その他の収益(注4)	11,232.66	1,231
<b>収益合計</b>	<b>801,905.62</b>	<b>87,857</b>
<b>費 用</b>		
スワップに係る支払利息(注1)	(439.82)	(48)
貸付証券に係るコスト(注12)	(5,095.59)	(558)
報酬(注2)	(779,007.99)	(85,348)
年次税(注3)	(13,904.24)	(1,523)
その他の手数料および報酬(注2)	(14,340.89)	(1,571)
現金および当座借越に係る利息	(2,026.87)	(222)
<b>費用合計</b>	<b>(814,815.40)</b>	<b>(89,271)</b>
<b>投資純(損)益</b>	<b>(12,909.78)</b>	<b>(1,414)</b>
<b>実現(損)益(注1)</b>		
無オプション市場価格証券に係る実現(損)益	1,859,191.87	203,693
金融先物に係る実現(損)益	(267,083.31)	(29,262)
先渡為替契約に係る実現(損)益	(278,894.82)	(30,556)
スワップに係る実現(損)益	108,503.04	11,888
為替差(損)益	46,519.53	5,097
<b>実現(損)益合計</b>	<b>1,468,236.31</b>	<b>160,860</b>
<b>当期実現純(損)益</b>	<b>1,455,326.53</b>	<b>159,446</b>
<b>未実現評価(損)益の変動(注1)</b>		
無オプション市場価格証券に係る未実現評価(損)益	3,719,151.11	407,470
オプションに係る未実現評価(損)益	(114,010.00)	(12,491)
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	1,662.49	182
金融先物に係る未実現評価(損)益	(65,137.26)	(7,136)
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	(17,880.35)	(1,959)
スワップに係る未実現評価(損)益	(66,544.52)	(7,291)
<b>未実現評価(損)益の変動合計</b>	<b>3,457,241.47</b>	<b>378,775</b>
<b>運用の結果による純資産の純増(減)</b>	<b>4,912,568.00</b>	<b>538,221</b>

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)

## 運用計算書

自2019年6月1日 至2019年11月30日

	(米ドル)	(千円)
<b>収 益</b>		
流動資産に係る利息	225,426.28	24,698
有価証券に係る利息	4,620,559.67	506,229
配当金	928,824.20	101,762
貸付証券に係る収益(注12)	100,184.92	10,976
その他の収益(注4)	334,111.04	36,605
<b>収益合計</b>	<b>6,209,106.11</b>	<b>680,270</b>
<b>費 用</b>		
貸付証券に係るコスト(注12)	(40,073.97)	(4,391)
報酬(注2)	(6,959,814.32)	(762,517)
年次税(注3)	(182,397.38)	(19,983)
その他の手数料および報酬(注2)	(121,438.59)	(13,305)
現金および当座借越に係る利息	(12,177.34)	(1,334)
<b>費用合計</b>	<b>(7,315,901.60)</b>	<b>(801,530)</b>
<b>投資純(損)益</b>	<b>(1,106,795.49)</b>	<b>(121,261)</b>
<b>実現(損)益(注1)</b>		
無オプション市場価格証券に係る実現(損)益	19,565,142.75	2,143,557
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	6,852.65	751
金融先物に係る実現(損)益	(18,556,834.55)	(2,033,087)
先渡為替契約に係る実現(損)益	(5,336,134.00)	(584,627)
為替差(損)益	1,421,387.05	155,727
<b>実現(損)益合計</b>	<b>(2,899,586.10)</b>	<b>(317,679)</b>
<b>当期実現純(損)益</b>	<b>(4,006,381.59)</b>	<b>(438,939)</b>
<b>未実現評価(損)益の変動(注1)</b>		
無オプション市場価格証券に係る未実現評価(損)益	30,494,249.98	3,340,950
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	27,393.55	3,001
金融先物に係る未実現評価(損)益	6,300,504.44	690,283
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	(2,268,255.47)	(248,510)
<b>未実現評価(損)益の変動合計</b>	<b>34,553,892.50</b>	<b>3,785,724</b>
<b>運用の結果による純資産の純増(減)</b>	<b>30,547,510.91</b>	<b>3,346,785</b>

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)

## 運用計算書

自2019年6月1日 至2019年11月30日

	(米ドル)	(千円)
<b>収 益</b>		
流動資産に係る利息	99,388.36	10,889
有価証券に係る利息	1,510,831.70	165,527
配当金	1,491,924.88	163,455
貸付証券に係る収益(注12)	71,984.53	7,887
その他の収益(注4)	71,980.96	7,886
<b>収益合計</b>	<b>3,246,110.43</b>	<b>355,644</b>
<b>費 用</b>		
貸付証券に係るコスト(注12)	(28,793.81)	(3,155)
報酬(注2)	(3,720,902.51)	(407,662)
年次税(注3)	(124,281.58)	(13,616)
その他の手数料および報酬(注2)	(59,044.63)	(6,469)
現金および当座借越に係る利息	(4,970.92)	(545)
<b>費用合計</b>	<b>(3,937,993.45)</b>	<b>(431,447)</b>
<b>投資純(損)益</b>	<b>(691,883.02)</b>	<b>(75,803)</b>
<b>実現(損)益(注1)</b>		
無オプション市場価格証券に係る実現(損)益	4,630,588.19	507,327
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	92,340.69	10,117
金融先物に係る実現(損)益	(18,996,043.44)	(2,081,207)
先渡為替契約に係る実現(損)益	(2,523,641.47)	(276,490)
スワップに係る実現(損)益	(3.11)	(0)
為替差(損)益	1,269,305.50	139,065
<b>実現(損)益合計</b>	<b>(15,527,453.64)</b>	<b>(1,701,188)</b>
<b>当期実現純(損)益</b>	<b>(16,219,336.66)</b>	<b>(1,776,991)</b>
<b>未実現評価(損)益の変動(注1)</b>		
無オプション市場価格証券に係る未実現評価(損)益	39,419,981.09	4,318,853
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	11,241.75	1,232
金融先物に係る未実現評価(損)益	5,941,631.84	650,965
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	(1,799,394.81)	(197,142)
<b>未実現評価(損)益の変動合計</b>	<b>43,573,459.87</b>	<b>4,773,908</b>
<b>運用の結果による純資産の純増(減)</b>	<b>27,354,123.21</b>	<b>2,996,918</b>

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

## 運用計算書

自2019年6月1日 至2019年11月30日

	(米ドル)	(千円)
<b>収 益</b>		
流動資産に係る利息	377,017.61	41,306
有価証券に係る利息	6,232,706.74	682,855
配当金	3,657,290.09	400,693
貸付証券に係る収益(注12)	254,050.95	27,834
その他の収益(注4)	164,622.15	18,036
<b>収益合計</b>	<b>10,685,687.54</b>	<b>1,170,724</b>
<b>費 用</b>		
貸付証券に係るコスト(注12)	(101,620.38)	(11,134)
報酬(注2)	(14,689,266.50)	(1,609,356)
年次税(注3)	(398,289.14)	(43,637)
その他の手数料および報酬(注2)	(229,991.50)	(25,198)
現金および当座借越に係る利息	(26,506.60)	(2,904)
<b>費用合計</b>	<b>(15,445,674.12)</b>	<b>(1,692,228)</b>
<b>投資純(損)益</b>	<b>(4,759,986.58)</b>	<b>(521,504)</b>
<b>実現(損)益(注1)</b>		
無オプション市場価格証券に係る実現(損)益	16,916,622.14	1,853,385
金融先物に係る実現(損)益	(54,470,305.93)	(5,967,767)
先渡為替契約に係る実現(損)益	(7,299,133.24)	(799,693)
スワップに係る実現(損)益	(12.80)	(1)
為替差(損)益	5,210,328.59	570,844
<b>実現(損)益合計</b>	<b>(39,642,501.24)</b>	<b>(4,343,232)</b>
<b>当期実現純(損)益</b>	<b>(44,402,487.82)</b>	<b>(4,864,737)</b>
<b>未実現評価(損)益の変動(注1)</b>		
無オプション市場価格証券に係る未実現評価(損)益	122,840,130.81	13,458,365
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	68,654.84	7,522
金融先物に係る未実現評価(損)益	17,261,272.86	1,891,145
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	(5,739,539.58)	(628,824)
<b>未実現評価(損)益の変動合計</b>	<b>134,430,518.93</b>	<b>14,728,208</b>
<b>運用の結果による純資産の純増(減)</b>	<b>90,028,031.11</b>	<b>9,863,471</b>

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

## 純資産変動計算書

	自2019年6月1日 至2019年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	326,403,802.47	35,760,801
発行額	210,971,594.10	23,114,048
買戻額	(49,378,366.50)	(5,409,894)
純発行(買戻)合計	161,593,227.60	17,704,154
支払配当金	(9,162,256.65)	(1,003,817)
投資純(損)益	(500,871.90)	(54,876)
実現(損)益合計	(2,033,282.83)	(222,766)
未実現評価(損)益の変動合計	25,565,524.76	2,800,959
運用の結果による純資産の純増(減)	23,031,370.03	2,523,317
<b>期末現在純資産</b>	<b>501,866,143.45</b>	<b>54,984,455</b>

## 発行済投資証券数の変動表

	自2019年6月1日 至2019年11月30日	
	(口)	
<b>クラスP - a c c</b>		
期首現在発行済投資証券数	369,590.5000	
期中発行投資証券数	292,518.6980	
期中買戻投資証券数	(59,383.8660)	
<b>期末現在発行済投資証券数</b>	<b>602,725.3320</b>	
<b>クラスP - m d i s t</b>		
期首現在発行済投資証券数	1,276,793.6250	
期中発行投資証券数	878,077.7590	
期中買戻投資証券数	(164,758.6140)	
<b>期末現在発行済投資証券数</b>	<b>1,990,112.7700</b>	

月次分配金<sup>1</sup>

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)	分配落ち日	支払日	通貨	1口当たり金額
P - m d i s t	2019年6月17日	2019年6月20日	米ドル	0.54
P - m d i s t	2019年7月15日	2019年7月18日	米ドル	0.45
P - m d i s t	2019年8月16日	2019年8月21日	米ドル	0.45
P - m d i s t	2019年9月16日	2019年9月19日	米ドル	0.45
P - m d i s t	2019年10月15日	2019年10月18日	米ドル	0.45
P - m d i s t	2019年11月15日	2019年11月20日	米ドル	0.45

<sup>1</sup> 注記5を参照

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

## 最重要数値

	ISIN	2019年11月30日	2019年5月31日
純資産額 (米ドル)		501 866 143.45	326 403 802.47
クラス P - a c c <sup>1</sup>	LU1917362490		
発行済投資証券数 (口)		602 725.3320	369 590.5000
1口当たり純資産価格 (米ドル)		107.26	101.24
1口当たり発行・買戻価格 (米ドル) <sup>2</sup>		107.26	101.49
クラス P - m d i s t <sup>1</sup>	LU1917361179		
発行済投資証券数 (口)		1 990 112.7700	1 276 793.6250
1口当たり純資産価格 (米ドル)		102.92	99.84
1口当たり発行・買戻価格 (米ドル) <sup>2</sup>		102.92	100.09

<sup>1</sup> 初回純資産価格計算日：2019年1月29日

<sup>2</sup> 注記1を参照

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

## 組入証券の構造

地域別分布表	(純資産に対する)		地域別分布表	(純資産に対する)	
	百分率	(%)		百分率	(%)
ルクセンブルグ	39.26		フィンランド	0.24	
アメリカ合衆国	24.34		スイス	0.11	
アイルランド	20.40		ベルギー	0.10	
日本	3.39		オーストリア	0.07	
イギリス	2.04		ポルトガル	0.05	
オーストラリア	1.68		バミューダ	0.02	
フランス	1.67		カナダ	0.02	
ドイツ	1.40		ジャージー	0.02	
スペイン	1.01		アルゼンチン	0.01	
オランダ	0.72		パプアニューギニア	0.01	
イタリア	0.57		合計	97.13	

業種別分布表	(純資産に対する)		業種別分布表	(純資産に対する)	
	百分率	(%)		百分率	(%)
投資信託	59.36		自動車	0.51	
国債・中央政府債	4.70		航空宇宙産業	0.50	
インターネット・ソフトウェア・ITサービス	3.25		各種貿易会社	0.38	
銀行・金融機関	3.12		その他のサービス業	0.34	
金融・持株会社	2.91		非鉄金属	0.27	
医薬品・化粧品・医療品	2.44		繊維・衣服・革製品	0.26	
コンピュータハードウェア・ネットワーク装置供給業	1.88		ヘルスケア・社会福祉	0.23	
通信	1.80		グラフィックデザイン・出版・メディア	0.22	
小売り・百貨店	1.49		林業・紙・パルプ製品	0.19	
エネルギー・水道	1.42		鉱業・石炭・鉄鋼	0.19	
電子機器・半導体	1.23		電子部品・デバイス	0.17	
石油	1.12		貴金属・宝石	0.07	
不動産	1.12		各種資本財	0.07	
機械工学・産業機器	1.11		ゴム・タイヤ	0.04	
保険	0.88		環境サービス・リサイクル	0.04	
食品・清涼飲料	0.87		その他の非分類会社	0.03	
交通・運輸	0.84		包装業	0.03	
バイオテクノロジー	0.81		農業・漁業	0.02	
建築業・資材	0.73		写真・光学	0.01	
宿泊・仕出し・レジャー	0.71		合計	97.13	
その他の消費財	0.69				
たばこ・アルコール	0.55				
化学	0.53				

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - フィクスト・インカム (米ドル)

## 純資産変動計算書

	自2019年6月1日 至2019年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	153,368,218.52	16,803,022
発行額	22,190,185.16	2,431,157
買戻額	(17,014,381.46)	(1,864,096)
純発行(買戻)合計	5,175,803.70	567,061
投資純(損)益	401,279.34	43,964
実現(損)益合計	582,634.33	63,833
未実現評価(損)益の変動合計	1,461,816.09	160,157
運用の結果による純資産の純増(減)	2,445,729.76	267,954
<b>期末現在純資産</b>	<b>160,989,751.98</b>	<b>17,638,037</b>

## 発行済投資証券数の変動表

	自2019年6月1日 至2019年11月30日	
	(口)	
<b>クラスP - a c c</b>		
期首現在発行済投資証券数	344,431.0760	
期中発行投資証券数	39,460.8760	
期中買戻投資証券数	(14,364.0020)	
<b>期末現在発行済投資証券数</b>	<b>369,527.9500</b>	
<b>クラス(日本円・ヘッジ)P - a c c</b>		
期首現在発行済投資証券数	684,496.6580	
期中発行投資証券数	98,784.9450	
期中買戻投資証券数	(107,368.1610)	
<b>期末現在発行済投資証券数</b>	<b>675,913.4420</b>	

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - フィクスト・インカム (米ドル)

## 最重要数値

	ISIN	2019年11月30日	2019年5月31日	2018年5月31日
純資産額 (米ドル)		160 989 751.98	153 368 218.52	171 926 461.34
クラス P - a c c	LU0042745397			
発行済投資証券数 (口)		369 527.9500	344 431.0760	394 876.3520
1口当たり純資産価格 (米ドル)		244.88	239.06	228.65
1口当たり発行・買戻価格 (米ドル) <sup>1</sup>		244.88	239.06	228.65
クラス (日本円・ヘッジ) P - a c c	LU1203193534			
発行済投資証券数 (口)		675 913.4420	684 496.6580	795 500.2490
1口当たり純資産価格 (日本円)		10 102	9 984	9 823
1口当たり発行・買戻価格 (日本円) <sup>1</sup>		10 102	9 984	9 823

<sup>1</sup> 注記1を参照

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - フィクスト・インカム (米ドル)

## 組入証券の構造

地域別分布表	(純資産に対する)		業種別分布表	(純資産に対する)	
	百分率	(%)		百分率	(%)
ルクセンブルグ	44.94		投資信託	43.15	
アメリカ合衆国	30.67		国債・中央政府債	16.69	
カナダ	4.17		銀行・金融機関	9.82	
オランダ	2.76		国際機関	6.37	
ドイツ	2.53		金融・持株会社	6.29	
韓国	2.22		郡・連邦州	3.14	
国際機関	2.20		コンピュータハードウェア・ネットワーク装置供給業	2.81	
フランス	1.24		石油	2.14	
オーストラリア	1.20		インターネット・ソフトウェア・ITサービス	1.92	
クウェート	1.07		公共・非営利機関	1.52	
フィリピン	0.72		その他のサービス業	1.04	
カタール	0.72		医薬品・化粧品・医療品	0.75	
スウェーデン	0.65		モーゲージ・資金調達機関	0.72	
ジャージー	0.62		バイオテクノロジー	0.69	
イギリス	0.52		小売り・百貨店	0.34	
シンガポール	0.52		その他の消費財	0.26	
日本	0.43		たばこ・アルコール	0.25	
アラブ首長国連邦	0.39		合計	97.90	
ニュージーランド	0.25				
ノルウェー	0.05				
オーストリア	0.03				
合計	97.90				

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - インカム (米ドル)

## 純資産変動計算書

	自2019年6月1日 至2019年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	137,065,284.80	15,016,873
発行額	4,206,005.49	460,810
買戻額	(6,992,726.76)	(766,123)
純発行(買戻)合計	(2,786,721.27)	(305,313)
支払配当金	(134,207.94)	(14,704)
投資純(損)益	(12,909.78)	(1,414)
実現(損)益合計	1,468,236.31	160,860
未実現評価(損)益の変動合計	3,457,241.47	378,775
運用の結果による純資産の純増(減)	4,912,568.00	538,221
<b>期末現在純資産</b>	<b>139,056,923.59</b>	<b>15,235,077</b>

## 発行済投資証券数の変動表

クラスP - a c c	自2019年6月1日 至2019年11月30日	
	(口)	
期首現在発行済投資証券数	634,957.5850	
期中発行投資証券数	31,151.3380	
期中買戻投資証券数	(52,131.0080)	
<b>期末現在発行済投資証券数</b>	<b>613,977.9150</b>	

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - インカム (米ドル)

## 最重要数値

	ISIN	2019年11月30日	2019年5月31日	2018年5月31日
純資産額 (米ドル)		139 056 923.59	137 065 284.80	151 457 204.17
クラス P - a c c	LU0994951548			
発行済投資証券数 (口)		613 977.9150	634 957.5850	782 024.8240
1口当たり純資産価格 (米ドル)		118.76	114.74	111.62
1口当たり発行・買戻価格 (米ドル) <sup>1</sup>		118.76	114.74	111.62
クラス (日本円・ヘッジ) P - a c c <sup>2</sup>	LU1411405076			
発行済投資証券数 (口)		-	-	31 126.2220
1口当たり純資産価格 (日本円)		-	-	10 167
1口当たり発行・買戻価格 (日本円) <sup>1</sup>		-	-	10 167

<sup>1</sup> 注記1を参照

<sup>2</sup> クラス (日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券は、2019年2月20日までの流通であった。

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - インカム (米ドル)

## 組入証券の構造

地域別分布表	(純資産に対する)		業種別分布表	(純資産に対する)	
	百分率	(%)		百分率	(%)
ルクセンブルグ	61.26		投資信託	62.21	
アメリカ合衆国	22.53		国債・中央政府債	14.30	
カナダ	1.92		銀行・金融機関	3.85	
アイルランド	1.79		国際機関	3.65	
オランダ	1.35		金融・持株会社	3.24	
韓国	1.26		コンピュータハードウェア・ネットワーク装置供給業	2.03	
ドイツ	1.06		郡・連邦州	1.72	
オーストラリア	1.02		インターネット・ソフトウェア・ITサービス	1.31	
フィリピン	0.70		石油	1.29	
クウェート	0.62		その他のサービス業	0.60	
イギリス	0.47		小売り・百貨店	0.55	
カタール	0.43		公共・非営利機関	0.44	
シンガポール	0.38		その他の消費財	0.38	
国際機関	0.35		医薬品・化粧品・医療品	0.35	
アラブ首長国連邦	0.30		バイオテクノロジー	0.20	
フランス	0.21		合計	96.12	
ノルウェー	0.18				
日本	0.15				
ニュージーランド	0.14				
合計	96.12				

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)

## 純資産変動計算書

	自2019年6月1日 至2019年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	1,087,131,873.23	119,106,168
発行額	267,890,054.84	29,350,034
買戻額	(193,210,236.35)	(21,168,113)
純発行(買戻)合計	74,679,818.49	8,181,921
支払配当金	(4,515,771.12)	(494,748)
投資純(損)益	(1,106,795.49)	(121,261)
実現(損)益合計	(2,899,586.10)	(317,679)
未実現評価(損)益の変動合計	34,553,892.50	3,785,724
運用の結果による純資産の純増(減)	30,547,510.91	3,346,785
<b>期末現在純資産</b>	<b>1,187,843,431.51</b>	<b>130,140,126</b>

## 発行済投資証券数の変動表

クラスP - a c c	自2019年6月1日 至2019年11月30日	
	(口)	
期首現在発行済投資証券数	3,109,847.0700	
期中発行投資証券数	585,237.0790	
期中買戻投資証券数	(389,661.6140)	
<b>期末現在発行済投資証券数</b>	<b>3,305,422.5350</b>	

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)

## 最重要数値

	ISIN	2019年11月30日	2019年5月31日	2018年5月31日
純資産額(米ドル)		1 187 843 431.51	1 087 131 873.23	922 334 114.59
クラス P - a c c	LU1599185649			
発行済投資証券数(口)		3 305 422.5350	3 109 847.0700	2 735 914.9920
1口当たり純資産価格(米ドル)		109.41	105.81	102.49
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) <sup>1</sup>		109.41	106.02	102.49

<sup>1</sup> 注記1を参照

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)

## 組入証券の構造

地域別分布表	(純資産に対する)		地域別分布表	(純資産に対する)	
	百分率	(%)		百分率	(%)
ルクセンブルグ	41.16		フィンランド	0.37	
アメリカ合衆国	18.66		シンガポール	0.36	
アイルランド	12.50		イタリア	0.35	
スイス	3.22		ノルウェー	0.31	
カナダ	3.12		ベルギー	0.24	
ドイツ	3.10		スウェーデン	0.22	
フランス	2.73		クウェート	0.22	
イギリス	2.03		ジャージー	0.18	
オランダ	1.84		デンマーク	0.15	
韓国	1.28		ニュージーランド	0.12	
オーストラリア	1.00		オーストリア	0.11	
国際機関	0.99		ケイマン諸島	0.10	
フィリピン	0.95		英領ヴァージン諸島	0.08	
カタール	0.57		ポルトガル	0.03	
日本	0.48		南アフリカ	0.01	
スペイン	0.47		マン島	0.01	
アラブ首長国連邦	0.40		合計	97.36	

業種別分布表	(純資産に対する 百分率 %)	業種別分布表	(純資産に対する 百分率 %)
投資信託	48.39	電子機器・半導体	0.29
金融・持株会社	8.51	繊維・衣服・革製品	0.28
国債・中央政府債	7.70	交通・運輸	0.27
銀行・金融機関	7.62	自動車	0.24
国際機関	5.06	バイオテクノロジー	0.21
医薬品・化粧品・医療品	2.46	航空宇宙産業	0.21
コンピュータハードウェア・ネットワーク装置供給業	2.13	電子部品・デバイス	0.20
郡・連邦州	1.98	不動産	0.14
石油	1.93	機械工学・産業機器	0.14
インターネット・ソフトウェア・ITサービス	1.70	時計・宝飾品	0.12
食品・清涼飲料	0.99	各種資本財	0.11
小売り・百貨店	0.73	宿泊・仕出し・レジャー	0.10
保険	0.72	グラフィックデザイン・出版・メディア	0.10
たばこ・アルコール	0.62	非鉄金属	0.10
エネルギー・水道	0.61	鉱業・石炭・鉄鋼	0.08
モーゲージ・資金調達機関	0.59	林業・紙・パルプ製品	0.06
化学	0.57	ゴム・タイヤ	0.04
その他の消費財	0.54	各種貿易会社	0.03
公共・非営利機関	0.51	その他の非分類会社	0.02
その他のサービス業	0.46	ヘルスケア・社会福祉	0.02
通信	0.43	貴金属・宝石	0.01
建築業・資材	0.34	合計	97.36

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)

## 純資産変動計算書

	自2019年6月1日 至2019年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	531,905,248.10	58,275,539
発行額	94,381,585.97	10,340,447
買戻額	(62,935,658.41)	(6,895,231)
純発行(買戻)合計	31,445,927.56	3,445,216
支払配当金	(706,571.76)	(77,412)
投資純(損)益	(691,883.02)	(75,803)
実現(損)益合計	(15,527,453.64)	(1,701,188)
未実現評価(損)益の変動合計	43,573,459.87	4,773,908
運用の結果による純資産の純増(減)	27,354,123.21	2,996,918
<b>期末現在純資産</b>	<b>589,998,727.11</b>	<b>64,640,261</b>

## 発行済投資証券数の変動表

クラスP - a c c	自2019年6月1日 至2019年11月30日	
	(口)	
期首現在発行済投資証券数	1,335,014.9300	
期中発行投資証券数	228,049.6330	
期中買戻投資証券数	(91,918.3510)	
<b>期末現在発行済投資証券数</b>	<b>1,471,146.2120</b>	

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)

## 最重要数値

	ISIN	2019年11月30日	2019年 5月31日	2018年 5月31日
純資産額 (米ドル)		589 998 727.11	531 905 248.10	449 170 847.39
クラス P - a c c	LU1599187934			
発行済投資証券数 (口)		1 471 146.2120	1 335 014.9300	1 224 045.5890
1口当たり純資産価格 (米ドル)		114.54	108.42	107.83
1口当たり発行・買戻価格 (米ドル) <sup>1</sup>		114.54	108.42	107.97

<sup>1</sup> 注記 1 を参照

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)

## 組入証券の構造

地域別分布表	(純資産に対する 百分率 %)	地域別分布表	(純資産に対する 百分率 %)
アイルランド	34.02	カタール	0.35
ルクセンブルグ	16.69	アラブ首長国連邦	0.34
アメリカ合衆国	10.03	クウェート	0.27
日本	4.47	シンガポール	0.26
スイス	4.18	ノルウェー	0.22
フランス	4.16	ジャージー	0.20
カナダ	4.06	オーストリア	0.13
ドイツ	3.89	スウェーデン	0.11
イギリス	3.78	ニュージーランド	0.07
オーストラリア	2.82	英領ヴァージン諸島	0.06
オランダ	2.36	ポルトガル	0.05
韓国	0.96	ケイマン諸島	0.05
スペイン	0.92	デンマーク	0.04
イタリア	0.67	南アフリカ	0.02
国際機関	0.66	マン島	0.01
フィリピン	0.57	パプアニューギニア	0.01
フィンランド	0.43	合計	97.25
ベルギー	0.39		

業種別分布表	(純資産に対する 百分率 %)	業種別分布表	(純資産に対する 百分率 %)
投資信託	47.56	繊維・衣服・革製品	0.55
銀行・金融機関	7.18	電子部品・デバイス	0.46
金融・持株会社	6.50	機械工学・産業機器	0.43
医薬品・化粧品・医療品	3.61	鉱業・石炭・鉄鋼	0.42
国際機関	3.22	航空宇宙産業	0.41
国債・中央政府債	2.97	バイオテクノロジー	0.38
石油	2.42	グラフィックデザイン・出版・メディア	0.32
インターネット・ソフトウェア・ITサービス	2.03	非鉄金属	0.27
食品・清涼飲料	1.46	宿泊・仕出し・レジャー	0.26
保険	1.44	公共・非営利機関	0.26
コンピュータハードウェア・ネットワーク装置供給業	1.44	モーゲージ・資金調達機関	0.24
郡・連邦州	1.40	各種資本財	0.22
エネルギー・水道	1.22	各種貿易会社	0.21
電子機器・半導体	1.21	時計・宝飾品	0.16
化学	1.16	貴金属・宝石	0.15
小売り・百貨店	1.06	ゴム・タイヤ	0.12
通信	1.04	林業・紙・パルプ製品	0.12
たばこ・アルコール	0.93	ヘルスケア・社会福祉	0.07
自動車	0.90	その他の非分類会社	0.05
交通・運輸	0.78	農業・漁業	0.04
建築業・資材	0.74	包装業	0.03
不動産	0.65	写真・光学	0.02
その他の消費財	0.57	合計	97.25
その他のサービス業	0.57		

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

## 純資産変動計算書

自2019年6月1日 至2019年11月30日

	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	2,120,118,601.72	232,280,194
発行額	362,759,685.22	39,743,951
買戻額	(234,586,593.26)	(25,701,307)
純発行(買戻)合計	128,173,091.96	14,042,644
支払配当金	(6,778,479.23)	(742,650)
投資純(損)益	(4,759,986.58)	(521,504)
実現(損)益合計	(39,642,501.24)	(4,343,232)
未実現評価(損)益の変動合計	134,430,518.93	14,728,208
運用の結果による純資産の純増(減)	90,028,031.11	9,863,471
<b>期末現在純資産</b>	<b>2,331,541,245.56</b>	<b>255,443,659</b>

## 発行済投資証券数の変動表

自2019年6月1日 至2019年11月30日

## クラスP - a c c

(口)

期首現在発行済投資証券数	5,559,346.9120
期中発行投資証券数	900,260.4580
期中買戻投資証券数	(561,525.1610)
<b>期末現在発行済投資証券数</b>	<b>5,898,082.2090</b>

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

## 最重要数値

	ISIN	2019年11月30日	2019年5月31日	2018年5月31日
純資産額(米ドル)		2 331 541 245.56	2 120 118 601.72	1 848 301 354.25
クラス P - a c c	LU1599186969			
発行済投資証券数(口)		5 898 082.2090	5 559 346.9120	5 282 863.6010
1口当たり純資産価格(米ドル)		112.07	107.15	105.36
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) <sup>1</sup>		112.07	107.15	105.28

<sup>1</sup> 注記1を参照

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

## 組入証券の構造

地域別分布表	(純資産に対する)		地域別分布表	(純資産に対する)	
	百分率	(%)		百分率	(%)
ルクセンブルグ	31.32		カタール	0.34	
アイルランド	24.24		ノルウェー	0.28	
アメリカ合衆国	14.44		ベルギー	0.28	
カナダ	3.90		クウェート	0.28	
日本	3.32		アラブ首長国連邦	0.26	
スイス	3.03		シンガポール	0.25	
ドイツ	3.01		ジャージー	0.18	
フランス	2.94		スウェーデン	0.14	
イギリス	2.77		オーストリア	0.10	
オランダ	1.88		ニュージーランド	0.09	
韓国	0.98		ケイマン諸島	0.07	
国際機関	0.73		英領ヴァージン諸島	0.06	
オーストラリア	0.71		デンマーク	0.04	
スペイン	0.62		ポルトガル	0.03	
フィリピン	0.53		南アフリカ	0.01	
イタリア	0.46		マン島	0.01	
フィンランド	0.35		合計	97.65	

業種別分布表	(純資産に対する 百分率 %)		業種別分布表	(純資産に対する 百分率 %)	
投資信託	51.71		繊維・衣服・革製品	0.38	
国債・中央政府債	7.29		不動産	0.36	
金融・持株会社	6.86		電子部品・デバイス	0.34	
銀行・金融機関	6.03		機械工学・産業機器	0.31	
国際機関	3.17		公共・非営利機関	0.29	
医薬品・化粧品・医療品	2.65		航空宇宙産業	0.29	
石油	2.01		モーゲージ・資金調達機関	0.23	
インターネット・ソフトウェア・ITサービス	1.74		グラフィックデザイン・出版・メディア	0.22	
コンピュータハードウェア・ネットワーク装置供給業	1.51		鉱業・石炭・鉄鋼	0.19	
郡・連邦州	1.31		バイオテクノロジー	0.18	
食品・清涼飲料	1.06		宿泊・仕出し・レジャー	0.17	
保険	1.00		各種貿易会社	0.15	
エネルギー・水道	0.90		各種資本財	0.15	
電子機器・半導体	0.85		非鉄金属	0.15	
小売り・百貨店	0.84		時計・宝飾品	0.11	
化学	0.79		貴金属・宝石	0.09	
通信	0.72		ゴム・タイヤ	0.09	
たばこ・アルコール	0.69		林業・紙・パルプ製品	0.08	
自動車	0.64		その他の非分類会社	0.04	
交通・運輸	0.54		農業・漁業	0.04	
建築業・資材	0.50		ヘルスケア・社会福祉	0.03	
その他のサービス業	0.47		写真・光学	0.02	
その他の消費財	0.46		合計	97.65	

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## 財務書類に対する注記

2019年11月30日現在

## 注1 - 重要な会計方針の要約

財務書類は、ルクセンブルグにおける投資信託に関する一般に公正妥当と認められる会計原則に従って作成されている。重要な会計方針は、以下のように要約される。

## a) 純資産額の計算

各サブ・ファンドまたは投資証券クラスの投資証券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、当該サブ・ファンドまたは投資証券クラスの計算通貨で表示され、各投資証券クラスに帰属するサブ・ファンドの純資産総額を当該サブ・ファンドの投資証券クラスの投資証券数で除することにより営業日毎に計算される。

この場合の「営業日」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）を指し、12月24日と31日、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等を除く。

サブ・ファンドの各投資証券クラスに帰属する純資産価額の百分率は、投資証券の発行または買戻しの度に変動する。この百分率は、投資証券クラスに請求される報酬を考慮し、サブ・ファンドの発行済投資証券総数に対する各投資証券クラスの発行済投資証券の比率によって決定される。

単一の取引日におけるサブ・ファンドの全投資証券クラスに影響する発行または買戻しの合計が純資本の流入または流出になる場合、サブ・ファンドの純資産額は、それぞれ増加または減少することがある（いわゆるシングル・スイング・プライシング）。最大調整額は、純資産価額の2%に達する。サブ・ファンドに発生すると予想される取引費用および課税金は、サブ・ファンドが投資する資産の見積呼値スプレッドと同様に考慮される可能性がある。影響を受けたサブ・ファンドの全投資証券数が純増する場合、調整は純資産額の増加を導く。投資証券数が純減する場合、調整は純資産額の減少となる。本投資法人の取締役会は各サブ・ファンドの限界値を設定することができる。これは、本投資法人の純資産額または該当サブ・ファンドの通貨の絶対量に関して一取引日における純増/純減について設けられる。純資産価額は、当該限界値が取引日に越えられた場合にのみ、調整が行われる。当該調整はサブ・ファンドの利益になり、「その他の収益」として運用計算書に記述されている。

## b) 評価原則

- 流動資産は、（現金、銀行預金、為替手形および要求払約束手形および売掛金、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という形態にかかわらず）いずれも総額として評価されるが、かかる価額が全額支払われるか受領される可能性が低い場合はこの限りではなく、かかる場合、その評価額は、その真正価値を表すために適切とみなされる減額分を考慮して決定される。
- 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投資対象は最新の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投資対象が複数の証券取引所に上場されている場合は、当該投資対象の主要市場である証券取引所の最新価格を適用する。

通常、証券取引所で取引されるものではなく、証券トレーダー間で流通市場が存在し市場に従い価格が決定される有価証券、派生商品およびその他の投資対象の場合、本投資法人はかかる有価証券、

派生商品およびその他の投資対象を当該価格を基準に評価することができる。有価証券、派生商品およびその他の投資対象が証券取引所には上場されていないが、定期的に運用され、公認され、公開されたその他の規制された市場で売買されている場合、かかる市場の最新価格で評価する。

- 証券取引所に上場されておらず、別の規制された市場でも取引されておらず、適当な価格が入手できない有価証券およびその他の投資対象は、予想売却価格に基づいて本投資法人が誠実に選んだその他の原則に従って本投資法人が評価する。
- 証券取引所に上場されていない派生商品(店頭派生商品)は独立した価格ソースに基づいて評価する。派生商品の評価する独立した価格ソースが一つしかない場合、派生商品の原資産の市場価格に基づいて本投資法人が認められた計算方法を使って入手評価の妥当性を検証する。
- その他の譲渡性証券集合投資事業(UCITS)および/または集合投資事業(UCI)の受益証券は最新の純資産価額で評価する。その他のUCITSおよび/またはUCIの一部の受益証券または投資証券は、投資運用会社または投資顧問会社から独立した信頼できるサービス提供会社により提供されたかかる証券の価値の見積り(価値見積り)に基づいて評価することができる。
- 証券取引所または公開されている他の規制された市場で取引されていない短期金融商品は、関連するカーブに基づいて評価される。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。このプロセスには次の原則が適用される。各短期金融商品には、残余期間に応じた金利が加えられる。このように計算された金利は、裏付けとなる借主の信用力を反映する信用スプレッドを加えることによって市場価格に転換される。この信用スプレッドは、借主の信用格付けに重大な変更がある場合、調整される。

該当する注文日と該当する評価日の間にサブ・ファンドが得た受取利息は、該当するサブ・ファンドの資産の評価に含まれる。したがって、評価日における投資証券1口当たりの資産価額は、予定される受取利息を含む。

- 関係するサブ・ファンドの参照通貨以外の通貨で表示され、外国為替取引によるヘッジを行わない有価証券、短期金融商品、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取引の公示された仲値(買呼値と売呼値の仲値)またはこれが提供されない場合には当該通貨を最も代表する市場における公示された仲値で評価する。
- 定期預金および信託投資はその名目価値に累積利息を加えて評価する。
- スワップの価値は、外部のサービス提供会社が計算し、別の外部サービス提供会社が第二の独立した評価を提供する。計算はすべての現金流入額と正味現在価値を基準とする。特別な場合に、内部計算(ブルームバーグから提供されたモデルと市場データに基づく。)および/またはブローカーの報告書の評価を利用することができる。評価方法は、それぞれの証券に依拠し、UBSの評価方針に基づき決定される。

特別な状況により上記の規則に基づく評価が実行不可能または不正確であることが分かった場合、本投資法人は純資産価額を適正に評価するため誠意をもって一般に認められ、証明可能なその他の評価基準を適用する権限を有する。

特別な状況の場合、当日のうちに追加の評価を行うことができる。その後、かかる新評価が投資証券の事後の発行および買戻しについて正式なものとなる。

c) 先渡為替契約の評価

未決済の先渡為替契約の未実現(損)益は、評価日の実勢先渡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直近の入手可能な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、運用計算書に記帳される。実現損益は、先入先出法に従って計算される。すなわち、最初の取得契約が最初に売却されるものと考えられる。

e) 証券の売却に係る実現純(損)益

証券の売却に係る実現損益は、売却証券の平均原価に基づいて計算される。

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保有される銀行勘定、その他の純資産および投資有価証券評価額は、評価日の最終現物相場の仲値で換算される。個々のサブ・ファンドの通貨以外の通貨建て収益および費用は、支払日の最終現物相場の仲値で換算される。為替差損益は運用計算書に計上される。

個々のサブ・ファンドの基準通貨以外の通貨建て証券の取得原価は、取得日の最終現物相場の仲値で換算される。

g) 組入証券取引の会計処理

組入証券取引は、取引日の翌銀行営業日に会計処理される。

h) モーゲージ担保証券

本投資法人はその投資方針に従い、「モーゲージ担保証券」に投資することができる。「モーゲージ担保証券」は、証券の形態に統合されたモーゲージ・プールへの参加を意味するものである。対象モーゲージに係る元本および利息の支払いは、モーゲージ担保証券の保有者にパススルーされ、そのうちの元本部分により証券のコスト・ベースが減少する。元本および利息の支払いは、米国の準政府機関により保証されることがある。利益または損失は、各元本に対する支払いがある都度計算される。この利益または損失は、運用計算書の「有価証券の売却に係る実現純利益または損失」に計上されている。さらに、対象モーゲージの期限前返済により証券の残存期間が短縮することがあり、それにより本投資法人の予想利回りが影響を受けることがある。

「モーゲージ担保証券」について、証券の額面価格に適用されるべき要因が、評価日現在1つ以上である場合、財務書類に表示される額面価格はこの要因を反映するよう調整される。その他の場合、表示される額面価格は、1要因についての影響を反映する。

#### i) 連結財務書類

連結財務書類は、ユーロで表示される。本投資法人の2019年11月30日現在の連結純資産計算書および連結運用計算書の各種科目は、各サブ・ファンドの財務書類の対応する科目を決算日現在の実勢為替レートでユーロに換算した金額の合計に等しい。

以下の為替レートが、2019年11月30日現在の連結財務書類の換算に用いられた。

##### 為替レート

1ユーロ	=	1.101883	スイス・フラン
1ユーロ	=	1.102600	米ドル

#### j) 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」の勘定科目には、外貨取引による未収金が含まれる。また「有価証券購入未払金」の勘定科目には、外貨取引による未払金が含まれる。外国為替取引による未収金および未払金は相殺される。

#### k) 収益の認識

源泉税控除後の配当金は、当該証券が「配当落ち」として最初に記載される日に収益として認識される。受取利息は、日々ベースで発生する。

#### l) スワップ

本投資法人は、その分野の取引において専門性を持つ一流金融機関を相手方として、金利スワップ契約、金利スワップションに係る先渡レート契約、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。

スワップ取引の評価額は、外部のサービス会社によって算出され、また第二の独立した評価を他のサービス会社から入手することができる。計算は、現金の流入と流出の両方を含むすべてのキャッシュ・フローの正味現在価値に基づいている。

特定の場合、内部計算（評価モデルおよびブルームバーグから入手した市場データに基づく）および/またはブローカーの報告書による評価が使用されることがある。

評価方法は、各証券によって異なり、UBSの評価方針に従って決定される。

かかる評価方法は、本投資法人によって認められている。

未実現損益の変動は、運用計算書の「スワップに係る未実現評価（損）益」の変動の項目に反映される。

手仕舞いまたは満期到来により生じたスワップに係る損益は、運用計算書の「スワップに係る実現（損）益」として計上される。

## 注2 - 報酬

本投資法人は、以下の表に表示されるようにサブ・ファンドの平均純資産額で計算される各サブ・ファンドの月次定率報酬を請求する。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

	上限定率報酬 (年率)	上限定率報酬 (年率)
	名称に「ヘッジ」が付く	名称に「ヘッジ」が付く
	投資証券クラス	投資証券クラス
名称に「P」が付く投資証券クラス	1.340%	1.390%

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - フィクスト・インカム (米ドル)

	上限定率報酬 (年率)	上限定率報酬 (年率)
	名称に「ヘッジ」が付く	名称に「ヘッジ」が付く
	投資証券クラス	投資証券クラス
名称に「P」が付く投資証券クラス	1.080%	1.130%

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - インカム (米ドル)

	上限定率報酬 (年率)	上限定率報酬 (年率)
	名称に「ヘッジ」が付く	名称に「ヘッジ」が付く
	投資証券クラス	投資証券クラス
名称に「P」が付く投資証券クラス	1.300%	1.350%

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ (米ドル)

	上限定率報酬 (年率)	上限定率報酬 (年率)
	名称に「ヘッジ」が付く	名称に「ヘッジ」が付く
	投資証券クラス	投資証券クラス
名称に「P」が付く投資証券クラス	1.320%	1.370%

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)

上限定率報酬 (年率)

上限定率報酬 (年率) 名称に「ヘッジ」が付

く

投資証券クラス

名称に「P」が付く投資証券クラス	1.680%	1.730%
------------------	--------	--------

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル)

上限定率報酬 (年率)

上限定率報酬 (年率) 名称に「ヘッジ」が付

く

投資証券クラス

名称に「P」が付く投資証券クラス	1.500%	1.550%
------------------	--------	--------

本投資法人は、投資証券クラス「P」「N」「K-1」「F」「Q」「I-A1」「I-A2」および「I-A3」について、サブ・ファンドの平均純資産価額で計算される月次上限定率管理報酬を支払う。当該上限定率管理報酬は以下の通り用いられる。

1. 以下の規定に従い、本投資法人の純資産価額に基づく上限定率管理報酬は、本投資法人の運用、管理事務、ポートフォリオの管理、投資助言および販売（該当する場合）、ならびに保管受託銀行のすべての職務（本投資法人の資産の保管および監督、支払取引の手続きならびに販売目論見書の「保管受託銀行および主たる支払代理人」の項に記載されているその他一切の職務等）に関して、本投資法人の資産から支払われる。当該報酬は、純資産の計算毎に比例按分ベースで本投資法人の資産に対し請求され、毎月支払われる（上限定率管理報酬）。関連する上限定率管理報酬は対応する投資証券クラスが発行されるまで請求されない。上限定率管理報酬の概要は、販売目論見書の「サブ・ファンドおよび特別投資方針」の項にて参照することができる。定率管理報酬に適用される実際の最大料率は、年次報告書および半期報告書で参照することができる。
2. 上限定率管理報酬は、以下の報酬および本投資法人の資産にも請求される追加費用を含まない。
  - a) 資産の売買のための本投資法人の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 / 売呼値スプレッド、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、投資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」の項に基づくシングル・スイング・プライシングの原理の適用により賄われる。
  - b) 本投資法人の設立、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支払う一切の手数料。
  - c) 本投資法人の設立、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事務管理に関して監査人が提供するサービスに関して監査法人に支払われ、かつ法律によって許可される一切のその他の報酬。

- d) 本投資法人の設立、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、本投資法人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) 本投資法人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) 本投資法人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本投資法人の登録に関するコスト(該当する場合、外国の監督官庁に支払われる手数料ならびに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) 本投資法人による議決権または債権者の権利により生じた費用(外部顧問報酬を含む)。
- i) 本投資法人の名義で登録された知的財産または本投資法人の使用権に関するコストおよび手数料。
- j) 管理会社、投資運用会社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る費用(例えば、法律コストおよび保管受託銀行に関するコスト)を本投資法人の資産に対して請求できる。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、当該コストは、証明可能かつ公表されており、および/または本投資法人の総費用比率(T E R)の開示において考慮される。

3. 管理会社は、本投資法人の販売業務を賄うために手数料を支払うことができる。

本投資法人の所得および資産に賦課されるすべての租税、特に年次税についても、本投資法人が負担する。

定率管理報酬を有していない他のファンドのプロバイダーの報酬規定との一般的な比較可能性の目的のために、「管理報酬の上限」は、定率管理報酬の80%で設定している。

投資証券クラス「I - B」について、報酬は、ファンドの管理事務費用(本投資法人、管理事務代行および保管受託銀行の費用からなる)を賄うために請求される。資産運用および販売に関する費用は、投資者とUBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジーまたは公認の代理人との間で直接結ばれた個別契約に基づき、本投資法人を除いて請求される。

投資証券クラス「I - X」「K - X」および「U - X」の資産運用、ファンド管理事務(本投資法人、管理事務代行および保管受託銀行の費用からなる)および販売について実施された業務に関連するコストは、投資者との個別契約に基づきUBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジーが受け取る資格を有する報酬によって賄われる。

個々のサブ・ファンドに帰属する費用はすべて、当該サブ・ファンドに請求される。

個々の投資証券クラスに割当てられる費用は、当該投資証券クラスに請求される。費用が複数またはすべてのサブ・ファンド/投資証券クラスに関連して発生した場合には、これらの費用について当該サブ・ファンド/投資証券がその純資産額に比例して負担する。

その投資方針の条項に従ってその他の投資信託(UCISまたはUCITS)に投資するサブ・ファンドに関して、当該対象ファンドおよびサブ・ファンドの両段階で支払が生じる。サブ・ファンドの資産における対象ファンドの管理報酬の最高限度は、あらゆるトレーラー・フィーを考慮して、投資金額の最高3%までである。

サブ・ファンドが、管理会社により、または共同経営もしくは支配を通じて、または実質的な直接保有もしくは間接保有を通じて、管理会社と関係する別の会社により直接もしくは委託によって運用されるファンドの受益証券への投資を行う場合、ターゲット・ファンドの受益証券に関して、投資を行うサブ・ファンドに発行または買戻手数料は請求されない。

本投資法人の現在発生中の費用の詳細は、KIIDで参照することができる。

#### 注3 - 年次税

ルクセンブルグの現行法規に準拠して、本投資法人は、四半期毎に支払われ各四半期末日の各サブ・ファンドの純資産額に基づいて計算される年率0.05%の年次税、または幾つかの投資証券クラスに関して年率0.01%になる減額された年次税を課されている。

ルクセンブルグ法の法定条項に準拠して、既に年次税を支払っている他の投資信託の受益証券もしくは投資証券に投資されている純資産の部分に関して、年次税は課されない。

#### 注4 - その他の収益

その他の収益は、主にシングル・スイング・プライシングから生じた収益で構成される。

#### 注5 - 収益の分配

当該サブ・ファンドの投資主総会は、取締役会の提案によりサブ・ファンドの年次決算の終了後に、各サブ・ファンドから分配を行うかおよび支払われる分配金の程度を決定する。本投資法人の純資産額が法律に規定されている最低額を下回る場合には、分配の支払は行われず。分配が行われる場合、支払は年度末後4ヶ月以内に行われる。

取締役会は、中間分配金を支払い、また分配金支払を停止する権限を有している。

分配が実際に収入を受け取る権利と一致するように、収入調整金が計算される。

## 注6 - ソフト・ダラーの取決め

2019年6月1日から2019年11月30日までの期間中に、UBS (Lux) ストラテジー・シキャブのために締結された「ソフト・ダラーの取決め」はなく、「ソフト・ダラー」の金額は零である。

## 注7 - 金融先物、オプションおよびスワップ契約

2019年11月30日現在、サブ・ファンドごとの金融先物、オプションおよびスワップ契約ならびに関連する通貨は、以下のように要約される。

## a) 金融先物

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ	債券に係る金融先物	
	(購入)	(売却)
- システムティック・アロケーション		
・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)	- 米ドル	119 130 218.75 米ドル
- システムティック・アロケーション		
・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)	- 米ドル	117 208 953.23 米ドル
- システムティック・アロケーション		
・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)	- 米ドル	344 572 914.27 米ドル

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ	指数に係る金融先物	
	(購入)	(売却)
- インカム(米ドル)	11 629 218.11 米ドル	8 481 353.93 米ドル
- システムティック・アロケーション		
・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)	136 106 626.87 米ドル	- 米ドル
- システムティック・アロケーション		
・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)	127 717 820.65 米ドル	- 米ドル
- システムティック・アロケーション		
・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)	386 287 045.25 米ドル	- 米ドル

債券または指数に係る金融先物契約(もしあれば)は、当該金融先物の時価(契約数×想定取引規模×当該先物の市場価格)に基づき計算される。

## b) オプション

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ	指数に係るオプション、従来型(売却)
- ダイナミック・インカム(米ドル)	30 876 500.63 米ドル

## c) スワップ

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ	指数に係るスワップおよび先渡スワップ	
	(購入)	(売却)
- ダイナミック・インカム(米ドル)	- 米ドル	20 599 987.38 米ドル

## 注8 - 総費用比率 (TER)

この比率は、スイス・ファンド資産運用協会 (SFAMA) の「TERの計算ならびに開示に関するガイドライン」現行版に従って計算された。比率はまた、純資産の百分率として遡及的に計算され、純資産 (運用費用) に対し継続ベースで請求されるすべての費用および手数料の合計を表す。

過去12ヶ月のTERは、以下のとおりである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ	総費用比率 (TER)
- ダイナミック・インカム (米ドル) P - a c c	1.60%
- ダイナミック・インカム (米ドル) P - m d i s t	1.60%
- フィクスト・インカム (米ドル) P - a c c	1.13%
- フィクスト・インカム (米ドル) (日本円・ヘッジ) P - a c c	1.14%
- インカム (米ドル) P - a c c	1.36%
- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ ・ディフェンシブ (米ドル) P - a c c	1.62%
- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ ・ダイナミック (米ドル) P - a c c	1.90%
- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ ・ミディアム (米ドル) P - a c c	1.77%

通貨ヘッジに関連して発生した取引費用およびその他の費用は、TERに含まれていない。

運用が12ヶ月未満の投資証券クラスのTERは、年率換算されている。

## 注9 - プーリング

本投資法人は2つ以上のサブ・ファンド (かかる目的上、以下「参加サブ・ファンド」という。) のポートフォリオ資産の一部または全部をプール形式で投資し、運用することができる。こうした資産プールは各参加サブ・ファンドから現金ならびにその他の資産を (プールの投資方針に合致している場合) 資産プールに移し替えることによって設定される。その後、本投資法人は更に個々の資産プールへの移し替えを行なうことができる。同じく、その参加額を限度とする資産を参加サブ・ファンドに戻すこともできる。

各資産プールの参加サブ・ファンドの投資証券は、同じ価値を有するみなし受益証券を基準にして評価する。資産プールを設定した際、本投資法人は (本投資法人が適当と判断する通貨で) みなし受益証券の当初価値を定め、各参加サブ・ファンドに対してサブ・ファンドが拠出した現金 (またはその他の資産) の合計額に相当するみなし受益証券を配分する。その後、資産プールの純資産を既存のみなし受益証券の口数で除して、みなし受益証券の価値を決定する。

追加の資金または資産が資産プールに拠出され、または資産プールから引き出された場合、拠出されたもしくは引き出された現金の額または資産の価値をプールの参加サブ・ファンドの投資額の現在価値で除して決定した数だけ関係する参加サブ・ファンドに配分されたみなし受益証券の口数を増減させる。資産プールに現金が拠出される場合、計算上、かかる現金の投資に関連する取引費用および取得費用に加え税務費用を考慮して本投資法人が適当と判断する金額を減額する。現金の引き出しの場合、資産プールの有価証券またはその他の資産の処分に関連する費用の額を織り込んだ減額が行なわれる。

資産プールの資産から得た配当、利息およびその他の所得の分配は当該資産プールに配分され、その結果として各純資産が増加することになる。本投資法人が清算した場合、資産プールの資産は資産プール内の各持分に比例して各参加サブ・ファンドに配分される。

直近の参加サブ・ファンド：

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - エクストラ・バランスド(ユーロ)

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - エクストラ・イールド(ユーロ)

#### 注10 - 当報告期間中における重要な事象

スイスのユービーエス資産運用事業は、ユービーエス・エイ・ジーからユービーエス・グループのメンバーであるUBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジーに移転した。2019年6月17日付で移転の効力が生じた。

UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジーは、スイスの金融市場監督局(FINMA)が承認した集合投資事業の資産運用者である。

#### 注11 - 適用法、業務地および公認言語

ルクセンブルグ地方裁判所は、投資主、本投資法人および保管受託銀行との間ですべての法的紛争処理を行う場所である。ルクセンブルグ法が適用される。しかし、他の国の投資者の賠償請求に関する件については、本投資法人および/または保管受託銀行は、本投資法人投資証券が売買された国の裁判管轄権に自らを服することを選択することができる。

当財務書類についてはドイツ語版が公認されたものである。しかし、本投資法人投資証券の購入および売却が可能なその他の国の投資主に対して投資証券が販売される場合、本投資法人および保管受託銀行は、当該国の言語への承認された翻訳(すなわち、本投資法人および保管受託銀行によって承認されたもの)に自らが拘束されるものと認めることができる。

## 注12 - 貸付証券

本投資法人は、第三者にファンドの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を通して、それらの機関が設定した方法に従ってのみ行われる。担保は、貸付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証券の少なくとも時価に相当する金額の高格付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貸付証券機関として行為する。

## 貸付証券

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ	2019年11月30日現在の貸付証券による 取引相手方エクスポージャー		2019年11月30日現在の 担保内訳(%)		
	貸付証券の時価	担保(ユービーエス・ スイス・エイ・ジー)	株式	債券	現金
- ダイナミック・インカム(米ドル)	63 601 639.44 米ドル	67 381 827.13 米ドル	36.06	63.94	0.00
- フィクスト・インカム(米ドル)	34 535 710.03 米ドル	36 588 353.12 米ドル	36.06	63.94	0.00
- インカム(米ドル)	20 716 217.61 米ドル	21 947 493.90 米ドル	36.06	63.94	0.00
- システマティック・アロケーション ・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)	145 644 995.45 米ドル	154 301 461.27 米ドル	36.06	63.94	0.00
- システマティック・アロケーション ・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)	55 818 363.63 米ドル	59 135 949.35 米ドル	36.06	63.94	0.00
- システマティック・アロケーション ・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)	271 824 478.99 米ドル	287 980 470.50 米ドル	36.06	63.94	0.00

[次へ](#)

## (2) 投資有価証券明細表等

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

## 2019年11月30日現在の投資有価証券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 比率 (%)
----	-----------	---	------------------

公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある証券および短期金融商品

## 無記名株式

オーストラリア			
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 比率 (%)
AUD AGL ENERGY NPV	52 853.00	729 652.79	0.15
AUD ALUMINA LTD NPV	8 083.00	12 629.56	0.00
AUD AMP LIMITED NPV(POST RECON)	15 656.00	20 702.90	0.00
AUD APA GROUP NPV	6 102.00	45 401.32	0.01
AUD ARISTOCRAT LEISURE NPV	1 459.00	33 474.55	0.01
AUD ASX LTD NPV	1 111.00	61 403.46	0.01
AUD AURIZON HOLDINGS NPV	9 446.00	36 930.01	0.01
AUD AUST & NZ BANK GRP NPV	14 289.00	240 080.58	0.05
AUD BK OF QUEENSLAND NPV	1 324.00	7 012.18	0.00
AUD BLUESCOPE STEEL NPV	2 664.00	26 218.08	0.01
AUD BORAL LIMITED NPV	6 181.00	21 489.46	0.00
AUD BRAMBLES LTD NPV	8 081.00	68 598.15	0.01
AUD CALTEX AUSTRALIA NPV	1 409.00	32 937.33	0.01
AUD CHALLENGER LIMITED NPV	3 155.00	17 371.10	0.00
AUD CIMIC GROUP LTD NPV	688.00	15 654.82	0.00
AUD CMNWLTH BK OF AUST NPV	8 905.00	486 806.50	0.10
AUD COCA-COLA AMATIL NPV	14 493.00	111 558.88	0.02
AUD COCHLEAR LTD NPV	274.00	43 366.21	0.01
AUD COMPUTERSHARE LTD NPV(POST REC)	2 695.00	32 319.98	0.01
AUD CROWN RESORTS LTD NPV	2 241.00	19 569.14	0.00
AUD CSL NPV	2 302.00	441 399.00	0.09
AUD DEXUS NPV (STAPLED)	5 768.00	47 715.04	0.01
AUD FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD NPV	4 792.00	142 714.83	0.03
AUD FORTESCUE METALS G NPV	25 975.00	170 951.14	0.03
AUD GOODMAN GROUP (STAPLED SECURITY)	8 354.00	83 742.57	0.02
AUD GPT GROUP NPV (STAPLED SECURITIES)	8 787.00	36 552.69	0.01
AUD HARVEY NORMAN HLDG NPV	3 456.00	10 051.85	0.00
AUD INSURANCE AUST GRP NPV	11 576.00	61 778.75	0.01
AUD LEND LEASE GROUP NPV	2 928.00	38 243.44	0.01
AUD MACQUARIE GP LTD NPV	1 636.00	152 764.80	0.03
AUD MAGELLAN FINANCIAL NPV	697.00	24 746.45	0.01
AUD MEDIBANK PRIVATE L NPV	11 335.00	24 994.40	0.01
AUD MIRVAC GROUP STAPLED SECURITIES	15 540.00	35 422.93	0.01
AUD NATL AUSTRALIA BK NPV	14 513.00	254 151.59	0.05
AUD NEWCREST MINING NPV	3 920.00	81 559.77	0.02
AUD ORICA LIMITED NPV	2 267.00	36 464.22	0.01
AUD ORIGIN ENERGY NPV	8 799.00	51 779.30	0.01
AUD QBE INS GROUP NPV	6 845.00	58 707.87	0.01
AUD RAMSAY HEALTH CARE NPV	904.00	44 624.76	0.01
AUD REA GROUP LIMITED NPV	271.00	19 129.65	0.00
AUD RIO TINTO LIMITED NPV	16 052.00	1 052 098.81	0.21
AUD SANTOS LIMITED NPV	9 006.00	49 647.02	0.01
AUD SCENTRE GROUP NPV STAPLED UNIT	22 910.00	61 055.52	0.01
AUD SEEK LIMITED NPV	1 956.00	30 681.26	0.01
AUD SONIC HEALTHCARE NPV	2 557.00	52 094.19	0.01
AUD SOUL PATTINSON(WH) NPV	1 214.00	18 328.06	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

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 比率 (%)
AUD SOUTH32 LTD NPV	21 371.00	39 029.43	0.01
AUD STOCKLAND NPV (STAPLED)	10 958.00	37 430.56	0.01
AUD SUNCORP GROUP LTD NPV	6 576.00	59 514.33	0.01
AUD SYDNEY AIRPORT NPV (STAPLED SECURITY)	5 602.00	34 784.79	0.01
AUD TABCORP HLDGS LTD NPV	9 281.00	30 070.04	0.01
AUD TELSTRA CORP NPV	18 023.00	47 056.32	0.01
AUD TPG TELECOM LTD NPV	1 414.00	6 685.44	0.00
AUD TRANSURBAN GROUP STAPLED UNITS NPV	13 830.00	143 593.29	0.03
AUD TREASURY WINE ESTA NPV	3 778.00	47 786.71	0.01
AUD VICINITY CENTRES NPV (STAPLED SECURITY)	10 555.00	19 133.60	0.00
AUD WESFARMERS LTD NPV	5 808.00	166 451.87	0.03
AUD WESTPAC BKG CORP NPV	66 967.00	1 110 669.66	0.22
AUD WISETECH GLOBAL LT NPV	778.00	14 355.81	0.00
AUD WOODSIDE PETROLEUM NPV	4 835.00	112 861.30	0.02
AUD WOOLWORTHS GRP LTD NPV	6 351.00	170 801.66	0.03
AUD WORLEY LIMITED NPV	1 792.00	18 181.63	0.00
<b>オーストラリア合計</b>		<b>7 202 983.35</b>	<b>1.44</b>
<b>オーストリア</b>			
EUR ANDRITZ AG NPV (BR)	163.00	6 362.22	0.00
EUR ERSTE GROUP BK AG NPV	899.00	32 215.22	0.01
EUR OMV AG NPV (VAR)	4 956.00	282 732.48	0.06
EUR RAIFFEISEN BK INTL NPV (REGD)	919.00	21 593.19	0.00
EUR VERBUND AG CLASS 'A' NPV	301.00	15 658.22	0.00
EUR VOESTALPINE AG NPV	259.00	6 868.04	0.00
<b>オーストリア合計</b>		<b>365 429.37</b>	<b>0.07</b>
<b>ベルギー</b>			
EUR ANHEUSER-BUSCH IN NPV	2 579.00	204 369.92	0.04
EUR COLRUYT SA NPV	1 145.00	59 336.42	0.01
EUR GPE BRUXELLES LAM NPV	347.00	35 237.66	0.01
EUR PROXIMUS SA NPV	605.00	18 264.46	0.00
EUR SOLVAY SA NPV	209.00	23 966.11	0.00
EUR UMICORE NPV	597.00	25 658.67	0.01
<b>ベルギー合計</b>		<b>366 833.24</b>	<b>0.07</b>
<b>バミューダ</b>			
USD MARVELL TECH GROUP COM USDO.002	1 318.00	34 755.66	0.01
<b>バミューダ合計</b>		<b>34 755.66</b>	<b>0.01</b>
<b>カナダ</b>			
USD WASTE CONNECTIONS COM NPV (POST REV SPLT)	532.00	48 172.60	0.01
<b>カナダ合計</b>		<b>48 172.60</b>	<b>0.01</b>
<b>フィンランド</b>			
EUR KONE CORPORATION NPV ORD 'B'	1 082.00	67 787.01	0.01
EUR METSO OYJ NPV	481.00	18 456.20	0.01
EUR WARTSILA OYJ ABP SER 'B' EUR3.50	1 420.00	14 304.16	0.00
<b>フィンランド合計</b>		<b>100 547.37</b>	<b>0.02</b>
<b>フランス</b>			
EUR ACCOR EUR3	564.00	24 147.07	0.01
EUR ADP EUR3	103.00	20 158.28	0.00
EUR AIR LIQUIDE (L') EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)	1 594.00	216 265.84	0.04
EUR AIRBUS EUR1	1 960.00	288 290.21	0.06
EUR ALSTOM EUR7.00	586.00	25 573.57	0.01
EUR AMUNDI EUR2.5 (AIW)	196.00	14 846.73	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

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 比率 (%)
EUR ARKEMA EUR10	203.00	21 053.24	0.01
EUR ATOS SE EUR1	372.00	31 615.69	0.01
EUR AXA EUR2.29	6 495.00	176 850.46	0.04
EUR BIOMERIEUX NPV (POST SPLIT)	214.00	19 360.22	0.00
EUR BNP PARIBAS EUR2	19 955.00	1 121 461.46	0.22
EUR BOLLORE EURO.16	1 997.00	8 543.34	0.00
EUR BOUYGUES EUR1	700.00	28 619.09	0.01
EUR BUREAU VERITAS EURO.12	750.00	19 648.33	0.00
EUR CAPGEMINI EUR8	493.00	58 353.50	0.01
EUR CARREFOUR EUR2.50	1 993.00	32 918.28	0.01
EUR CASINO GUICH-PERR EUR1.53	169.00	7 442.40	0.00
EUR CIE DE ST-GOBAIN EUR4	1 640.00	66 453.70	0.01
EUR CNP ASSURANCES EUR1	26 421.00	522 041.76	0.10
EUR COVIVIO EUR3	77.00	8 523.98	0.00
EUR CREDIT AGRICOLE SA EUR3	3 625.00	49 621.83	0.01
EUR DANONE EURO.25	5 506.00	453 618.81	0.09
EUR DASSAULT AVIATION EUR8	80.00	108 936.88	0.02
EUR DASSAULT SYSTEMES EURO.50	450.00	70 952.31	0.01
EUR EDENRED EUR2	834.00	41 426.56	0.01
EUR EDF EURO.5	2 355.00	24 210.91	0.01
EUR EIFFAGE EUR4	4 033.00	440 676.47	0.09
EUR ENGIE EUR1	37 593.00	595 222.60	0.12
EUR ESSILORLUXOTTICA EURO.18	968.00	150 491.67	0.03
EUR EURAZEO NPV	90.00	6 137.62	0.00
EUR EUTELSAT COMMUNICA EUR1	413.00	6 780.52	0.00
EUR FAURECIA EUR7	306.00	16 242.22	0.00
EUR GETLINK SE EURO.40	1 245.00	21 016.60	0.01
EUR HERMES INTL NPV	101.00	75 726.57	0.02
EUR ICADE NPV	77.00	7 713.18	0.00
EUR ILIAD NPV	63.00	8 026.54	0.00
EUR INGENICO GROUP EUR1	190.00	20 291.59	0.00
EUR IPSEN EUR1	145.00	16 387.39	0.00
EUR JC DECAUX SA NPV	269.00	7 711.58	0.00
EUR KERING EUR4	261.00	157 328.56	0.03
EUR KLEPIERRE EUR1.40	581.00	20 864.69	0.00
EUR L'OREAL EURO.20	842.00	240 174.29	0.05
EUR LEGRAND SA EUR4	892.00	70 498.66	0.01
EUR LVMH MOET HENNESSY EURO.30	937.00	420 796.37	0.08
EUR NATIXIS EUR1.6	28 569.00	119 480.18	0.02
EUR ORANGE EUR4	6 231.00	103 054.51	0.02
EUR PERNOD RICARD EUR1.55	724.00	133 073.68	0.03
EUR PEUGEOT SA EUR1	11 634.00	281 182.05	0.06
EUR PUBLICIS GROUPE SA EURO.40	633.00	27 875.96	0.01
EUR REMY COINTREAU EUR1.60	47.00	6 058.02	0.00
EUR RENAULT SA EUR3.81	610.00	29 227.22	0.01
EUR SAFRAN EURO.20	1 094.00	179 066.98	0.04
EUR SANOFI EUR2	3 766.00	350 918.61	0.07
EUR SARTORIUS STEDIM B EURO.20 (POST SUBD)	117.00	18 589.51	0.00
EUR SCHNEIDER ELECTRIC EUR8	1 758.00	169 801.28	0.03
EUR SCOR SE EUR7.876972 (POST CONS)	486.00	20 893.32	0.00
EUR SEB SA EUR1	116.00	18 034.13	0.00
EUR SOC GENERALE EUR1.25	2 687.00	84 614.32	0.02
EUR SODEXO EUR4	312.00	36 396.38	0.01
EUR SUEZ EUR4	1 228.00	18 190.89	0.00
EUR TELEPERFORMANCE EUR2.50	188.00	44 567.09	0.01
EUR THALES EUR3	375.00	36 766.20	0.01
EUR TOTAL EUR2.5	7 993.00	419 855.22	0.08

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

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 比率 (%)
EUR UBISOFT ENTERTAIN EURO.31	246.00	14 945.30	0.00
EUR UNIBAIL-RODAMCO-WE NPV(1 ORD UNIBAIL-R & 1CLS)	519.00	81 202.19	0.02
EUR VALEO EUR1 (POST SUBD)	862.00	33 987.78	0.01
EUR VEOLIA ENVIRONNEME EUR5	1 623.00	41 588.44	0.01
EUR VINCI EUR2.50	1 732.00	189 022.42	0.04
EUR VIVENDI SA EUR5.50	3 095.00	85 040.67	0.02
EUR WENDEL EUR4	46.00	6 203.01	0.00
EUR WORLDLINE EURO.68	391.00	25 328.10	0.01
<b>フランス合計</b>		<b>8 317 985.03</b>	<b>1.66</b>
<b>ドイツ</b>			
EUR BAYERISCHE MOTORENWERKE AG EUR1	1 173.00	94 802.54	0.02
EUR BEIERSDORF AG NPV	394.00	45 983.82	0.01
EUR CARL ZEISS MEDITEC NPV	168.00	20 561.28	0.00
EUR COMMERZBANK AG NPV	2 939.00	17 048.49	0.00
EUR CONTINENTAL AG ORD NPV	388.00	50 738.12	0.01
EUR COVESTRO AG NPV	673.00	31 537.12	0.01
EUR DEUTSCHE WOHNEN AG NPV (BR)	1 164.00	45 497.47	0.01
EUR FRAPORT AG NPV	213.00	18 158.90	0.00
EUR FRESENIUS MED CARE NPV	726.00	53 280.45	0.01
EUR FRESENIUS SE & CO. KGAA NPV	1 308.00	71 590.85	0.02
EUR GEA GROUP AG NPV	549.00	17 657.40	0.00
EUR HEIDELBERGCEMENT NPV	579.00	42 837.00	0.01
EUR HENKEL AG & CO KGAA	338.00	32 721.20	0.01
EUR HOCHTIEF AG NPV	1 852.00	227 684.70	0.05
EUR KION GROUP AG NPV	248.00	16 466.85	0.00
EUR KNORR BREMSE AG NPV	204.00	19 856.86	0.00
EUR LANXESS AG NPV	320.00	21 346.34	0.01
EUR MERCK KGAA NPV	442.00	51 659.02	0.01
EUR METRO AG (NEW) NPV	398.00	6 417.96	0.00
EUR PUMA SE NPV	261.00	19 626.50	0.00
EUR RWE AG (NEU) NPV	1 841.00	54 624.25	0.01
EUR SAP AG ORD NPV	3 319.00	451 878.69	0.09
EUR SYMRISE AG NPV (BR)	423.00	41 061.84	0.01
EUR THYSSENKRUPP AG NPV	1 479.00	18 557.89	0.00
EUR VOLKSWAGEN AG ORD NPV	107.00	20 427.93	0.00
EUR WIRECARD AG NPV	390.00	51 515.68	0.01
EUR ZALANDO SE NPV	550.00	23 711.41	0.01
<b>ドイツ合計</b>		<b>1 567 250.56</b>	<b>0.31</b>
<b>アイルランド</b>			
EUR AIB GROUP PLC ORD EURO.625	1 942.00	6 359.51	0.00
EUR BANK OF IRELAND GR EUR1	1 526.00	7 672.51	0.00
GBP DCC ORD EURO.25	227.00	19 402.71	0.00
EUR FLUTTER ENTERTAINM ORD EURO.09	185.00	21 214.02	0.01
EUR KERRY GROUP 'A' ORD EURO.125(DUBLIN LIST)	471.00	60 449.38	0.01
USD SEAGATE TECH PLC COM USD0.00001	12 324.00	735 496.32	0.15
<b>アイルランド合計</b>		<b>850 594.45</b>	<b>0.17</b>
<b>イタリア</b>			
EUR ASSIC GENERALI SPA EUR1	3 478.00	71 059.64	0.01
EUR FINECOBANK SPA EURO.33	1 811.00	22 484.06	0.01
EUR LEONARDO SPA EUR4.40	46 886.00	548 758.39	0.11
EUR POSTE ITALIANE SPA NPV	1 662.00	19 406.40	0.00
EUR TELECOM ITALIA SPA DI RISP EURO.55	12 165.00	7 497.94	0.00
EUR TELECOM ITALIA SPA EURO.55	251 404.00	157 503.94	0.03
<b>イタリア合計</b>		<b>826 710.37</b>	<b>0.16</b>

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

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 比率 (%)
日本			
JPY アドバンテスト	400.00	19 541.59	0.01
JPY エア・ウォーター	600.00	9 632.00	0.00
JPY アイシン精機	200.00	7 560.95	0.00
JPY アマダホールディングス	900.00	10 026.48	0.00
JPY 朝日インテック	600.00	17 477.86	0.00
JPY バンダイナムコホールディングス	500.00	30 303.17	0.01
JPY カルビー	300.00	9 656.65	0.00
JPY 東海旅客鉄道	300.00	60 528.72	0.01
JPY 中外製薬	500.00	43 639.85	0.01
JPY コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	300.00	7 202.08	0.00
JPY コンコルディア・フィナンシャルグループ	2 500.00	10 136.06	0.00
JPY クレディセゾン	600.00	9 916.90	0.00
JPY サイバーエージェント	200.00	6 903.48	0.00
JPY 第一生命ホールディングス	2 300.00	37 027.67	0.01
JPY ダイセル	1 700.00	16 703.50	0.00
JPY ダイフク	100.00	5 816.82	0.00
JPY 第一三共	1 200.00	75 193.13	0.02
JPY ダイキン工業	500.00	71 888.41	0.02
JPY 大東建託	200.00	24 445.26	0.01
JPY 大和ハウス工業	1 200.00	36 698.02	0.01
JPY 大和ハウスリート投資法人	2.00	5 467.99	0.00
JPY 電通	200.00	7 250.48	0.00
JPY ディスコ	100.00	21 568.81	0.01
JPY エーザイ	500.00	37 028.58	0.01
JPY ファナック	400.00	76 358.32	0.02
JPY ファーストリテイリング	100.00	60 898.55	0.01
JPY 富士電機	11 100.00	341 585.24	0.07
JPY ふくおかフィナンシャルグループ	500.00	9 519.68	0.00
JPY G M O ベイメントゲートウェイ	100.00	7 086.11	0.00
JPY 阪急阪神ホールディングス	200.00	8 583.69	0.00
JPY 日立ハイテクノロジーズ	100.00	6 519.95	0.00
JPY ホシザキ	100.00	8 738.93	0.00
JPY ヒューリック	700.00	7 868.69	0.00
JPY 出光興産	600.00	16 371.11	0.00
JPY I H I	400.00	9 325.18	0.00
JPY いすゞ自動車	1 600.00	18 708.79	0.01
JPY 伊藤忠テクノソリューションズ	400.00	10 676.65	0.00
JPY J . フロント リテイリング	800.00	10 504.98	0.00
JPY 日本空港ビルデング	200.00	10 391.74	0.00
JPY 日本取引所グループ	1 200.00	20 392.66	0.01
JPY ジャパンリアルエステイト投資法人	1.00	6 803.03	0.00
JPY 日揮ホールディングス	500.00	7 264.18	0.00
JPY ジェイテクト	20 000.00	248 379.14	0.05
JPY 鹿島建設	1 400.00	18 447.63	0.01
JPY カカクコム	300.00	7 234.96	0.00
JPY 関西電力	1 400.00	15 954.71	0.00
JPY 関西ペイント	700.00	17 629.44	0.01
JPY 花王	1 000.00	78 641.22	0.02
JPY 川崎重工業	15 200.00	341 170.67	0.07
JPY 京浜急行電鉄	900.00	18 499.68	0.01
JPY 京王電鉄	300.00	19 231.12	0.01
JPY キッコーマン	300.00	15 067.11	0.00
JPY 近鉄グループホールディングス	100.00	5 652.45	0.00
JPY キリンホールディングス	1 800.00	39 826.50	0.01
JPY 小林製薬	100.00	8 200.16	0.00
JPY 小松製作所	2 000.00	46 881.56	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

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 比率 (%)
JPY コーセー	100.00	15 916.35	0.00
JPY クラレ	600.00	7 248.65	0.00
JPY 九州旅客鉄道	200.00	6 803.03	0.00
JPY LINE	200.00	9 405.53	0.00
JPY ライオン	800.00	16 108.11	0.00
JPY エムスリー	800.00	21 988.86	0.01
JPY マキタ	200.00	6 611.27	0.00
JPY 丸井グループ	700.00	16 836.82	0.00
JPY 明治ホールディングス	100.00	6 793.90	0.00
JPY ミネベアミツミ	1 100.00	21 335.04	0.01
JPY ミスミグループ本社	800.00	19 797.28	0.01
JPY 三菱瓦斯化学	700.00	10 943.29	0.00
JPY 三井不動産	1 900.00	47 244.09	0.01
JPY ナブテスコ	300.00	9 204.64	0.00
JPY 名古屋鉄道	400.00	12 729.43	0.00
JPY 日本電産	500.00	73 920.19	0.02
JPY 日本ビルファンド投資法人	49.00	367 802.02	0.07
JPY 日本通運	200.00	12 674.64	0.00
JPY 日本ペイントホールディングス	300.00	15 998.54	0.00
JPY 日本新薬	100.00	9 022.01	0.00
JPY 日本製鉄	1 800.00	26 389.37	0.01
JPY 日産化学	200.00	7 917.09	0.00
JPY 日清製粉グループ本社	600.00	11 264.72	0.00
JPY 日清食品ホールディングス	200.00	14 975.80	0.00
JPY ニトリホールディングス	200.00	31 321.34	0.01
JPY 日東電工	400.00	22 427.18	0.01
JPY 野村不動産ホールディングス	11 000.00	265 683.50	0.05
JPY 大林組	1 600.00	16 948.22	0.00
JPY オービック	100.00	13 268.19	0.00
JPY 小田急電鉄	700.00	17 201.17	0.00
JPY 王子ホールディングス	1 300.00	7 419.41	0.00
JPY オリンパス	2 500.00	37 074.24	0.01
JPY 小野薬品工業	900.00	20 176.24	0.01
JPY オリエンタルランド	400.00	55 319.15	0.01
JPY パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	1 000.00	16 199.43	0.00
JPY ペプチドリーム	300.00	13 779.57	0.00
JPY パーソルホールディングス	300.00	5 514.56	0.00
JPY ピジョン	200.00	9 295.95	0.00
JPY ポーラ・オルビスホールディングス	400.00	9 854.81	0.00
JPY 楽天	1 800.00	15 598.58	0.00
JPY リクルートホールディングス	2 900.00	104 920.10	0.02
JPY リンナイ	100.00	7 670.53	0.00
JPY 良品計画	400.00	9 106.02	0.00
JPY SBIホールディングス	800.00	16 604.88	0.00
JPY セコム	500.00	42 493.84	0.01
JPY 西武ホールディングス	600.00	10 568.90	0.00
JPY 積水ハウス	1 000.00	21 596.20	0.01
JPY シャープ	500.00	7 551.82	0.00
JPY シマノ	200.00	32 325.81	0.01
JPY 清水建設	1 800.00	17 225.82	0.00
JPY 信越化学工業	800.00	85 544.70	0.02
JPY 塩野義製薬	2 200.00	129 336.13	0.03
JPY 資生堂	800.00	57 748.15	0.01
JPY 昭和電工	300.00	8 007.49	0.00
JPY SMC	100.00	45 301.80	0.01
JPY スクウェア・エニックス・ホールディングス	200.00	9 880.38	0.00
JPY 住友重機械工業	28 100.00	803 150.39	0.16
JPY 住友金属鉱山	600.00	18 168.20	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

## U B S ( L u x ) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

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 比率 (%)
JPY 住友ゴム工業	800.00	10 161.63	0.00
JPY サントリー食品インターナショナル	200.00	8 675.01	0.00
JPY スズケン	200.00	8 738.93	0.00
JPY スズキ	800.00	35 474.39	0.01
JPY シスメックス	300.00	20 784.40	0.01
JPY T & Dホールディングス	1 700.00	19 994.52	0.01
JPY 大成建設	500.00	19 610.08	0.01
JPY 大陽日酸	300.00	6 676.10	0.00
JPY 帝人	800.00	15 041.55	0.00
JPY テルモ	1 400.00	49 104.19	0.01
JPY T H K	600.00	16 847.78	0.00
JPY 東武鉄道	200.00	7 314.40	0.00
JPY 東宝	200.00	8 117.98	0.00
JPY 東邦瓦斯	300.00	11 327.73	0.00
JPY 東北電力	1 000.00	9 907.77	0.00
JPY 東京瓦斯	700.00	16 903.94	0.00
JPY 東急	1 000.00	19 715.09	0.01
JPY 東レ	2 700.00	17 850.42	0.01
JPY 東ソー	500.00	7 442.24	0.00
JPY T O T O	200.00	8 748.06	0.00
JPY 豊田自動織機	300.00	17 614.83	0.00
JPY 豊田通商	500.00	17 464.16	0.00
JPY ツルハホールディングス	100.00	11 898.46	0.00
JPY ユー・エス・エス	700.00	13 564.06	0.00
JPY ヤクルト本社	100.00	5 862.48	0.00
JPY ヤマハ	300.00	16 519.04	0.00
JPY ヤマトホールディングス	1 000.00	17 094.33	0.00
JPY Z O Z O	238.00	4 735.66	0.00
日本合計		5 276 430.89	1.05
ジャージー			
GBP GLENCORE XSTRATA ORD USD0.01	23 212.00	73 230.30	0.01
ジャージー合計		73 230.30	0.01
ルクセンブルグ			
EUR AROUNDTOWN SA EURO.01	3 293.00	28 618.46	0.01
EUR EUROFINS SCIENTIFI EURO.10	44.00	23 121.97	0.00
ルクセンブルグ合計		51 740.43	0.01
オランダ			
USD AERCAP HOLDINGS EURO.01	433.00	26 763.73	0.01
EUR AKZO NOBEL NV EURO.50(POST REV SPLIT)	5 943.00	569 565.19	0.11
EUR EXOR NV EURO.01	357.00	27 333.54	0.01
EUR HEINEKEN HOLDING EUR1.6	372.00	35 684.55	0.01
EUR HEINEKEN NV EUR1.60	843.00	87 409.41	0.02
EUR ING GROEP N.V. EURO.01	13 749.00	158 327.36	0.03
EUR KON KPN NV EURO.04	10 055.00	30 998.25	0.01
EUR KONINKLIJKE AHOLD EURO.01	20 586.00	530 795.62	0.11
EUR KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20	9 112.00	423 426.23	0.08
USD NXP SEMICONDUCTORS EURO.20	970.00	112 112.60	0.02
EUR QIAGEN NV EURO.01	747.00	32 006.73	0.01
EUR RANDSTAD N.V. EURO.10	567.00	33 046.71	0.01
GBP ROYAL DUTCH SHELL ' B ' SHS EURO.07 (UK LIST)	12 073.00	341 921.64	0.07
EUR STMICROELECTRONICS EUR1.04	2 164.00	53 208.39	0.01
EUR VOPAK(KON) EURO.50	255.00	13 605.48	0.00
EUR WOLTERS KLUWER EURO.12	1 044.00	75 006.61	0.01
オランダ合計		2 551 212.04	0.52

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

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 比率 (%)
<b>パプアニューギニア</b>			
AUD OIL SEARCH LTD PGK0.10	6 944.00	34 945.10	0.01
<b>パプアニューギニア合計</b>		<b>34 945.10</b>	<b>0.01</b>
<b>シンガポール</b>			
USD FLEX LTD COM USD0.01	773.00	9 175.51	0.00
<b>シンガポール合計</b>		<b>9 175.51</b>	<b>0.00</b>
<b>スペイン</b>			
EUR ACS ACTIVIDADES CO EURO.5	885.00	34 475.05	0.01
EUR AENA SME S.A. EUR10	1 348.00	247 767.01	0.05
EUR AMADEUS IT GROUP EURO.01	9 493.00	756 762.78	0.15
EUR BANKIA S.A. EUR1 (POST CONS)	3 749.00	7 269.02	0.00
EUR BCO DE SABADELL EURO.125	15 536.00	17 249.90	0.00
EUR CAIXABANK SA EUR1	253 650.00	749 247.96	0.15
EUR CELLNEX TELECOM SA EURO.25	928.00	39 905.30	0.01
EUR ENAGAS SA EUR1.50	24 329.00	606 516.76	0.12
EUR ENDESA SA EUR1.2	965.00	26 259.74	0.01
EUR FERROVIAL SA EURO.2	1 634.00	48 554.42	0.01
EUR GRIFOLS SA EURO.25 (CLASS A) POST SUBD	896.00	30 635.70	0.01
EUR IBERDROLA SA EURO.75 (POST SUBDIVISION)	62 377.00	614 039.99	0.12
EUR INDITEX EURO.03 (POST SUBD)	3 491.00	108 777.73	0.02
EUR NATURGY ENERGY GRO EUR1	24 829.00	646 084.35	0.13
EUR RED ELECTRICA CORP EURO.5	14 121.00	276 364.21	0.06
EUR REPSOL SA EUR1	4 708.00	74 179.97	0.01
EUR SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	1 028.00	16 418.35	0.00
EUR TELEFONICA SA EUR1	15 422.00	118 213.87	0.02
<b>スペイン合計</b>		<b>4 418 722.11</b>	<b>0.88</b>
<b>イギリス</b>			
GBP 3I GROUP ORD GBPO.738636	1 783.00	24 700.59	0.01
USD AON PLC COM USD0.01 CL A	465.00	94 678.65	0.02
GBP ASTRAZENECA ORD USD0.25	2 899.00	279 664.30	0.06
GBP AVIVA ORD GBPO.25	7 916.00	41 346.48	0.01
GBP BAE SYSTEMS ORD GBPO.025	7 231.00	53 631.81	0.01
GBP BARRATT DEVEL ORD GBPO.10	84 297.00	727 066.52	0.15
GBP BRIT AMER TOBACCO ORD GBPO.25	5 090.00	201 467.80	0.04
GBP BRITISH LAND CO PLC REIT	3 031.00	22 566.97	0.00
GBP BT GROUP ORD GBPO.05	18 543.00	45 946.37	0.01
GBP BUNZL ORD GBPO.32142857	698.00	19 167.78	0.00
USD COCA-COLA EUROPEAN ORD EURO.01	869.00	43 849.74	0.01
GBP EVRAZ PLC ORD USD1	49 920.00	239 172.91	0.05
GBP HALMA ORD GBPO.10	784.00	21 357.03	0.00
USD IHS MARKIT LTD COM	731.00	53 107.15	0.01
GBP INFORMA PLC (GB) ORD GBPO.001	2 500.00	25 591.90	0.01
GBP ITV ORD GBPO.10	9 750.00	18 299.47	0.00
GBP JOHNSON MATTHEY ORD GBP1.109245	496.00	18 438.89	0.00
GBP KINGFISHER ORD GBPO.157142857	2 424.00	6 581.30	0.00
GBP LAND SECURITIES GP ORD GBPO.106666666	1 876.00	23 256.59	0.01
USD LIBERTY GLOBAL INC USD0.01 A	293.00	6 607.15	0.00
GBP LLOYDS BANKING GP ORD GBPO.1	164 358.00	130 003.11	0.03
GBP MARKS & SPENCER GP ORD GBPO.25	2 814.00	7 074.16	0.00
GBP MEGGITT ORD GBPO.05	2 543.00	21 150.65	0.00
GBP MELROSE INDUST PLC ORD GBPO.0685714	10 168.00	30 197.70	0.01
GBP NATIONAL GRID ORD GBPO.12431289	7 115.00	81 881.34	0.02
GBP OCADO GROUP PLC ORD GBPO.02	1 260.00	21 594.98	0.00
GBP RECKITT BENCK GRP ORD GBPO.10	1 572.00	123 344.95	0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

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 比率 (%)
GBP RELX PLC GBPO.1444	4 299.00	104 152.97	0.02
GBP RENTOKIL INITIAL ORD GBPO.01	3 766.00	21 672.50	0.00
GBP ROLLS-ROYCE HLDGS ORD GBPO.20	4 074.00	37 499.32	0.01
GBP SAGE GROUP GBPO.01051948	2 069.00	20 173.58	0.00
GBP SEVERN TRENT ORD GBPO.9789	292.00	8 471.86	0.00
GBP SMITHS GROUP ORD GBPO.375	938.00	20 152.96	0.00
GBP SPIRAX-SARCO ENG ORD GBPO.269230769	171.00	19 741.07	0.00
GBP SSE PLC ORD GBPO.50	2 303.00	38 726.10	0.01
GBP ST JAMES ' S PLACE ORD GBPO.15	1 658.00	23 344.22	0.01
EUR UNILEVER EURO.16	20 794.00	1 233 497.58	0.25
GBP UNITED UTILITIES G ORD GBPO.05	1 870.00	20 642.42	0.00
GBP WEIR GROUP ORD GBPO.125	1 113.00	20 090.54	0.00
GBP WHITBREAD ORD GBPO.76797385	11 815.00	703 157.14	0.14
USD WILLIS TOWERS WATS COM USDO.000304635	242.00	47 538.48	0.01
GBP WPP PLC ORD GBPO.10	2 750.00	35 589.04	0.01
<b>イギリス合計</b>		<b>4 736 196.07</b>	<b>0.94</b>
<b>アメリカ合衆国</b>			
USD 3M CO COM	1 060.00	179 956.20	0.04
USD AFLAC INC COM USDO.10	1 479.00	81 108.36	0.02
USD AKAMA I TECHNOLOGIES INC COM	6 401.00	557 655.12	0.11
USD ALBEMARLE CORP COM USDO.01	165.00	10 787.70	0.00
USD ALIGN TECHNOLOGY INC COM	142.00	39 382.28	0.01
USD ALLEGHANY CORP DEL COM	14.00	10 920.56	0.00
USD ALLIANCE DATA SYST COM USDO.01	3 393.00	362 745.63	0.07
USD ALLIANT ENERGY CORP COM	487.00	25 811.00	0.01
USD ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC COM	200.00	23 428.00	0.00
USD ALPHABET INC CAP STK USDO.001 CL C	963.00	1 256 676.48	0.25
USD ALTICE USA INC COM USDO.01 CL A	509.00	13 020.22	0.00
USD AMER ELEC PWR INC COM USD6.50	929.00	84 864.15	0.02
USD AMERICAN AIRLINES COM USD1	241.00	6 926.34	0.00
USD AMERICAN WATER WOR COM STK USDO.01	336.00	40 666.08	0.01
USD ANSYS INC COM	149.00	37 948.81	0.01
USD ARISTA NETWORKS IN COM USDO.0001	82.00	16 000.66	0.00
USD ARROW ELECTRS INC COM	219.00	17 441.16	0.00
USD BAKER HUGHES COMPA COM USDO.0001 CL A	1 110.00	24 886.20	0.00
USD BERKLEY(WR)CORP COM USDO.20	363.00	24 684.00	0.00
USD BERKSHIRE HATHAWAY CLASS ' B ' COM USDO.0033	2 513.00	553 613.90	0.11
USD BIOMARIN PHARMA COM USDO.001	363.00	29 297.73	0.01
USD BLACKROCK INC COM STK USDO.01	212.00	104 920.92	0.02
USD BOSTON PPTYS INC COM USDO.01	288.00	39 899.52	0.01
USD BOSTON SCIENTIFIC COM USDO.01	2 695.00	116 558.75	0.02
USD BROADRIDGE FIN SOL COM STK USDO.01	226.00	27 958.46	0.01
USD BROWN FORMAN CORP CL B	604.00	40 963.28	0.01
USD CABOT OIL & GAS CO COM USDO.10	647.00	10 313.18	0.00
USD CADENCE DESIGN SYS COM USDO.01	10 633.00	746 968.25	0.15
USD CAMPBELL SOUP CO CAP USDO.0375	272.00	12 667.04	0.00
USD CDK GLOBAL INC COM USDO.01	168.00	8 996.40	0.00
USD CDW CORP COM USDO.01	273.00	36 868.65	0.01
USD CERNER CORP COM	579.00	41 450.61	0.01
USD CHENIERE ENERGY INC COM NEW	498.00	30 148.92	0.01
USD CINCINNATI FINL CORP COM	245.00	26 227.25	0.01
USD CINTAS CORP COM	160.00	41 129.60	0.01
USD CLOROX CO DEL COM	242.00	35 871.66	0.01
USD CME GROUP INC COM STK USDO.01 CLASS ' A '	681.00	138 059.13	0.03
USD CMS ENERGY CORP COM	540.00	33 102.00	0.01
USD COCA-COLA CO COM USDO.25	7 830.00	418 122.00	0.08

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

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 比率 (%)
USD COGNEX CORP COM	272.00	13 648.96	0.00
USD COLGATE-PALMOLIVE COM USD1	1 487.00	100 848.34	0.02
USD CONSTELLATION BRDS CLASS ' A ' COM USDO.01	338.00	62 888.28	0.01
USD COPART INC COM	417.00	37 113.00	0.01
USD COSTAR GROUP INC COM	66.00	40 448.76	0.01
USD COTY INC COM USDO.01 CL ' A '	606.00	6 993.24	0.00
USD CSX CORP COM USD1	1 461.00	104 519.94	0.02
USD DEERE & CO COM USD1	599.00	100 661.95	0.02
USD DEVON ENERGY CORP NEW COM	662.00	14 491.18	0.00
USD DEXCOM INC COM	173.00	39 324.63	0.01
USD DIGITAL REALTY TRU COM STK USDO.01	329.00	39 792.55	0.01
USD DISCOVERY INC COM USDO.01 SER A	24 606.00	810 521.64	0.16
USD DISCOVERY INC COM USDO.01 SER C	833.00	25 423.16	0.01
USD DOMINION ENERGY IN COM STK NPV	1 573.00	130 732.03	0.03
USD DROPBOX INC COM USDO.00001 CL A	300.00	5 547.00	0.00
USD DUKE ENERGY CORP COM USDO.001 (POST REV SPLT)	1 479.00	130 403.43	0.03
USD ECOLAB INC COM	490.00	91 468.30	0.02
USD EDWARDS LIFESCIENCES CORP COM	386.00	94 546.84	0.02
USD EOG RESOURCES INC COM USDO.01	1 093.00	77 493.70	0.02
USD EPAM SYS INC COM USDO.001	69.00	14 617.65	0.00
USD EQUIFAX INC COM	244.00	34 072.16	0.01
USD EQUITY LIFESTYLE PPTYS INC	356.00	26 372.48	0.01
USD EQUITY RESIDENTIAL SBI USDO.01	780.00	66 378.00	0.01
USD ERIE INDTY CO CL A	28.00	4 740.40	0.00
USD ESSEX PROP TRUST COM USDO.0001	115.00	35 900.70	0.01
USD EXACT SCIENCES CORP COM	288.00	23 330.88	0.00
USD EXPEDTRS INTL WASH COM USDO.01	7 660.00	572 661.60	0.11
USD F M C CORP COM NEW	214.00	20 963.44	0.00
USD F5 NETWORK INC COM STK NPV	140.00	20 399.40	0.00
USD FACTSET RESH SYS INC COM	51.00	13 242.15	0.00
USD FASTENAL COM USDO.01	1 044.00	37 082.88	0.01
USD FIDELITY NATL FINL FNF GROUP COM USDO.0001	576.00	27 434.88	0.01
USD FLIR SYS INC COM	201.00	10 765.56	0.00
USD FLOWSERVE CORP COM	185.00	9 009.50	0.00
USD FORTINET INC COM USDO.001	306.00	32 163.66	0.01
USD FORTIVE CORP COM USDO.01	545.00	39 332.65	0.01
USD FRANKLIN RES INC COM	452.00	12 425.48	0.00
USD GALLAGHER ARTHUR J & CO COM	398.00	37 121.46	0.01
USD GAP INC DEL COM	710.00	11 793.10	0.00
USD GARTNER INC COM	177.00	28 401.42	0.01
USD GEN DYNAMICS CORP COM USD1	473.00	85 963.02	0.02
USD GEN ELEC CO COM USDO.06	16 838.00	189 764.26	0.04
USD GRUBHUB INC COM USDO.0001	134.00	5 778.08	0.00
USD HANESBRANDS INC COM	5 467.00	82 387.69	0.02
USD HARLEY DAVIDSON INC COM	239.00	8 694.82	0.00
USD HEICO CORP NEW CL A	106.00	10 646.64	0.00
USD HEICO CORP NEW COM	62.00	8 053.18	0.00
USD HENRY JACK & ASSOC COM USDO.01	145.00	22 031.30	0.00
USD HONEYWELL INTL INC COM	1 418.00	253 183.90	0.05
USD HUNT J B TRANS SVCS INC COM	143.00	16 533.66	0.00
USD IAC INTERACTIVECOR COM USDO.001	153.00	34 073.10	0.01
USD IDEX CORP COM	142.00	23 109.08	0.00
USD IDEXX LABORATORIES COM USDO.10	142.00	35 724.36	0.01
USD ILLINOIS TOOL WKS COM NPV	636.00	110 873.88	0.02
USD ILLUMINA INC COM USDO.01	275.00	88 209.00	0.02
USD INCYTE CORPORATION COM USDO.001	364.00	34 274.24	0.01
USD INTERCONTINENTAL E COM USDO.01	1 086.00	102 268.62	0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

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 比率 (%)
USD INTERNATIONAL FLAVORS&FRAGRANC COM	169.00	23 867.87	0.00
USD INTERPUBLIC GROUP COM USD0.10	979.00	21 929.60	0.00
USD INTUITIVE SURGICAL COM USD0.001	219.00	129 845.10	0.03
USD INVITATION HOMES I COM USD0.01	1 042.00	31 812.26	0.01
USD IONIS PHARMACEUTIC COM USD0.001	325.00	20 787.00	0.00
USD IPG PHOTONICS CORP COM USD0.0001	52.00	7 388.68	0.00
USD JOHNSON & JOHNSON COM USD1	5 478.00	753 170.22	0.15
USD JP MORGAN CHASE & COM USD1	7 091.00	934 310.16	0.19
USD JUNIPER NETWORKS COM USD0.00001	15 959.00	399 932.54	0.08
USD KRAFT HEINZ CO COM USD0.01	1 320.00	40 260.00	0.01
USD LAMB WESTON HLDGS COM USD1.00 WI	313.00	26 285.74	0.01
USD LEGGETT & PLATT IN COM USD0.01	300.00	15 696.00	0.00
USD LEIDOS HLDGS INC COM USD0.0001	297.00	26 979.48	0.01
USD LENNOX INTL INC COM	46.00	11 769.10	0.00
USD LIBERTY BROADBAND COM USD0.01 CL 'C'	182.00	21 747.18	0.00
USD LIBERTY MEDIA CORP COM USD0.01 SER A SIRIUSXM	152.00	7 402.40	0.00
USD LIBERTY MEDIA CORP COM USD0.01 SER C SIRIUSXM	290.00	14 067.90	0.00
USD LIBERTY MEDIA CORP COM USD0.01 SER C FORMULA	313.00	14 113.17	0.00
USD LIVE NATION INC COM	243.00	16 963.83	0.00
USD LOCKHEED MARTIN CORP COM	487.00	190 431.61	0.04
USD LOEWS CORP COM	616.00	31 354.40	0.01
USD LYONDELLBASELL IND COM USD0.01	550.00	50 897.00	0.01
USD M & T BANK CORP COM USD0.50	249.00	41 020.26	0.01
USD MARKEL CORP COM	22.00	24 982.10	0.00
USD MARKETAXESS HLDGS INC COM	76.00	30 690.32	0.01
USD MARSH & MCLENNAN COM USD1	948.00	102 450.36	0.02
USD MARTIN MARIETTA M. COM USD0.01	130.00	34 892.00	0.01
USD MAXIM INTEGRATED COM USD0.001	557.00	31 565.19	0.01
USD METTLER TOLEDO INTERNATIONAL COM	41.00	29 495.81	0.01
USD MONGODB INC COM USD0.001 CL A	100.00	14 870.00	0.00
USD MONSTER BEV CORP USD0.005(NEW)	778.00	46 539.96	0.01
USD MOODYS CORP COM USD0.01	332.00	75 254.44	0.01
USD MYLAN NV EURO.01	1 089.00	20 451.42	0.00
USD NASDAQ INC COM STK USD0.01	173.00	18 130.40	0.00
USD NEWS CORP NEW COM USD0.01 CL 'A'	609.00	7 843.92	0.00
USD NEXTERA ENERGY INC COM USD0.01	921.00	215 348.22	0.04
USD NORDSTROM INC COM NPV	388.00	14 809.96	0.00
USD OKTA INC COM USD0.0001 CL A	200.00	25 956.00	0.01
USD PAYCOM SOFTWARE IN COM USD0.01	104.00	28 788.24	0.01
USD PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC COM STK USD0.01	1 106.00	18 249.00	0.00
USD PEPSICO INC CAP USD0.016666	2 711.00	368 235.13	0.07
USD PERKINELMER INC COM USD1	226.00	20 995.40	0.00
USD PHILIP MORRIS INTL COM STK NPV 'WI'	2 992.00	248 126.56	0.05
USD PIONEER NATURAL RE COM STK USD0.01	317.00	40 525.28	0.01
USD POLARIS INC COM USD0.01	77.00	7 522.90	0.00
USD PPG INDS INC COM	502.00	64 677.68	0.01
USD PROGRESSIVE CP(OH) COM USD1	1 124.00	82 108.20	0.02
USD PTC INC COM USD0.01	167.00	12 792.20	0.00
USD PUBLIC STORAGE COM USD0.10	267.00	56 251.56	0.01
USD PULTE GROUP INC COM USD0.01	18 294.00	725 357.10	0.14
USD QORVO INC COM USD 0.0001	273.00	28 449.33	0.01
USD RALPH LAUREN CORP CLASS 'A' COM USD0.01	66.00	7 084.44	0.00
USD REALTY INCOME CORP	700.00	53 641.00	0.01
USD RESMED INC COM USD0.004	309.00	46 226.40	0.01
USD ROKU INC COM USD0.0001 CLASS A	145.00	23 253.65	0.00
USD ROLLINS INC COM	243.00	8 711.55	0.00
USD ROPER TECHNOLOGIES COM USD0.01	201.00	72 434.37	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

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 比率 (%)
USD S&P GLOBAL INC COM USD1	470.00	124 385.50	0.02
USD SABRE CORP COM USDO.01	391.00	8 770.13	0.00
USD SAREPTA THERA INC COM USDO.0001	130.00	14 623.70	0.00
USD SEATTLE GENETICS I COM USDO.001	240.00	28 884.00	0.01
USD SEMPRA ENERGY COM NPV	532.00	78 347.64	0.02
USD SHERWIN-WILLIAMS COM USD1	158.00	92 134.54	0.02
USD SMITH A O COM	217.00	10 502.80	0.00
USD SNAP INC COM USDO.00001 CL A	1 642.00	25 040.50	0.00
USD SOUTHERN CO COM	1 985.00	123 050.15	0.02
USD SPLUNK INC COM USDO.001	291.00	43 423.02	0.01
USD SPRINT CORPORATION COM USDO.01	1 208.00	7 151.36	0.00
USD SS&C TECH HLDGS COM USDO.01	358.00	21 497.90	0.00
USD STRYKER CORP COM USDO.10	653.00	133 773.58	0.03
USD SUN COMMUNITIES COM USDO.01	171.00	28 165.41	0.01
USD SVB FINL GROUP COM	103.00	23 868.19	0.00
USD SYNOPSIS INC COM USDO.01	753.00	106 203.12	0.02
USD TAKE TWO INTERACTI COM USDO.01	5 151.00	625 073.85	0.12
USD TARGA RESOURCES CO COM USDO.001	364.00	13 296.92	0.00
USD TRANSUNION COM USDO.01	297.00	25 634.07	0.01
USD TRIMBLE INC COM NPV	396.00	16 049.88	0.00
USD TRIPADVISOR INC COM USDO.001	164.00	4 657.60	0.00
USD TWILIO INC COM USDO.001 CL A	252.00	26 026.56	0.01
USD UDR INC	574.00	27 580.70	0.01
USD UNDER ARMOUR INC COM STK USDO.000333 CL A	291.00	5 496.99	0.00
USD UNDER ARMOUR INC COM STK USDO.0003333 CL C	326.00	5 639.80	0.00
USD UNITED PARCEL SERVICE INC CL B	1 353.00	161 994.69	0.03
USD UTD TECHNOLOGIES COM USD1	1 582.00	234 673.88	0.05
USD VEEVA SYSTEMS INC COM USDO.00001 CL 'A'	239.00	35 654.02	0.01
USD VERISIGN INC COM	192.00	36 622.08	0.01
USD VERISK ANALYTICS I CL A USDO.001	293.00	43 211.64	0.01
USD VERTEX PHARMACEUTI COM USDO.01	462.00	102 448.50	0.02
USD VMWARE INC COM STK USDO.01 CLASS 'A'	171.00	26 611.02	0.01
USD VORNADO REALTY TR COM USDO.04	284.00	18 337.88	0.00
USD VULCAN MATERIALS COM STK USD1	272.00	38 588.64	0.01
USD W P CAREY INC COM USDO.001	363.00	30 281.46	0.01
USD WABTEC CORP COM	331.00	26 006.67	0.01
USD WATERS CORP COM	143.00	31 756.01	0.01
USD WAYFAIR INC COM USDO.001 A	90.00	7 642.80	0.00
USD WEC ENERGY GROUP COM USDO.01	586.00	51 948.90	0.01
USD WELLCARE HEALTH PL COM USDO.01	100.00	32 207.00	0.01
USD WESTERN UN CO COM	10 281.00	276 353.28	0.06
USD XCEL ENERGY INC COM	1 005.00	61 797.45	0.01
USD ZAYO GROUP HOLDING COM USDO.001	381.00	13 045.44	0.00
USD ZEBRA TECHNOLOGIES CORP CL A	112.00	28 105.28	0.01
USD ZILLOW GROUP INC COM USDO.0001 CLASS C WI	203.00	7 947.45	0.00
USD ZOETIS INC COM USDO.01 CL 'A'	910.00	109 673.20	0.02
アメリカ合衆国合計		17 857 618.20	3.56
無記名株式合計		54 690 532.65	10.90
その他の株式			
アメリカ合衆国			
USD CAMDEN PROP TST SBI USDO.01	202.00	22 533.10	0.00
アメリカ合衆国合計		22 533.10	0.00
その他の株式合計		22 533.10	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

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 比率 (%)
<b>優先株式</b>			
<b>ドイツ</b>			
EUR BAYERISCHE MOTORENWERKE AG EUR1	118.00	7 285.98	0.00
EUR FUCHS PETROLUB SE NON-VTG PRF NPV	172.00	7 434.17	0.00
EUR HENKEL AG&CO. KGAA NON-VTG PRF NPV	6 867.00	725 960.62	0.15
EUR PORSCHE AUTO HL SE NON VTG PRF NPV	493.00	36 517.83	0.01
EUR SARTORIUS AG NON VTG PRF NPV	101.00	21 303.67	0.00
EUR VOLKSWAGEN AG NON VTG PRF NPV	2 776.00	537 112.27	0.11
<b>ドイツ合計</b>		<b>1 335 614.54</b>	<b>0.27</b>
<b>優先株式合計</b>		<b>1 335 614.54</b>	<b>0.27</b>
<b>記名株式</b>			
<b>アルゼンチン</b>			
USD MERCADOLIBRE INC COM STK USDO.001	78.00	45 285.24	0.01
<b>アルゼンチン合計</b>		<b>45 285.24</b>	<b>0.01</b>
<b>オーストラリア</b>			
AUD BENDIGO & ADELAIDE NPV	2 357.00	15 990.58	0.00
AUD BHP GROUP LTD NPV	14 602.00	377 589.79	0.08
GBP BHP GROUP PLC ORD USDO.50	4 414.00	97 632.60	0.02
AUD COLES GROUP LTD NPV	68 287.00	751 038.45	0.15
<b>オーストラリア合計</b>		<b>1 242 251.42</b>	<b>0.25</b>
<b>ベルギー</b>			
EUR AGEAS NPV	704.00	42 289.03	0.01
EUR KBC GROUP NV NPV	847.00	61 768.29	0.01
EUR TELENET GRP HLDG NPV	122.00	5 509.82	0.00
EUR UCB NPV	422.00	34 227.26	0.01
<b>ベルギー合計</b>		<b>143 794.40</b>	<b>0.03</b>
<b>バミューダ</b>			
USD ARCH CAPITAL GROUP COM USDO.01	855.00	35 884.35	0.01
USD EVEREST RE GROUP COM USDO.01	87.00	23 599.62	0.00
USD RENAISSANCE RE HLG COM USD1	62.00	11 676.46	0.00
<b>バミューダ合計</b>		<b>71 160.43</b>	<b>0.01</b>
<b>カナダ</b>			
USD LULULEMON ATHLETIC COM STK USDO.01	206.00	46 492.14	0.01
<b>カナダ合計</b>		<b>46 492.14</b>	<b>0.01</b>
<b>フィンランド</b>			
EUR ELISA CORPORATION EURO.50	511.00	27 331.92	0.01
EUR FORTUM OYJ EUR3.40	4 223.00	99 597.82	0.02
EUR NESTE OIL OYJ NPV	20 965.00	709 199.16	0.14
EUR NOKIA OYJ NPV	20 005.00	70 837.71	0.01
EUR NOKIAN RENKAAT OYJ NPV	617.00	16 708.27	0.00
EUR ORION CORP SER ' B ' NPV	502.00	21 863.46	0.01
EUR SAMPO OYJ SER ' A ' NPV	1 518.00	61 426.51	0.01
EUR STORA ENSO OYJ NPV SER ' R '	1 659.00	22 316.40	0.01
EUR UPM-KYMMENE CORP NPV	1 881.00	62 883.40	0.01
<b>フィンランド合計</b>		<b>1 092 164.65</b>	<b>0.22</b>

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

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 比率 (%)
<b>フランス</b>			
EUR BOLLORE EURO.16 (RFD 01/01/2020)	11.00	46.21	0.00
EUR GECINA EUR7.50	161.00	27 834.92	0.01
EUR MICHELIN (CGDE) EUR2	580.00	69 642.42	0.01
<b>フランス合計</b>		<b>97 523.55</b>	<b>0.02</b>
<b>ドイツ</b>			
EUR ADIDAS AG NPV (REGD)	614.00	191 420.73	0.04
EUR ALLIANZ SE NPV(REGD)(VINKULIERT)	5 607.00	1 343 718.17	0.27
EUR AXEL SPRINGER SE NPV (ASD 02/08/19 TRAVIATA)	249.00	17 159.21	0.00
EUR BASF SE NPV	3 123.00	234 910.10	0.05
EUR BAYER AG NPV (REGD)	3 137.00	237 623.42	0.05
EUR BRENNTAG AG	518.00	27 649.22	0.00
EUR DAIMLER AG ORD NPV(REGD)	3 118.00	176 020.83	0.03
EUR DELIVERY HERO SE NPV	373.00	19 740.95	0.00
EUR DEUTSCHE BANK AG NPV(REGD)	6 050.00	43 653.26	0.01
EUR DEUTSCHE BOERSE AG NPV(REGD)	598.00	91 815.16	0.02
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA ORD NPV (REGD)(VINK)	859.00	16 309.64	0.00
EUR DEUTSCHE POST AG NPV(REGD)	3 457.00	128 987.53	0.03
EUR DEUTSCHE TELEKOM NPV(REGD)	11 276.00	189 427.94	0.04
EUR E.ON SE NPV	7 912.00	82 858.38	0.02
EUR EVONIK INDUSTRIES NPV	735.00	21 346.23	0.00
EUR HANNOVER RUECKVERS ORD NPV(REGD)	183.00	33 999.22	0.01
EUR INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)	4 133.00	88 352.00	0.02
EUR MTU AERO ENGINES H NPV (REGD)	185.00	50 158.93	0.01
EUR MUENCHENER RUECKVE NPV(REGD)	478.00	137 347.35	0.03
EUR SIEMENS AG NPV(REGD)	2 579.00	333 043.06	0.07
EUR SIEMENS HEALTHINEE NPV	2 129.00	103 334.11	0.02
EUR TELEFONICA DEUTSCH NPV	84 317.00	257 614.12	0.05
GBP TUI AG NPV (REGD)	1 219.00	16 769.02	0.00
EUR UNIPER SE NPV	5 418.00	175 034.88	0.03
EUR UNITED INTERNET AG NPV(REGD)	501.00	16 986.38	0.00
EUR VONOVIA SE NPV	1 739.00	90 674.86	0.02
<b>ドイツ合計</b>		<b>4 125 954.70</b>	<b>0.82</b>
<b>アイルランド</b>			
USD ACCENTURE PLC SHS CL A 'NEW'	2 768.00	556 810.88	0.11
USD ALLEGION PLC CIM USDO.01	191.00	22 925.73	0.01
USD APTIV PLC COM USDO.01	489.00	45 907.32	0.01
EUR CRH ORD EURO.32	2 297.00	87 959.71	0.02
USD EATON CORP PLC COM USDO.01	802.00	74 185.00	0.02
GBP EXPERIAN ORD USDO.10	1 767.00	58 580.30	0.01
USD JAZZ PHARMA PLC COM USDO.0001	2 061.00	311 458.32	0.06
EUR KINGSPAN GROUP ORD EURO.13(DUBLIN LISTING)	327.00	17 638.12	0.00
USD PENTAIR PLC COM USDO.01	381.00	16 897.35	0.00
USD PERRIGO CO LTD COM EURO.001	333.00	17 059.59	0.00
EUR SMURFIT KAPPA GRP ORD EURO.001	523.00	18 568.45	0.00
USD STERIS PLC ORD USDO.001	156.00	23 577.84	0.01
<b>アイルランド合計</b>		<b>1 251 568.61</b>	<b>0.25</b>
<b>マン島</b>			
GBP GVC HLDGS PLC ORD EURO.01	923.00	10 167.26	0.00
<b>マン島合計</b>		<b>10 167.26</b>	<b>0.00</b>
<b>イタリア</b>			
EUR ATLANTIA SPA EUR1	1 711.00	37 957.36	0.01
EUR DAVIDE DE CAMPARI EURO.05 (POST SUBD)	1 650.00	15 072.82	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

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 比率 (%)
EUR ENEL EUR1	26 144.00	197 633.62	0.04
EUR ENI SPA EUR1	46 242.00	699 227.89	0.14
EUR FERRARI NV EURO.01(NEW)	410.00	69 346.92	0.01
EUR INTESA SANPAOLO NPV	52 675.00	133 611.79	0.03
EUR MEDIOBANCA SPA EURO.5	1 784.00	19 965.44	0.00
EUR MONCLER SPA NPV	654.00	28 678.16	0.01
EUR PIRELLI & C SPA NPV	1 172.00	6 655.07	0.00
EUR PRYSMIAN SPA EURO.10	841.00	19 185.56	0.00
EUR RECORDATI EURO.125	362.00	15 195.31	0.00
EUR SNAM EUR1	6 317.00	31 426.64	0.01
EUR TERNA SPA ORD EURO.22	4 262.00	27 396.81	0.01
EUR UNICREDIT SPA NPV (POST REV SPLIT)	54 075.00	748 985.32	0.15
イタリア合計		2 050 338.71	0.41
日本			
JPY イオン	1 500.00	30 586.25	0.01
JPY A G C	200.00	7 296.14	0.00
JPY 味の素	1 000.00	16 656.01	0.00
JPY アルフレッサ ホールディングス	800.00	16 517.21	0.00
JPY アルプスアルパイン	400.00	9 025.66	0.00
JPY A N A ホールディングス	500.00	17 016.71	0.00
JPY アサヒグループホールディングス	17 900.00	860 756.09	0.17
JPY 旭化成	2 900.00	32 559.13	0.01
JPY アステラス製薬	10 300.00	175 648.34	0.03
JPY ブリヂストン	1 300.00	51 935.89	0.01
JPY ブラザー工業	900.00	17 833.99	0.00
JPY キヤノン	2 100.00	58 104.28	0.01
JPY カシオ計算機	500.00	9 528.81	0.00
JPY 中部電力	1 200.00	16 721.76	0.00
JPY 中国電力	800.00	10 570.72	0.00
JPY 大日本印刷	900.00	24 055.34	0.01
JPY 大和証券グループ本社	4 100.00	20 778.92	0.00
JPY デンソー	1 000.00	44 635.19	0.01
JPY 東日本旅客鉄道	600.00	55 173.04	0.01
JPY 電源開発	400.00	9 588.17	0.00
JPY ファミリーマート	700.00	16 517.22	0.00
JPY 富士フイルムホールディングス	3 000.00	141 685.69	0.03
JPY 富士通	400.00	36 347.37	0.01
JPY 浜松ホトニクス	400.00	16 199.43	0.00
JPY 日立製作所	2 100.00	82 458.22	0.02
JPY 本田技研工業	3 500.00	98 023.01	0.02
JPY H O Y A	2 600.00	237 183.82	0.05
JPY 国際石油開発帝石	2 000.00	19 523.33	0.00
JPY 伊藤忠商事	42 600.00	928 945.30	0.19
JPY 日本航空	400.00	12 426.26	0.00
JPY 日本郵政	2 200.00	20 672.08	0.00
JPY 日本リテールファンド投資法人	9.00	20 488.54	0.00
JPY 日本たばこ産業	2 600.00	59 224.73	0.01
JPY ジェイ エフ イー ホールディングス	8 000.00	101 908.50	0.02
JPY J X T G ホールディングス	7 000.00	31 104.01	0.01
JPY K D D I	29 600.00	848 455.84	0.17
JPY キーエンス	400.00	136 754.63	0.03
JPY コナミホールディングス	200.00	8 802.85	0.00
JPY クボタ	2 300.00	35 462.97	0.01
JPY 京セラ	700.00	47 602.05	0.01
JPY 協和キリン	400.00	8 485.07	0.00
JPY ローソン	8 900.00	484 375.85	0.10

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

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 比率 (%)	
JPY	L I X I Lグループ	1 000.00	16 893.43	0.00
JPY	丸紅	80 000.00	590 411.83	0.12
JPY	マツダ	2 000.00	17 715.28	0.00
JPY	メディカルホールディングス	8 800.00	188 680.48	0.04
JPY	メルカリ	200.00	4 408.73	0.00
JPY	三菱ケミカルホールディングス	2 500.00	18 530.27	0.00
JPY	三菱商事	2 900.00	75 896.26	0.02
JPY	三菱電機	3 900.00	53 829.33	0.01
JPY	三菱地所	2 500.00	45 806.32	0.01
JPY	三菱重工業	15 800.00	604 240.70	0.12
JPY	三菱マテリアル	600.00	16 020.45	0.00
JPY	田辺三菱製薬	15 800.00	288 990.96	0.06
JPY	三菱UFJフィナンシャル・グループ	26 000.00	137 253.22	0.03
JPY	三井物産	3 500.00	61 987.49	0.01
JPY	商船三井	400.00	10 483.06	0.00
JPY	みずほフィナンシャルグループ	49 400.00	76 326.18	0.02
JPY	M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	1 100.00	35 568.44	0.01
JPY	村田製作所	1 200.00	69 516.94	0.01
JPY	日本電気	600.00	23 970.41	0.01
JPY	ネクソン	1 100.00	14 996.80	0.00
JPY	日本碍子	800.00	13 186.01	0.00
JPY	日本特殊陶業	500.00	10 003.65	0.00
JPY	ニコン	800.00	10 965.21	0.00
JPY	任天堂	200.00	77 344.53	0.02
JPY	日本プロロジスリート投資法人	8.00	21 455.57	0.01
JPY	日本電信電話	19 800.00	999 311.47	0.20
JPY	日本郵船	600.00	10 294.95	0.00
JPY	日産自動車	5 500.00	34 091.86	0.01
JPY	野村ホールディングス	7 100.00	36 352.57	0.01
JPY	野村不動産マスターファンド投資法人	11.00	20 069.40	0.00
JPY	野村総合研究所	1 000.00	21 084.83	0.01
JPY	エヌ・ティ・ティ・データ	1 400.00	19 074.06	0.00
JPY	N T Tドコモ	36 900.00	1 011 877.45	0.20
JPY	オムロン	400.00	23 486.44	0.01
JPY	オリックス	1 600.00	26 189.39	0.01
JPY	オリックス不動産投資法人	9.00	19 781.75	0.00
JPY	大阪瓦斯	1 000.00	18 738.01	0.00
JPY	大塚商会	200.00	8 008.40	0.00
JPY	大塚ホールディングス	700.00	30 515.93	0.01
JPY	パナソニック	4 900.00	46 176.60	0.01
JPY	パーク24	400.00	9 661.22	0.00
JPY	ルネサスエレクトロニクス	1 100.00	7 161.90	0.00
JPY	りそなホールディングス	4 300.00	18 223.27	0.00
JPY	リコー	700.00	7 203.91	0.00
JPY	ローム	200.00	16 802.12	0.00
JPY	参天製薬	1 000.00	18 719.75	0.00
JPY	積水化学工業	1 200.00	20 874.81	0.01
JPY	セブン&アイ・ホールディングス	1 600.00	59 581.77	0.01
JPY	S Gホールディングス	300.00	7 193.86	0.00
JPY	島津製作所	800.00	24 070.86	0.01
JPY	ソフトバンク	3 500.00	47 493.38	0.01
JPY	ソフトバンクグループ	3 300.00	128 160.90	0.03
JPY	総合警備保障	200.00	10 391.74	0.00
JPY	S O M P Oホールディングス	800.00	31 529.54	0.01
JPY	ソニー	8 300.00	523 269.10	0.11
JPY	S U B A R U	1 400.00	36 645.97	0.01
JPY	S U M C O	500.00	7 720.76	0.00
JPY	住友商事	2 500.00	37 644.96	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

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 比率 (%)
JPY 住友電気工業	1 500.00	22 381.52	0.01
JPY 三井住友フィナンシャルグループ	2 800.00	101 992.51	0.02
JPY 三井住友トラスト・ホールディングス	900.00	34 410.56	0.01
JPY 住友不動産	600.00	20 896.72	0.01
JPY 武田薬品工業	3 200.00	130 179.89	0.03
JPY TDK	200.00	21 020.91	0.00
JPY 東京海上ホールディングス	1 400.00	76 091.68	0.02
JPY 東京電力ホールディングス	1 300.00	5 698.11	0.00
JPY 東京エレクトロン	300.00	61 912.15	0.01
JPY 東急不動産ホールディングス	1 500.00	10 286.73	0.00
JPY 凸版印刷	600.00	11 927.68	0.00
JPY 東芝	1 000.00	35 887.13	0.01
JPY トヨタ自動車	4 800.00	334 785.86	0.07
JPY トレンドマイクロ	300.00	16 190.30	0.00
JPY ユニ・チャーム	900.00	29 463.06	0.01
JPY ユナイテッド・アーバン投資法人	10.00	19 450.28	0.00
JPY 西日本旅客鉄道	300.00	26 400.33	0.01
JPY ヤマハ発動機	400.00	8 353.57	0.00
JPY 安川電機	500.00	18 354.49	0.00
JPY 横河電機	900.00	16 461.51	0.00
JPY 横浜ゴム	500.00	10 295.86	0.00
JPY Zホールディングス	2 400.00	8 262.26	0.00
日本合計		11 720 222.01	2.34
ルクセンブルグ			
EUR ARCELORMITTAL NPV(POST STOCK SPLIT)	2 622.00	44 891.72	0.01
EUR TENARIS S.A. USD1	1 490.00	15 857.02	0.00
ルクセンブルグ合計		60 748.74	0.01
オランダ			
EUR ADYEN NV EURO.01	33.00	25 331.79	0.00
EUR AEGON NV EURO.12	5 706.00	25 744.55	0.01
EUR ASML HOLDING NV EURO.09	1 438.00	391 628.08	0.08
EUR CNH INDUSTRIAL NV COM EURO.01	3 191.00	34 226.96	0.01
EUR FIAT CHRYSLER AUTO EURO.01	3 419.00	50 590.57	0.01
EUR KONINKLIJKE DSM NV EUR1.5	601.00	77 067.66	0.02
EUR NN GROUP N.V. EURO.12	1 072.00	41 180.43	0.01
EUR PROSUS N.V. EURO.05	1 547.00	105 533.03	0.02
GBP ROYAL DUTCH SHELL PLC 'A' SHS EURO.07	9 586.00	274 152.75	0.05
オランダ合計		1 025 455.82	0.21
ポルトガル			
EUR EDP ENERGIAS PORTU EUR1(REGD)	51 358.00	207 822.30	0.04
EUR GALP ENERGIA EUR1-B	1 748.00	28 476.52	0.01
EUR JERONIMO MARTINS EUR5	1 127.00	18 011.93	0.00
ポルトガル合計		254 310.75	0.05
南アフリカ			
GBP MONDI ORD EURO.20	912.00	19 765.40	0.00
南アフリカ合計		19 765.40	0.00
スペイン			
EUR BANCO SANTANDER SA EURO.50(REGD)	77 313.00	301 512.67	0.06
EUR BANKINTER SA EURO.3(REGD)	2 696.00	18 870.13	0.01
EUR BBVA(BILB-VIZ-ARG) EURO.49	56 605.00	298 426.20	0.06
EUR MAPFRE SA EURO.10	6 475.00	18 269.56	0.00
スペイン合計		637 078.56	0.13

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

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 比率 (%)
<b>スウェーデン</b>			
USD AUTOLIV INC COM	216.00	17 651.52	0.00
<b>スウェーデン合計</b>		<b>17 651.52</b>	<b>0.00</b>
<b>スイス</b>			
USD CHUBB LIMITED ORD CHF24.15	893.00	135 271.64	0.03
GBP COCA-COLA HBC AG ORD CHF6.70	524.00	17 480.31	0.00
USD GARMIN LTD COM CHF10.00	3 553.00	347 092.57	0.07
USD TE CONNECTIVITY LT COM CHF0.57	694.00	64 340.74	0.01
<b>スイス合計</b>		<b>564 185.26</b>	<b>0.11</b>
<b>アラブ首長国連邦</b>			
GBP NMC HEALTH PLC ORD GBPO.1	225.00	7 302.13	0.00
<b>アラブ首長国連邦合計</b>		<b>7 302.13</b>	<b>0.00</b>
<b>イギリス</b>			
GBP ADMIRAL GROUP ORD GBPO.001	259.00	7 169.35	0.00
USD AMCOR PLC ORD USDO.01	2 600.00	26 676.00	0.01
GBP ANGLO AMERICAN USDO.54945	1 983.00	51 979.94	0.01
GBP ANTOFAGASTA ORD GBPO.05	1 773.00	19 906.50	0.00
GBP ASHTEAD GROUP ORD GBPO.10	845.00	25 685.68	0.01
GBP ASSOCD BRIT FOODS ORD GBPO.0568	856.00	28 444.89	0.01
GBP AUTO TRADER GROUP ORD GBPO.01	2 829.00	20 565.33	0.00
GBP BARCLAYS ORD GBPO.25	88 268.00	195 855.21	0.04
GBP BERKELEY GP HLDGS ORD GBPO.05	2 236.00	132 639.32	0.03
GBP BP ORD USDO.25	44 801.00	278 276.35	0.06
GBP BURBERRY GROUP ORD GBPO.0005	981.00	26 698.15	0.01
USD CAPRI HOLDINGS LTD COM NPV	424.00	15 747.36	0.00
GBP CARNIVAL PLC ORD USD1.66	376.00	15 821.16	0.00
GBP CENTRICA ORD GBPO.061728395	7 338.00	7 614.24	0.00
GBP COMPASS GROUP ORD GBPO.1105	8 612.00	211 040.14	0.04
GBP CRODA INTL ORD GBPO.10609756	243.00	15 653.16	0.00
GBP DIAGEO ORD GBPO.28 101/108	5 214.00	213 457.38	0.04
GBP DIRECT LINE INSURA ORD GBP 0.109090909	2 305.00	9 105.55	0.00
GBP EASYJET ORD GBPO.27285714	466.00	8 065.08	0.00
GBP FERGUSON PLC (NEW) ORD GBPO.10	495.00	43 039.79	0.01
GBP G4S ORD GBPO.25	2 897.00	7 835.54	0.00
GBP GLAXOSMITHKLINE ORD GBPO.25	10 595.00	240 379.25	0.05
GBP HARGREAVES LANSDOW ORD GBPO.004 (WI)	763.00	18 307.75	0.00
GBP HSBC HLDGS ORD USDO.50(UK REG)	44 912.00	334 793.84	0.07
GBP IMPERIAL BRANDS PL GBPO.10	15 672.00	345 268.13	0.07
GBP INTERCONTL HOTELS ORD GBPO.208521303	327.00	21 178.33	0.01
GBP INTERTEK GROUP ORD GBPO.01	267.00	19 050.31	0.00
GBP LEGAL & GENERAL GP ORD GBPO.025	11 771.00	42 769.24	0.01
USD LIBERTY GLOBAL INC USDO.01 C	798.00	17 157.00	0.00
USD LINDE PLC COM EURO.001	1 053.00	217 139.13	0.04
GBP LONDON STOCK EXCH ORD GBPO.06918604	628.00	55 822.49	0.01
GBP M&G PLC ORD GBPO.05	4 765.00	14 545.92	0.00
GBP MICRO FOCUS INTL ORD GBPO.10	880.00	12 894.44	0.00
GBP MORRISON(W)SUPRMKT ORD GBPO.10	30 727.00	78 815.08	0.02
GBP NEXT ORD GBPO.10	277.00	24 213.88	0.01
GBP PEARSON ORD GBPO.25	1 780.00	14 887.51	0.00
GBP PERSIMMON ORD GBPO.10	4 402.00	145 652.19	0.03
GBP PRUDENTIAL ORD GBPO.05	5 384.00	95 862.27	0.02
GBP RIO TINTO ORD GBPO.10	2 502.00	135 974.70	0.03
GBP ROYAL BK SCOT GRP ORD GBP1 (POST CONS)	10 058.00	29 428.68	0.01
GBP RSA INSURANCE GRP ORD GBP1.00	2 174.00	15 505.75	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

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 比率 (%)
GBP SAINSBURY(J) ORD GBPO.28571428	120 440.00	333 856.13	0.07
GBP SCHROEDERS VTG SHS GBP1	291.00	12 417.72	0.00
GBP SMITH & NEPHEW ORD USDO.20	5 150.00	115 311.00	0.02
GBP STANDARD CHARTERED ORD USDO.50	6 757.00	60 954.01	0.01
GBP STD LIFE ABERDEEN ORD GBPO.1396825396	5 146.00	21 093.97	0.01
GBP TAYLOR WIMPEY ORD GBPO.01	6 153.00	13 868.39	0.00
USD TECHNIPFMC PLC COM USD1	34 662.00	653 032.08	0.13
GBP TESCO ORD GBPO.05	19 990.00	59 316.11	0.01
GBP UNILEVER PLC ORD GBPO.031111	15 259.00	903 583.51	0.18
GBP VODAFONE GROUP ORD USDO.2095238(POST CONS)	105 983.00	210 239.71	0.04
イギリス合計		5 624 594.64	1.12

## アメリカ合衆国

USD ABBOTT LABS COM	3 412.00	291 555.40	0.06
USD ABBVIE INC COM USDO.01	4 521.00	396 627.33	0.08
USD ABIOMED INC COM	64.00	12 555.52	0.00
USD ACTIVISION BLIZZAR COM STK USDO.000001	1 470.00	80 600.10	0.02
USD ACUITY BRANDS INC COM STK USDO.01	50.00	6 539.00	0.00
USD ADOBE INC COM USDO.0001	943.00	291 886.79	0.06
USD ADVANCE AUTO PARTS COM USDO.0001	156.00	24 504.48	0.00
USD ADVANCED MICRO DEV COM USDO.01	1 959.00	76 694.85	0.02
USD AES CORP COM	8 871.00	167 750.61	0.03
USD AGILENT TECHNOLOGIES INC COM	551.00	44 504.27	0.01
USD AGNC INV CORP COM USDO.01	40 145.00	695 311.40	0.14
USD AIR PRODS & CHEMS COM USD1	417.00	98 549.61	0.02
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQ INC COM	222.00	36 079.44	0.01
USD ALEXION PHARMACEUT COM USDO.0001	2 582.00	294 193.08	0.06
USD ALLERGAN PLC COM USDO.0001	609.00	112 628.46	0.02
USD ALLSTATE CORP COM	1 735.00	193 192.25	0.04
USD ALLY FINANCIAL INC COM USDO.01	6 222.00	198 108.48	0.04
USD ALPHABET INC CAP STK USDO.001 CL A	907.00	1 182 809.63	0.24
USD ALTRIA GROUP INC COM USDO.333333	3 621.00	179 963.70	0.04
USD AMAZON COM INC COM USDO.01	1 229.00	2 213 183.20	0.44
USD AMER EXPRESS CO COM USDO.20	1 393.00	167 327.16	0.03
USD AMER FINL GP OHIO COM NPV	800.00	87 768.00	0.02
USD AMER INTL GRP COM USD2.50	1 794.00	94 472.04	0.02
USD AMER TOWER CORP COM NEW USDO.01	851.00	182 139.53	0.04
USD AMEREN CORP COM	442.00	32 853.86	0.01
USD AMERIPRISE FINL INC COM	4 969.00	814 270.03	0.16
USD AMERISOURCEBERGEN COM STK USDO.01	2 221.00	195 248.11	0.04
USD AMETEK INC COM USDO.01	421.00	41 683.21	0.01
USD AMGEN INC COM USDO.0001	5 379.00	1 262 558.88	0.25
USD AMPHENOL CORP NEW CL A	560.00	58 240.00	0.01
USD ANALOG DEVICES INC COM	733.00	82 792.35	0.02
USD ANNALY CAPITAL MAN COM USDO.01	2 883.00	26 898.39	0.01
USD ANTHEM INC COM USDO.01	492.00	142 020.72	0.03
USD APACHE CORP COM USDO.625	904.00	20 141.12	0.00
USD APPLE INC COM NPV	18 007.00	4 812 370.75	0.96
USD APPLIED MATLS INC COM	1 830.00	105 957.00	0.02
USD ARAMARK COM USDO.01	369.00	16 103.16	0.00
USD ARCHER DANIELS MIDLAND CO COM	8 224.00	353 056.32	0.07
USD ARCONIC INC COM USD1.00	669.00	20 712.24	0.00
USD ASSURANT INC COM	96.00	12 755.52	0.00
USD AT&T INC COM USD1	13 998.00	523 245.24	0.10
USD ATHENE HOLDING LTD COM USDO.001 CL A	10 318.00	464 516.36	0.09
USD ATMOS ENERGY CORP COM	237.00	25 349.52	0.01
USD AUTO DATA PROCESS COM USDO.10	762.00	130 134.36	0.03

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

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 比率 (%)
USD AUTODESK INC COM USDO.01	436.00	78 872.40	0.02
USD AUTOZONE INC COM USDO.01	49.00	57 718.08	0.01
USD AVALONBAY COMMUNI COM USDO.01	266.00	57 033.06	0.01
USD AVERY DENNISON CORP COM	202.00	26 334.74	0.01
USD AXA EQUITABLE HLD COM USDO.01	828.00	20 484.72	0.00
USD AXALTA COATING SYS COM USD1.00	367.00	10 448.49	0.00
USD BALL CORP COM NPV	630.00	41 617.80	0.01
USD BAXTER INTL INC COM USD1	892.00	73 117.24	0.01
USD BB&T CORP COM USD5	1 482.00	81 095.04	0.02
USD BECTON DICKINSON COM USD1	521.00	134 678.50	0.03
USD BEST BUY CO INC COM USDO.10	4 982.00	401 748.48	0.08
USD BIOGEN INC COM STK USDO.0005	3 098.00	928 811.38	0.19
USD BK OF AMERICA CORP COM USDO.01	17 355.00	578 268.60	0.12
USD BK OF NY MELLON CP COM STK USDO.01	1 658.00	81 192.26	0.02
USD BOEING CO COM USD5	1 025.00	375 334.50	0.07
USD BOOKING HLDGS INC COM USDO.008	415.00	790 172.45	0.16
USD BORG WARNER INC COM	349.00	14 675.45	0.00
USD BRISTOL-MYRS SQUIB COM STK USDO.10	26 428.00	1 504 810.32	0.30
USD BROADCOM CORP COM USD1.00	761.00	240 635.81	0.05
USD BUNGE LIMITED COM USDO.01	213.00	11 369.94	0.00
USD BURLINGTON STORES COM USDO.0001	95.00	21 375.00	0.00
USD CAPITAL ONE FINL COM USDO.01	8 914.00	891 489.14	0.18
USD CARDINAL HEALTH INC COM	617.00	33 953.51	0.01
USD CARMAX INC COM USDO.50	342.00	33 262.92	0.01
USD CARNIVAL CORP COM USDO.01(PAIRED STOCK)	6 744.00	304 019.52	0.06
USD CATERPILLAR INC DEL COM	6 778.00	980 979.94	0.20
USD CBOE GLOBAL MARKET COM USDO.01	222.00	26 395.80	0.01
USD CBRE GROUP INC CLASS 'A' USDO.01	12 871.00	733 904.42	0.15
USD CBS CORP NEW CL B	719.00	29 033.22	0.01
USD CELANESE CORP COM SERIES 'A' USDO.0001	2 965.00	372 315.05	0.07
USD CENTENE CORP DEL COM	2 207.00	133 457.29	0.03
USD CENTERPOINT ENERGY INC COM	1 027.00	25 223.12	0.00
USD CENTURYLINK INC COM	48 561.00	703 648.89	0.14
USD CF INDS HLDGS INC COM	530.00	24 491.30	0.00
USD CH ROBINSON WORLDW COM USDO.1	7 592.00	583 445.20	0.12
USD CHARTER COMMUN INC COM USDO.001 CLASS 'A'	299.00	140 532.99	0.03
USD CHEVRON CORP COM USDO.75	3 633.00	425 533.29	0.08
USD CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC CL A	49.00	39 882.08	0.01
USD CHURCH & DWIGHT INC COM	4 813.00	338 065.12	0.07
USD CIGNA CORP COM USDO.25	721.00	144 142.32	0.03
USD CISCO SYSTEMS COM USDO.001	31 045.00	1 406 648.95	0.28
USD CITIGROUP INC COM USDO.01	4 447.00	334 058.64	0.07
USD CITIZENS FINL GP COM USDO.01	898.00	34 537.08	0.01
USD CITRIX SYSTEMS INC COM USDO.001	6 462.00	728 978.22	0.15
USD COGNIZANT TECHNOLO COM CL 'A' USDO.01	1 003.00	64 302.33	0.01
USD COMCAST CORP COM CLS 'A' USDO.01	8 751.00	386 356.65	0.08
USD COMERICA INC COM	8 708.00	613 130.28	0.12
USD CONAGRA BRANDS IN COM USD5	775.00	22 374.25	0.00
USD CONCHO RES INC COM USDO.001	429.00	31 128.24	0.01
USD CONOCOPHILLIPS COM USDO.01	2 173.00	130 249.62	0.03
USD CONSOLIDATED EDISON INC COM	583.00	50 656.87	0.01
USD CONTINENTAL RES IN COM STK USDO.01	197.00	6 083.36	0.00
USD COOPER COS INC COM USDO.10	86.00	26 925.74	0.01
USD CORNING INC COM USDO.50	1 475.00	42 834.00	0.01
USD CORTEVA INC COM USDO.01	1 468.00	38 197.36	0.01
USD COSTCO WHSL CORP NEW COM	842.00	252 440.02	0.05
USD CROWN CASTLE INTL COM USDO.01	829.00	110 804.14	0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

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 比率 (%)
USD CROWN HOLDINGS INC COM USD5	221.00	16 773.90	0.00
USD CUMMINS INC COM	4 492.00	821 407.12	0.16
USD CVS HEALTH CORP COM STK USD0.01	2 492.00	187 572.84	0.04
USD D R HORTON INC COM	1 918.00	106 161.30	0.02
USD DANAHER CORP COM USD0.01	1 193.00	174 154.14	0.03
USD DARDEN RESTAURANTS INC COM	257.00	30 439.08	0.01
USD DAVITA INC COM USD0.001	186.00	13 349.22	0.00
USD DELL TECHNOLOGIES COM USD0.01 CL C	341.00	16 535.09	0.00
USD DELTA AIRLINES INC COM USD0.0001	12 442.00	713 051.02	0.14
USD DENTSPLY SIRONA IN COM NPV	463.00	26 178.02	0.01
USD DIAMONDBACK ENERGY COM USD0.01	324.00	25 058.16	0.00
USD DISCOVER FINL SVCS COM STK USD0.01	9 311.00	790 224.57	0.16
USD DISH NETWORK CORPO CLASS ' A ' COM USD0.01	580.00	19 818.60	0.00
USD DOCUSIGN INC COM USD0.0001	200.00	14 242.00	0.00
USD DOLLAR GENERAL CP COM USD0.875	494.00	77 735.84	0.02
USD DOLLAR TREE INC	426.00	38 961.96	0.01
USD DOMINOS PIZZA INC COM USD0.01	83.00	24 426.90	0.00
USD DOVER CORP COM	294.00	32 775.12	0.01
USD DOW INC COM USD0.01	1 492.00	79 628.04	0.02
USD DTE ENERGY CO COM	321.00	40 105.74	0.01
USD DUPONT DE NEMOURS COM USD0.01	1 421.00	92 095.01	0.02
USD DXC TECHNOLOGY CO COM USD0.01	11 303.00	421 940.99	0.08
USD E TRADE FINANCIAL COM USD0.01	507.00	22 460.10	0.00
USD EAST WEST BANCORP INC COM	237.00	10 859.34	0.00
USD EASTMAN CHEM CO COM	1 898.00	148 746.26	0.03
USD EATON VANCE CORP COM NON VTG	311.00	14 669.87	0.00
USD EBAY INC COM USD0.001	19 896.00	706 705.92	0.14
USD EDISON INTL COM	675.00	46 642.50	0.01
USD ELANCO ANIMAL HEAL COM NPV	635.00	17 595.85	0.00
USD ELECTRONIC ARTS INC COM	548.00	55 353.48	0.01
USD ELI LILLY AND CO COM NPV	1 669.00	195 857.15	0.04
USD EMERSON ELEC CO COM	1 157.00	85 456.02	0.02
USD ENTERGY CORP NEW COM	393.00	45 741.27	0.01
USD EQUINIX INC COM USD0.001 NEW	153.00	86 728.05	0.02
USD ESTEE LAUDER COS CLASS ' A ' COM USD0.01	893.00	174 554.71	0.03
USD EVERGY INC COM NPV	522.00	33 026.94	0.01
USD EVERSOURCE ENERGY COM USD5	667.00	55 120.88	0.01
USD EXELON CORP COM NPV	1 833.00	81 403.53	0.02
USD EXPEDIA GROUP INC COM USD0.001	260.00	26 431.60	0.01
USD EXTRA SPACE STORAG COM USD0.01	249.00	26 406.45	0.01
USD EXXON MOBIL CORP COM NPV	8 156.00	555 668.28	0.11
USD FACEBOOK INC COM USD0.000006 CL ' A '	5 718.00	1 152 977.52	0.23
USD FED REALTY INV TR SBI USD0.01	163.00	21 527.41	0.00
USD FEDEX CORP COM USD0.10	481.00	76 984.05	0.02
USD FIDELITY NATL INF COM STK USD0.01	1 228.00	169 648.20	0.03
USD FIFTH THIRD BANCORP COM	26 648.00	804 503.12	0.16
USD FIRST REPUBLIC BAN COM USD0.01	269.00	29 563.10	0.01
USD FIRSTENERGY CORP COM USD0.10	951.00	45 353.19	0.01
USD FISERV INC COM USD0.01	1 044.00	121 354.56	0.02
USD FLEETCOR TECHNOLOG COM STK USD0.001	179.00	54 938.68	0.01
USD FORD MOTOR CO COM STK USD0.01	6 724.00	60 919.44	0.01
USD FORTUNE BRANDS HOME USD0.01 WI	344.00	21 761.44	0.00
USD FOX CORP COM USD0.01 CL A	600.00	21 456.00	0.00
USD FOX CORP COM USD0.01 CL B	300.00	10 494.00	0.00
USD FREEPORT-MCMORAN COM STK USD0.10	2 760.00	31 408.80	0.01
USD GENERAL MLS INC COM	7 119.00	379 585.08	0.08
USD GENERAL MOTORS CO COM USD0.01	2 572.00	92 592.00	0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

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 比率 (%)
USD GENUINE PARTS CO COM STK USD1	958.00	99 986.46	0.02
USD GILEAD SCIENCES COM USDO.001	11 399.00	766 468.76	0.15
USD GLOBAL PAYMENTS COM NPV	559.00	101 234.90	0.02
USD GLOBE LIFE INC COM USD1.00	253.00	25 998.28	0.01
USD GODADDY INC COM CL A USDO.001	269.00	17 856.22	0.00
USD GOLDMAN SACHS GRP COM USDO.01	632.00	139 893.20	0.03
USD GRAINGER W W INC COM	93.00	29 476.35	0.01
USD HALLIBURTON COM STK USD2.50	1 583.00	33 227.17	0.01
USD HARTFORD FINL SVCS COM USDO.01	789.00	48 807.54	0.01
USD HASBRO INC COM	262.00	26 645.40	0.01
USD HCA HEALTHCARE INC COM USDO.01	2 417.00	335 141.22	0.07
USD HD SUPPLY INC COM USDO.01	429.00	17 082.78	0.00
USD HEALTHPEAK PPTYS I COM USD1	921.00	32 124.48	0.01
USD HERSHEY COMPANY COM USD1.00	4 425.00	655 608.00	0.13
USD HESS CORPORATION COM USD1	546.00	33 901.14	0.01
USD HEWLETT PACKARD EN COM USDO.01	7 104.00	112 456.32	0.02
USD HILTON WORLDWIDE H COM USDO.01	502.00	52 710.00	0.01
USD HOLLYFRONTIER CORP COM USDO.01	382.00	19 692.10	0.00
USD HOLOGIC INC COM USDO.01	512.00	26 275.84	0.01
USD HOME DEPOT INC COM USDO.05	2 121.00	467 701.71	0.09
USD HORMEL FOODS CORP COM USDO.0586	665.00	29 612.45	0.01
USD HOST HOTELS & RESO COM STK USDO.01	40 819.00	713 924.31	0.14
USD HP INC COM USDO.01	17 243.00	346 239.44	0.07
USD HUMANA INC COM USDO.166	256.00	87 354.88	0.02
USD HUNTINGTON BANCSHARES INC COM	2 134.00	31 775.26	0.01
USD HUNTINGTON INGALLS COM USDO.01	73.00	18 371.91	0.00
USD INGERSOLL-RAND PLC SHS USD1	480.00	62 932.80	0.01
USD INGREDION INC COM USDO.01	186.00	15 469.62	0.00
USD INTEL CORP COM USDO.001	28 508.00	1 654 889.40	0.33
USD INTL BUSINESS MCHN COM USDO.20	1 712.00	230 178.40	0.05
USD INTL PAPER CO COM USD1.00	13 860.00	642 272.40	0.13
USD INTUIT INC COM USDO.01	501.00	129 703.89	0.03
USD INVESCO LTD COM STK USDO.20	525.00	9 219.00	0.00
USD IQVIA HOLDINGS INC COM USDO.01	301.00	43 939.98	0.01
USD IRON MTN INC NEW COM NPV	655.00	21 038.60	0.00
USD JACOBS ENG GROUP COM USD1	301.00	27 719.09	0.01
USD JEFFERIES FINL GRP COM USDO.0001	10 730.00	224 257.00	0.04
USD JOHNSON CTLS INTL COM USDO.01	1 616.00	69 213.28	0.01
USD JONES LANG LASALLE INC COM	65.00	10 811.45	0.00
USD KANSAS CITY STHN I COM USDO.01	223.00	33 989.66	0.01
USD KELLOGG CO COM USDO.25	531.00	34 578.72	0.01
USD KEYCORP NEW COM	1 911.00	37 054.29	0.01
USD KEYSIGHT TECHNOLOG COM USDO.01 'WD'	1 414.00	151 340.42	0.03
USD KIMBERLY-CLARK CP COM USD1.25	661.00	90 120.74	0.02
USD KIMCO REALTY COM USDO.01	686.00	14 831.32	0.00
USD KINDER MORGAN INC USDO.01	3 733.00	73 204.13	0.01
USD KKR & CO INC COM NPV CLASS A	800.00	23 592.00	0.00
USD KLA CORPORATION COM USDO.001	303.00	49 649.58	0.01
USD KNIGHT SWIFT TRANS CL A COM STK USDO.01	238.00	8 803.62	0.00
USD KOHLS CORPORATION COM USDO.01	997.00	46 868.97	0.01
USD KROGER CO COM USD1	1 543.00	42 185.62	0.01
USD L3HARRIS TECHNOLOG COM USD1.00	400.00	80 436.00	0.02
USD LAB CORP AMER HLDG COM USDO.1	183.00	31 529.07	0.01
USD LAM RESEARCH CORP COM USDO.001	274.00	73 111.42	0.01
USD LAS VEGAS SANDS CORP COM	634.00	39 783.50	0.01
USD LEAR CORP COM USDO.01	79.00	9 504.49	0.00
USD LENNAR CORP COM CL 'A' USDO.10	544.00	32 449.60	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

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 比率 (%)
USD LINCOLN NATL CORP COM NPV	320.00	18 896.00	0.00
USD LKQ CORP COM	651.00	22 967.28	0.00
USD LOWE 'S COS INC COM USDO.50	1 528.00	179 249.68	0.04
USD MANPOWER GROUP COM USDO.01	72.00	6 670.08	0.00
USD MARATHON OIL CORP COM USD1	1 853.00	21 587.45	0.00
USD MARATHON PETROLEUM COM USDO.01	1 155.00	70 039.20	0.01
USD MARRIOTT INTL INC COM USDO.01 CLASS 'A'	560.00	78 601.60	0.02
USD MASCO CORP COM	619.00	28 814.45	0.01
USD MASTERCARD INC COM USDO.0001 CLASS 'A'	1 759.00	514 032.57	0.10
USD MCCORMICK & CO INC COM N/VTG NPV	233.00	39 435.25	0.01
USD MCDONALD 'S CORP COM USDO.01	1 473.00	286 469.04	0.06
USD MCKESSON CORP COM USDO.01	341.00	49 322.24	0.01
USD MEDTRONIC PLC USDO.0001	11 196.00	1 247 122.44	0.25
USD MERCK & CO INC COM USDO.50	17 365.00	1 513 880.70	0.30
USD METLIFE INC COM USDO.01	1 595.00	79 606.45	0.02
USD MGM RESORTS INTL COM STK USDO.01	1 028.00	32 844.60	0.01
USD MICROCHIP TECHNLY COM USDO.001	455.00	43 015.70	0.01
USD MICRON TECHNOLOGY COM USDO.10	2 087.00	99 153.37	0.02
USD MICROSOFT CORP COM USDO.0000125	23 052.00	3 489 611.76	0.70
USD MID-AMER APARTMENT COM STK USDO.01	242.00	32 938.62	0.01
USD MIDDLEBY CORP COM USDO.01	71.00	8 218.96	0.00
USD MOHAWK INDS COM USDO.01	129.00	17 978.73	0.00
USD MOLSON COORS BREWI CLASS 'B' USDO.01	300.00	15 144.00	0.00
USD MONDELEZ INTL INC COM USDO.01	2 706.00	142 173.24	0.03
USD MORGAN STANLEY COM STK USDO.01	2 498.00	123 601.04	0.02
USD MOSAIC CO COM USDO.01	635.00	12 096.75	0.00
USD MOTOROLA SOLUTIONS COM USDO.01	297.00	49 688.10	0.01
USD MSCI INC COM STK USDO.01	2 983.00	773 163.77	0.15
USD NATIONAL OILWELL VARCO INC COM	574.00	12 943.70	0.00
USD NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	394.00	21 961.56	0.00
USD NETAPP INC COM USDO.001	4 930.00	298 708.70	0.06
USD NETFLIX INC COM USDO.001	840.00	264 314.40	0.05
USD NEWELL BRANDS INC COM USD1	651.00	12 512.22	0.00
USD NEWMONT GOLDCORP C COM USDO.1.60	1 738.00	66 739.20	0.01
USD NIELSEN HLDGS PLC COM EURO.07	561.00	10 967.55	0.00
USD NIKE INC CLASS 'B' COM NPV	2 416.00	225 871.84	0.04
USD NISOURCE INC COM NPV	596.00	15 764.20	0.00
USD NOBLE ENERGY INC COM USDO.01	1 169.00	24 268.44	0.00
USD NORFOLK STHN CORP COM USD1	516.00	99 846.00	0.02
USD NORTHERN TRUST CP COM USD1.666	383.00	41 072.92	0.01
USD NORTONLIFELOCK INC COM USDO.01	1 276.00	31 772.40	0.01
USD NORWEGIAN CRUISE L COM USDO.001	472.00	25 318.08	0.00
USD NRG ENERGY INC COM USDO.01	17 402.00	691 381.46	0.14
USD NUCOR CORP COM	509.00	28 687.24	0.01
USD NVIDIA CORP COM USDO.001	1 112.00	241 014.88	0.05
USD NVR INC COM STK USDO.01	25.00	94 797.25	0.02
USD OCCIDENTAL PETRLM COM USDO.20	1 565.00	60 362.05	0.01
USD OGE ENERGY CORP COM USDO.01	489.00	20 567.34	0.00
USD OLD DOMINION FGHT LINES INC COM	140.00	26 822.60	0.01
USD OMNICOM GROUP INC COM USDO.15	448.00	35 607.04	0.01
USD ON SEMICONDUCTOR CORP COM	700.00	15 029.00	0.00
USD ONEOK INC	766.00	54 424.30	0.01
USD ORACLE CORP COM USDO.01	20 695.00	1 161 817.30	0.23
USD OREILLY AUTO NEW COM USDO.01	151.00	66 784.28	0.01
USD OWENS CORNING COM STK USDO.01	167.00	11 199.02	0.00
USD PACCAR INC COM STK USD1	4 805.00	390 982.85	0.08
USD PACKAGING CORP AMER COM	155.00	17 344.50	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

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 比率 (%)
USD PALO ALTO NETWORKS COM USDO.0001	177.00	40 217.94	0.01
USD PARKER-HANNIFIN COM STK USDO.50	220.00	43 733.80	0.01
USD PAYCHEX INC COM	575.00	49 519.00	0.01
USD PAYPAL HOLDINGS IN COM USDO.0001	2 157.00	232 977.57	0.05
USD PFIZER INC COM USDO.05	23 360.00	899 827.20	0.18
USD PHILLIPS 66 COM USDO.01	845.00	96 938.40	0.02
USD PINNACLE WEST CAP CORP COM	244.00	21 323.16	0.00
USD PNC FINANCIAL SVCS COM USD5	870.00	133 292.70	0.03
USD PPL CORP COM USDO.01	1 534.00	52 202.02	0.01
USD PRINCIPAL FINL GP COM USDO.01	570.00	31 407.00	0.01
USD PROCTER & GAMBLE COM NPV	4 825.00	588 939.50	0.12
USD PROLOGIS INC COM USDO.01	1 176.00	107 662.80	0.02
USD PRUDENTIAL FINL COM USDO.01	725.00	67 874.50	0.01
USD PUBLIC SVC ENTERPRISE GROUP COM	1 028.00	60 970.68	0.01
USD PVH CORP COM USD1	174.00	16 871.04	0.00
USD QUALCOMM INC COM USDO.0001	11 972.00	1 000 260.60	0.20
USD QUEST DIAGNOSTICS INC COM	262.00	27 916.10	0.01
USD RAYMOND JAMES FINANCIAL INC COM	263.00	23 622.66	0.00
USD RAYTHEON CO COM NEW	511.00	111 101.62	0.02
USD REGENCY CENTERS COM USDO.01	350.00	22 764.00	0.00
USD REGENERON PHARMACE COM USDO.001	164.00	60 516.00	0.01
USD REGIONS FINANCIAL CORP NEW COM	13 396.00	222 909.44	0.04
USD REINSURANCE GROUP COM USDO.01	120.00	19 855.20	0.00
USD REPUBLIC SERVICES COM USDO.01	436.00	38 651.40	0.01
USD ROBERT HALF INTL COM USDO.001	5 205.00	302 931.00	0.06
USD ROCKWELL AUTOMATIO COM USD1	217.00	42 497.28	0.01
USD ROSS STORES INC COM USDO.01	690.00	80 143.50	0.02
USD ROYAL CARIBBEAN COM USDO.01	336.00	40 326.72	0.01
USD SALESFORCE.COM INC COM USDO.001	1 613.00	262 741.57	0.05
USD SBA COMMUNICATIONS COM USDO.01 CL A	196.00	46 348.12	0.01
USD SCHEIN HENRY INC COM	327.00	22 530.30	0.00
USD SCHLUMBERGER COM USDO.01	2 558.00	92 599.60	0.02
USD SCHWAB(CHARLES)CP COM USDO.01	2 293.00	113 503.50	0.02
USD SEALED AIR CORP NEW COM	262.00	9 885.26	0.00
USD SEI INVESTMENT COM USDO.01	177.00	11 421.81	0.00
USD SENSATA TECHNO PLC COM EURO.01	357.00	18 381.93	0.00
USD SERVICENOW INC COM USDO.001	343.00	97 082.72	0.02
USD SIGNATURE BK COM USDO.01	72.00	8 881.92	0.00
USD SIMON PROP GROUP COM USDO.0001	5 398.00	816 231.58	0.16
USD SIRIUS XM HLDGS IN COM USDO.001	2 299.00	16 047.02	0.00
USD SKYWORKS SOLUTIONS INC COM	359.00	35 289.70	0.01
USD SMUCKER(JM)CO COM NPV	249.00	26 167.41	0.01
USD SNAP-ON INC COM USD1	71.00	11 392.66	0.00
USD SOUTHWEST AIRLINES COM USD1	3 113.00	179 433.32	0.04
USD SPIRIT AEROSYSTEMS COM STK USDO.01 CLASS 'A'	235.00	20 442.65	0.00
USD SQUARE INC COM USDO.0000001 CL A	628.00	43 407.36	0.01
USD STANLEY BLACK & DE COM USD2.50	265.00	41 801.10	0.01
USD STARBUCKS CORP COM USDO.001	8 765.00	748 793.95	0.15
USD STATE STREET CORP COM STK USD1	675.00	50 692.50	0.01
USD STEEL DYNAMICS INC COM	485.00	16 359.05	0.00
USD SUNTRUST BKS INC COM	914.00	64 747.76	0.01
USD SYNCHRONY FINANCIA COM USDO.001	21 769.00	814 378.29	0.16
USD SYSCO CORP COM USD1	1 713.00	137 982.15	0.03
USD T ROWE PRICE GROUP COM USDO.20	403.00	49 794.68	0.01
USD T-MOBILE US INC COM USDO.0001	616.00	48 386.80	0.01
USD TAPESTRY INC COM USDO.01	682.00	18 338.98	0.00
USD TARGET CORP COM STK USDO.0833	1 000.00	125 010.00	0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

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 比率 (%)
USD TD AMERITRADE HLDG COM USD0.01	615.00	31 875.45	0.01
USD TELEFLEX INC COM	77.00	27 207.18	0.01
USD TESLA INC COM USD0.001	253.00	83 474.82	0.02
USD TEXAS INSTRUMENTS COM USD1	3 807.00	457 639.47	0.09
USD THERMO FISHER SCIE COM USD1	765.00	240 171.75	0.05
USD TIFFANY & CO NEW COM	211.00	28 231.80	0.01
USD TJX COS INC COM USD1	2 408.00	147 201.04	0.03
USD TRACTOR SUPPLY CO COM USD0.008	252.00	23 798.88	0.00
USD TRANSDIGM GROUP INC COM	85.00	48 203.50	0.01
USD TRAVELERS CO INC COM NPV	527.00	72 051.44	0.01
USD TWITTER INC COM USD0.000005	1 387.00	42 872.17	0.01
USD TYSON FOODS INC CL A	545.00	48 990.05	0.01
USD UBER TECHNOLOGIES COM USD0.00001	300.00	8 880.00	0.00
USD UGI CORP NEW COM	422.00	18 378.10	0.00
USD ULTA BEAUTY INC COM STK USD0.01	118.00	27 595.48	0.01
USD UNION PACIFIC CORP COM USD2.50	1 366.00	240 402.34	0.05
USD UNITED AIRLINES HO COM USD0.01	4 848.00	449 894.40	0.09
USD UNITED RENTALS INC COM	163.00	24 947.15	0.00
USD UNITEDHEALTH GRP COM USD0.01	1 819.00	509 083.53	0.10
USD UNIVERSAL HEALTH S CLASS ' B ' COM USD0.01	167.00	23 294.83	0.00
USD UNUM GROUP COM USD0.10	334.00	10 267.16	0.00
USD US BANCORP COM USD0.01	2 943.00	176 668.29	0.04
USD VAIL RESORTS INC COM	57.00	13 832.19	0.00
USD VALERO ENERGY CORP NEW COM	3 122.00	298 119.78	0.06
USD VARIAN MEDICAL SYS COM USD1	199.00	26 612.27	0.01
USD VEREIT INC COM USD0.001	1 844.00	17 997.44	0.00
USD VERIZON COMMUN COM USD0.10	7 940.00	478 305.60	0.10
USD VF CORP COM NPV	601.00	53 212.54	0.01
USD VIACOM INC NEW CL ' B ' NON-VTG USD0.001	19 496.00	469 268.72	0.09
USD VISA INC COM STK USD0.0001	3 366.00	621 060.66	0.12
USD VISTRA ENERGY CORP COM USD0.01	12 544.00	332 792.32	0.07
USD VOYA FINL INC COM USD0.01	3 500.00	203 980.00	0.04
USD WABCO HOLDINGS INC COM STK USD0.01	126.00	16 978.50	0.00
USD WALGREENS BOOTS AL COM USD0.01	1 476.00	87 969.60	0.02
USD WALMART INC COM USD0.10	2 758.00	328 450.22	0.07
USD WALT DISNEY CO. DISNEY COM USD0.01	3 471.00	526 134.18	0.10
USD WASTE MGMT INC DEL COM	787.00	88 860.17	0.02
USD WELLS FARGO & CO COM USD1 2/3	12 624.00	687 503.04	0.14
USD WELLTOWER INC COM USD1	866.00	73 237.62	0.01
USD WESTERN DIGITAL CORP COM	591.00	29 745.03	0.01
USD WESTLAKE CHEM CORP COM USD0.01	106.00	7 280.08	0.00
USD WESTROCK CO COM USD0.01	646.00	26 053.18	0.01
USD WEYERHAEUSER CO COM USD1.25	1 466.00	43 261.66	0.01
USD WHIRLPOOL CORP COM	80.00	11 448.00	0.00
USD WILLIAMS COS INC COM USD1	2 528.00	57 436.16	0.01
USD WORKDAY INC COM USD0.001 CL A	326.00	58 393.12	0.01
USD WYNN RESORTS LTD COM	195.00	23 565.75	0.00
USD XEROX HLDGS CORP COM USD1.00	18 089.00	704 204.77	0.14
USD XILINX INC COM USD0.01	479.00	44 441.62	0.01
USD XPO LOGISTICS INC COM USD0.001	163.00	13 478.47	0.00
USD XYLEM INC COM USD0.01 WI	368.00	28 523.68	0.01
USD YUM BRANDS INC COM	7 188.00	723 615.96	0.14
USD ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC COM USD0.01	421.00	61 162.88	0.01
USD ZIONS BANCORPORATI COM USD0.001	418.00	20 808.04	0.00
アメリカ合衆国合計		79 943 894.22	15.93
記名株式合計		110 051 910.16	21.93

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

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 比率 (%)
<b>預託証券</b>			
アイルランド			
AUD JAMES HARDIE ID PLC CUF5 EURO.5	2 460.00	48 187.82	0.01
アイルランド合計		48 187.82	0.01
ルクセンブルグ			
EUR SES S.A. FDR EACH REP 1 'A' NPV	1 101.00	14 622.19	0.00
ルクセンブルグ合計		14 622.19	0.00
オランダ			
EUR ABN AMRO BANK N.V. DR EACH REP SHS	1 461.00	24 952.82	0.01
オランダ合計		24 952.82	0.01
預託証券合計		87 762.83	0.02
<b>投資信託、クローズド・エンド型</b>			
イギリス			
GBP SEGRO PLC REIT	1 994.00	23 058.40	0.01
イギリス合計		23 058.40	0.01
アメリカ合衆国			
USD DUKE REALTY CORP REIT	796.00	28 003.28	0.01
USD LIBERTY PPTY TST SBI USDO.001	353.00	21 751.86	0.00
USD SL GREEN REALTY CORPORATION	121.00	10 324.93	0.00
USD VENTAS INC REIT	11 405.00	665 025.55	0.13
アメリカ合衆国合計		725 105.62	0.14
投資信託、クローズド・エンド型合計		748 164.02	0.15
<b>新株引受権</b>			
アメリカ合衆国			
USD BRISTOL-MYERS SQUIBB CO CVR RIGHTS 31.12.20	8 825.00	18 973.75	0.00
USD DISH NETWORK CORP RIGHTS 09.12.19	31.39	21.35	0.00
アメリカ合衆国合計		18 995.10	0.00
新株引受権合計		18 995.10	0.00
<b>財務省証券(T-note)、固定利付債</b>			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.00000% 18-30.09.25	1 800 000.00	1 930 078.08	0.38
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.12500% 18-15.11.28	2 300 000.00	2 557 402.20	0.51
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.00000% 16-15.11.26	1 500 000.00	1 527 070.20	0.30
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 17-15.02.27	1 750 000.00	1 811 728.45	0.36
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.50000% 14-15.05.24	1 550 000.00	1 607 640.63	0.32
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.37500% 17-15.05.27	1 900 000.00	1 985 574.10	0.40
米ドル合計		11 419 493.66	2.27
財務省証券(T-note)、固定利付債合計		11 419 493.66	2.27
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある証券および短期金融商品合計		178 375 006.06	35.54

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

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 比率 (%)
<b>他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券および短期金融商品</b>			
<b>財務省短期証券(T-bills)、ゼロ・クーポン</b>			
<b>米ドル</b>			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 31.01.19-30.01.20	5 000 000.00	4 987 058.25	0.99
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 28.02.19-27.02.20	3 000 000.00	2 988 726.24	0.60
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 25.04.19-23.04.20	3 500 000.00	3 478 294.30	0.69
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 20.06.19-18.06.20	100 000.00	99 135.82	0.02
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 13.06.19-12.12.19	100 000.00	99 956.17	0.02
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 22.08.19-20.02.20	400 000.00	398 615.56	0.08
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 12.09.19-12.03.20	100 000.00	99 562.33	0.02
<b>米ドル合計</b>		<b>12 151 348.67</b>	<b>2.42</b>
<b>財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン合計</b>		<b>12 151 348.67</b>	<b>2.42</b>
<b>他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券および短期金融商品合計</b>		<b>12 151 348.67</b>	<b>2.42</b>
<b>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取引されていない譲渡性のある証券および短期金融商品</b>			
<b>優先株式</b>			
<b>イギリス</b>			
GBP ROLLS ROYCE HLDGS NON CUM RED PREF GBPO.001 C	148 028.00	191.48	0.00
<b>イギリス合計</b>		<b>191.48</b>	<b>0.00</b>
<b>優先株式合計</b>		<b>191.48</b>	<b>0.00</b>
<b>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取引されていない譲渡性のある証券および短期金融商品合計</b>		<b>191.48</b>	<b>0.00</b>
<b>ルクセンブルグ2010年12月17日法(改訂済)の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs</b>			
<b>投資信託、オープン・エンド型</b>			
<b>アイルランド</b>			
USD NEUBERGER BERMAN EUROPE LTD-STRATEGIC INC FD-I-ACC	2 005 000.00	24 420 900.00	4.87
USD PIMCO GIS DIVERSIFIED INCOME FUND-INSTITUTIONAL CLASS-USD-ACC	2 931 000.00	75 824 970.00	15.11
<b>アイルランド合計</b>		<b>100 245 870.00</b>	<b>19.98</b>
<b>ルクセンブルグ</b>			
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD U-X-ACC	1 746.00	34 531 008.66	6.88
USD UBS (LUX) BOND SICAV - ASIAN HIGH YIELD U-X-ACC	982.00	11 451 720.66	2.28
USD UBS (LUX) BOND SICAV - SHORT DURATION H Y SUST (USD) I-X-ACC	213 979.00	26 043 384.09	5.19
USD UBS (LUX) BOND SICAV - ASIAN INVST GRADE BONDS (USD)-U-X-CAP	476.00	5 627 600.44	1.12
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD INVEST GRADE CORP USD U X ACC	1 013.00	11 578 083.50	2.31
USD UBS (LUX) EMERGING ECONOMIES FUND - GLOBAL BONDS (USD)-U-X ACC	3 036.00	41 386 084.08	8.25
USD UBS (LUX) INSTITUTIONAL SICAV - E MARKETS EQUITY PASS FA USD	1 905.71	24 639 101.56	4.91
USD UBS (LUX) SICAV 1 - MEDIUM TERM USD CORP BDS (USD) U-X-ACC	2 394.97	24 460 064.58	4.87
USD UBS LUX BOND SICAV - EMERGING ECONOMIES CORP USD-I-X-ACC	145 740.00	17 174 001.60	3.42
<b>ルクセンブルグ合計</b>		<b>196 891 049.17</b>	<b>39.23</b>
<b>投資信託、オープン・エンド型合計</b>		<b>297 136 919.17</b>	<b>59.21</b>
<b>ルクセンブルグ2010年12月17日法(改訂済)の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs合計</b>		<b>297 136 919.17</b>	<b>59.21</b>

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

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 比率 (%)
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取引されていない派生商品			
指数に係るオプション、従来型			
豪ドル			
AUD MORGAN STANLEY/S&P/ASX 200 INDEX CALL 6845.29450 03.12.19	-490.00	-7 400.63	0.00
AUD GOLDMAN SACHS/S&P/ASX 200 INDEX CALL 6935.35500 17.12.19	-490.00	-7 432.62	0.00
豪ドル合計		-14 833.25	0.00
ユーロ			
EUR GOLDMAN SACHS/EURO STOXX 50 CALL 3764.75650 03.12.19	-3 130.00	-252.53	0.00
EUR HSBC/EURO STOXX 50 CALL 3785.27740 17.12.19	-3 340.00	-17 989.13	-0.01
ユーロ合計		-18 241.66	-0.01
英ポンド			
GBP GOLDMAN SACHS/FTSE 100 INDEX CALL 7550.61780 03.12.19	-390.00	-15.15	0.00
GBP UBS/FTSE 100 INDEX CALL 7499.57120 17.12.19	-430.00	-9 882.28	0.00
英ポンド合計		-9 897.43	0.00
日本円			
JPY GOLDMAN SACHS/TOPIX INDEX (TOKYO) CALL 1747.79690 03.12.19	-362 000.00	-7.23	0.00
JPY GOLDMAN SACHS/TOPIX INDEX (TOKYO) CALL 1733.50840 17.12.19	-377 670.00	-13 887.15	0.00
日本円合計		-13 894.38	0.00
米ドル			
USD GOLDMAN SACHS/S&P 500 INDEX CALL 3148.41090 03.12.19	-7 210.00	-32 787.39	-0.01
USD MORGAN STANLEY/MSCI EM INDEX CALL 1113.34950 03.12.19	-10 470.00	0.00	0.00
USD GOLDMAN SACHS/S&P 500 INDEX CALL 3166.04420 10.12.19	-8 300.00	-53 956.93	-0.01
USD BNP/S&P 500 INDEX CALL 3195.06430 17.12.19	-7 680.00	-38 831.09	-0.01
USD BNP/MSCI EM INDEX CALL 1092.91370 17.12.19	-11 060.00	-6 291.66	0.00
米ドル合計		-131 867.07	-0.03
指数に係るオプション、従来型合計		-188 733.79	-0.04
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取引されていない 派生商品合計		-188 733.79	-0.04
投資有価証券合計		487 474 731.59	97.13

## 派生商品

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取引されていない派生商品

## 指数に係るスワップおよび先渡スワップ

USD UBS/FTSE EEPRA NAREIT DVLPD TR EQS REC PERF 19-31.01.20	20 619 274.90	-19 287.52	0.00
USD UBS/FTSE EEPRA NAREIT DVLPD TR EQS PAYER 3ML 19-31.01.20			
指数に係るスワップおよび先渡スワップ合計		-19 287.52	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取引されていない 派生商品合計		-19 287.52	0.00
派生商品合計		-19 287.52	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

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 比率 (%)
先渡為替契約			
先渡為替契約(購入/売却)			
USD	166 339.20	EUR 150 000.00 9.1.2020	443.41 0.00
USD	2 992 896.60	AUD 4 413 000.00 9.1.2020	4 636.94 0.00
USD	1 650 167.96	HKD 12 935 000.00 9.1.2020	-1 574.56 0.00
USD	4 823 529.75	GBP 3 802 938.85 9.1.2020	-103 868.34 -0.02
USD	3 631 719.66	JPY 390 943 000.00 9.1.2020	49 972.16 0.01
USD	253 471.15	SEK 2 480 000.00 9.1.2020	-6 298.32 0.00
USD	405 476.79	SGD 555 000.00 9.1.2020	-539.81 0.00
USD	504 974.47	CAD 667 500.00 9.1.2020	2 240.87 0.00
USD	15 292 149.63	EUR 13 804 843.41 9.1.2020	24 380.27 0.01
USD	133 233.74	CHF 132 000.00 9.1.2020	681.42 0.00
USD	129 550.94	JPY 14 000 000.00 9.1.2020	1 285.53 0.00
USD	37 675.88	AUD 55 000.00 9.1.2020	432.67 0.00
EUR	200 000.00	USD 223 813.40 9.1.2020	-2 619.01 0.00
USD	312 223.52	EUR 280 000.00 9.1.2020	2 551.38 0.00
USD	126 974.75	AUD 185 000.00 9.1.2020	1 702.14 0.00
USD	204 117.22	HKD 1 600 000.00 9.1.2020	-195.73 0.00
JPY	10 000 000.00	USD 92 892.95 9.1.2020	-1 274.80 0.00
HKD	1 150 000.00	USD 146 726.91 9.1.2020	123.02 0.00
USD	173 576.44	EUR 155 000.00 9.1.2020	2 150.79 0.00
SGD	77 989 800.00	USD 57 482 638.71 5.12.2019	-448 578.35 -0.09
USD	409 409.48	SGD 555 000.00 15.1.2020	3 365.00 0.00
USD	4 951 071.17	GBP 3 832 938.00 15.1.2020	-15 992.96 0.00
USD	508 840.87	CAD 667 500.00 15.1.2020	6 099.94 0.00
USD	3 234 424.67	AUD 4 663 000.00 15.1.2020	76 429.10 0.02
USD	1 708 406.15	HKD 13 385 000.00 15.1.2020	-765.38 0.00
USD	259 647.31	SEK 2 480 000.00 15.1.2020	-194.17 0.00
USD	3 644 569.09	JPY 394 943 000.00 15.1.2020	25 058.53 0.00
USD	133 985.67	CHF 132 000.00 15.1.2020	1 379.49 0.00
USD	15 914 017.19	EUR 14 229 844.00 15.1.2020	170 493.64 0.03
USD	250 508.48	EUR 225 000.00 9.1.2020	1 664.79 0.00
USD	90 409.97	GBP 70 000.00 9.1.2020	-287.75 0.00
USD	250 601.40	EUR 225 000.00 15.1.2020	1 667.34 0.00
USD	90 423.90	GBP 70 000.00 15.1.2020	-288.37 0.00
USD	166 589.85	EUR 150 000.00 15.1.2020	633.81 0.00
USD	166 527.60	EUR 150 000.00 9.1.2020	631.81 0.00
USD	114 996.25	JPY 12 500 000.00 9.1.2020	473.56 0.00
USD	115 035.30	JPY 12 500 000.00 15.1.2020	477.30 0.00
USD	25 253.19	CHF 25 000.00 9.1.2020	148.58 0.00
USD	41 329.21	SEK 400 000.00 9.1.2020	-569.09 0.00
USD	25 263.86	CHF 25 000.00 15.1.2020	149.05 0.00
USD	41 341.17	SEK 400 000.00 15.1.2020	-568.75 0.00
JPY	16 000 000.00	USD 147 253.72 9.1.2020	-664.68 0.00
USD	102 896.85	AUD 150 000.00 15.1.2020	1 310.03 0.00
USD	102 882.30	AUD 150 000.00 9.1.2020	1 309.91 0.00
USD	191 498.42	HKD 1 500 000.00 9.1.2020	-44.97 0.00
USD	68 131.03	CAD 90 000.00 15.1.2020	345.74 0.00
USD	73 522.11	SGD 100 000.00 9.1.2020	365.97 0.00
JPY	16 000 000.00	USD 147 303.07 15.1.2020	-668.82 0.00
USD	191 459.38	HKD 1 500 000.00 15.1.2020	-80.20 0.00
USD	73 527.47	SGD 100 000.00 15.1.2020	366.30 0.00
USD	68 129.74	CAD 90 000.00 9.1.2020	345.43 0.00
USD	1 096 880.40	EUR 990 000.00 9.1.2020	1 968.19 0.00
USD	1 097 292.24	EUR 990 000.00 15.1.2020	1 982.39 0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)

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 比率 (%)
先渡為替契約 (続き)			
先渡為替契約 (購入 / 売却)			
USD	251 545.52	GBP 195 000.00 9.1.2020	-1 112.40 0.00
USD	251 587.25	GBP 195 000.00 15.1.2020	-1 111.20 0.00
USD	192 750.00	GBP 150 000.00 15.1.2020	-1 633.43 0.00
USD	143 925.81	AUD 210 000.00 15.1.2020	1 704.26 0.00
USD	143 905.44	AUD 210 000.00 9.1.2020	1 704.10 0.00
USD	285 023.14	JPY 31 000 000.00 9.1.2020	1 006.87 0.00
USD	192 718.05	GBP 150 000.00 9.1.2020	-1 634.20 0.00
USD	285 121.71	JPY 31 000 000.00 15.1.2020	1 017.86 0.00
USD	143 987.87	EUR 130 000.00 15.1.2020	159.30 0.00
USD	143 934.18	EUR 130 000.00 9.1.2020	157.83 0.00
SGD	1 097 400.00	USD 805 926.28 5.12.2019	-3 395.98 0.00
USD	261 294.62	EUR 235 000.00 9.1.2020	1 391.22 0.00
USD	261 394.50	EUR 235 000.00 15.1.2020	1 396.71 0.00
USD	4 615.36	JPY 500 000.00 9.1.2020	34.45 0.00
USD	4 616.90	JPY 500 000.00 15.1.2020	34.58 0.00
SGD	573 700.00	USD 421 347.80 5.12.2019	-1 800.11 0.00
USD	116 712.65	EUR 105 000.00 15.1.2020	543.42 0.00
USD	116 669.39	EUR 105 000.00 9.1.2020	542.34 0.00
USD	200 893.53	AUD 295 000.00 9.1.2020	1 134.50 0.00
JPY	11 000 000.00	USD 101 673.08 15.1.2020	-862.04 0.00
JPY	11 000 000.00	USD 101 639.54 9.1.2020	-859.57 0.00
USD	200 922.44	AUD 295 000.00 15.1.2020	1 135.03 0.00
USD	46 172.95	JPY 5 000 000.00 9.1.2020	363.87 0.00
USD	46 188.31	JPY 5 000 000.00 15.1.2020	365.11 0.00
SGD	8 077 700.00	USD 5 918 353.29 5.12.2019	-11 118.89 0.00
USD	342 448.94	EUR 310 000.00 9.1.2020	-402.36 0.00
USD	31 908.05	HKD 250 000.00 15.1.2020	-15.21 0.00
USD	31 909.47	HKD 250 000.00 9.1.2020	-14.43 0.00
USD	342 577.28	EUR 310 000.00 15.1.2020	-398.53 0.00
USD	137 848.39	JPY 15 000 000.00 9.1.2020	421.16 0.00
USD	137 895.40	JPY 15 000 000.00 15.1.2020	425.79 0.00
SGD	394 400.00	USD 288 880.38 5.12.2019	-455.06 0.00
USD	63 830.17	HKD 500 000.00 15.1.2020	-16.36 0.00
USD	63 831.90	HKD 500 000.00 9.1.2020	-15.90 0.00
JPY	275 000 000.00	USD 2 510 991.29 4.12.2019	481.20 0.00
JPY	138 500 000.00	USD 1 268 833.24 15.1.2020	469.45 0.00
GBP	3 800 000.00	USD 4 921 934.80 9.1.2020	1 655.48 0.00
JPY	138 500 000.00	USD 1 268 411.43 9.1.2020	499.97 0.00
GBP	3 800 000.00	USD 4 922 740.40 15.1.2020	1 639.72 0.00
先渡為替契約 (購入 / 売却) 合計			-204 369.01 -0.04
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産			7 605 333.44* 1.52
その他の資産および負債			7 009 734.95 1.39
純資産総額			501 866 143.45 100.00

\* 2019年11月30日現在、当該金額のうち80,000米ドルについて、取引相手方であるユービーエス・エイ・ジーの担保となっている。

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - フィクスト・インカム (米ドル)

## 2019年11月30日現在の投資有価証券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 比率 (%)
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある証券および短期金融商品			
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD ABU DHABI, GOVERNMENT OF-REG-S 3.12500% 17-11.10.27	600 000.00	627 750.00	0.39
USD ALPHABET INC 1.99800% 16-15.08.26	650 000.00	648 074.26	0.40
USD AMERICAN EXPRESS CO 3.40000% 18-27.02.23	430 000.00	446 624.88	0.28
USD APPLE INC 2.25000% 16-23.02.21	675 000.00	678 427.31	0.42
USD APPLE INC 2.40000% 13-03.05.23	400 000.00	406 100.24	0.25
USD APPLE INC 2.45000% 16-04.08.26	500 000.00	507 752.40	0.32
USD APPLE INC 2.90000% 17-12.09.27	1 125 000.00	1 173 679.08	0.73
USD APPLE INC 3.45000% 14-06.05.24	1 200 000.00	1 274 264.40	0.79
USD BAYER US FINANCE II LLC-REG-S 3.87500% 18-15.12.23	400 000.00	419 684.12	0.26
USD BERKSHIRE HATHAWAY INC 2.75000% 16-15.03.23	700 000.00	718 856.04	0.45
USD CHEVRON CORP 2.95400% 16-16.05.26	1 200 000.00	1 261 887.96	0.78
USD EQUINOR ASA 3.62500% 18-10.09.28	80 000.00	88 117.31	0.05
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.00000% 16-15.03.21	1 250 000.00	1 254 088.50	0.78
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.37500% 17-24.05.27	300 000.00	312 080.97	0.19
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.62500% 19-20.05.22	800 000.00	818 355.52	0.51
USD EXXON MOBIL CORP 2.72600% 16-01.03.23	1 000 000.00	1 025 295.00	0.64
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.25000% 19-18.06.29	200 000.00	206 700.54	0.13
USD INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 2.85000% 19-13.05.22	475 000.00	484 085.18	0.30
USD JOHNSON & JOHNSON 3.37500% 13-05.12.23	550 000.00	583 817.13	0.36
USD KOREA DEVELOPMENT BANK 4.62500% 11-16.11.21	1 000 000.00	1 050 312.50	0.65
USD KOREA HYDRO&NUCLEAR POWER CO LTD-REG-S 3.12500% 17-25.07.27	800 000.00	832 500.00	0.52
USD KOREA RESOURCES CORP-REG-S 3.00000% 17-24.04.22	400 000.00	404 625.00	0.25
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.12500% 13-17.01.23	1 270 000.00	1 287 505.55	0.80
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 1.62500% 16-15.03.21	1 550 000.00	1 548 309.99	0.96
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.87500% 18-03.04.28	150 000.00	162 309.69	0.10
USD KUWAIT INTERNATIONAL GOVT BOND-REG-S 3.50000% 17-20.03.27	1 600 000.00	1 716 500.00	1.07
USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 2.00000% 15-13.01.25	850 000.00	861 019.83	0.54
USD MICROSOFT CORP 3.30000% 17-06.02.27	950 000.00	1 022 994.48	0.64
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 3.10000% 17-17.05.27	475 000.00	502 368.79	0.31
USD ONTARIO, PROVINCE OF 2.00000% 19-02.10.29	175 000.00	173 637.28	0.11
USD PROCTER & GAMBLE CO 1.85000% 16-02.02.21	425 000.00	425 394.91	0.26
USD QATAR, STATE OF-REG-S 2.37500% 16-02.06.21	1 150 000.00	1 154 312.50	0.72
USD QUEBEC, PROVINCE OF 3.50000% 10-29.07.20	625 000.00	631 436.68	0.39
USD QUEBEC, PROVINCE OF 2.50000% 16-20.04.26	700 000.00	722 260.07	0.45
USD ROCHE HOLDINGS INC-REG-S 3.62500% 18-17.09.28	1 000 000.00	1 110 630.50	0.69
USD SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 2.25000% 12-06.01.23	660 000.00	664 558.03	0.41
USD SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 2.87500% 16-10.05.26	700 000.00	725 227.09	0.45
USD TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.70000% 13-15.01.24	375 000.00	398 589.90	0.25
USD WALMART INC 3.05000% 19-08.07.26	250 000.00	263 525.07	0.16
USD WALMART INC 3.12500% 18-23.06.21	275 000.00	280 707.68	0.17
USD WELLS FARGO CO 3.50000% 12-08.03.22	900 000.00	927 854.10	0.58
USD WESTPAC BANKING CORP 2.85000% 16-13.05.26	1 175 000.00	1 200 168.50	0.75
米ドル合計		31 002 388.98	19.26
ノート、固定利付債合計		31 002 388.98	19.26

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - フィクスト・インカム (米ドル)

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 比率 (%)
<b>ノート、変動利付債</b>			
米ドル			
USD CITIGROUP INC 3M LIBOR+143BP 16-01.09.23	165 000.00	168 470.63	0.10
米ドル合計		168 470.63	0.10
<b>ノート、変動利付債合計</b>		168 470.63	0.10
<b>中期債券、固定利付債</b>			
米ドル			
USD ASB FINANCE LTD-REG-S 2.12500% 16-01.09.21	400 000.00	399 960.00	0.25
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.00000% 15-22.01.25	325 000.00	329 953.72	0.20
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.62500% 17-12.01.27	675 000.00	711 470.52	0.44
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.00000% 17-16.02.22	440 000.00	443 071.20	0.28
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.75000% 18-19.01.28	1 000 000.00	1 069 403.90	0.66
USD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GRP/NY 2.30000% 16-01.06.21	1 250 000.00	1 253 312.50	0.78
USD BANK OF AMERICA CORP 3.24800% 16-21.10.27	225 000.00	234 580.50	0.15
USD CAISSE D' AMOR DE LA DETTE SOCIALE-REG-S 3.37500% 14-20.03.24	925 000.00	984 928.90	0.61
USD CPPIB CAPITAL INC-REG-S 2.75000% 17-02.11.27	350 000.00	369 087.07	0.23
USD IDB TRUST SERVICES LTD-REG-S 2.26100% 17-26.09.22	1 000 000.00	1 002 000.00	0.62
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 1.62500% 17-12.05.20	300 000.00	299 859.16	0.19
USD JAPAN TOBACCO INC-REG-S 2.80000% 16-13.04.26	400 000.00	403 672.00	0.25
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 3.00000% 17-19.04.24	275 000.00	281 617.18	0.17
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 2.37500% 17-18.01.22	1 000 000.00	1 009 797.60	0.63
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 3.12500% 18-22.03.23	200 000.00	207 312.00	0.13
USD NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CORP-REG-S 2.60000% 17-28.09.22	75 000.00	75 404.60	0.05
USD SP POWERASSETS LTD-REG-S 3.25000% 15-24.11.25	800 000.00	840 656.00	0.52
USD SUMITOMO MITSUI BANKING CORP-REG-S 2.44000% 19-18.06.24	279 000.00	283 879.96	0.18
USD SVENSK EXPORTKREDIT AB 1.75000% 16-10.03.21	400 000.00	399 831.42	0.25
USD TORONTO-DOMINION BANK 2.50000% 15-14.12.20	1 010 000.00	1 016 221.50	0.63
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 2.60000% 17-11.01.22	700 000.00	710 061.03	0.44
米ドル合計		12 326 080.76	7.66
<b>中期債券、固定利付債合計</b>		12 326 080.76	7.66
<b>債券、固定利付債</b>			
米ドル			
USD BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN NV-REG-S 2.62500% 14-28.04.21	1 520 000.00	1 537 362.96	0.95
USD BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN NV-REG-S 2.37500% 16-16.03.26	250 000.00	257 449.00	0.16
USD BANK OF NOVA SCOTIA 1.85000% 15-14.04.20	900 000.00	899 599.64	0.56
USD BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 2.25000% 16-02.06.26	600 000.00	612 691.44	0.38
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 3.25000% 14-29.01.24	225 000.00	238 925.97	0.15
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.87500% 15-10.02.25	250 000.00	252 594.78	0.16
USD FANNIE MAE 1.62500% 15-21.01.20	515 000.00	514 993.29	0.32
USD ING BANK NV-REG-S 2.62500% 12-05.12.22	950 000.00	969 950.00	0.60
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 3.87500% 10-14.02.20	800 000.00	802 981.60	0.50
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 3.00000% 14-21.02.24	750 000.00	788 794.58	0.49
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.12500% 15-15.01.25	250 000.00	254 652.70	0.16
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 7.62500% 93-19.01.23	875 000.00	1 030 221.50	0.64
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT 2.50000% 15-29.07.25	1 100 000.00	1 145 741.41	0.71
USD KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 3.25000% 14-10.07.24	1 025 000.00	1 066 960.94	0.66
USD KOREA, REPUBLIC OF 3.87500% 13-11.09.23	200 000.00	213 875.00	0.13
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.50000% 14-20.11.24	200 000.00	207 601.35	0.13
USD MICROSOFT CORP 2.40000% 16-08.08.26	1 400 000.00	1 424 774.26	0.88

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - フィクスト・インカム (米ドル)

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 比率 (%)
USD MORGAN STANLEY 5.50000% 10-24.07.20	1 000 000.00	1 022 585.30	0.64
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 3.40000% 14-06.05.24	500 000.00	528 717.65	0.33
USD OESTERREICHISCHE KONTROLLBANK AG 2.37500% 14-01.10.21	50 000.00	50 563.61	0.03
USD ONTARIO, PROVINCE OF 3.20000% 14-16.05.24	1 000 000.00	1 057 980.00	0.66
USD ONTARIO, PROVINCE OF 2.50000% 16-27.04.26	1 200 000.00	1 237 218.36	0.77
USD SWEDBANK HYPOTEK AB-REG-S 2.00000% 15-12.05.20	650 000.00	649 720.50	0.40
<b>米ドル合計</b>		<b>16 765 955.84</b>	<b>10.41</b>
<b>債券、固定利付債合計</b>		<b>16 765 955.84</b>	<b>10.41</b>
<b>財務省証券 (T-note)、固定利付債</b>			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 15-31.01.22	365 000.00	364 073.25	0.23
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.62500% 10-15.11.20	1 100 000.00	1 109 581.99	0.69
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.12500% 16-31.07.21	3 000 000.00	2 973 164.07	1.85
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.37500% 16-30.09.23	6 290 000.00	6 233 979.69	3.87
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 17-15.02.27	1 905 000.00	1 972 195.82	1.23
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.50000% 13-15.08.23	1 520 000.00	1 568 034.28	0.97
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 17-15.05.20	5 000.00	4 996.29	0.00
<b>米ドル合計</b>		<b>14 226 025.39</b>	<b>8.84</b>
<b>財務省証券 (T-note)、固定利付債合計</b>		<b>14 226 025.39</b>	<b>8.84</b>
<b>財務省証券 (T-note)、変動利付債</b>			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.875%/CPI LINKED 99-15.04.29	350 000.00	729 738.03	0.45
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.375%/CPI LINKED 04-15.01.25	360 000.00	543 954.08	0.34
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.500%/CPI LINKED 18-15.01.28	550 000.00	585 949.27	0.36
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.625%/CPI LINKED 16-15.01.26	450 000.00	498 742.94	0.31
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.125%/CPI LINKED 11-15.01.21	250 000.00	295 378.53	0.18
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 12-15.01.22	300 000.00	338 316.75	0.21
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 13-15.01.23	400 000.00	442 272.54	0.28
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI LINKED 17-15.01.27	400 000.00	430 156.81	0.27
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI LINKED 15-15.07.25	450 000.00	493 616.18	0.31
<b>米ドル合計</b>		<b>4 358 125.13</b>	<b>2.71</b>
<b>財務省証券 (T-note)、変動利付債合計</b>		<b>4 358 125.13</b>	<b>2.71</b>
<b>公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある証券および短期金融商品合計</b>		<b>78 847 046.73</b>	<b>48.98</b>
<b>他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券および短期金融商品</b>			
<b>ノート、固定利付債</b>			
米ドル			
USD HSBC HOLDINGS PLC 4.87500% 11-14.01.22	800 000.00	844 948.40	0.52
USD JPMORGAN CHASE & CO 4.25000% 10-15.10.20	200 000.00	203 931.32	0.13
USD NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 1.95000% 17-28.09.20	500 000.00	500 303.05	0.31
USD SANOFI 4.00000% 11-29.03.21	600 000.00	617 112.00	0.38
USD SCENTRE GROUP TRUST 1 / 2-REG-S 3.75000% 17-23.03.27	225 000.00	236 958.75	0.15
USD WESTPAC BANKING CORP 2.65000% 18-25.01.21	500 000.00	503 020.00	0.31
<b>米ドル合計</b>		<b>2 906 273.52</b>	<b>1.80</b>
<b>ノート、固定利付債合計</b>		<b>2 906 273.52</b>	<b>1.80</b>

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - フィクスト・インカム (米ドル)

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 比率 (%)
<b>中期債券、固定利付債</b>			
米ドル			
USD GUARDIAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 2.00000% 16-26.04.21	350 000.00	350 154.66	0.22
米ドル合計		350 154.66	0.22
<b>中期債券、固定利付債合計</b>		350 154.66	0.22
<b>中期債券、ゼロ・クーポン債</b>			
米ドル			
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.00000% 00-01.05.30	370 000.00	290 451.61	0.18
米ドル合計		290 451.61	0.18
<b>中期債券、ゼロ・クーポン債合計</b>		290 451.61	0.18
<b>中期債券、変動利付債</b>			
米ドル			
USD GOLDMAN SACHS GROUP 3M LIBOR+160BP 13-29.11.23	525 000.00	543 098.22	0.34
米ドル合計		543 098.22	0.34
<b>中期債券、変動利付債合計</b>		543 098.22	0.34
<b>財務省証券 (T-note)、固定利付債</b>			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 12-15.05.22	3 470 000.00	3 482 334.46	2.16
米ドル合計		3 482 334.46	2.16
<b>財務省証券 (T-note)、固定利付債合計</b>		3 482 334.46	2.16
<b>財務省証券 (T-note)、変動利付債</b>			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.625%/CPI LINKED 14-15.01.24	400 000.00	447 116.06	0.28
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.250%/CPI LINKED 15-15.01.25	450 000.00	489 072.76	0.30
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 12-15.07.22	300 000.00	334 409.60	0.21
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI INDEX 13-15.07.23	400 000.00	444 916.02	0.28
米ドル合計		1 715 514.44	1.07
<b>財務省証券 (T-note)、変動利付債合計</b>		1 715 514.44	1.07
<b>他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券および短期金融商品合計</b>		9 287 826.91	5.77
<b>ルクセンブルグ2010年12月17日法 (改訂済) の第41条(1)e)に規定されたUCITS / その他のUCIs</b>			
<b>投資信託、オープン・エンド型</b>			
<b>ルクセンブルグ</b>			
EUR UBS (LUX) BOND FUND - EURO HIGH YIELD (EUR) I-X-ACC	22 162.00	3 251 430.37	2.02
USD UBS (LUX) BOND SICAV - SHORT TERM USD CORPORATES (USD) U-X-A	1 552.00	16 870 177.92	10.48
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD CORPORATES U-X-ACC	482.00	5 747 840.36	3.57
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD U-X-ACC	245.00	4 845 416.45	3.01
USD UBS (LUX) BOND SICAV - EMERGING ECONOMIES CORP (USD)-I-X-DIS	30 310.00	3 232 561.50	2.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - フィクスト・インカム (米ドル)

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 比率 (%)	
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD INVEST GRADE CORP USD U X ACC	2 260.00	25 830 670.00	16.04	
USD UBS (LUX) EMERGING ECONOMIES FUND - GLOBAL BONDS (USD)-U-X ACC	710.00	9 678 563.80	6.01	
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD U-X-ACC	1.00	11 088.70	0.01	
ルクセンブルグ合計		69 467 749.10	43.15	
投資信託、オープン・エンド型合計		69 467 749.10	43.15	
ルクセンブルグ2010年12月17日法(改訂済)の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs合計		69 467 749.10	43.15	
投資有価証券合計		157 602 622.74	97.90	
先渡為替契約				
先渡為替契約(購入/売却)				
USD 2 345 766.01	AUD 3 458 811.58	9.1.2020	3 634.33	0.00
NZD 5 000.00	USD 3 146.97	9.1.2020	64.54	0.00
GBP 1 249 269.79	USD 1 584 535.07	9.1.2020	34 120.88	0.02
USD 5 336.10	ZAR 80 000.00	9.1.2020	-92.94	0.00
USD 1 535 727.61	CAD 2 030 000.00	9.1.2020	6 814.93	0.01
USD 5 601 223.08	EUR 5 055 000.00	9.1.2020	10 534.96	0.01
CHF 4 522.25	USD 4 564.52	9.1.2020	-23.35	0.00
NOK 28 564 560.45	USD 3 123 015.74	9.1.2020	-19 987.39	-0.01
EUR 1 349 641.71	NOK 13 815 000.00	9.1.2020	-8 080.44	0.00
CAD 1 965 414.96	NOK 13 815 000.00	9.1.2020	-20 473.28	-0.01
USD 97 773.18	NOK 900 000.00	9.1.2020	4.28	0.00
EUR 60 000.00	USD 66 886.80	9.1.2020	-528.48	0.00
GBP 1 249 080.92	USD 1 613 459.06	15.1.2020	5 211.79	0.00
NZD 5 000.00	USD 3 217.44	15.1.2020	-5.66	0.00
USD 43 725.80	CAD 57 359.72	15.1.2020	524.18	0.00
USD 2 398 310.85	AUD 3 457 592.81	15.1.2020	56 671.83	0.04
NOK 16 811.67	USD 1 846.89	15.1.2020	-20.59	0.00
USD 56 179.45	JPY 6 087 875.00	15.1.2020	386.27	0.00
USD 36 483.96	CHF 35 943.27	15.1.2020	375.63	0.00
USD 4 126 323.29	EUR 3 689 996.02	15.1.2020	43 809.16	0.03
IDR 21 659 870 000.00	USD 1 529 543.82	16.1.2020	-1 740.76	0.00
INR 105 940 000.00	USD 1 465 384.88	16.1.2020	5 627.04	0.00
USD 1 574 034.37	TWD 47 720 000.00	16.1.2020	5 005.13	0.00
CAD 60 000.00	USD 45 449.38	15.1.2020	-259.18	0.00
CAD 70 000.00	USD 53 023.76	9.1.2020	-302.63	0.00
USD 64 852.95	GBP 50 000.00	9.1.2020	68.87	0.00
USD 64 863.65	GBP 50 000.00	15.1.2020	69.17	0.00
EUR 2 110 000.00	USD 2 345 302.98	9.1.2020	-11 702.20	-0.01
EUR 2 110 000.00	USD 2 346 206.06	15.1.2020	-11 757.79	-0.01
JPY 6 135 264 000.00	USD 56 736 249.66	14.1.2020	-517 429.60	-0.32
USD 160 215.48	JPY 17 348 100.00	14.1.2020	1 250.89	0.00
USD 3 595 113.87	JPY 390 213 300.00	14.1.2020	19 500.61	0.01
JPY 997 476 500.00	USD 9 150 505.74	14.1.2020	-10 401.60	-0.01
先渡為替契約(購入/売却)合計			-409 131.40	-0.25
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産			7 227 442.07	4.49
その他の資産および負債			-3 431 181.43	-2.14
純資産総額			160 989 751.98	100.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - インカム (米ドル)

## 2019年11月30日現在の投資有価証券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 比率 (%)
----	---------	--	------------------

## 公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある証券および短期金融商品

## ノート、固定利付債

## 米ドル

USD	ABU DHABI, GOVERNMENT OF-REG-S 3.12500% 17-11.10.27	400 000.00	418 500.00	0.30
USD	ALBERTA, PROVINCE OF 3.30000% 18-15.03.28	250 000.00	273 151.13	0.20
USD	ALPHABET INC 1.99800% 16-15.08.26	330 000.00	329 022.32	0.24
USD	AMERICAN EXPRESS CO 3.40000% 18-27.02.23	115 000.00	119 446.19	0.09
USD	APPLE INC 2.45000% 16-04.08.26	230 000.00	233 566.10	0.17
USD	APPLE INC 2.90000% 17-12.09.27	650 000.00	678 125.69	0.49
USD	APPLE INC 3.00000% 17-09.02.24	200 000.00	207 786.58	0.15
USD	APPLE INC 3.20000% 17-11.05.27	750 000.00	795 669.75	0.57
USD	APPLE INC 3.25000% 16-23.02.26	300 000.00	318 458.70	0.23
USD	APPLE INC 3.45000% 14-06.05.24	550 000.00	584 037.85	0.42
USD	BERKSHIRE HATHAWAY INC 3.12500% 16-15.03.26	400 000.00	421 428.28	0.30
USD	CHEVRON CORP 2.95400% 16-16.05.26	575 000.00	604 654.64	0.43
USD	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 3.35000% 19-04.06.24	200 000.00	209 628.00	0.15
USD	CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 4.37500% 12-15.06.22	225 000.00	235 982.25	0.17
USD	EQUINOR ASA 3.62500% 18-10.09.28	230 000.00	253 337.27	0.18
USD	EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.37500% 17-24.05.27	450 000.00	468 121.45	0.34
USD	EXXON MOBIL CORP 2.72600% 16-01.03.23	300 000.00	307 588.50	0.22
USD	HSBC BANK PLC-REG-S 4.12500% 10-12.08.20	250 000.00	253 683.08	0.18
USD	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.25000% 19-18.06.29	600 000.00	620 101.62	0.45
USD	JOHNSON & JOHNSON 2.45000% 16-01.03.26	475 000.00	483 940.12	0.35
USD	KOREA HYDRO&NUCLEAR POWER CO LTD-REG-S 3.12500% 17-25.07.27	300 000.00	312 187.50	0.22
USD	KOREA RESOURCES CORP-REG-S 3.00000% 17-24.04.22	600 000.00	606 937.50	0.44
USD	KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.00000% 15-02.05.25	845 000.00	857 571.66	0.62
USD	KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.87500% 18-03.04.28	380 000.00	411 184.54	0.29
USD	KUWAIT INTERNATIONAL GOVT BOND-REG-S 3.50000% 17-20.03.27	800 000.00	858 250.00	0.62
USD	MICROSOFT CORP 2.87500% 17-06.02.24	50 000.00	51 910.33	0.04
USD	MICROSOFT CORP 3.30000% 17-06.02.27	1 030 000.00	1 109 141.39	0.80
USD	MICROSOFT CORP 4.00000% 11-08.02.21	125 000.00	128 333.77	0.09
USD	NOVARTIS CAPITAL CORP 3.10000% 17-17.05.27	240 000.00	253 828.44	0.18
USD	PROCTER & GAMBLE CO 2.85000% 17-11.08.27	500 000.00	529 936.85	0.38
USD	QATAR, STATE OF-REG-S 2.37500% 16-02.06.21	600 000.00	602 250.00	0.43
USD	QUEBEC, PROVINCE OF 2.50000% 16-20.04.26	500 000.00	515 900.05	0.37
USD	ROCHE HOLDINGS INC-REG-S 3.62500% 18-17.09.28	250 000.00	277 657.63	0.20
USD	SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 2.87500% 16-10.05.26	250 000.00	259 009.68	0.19
USD	TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.70000% 13-15.01.24	275 000.00	292 299.26	0.21
USD	WALMART INC 3.05000% 19-08.07.26	100 000.00	105 410.03	0.08
USD	WALMART INC 3.70000% 18-26.06.28	600 000.00	663 385.32	0.48
USD	WESTPAC BANKING CORP 2.85000% 16-13.05.26	850 000.00	868 207.00	0.62
米ドル合計			16 519 630.47	11.89

## ノート、固定利付債合計

16 519 630.47 11.89

## 中期債券、固定利付債

## 米ドル

USD	ASB FINANCE LTD-REG-S 2.12500% 16-01.09.21	200 000.00	199 980.00	0.14
USD	ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.62500% 17-12.01.27	550 000.00	579 716.72	0.42
USD	ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.75000% 18-19.01.28	50 000.00	53 470.19	0.04
USD	ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.75000% 19-19.09.29	400 000.00	395 934.88	0.28

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - インカム (米ドル)

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 比率 (%)
USD BANK OF AMERICA CORP 3.24800% 16-21.10.27	165 000.00	172 025.70	0.12
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 3.15000% 17-19.09.27	175 000.00	183 344.00	0.13
USD CPPIB CAPITAL INC-REG-S 2.75000% 17-02.11.27	250 000.00	263 633.63	0.19
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 3.00000% 17-19.04.24	550 000.00	563 234.38	0.41
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 3.12500% 18-22.03.23	140 000.00	145 118.40	0.10
USD SP POWERASSETS LTD-REG-S 3.25000% 15-24.11.25	500 000.00	525 410.00	0.38
USD SUMITOMO MITSUI BANKING CORP-REG-S 2.44000% 19-18.06.24	200 000.00	203 498.18	0.15
USD TORONTO-DOMINION BANK 2.50000% 15-14.12.20	175 000.00	176 077.98	0.13
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 2.60000% 17-11.01.22	500 000.00	507 186.45	0.36
米ドル合計		3 968 630.51	2.85

中期債券、固定利付債合計		3 968 630.51	2.85
--------------	--	--------------	------

## 債券、固定利付債

## 米ドル

USD BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN NV-REG-S 2.62500% 14-28.04.21	400 000.00	404 569.20	0.29
USD BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN NV-REG-S 2.37500% 16-16.03.26	80 000.00	82 383.68	0.06
USD BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 2.25000% 16-02.06.26	200 000.00	204 230.48	0.15
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 3.25000% 14-29.01.24	350 000.00	371 662.62	0.27
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.87500% 15-10.02.25	330 000.00	333 425.10	0.24
USD ING BANK NV-REG-S 2.62500% 12-05.12.22	550 000.00	561 550.00	0.40
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.12500% 15-15.01.25	80 000.00	81 488.86	0.06
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT 2.50000% 15-29.07.25	1 750 000.00	1 822 770.43	1.31
USD KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 3.25000% 14-10.07.24	600 000.00	624 562.50	0.45
USD KOREA, REPUBLIC OF 3.87500% 13-11.09.23	200 000.00	213 875.00	0.15
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.50000% 14-20.11.24	200 000.00	207 601.36	0.15
USD MICROSOFT CORP 2.40000% 16-08.08.26	200 000.00	203 539.18	0.15
USD MORGAN STANLEY 5.50000% 10-24.07.20	550 000.00	562 421.92	0.40
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 3.40000% 14-06.05.24	400 000.00	422 974.12	0.30
USD ONTARIO, PROVINCE OF 3.20000% 14-16.05.24	25 000.00	26 449.50	0.02
USD ONTARIO, PROVINCE OF 2.50000% 16-27.04.26	925 000.00	953 689.16	0.69
米ドル合計		7 077 193.11	5.09

債券、固定利付債合計		7 077 193.11	5.09
------------	--	--------------	------

## 財務省証券(T-note)、固定利付債

## 米ドル

USD AMERICA, UNITED STATES OF 5.37500% 01-15.02.31	200 000.00	272 351.56	0.20
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.37500% 08-15.02.38	55 000.00	74 838.68	0.06
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.37500% 11-15.05.41	270 000.00	373 812.86	0.27
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.00000% 18-15.08.48	290 000.00	338 846.87	0.24
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 17-15.08.27	325 000.00	336 971.67	0.24
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.62500% 19-15.02.29	1 000.00	1 071.92	0.00
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 15-31.01.22	1 000.00	997.46	0.00
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.62500% 10-15.02.20	1 000 000.00	1 003 671.80	0.72
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.62500% 10-15.11.20	1 025 000.00	1 033 928.67	0.74
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.12500% 16-31.07.21	2 175 000.00	2 155 543.95	1.55
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.37500% 16-30.09.23	2 230 000.00	2 210 139.06	1.59
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 17-15.02.27	591 000.00	611 846.58	0.44
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 13-15.05.23	1 125 000.00	1 130 053.61	0.81
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.50000% 13-15.08.23	1 000.00	1 031.60	0.00
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 17-15.05.20	1 000.00	999.25	0.00
米ドル合計		9 546 105.54	6.86

財務省証券(T-note)、固定利付債合計		9 546 105.54	6.86
-----------------------	--	--------------	------

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - インカム (米ドル)

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 比率 (%)
<b>財務省証券 (T-note)、変動利付債</b>			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.875%/CPI LINKED 99-15.04.29	400 000.00	833 986.33	0.60
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.375%/CPI LINKED 04-15.01.25	345 000.00	521 289.31	0.37
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.500%/CPI LINKED 18-15.01.28	450 000.00	479 413.04	0.34
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.625%/CPI LINKED 16-15.01.26	435 000.00	482 118.18	0.35
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.125%/CPI LINKED 11-15.01.21	350 000.00	413 529.94	0.30
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 12-15.01.22	280 000.00	315 762.29	0.23
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 13-15.01.23	340 000.00	375 931.65	0.27
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI LINKED 17-15.01.27	275 000.00	295 732.80	0.21
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI LINKED 15-15.07.25	440 000.00	482 646.93	0.35
米ドル合計		4 200 410.47	3.02
<b>財務省証券 (T-note)、変動利付債合計</b>		4 200 410.47	3.02
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある証券および短期金融商品合計		41 311 970.10	29.71
<b>他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券および短期金融商品</b>			
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD HSBC HOLDINGS PLC 4.87500% 11-14.01.22	375 000.00	396 069.56	0.28
USD NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 1.95000% 17-28.09.20	300 000.00	300 181.83	0.22
USD SCENTRE GROUP TRUST 1 / 2-REG-S 3.75000% 17-23.03.27	150 000.00	157 972.50	0.11
米ドル合計		854 223.89	0.61
ノート、固定利付債合計		854 223.89	0.61
中期債券、固定利付債			
米ドル			
USD GUARDIAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 2.00000% 16-26.04.21	150 000.00	150 066.29	0.11
USD ROYAL BANK OF CANADA 2.12500% 17-02.03.20	250 000.00	250 129.93	0.18
米ドル合計		400 196.22	0.29
中期債券、固定利付債合計		400 196.22	0.29
中期債券、ゼロ・クーポン債			
米ドル			
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.00000% 00-01.05.30	150 000.00	117 750.65	0.08
米ドル合計		117 750.65	0.08
中期債券、ゼロ・クーポン債合計		117 750.65	0.08
財務省証券 (T-note)、固定利付債			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 12-15.05.22	3 000 000.00	3 010 663.80	2.17
米ドル合計		3 010 663.80	2.17
財務省証券 (T-note)、固定利付債合計		3 010 663.80	2.17

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - インカム (米ドル)

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 比率 (%)
<b>財務省証券(T-note)、変動利付債</b>			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.625%/CPI LINKED 14-15.01.24	350 000.00	391 226.55	0.28
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.250%/CPI LINKED 15-15.01.25	285 000.00	309 746.07	0.23
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 12-15.07.22	340 000.00	378 997.55	0.27
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI INDEX 13-15.07.23	340 000.00	378 178.62	0.27
米ドル合計		1 458 148.79	1.05
<b>財務省証券(T-note)、変動利付債合計</b>		1 458 148.79	1.05
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券および短期金融商品合計		5 840 983.35	4.20
<b>ルクセンブルグ2010年12月17日法(改訂済)の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs</b>			
<b>投資信託、オープン・エンド型</b>			
アイルランド			
USD SOURCE MARKETS PLC - MSCI USA SOURCE ETF-A	14 700.00	1 241 194.50	0.89
USD UBS ETFS PLC - MSCI USA TRN INDEX SF (USD) A-ACC	14 700.00	1 242 885.00	0.90
アイルランド合計		2 484 079.50	1.79
ルクセンブルグ			
EUR UBS (LUX) BOND FUND - EURO HIGH YIELD (EUR) I-X-ACC	19 279.00	2 828 459.80	2.04
USD UBS (LUX) BOND SICAV - SHORT TERM USD CORPORATES (USD) U-X-A	1 748.00	19 000 690.08	13.66
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD CORPORATES U-X-ACC	512.00	6 105 589.76	4.39
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD U-X-ACC	210.00	4 153 214.10	2.99
USD UBS (LUX) BOND SICAV - EMERGING ECONOMIES CORP (USD)-I-X-DIS	26 448.00	2 820 679.20	2.03
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD INVEST GRADE CORP USD U X ACC	1 953.00	22 321 813.50	16.05
USD UBS (LUX) EMERGING ECONOMIES FUND-GLOBAL BONDS (USD)-U-X ACC	662.00	9 024 238.36	6.49
USD UBS (LUX) EQUITY FUND - GLOBAL SUSTAINABLE (USD) U-X-ACC	207.00	2 253 420.63	1.62
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV-GLOBAL QUANTITATIVE (USD) U-X-ACC	388.00	5 983 961.04	4.30
USD UBS (LUX) INST FUND-KEY SEL. GLOBAL EQUITY FA-USD	289.00	7 386 380.49	5.31
USD UBS (LUX) INSTITUTION SICAV-EQUITIES GLB (EX USA) PASSIVE XA	14 089.00	1 443 136.27	1.04
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD U-X-ACC	63.00	698 588.10	0.50
ルクセンブルグ合計		84 020 171.33	60.42
<b>投資信託、オープン・エンド型合計</b>		86 504 250.83	62.21
ルクセンブルグ2010年12月17日法(改訂済)の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs合計		86 504 250.83	62.21
<b>公認の証券取引所に上場されている派生商品</b>			
<b>指数に係るオプション、従来型</b>			
米ドル			
USD S&P 500 INDEX PUT 2700.00000 20.12.19	10.00	990.00	0.00
米ドル合計		990.00	0.00
<b>指数に係るオプション、従来型合計</b>		990.00	0.00
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		990.00	0.00
<b>投資有価証券合計</b>		133 658 194.28	96.12

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - インカム (米ドル)

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 比率 (%)
<b>派生商品</b>			
公認の証券取引所に上場されている派生商品			
<b>指数に係る金融先物</b>			
EUR	EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 20.12.19	-188.00	-411 675.56 -0.30
CHF	SWISS MARKET INDEX FUTURE 20.12.19	31.00	161 072.20 0.12
GBP	FTSE 100 INDEX FUTURE 20.12.19	58.00	50 853.91 0.04
USD	S&P500 EMINI FUTURE 20.12.19	10.00	33 526.48 0.02
AUD	SPI 200 INDEX FUTURE 19.12.19	-3.00	-8 674.83 -0.01
CAD	S&P/TSX 60 INDEX FUTURE 19.12.19	-3.00	-9 779.79 -0.01
JPY	NIKKEI 225 (OSE) INDEX FUTURE 12.12.19	6.00	120 399.96 0.09
<b>指数に係る金融先物合計</b>			<b>-64 277.63 -0.05</b>
<b>公認の証券取引所に上場されている派生商品合計</b>			<b>-64 277.63 -0.05</b>
<b>派生商品合計</b>			<b>-64 277.63 -0.05</b>

**先渡為替契約****先渡為替契約(購入/売却)**

USD	52 691.06	DKK	355 000.00	9.1.2020	125.14	0.00
USD	2 839 036.51	AUD	4 186 134.63	9.1.2020	4 398.57	0.00
GBP	300 665.71	USD	381 355.07	9.1.2020	8 211.97	0.01
USD	146 709.95	HKD	1 150 000.00	9.1.2020	-139.98	0.00
JPY	42 995 078.00	USD	399 408.79	9.1.2020	-5 495.83	0.00
USD	13 340.24	ZAR	200 000.00	9.1.2020	-232.36	0.00
NZD	5 000.00	USD	3 146.97	9.1.2020	64.54	0.00
USD	67 436.74	SEK	659 811.26	9.1.2020	-1 675.69	0.00
USD	2 061 540.05	CAD	2 725 044.65	9.1.2020	9 148.27	0.01
USD	54 794.16	SGD	75 000.00	9.1.2020	-72.95	0.00
NOK	25 075 478.90	USD	2 741 548.06	9.1.2020	-17 545.98	-0.01
USD	365 409.11	CHF	362 025.42	9.1.2020	1 868.90	0.00
USD	5 703 703.21	EUR	5 147 486.42	9.1.2020	10 727.70	0.01
USD	72 657.33	EUR	65 000.00	9.1.2020	769.15	0.00
GBP	1 680 000.00	USD	2 160 130.56	9.1.2020	16 614.62	0.01
EUR	1 229 478.17	NOK	12 585 000.00	9.1.2020	-7 361.00	-0.01
CAD	1 790 426.87	NOK	12 585 000.00	9.1.2020	-18 650.47	-0.01
USD	96 911.84	JPY	10 500 000.00	9.1.2020	712.78	0.00
USD	58 054.01	GBP	45 000.00	9.1.2020	-251.66	0.00
USD	96 018.66	CHF	95 000.00	9.1.2020	621.16	0.00
GBP	2 411 263.48	USD	3 114 670.03	15.1.2020	10 061.01	0.01
USD	148 057.61	HKD	1 160 000.00	15.1.2020	-66.33	0.00
USD	37 438.43	DKK	250 000.00	15.1.2020	405.07	0.00
USD	1 712 401.68	AUD	2 468 732.42	15.1.2020	40 463.86	0.03
NZD	5 000.00	USD	3 217.44	15.1.2020	-5.66	0.00
CAD	121 118.20	USD	92 329.42	15.1.2020	-1 106.83	0.00
USD	68 373.61	SEK	653 064.93	15.1.2020	-51.13	0.00
USD	55 325.61	SGD	75 000.00	15.1.2020	454.73	0.00
USD	10 214.75	NOK	92 981.75	15.1.2020	113.86	0.00
JPY	32 515 927.00	USD	300 059.86	15.1.2020	-2 063.08	0.00
USD	4 265 118.29	EUR	3 814 114.51	15.1.2020	45 282.74	0.03
USD	326 814.49	CHF	321 971.10	15.1.2020	3 364.81	0.00
USD	89 102.72	EUR	80 000.00	15.1.2020	592.83	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - インカム (米ドル)

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 比率 (%)
<b>先渡為替契約 (続き)</b>			
<b>先渡為替契約 (購入 / 売却)</b>			
USD	89 069.68	EUR 80 000.00 9.1.2020	591.93 0.00
USD	122 018.00	GBP 95 000.00 15.1.2020	-1 091.50 0.00
USD	121 997.48	GBP 95 000.00 9.1.2020	-1 092.28 0.00
IDR	19 712 380 000.00	USD 1 392 018.93 16.1.2020	-1 584.25 0.00
USD	1 432 529.60	TWD 43 430 000.00 16.1.2020	4 555.17 0.00
INR	96 420 000.00	USD 1 333 702.19 16.1.2020	5 121.38 0.00
USD	64 863.65	GBP 50 000.00 15.1.2020	69.17 0.00
HKD	350 000.00	USD 44 668.80 9.1.2020	24.66 0.00
USD	64 852.95	GBP 50 000.00 9.1.2020	68.87 0.00
AUD	60 000.00	USD 40 991.64 15.1.2020	-356.91 0.00
USD	54 351.54	DKK 365 000.00 15.1.2020	282.84 0.00
AUD	70 000.00	USD 47 816.65 9.1.2020	-416.20 0.00
USD	54 328.86	DKK 365 000.00 9.1.2020	282.21 0.00
USD	36 941.71	JPY 4 000 000.00 15.1.2020	283.15 0.00
HKD	350 000.00	USD 44 665.78 15.1.2020	26.79 0.00
USD	36 929.26	JPY 4 000 000.00 9.1.2020	282.00 0.00
CHF	110 000.00	USD 111 440.93 9.1.2020	-980.67 0.00
EUR	1 100 000.00	USD 1 222 669.80 9.1.2020	-6 100.67 -0.01
CHF	110 000.00	USD 111 487.80 15.1.2020	-982.65 0.00
EUR	1 090 000.00	USD 1 212 021.14 15.1.2020	-6 073.93 0.00
USD	37 241.82	AUD 55 000.00 9.1.2020	-1.39 0.00
USD	37 247.32	AUD 55 000.00 15.1.2020	-1.18 0.00
<b>先渡為替契約 (購入 / 売却) 合計</b>			<b>92 189.30 0.07</b>
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産			5 279 508.85 3.80
当座借越およびその他の短期負債			-866.49 0.00
その他の資産および負債			92 175.28 0.06
<b>純資産総額</b>			<b>139 056 923.59 100.00</b>

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)

## 2019年11月30日現在の投資有価証券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 比率 (%)
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある証券および短期金融商品			
無記名株式			
オーストリア			
EUR ANDRITZ AG NPV(BR)	1 106.00	43 169.44	0.00
EUR ERSTE GROUP BK AG NPV	4 168.00	149 358.20	0.01
EUR OMV AG NPV(VAR)	2 083.00	118 832.08	0.01
EUR RAIFFEISEN BK INTL NPV (REGD)	1 858.00	43 656.32	0.00
EUR VERBUND AG CLASS 'A' NPV	1 002.00	52 124.71	0.01
EUR VOESTALPINE AG NPV	1 855.00	49 190.02	0.01
オーストリア合計		456 330.77	0.04
ベルギー			
EUR ANHEUSER-BUSCH IN NPV	10 404.00	824 453.14	0.07
EUR COLRUYT SA NPV	870.00	45 085.31	0.00
EUR GALAPAGOS NV NPV	269.00	53 046.80	0.00
EUR GPE BRUXELLES LAM NPV	1 098.00	111 501.31	0.01
EUR PROXIMUS SA NPV	2 156.00	65 087.89	0.01
EUR SOLVAY SA NPV	1 054.00	120 862.60	0.01
EUR UMICORE NPV	2 599.00	111 703.33	0.01
ベルギー合計		1 331 740.38	0.11
フィンランド			
EUR KONE CORPORATION NPV ORD 'B'	4 712.00	295 205.54	0.02
EUR METSO OYJ NPV	1 372.00	52 644.30	0.00
EUR WARTSILA OYJ ABP SER 'B' EUR3.50	6 144.00	61 890.68	0.01
フィンランド合計		409 740.52	0.03
フランス			
EUR ACCOR EUR3	2 571.00	110 074.69	0.01
EUR ADP EUR3	405.00	79 263.16	0.01
EUR AIR LIQUIDE(L') EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)	6 582.00	893 012.39	0.08
EUR AIRBUS EUR1	8 008.00	1 177 871.41	0.10
EUR ALSTOM EUR7.00	2 189.00	95 529.95	0.01
EUR AMUNDI EUR2.5 (AIW)	769.00	58 250.69	0.01
EUR ARKEMA EUR10	982.00	101 843.77	0.01
EUR ATOS SE EUR1	1 378.00	117 114.03	0.01
EUR AXA EUR2.29	26 912.00	732 778.96	0.06
EUR BIOMERIEUX NPV (POST SPLIT)	565.00	51 114.61	0.00
EUR BNP PARIBAS EUR2	15 559.00	874 408.36	0.07
EUR BOLLORE EURO.16	12 078.00	51 670.75	0.00
EUR BOUYGUES EUR1	3 074.00	125 678.67	0.01
EUR BUREAU VERITAS EURO.12	4 280.00	112 126.48	0.01
EUR CAPGEMINI EUR8	2 243.00	265 490.70	0.02
EUR CARREFOUR EUR2.50	7 818.00	129 129.50	0.01
EUR CASINO GUICH-PERR EUR1.53	871.00	38 356.96	0.00
EUR CIE DE ST-GOBAIN EUR4	6 640.00	269 056.45	0.02
EUR CNP ASSURANCES EUR1	2 290.00	45 247.18	0.00
EUR COVIVIO EUR3	662.00	73 284.09	0.01
EUR CREDIT AGRICOLE SA EUR3	15 954.00	218 390.78	0.02
EUR DANONE EURO.25	8 571.00	706 132.74	0.06

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)

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 比率 (%)
EUR DASSAULT AVIATION EUR8	30.00	40 851.33	0.00
EUR DASSAULT SYSTEMES EURO.50	1 823.00	287 435.69	0.02
EUR EDENRED EUR2	3 424.00	170 077.37	0.01
EUR EDF EURO.5	8 517.00	87 560.23	0.01
EUR EIFFAGE EUR4	1 119.00	122 270.51	0.01
EUR ENGIE EUR1	24 814.00	392 888.40	0.03
EUR ESSILORLUXOTTICA EURO.18	3 938.00	612 227.47	0.05
EUR EURAZEO NPV	535.00	36 484.76	0.00
EUR EUTELSAT COMMUNICA EUR1	2 663.00	43 720.37	0.00
EUR FAURECIA EUR7	977.00	51 858.34	0.00
EUR GETLINK SE EURO.40	6 494.00	109 623.95	0.01
EUR HERMES INTL NPV	441.00	330 647.69	0.03
EUR ICADE NPV	366.00	36 662.66	0.00
EUR ILIAD NPV	372.00	47 394.82	0.00
EUR INGENICO GROUP EUR1	794.00	84 797.48	0.01
EUR IPSEN EUR1	538.00	60 802.88	0.01
EUR JC DECAUX SA NPV	885.00	25 370.83	0.00
EUR KERING EUR4	1 051.00	633 533.78	0.05
EUR KLEPIERRE EUR1.40	2 786.00	100 049.95	0.01
EUR L'OREAL EURO.20	3 470.00	989 791.89	0.08
EUR LEGRAND SA EUR4	3 611.00	285 393.10	0.02
EUR LVMH MOET HENNESSY EURO.30	3 823.00	1 716 867.17	0.14
EUR NATIXIS EUR1.6	13 219.00	55 284.00	0.01
EUR ORANGE EUR4	27 506.00	454 921.73	0.04
EUR PERNOD RICARD EUR1.55	2 945.00	541 301.07	0.05
EUR PEUGEOT SA EUR1	8 198.00	198 137.40	0.02
EUR PUBLICIS GROUPE SA EURO.40	2 939.00	129 427.22	0.01
EUR REMY COINTREAU EUR1.60	333.00	42 921.68	0.00
EUR RENAULT SA EUR3.81	2 694.00	129 078.92	0.01
EUR SAFRAN EURO.20	4 539.00	742 947.92	0.06
EUR SANOFI EUR2	15 457.00	1 440 294.48	0.12
EUR SARTORIUS STEDIM B EURO.20 (POST SUBD)	425.00	67 525.98	0.01
EUR SCHNEIDER ELECTRIC EUR8	7 613.00	735 322.62	0.06
EUR SCOR SE EUR7.876972 (POST CONS)	2 265.00	97 373.20	0.01
EUR SEB SA EUR1	318.00	49 438.38	0.00
EUR SOC GENERALE EUR1.25	10 620.00	334 426.52	0.03
EUR SODEXO EUR4	1 231.00	143 602.40	0.01
EUR SUEZ EUR4	5 224.00	77 385.36	0.01
EUR TELEPERFORMANCE EUR2.50	797.00	188 936.02	0.02
EUR THALES EUR3	1 492.00	146 280.44	0.01
EUR TOTAL EUR2.5	32 871.00	1 726 643.42	0.15
EUR UBISOFT ENTERTAIN EURO.31	1 171.00	71 142.07	0.01
EUR UNIBAIL-RODAMCO-WE NPV(1 ORD UNIBAIL-R & 1CLS)	1 926.00	301 339.92	0.03
EUR VALEO EUR1 (POST SUBD)	3 364.00	132 639.08	0.01
EUR VEOLIA ENVIRONNEME EUR5	7 484.00	191 773.19	0.02
EUR VINCI EUR2.50	7 075.00	772 132.59	0.07
EUR VIVENDI SA EUR5.50	12 574.00	345 493.18	0.03
EUR WENDEL EUR4	410.00	55 287.67	0.01
EUR WORLDLINE EURO.68	1 097.00	71 061.19	0.01
フランス合計		21 834 254.64	1.84
ドイツ			
EUR BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG EUR1	4 573.00	369 592.51	0.03
EUR BEIERSDORF AG NPV	1 431.00	167 012.31	0.01
EUR CARL ZEISS MEDITEC NPV	549.00	67 191.34	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)

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 比率 (%)	
EUR	COMMERZBANK AG NPV	14 146.00	82 057.82	0.01
EUR	CONTINENTAL AG ORD NPV	1 451.00	189 744.89	0.02
EUR	COVESTRO AG NPV	2 460.00	115 276.83	0.01
EUR	DEUTSCHE WOHNEN AG NPV (BR)	5 022.00	196 295.77	0.02
EUR	FRAPORT AG NPV	600.00	51 151.81	0.00
EUR	FRESENIUS MED CARE NPV	3 014.00	221 194.61	0.02
EUR	FRESENIUS SE & CO. KGAA NPV	5 763.00	315 426.65	0.03
EUR	GEA GROUP AG NPV	2 331.00	74 971.58	0.01
EUR	HEIDELBERGCEMENT NPV	1 968.00	145 601.42	0.01
EUR	HENKEL AG & CO KGAA	1 443.00	139 694.35	0.01
EUR	HOCHTIEF AG NPV	340.00	41 799.57	0.00
EUR	KION GROUP AG NPV	900.00	59 758.71	0.00
EUR	KNORR BREMSE AG NPV	687.00	66 870.88	0.01
EUR	LANXESS AG NPV	1 240.00	82 717.05	0.01
EUR	MERCK KGAA NPV	1 817.00	212 362.97	0.02
EUR	METRO AG (NEW) NPV	2 588.00	41 732.86	0.00
EUR	PUMA SE NPV	1 200.00	90 236.78	0.01
EUR	RWE AG (NEU) NPV	7 766.00	230 424.72	0.02
EUR	SAP AG ORD NPV	13 531.00	1 842 232.77	0.15
EUR	SYMRISE AG NPV (BR)	1 737.00	168 615.63	0.01
EUR	THYSSENKRUPP AG NPV	5 298.00	66 477.13	0.00
EUR	VOLKSWAGEN AG ORD NPV	463.00	88 393.73	0.01
EUR	WIRECARD AG NPV	1 614.00	213 195.65	0.02
EUR	ZALANDO SE NPV	1 804.00	77 773.43	0.01
ドイツ合計			5 417 803.77	0.46
アイルランド				
EUR	AIB GROUP PLC ORD EURO.625	9 801.00	32 095.55	0.00
EUR	BANK OF IRELAND GR EUR1	12 159.00	61 133.70	0.01
GBP	DCC ORD EURO.25	1 054.00	90 090.10	0.01
EUR	FLUTTER ENTERTAINM ORD EURO.09	1 074.00	123 156.01	0.01
EUR	KERRY GROUP 'A' ORD EURO.125(DUBLIN LIST)	2 109.00	270 674.63	0.02
アイルランド合計			577 149.99	0.05
イタリア				
EUR	ASSIC GENERALI SPA EUR1	14 946.00	305 364.39	0.02
EUR	FINECOBANK SPA EURO.33	8 852.00	109 900.02	0.01
EUR	LEONARDO SPA EUR4.40	6 073.00	71 079.00	0.01
EUR	POSTE ITALIANE SPA NPV	7 256.00	84 724.93	0.01
EUR	TELECOM ITALIA SPA DI RISP EURO.55	87 982.00	54 228.01	0.00
EUR	TELECOM ITALIA SPA EURO.55	131 310.00	82 265.36	0.01
イタリア合計			707 561.71	0.06
ジャージー				
GBP	GLENCORE XSTRATA ORD USD0.01	119 785.00	377 903.29	0.03
ジャージー合計			377 903.29	0.03
ルクセンブルグ				
EUR	AROUNDTOWN SA EURO.01	13 034.00	113 274.50	0.01
EUR	EUROFINS SCIENTIFI EURO.10	160.00	84 079.87	0.01
ルクセンブルグ合計			197 354.37	0.02
オランダ				
USD	AERCAP HOLDINGS EURO.01	1 839.00	113 668.59	0.01
EUR	AKZO NOBEL NV EURO.50(POST REV SPLIT)	3 162.00	303 039.73	0.03

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)

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 比率 (%)
EUR ALTICE EUROPE N.V. EURO.01 (COMMON SHARES A)	6 572.00	39 144.44	0.00
EUR EXOR NV EURO.01	1 484.00	113 621.78	0.01
EUR HEINEKEN HOLDING EUR1.6	1 632.00	156 551.56	0.01
EUR HEINEKEN NV EUR1.60	3 540.00	367 057.30	0.03
EUR ING GROEP N.V. EURO.01	53 934.00	621 079.92	0.05
EUR KON KPN NV EURO.04	50 832.00	156 708.43	0.01
EUR KONINKLIJKE AHOLD EURO.01	16 368.00	422 037.44	0.04
EUR KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20	12 790.00	594 339.49	0.05
USD NXP SEMICONDUCTORS EURO.20	3 967.00	458 505.86	0.04
EUR QIAGEN NV EURO.01	3 060.00	131 111.93	0.01
EUR RANDSTAD N.V. EURO.10	1 713.00	99 839.53	0.01
GBP ROYAL DUTCH SHELL 'B' SHS EURO.07 (UK LIST)	40 889.00	1 158 024.84	0.10
EUR STMICROELECTRONICS EUR1.04	9 458.00	232 553.11	0.02
EUR VOPAK(KON) EURO.50	1 052.00	56 129.26	0.00
EUR WOLTERS KLUWER EURO.12	3 794.00	272 581.51	0.02
<b>オランダ合計</b>		<b>5 295 994.72</b>	<b>0.44</b>
<b>スペイン</b>			
EUR ACS ACTIVIDADES CO EURO.5	3 704.00	144 288.79	0.01
EUR AENA SME S.A. EUR10	958.00	176 083.68	0.02
EUR AMADEUS IT GROUP EURO.01	6 072.00	484 047.57	0.04
EUR BANKIA S.A. EUR1 (POST CONS)	19 902.00	38 588.43	0.00
EUR BCO DE SABADELL EURO.125	79 098.00	87 823.95	0.01
EUR CAIXABANK SA EUR1	50 578.00	149 400.60	0.01
EUR CELLNEX TELECOM SA EURO.25	3 464.00	148 956.85	0.01
EUR ENAGAS SA EUR1.50	3 216.00	80 174.19	0.01
EUR ENDESA SA EUR1.2	4 499.00	122 427.54	0.01
EUR FERROVIAL SA EURO.2	6 616.00	196 594.90	0.02
EUR GRIFOLS SA EURO.25 (CLASS A) POST SUBD	4 161.00	142 271.36	0.01
EUR IBERDROLA SA EURO.75 (POST SUBDIVISION)	82 820.00	815 281.14	0.07
EUR INDITEX EURO.03 (POST SUBD)	15 124.00	471 255.92	0.04
EUR NATURGY ENERGY GRO EUR1	3 937.00	102 446.10	0.01
EUR RED ELECTRICA CORP EURO.5	6 044.00	118 288.03	0.01
EUR REPSOL SA EUR1	19 679.00	310 065.35	0.03
EUR SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	3 366.00	53 758.94	0.00
EUR TELEFONICA SA EUR1	63 200.00	484 445.39	0.04
<b>スペイン合計</b>		<b>4 126 198.73</b>	<b>0.35</b>
<b>スイス</b>			
CHF PARGESA HLDGS SA CHF20(BR)	1 156.00	91 267.72	0.01
CHF SWATCH GROUP CHF2.25(BR)	838.00	234 792.62	0.02
CHF SWISS RE AG CHF0.10	8 652.00	937 621.05	0.08
CHF VIFOR PHARMA AG CHF0.01	1 321.00	235 687.50	0.02
<b>スイス合計</b>		<b>1 499 368.89</b>	<b>0.13</b>
<b>イギリス</b>			
GBP 3I GROUP ORD GBPO.738636	10 377.00	143 756.58	0.01
GBP ASTRAZENECA ORD USDO.25	14 324.00	1 381 825.25	0.12
GBP AVIVA ORD GBPO.25	41 825.00	218 458.37	0.02
GBP BAE SYSTEMS ORD GBPO.025	34 262.00	254 118.82	0.02
GBP BARRATT DEVEL ORD GBPO.10	10 848.00	93 564.62	0.01
GBP BRIT AMER TOBACCO ORD GBPO.25	25 053.00	991 625.30	0.08
GBP BRITISH LAND CO PLC REIT	9 758.00	72 652.08	0.01
GBP BT GROUP ORD GBPO.05	91 142.00	225 834.26	0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ (米ドル)

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 比率 (%)
GBP BUNZL ORD GBPO.32142857	3 586.00	98 475.16	0.01
USD COCA-COLA EUROPEAN ORD EURO.01	3 194.00	161 169.24	0.01
GBP EVRAZ PLC ORD USD1	5 142.00	24 635.96	0.00
GBP HALMA ORD GBPO.10	4 285.00	116 728.16	0.01
GBP INFORMA PLC (GB) ORD GBPO.001	14 462.00	148 044.01	0.01
GBP ITV ORD GBPO.10	41 769.00	78 394.92	0.01
GBP JOHNSON MATTHEY ORD GBP1.109245	2 071.00	76 989.82	0.01
GBP KINGFISHER ORD GBPO.157142857	22 511.00	61 118.64	0.00
GBP LAND SECURITIES GP ORD GBPO.106666666	7 996.00	99 125.64	0.01
GBP LLOYDS BANKING GP ORD GBPO.1	778 296.00	615 612.87	0.05
GBP MARKS & SPENCER GP ORD GBPO.25	21 294.00	53 531.36	0.00
GBP MEGGITT ORD GBPO.05	8 583.00	71 386.57	0.01
GBP MELROSE INDUST PLC ORD GBPO.0685714	52 925.00	157 180.69	0.01
GBP NATIONAL GRID ORD GBPO.12431289	37 370.00	430 064.03	0.04
GBP OCADO GROUP PLC ORD GBPO.02	4 803.00	82 318.02	0.01
GBP RECKITT BENCK GRP ORD GBPO.10	7 739.00	607 230.65	0.05
GBP RELX PLC GBPO.1444	20 620.00	499 566.00	0.04
EUR RELX PLC GBPO.1444	732.00	17 740.13	0.00
GBP RENTOKIL INITIAL ORD GBPO.01	19 121.00	110 037.18	0.01
GBP ROLLS-ROYCE HLDGS ORD GBPO.20	18 129.00	166 869.21	0.01
GBP SAGE GROUP GBPO.01051948	11 614.00	113 241.18	0.01
GBP SEVERN TRENT ORD GBPO.9789	2 577.00	74 767.03	0.01
GBP SMITHS GROUP ORD GBPO.375	4 242.00	91 139.52	0.01
GBP SPIRAX-SARCO ENG ORD GBPO.269230769	882.00	101 822.38	0.01
GBP SSE PLC ORD GBPO.50	11 070.00	186 147.59	0.01
GBP ST JAMES ' S PLACE ORD GBPO.15	5 660.00	79 691.37	0.01
EUR UNILEVER EURO.16	19 984.00	1 185 448.48	0.10
GBP UNITED UTILITIES G ORD GBPO.05	7 330.00	80 913.88	0.01
GBP WEIR GROUP ORD GBPO.125	2 717.00	49 044.01	0.00
GBP WHITBREAD ORD GBPO.76797385	1 524.00	90 699.24	0.01
GBP WPP PLC ORD GBPO.10	13 438.00	173 907.44	0.01
<b>イギリス合計</b>		<b>9 284 875.66</b>	<b>0.78</b>
<b>無記名株式合計</b>		<b>51 516 277.44</b>	<b>4.34</b>
<b>参加証券</b>			
<b>スイス</b>			
CHF LINDT & SPRUENGLI PTG CERT CHF10	31.00	236 528.74	0.02
CHF SCHINDLER-HLDG AG PTG CERT CHF0.10(POST-SUBD)	1 162.00	289 875.02	0.02
<b>スイス合計</b>		<b>526 403.76</b>	<b>0.04</b>
<b>参加証券合計</b>		<b>526 403.76</b>	<b>0.04</b>
<b>その他の株式</b>			
<b>スイス</b>			
CHF ROCHE HLDGS AG GENUSSSCHEINE NPV	20 114.00	6 203 166.86	0.52
<b>スイス合計</b>		<b>6 203 166.86</b>	<b>0.52</b>
<b>その他の株式合計</b>		<b>6 203 166.86</b>	<b>0.52</b>

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)

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 比率 (%)
<b>優先株式</b>			
<b>ドイツ</b>			
EUR BAYERISCHE MOTORENWERKE AG EUR1	639.00	39 455.44	0.01
EUR FUCHS PETROLUB SE NON-VTG PRF NPV	870.00	37 603.07	0.00
EUR HENKEL AG&CO. KGAA NON-VTG PRF NPV	2 508.00	265 138.96	0.02
EUR PORSCHE AUTO HL SE NON VTG PRF NPV	2 136.00	158 219.22	0.01
EUR SARTORIUS AG NON VTG PRF NPV	490.00	103 354.42	0.01
EUR VOLKSWAGEN AG NON VTG PRF NPV	2 571.00	497 448.00	0.04
<b>ドイツ合計</b>		<b>1 101 219.11</b>	<b>0.09</b>
<b>優先株式合計</b>		<b>1 101 219.11</b>	<b>0.09</b>
<b>記名株式</b>			
<b>オーストラリア</b>			
GBP BHP GROUP PLC ORD USD0.50	22 766.00	503 557.74	0.04
<b>オーストラリア合計</b>		<b>503 557.74</b>	<b>0.04</b>
<b>ベルギー</b>			
EUR AGEAS NPV	2 428.00	145 849.11	0.01
EUR KBC GROUP NV NPV	3 458.00	252 177.99	0.02
EUR TELENET GRP HLDG NPV	778.00	35 136.42	0.01
EUR UCB NPV	1 785.00	144 776.45	0.01
<b>ベルギー合計</b>		<b>577 939.97</b>	<b>0.05</b>
<b>カナダ</b>			
CAD BARRICK GOLD CORP COM NPV	1.00	16.70	0.00
<b>カナダ合計</b>		<b>16.70</b>	<b>0.00</b>
<b>フィンランド</b>			
EUR ELISA CORPORATION EURO.50	2 010.00	107 509.12	0.01
EUR FORTUM OYJ EUR3.40	6 209.00	146 436.87	0.01
EUR NESTE OIL OYJ NPV	5 701.00	192 852.11	0.02
EUR NOKIA OYJ NPV	78 310.00	277 295.71	0.02
EUR NOKIAN RENKAAT OYJ NPV	1 932.00	52 318.28	0.00
EUR ORION CORP SER ' B ' NPV	1 307.00	56 923.38	0.01
EUR SAMPO OYJ SER ' A ' NPV	6 236.00	252 342.36	0.02
EUR STORA ENSO OYJ NPV SER ' R '	7 891.00	106 147.52	0.01
EUR UPM-KYMMENE CORP NPV	7 462.00	249 460.87	0.02
<b>フィンランド合計</b>		<b>1 441 286.22</b>	<b>0.12</b>
<b>フランス</b>			
EUR BOLLORE EURO.16 (RFD 01/01/2020)	70.00	294.06	0.00
EUR GECINA EUR7.50	628.00	108 573.46	0.01
EUR MICHELIN (CGDE) EUR2	2 374.00	285 053.63	0.02
<b>フランス合計</b>		<b>393 921.15</b>	<b>0.03</b>
<b>ドイツ</b>			
EUR ADIDAS AG NPV (REGD)	2 505.00	780 959.18	0.07
EUR ALLIANZ SE NPV(REGD)(VINKULIERT)	5 844.00	1 400 515.24	0.12
EUR AXEL SPRINGER SE NPV (ASD 02/08/19 TRAVIATA)	639.00	44 035.09	0.00
EUR BASF SE NPV	12 749.00	958 971.77	0.08
EUR BAYER AG NPV (REGD)	12 932.00	979 581.15	0.08
EUR BRENNTAG AG	2 225.00	118 763.53	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)

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 比率 (%)	
EUR	DAIMLER AG ORD NPV(REGD)	12 360.00	697 760.56	0.06
EUR	DELIVERY HERO SE NPV	1 593.00	84 309.21	0.01
EUR	DEUTSCHE BANK AG NPV(REGD)	27 699.00	199 859.77	0.02
EUR	DEUTSCHE BOERSE AG NPV(REGD)	2 644.00	405 951.96	0.03
EUR	DEUTSCHE LUFTHANSA ORD NPV (REGD)(VINK)	3 456.00	65 618.28	0.01
EUR	DEUTSCHE POST AG NPV(REGD)	13 430.00	501 099.95	0.04
EUR	DEUTSCHE TELEKOM NPV(REGD)	45 901.00	771 100.71	0.06
EUR	E.ON SE NPV	30 041.00	314 604.22	0.03
EUR	EVONIK INDUSTRIES NPV	2 449.00	71 125.04	0.01
EUR	HANNOVER RUECKVERS ORD NPV(REGD)	828.00	153 832.55	0.01
EUR	INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)	17 309.00	370 018.10	0.03
EUR	MTU AERO ENGINES H NPV (REGD)	730.00	197 924.42	0.02
EUR	MUENCHENER RUECKVE NPV(REGD)	2 006.00	576 399.15	0.05
EUR	SIEMENS AG NPV(REGD)	10 598.00	1 368 588.75	0.11
EUR	SIEMENS HEALTHINEE NPV	2 097.00	101 780.94	0.01
EUR	TELEFONICA DEUTSCH NPV	13 761.00	42 044.05	0.00
GBP	TUI AG NPV (REGD)	5 038.00	69 304.60	0.01
EUR	UNIPER SE NPV	2 823.00	91 200.35	0.01
EUR	UNITED INTERNET AG NPV(REGD)	1 763.00	59 774.43	0.00
EUR	VONOVIA SE NPV	6 932.00	361 448.03	0.03
ドイツ合計			10 786 571.03	0.91
アイルランド				
EUR	CRH ORD EURO.32	11 057.00	423 409.00	0.03
GBP	EXPERIAN ORD USD0.10	10 047.00	333 082.21	0.03
EUR	KINGSPAN GROUP ORD EURO.13(DUBLIN LISTING)	1 897.00	102 322.65	0.01
EUR	SMURFIT KAPPA GRP ORD EURO.001	2 904.00	103 102.80	0.01
アイルランド合計			961 916.66	0.08
マン島				
GBP	GVC HLDGS PLC ORD EURO.01	6 427.00	70 796.27	0.01
マン島合計			70 796.27	0.01
イタリア				
EUR	ATLANTIA SPA EUR1	6 845.00	151 851.62	0.01
EUR	DAVIDE DE CAMPARI EURO.05 (POST SUBD)	7 969.00	72 797.15	0.01
EUR	ENEL EUR1	111 139.00	840 147.00	0.07
EUR	ENI SPA EUR1	35 050.00	529 993.03	0.05
EUR	FERRARI NV EURO.01(NEW)	1 705.00	288 381.72	0.02
EUR	INTESA SANPAOLO NPV	200 425.00	508 384.28	0.04
EUR	MEDIABANCA SPA EURO.5	8 635.00	96 637.65	0.01
EUR	MONCLER SPA NPV	2 493.00	109 319.05	0.01
EUR	PIRELLI & C SPA NPV	5 939.00	33 723.96	0.00
EUR	PRYSMIAN SPA EURO.10	3 386.00	77 244.12	0.01
EUR	RECORDATI EURO.125	1 505.00	63 173.85	0.01
EUR	SNAM EUR1	28 654.00	142 551.68	0.01
EUR	TERNA SPA ORD EURO.22	18 611.00	119 634.45	0.01
EUR	UNICREDIT SPA NPV (POST REV SPLIT)	27 676.00	383 336.43	0.03
イタリア合計			3 417 175.99	0.29
ルクセンブルグ				
EUR	ARCELORMITTAL NPV(POST STOCK SPLIT)	9 023.00	154 484.34	0.01
EUR	TENARIS S.A. USD1	6 757.00	71 909.98	0.01
ルクセンブルグ合計			226 394.32	0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)

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 比率 (%)
<b>オランダ</b>			
EUR ADYEN NV EURO.01	145.00	111 306.37	0.01
EUR AEGON NV EURO.12	24 131.00	108 875.19	0.01
EUR ASML HOLDING NV EURO.09	5 854.00	1 594 291.24	0.13
EUR CNH INDUSTRIAL NV COM EURO.01	14 158.00	151 860.02	0.01
EUR FIAT CHRYSLER AUTO EURO.01	15 121.00	223 743.80	0.02
EUR KONINKLIJKE DSM NV EUR1.5	2 492.00	319 555.09	0.03
EUR NN GROUP N.V. EURO.12	4 333.00	166 450.39	0.01
EUR PROSUS N.V. EURO.05	6 804.00	464 154.33	0.04
GBP ROYAL DUTCH SHELL PLC 'A' SHS EURO.07	47 516.00	1 358 923.63	0.12
<b>オランダ合計</b>		<b>4 499 160.06</b>	<b>0.38</b>
<b>ポルトガル</b>			
EUR EDP ENERGIAS PORTU EUR1(REGD)	36 495.00	147 678.56	0.01
EUR GALP ENERGIA EUR1-B	7 114.00	115 893.57	0.01
EUR JERONIMO MARTINS EUR5	3 477.00	55 570.07	0.01
<b>ポルトガル合計</b>		<b>319 142.20</b>	<b>0.03</b>
<b>南アフリカ</b>			
GBP MONDI ORD EURO.20	5 104.00	110 616.91	0.01
<b>南アフリカ合計</b>		<b>110 616.91</b>	<b>0.01</b>
<b>スペイン</b>			
EUR BANCO SANTANDER SA EURO.50(REGD)	229 582.00	895 345.96	0.07
EUR BANKINTER SA EURO.3(REGD)	9 843.00	68 894.15	0.01
EUR BBVA(BILB-VIZ-ARG) EURO.49	91 407.00	481 905.19	0.04
EUR MAPFRE SA EURO.10	16 549.00	46 693.89	0.00
<b>スペイン合計</b>		<b>1 492 839.19</b>	<b>0.12</b>
<b>スイス</b>			
CHF ABB LTD CHF0.12 (REGD)	52 675.00	1 152 751.54	0.10
CHF ADECCO GROUP AG CHF0.1 (REGD)	4 522.00	279 731.87	0.02
CHF ALCON AG CHF0.04	11 769.00	650 189.11	0.06
CHF BALOISE-HLDGS CHF0.1(REGD)	1 382.00	240 347.83	0.02
CHF BARRY CALLEBAUT AG CHF0.02 (REGD)	63.00	126 712.36	0.01
CHF CLARIANT CHF4.00(REGD)	5 596.00	115 688.56	0.01
GBP COCA-COLA HBC AG ORD CHF6.70	2 182.00	72 790.13	0.01
CHF CREDIT SUISSE GRP CHF0.04(REGD)	72 158.00	946 245.65	0.08
CHF DUFREY AG CHF5 (REGD)	1 214.00	118 539.17	0.01
CHF EMS-CHEMIE HLDG AG CHF0.01(REGD)(POST RECON)	233.00	144 670.54	0.01
CHF GEBERIT CHF0.10(REGD)	1 062.00	570 452.39	0.05
CHF GIVAUDAN AG CHF10	260.00	764 637.01	0.07
CHF JULIUS BAER GRUPPE CHF0.02 (REGD)	6 337.00	298 540.01	0.03
CHF KUEHNE&NAGEL INTL CHF1(REGD)(POST-SUBD)	1 514.00	246 336.52	0.02
CHF LAFARGEHOLCIM LTD CHF2 (REGD)	13 964.00	720 452.13	0.06
CHF LINDT & SPRUENGLI CHF100(REGD)	3.00	256 066.44	0.02
CHF LONZA GROUP AG CHF1(REGD)	2 138.00	726 537.05	0.06
CHF NESTLE SA CHF0.10(REGD)	86 723.00	9 018 115.93	0.76
CHF NOVARTIS AG CHF0.50(REGD)	61 496.00	5 665 004.01	0.48
CHF PARTNERS GROUP HLG CHF0.01 (REGD)	535.00	451 405.41	0.04
CHF RICHEMONT(CIE FIN) CHF1.00 (REG) SER 'A'	14 935.00	1 138 189.42	0.10
CHF SCHINDLER-HLDG AG CHF0.1(REGD)(POST-SUBD)	589.00	140 980.44	0.01
CHF SGS LTD CHF1(REGD)	151.00	393 157.55	0.03
CHF SIKA AG CHF0.01 (REG)	3 642.00	634 302.40	0.05
CHF SONOVA HOLDING AG CHF0.05 (REGD)	1 591.00	363 461.55	0.03

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)

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 比率 (%)
CHF STRAUMANN HLDG CHF0.1(REGD)	290.00	279 161.45	0.02
CHF SWATCH GROUP CHF0.45(REGD)	1 707.00	91 042.28	0.01
CHF SWISS LIFE HLDG CHF5.1(REGD)	969.00	480 742.68	0.04
CHF SWISS PRIME SITE CHF15.3 (REGD)	2 200.00	232 471.11	0.02
CHF SWISSCOM AG CHF1(REGD)	744.00	385 344.87	0.03
CHF TEMENOS AG CHF5 (REGD)	1 874.00	284 470.71	0.02
CHF UBS GROUP CHF0.10 (REGD)	110 330.00	1 338 069.34	0.11
CHF ZURICH INSURANCE GRP CHF0.10	4 327.00	1 698 586.18	0.14
スイス合計		30 025 193.64	2.53
アラブ首長国連邦			
GBP NMC HEALTH PLC ORD GBPO.1	924.00	29 987.42	0.00
アラブ首長国連邦合計		29 987.42	0.00
イギリス			
GBP ADMIRAL GROUP ORD GBPO.001	2 252.00	62 337.39	0.00
GBP ANGLO AMERICAN USDO.54945	11 599.00	304 042.01	0.03
GBP ANTOFAGASTA ORD GBPO.05	4 479.00	50 288.33	0.00
GBP ASHTEAD GROUP ORD GBPO.10	5 125.00	155 785.91	0.01
GBP ASSOCD BRIT FOODS ORD GBPO.0568	3 790.00	125 941.76	0.01
GBP AUTO TRADER GROUP ORD GBPO.01	9 948.00	72 316.69	0.01
GBP BARCLAYS ORD GBPO.25	190 666.00	423 063.05	0.04
GBP BERKELEY GP HLDGS ORD GBPO.05	1 334.00	79 132.76	0.01
GBP BP ORD USDO.25	221 919.00	1 378 424.79	0.12
GBP BURBERRY GROUP ORD GBPO.0005	4 360.00	118 658.45	0.01
GBP CARNIVAL PLC ORD USD1.66	1 798.00	75 655.44	0.01
GBP CENTRICA ORD GBPO.061728395	60 506.00	62 783.79	0.00
GBP COMPASS GROUP ORD GBPO.1105	17 348.00	425 118.94	0.04
GBP CRODA INTL ORD GBPO.10609756	1 323.00	85 222.76	0.01
GBP DIAGEO ORD GBPO.28 101/108	26 026.00	1 065 485.57	0.09
GBP DIRECT LINE INSURA ORD GBP 0.109090909	14 872.00	58 749.59	0.00
GBP EASYJET ORD GBPO.27285714	1 373.00	23 762.55	0.00
GBP FERGUSON PLC (NEW) ORD GBPO.10	2 599.00	225 980.63	0.02
GBP G4S ORD GBPO.25	18 703.00	50 586.16	0.00
GBP GLAXOSMITHKLINE ORD GBPO.25	54 477.00	1 235 973.63	0.10
GBP HARGREAVES LANSDOW ORD GBPO.004 (WI)	3 032.00	72 751.10	0.01
GBP HSBC HLDGS ORD USDO.50(UK REG)	221 073.00	1 647 975.53	0.14
GBP IMPERIAL BRANDS PL GBPO.10	10 245.00	225 706.49	0.02
GBP INTERCONTL HOTELS ORD GBPO.208521303	1 822.00	118 002.82	0.01
GBP INTERTEK GROUP ORD GBPO.01	1 728.00	123 291.87	0.01
GBP LEGAL & GENERAL GP ORD GBPO.025	64 465.00	234 229.81	0.02
GBP LONDON STOCK EXCH ORD GBPO.06918604	3 517.00	312 623.74	0.03
GBP M&G PLC ORD GBPO.05	23 395.00	71 416.98	0.01
GBP MICRO FOCUS INTL ORD GBPO.10	3 706.00	54 303.16	0.00
GBP MORRISON(W)SUPRMKT ORD GBPO.10	24 366.00	62 499.05	0.00
GBP NEXT ORD GBPO.10	1 480.00	129 373.80	0.01
GBP PEARSON ORD GBPO.25	8 321.00	69 594.94	0.01
GBP PERSIMMON ORD GBPO.10	3 474.00	114 946.77	0.01
GBP PRUDENTIAL ORD GBPO.05	28 889.00	514 369.45	0.04
GBP RIO TINTO ORD GBPO.10	12 436.00	675 851.86	0.06
GBP ROYAL BK SCOT GRP ORD GBP1 (POST CONS)	52 607.00	153 922.66	0.01
GBP RSA INSURANCE GRP ORD GBP1.00	10 956.00	78 142.12	0.01
GBP SAINSBURY(J) ORD GBPO.28571428	20 723.00	57 443.55	0.00
GBP SCHROEDERS VTG SHS GBP1	1 465.00	62 515.31	0.00
GBP SMITH & NEPHEW ORD USDO.20	9 802.00	219 471.53	0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)

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 比率 (%)
GBP STANDARD CHARTERED ORD USD0.50	30 218.00	272 592.62	0.02
GBP STD LIFE ABERDEEN ORD GBPO.1396825396	26 771.00	109 737.05	0.01
GBP TAYLOR WIMPEY ORD GBPO.01	35 009.00	78 907.61	0.01
GBP TESCO ORD GBPO.05	107 997.00	320 458.31	0.03
GBP UNILEVER PLC ORD GBPO.031111	12 082.00	715 452.91	0.06
GBP VODAFONE GROUP ORD USD0.2095238(POST CONS)	291 071.00	577 400.92	0.05
<b>イギリス合計</b>		<b>13 152 292.16</b>	<b>1.11</b>
<b>記名株式合計</b>		<b>68 008 807.63</b>	<b>5.73</b>
<b>預託証券</b>			
<b>ルクセンブルグ</b>			
EUR SES S.A. FDR EACH REP 1 'A' NPV	5 068.00	67 307.18	0.00
<b>ルクセンブルグ合計</b>		<b>67 307.18</b>	<b>0.00</b>
<b>オランダ</b>			
EUR ABN AMRO BANK N.V. DR EACH REP SHS	6 021.00	102 834.31	0.01
<b>オランダ合計</b>		<b>102 834.31</b>	<b>0.01</b>
<b>預託証券合計</b>		<b>170 141.49</b>	<b>0.01</b>
<b>投資信託証券</b>			
<b>アイルランド</b>			
USD STAR COMPASS PLC/UBS DYNMC DIVERSIFIED LTD NOTE DUE 31.03.21	33 350 000.00	47 340 325.00	3.98
<b>アイルランド合計</b>		<b>47 340 325.00</b>	<b>3.98</b>
<b>投資信託証券合計</b>		<b>47 340 325.00</b>	<b>3.98</b>
<b>投資信託、クローズド・エンド型</b>			
<b>イギリス</b>			
GBP SEGRO PLC REIT	11 802.00	136 477.03	0.01
<b>イギリス合計</b>		<b>136 477.03</b>	<b>0.01</b>
<b>投資信託、クローズド・エンド型合計</b>		<b>136 477.03</b>	<b>0.01</b>
<b>ノート、固定利付債</b>			
<b>米ドル</b>			
USD 3M CO 2.25000% 16-19.09.26	1 150 000.00	1 156 071.31	0.10
USD ABU DHABI, GOVERNMENT OF-REG-S 3.12500% 17-11.10.27	4 475 000.00	4 681 968.75	0.39
USD ALBERTA, PROVINCE OF 3.30000% 18-15.03.28	2 800 000.00	3 059 292.60	0.26
USD ALPHABET INC 1.99800% 16-15.08.26	3 150 000.00	3 140 667.59	0.26
USD AMERICAN EXPRESS CO 3.40000% 18-27.02.23	1 900 000.00	1 973 458.75	0.17
USD APPLE INC 2.00000% 15-06.05.20	4 475 000.00	4 477 938.73	0.38
USD APPLE INC 2.40000% 13-03.05.23	4 075 000.00	4 137 146.20	0.35
USD APPLE INC 2.45000% 16-04.08.26	3 075 000.00	3 122 677.26	0.26
USD APPLE INC 2.85000% 16-23.02.23	4 250 000.00	4 362 829.85	0.37
USD APPLE INC 3.20000% 17-11.05.27	2 350 000.00	2 493 098.55	0.21
USD APPLE INC 3.25000% 16-23.02.26	4 000 000.00	4 246 116.00	0.36
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.62500% 19-30.01.24	2 000 000.00	2 073 489.20	0.17
USD BANK OF NOVA SCOTIA 2.00000% 19-15.11.22	1 410 000.00	1 408 149.63	0.12
USD BAYER US FINANCE II LLC-REG-S 3.87500% 18-15.12.23	1 400 000.00	1 468 894.42	0.12

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)

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 比率 (%)
USD	BERKSHIRE HATHAWAY INC 2.20000% 16-15.03.21	1 750 000.00	0.15
USD	BERKSHIRE HATHAWAY INC 3.12500% 16-15.03.26	1 075 000.00	0.09
USD	BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 1.75000% 19-27.09.24	750 000.00	0.06
USD	CHEVRON CORP 2.41900% 15-17.11.20	2 300 000.00	0.19
USD	CHEVRON CORP 3.19100% 13-24.06.23	4 950 000.00	0.43
USD	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 3.90000% 18-16.03.28	1 000 000.00	0.09
USD	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 3.35000% 19-04.06.24	500 000.00	0.04
USD	CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 4.37500% 12-15.06.22	3 400 000.00	0.30
USD	COUNCIL OF EUROPE DEVELOPMENT BANK 1.62500% 16-16.03.21	800 000.00	0.07
USD	DEXIA CREDIT LOCAL SA-REG-S 2.50000% 18-25.01.21	1 500 000.00	0.13
USD	EQUINOR ASA 3.62500% 18-10.09.28	2 000 000.00	0.19
USD	EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.00000% 16-15.03.21	3 500 000.00	0.30
USD	EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.25000% 16-16.12.19	4 550 000.00	0.38
USD	EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.37500% 17-24.05.27	2 000 000.00	0.17
USD	EXPORT DEVELOPMENT CANADA 2.00000% 17-17.05.22	800 000.00	0.07
USD	EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 2.50000% 15-10.05.21	800 000.00	0.07
USD	EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 3.25000% 15-10.11.25	1 200 000.00	0.11
USD	EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 2.75000% 17-25.01.22	2 775 000.00	0.24
USD	EXXON MOBIL CORP 3.04300% 16-01.03.26	4 350 000.00	0.39
USD	HSBC BANK PLC-REG-S 4.12500% 10-12.08.20	500 000.00	0.04
USD	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.37500% 17-07.07.27	900 000.00	0.08
USD	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.25000% 19-18.06.29	2 450 000.00	0.21
USD	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.00000% 19-23.07.26	2 300 000.00	0.20
USD	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 2.85000% 19-13.05.22	2 400 000.00	0.21
USD	INTL BK FOR RECONS & DEV WORLD BK 1.75000% 19-23.10.29	1 900 000.00	0.16
USD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.12500% 17-13.12.21	4 400 000.00	0.37
USD	JOHNSON & JOHNSON 2.45000% 16-01.03.26	2 075 000.00	0.18
USD	JOHNSON & JOHNSON 2.90000% 17-15.01.28	1 000 000.00	0.09
USD	JOHNSON & JOHNSON 3.37500% 13-05.12.23	975 000.00	0.09
USD	KOREA DEVELOPMENT BANK 2.75000% 17-19.03.23	1 650 000.00	0.14
USD	KOREA EAST-WEST POWER CO LTD-REG-S 3.87500% 18-19.07.23	2 360 000.00	0.21
USD	KOREA HYDRO&NUCLEAR POWER CO LTD-REG-S 3.00000% 12-19.09.22	1 150 000.00	0.10
USD	KOREA HYDRO&NUCLEAR POWER CO LTD-REG-S 3.12500% 17-25.07.27	1 575 000.00	0.14
USD	KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.12500% 13-17.01.23	3 625 000.00	0.31
USD	KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.00000% 15-02.05.25	1 075 000.00	0.09
USD	KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 1.62500% 16-15.03.21	5 000 000.00	0.42
USD	KUWAIT INTERNATIONAL GOVT BOND-REG-S 3.50000% 17-20.03.27	2 400 000.00	0.22
USD	LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 2.00000% 15-13.01.25	3 200 000.00	0.27
USD	MANITOBA, PROVINCE OF 2.12500% 17-04.05.22	4 900 000.00	0.42
USD	MICROSOFT CORP 2.65000% 15-03.11.22	2 950 000.00	0.25
USD	MICROSOFT CORP 2.87500% 17-06.02.24	3 575 000.00	0.31
USD	MICROSOFT CORP 3.30000% 17-06.02.27	5 475 000.00	0.50
USD	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD/NY 2.50000% 16-12.07.26	2 300 000.00	0.19
USD	NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 3.00000% 18-10.01.28	950 000.00	0.08
USD	NORDEA BANK AB-REG-S 4.87500% 10-27.01.20	900 000.00	0.08
USD	NORDIC INVESTMENT BANK 2.25000% 14-30.09.21	750 000.00	0.06
USD	NOVARTIS CAPITAL CORP 2.40000% 12-21.09.22	3 400 000.00	0.29
USD	NOVARTIS CAPITAL CORP 3.10000% 17-17.05.27	2 600 000.00	0.23
USD	QATAR, STATE OF-REG-S 2.37500% 16-02.06.21	4 250 000.00	0.36
USD	QATAR, STATE OF-REG-S 3.37500% 19-14.03.24	2 400 000.00	0.21
USD	QUEBEC, PROVINCE OF 2.50000% 16-20.04.26	2 725 000.00	0.24
USD	ROCHE HOLDINGS INC-REG-S 3.00000% 15-10.11.25	2 675 000.00	0.24
USD	ROCHE HOLDINGS INC-REG-S 3.62500% 18-17.09.28	2 000 000.00	0.19
USD	SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 2.25000% 12-06.01.23	1 200 000.00	0.10
USD	SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 1.87500% 16-10.05.21	900 000.00	0.08

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)

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 比率 (%)
USD SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 2.87500% 16-10.05.26	1 675 000.00	1 735 364.82	0.15
USD SINOPEC GROUP OVERSEAS DEV 2013-REG-S 4.37500% 13-17.10.23	250 000.00	266 705.00	0.02
USD SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMNT-REG-S 2.50000% 15-28.04.20	650 000.00	650 213.26	0.05
USD TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.70000% 13-15.01.24	1 150 000.00	1 222 342.36	0.10
USD WALMART INC 2.55000% 13-11.04.23	2 675 000.00	2 728 946.46	0.23
USD WALMART INC 3.70000% 18-26.06.28	3 000 000.00	3 316 926.60	0.28
USD WELLS FARGO CO 3.50000% 12-08.03.22	1 200 000.00	1 237 138.80	0.10
USD WESTPAC BANKING CORP 2.85000% 16-13.05.26	5 000 000.00	5 107 100.00	0.43
USD WESTPAC BANKING CORP 3.35000% 17-08.03.27	1 000 000.00	1 054 550.00	0.09
米ドル合計		187 641 668.85	15.80

ノート、固定利付債合計		187 641 668.85	15.80
-------------	--	----------------	-------

## 中期債券、固定利付債

## 米ドル

USD AFRICAN DEVELOPMENT BANK 2.37500% 14-23.09.21	1 725 000.00	1 745 407.79	0.15
USD ASB FINANCE LTD-REG-S 2.12500% 16-01.09.21	1 400 000.00	1 399 860.00	0.12
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.62500% 17-12.01.27	1 550 000.00	1 633 747.12	0.14
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.00000% 17-16.02.22	4 500 000.00	4 531 410.00	0.38
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.50000% 17-02.11.27	2 900 000.00	3 038 931.75	0.26
USD AUSTRALIA & NZ BANKING GRP-REG-S 5.10000% 10-13.01.20	1 000 000.00	1 003 412.00	0.08
USD BANK OF AMERICA CORP 3.24800% 16-21.10.27	1 800 000.00	1 876 644.00	0.16
USD BANK OF MONTREAL 1.90000% 16-27.08.21	1 100 000.00	1 099 109.53	0.09
USD BELGIUM, KINGDOM OF-REG-S 1.62500% 17-15.01.20	900 000.00	899 703.00	0.08
USD CAISSE D'AMOR DE LA DETTE SOCIALE-REG-S 3.37500% 14-20.03.24	1 350 000.00	1 437 463.80	0.12
USD CLIFFORD CAPITAL PTE LTD-REG-S 1.73300% 19-10.09.24	1 750 000.00	1 729 122.50	0.15
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 3.15000% 17-19.09.27	625 000.00	654 800.00	0.05
USD CPPIB CAPITAL INC-REG-S 2.75000% 17-02.11.27	3 125 000.00	3 295 420.30	0.28
USD FINNVERA OYJ-REG-S 1.87500% 17-05.10.20	800 000.00	800 120.00	0.07
USD IDB TRUST SERVICES LTD-REG-S 2.26100% 17-26.09.22	1 800 000.00	1 803 600.00	0.15
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 1.62500% 17-12.05.20	1 875 000.00	1 874 119.75	0.16
USD INTERNATIONAL FINANCE CORP 2.12500% 16-07.04.26	1 000 000.00	1 019 485.90	0.09
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 17-22.11.27	3 195 000.00	3 355 609.13	0.28
USD JAPAN TOBACCO INC-REG-S 2.80000% 16-13.04.26	1 400 000.00	1 412 852.00	0.12
USD KOMMUNEKREDIT-REG-S 1.62500% 16-01.06.21	1 825 000.00	1 819 849.85	0.15
USD LANDESKREDITBANK B-WUERTT FOERDBK-REG-S 1.37500% 16-21.07.21	875 000.00	869 316.00	0.07
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 3.00000% 17-19.04.24	2 000 000.00	2 048 125.00	0.17
USD MUNICIPALITY FINANCE PLC-REG-S 1.87500% 17-18.09.20	825 000.00	825 057.75	0.07
USD NEDERLANDSE WATERSCHAPSBK NV-REG-S 3.00000% 18-21.12.21	825 000.00	845 303.25	0.07
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 1.87500% 16-09.03.21	1 600 000.00	1 599 801.60	0.13
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 2.37500% 17-18.01.22	950 000.00	959 307.72	0.08
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 3.12500% 18-22.03.23	1 330 000.00	1 378 624.80	0.12
USD NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CORP-REG-S 2.60000% 17-28.09.22	400 000.00	402 157.88	0.03
USD NORDRHEIN-WESTFALEN, STATE OF-REG-S 2.25000% 15-16.04.25	700 000.00	712 490.80	0.06
USD SP POWERASSETS LTD-REG-S 3.25000% 15-24.11.25	1 000 000.00	1 050 820.00	0.09
USD SUMITOMO MITSUI BANKING CORP-REG-S 2.44000% 19-18.06.24	1 186 000.00	1 206 744.20	0.10
USD SVENSK EXPORTKREDIT AB 1.75000% 16-10.03.21	800 000.00	799 662.84	0.07
USD TORONTO-DOMINION BANK 2.50000% 15-14.12.20	3 350 000.00	3 370 635.66	0.28
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 2.60000% 17-11.01.22	1 225 000.00	1 242 606.80	0.10
USD TOYOTA MOTOR FINANCE NL BV-REG-S 2.76400% 19-26.04.21	1 600 000.00	1 613 258.24	0.14
米ドル合計		55 354 580.96	4.66

中期債券、固定利付債合計		55 354 580.96	4.66
--------------	--	---------------	------

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)

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 比率 (%)
<b>債券、固定利付債</b>			
<b>米ドル</b>			
USD	AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT-REG-S 1.62500% 15-21.01.20	1 250 000.00	0.10
USD	BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN NV-REG-S 2.62500% 14-28.04.21	1 400 000.00	0.12
USD	BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN NV-REG-S 2.37500% 16-16.03.26	1 000 000.00	0.09
USD	BANK OF NOVA SCOTIA 1.85000% 15-14.04.20	1 375 000.00	0.12
USD	CAISSE D' AMORTIS DE LA DETTE SOC-REG-S 1.87500% 15-12.02.22	1 400 000.00	0.12
USD	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COM/CAN-REG-S 2.35000% 17-27.07.22	2 275 000.00	0.19
USD	CENTRAL JAPAN RAILWAY CO-REG-S 3.40000% 18-06.09.23	1 400 000.00	0.12
USD	DBS BANK LTD-REG-S 3.30000% 18-27.11.21	1 520 000.00	0.13
USD	DNB BOLIGKREDITT AS-REG-S 2.50000% 17-28.03.22	1 450 000.00	0.12
USD	EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.87500% 15-10.02.25	3 250 000.00	0.28
USD	FAB SUKUK CO LTD-REG-S 3.87500% 19-22.01.24	1 100 000.00	0.10
USD	FMS WERTMANAGEMENT 2.00000% 17-01.08.22	1 375 000.00	0.12
USD	ING BANK NV-REG-S 2.62500% 12-05.12.22	1 200 000.00	0.10
USD	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 3.87500% 10-14.02.20	1 500 000.00	0.13
USD	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.12500% 15-15.01.25	2 000 000.00	0.17
USD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 14-25.11.24	1 825 000.00	0.16
USD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT 2.50000% 15-29.07.25	3 500 000.00	0.31
USD	KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 3.25000% 14-10.07.24	1 550 000.00	0.14
USD	KOREA, REPUBLIC OF 3.87500% 13-11.09.23	1 600 000.00	0.14
USD	KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.50000% 14-20.11.24	3 450 000.00	0.30
USD	MDGH - GMTN BV-REG-S 2.75000% 16-11.05.23	1 500 000.00	0.13
USD	MORGAN STANLEY 5.50000% 10-24.07.20	1 253 000.00	0.11
USD	NOVARTIS CAPITAL CORP 3.40000% 14-06.05.24	450 000.00	0.04
USD	OESTERREICHISCHE KONTROLLBANK AG 2.37500% 14-01.10.21	900 000.00	0.08
USD	ONTARIO, PROVINCE OF 3.20000% 14-16.05.24	3 500 000.00	0.31
USD	ONTARIO, PROVINCE OF 2.50000% 16-27.04.26	2 800 000.00	0.24
USD	ROYAL BANK OF CANADA 2.10000% 15-14.10.20	1 125 000.00	0.09
<b>米ドル合計</b>		<b>48 184 251.47</b>	<b>4.06</b>
<b>債券、固定利付債合計</b>		<b>48 184 251.47</b>	<b>4.06</b>

## 財務省証券(T-note)、固定利付債

<b>米ドル</b>			
USD	AMERICA, UNITED STATES OF 2.62500% 19-15.02.29	4 700 000.00	0.42
USD	AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 15-31.01.22	1 900 000.00	0.16
USD	AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 17-15.02.27	3 350 000.00	0.29
USD	AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 13-15.05.23	9 350 000.00	0.79
USD	AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 17-15.05.20	7 200 000.00	0.61
<b>米ドル合計</b>		<b>26 987 994.84</b>	<b>2.27</b>
<b>財務省証券(T-note)、固定利付債合計</b>		<b>26 987 994.84</b>	<b>2.27</b>

## 財務省証券(T-note)、変動利付債

<b>米ドル</b>			
USD	AMERICA, UNITED STATES OF 3.875%/CPI LINKED 99-15.04.29	2 750 000.00	0.48
USD	AMERICA, UNITED STATES OF 2.375%/CPI LINKED 04-15.01.25	2 780 000.00	0.35
USD	AMERICA, UNITED STATES OF 0.625%/CPI LINKED 16-15.01.26	3 200 000.00	0.30
USD	AMERICA, UNITED STATES OF 1.125%/CPI LINKED 11-15.01.21	1 000 000.00	0.10
USD	AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 12-15.01.22	2 400 000.00	0.23
USD	AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 13-15.01.23	1 895 000.00	0.18

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)

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 比率 (%)
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI LINKED 17-15.01.27	4 395 000.00	4 726 347.97	0.40
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI LINKED 15-15.07.25	3 815 000.00	4 184 768.30	0.35
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.750%/CPI LINKED 18-15.07.28	3 950 000.00	4 240 162.55	0.36
米ドル合計		32 615 399.77	2.75
財務省証券(T-note)、変動利付債合計		32 615 399.77	2.75
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある証券および短期金融商品合計		525 786 714.21	44.26
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券および短期金融商品			
財務省短期証券(T-bills)、ゼロ・クーポン			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 06.12.18-05.12.19	2 500 000.00	2 499 706.40	0.21
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 11.07.19-09.01.20	2 500 000.00	2 495 865.75	0.21
米ドル合計		4 995 572.15	0.42
財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン合計		4 995 572.15	0.42
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD ALTRIA GROUP INC 2.85000% 12-09.08.22	1 600 000.00	1 623 031.04	0.14
USD FANNIE MAE 2.12500% 16-24.04.26	1 625 000.00	1 658 346.95	0.14
USD HSBC HOLDINGS PLC 4.87500% 11-14.01.22	1 025 000.00	1 082 590.14	0.09
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 2.45000% 15-23.11.20	850 000.00	854 471.94	0.07
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD NEW YORK 2.87500% 18-12.04.23	2 000 000.00	2 044 790.60	0.17
USD NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 1.95000% 17-28.09.20	800 000.00	800 484.88	0.07
USD PROCTER & GAMBLE CO 2.30000% 12-06.02.22	3 025 000.00	3 066 489.69	0.26
USD SANOFI 4.00000% 11-29.03.21	2 500 000.00	2 571 300.00	0.21
米ドル合計		13 701 505.24	1.15
ノート、固定利付債合計		13 701 505.24	1.15
ノート、変動利付債			
米ドル			
USD JPMORGAN CHASE BANK NA 3.086%/VAR 18-26.04.21	1 500 000.00	1 505 706.15	0.13
米ドル合計		1 505 706.15	0.13
ノート、変動利付債合計		1 505 706.15	0.13
中期債券、固定利付債			
米ドル			
USD FREDDIE MAC 2.37500% 12-13.01.22	5 225 000.00	5 302 547.88	0.45
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 3.85000% 14-08.07.24	1 000 000.00	1 058 474.80	0.09
USD GUARDIAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 2.00000% 16-26.04.21	1 400 000.00	1 400 618.66	0.12
USD MACQUARIE GROUP LTD-REG-S 6.25000% 11-14.01.21	1 200 000.00	1 250 556.00	0.10
米ドル合計		9 012 197.34	0.76
中期債券、固定利付債合計		9 012 197.34	0.76

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)

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 比率 (%)
<b>中期債券、ゼロ・クーポン債</b>			
米ドル			
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.00000% 00-01.05.30	1 400 000.00	1 099 006.08	0.09
米ドル合計		1 099 006.08	0.09
<b>中期債券、ゼロ・クーポン債合計</b>		1 099 006.08	0.09
<b>債券、固定利付債</b>			
米ドル			
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 1.62500% 19-17.10.22	750 000.00	744 450.00	0.06
USD FEDERAL HOME LOAN BANK SYSTEM 2.00000% 12-09.09.22	2 175 000.00	2 194 170.66	0.18
USD ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 3.35000% 18-22.10.21	1 600 000.00	1 642 653.12	0.14
米ドル合計		4 581 273.78	0.38
<b>債券、固定利付債合計</b>		4 581 273.78	0.38
<b>財務省証券(T-note)、変動利付債</b>			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.625%/CPI LINKED 14-15.01.24	2 740 000.00	3 062 744.99	0.26
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.250%/CPI LINKED 15-15.01.25	4 100 000.00	4 455 996.22	0.38
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 16-15.04.21	2 250 000.00	2 421 117.04	0.20
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 12-15.07.22	2 233 000.00	2 489 122.12	0.21
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI INDEX 13-15.07.23	2 252 000.00	2 504 877.20	0.21
米ドル合計		14 933 857.57	1.26
<b>財務省証券(T-note)、変動利付債合計</b>		14 933 857.57	1.26
<b>他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券および短期金融商品合計</b>		49 829 118.31	4.19
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取引されていない譲渡性のある証券および短期金融商品			
<b>優先株式</b>			
イギリス			
GBP ROLLS ROYCE HLDGS NON CUM RED PREF GBPO.001 C	895 344.00	1 158.12	0.00
イギリス合計		1 158.12	0.00
<b>優先株式合計</b>		1 158.12	0.00
<b>ノート、固定利付債</b>			
米ドル			
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 2.95000% 18-11.01.25	1 100 000.00	1 130 727.73	0.10
USD SVENSKA HANDELSBANKEN AB 1.95000% 17-08.09.20	1 000 000.00	998 890.40	0.08
米ドル合計		2 129 618.13	0.18
<b>ノート、固定利付債合計</b>		2 129 618.13	0.18

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)

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 比率 (%)
<b>債券、固定利付債</b>			
米ドル			
USD HSBC BANK CANADA-REG-S 3.30000% 18-28.11.21	1 300 000.00	1 334 305.83	0.11
USD HSBC BANK CANADA-REG-S 1.65000% 19-10.09.22	1 200 000.00	1 191 774.36	0.10
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 2.75000% 17-22.06.24	800 000.00	815 727.76	0.07
USD SWEDBANK AB-REG-S 2.80000% 17-14.03.22	800 000.00	808 103.04	0.07
米ドル合計		4 149 910.99	0.35
<b>債券、固定利付債合計</b>			
		4 149 910.99	0.35
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取引されていない 譲渡性のある証券および短期金融商品合計			
		6 280 687.24	0.53
ルクセンブルグ2010年12月17日法(改訂済)の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs			
投資信託、オープン・エンド型			
アイルランド			
USD UBS (IRL) ETF PLC - MSCI USA UCITS-ACC-A-USD-ETF	1 766 801.00	30 141 625.06	2.54
USD UBS ETFS PLC - MSCI USA TRN INDEX SF (USD) A-ACC	821 545.00	69 461 629.75	5.85
アイルランド合計		99 603 254.81	8.39
ルクセンブルグ			
USD AQR UCITS FUNDS - GLOBAL RISK PARITY UCITS FUND-A2-CAP	202 803.57	24 212 718.22	2.04
EUR DB PLATINUM IV UBS MULTI-STRATEGY ALTERNATIVES-IOC-E-CAP	4 238.06	46 904 247.41	3.95
USD INVESCO FUNDS SICAV BAL RISK ALLOCATION-PI1-USD HDG-CAP	2 058 593.31	24 353 158.86	2.05
USD UBS (LUX) BOND FUND - EURO HIGH YIELD (EUR) (USD HEDGED) F-ACC	208 136.00	24 041 789.36	2.02
USD UBS (LUX) BOND SICAV - SHORT TERM USD CORPORATES (USD) F- ACC	261 472.00	28 837 746.88	2.43
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD CORPORATES (USD) F-ACC	897 058.00	18 945 864.96	1.60
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD (USD) F-ACC	110 115.00	35 638 719.75	3.00
USD UBS (LUX) BOND SICAV USD - INVEST GRADE CORP USD F ACC	1 938.70	212 554 073.50	17.89
USD UBS (LUX) BOND SICAV - EMERG ECON CORPORATES (USD) F-ACC	210 716.00	23 901 515.88	2.01
USD UBS (LUX) EMERGING ECONOMIES FUND - GLOBAL BONDS (USD) F- ACC	17 683.00	35 547 427.58	2.99
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD U-X-ACC	9.00	99 798.30	0.01
ルクセンブルグ合計		475 037 060.70	39.99
投資信託、オープン・エンド型合計			
		574 640 315.51	48.38
ルクセンブルグ2010年12月17日法(改訂済)の第41条(1)e)に規定され たUCITS/その他のUCIs合計			
		574 640 315.51	48.38
投資有価証券合計			
		1 156 536 835.27	97.36

## 派生商品

## 公認の証券取引所に上場されている派生商品

## 債券に係る金融先物

USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 20.03.20	-228.00	146 062.50	0.01
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.20	-359.00	75 726.74	0.01
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 20.03.20	-302.00	132 125.00	0.01
USD US LONG BOND FUTURE 20.03.20	-31.00	31 000.00	0.00
債券に係る金融先物合計		384 914.24	0.03

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)

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 比率 (%)			
<b>指数に係る金融先物</b>						
EUR	EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 20.12.19	192.00	166 272.08	0.01		
CHF	SWISS MARKET INDEX FUTURE 20.12.19	7.00	18 937.31	0.00		
GBP	FTSE 100 INDEX FUTURE 20.12.19	46.00	30 090.78	0.00		
SGD	MSCI SINGAPORE INDEX FUTURE 30.12.19	18.00	-2 764.27	0.00		
USD	S&P500 EMINI FUTURE 20.12.19	585.00	3 416 360.17	0.29		
JPY	TOPIX INDX FUTURE 12.12.19	60.00	224 159.35	0.02		
USD	MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 20.12.19	267.00	-176 835.44	-0.01		
AUD	SPI 200 INDEX FUTURE 19.12.19	22.00	41 444.91	0.00		
CAD	S&P/TSX 60 INDEX FUTURE 19.12.19	25.00	137 605.33	0.01		
HKD	HANG SENG INDEX FUTURE 30.12.19	7.00	-35 367.76	0.00		
<b>指数に係る金融先物合計</b>			<b>3 819 902.46</b>	<b>0.32</b>		
<b>公認の証券取引所に上場されている派生商品合計</b>			<b>4 204 816.70</b>	<b>0.35</b>		
<b>派生商品合計</b>			<b>4 204 816.70</b>	<b>0.35</b>		
<b>先渡為替契約</b>						
<b>先渡為替契約(購入/売却)</b>						
USD	18 100 460.58	CHF	17 940 000.00	9.1.2020	85 395.89	0.01
USD	11 885 845.00	GBP	9 370 000.00	9.1.2020	-254 692.08	-0.02
USD	608 471.41	JPY	65 500 000.00	9.1.2020	8 372.52	0.00
HKD	1 650 000.00	USD	210 496.88	9.1.2020	200.85	0.00
USD	121 042.57	CAD	160 000.00	9.1.2020	537.14	0.00
USD	73 058.88	SGD	100 000.00	9.1.2020	-97.26	0.00
USD	203 460.00	AUD	300 000.00	9.1.2020	315.22	0.00
USD	52 533 366.91	EUR	47 424 000.00	9.1.2020	83 753.94	0.01
USD	836 354.18	EUR	750 000.00	9.1.2020	6 875.23	0.00
USD	606 223.00	CHF	600 000.00	9.1.2020	3 712.48	0.00
USD	76 660.84	CAD	100 000.00	9.1.2020	1 344.94	0.00
USD	15 584 751.33	GBP	12 067 000.00	15.1.2020	-52 747.32	-0.01
USD	244 701.00	CAD	321 000.00	15.1.2020	2 933.45	0.00
USD	73 767.47	SGD	100 000.00	15.1.2020	606.30	0.00
USD	1 065 759.53	HKD	8 350 000.00	15.1.2020	-477.47	0.00
USD	291 327.12	AUD	420 000.00	15.1.2020	6 884.03	0.00
USD	21 011 022.21	CHF	20 698 000.00	15.1.2020	217 971.16	0.02
USD	742 861.15	JPY	80 500 000.00	15.1.2020	5 107.60	0.00
USD	65 891 239.89	EUR	58 918 000.00	15.1.2020	705 920.87	0.06
USD	834 785.93	EUR	750 000.00	9.1.2020	5 306.98	0.00
USD	835 097.93	EUR	750 000.00	15.1.2020	5 317.74	0.00
GBP	13 391 500.00	USD	17 281 307.58	16.1.2020	73 060.72	0.01
SEK	9 004 500.00	USD	939 307.75	16.1.2020	4 180.45	0.00
CHF	165 636 700.00	USD	166 733 808.46	16.1.2020	-325 187.36	-0.03
EUR	273 933 200.00	USD	302 855 067.26	16.1.2020	235 735.40	0.02
SGD	40 855 700.00	USD	29 942 322.35	16.1.2020	-51 473.00	-0.01
USD	3 636 155.78	EUR	3 290 600.00	16.1.2020	-4 697.52	0.00
SGD	428 100.00	USD	313 651.42	16.1.2020	-444.88	0.00
EUR	2 500 000.00	USD	2 762 610.00	15.1.2020	3 323.97	0.00
EUR	2 500 000.00	USD	2 761 572.50	9.1.2020	3 357.33	0.00
USD	5 507 165.00	EUR	5 000 000.00	2.12.2019	-5 835.00	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)

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 比率 (%)
先渡為替契約(続き)			
先渡為替契約(購入/売却)			
SGD	298 900.00	USD 219 119.64 16.1.2020	-438.41 0.00
USD	742 239.94	CHF 738 600.00 16.1.2020	197.82 0.00
USD	135 912.35	SGD 185 600.00 16.1.2020	123.67 0.00
USD	331 488.30	EUR 300 000.00 9.1.2020	-303.28 0.00
USD	331 610.70	EUR 300 000.00 15.1.2020	-301.38 0.00
USD	602 041.16	CHF 600 000.00 9.1.2020	-469.36 0.00
USD	602 289.36	CHF 600 000.00 15.1.2020	-466.01 0.00
先渡為替契約(購入/売却)合計			762 905.37 0.06
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産			27 164 517.22 2.29
その他の資産および負債			-825 643.05 -0.06
純資産総額			1 187 843 431.51 100.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)

## 2019年11月30日現在の投資有価証券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 比率 (%)
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある証券および短期金融商品			
無記名株式			
オーストラリア			
AUD AGL ENERGY NPV	8 287.00	114 404.72	0.02
AUD ALUMINA LTD NPV	23 044.00	36 005.88	0.01
AUD AMP LIMITED NPV(POST RECON)	42 571.00	56 294.28	0.01
AUD APA GROUP NPV	12 962.00	96 442.46	0.02
AUD ARISTOCRAT LEISURE NPV	7 167.00	164 435.98	0.03
AUD ASX LTD NPV	2 586.00	142 924.71	0.02
AUD AURIZON HOLDINGS NPV	24 419.00	95 468.33	0.02
AUD AUSNET SERVICES NPV	11 781.00	13 865.48	0.00
AUD AUST & NZ BANK GRP NPV	35 682.00	599 520.97	0.10
AUD BLUESCOPE STEEL NPV	5 942.00	58 478.91	0.01
AUD BORAL LIMITED NPV	12 589.00	43 768.13	0.01
AUD BRAMBLES LTD NPV	19 096.00	162 102.51	0.03
AUD CALTEX AUSTRALIA NPV	2 957.00	69 123.97	0.01
AUD CHALLENGER LIMITED NPV	6 265.00	34 494.44	0.01
AUD CIMIC GROUP LTD NPV	1 223.00	27 828.26	0.00
AUD CMNWLTH BK OF AUST NPV	22 052.00	1 205 508.92	0.20
AUD COCA-COLA AMATIL NPV	5 842.00	44 968.40	0.01
AUD COCHLEAR LTD NPV	739.00	116 962.15	0.02
AUD COMPUTERSHARE LTD NPV(POST REC)	6 701.00	80 362.22	0.01
AUD CROWN RESORTS LTD NPV	4 640.00	40 517.98	0.01
AUD CSL NPV	5 642.00	1 081 830.21	0.18
AUD DEXUS NPV (STAPLED)	13 519.00	111 834.20	0.02
AUD FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD NPV	674.00	20 073.00	0.00
AUD FORTESCUE METALS G NPV	16 261.00	107 019.69	0.02
AUD GOODMAN GROUP (STAPLED SECURITY)	19 704.00	197 517.78	0.03
AUD GPT GROUP NPV (STAPLED SECURITIES)	22 772.00	94 728.33	0.02
AUD HARVEY NORMAN HLDG NPV	5 619.00	16 342.97	0.00
AUD INCITEC PIVOT NPV	15 269.00	33 359.28	0.01
AUD INSURANCE AUST GRP NPV	27 406.00	146 260.23	0.03
AUD LEND LEASE GROUP NPV	7 608.00	99 370.25	0.02
AUD MACQUARIE GP LTD NPV	4 104.00	383 219.29	0.07
AUD MAGELLAN FINANCIAL NPV	1 537.00	54 570.01	0.01
AUD MEDIBANK PRIVATE L NPV	32 647.00	71 988.72	0.01
AUD MIRVAC GROUP STAPLED SECURITIES	39 554.00	90 162.08	0.02
AUD NATL AUSTRALIA BK NPV	35 180.00	616 072.02	0.10
AUD NEWCREST MINING NPV	9 222.00	191 873.52	0.03
AUD ORICA LIMITED NPV	5 238.00	84 252.14	0.01
AUD ORIGIN ENERGY NPV	21 697.00	127 679.90	0.02
AUD QBE INS GROUP NPV	16 131.00	138 351.59	0.02
AUD RAMSAY HEALTH CARE NPV	2 249.00	111 018.90	0.02
AUD REA GROUP LIMITED NPV	810.00	57 177.17	0.01
AUD RIO TINTO LIMITED NPV	4 763.00	312 182.07	0.05
AUD SANTOS LIMITED NPV	22 155.00	122 132.98	0.02
AUD SCENTRE GROUP NPV STAPLED UNIT	58 743.00	156 551.03	0.03
AUD SEEK LIMITED NPV	3 790.00	59 448.86	0.01
AUD SONIC HEALTHCARE NPV	5 581.00	113 702.65	0.02
AUD SOUL PATTINSON(WH) NPV	1 286.00	19 415.06	0.00
AUD SOUTH32 LTD NPV	53 162.00	97 088.70	0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)

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 比率 (%)
AUD STOCKLAND NPV (STAPLED)	28 904.00	98 730.86	0.02
AUD SUNCORP GROUP LTD NPV	15 382.00	139 210.67	0.02
AUD SYDNEY AIRPORT NPV(STAPLED SECURITY)	12 051.00	74 828.90	0.01
AUD TABCORP HLDGS LTD NPV	20 137.00	65 243.00	0.01
AUD TELSTRA CORP NPV	46 492.00	121 386.15	0.02
AUD TPG TELECOM LTD NPV	4 194.00	19 829.38	0.00
AUD TRANSURBAN GROUP STAPLED UNITS NPV	33 658.00	349 462.26	0.06
AUD TREASURY WINE ESTA NPV	9 247.00	116 962.34	0.02
AUD VICINITY CENTRES NPV (STAPLED SECURITY)	28 961.00	52 499.11	0.01
AUD WESFARMERS LTD NPV	14 252.00	408 449.04	0.07
AUD WESTPAC BKG CORP NPV	43 074.00	714 396.41	0.12
AUD WOODSIDE PETROLEUM NPV	12 099.00	282 421.68	0.05
AUD WOOLWORTHS GRP LTD NPV	15 921.00	428 174.02	0.07
AUD WORLEY LIMITED NPV	5 513.00	55 934.90	0.01
オーストラリア合計		10 846 230.05	1.84
オーストリア			
EUR ANDRITZ AG NPV(BR)	931.00	36 338.83	0.00
EUR ERSTE GROUP BK AG NPV	4 352.00	155 951.74	0.02
EUR OMV AG NPV(VAR)	2 012.00	114 781.63	0.02
EUR RAIFFEISEN BK INTL NPV (REGD)	1 627.00	38 228.65	0.01
EUR VERBUND AG CLASS ' A ' NPV	890.00	46 298.39	0.01
EUR VOESTALPINE AG NPV	1 622.00	43 011.43	0.01
オーストリア合計		434 610.67	0.07
ベルギー			
EUR ANHEUSER-BUSCH IN NPV	10 105.00	800 759.22	0.13
EUR COLRUYT SA NPV	736.00	38 141.14	0.01
EUR GALAPAGOS NV NPV	338.00	66 653.60	0.01
EUR GPE BRUXELLES LAM NPV	1 220.00	123 890.34	0.02
EUR PROXIMUS SA NPV	2 034.00	61 404.81	0.01
EUR SOLVAY SA NPV	1 042.00	119 486.56	0.02
EUR UMICORE NPV	2 508.00	107 792.20	0.02
ベルギー合計		1 318 127.87	0.22
カナダ			
CAD 1ST CAP REALTY INC COM NPV	1 500.00	24 370.41	0.00
CAD AIR CANADA VAR VTG SHS NPV	1 045.00	39 376.81	0.01
CAD ALTAGAS LTD COM NPV	2 076.00	30 790.29	0.01
CAD ATCO LTD CL 1 NON VTG	600.00	22 762.28	0.00
CAD AURORA CANNABIS IN COM NPV	5 000.00	12 497.65	0.00
CAD BOMBARDIER INC CLASS ' B ' SUB-VTG NPV	13 579.00	20 139.76	0.00
CAD CAE INC COM NPV	2 100.00	56 426.88	0.01
CAD CAMECO CORP COM	2 930.00	26 691.51	0.00
CAD CANADIAN UTILS LTD CL A	975.00	28 671.94	0.01
CAD CANOPY GROWTH CORP COM NPV	1 800.00	33 215.13	0.01
CAD CI FINANCIAL CORP COM NPV	1 942.00	30 586.59	0.01
CAD EMERA INC COM	1 983.00	81 544.48	0.01
CAD EMPIRE LTD CL A	1 300.00	34 813.48	0.01
CAD HUSKY ENERGY INC COM	2 604.00	18 957.79	0.00
CAD HYDRO ONE INC COM NPV	2 493.00	46 960.18	0.01
CAD IGM FINANCIAL INC COM	1 126.00	32 383.36	0.01
CAD KEYERA CORPORATION COM NPV	1 670.00	40 748.88	0.01
CAD KINROSS GOLD CORP COM NPV	10 773.00	46 555.26	0.01
CAD KIRKLAND LAKE GOLD COM NPV	1 600.00	67 204.22	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)

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 比率 (%)
CAD LUNDIN MINING CORP COM	4 800.00	25 983.06	0.00
CAD METHANEX CORP COM	500.00	18 607.19	0.00
CAD ONEX CORP SUB VTG	900.00	53 596.84	0.01
CAD PRAIRIESKY ROYALTY COM NPV	1 600.00	16 502.92	0.00
CAD QUEBECOR INC CL B	1 500.00	37 199.32	0.01
CAD STARS GROUP INC(TH COM NPV)	2 200.00	52 720.50	0.01
CAD TELUS CORPORATION NPV	1 623.00	61 266.49	0.01
CAD WEST FRASER TIMBER COM NPV	400.00	17 397.33	0.00
CAD WSP GLOBAL INC COM NPV	1 000.00	64 543.57	0.01
<b>カナダ合計</b>		<b>1 042 514.12</b>	<b>0.18</b>
<b>フィンランド</b>			
EUR KONE CORPORATION NPV ORD ' B '	4 627.00	289 880.31	0.05
EUR METSO OYJ NPV	1 592.00	61 085.80	0.01
EUR WARTSILA OYJ ABP SER ' B ' EUR3.50	5 344.00	53 832.00	0.01
<b>フィンランド合計</b>		<b>404 798.11</b>	<b>0.07</b>
<b>フランス</b>			
EUR ACCOR EUR3	2 607.00	111 615.99	0.02
EUR ADP EUR3	367.00	71 826.12	0.01
EUR AIR LIQUIDE(L ' ) EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)	6 349.00	861 400.13	0.15
EUR AIRBUS EUR1	7 766.00	1 142 276.40	0.19
EUR ALSTOM EUR7.00	1 957.00	85 405.26	0.01
EUR AMUNDI EUR2.5 (AIW)	886.00	67 113.28	0.01
EUR ARKEMA EUR10	979.00	101 532.63	0.02
EUR ATOS SE EUR1	1 367.00	116 179.15	0.02
EUR AXA EUR2.29	25 986.00	707 565.18	0.12
EUR BIOMERIEUX NPV (POST SPLIT)	509.00	46 048.38	0.01
EUR BNP PARIBAS EUR2	15 238.00	856 368.32	0.14
EUR BOLLORE EURO.16	10 890.00	46 588.38	0.01
EUR BOUYGUES EUR1	3 090.00	126 332.82	0.02
EUR BUREAU VERITAS EURO.12	3 885.00	101 778.36	0.02
EUR CAPGEMINI EUR8	2 160.00	255 666.48	0.04
EUR CARREFOUR EUR2.50	7 961.00	131 491.42	0.02
EUR CASINO GUICH-PERR EUR1.53	782.00	34 437.59	0.01
EUR CIE DE ST-GOBAIN EUR4	6 749.00	273 473.20	0.05
EUR CNP ASSURANCES EUR1	2 167.00	42 816.87	0.01
EUR COVIVIO EUR3	559.00	61 881.88	0.01
EUR CREDIT AGRICOLE SA EUR3	15 049.00	206 002.44	0.03
EUR DANONE EURO.25	8 275.00	681 746.40	0.12
EUR DASSAULT AVIATION EUR8	33.00	44 936.46	0.01
EUR DASSAULT SYSTEMES EURO.50	1 766.00	278 448.40	0.05
EUR EDENRED EUR2	3 164.00	157 162.62	0.03
EUR EDF EURO.5	8 212.00	84 424.64	0.01
EUR EIFFAGE EUR4	1 141.00	124 674.40	0.02
EUR ENGIE EUR1	24 520.00	388 233.40	0.07
EUR ESSILORLUXOTTICA EURO.18	3 811.00	592 483.21	0.10
EUR EURAZEO NPV	606.00	41 326.66	0.01
EUR EUTELSAT COMMUNICA EUR1	2 294.00	37 662.24	0.01
EUR FAURECIA EUR7	961.00	51 009.08	0.01
EUR GETLINK SE EURO.40	5 498.00	92 810.67	0.02
EUR HERMES INTL NPV	416.00	311 903.49	0.05
EUR ICADE NPV	290.00	29 049.65	0.00
EUR ILIAD NPV	292.00	37 202.39	0.01
EUR INGENICO GROUP EUR1	827.00	88 321.81	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)

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 比率 (%)
EUR IPSEN EUR1	486.00	54 926.02	0.01
EUR JC DECAUX SA NPV	787.00	22 561.40	0.00
EUR KERING EUR4	1 030.00	620 875.16	0.11
EUR KLEPIERRE EUR1.40	3 008.00	108 022.34	0.02
EUR L' OREAL EURO.20	3 390.00	966 972.48	0.16
EUR LEGRAND SA EUR4	3 634.00	287 210.89	0.05
EUR LVMH MOET HENNESSY EURO.30	3 707.00	1 664 772.85	0.28
EUR NATIXIS EUR1.6	13 893.00	58 102.77	0.01
EUR ORANGE EUR4	27 188.00	449 662.33	0.08
EUR PERNOD RICARD EUR1.55	2 860.00	525 677.78	0.09
EUR PEUGEOT SA EUR1	8 147.00	196 904.78	0.03
EUR PUBLICIS GROUPE SA EURO.40	2 755.00	121 324.26	0.02
EUR REMY COINTREAU EUR1.60	302.00	38 925.97	0.01
EUR RENAULT SA EUR3.81	2 515.00	120 502.42	0.02
EUR SAFRAN EURO.20	4 334.00	709 393.32	0.12
EUR SANOFI EUR2	15 085.00	1 405 631.25	0.24
EUR SARTORIUS STEDIM B EURO.20 (POST SUBD)	414.00	65 778.25	0.01
EUR SCHNEIDER ELECTRIC EUR8	7 277.00	702 869.13	0.12
EUR SCOR SE EUR7.876972 (POST CONS)	2 275.00	97 803.10	0.02
EUR SEB SA EUR1	306.00	47 572.78	0.01
EUR SOC GENERALE EUR1.25	10 142.00	319 374.18	0.05
EUR SODEXO EUR4	1 203.00	140 336.06	0.02
EUR SUEZ EUR4	4 632.00	68 615.81	0.01
EUR TELEPERFORMANCE EUR2.50	813.00	192 728.97	0.03
EUR THALES EUR3	1 397.00	136 966.34	0.02
EUR TOTAL EUR2.5	31 805.00	1 670 648.71	0.28
EUR UBISOFT ENTERTAIN EURO.31	1 104.00	67 071.60	0.01
EUR UNIBAIL-RODAMCO-WE NPV(1 ORD UNIBAIL-R & 1CLS)	1 874.00	293 204.05	0.05
EUR VALEO EUR1 (POST SUBD)	3 419.00	134 807.67	0.02
EUR VEOLIA ENVIRONNEME EUR5	6 990.00	179 114.72	0.03
EUR VINCI EUR2.50	6 757.00	737 427.55	0.12
EUR VIVENDI SA EUR5.50	12 360.00	339 613.15	0.06
EUR WENDEL EUR4	311.00	41 937.72	0.01
EUR WORLDLINE EURO.68	1 173.80	76 036.12	0.01
<b>フランス合計</b>		<b>21 152 567.73</b>	<b>3.58</b>
<b>ドイツ</b>			
EUR BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG EUR1	4 505.00	364 096.71	0.06
EUR BEIERSDORF AG NPV	1 400.00	163 394.29	0.03
EUR CARL ZEISS MEDITEC NPV	487.00	59 603.25	0.01
EUR COMMERZBANK AG NPV	14 791.00	85 799.32	0.02
EUR CONTINENTAL AG ORD NPV	1 523.00	199 160.21	0.03
EUR COVESTRO AG NPV	2 294.00	107 497.99	0.02
EUR DEUTSCHE WOHNEN AG NPV (BR)	4 643.00	181 481.73	0.03
EUR FRAPORT AG NPV	582.00	49 617.26	0.01
EUR FRESENIUS MED CARE NPV	2 963.00	217 451.77	0.04
EUR FRESENIUS SE & CO. KGAA NPV	5 659.00	309 734.41	0.05
EUR GEA GROUP AG NPV	1 810.00	58 214.74	0.01
EUR HEIDELBERGCEMENT NPV	2 083.00	154 109.63	0.03
EUR HENKEL AG & CO KGAA	1 347.00	130 400.75	0.02
EUR HOCHTIEF AG NPV	336.00	41 307.81	0.01
EUR KION GROUP AG NPV	952.00	63 211.44	0.01
EUR KNORR BREMSE AG NPV	606.00	58 986.54	0.01
EUR LANXESS AG NPV	1 243.00	82 917.17	0.01
EUR MERCK KGAA NPV	1 708.00	199 623.52	0.03

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)

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 比率 (%)
EUR METRO AG (NEW) NPV	2 118.00	34 153.86	0.01
EUR PUMA SE NPV	1 040.00	78 205.21	0.01
EUR RWE AG (NEU) NPV	7 296.00	216 479.37	0.04
EUR SAP AG ORD NPV	13 136.00	1 788 453.89	0.30
EUR SYMRISE AG NPV (BR)	1 813.00	175 993.17	0.03
EUR THYSSENKRUPP AG NPV	5 292.00	66 401.84	0.01
EUR VOLKSWAGEN AG ORD NPV	399.00	76 175.16	0.01
EUR WIRECARD AG NPV	1 591.00	210 157.54	0.04
EUR ZALANDO SE NPV	1 788.00	77 083.65	0.01
<b>ドイツ合計</b>		<b>5 249 712.23</b>	<b>0.89</b>
<b>アイルランド</b>			
EUR AIB GROUP PLC ORD EURO.625	7 309.00	23 934.94	0.00
EUR BANK OF IRELAND GR EUR1	9 786.00	49 202.60	0.01
GBP DCC ORD EURO.25	1 069.00	91 372.22	0.02
EUR FLUTTER ENTERTAINM ORD EURO.09	926.00	106 184.79	0.02
EUR KERRY GROUP 'A' ORD EURO.125(DUBLIN LIST)	1 912.00	245 391.13	0.04
<b>アイルランド合計</b>		<b>516 085.68</b>	<b>0.09</b>
<b>イタリア</b>			
EUR ASSIC GENERALI SPA EUR1	13 990.00	285 832.18	0.05
EUR FINECOBANK SPA EURO.33	8 113.00	100 725.13	0.02
EUR LEONARDO SPA EUR4.40	5 881.00	68 831.81	0.01
EUR POSTE ITALIANE SPA NPV	7 596.00	88 694.95	0.01
EUR TELECOM ITALIA SPA DI RISP EURO.55	80 126.00	49 385.93	0.01
EUR TELECOM ITALIA SPA EURO.55	112 445.00	70 446.49	0.01
<b>イタリア合計</b>		<b>663 916.49</b>	<b>0.11</b>
<b>日本</b>			
JPY アコム	1 600.00	6 633.18	0.00
JPY アドバンテスト	1 300.00	63 510.18	0.01
JPY イオンフィナンシャルサービス	800.00	12 090.22	0.00
JPY エア・ウォーター	900.00	14 448.00	0.00
JPY アイシン精機	900.00	34 024.29	0.01
JPY アマダホールディングス	2 700.00	30 079.44	0.01
JPY あおぞら銀行	800.00	20 367.09	0.00
JPY 朝日インテック	1 200.00	34 955.71	0.01
JPY バンダイナムコホールディングス	1 300.00	78 788.24	0.01
JPY ベネッセホールディングス	400.00	10 548.81	0.00
JPY 京都銀行	600.00	24 737.47	0.00
JPY カルビー	600.00	19 313.30	0.00
JPY 東海旅客鉄道	1 000.00	201 762.39	0.03
JPY 千葉銀行	3 000.00	17 094.33	0.00
JPY 中外製薬	1 500.00	130 919.55	0.02
JPY コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	700.00	16 804.86	0.00
JPY コンコルディア・フィナンシャルグループ	6 600.00	26 759.20	0.00
JPY クレディセゾン	1 100.00	18 180.99	0.00
JPY サイバーエージェント	900.00	31 065.66	0.01
JPY 第一生命ホールディングス	6 600.00	106 253.31	0.02
JPY ダイセル	1 700.00	16 703.50	0.00
JPY ダイフク	700.00	40 717.74	0.01
JPY 第一三共	4 000.00	250 643.78	0.04
JPY ダイキン工業	1 700.00	244 420.60	0.04
JPY 大東建託	500.00	61 113.14	0.01
JPY 大和ハウス工業	3 900.00	119 268.56	0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)

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 比率 (%)
JPY 大和ハウスリート投資法人	15.00	41 009.95	0.01
JPY 電通	1 600.00	58 003.84	0.01
JPY ディスコ	200.00	43 137.61	0.01
JPY エーザイ	1 700.00	125 897.18	0.02
JPY ファナック	1 400.00	267 254.13	0.05
JPY ファーストリテイリング	400.00	243 594.19	0.04
JPY 富士電機	1 000.00	30 773.45	0.01
JPY ふくおかフィナンシャルグループ	800.00	15 231.49	0.00
JPY G M O ペイメントゲートウェイ	200.00	14 172.22	0.00
JPY 阪急阪神ホールディングス	1 800.00	77 253.22	0.01
JPY 光通信	200.00	46 607.62	0.01
JPY ヒロセ電機	210.00	25 811.34	0.00
JPY 久光製薬	300.00	14 710.99	0.00
JPY 日立化成	1 000.00	35 978.45	0.01
JPY 日立ハイテクノロジーズ	400.00	26 079.81	0.00
JPY ホシザキ	300.00	26 216.78	0.00
JPY ヒューリック	1 800.00	20 233.77	0.00
JPY 出光興産	1 292.00	35 252.45	0.01
JPY I H I	800.00	18 650.35	0.00
JPY 三越伊勢丹ホールディングス	1 900.00	16 916.27	0.00
JPY いすゞ自動車	4 400.00	51 449.18	0.01
JPY 伊藤忠テクノソリューションズ	600.00	16 014.98	0.00
JPY J . フロント リテイリング	1 300.00	17 070.59	0.00
JPY 日本空港ビルデング	500.00	25 979.36	0.00
JPY 日本取引所グループ	3 300.00	56 079.81	0.01
JPY ジャパンリアルエステイト投資法人	10.00	68 030.32	0.01
JPY 日揮ホールディングス	1 100.00	15 981.19	0.00
JPY J S R	2 000.00	35 375.76	0.01
JPY ジェイテクト	1 400.00	17 386.54	0.00
JPY 鹿島建設	3 000.00	39 530.64	0.01
JPY カカクコム	1 100.00	26 528.17	0.01
JPY 上組	1 000.00	22 153.23	0.00
JPY 関西電力	4 600.00	52 422.61	0.01
JPY 関西ペイント	1 200.00	30 221.90	0.01
JPY 花王	3 300.00	259 516.02	0.04
JPY 川崎重工業	1 100.00	24 689.98	0.00
JPY 京阪ホールディングス	700.00	34 197.79	0.01
JPY 京浜急行電鉄	1 300.00	26 721.76	0.00
JPY 京王電鉄	700.00	44 872.61	0.01
JPY 京成電鉄	1 100.00	45 301.80	0.01
JPY キッコーマン	1 100.00	55 246.10	0.01
JPY 近鉄グループホールディングス	1 000.00	56 524.52	0.01
JPY キリンホールディングス	5 700.00	126 117.25	0.02
JPY 小林製薬	400.00	32 800.66	0.01
JPY 小糸製作所	700.00	36 051.50	0.01
JPY 小松製作所	6 400.00	150 021.00	0.03
JPY コーセー	200.00	31 832.71	0.01
JPY クラレ	2 400.00	28 994.61	0.01
JPY 栗田工業	800.00	22 354.12	0.00
JPY 九州電力	2 200.00	19 366.27	0.00
JPY 九州旅客鉄道	800.00	27 212.13	0.01
JPY L I N E	400.00	18 811.07	0.00
JPY ライオン	1 300.00	26 175.69	0.00
JPY エムスリー	3 200.00	87 955.44	0.02
JPY マキタ	1 400.00	46 278.88	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)

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 比率 (%)
JPY 丸井グループ	1 200.00	28 863.12	0.01
JPY 丸一鋼管	600.00	17 258.70	0.00
JPY 日本マクドナルドホールディングス	400.00	19 760.75	0.00
JPY めぶきフィナンシャルグループ	4 700.00	12 145.92	0.00
JPY 明治ホールディングス	800.00	54 351.20	0.01
JPY ミネベアミツミ	2 400.00	46 549.17	0.01
JPY ミスミグループ本社	1 800.00	44 543.88	0.01
JPY 三菱瓦斯化学	800.00	12 506.62	0.00
JPY 三菱自動車工業	3 400.00	15 213.22	0.00
JPY 三菱UFJリース	1 300.00	8 345.36	0.00
JPY 三井化学	1 200.00	28 742.58	0.01
JPY 三井不動産	6 300.00	156 651.45	0.03
JPY MonotaRO	1 000.00	28 125.29	0.01
JPY ナブテスコ	1 000.00	30 682.13	0.01
JPY 名古屋鉄道	1 400.00	44 553.01	0.01
JPY 日本ハム	500.00	20 956.99	0.00
JPY 日本電産	1 600.00	236 544.61	0.04
JPY 日本ビルファンド投資法人	10.00	75 061.64	0.01
JPY 日本通運	500.00	31 686.60	0.01
JPY 日本ペイントホールディングス	1 200.00	63 994.16	0.01
JPY 日本製鉄	5 400.00	79 168.11	0.01
JPY 日産化学	800.00	31 668.34	0.01
JPY 日清製粉グループ本社	1 800.00	33 794.17	0.01
JPY 日清食品ホールディングス	400.00	29 951.60	0.01
JPY ニトリホールディングス	600.00	93 964.02	0.02
JPY 日東電工	1 000.00	56 067.94	0.01
JPY 野村不動産ホールディングス	800.00	19 322.44	0.00
JPY 日本精工	1 800.00	17 390.19	0.00
JPY 大林組	5 100.00	54 022.46	0.01
JPY オービック	500.00	66 340.97	0.01
JPY 小田急電鉄	2 300.00	56 518.13	0.01
JPY 王子ホールディングス	6 000.00	34 243.45	0.01
JPY オリンパス	8 000.00	118 637.57	0.02
JPY 小野薬品工業	2 700.00	60 528.71	0.01
JPY 日本オラクル	400.00	36 782.03	0.01
JPY オリエンタルランド	1 400.00	193 617.02	0.03
JPY パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	3 200.00	51 838.19	0.01
JPY ベプチドリーム	600.00	27 559.13	0.01
JPY パーソルホールディングス	1 600.00	29 411.01	0.01
JPY ビジョン	800.00	37 183.82	0.01
JPY ポーラ・オルビスホールディングス	1 000.00	24 637.02	0.00
JPY 楽天	5 600.00	48 528.90	0.01
JPY リクルートホールディングス	9 500.00	343 703.77	0.06
JPY リンナイ	200.00	15 341.06	0.00
JPY 良品計画	2 000.00	45 530.09	0.01
JPY SANKYO	200.00	6 757.37	0.00
JPY SBIホールディングス	1 500.00	31 134.14	0.01
JPY セコム	1 500.00	127 481.51	0.02
JPY 西武ホールディングス	1 200.00	21 137.80	0.00
JPY 積水ハウス	4 700.00	101 502.15	0.02
JPY セブン銀行	1 900.00	5 881.65	0.00
JPY シャープ	1 900.00	28 696.92	0.01
JPY シマノ	500.00	80 814.54	0.01
JPY 清水建設	4 000.00	38 279.61	0.01
JPY 信越化学工業	2 600.00	278 020.27	0.05

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)

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 比率 (%)
JPY 新生銀行	1 300.00	20 453.84	0.00
JPY 塩野義製薬	1 900.00	111 699.39	0.02
JPY 資生堂	2 800.00	202 118.53	0.03
JPY 静岡銀行	3 000.00	22 819.83	0.00
JPY 昭和電工	1 200.00	32 029.95	0.01
JPY S M C	400.00	181 207.20	0.03
JPY ソニーフィナンシャルホールディングス	1 000.00	23 194.23	0.00
JPY スタンレー電気	1 200.00	33 202.45	0.01
JPY 住友重機械工業	600.00	17 149.12	0.00
JPY 住友金属鉱山	1 700.00	51 476.58	0.01
JPY 住友ゴム工業	1 500.00	19 053.05	0.00
JPY サンドラッグ	400.00	14 026.12	0.00
JPY サントリー食品インターナショナル	900.00	39 037.53	0.01
JPY スズケン	400.00	17 477.86	0.00
JPY スズキ	2 500.00	110 857.46	0.02
JPY シスメックス	1 200.00	83 137.61	0.01
JPY T & Dホールディングス	3 600.00	42 341.34	0.01
JPY 太平洋セメント	600.00	17 340.88	0.00
JPY 大成建設	1 500.00	58 830.24	0.01
JPY 大正製薬ホールディングス	200.00	14 756.64	0.00
JPY 大陽日酸	700.00	15 577.57	0.00
JPY 帝人	1 500.00	28 202.90	0.01
JPY テルモ	4 600.00	161 342.34	0.03
JPY T H K	600.00	16 847.78	0.00
JPY 東武鉄道	1 200.00	43 886.40	0.01
JPY 東宝	1 000.00	40 589.90	0.01
JPY 東邦瓦斯	500.00	18 879.55	0.00
JPY 東北電力	2 400.00	23 778.65	0.00
JPY 東京センチュリー	400.00	21 331.39	0.00
JPY 東京瓦斯	2 500.00	60 371.20	0.01
JPY 東急	3 700.00	72 945.85	0.01
JPY 東レ	10 800.00	71 401.70	0.01
JPY 東ソー	1 400.00	20 838.28	0.00
JPY T O T O	1 000.00	43 740.30	0.01
JPY 東洋水産	600.00	25 860.65	0.00
JPY 豊田合成	100.00	2 334.95	0.00
JPY 豊田自動織機	800.00	46 972.88	0.01
JPY 豊田通商	1 500.00	52 392.48	0.01
JPY ツルハホールディングス	300.00	35 695.37	0.01
JPY ユー・エス・エス	1 200.00	23 252.67	0.00
JPY ウエルシアホールディングス	300.00	18 381.88	0.00
JPY ヤクルト本社	700.00	41 037.35	0.01
JPY ヤマハ	1 000.00	55 063.46	0.01
JPY ヤマトホールディングス	2 000.00	34 188.66	0.01
JPY Z O Z O	940.00	18 703.86	0.00
日本合計		9 897 075.21	1.68
ジャージー			
GBP GLENCORE XSTRATA ORD USD0.01	116 059.00	366 148.33	0.06
ジャージー合計		366 148.33	0.06
ルクセンブルグ			
EUR AROUNDTOWN SA EURO.01	12 701.00	110 380.49	0.02
EUR EUROFINS SCIENTIFI EURO.10	152.00	79 875.87	0.01
ルクセンブルグ合計		190 256.36	0.03

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)

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 比率 (%)
<b>オランダ</b>			
USD AERCAP HOLDINGS EURO.01	1 847.00	114 163.07	0.02
EUR AKZO NOBEL NV EURO.50(POST REV SPLIT)	3 135.00	300 452.10	0.05
EUR ALTICE EUROPE N.V. EURO.01 (COMMON SHARES A)	5 510.00	32 818.91	0.00
EUR EXOR NV EURO.01	1 494.00	114 387.43	0.02
EUR HEINEKEN HOLDING EUR1.6	1 638.00	157 127.12	0.03
EUR HEINEKEN NV EUR1.60	3 555.00	368 612.63	0.06
EUR ING GROEP N.V. EURO.01	51 599.00	594 191.10	0.10
EUR KON KPN NV EURO.04	50 004.00	154 155.81	0.03
EUR KONINKLIJKE AHOLD EURO.01	16 087.00	414 792.06	0.07
EUR KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20	12 153.00	564 738.70	0.10
USD NXP SEMICONDUCTORS EURO.20	3 831.00	442 786.98	0.07
EUR QIAGEN NV EURO.01	3 088.00	132 311.65	0.02
EUR RANDSTAD N.V. EURO.10	1 524.00	88 823.96	0.01
GBP ROYAL DUTCH SHELL 'B' SHS EURO.07 (UK LIST)	39 639.00	1 122 623.36	0.19
EUR STMICROELECTRONICS EUR1.04	8 746.00	215 046.47	0.04
EUR VOPAK(KON) EURO.50	855.00	45 618.37	0.01
EUR WOLTERS KLUWER EURO.12	3 859.00	277 251.46	0.05
<b>オランダ合計</b>		<b>5 139 901.18</b>	<b>0.87</b>
<b>パプアニューギニア</b>			
AUD OIL SEARCH LTD PGKO.10	15 068.00	75 828.44	0.01
<b>パプアニューギニア合計</b>		<b>75 828.44</b>	<b>0.01</b>
<b>スペイン</b>			
EUR ACS ACTIVIDADES CO EURO.5	3 554.00	138 445.57	0.02
EUR AENA SME S.A. EUR10	885.00	162 666.03	0.03
EUR AMADEUS IT GROUP EURO.01	5 962.00	475 278.60	0.08
EUR BANKIA S.A. EUR1 (POST CONS)	17 436.00	33 807.05	0.01
EUR BCO DE SABADELL EURO.125	84 848.00	94 208.28	0.02
EUR CAIXABANK SA EUR1	47 268.00	139 623.31	0.02
EUR CELLNEX TELECOM SA EURO.25	3 167.00	136 185.43	0.02
EUR ENAGAS SA EUR1.50	3 379.00	84 237.75	0.02
EUR ENDESA SA EUR1.2	4 465.00	121 502.33	0.02
EUR FERROVIAL SA EURO.2	6 158.00	182 985.40	0.03
EUR GRIFOLS SA EURO.25 (CLASS A) POST SUBD	4 101.00	140 219.86	0.02
EUR IBERDROLA SA EURO.75 (POST SUBDIVISION)	79 324.00	780 866.47	0.13
EUR INDITEX EURO.03 (POST SUBD)	14 206.00	442 651.52	0.08
EUR NATURGY ENERGY GRO EUR1	4 247.00	110 512.72	0.02
EUR RED ELECTRICA CORP EURO.5	5 983.00	117 094.19	0.02
EUR REPSOL SA EUR1	18 957.00	298 689.41	0.05
EUR SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	3 440.00	54 940.79	0.01
EUR TELEFONICA SA EUR1	62 788.00	481 287.30	0.08
<b>スペイン合計</b>		<b>3 995 202.01</b>	<b>0.68</b>
<b>スイス</b>			
CHF PARGESA HLDGS SA CHF20(BR)	732.00	57 792.37	0.01
CHF SWATCH GROUP CHF2.25(BR)	534.00	149 617.25	0.03
CHF SWISS RE AG CHF0.10	5 550.00	601 455.95	0.10
CHF VIFOR PHARMA AG CHF0.01	802.00	143 089.61	0.02
<b>スイス合計</b>		<b>951 955.18</b>	<b>0.16</b>
<b>イギリス</b>			
GBP 3I GROUP ORD GBPO.738636	10 848.00	150 281.52	0.03
GBP ASTRAZENECA ORD USDO.25	13 915.00	1 342 369.34	0.23
GBP AVIVA ORD GBPO.25	41 287.00	215 648.32	0.04

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)

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 比率 (%)
GBP BAE SYSTEMS ORD GBPO.025	33 243.00	246 560.97	0.04
GBP BARRATT DEVEL ORD GBPO.10	10 971.00	94 625.51	0.02
GBP BRIT AMER TOBACCO ORD GBPO.25	24 350.00	963 799.79	0.16
GBP BRITISH LAND CO PLC REIT	10 296.00	76 657.70	0.01
GBP BT GROUP ORD GBPO.05	88 318.00	218 836.87	0.04
GBP BUNZL ORD GBPO.32142857	3 462.00	95 070.00	0.02
USD COCA-COLA EUROPEAN ORD EURO.01	3 286.00	165 811.56	0.03
GBP EVRAZ PLC ORD USD1	4 644.00	22 249.99	0.00
GBP HALMA ORD GBPO.10	3 640.00	99 157.64	0.02
GBP INFORMA PLC (GB) ORD GBPO.001	12 764.00	130 662.00	0.02
GBP ITV ORD GBPO.10	33 360.00	62 612.33	0.01
GBP JOHNSON MATTHEY ORD GBP1.109245	2 141.00	79 592.08	0.01
GBP KINGFISHER ORD GBPO.157142857	25 757.00	69 931.71	0.01
GBP LAND SECURITIES GP ORD GBPO.106666666	7 582.00	93 993.33	0.02
GBP LLOYDS BANKING GP ORD GBPO.1	760 596.00	601 612.61	0.10
GBP MARKS & SPENCER GP ORD GBPO.25	24 075.00	60 522.55	0.01
GBP MEGGITT ORD GBPO.05	9 041.00	75 195.85	0.01
GBP MELROSE INDUST PLC ORD GBPO.0685714	51 497.00	152 939.70	0.03
GBP NATIONAL GRID ORD GBPO.12431289	35 464.00	408 129.27	0.07
GBP OCADO GROUP PLC ORD GBPO.02	4 396.00	75 342.49	0.01
GBP RECKITT BENCK GRP ORD GBPO.10	7 507.00	589 027.07	0.10
GBP RELX PLC GBPO.1444	20 790.00	503 684.63	0.09
GBP RENTOKIL INITIAL ORD GBPO.01	20 022.00	115 222.24	0.02
GBP ROLLS-ROYCE HLDGS ORD GBPO.20	17 786.00	163 712.06	0.03
GBP SAGE GROUP GBPO.01051948	11 798.00	115 035.25	0.02
GBP SEVERN TRENT ORD GBPO.9789	2 679.00	77 726.38	0.01
GBP SMITHS GROUP ORD GBPO.375	4 305.00	92 493.08	0.02
GBP SPIRAX-SARCO ENG ORD GBPO.269230769	709.00	81 850.42	0.01
GBP SSE PLC ORD GBPO.50	10 957.00	184 247.43	0.03
GBP ST JAMES ' S PLACE ORD GBPO.15	5 582.00	78 593.15	0.01
EUR UNILEVER EURO.16	19 410.00	1 151 398.87	0.19
GBP UNITED UTILITIES G ORD GBPO.05	7 493.00	82 713.19	0.01
GBP WEIR GROUP ORD GBPO.125	3 176.00	57 329.32	0.01
GBP WHITBREAD ORD GBPO.76797385	1 553.00	92 425.14	0.02
GBP WPP PLC ORD GBPO.10	13 624.00	176 314.55	0.03
イギリス合計		9 063 375.91	1.54
無記名株式合計		71 308 305.57	12.08
参加証券			
スイス			
CHF LINDT & SPRUENGLI PTG CERT CHF10	20.00	152 599.19	0.02
CHF SCHINDLER-HLDG AG PTG CERT CHF0.10(POST-SUBD)	704.00	175 621.35	0.03
スイス合計		328 220.54	0.05
参加証券合計		328 220.54	0.05
その他の株式			
スイス			
CHF ROCHE HLDGS AG GENUSSSCHEINE NPV	12 972.00	4 000 570.77	0.68
スイス合計		4 000 570.77	0.68
その他の株式合計		4 000 570.77	0.68

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)

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 比率 (%)
<b>優先株式</b>			
<b>ドイツ</b>			
EUR BAYERISCHE MOTORENWERKE AG EUR1	728.00	44 950.80	0.01
EUR FUCHS PETROLUB SE NON-VTG PRF NPV	762.00	32 935.10	0.00
EUR HENKEL AG&CO. KGAA NON-VTG PRF NPV	2 443.00	258 267.33	0.04
EUR PORSCHE AUTO HL SE NON VTG PRF NPV	2 038.00	150 960.09	0.03
EUR SARTORIUS AG NON VTG PRF NPV	455.00	95 971.96	0.02
EUR VOLKSWAGEN AG NON VTG PRF NPV	2 502.00	484 097.59	0.08
ドイツ合計		1 067 182.87	0.18
<b>優先株式合計</b>		1 067 182.87	0.18
<b>記名株式</b>			
<b>オーストラリア</b>			
AUD BENDIGO & ADELAIDE NPV	5 870.00	39 823.79	0.01
AUD BHP GROUP LTD NPV	36 206.00	936 242.70	0.16
GBP BHP GROUP PLC ORD USD0.50	22 782.00	503 911.64	0.08
AUD COLES GROUP LTD NPV	13 993.00	153 898.71	0.03
オーストラリア合計		1 633 876.84	0.28
<b>ベルギー</b>			
EUR AGEAS NPV	2 538.00	152 456.77	0.03
EUR KBC GROUP NV NPV	3 507.00	255 751.36	0.04
EUR TELENET GRP HLDG NPV	648.00	29 265.30	0.01
EUR UCB NPV	1 743.00	141 369.95	0.02
ベルギー合計		578 843.38	0.10
<b>カナダ</b>			
CAD 1ST QUANTUM MINLS COM NPV	5 100.00	46 651.61	0.01
CAD AGNICO EAGLE MINES LTD COM	2 038.00	121 090.88	0.02
CAD ALIMENTATION COUCHE TARD INC SUB VTG SH	7 232.00	236 629.19	0.04
CAD BANK NOVA SCOTIA HALIFAX COM	10 203.00	575 654.30	0.10
CAD BANK OF MONTREAL COM NPV	5 338.00	410 803.96	0.07
CAD BARRICK GOLD CORP COM NPV	14 887.00	248 593.01	0.04
CAD BCE INC COM NEW	1 220.00	58 729.00	0.01
CAD BLACKBERRY LTD NPV	3 767.00	20 788.34	0.00
CAD BROOKFIELD ASSET M LTD VTG SHS NPV CL 'A'	7 586.00	438 911.42	0.07
CAD CAN PACIFIC RYS COM NPV	1 192.00	282 301.86	0.05
CAD CANADIAN NAT RES LTD COM	10 198.00	284 922.10	0.05
CAD CANADIAN NATL RY CO COM	6 067.00	550 905.98	0.09
CAD CANADIAN TIRE LTD CL A	456.00	53 130.48	0.01
CAD CCL INDUSTRIES INC 'B' NON-VTG COM NPV	1 100.00	47 047.62	0.01
CAD CDN IMPERIAL BK OF COMMERCE COM	3 730.00	324 235.50	0.05
CAD CENOVUS ENERGY INC COM NPV	9 319.00	82 367.82	0.01
CAD CGI INC COM NPV SUB VOTING SHARES C	2 127.00	176 261.16	0.03
CAD CONSTELLATION SOFT COM STK NPV	164.00	175 329.67	0.03
CAD CRONOS GROUP INC COM NPV	1 300.00	8 837.94	0.00
CAD DOLLARAMA INC COM NPV	2 400.00	87 796.73	0.01
CAD ENBRIDGE INC COM NPV	17 429.00	660 025.37	0.11
CAD ENCANVA CORP COM NPV	13 095.00	51 364.54	0.01
CAD FAIRFAX FINL HLDGS LTD SUB VTG	216.00	97 573.62	0.02
CAD FORTIS INC COM NPV	3 650.00	143 004.71	0.02
CAD FRANCO NEVADA CORP COM NPV	1 554.00	152 878.74	0.03

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)

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 比率 (%)
CAD GILDAN ACTIVEWEAR INC COM	1 900.00	55 787.69	0.01
CAD GREAT WEST LIFE CO INC COM	2 349.00	59 156.07	0.01
CAD IA FINANCIAL CORP COM NPV	800.00	40 956.15	0.01
CAD IMPERIAL OIL LTD COM NEW	2 106.00	52 735.22	0.01
CAD INTACT FINL CORP COM NPV	1 160.00	119 619.95	0.02
CAD INTER PIPELINE LTD COM NPV	3 700.00	61 283.64	0.01
CAD LOBLAW COS LTD COM	1 685.00	90 830.79	0.02
CAD MAGNA INTL INC COM NPV	2 714.00	149 527.97	0.02
CAD MANULIFE FINL CORP COM	16 369.00	322 019.18	0.05
CAD METRO INC CL A SUB	2 224.00	97 415.64	0.02
CAD NATL BK OF CANADA COM NPV	2 921.00	156 468.40	0.03
CAD NUTRIEN LTD NPV	5 131.00	242 208.70	0.04
CAD OPEN TEXT CO COM NPV	2 400.00	104 492.38	0.02
CAD PEMBINA PIPELINE C COM NPV	4 300.00	150 147.94	0.03
CAD POWER CORP CDA COM	2 774.00	67 332.02	0.01
CAD POWER FINANCIAL CORP COM	2 626.00	64 214.18	0.01
CAD RESTAURANT BRANDS COM NPV	2 000.00	131 405.99	0.02
CAD ROGERS COMMS INC CLASS ' B ' COM CAD1.62478	3 111.00	150 883.21	0.03
CAD ROYAL BK OF CANADA COM NPV	12 152.00	994 757.73	0.17
CAD SAPUTO INC COM	2 159.00	65 261.70	0.01
CAD SHAW COMMUNICATIONS INC CL B CONV	3 543.00	73 220.67	0.01
CAD SHOPIFY INC COM NPV CL A	800.00	268 292.87	0.05
CAD SUN LIFE FINL INC COM	5 094.00	232 446.71	0.04
CAD SUNCOR ENERGY INC COM NPV ' NEW '	13 658.00	426 012.38	0.07
CAD TC ENERGY CORPORAT COM NPV	8 013.00	405 400.79	0.07
CAD TECK RESOURCES LTD CLASS ' B ' SUB-VTG COM NPV	4 750.00	74 383.59	0.01
CAD THOMSON-REUTERS CP COM NPV(POST REV SPLIT)	1 700.00	118 875.21	0.02
CAD TORONTO-DOMINION COM NPV	15 517.00	894 746.49	0.15
CAD WESTON GEORGE LTD COM	718.00	58 402.20	0.01
CAD WHEATON PRECIOUS M COM NPV	4 007.00	110 111.42	0.02
<b>カナダ合計</b>		<b>11 174 232.43</b>	<b>1.89</b>
<b>フィンランド</b>			
EUR ELISA CORPORATION EURO.50	2 024.00	108 257.94	0.02
EUR FORTUM OYJ EUR3.40	5 898.00	139 102.05	0.02
EUR NESTE OIL OYJ NPV	5 833.00	197 317.37	0.03
EUR NOKIA OYJ NPV	76 508.00	270 914.82	0.05
EUR NOKIAN RENKAAT OYJ NPV	1 868.00	50 585.17	0.01
EUR ORION CORP SER ' B ' NPV	1 529.00	66 592.08	0.01
EUR SAMPO OYJ SER ' A ' NPV	6 061.00	245 260.91	0.04
EUR STORA ENSO OYJ NPV SER ' R '	7 915.00	106 470.36	0.02
EUR UPM-KYMMENE CORP NPV	6 895.00	230 505.59	0.04
<b>フィンランド合計</b>		<b>1 415 006.29</b>	<b>0.24</b>
<b>フランス</b>			
EUR BOLLORE EURO.16 (RFD 01/01/2020)	63.00	264.66	0.00
EUR GECINA EUR7.50	624.00	107 881.91	0.02
EUR MICHELIN (CGDE) EUR2	2 310.00	277 368.95	0.05
<b>フランス合計</b>		<b>385 515.52</b>	<b>0.07</b>
<b>ドイツ</b>			
EUR ADIDAS AG NPV (REGD)	2 396.00	746 977.32	0.13
EUR ALLIANZ SE NPV(REGD)(VINKULIERT)	5 680.00	1 361 212.62	0.23
EUR AXEL SPRINGER SE NPV (ASD 02/08/19 TRAVIATA)	715.00	49 272.44	0.01
EUR BASF SE NPV	12 238.00	920 534.67	0.16

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)

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 比率 (%)
EUR BAYER AG NPV (REGD)	12 408.00	939 888.88	0.16
EUR BRENNTAG AG	2 160.00	115 294.03	0.02
EUR DAIMLER AG ORD NPV(REGD)	12 033.00	679 300.39	0.12
EUR DELIVERY HERO SE NPV	1 466.00	77 587.76	0.01
EUR DEUTSCHE BANK AG NPV(REGD)	27 155.00	195 934.58	0.03
EUR DEUTSCHE BOERSE AG NPV(REGD)	2 593.00	398 121.57	0.07
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA ORD NPV (REGD)(VINK)	3 049.00	57 890.67	0.01
EUR DEUTSCHE POST AG NPV(REGD)	13 452.00	501 920.81	0.08
EUR DEUTSCHE TELEKOM NPV(REGD)	44 371.00	745 397.91	0.13
EUR E.ON SE NPV	30 128.00	315 515.33	0.05
EUR EVONIK INDUSTRIES NPV	2 443.00	70 950.79	0.01
EUR HANNOVER RUECKVERS ORD NPV(REGD)	711.00	132 095.34	0.02
EUR INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)	17 038.00	364 224.88	0.06
EUR MTU AERO ENGINES H NPV (REGD)	680.00	184 367.95	0.03
EUR MUENCHENER RUECKVE NPV(REGD)	1 964.00	564 330.97	0.10
EUR SIEMENS AG NPV(REGD)	10 192.00	1 316 159.33	0.22
EUR SIEMENS HEALTHINEE NPV	2 208.00	107 168.49	0.02
EUR TELEFONICA DEUTSCH NPV	14 536.00	44 411.91	0.01
GBP TUI AG NPV (REGD)	5 415.00	74 490.76	0.01
EUR UNIPER SE NPV	2 447.00	79 053.22	0.01
EUR UNITED INTERNET AG NPV(REGD)	1 679.00	56 926.41	0.01
EUR VONOVIA SE NPV	6 733.00	351 071.78	0.06
<b>ドイツ合計</b>		<b>10 450 100.81</b>	<b>1.77</b>
<b>アイルランド</b>			
EUR CRH ORD EURO.32	10 490.00	401 696.70	0.07
GBP EXPERIAN ORD USD0.10	9 805.00	325 059.33	0.05
EUR KINGSPAN GROUP ORD EURO.13(DUBLIN LISTING)	1 661.00	89 593.00	0.02
EUR SMURFIT KAPPA GRP ORD EURO.001	2 490.00	88 404.26	0.01
<b>アイルランド合計</b>		<b>904 753.29</b>	<b>0.15</b>
<b>マン島</b>			
GBP GVC HLDGS PLC ORD EURO.01	6 983.00	76 920.86	0.01
<b>マン島合計</b>		<b>76 920.86</b>	<b>0.01</b>
<b>イタリア</b>			
EUR ATLANTIA SPA EUR1	6 356.00	141 003.49	0.02
EUR DAVIDE DE CAMPARI EURO.05 (POST SUBD)	6 932.00	63 324.10	0.01
EUR ENEL EUR1	107 133.00	809 863.95	0.14
EUR ENI SPA EUR1	33 998.00	514 085.67	0.09
EUR FERRARI NV EURO.01(NEW)	1 643.00	277 895.11	0.05
EUR INTESA SANPAOLO NPV	195 496.00	495 881.73	0.08
EUR MEDIOBANCA SPA EURO.5	8 021.00	89 766.14	0.02
EUR MONCLER SPA NPV	2 545.00	111 599.27	0.02
EUR PIRELLI & C SPA NPV	5 372.00	30 504.31	0.01
EUR PRYSMIAN SPA EURO.10	3 081.00	70 286.22	0.01
EUR RECORDATI EURO.125	1 455.00	61 075.05	0.01
EUR SNAM EUR1	28 992.00	144 233.21	0.02
EUR TERNA SPA ORD EURO.22	19 228.00	123 600.62	0.02
EUR UNICREDIT SPA NPV (POST REV SPLIT)	27 296.00	378 073.11	0.06
<b>イタリア合計</b>		<b>3 311 191.98</b>	<b>0.56</b>
<b>日本</b>			
JPY エービーシー・マート	300.00	19 970.78	0.00
JPY イオン	4 600.00	93 797.83	0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)

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 比率 (%)
JPY イオンモール	1 300.00	20 881.20	0.00
JPY A G C	1 300.00	47 424.89	0.01
JPY 味の素	2 700.00	44 971.24	0.01
JPY アルフレッサ ホールディングス	1 300.00	26 840.47	0.00
JPY アルプスアルパイン	1 500.00	33 846.22	0.01
JPY A N Aホールディングス	1 000.00	34 033.42	0.01
JPY アサヒグループホールディングス	2 500.00	120 217.33	0.02
JPY 旭化成	9 000.00	101 045.57	0.02
JPY アステラス製薬	13 100.00	223 397.41	0.04
JPY ブリヂストン	3 800.00	151 812.61	0.03
JPY ブラザー工業	1 900.00	37 649.53	0.01
JPY キヤノン	6 900.00	190 914.07	0.03
JPY カシオ計算機	1 300.00	24 774.91	0.00
JPY 中部電力	4 800.00	66 887.04	0.01
JPY 中国電力	1 700.00	22 462.79	0.00
JPY 大日本印刷	1 800.00	48 110.67	0.01
JPY 大和証券グループ本社	11 400.00	57 775.55	0.01
JPY デンソー	2 900.00	129 442.06	0.02
JPY 東日本旅客鉄道	2 100.00	193 105.65	0.03
JPY 電源開発	1 200.00	28 764.50	0.01
JPY ファミリーマート	1 600.00	37 753.63	0.01
JPY 富士フイルムホールディングス	2 700.00	127 517.12	0.02
JPY 富士通	1 400.00	127 215.78	0.02
JPY 博報堂D Yホールディングス	1 400.00	22 615.29	0.00
JPY 浜松ホトニクス	1 000.00	40 498.58	0.01
JPY 日野自動車	1 400.00	13 691.90	0.00
JPY 日立建機	1 000.00	26 353.76	0.00
JPY 日立金属	1 600.00	22 383.34	0.00
JPY 日立製作所	6 400.00	251 301.25	0.04
JPY 本田技研工業	11 100.00	310 872.98	0.05
JPY H O Y A	2 600.00	237 183.82	0.04
JPY 飯田グループホールディングス	1 000.00	17 760.93	0.00
JPY 国際石油開発帝石	6 400.00	62 474.66	0.01
JPY 伊藤忠商事	9 200.00	200 617.29	0.03
JPY 日本航空	900.00	27 959.09	0.00
JPY ゆうちょ銀行	3 200.00	30 974.34	0.01
JPY 日本郵政	10 200.00	95 843.30	0.02
JPY 日本プライムリアルティ投資法人	5.00	22 760.48	0.00
JPY 日本リテールファンド投資法人	19.00	43 253.58	0.01
JPY 日本たばこ産業	8 200.00	186 785.68	0.03
JPY ジェイ エフ イー ホールディングス	3 200.00	40 763.40	0.01
JPY J X T Gホールディングス	22 600.00	100 421.51	0.02
JPY K D D I	12 100.00	346 834.99	0.06
JPY キーエンス	1 200.00	410 263.90	0.07
JPY コナミホールディングス	500.00	22 007.12	0.00
JPY コニカミノルタ	3 900.00	25 534.65	0.00
JPY クボタ	7 000.00	107 930.78	0.02
JPY 京セラ	2 300.00	156 406.72	0.03
JPY 協和キリン	1 400.00	29 697.74	0.01
JPY ローソン	200.00	10 884.85	0.00
JPY L I X I Lグループ	1 800.00	30 408.18	0.01
JPY 丸紅	9 700.00	71 587.43	0.01
JPY マツダ	4 500.00	39 859.37	0.01
JPY メディカルホールディングス	1 100.00	23 585.06	0.00
JPY メルカリ	500.00	11 021.82	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)

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 比率 (%)
JPY 三菱ケミカルホールディングス	8 900.00	65 967.77	0.01
JPY 三菱商事	9 300.00	243 391.47	0.04
JPY 三菱電機	12 600.00	173 910.14	0.03
JPY 三菱地所	8 200.00	150 244.73	0.03
JPY 三菱重工業	2 000.00	76 486.17	0.01
JPY 三菱マテリアル	600.00	16 020.45	0.00
JPY 田辺三菱製薬	1 300.00	23 777.74	0.00
JPY 三菱UFJフィナンシャル・グループ	81 900.00	432 347.64	0.07
JPY 三井物産	11 700.00	207 215.32	0.04
JPY 商船三井	900.00	23 586.89	0.00
JPY みずほフィナンシャルグループ	172 700.00	266 832.62	0.05
JPY M S & A D インシュアランスグループホールディングス	3 300.00	106 705.32	0.02
JPY 村田製作所	4 000.00	231 723.13	0.04
JPY 日本電気	2 000.00	79 901.38	0.01
JPY ネクソン	3 500.00	47 717.10	0.01
JPY 日本碍子	1 300.00	21 427.27	0.00
JPY 日本特殊陶業	1 000.00	20 007.31	0.00
JPY ニコン	2 200.00	30 154.32	0.01
JPY 任天堂	800.00	309 378.13	0.05
JPY 日本プロロジスリート投資法人	17.00	45 593.10	0.01
JPY 日本電信電話	4 500.00	227 116.24	0.04
JPY 日本郵船	800.00	13 726.60	0.00
JPY 日産自動車	16 900.00	104 755.00	0.02
JPY 野村ホールディングス	21 700.00	111 105.74	0.02
JPY 野村不動産マスターファンド投資法人	26.00	47 436.76	0.01
JPY 野村総合研究所	2 600.00	54 820.56	0.01
JPY エヌ・ティ・ティ・データ	3 900.00	53 134.87	0.01
JPY N T T ドコモ	9 100.00	249 541.59	0.04
JPY オムロン	1 300.00	76 330.93	0.01
JPY オリックス	9 300.00	152 225.82	0.03
JPY 大阪瓦斯	3 000.00	56 214.04	0.01
JPY 大塚商会	700.00	28 029.40	0.01
JPY 大塚ホールディングス	2 600.00	113 344.90	0.02
JPY パナソニック	15 400.00	145 126.47	0.02
JPY パーク 2 4	1 000.00	24 153.05	0.00
JPY ルネサスエレクトロニクス	6 600.00	42 971.42	0.01
JPY リソナホールディングス	16 300.00	69 078.90	0.01
JPY リコー	4 300.00	44 252.58	0.01
JPY ローム	700.00	58 807.41	0.01
JPY 参天製薬	2 600.00	48 671.35	0.01
JPY セガサミーホールディングス	1 300.00	18 744.41	0.00
JPY セイコーエプソン	1 900.00	28 905.12	0.01
JPY 積水化学工業	2 300.00	40 010.04	0.01
JPY セブン&アイ・ホールディングス	5 600.00	208 536.21	0.04
JPY S G ホールディングス	900.00	21 581.59	0.00
JPY 島津製作所	1 400.00	42 124.01	0.01
JPY しまむら	100.00	8 017.53	0.00
JPY ソフトバンク	11 500.00	156 049.67	0.03
JPY ソフトバンクグループ	11 300.00	438 853.98	0.07
JPY 総合警備保障	400.00	20 783.49	0.00
JPY S O M P O ホールディングス	2 400.00	94 588.62	0.02
JPY ソニー	8 700.00	548 486.89	0.09
JPY S U B A R U	4 300.00	112 555.47	0.02
JPY S U M C O	1 300.00	20 073.97	0.00
JPY 住友化学	9 000.00	40 599.03	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)

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 比率 (%)
JPY 住友商事	8 100.00	121 969.68	0.02
JPY 大日本住友製薬	1 100.00	20 762.49	0.00
JPY 住友電気工業	4 600.00	68 636.65	0.01
JPY 三井住友フィナンシャルグループ	9 500.00	346 046.02	0.06
JPY 三井住友トラスト・ホールディングス	2 600.00	99 408.27	0.02
JPY 住友不動産	2 700.00	94 035.25	0.02
JPY 武田薬品工業	10 209.00	415 314.53	0.07
JPY T D K	1 000.00	105 104.56	0.02
JPY 東京海上ホールディングス	4 400.00	239 145.28	0.04
JPY 東京電力ホールディングス	11 900.00	52 159.62	0.01
JPY 東京エレクトロン	1 100.00	227 011.23	0.04
JPY 東急不動産ホールディングス	2 600.00	17 830.34	0.00
JPY 凸版印刷	1 800.00	35 783.03	0.01
JPY 東芝	3 700.00	132 782.39	0.02
JPY 東洋製罐グループホールディングス	1 500.00	26 120.90	0.00
JPY トヨタ自動車	15 600.00	1 088 054.05	0.18
JPY トレンドマイクロ	900.00	48 570.91	0.01
JPY ユニ・チャーム	2 900.00	94 936.53	0.02
JPY ユナイテッド・アーバン投資法人	25.00	48 625.70	0.01
JPY 西日本旅客鉄道	1 200.00	105 601.31	0.02
JPY ヤマダ電機	3 100.00	15 456.12	0.00
JPY ヤマハ発動機	1 700.00	35 502.69	0.01
JPY 山崎製パン	600.00	10 996.26	0.00
JPY 安川電機	1 600.00	58 734.36	0.01
JPY 横河電機	1 300.00	23 777.74	0.00
JPY 横浜ゴム	700.00	14 414.21	0.00
JPY Zホールディングス	19 200.00	66 098.07	0.01
日本合計		14 757 169.91	2.50
ルクセンブルグ			
EUR ARCELORMITTAL NPV(POST STOCK SPLIT)	9 074.00	155 357.52	0.03
EUR TENARIS S.A. USD1	5 675.00	60 395.03	0.01
ルクセンブルグ合計		215 752.55	0.04
オランダ			
EUR ADYEN NV EURO.01	134.00	102 862.44	0.02
EUR AEGON NV EURO.12	26 403.00	119 126.09	0.02
EUR ASML HOLDING NV EURO.09	5 666.00	1 543 090.91	0.26
EUR CNH INDUSTRIAL NV COM EURO.01	13 636.00	146 261.00	0.02
EUR FIAT CHRYSLER AUTO EURO.01	15 100.00	223 433.07	0.04
EUR KONINKLIJKE DSM NV EUR1.5	2 485.00	318 657.46	0.05
EUR NN GROUP N.V. EURO.12	4 325.00	166 143.08	0.03
EUR PROSUS N.V. EURO.05	6 562.00	447 645.61	0.08
GBP ROYAL DUTCH SHELL PLC 'A' SHS EURO.07	45 754.00	1 308 531.69	0.22
オランダ合計		4 375 751.35	0.74
ポルトガル			
EUR EDP ENERGIAS PORTU EUR1(REGD)	34 838.00	140 973.43	0.02
EUR GALP ENERGIA EUR1-B	6 889.00	112 228.12	0.02
EUR JERONIMO MARTINS EUR5	3 900.00	62 330.54	0.01
ポルトガル合計		315 532.09	0.05
南アフリカ			
GBP MONDI ORD EURO.20	5 342.00	115 774.99	0.02
南アフリカ合計		115 774.99	0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)

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 比率 (%)
<b>スペイン</b>			
EUR BANCO SANTANDER SA EURO.50(REGD)	224 879.00	877 004.75	0.15
EUR BANKINTER SA EURO.3(REGD)	9 014.00	63 091.73	0.01
EUR BBVA(BILB-VIZ-ARG) EURO.49	87 503.00	461 322.98	0.08
EUR MAPFRE SA EURO.10	17 833.00	50 316.77	0.01
<b>スペイン合計</b>		<b>1 451 736.23</b>	<b>0.25</b>
<b>スイス</b>			
CHF ABB LTD CHF0.12 (REGD)	34 484.00	754 655.61	0.13
CHF ADECCO GROUP AG CHF0.1 (REGD)	3 003.00	185 766.21	0.03
CHF ALCON AG CHF0.04	7 736.00	427 382.36	0.07
CHF BALOISE-HLDGS CHF0.1(REGD)	913.00	158 782.61	0.03
CHF BARRY CALLEBAUT AG CHF0.02 (REGD)	39.00	78 440.99	0.01
CHF CLARIANT CHF4.00(REGD)	3 440.00	71 116.63	0.01
GBP COCA-COLA HBC AG ORD CHF6.70	1 775.00	59 212.87	0.01
CHF CREDIT SUISSE GRP CHF0.04(REGD)	47 171.00	618 578.04	0.10
CHF DUFREY AG CHF5 (REGD)	805.00	78 602.99	0.01
CHF EMS-CHEMIE HLDG AG CHF0.01(REGD)(POST RECON)	135.00	83 821.98	0.01
CHF GEBERIT CHF0.10(REGD)	664.00	356 667.03	0.06
CHF GIVAUDAN AG CHF10	170.00	499 954.97	0.08
CHF JULIUS BAER GRUPPE CHF0.02 (REGD)	4 201.00	197 911.73	0.03
CHF KUEHNE&NAGEL INTL CHF1(REGD)(POST-SUBD)	1 035.00	168 400.46	0.03
CHF LAFARGEHOLCIM LTD CHF2 (REGD)	8 968.00	462 690.83	0.08
CHF LINDT & SPRUENGLI CHF100(REGD)	2.00	170 710.96	0.03
CHF LONZA GROUP AG CHF1(REGD)	1 373.00	466 574.07	0.08
CHF NESTLE SA CHF0.10(REGD)	55 901.00	5 813 010.38	0.99
CHF NOVARTIS AG CHF0.50(REGD)	39 673.00	3 654 671.92	0.62
CHF PARTNERS GROUP HLG CHF0.01 (REGD)	330.00	278 436.98	0.05
CHF RICHEMONT(CIE FIN) CHF1.00 (REG) SER 'A'	9 783.00	745 557.89	0.13
CHF SCHINDLER-HLDG AG CHF0.1(REGD)(POST-SUBD)	365.00	87 364.79	0.02
CHF SGS LTD CHF1(REGD)	95.00	247 350.78	0.04
CHF SIKA AG CHF0.01 (REG)	2 347.00	408 761.04	0.07
CHF SONOVA HOLDING AG CHF0.05 (REGD)	1 033.00	235 987.29	0.04
CHF STRAUMANN HLDG CHF0.1(REGD)	191.00	183 861.51	0.03
CHF SWATCH GROUP CHF0.45(REGD)	906.00	48 321.21	0.01
CHF SWISS LIFE HLDG CHF5.1(REGD)	603.00	299 161.86	0.05
CHF SWISS PRIME SITE CHF15.3 (REGD)	1 496.00	158 080.35	0.03
CHF SWISSCOM AG CHF1(REGD)	476.00	246 537.85	0.04
CHF TEMENOS AG CHF5 (REGD)	1 203.00	182 613.80	0.03
CHF UBS GROUP CHF0.10 (REGD)	70 463.00	854 567.03	0.15
CHF ZURICH INSURANCE GRP CHF0.10	2 803.00	1 100 332.12	0.19
<b>スイス合計</b>		<b>19 383 887.14</b>	<b>3.29</b>
<b>アラブ首長国連邦</b>			
GBP NMC HEALTH PLC ORD GBPO.1	997.00	32 356.55	0.01
<b>アラブ首長国連邦合計</b>		<b>32 356.55</b>	<b>0.01</b>
<b>イギリス</b>			
GBP ADMIRAL GROUP ORD GBPO.001	1 725.00	47 749.55	0.01
GBP ANGLO AMERICAN USDO.54945	11 345.00	297 383.97	0.05
GBP ANTOFAGASTA ORD GBPO.05	5 172.00	58 069.04	0.01
GBP ASHTEAD GROUP ORD GBPO.10	4 957.00	150 679.17	0.03
GBP ASSOCD BRIT FOODS ORD GBPO.0568	3 670.00	121 954.16	0.02
GBP AUTO TRADER GROUP ORD GBPO.01	10 712.00	77 870.56	0.01
GBP BARCLAYS ORD GBPO.25	177 347.00	393 509.92	0.07

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)

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 比率 (%)
GBP BERKELEY GP HLDGS ORD GBPO.05	1 404.00	83 285.15	0.01
GBP BP ORD USDO.25	215 735.00	1 340 013.57	0.23
GBP BURBERRY GROUP ORD GBPO.0005	4 283.00	116 562.87	0.02
GBP CARNIVAL PLC ORD USD1.66	1 510.00	63 537.11	0.01
GBP CENTRICA ORD GBPO.061728395	63 874.00	66 278.58	0.01
GBP COMPASS GROUP ORD GBPO.1105	16 883.00	413 723.96	0.07
GBP CRODA INTL ORD GBPO.10609756	1 341.00	86 382.26	0.02
GBP DIAGEO ORD GBPO.28 101/108	25 172.00	1 030 523.43	0.18
GBP DIRECT LINE INSURA ORD GBP 0.109090909	14 796.00	58 449.36	0.01
GBP EASYJET ORD GBPO.27285714	1 286.00	22 256.84	0.00
GBP FERGUSON PLC (NEW) ORD GBPO.10	2 491.00	216 590.13	0.04
GBP G4S ORD GBPO.25	13 849.00	37 457.51	0.01
GBP GLAXOSMITHKLINE ORD GBPO.25	52 991.00	1 202 259.28	0.20
GBP HARGREAVES LANSDOW ORD GBPO.004 (WI)	3 115.00	74 742.63	0.01
GBP HSBC HLDGS ORD USDO.50(UK REG)	214 123.00	1 596 167.16	0.27
GBP IMPERIAL BRANDS PL GBPO.10	9 872.00	217 488.96	0.04
GBP INTERCONTL HOTELS ORD GBPO.208521303	1 699.00	110 036.66	0.02
GBP INTERTEK GROUP ORD GBPO.01	1 636.00	116 727.72	0.02
GBP LEGAL & GENERAL GP ORD GBPO.025	62 827.00	228 278.23	0.04
GBP LONDON STOCK EXCH ORD GBPO.06918604	3 322.00	295 290.32	0.05
GBP M&G PLC ORD GBPO.05	26 919.00	82 174.55	0.01
GBP MICRO FOCUS INTL ORD GBPO.10	3 953.00	57 922.39	0.01
GBP MORRISON(W)SUPRMKT ORD GBPO.10	24 088.00	61 785.97	0.01
GBP NEXT ORD GBPO.10	1 433.00	125 265.31	0.02
GBP PEARSON ORD GBPO.25	8 268.00	69 151.66	0.01
GBP PERSIMMON ORD GBPO.10	3 282.00	108 593.93	0.02
GBP PRUDENTIAL ORD GBPO.05	26 919.00	479 293.54	0.08
GBP RIO TINTO ORD GBPO.10	12 159.00	660 797.91	0.11
GBP ROYAL BK SCOT GRP ORD GBP1 (POST CONS)	49 597.00	145 115.71	0.02
GBP RSA INSURANCE GRP ORD GBP1.00	10 618.00	75 731.39	0.01
GBP SAINSBURY(J) ORD GBPO.28571428	15 333.00	42 502.62	0.01
GBP SCHROEDERS VTG SHS GBP1	1 158.00	49 414.83	0.01
GBP SMITH & NEPHEW ORD USDO.20	8 945.00	200 282.89	0.03
GBP STANDARD CHARTERED ORD USDO.50	29 174.00	263 174.84	0.04
GBP STD LIFE ABERDEEN ORD GBPO.1396825396	25 301.00	103 711.37	0.02
GBP TAYLOR WIMPEY ORD GBPO.01	37 617.00	84 785.85	0.01
GBP TESCO ORD GBPO.05	102 236.00	303 363.75	0.05
GBP UNILEVER PLC ORD GBPO.031111	11 704.00	693 069.10	0.12
GBP VODAFONE GROUP ORD USDO.2095238(POST CONS)	283 954.00	563 282.84	0.10
<b>イギリス合計</b>		<b>12 692 688.55</b>	<b>2.15</b>
<b>アメリカ合衆国</b>			
CAD BAUSCH HEALTH COMP COM NPV	2 800.00	79 093.54	0.01
<b>アメリカ合衆国合計</b>		<b>79 093.54</b>	<b>0.01</b>
<b>記名株式合計</b>		<b>83 350 184.30</b>	<b>14.13</b>
<b>預託証券</b>			
<b>アイルランド</b>			
AUD JAMES HARDIE ID PLC CUFS EURO.5	6 033.00	118 177.69	0.02
<b>アイルランド合計</b>		<b>118 177.69</b>	<b>0.02</b>
<b>ルクセンブルグ</b>			
EUR SES S.A. FDR EACH REP 1 'A' NPV	5 207.00	69 153.22	0.01
<b>ルクセンブルグ合計</b>		<b>69 153.22</b>	<b>0.01</b>

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)

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 比率 (%)
<b>オランダ</b>			
EUR ABN AMRO BANK N.V. DR EACH REP SHS	5 629.00	96 139.23	0.02
<b>オランダ合計</b>		96 139.23	0.02
<b>預託証券合計</b>		283 470.14	0.05
<b>投資信託証券</b>			
<b>アイルランド</b>			
USD STAR COMPASS PLC/UBS DYNMC DIVERSIFIED LTD NOTE DUE 31.03.21	8 550 000.00	12 136 725.00	2.06
<b>アイルランド合計</b>		12 136 725.00	2.06
<b>投資信託証券合計</b>		12 136 725.00	2.06
<b>投資信託、クローズド・エンド型</b>			
<b>カナダ</b>			
CAD RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1 429.00	29 198.61	0.01
<b>カナダ合計</b>		29 198.61	0.01
<b>イギリス</b>			
GBP SEGRO PLC REIT	12 609.00	145 809.09	0.02
<b>イギリス合計</b>		145 809.09	0.02
<b>投資信託、クローズド・エンド型合計</b>		175 007.70	0.03
<b>ノート、固定利付債</b>			
<b>米ドル</b>			
USD 3M CO 2.25000% 16-19.09.26	350 000.00	351 847.79	0.06
USD ABU DHABI, GOVERNMENT OF-REG-S 3.12500% 17-11.10.27	1 900 000.00	1 987 875.00	0.34
USD ALBERTA, PROVINCE OF 3.30000% 18-15.03.28	900 000.00	983 344.05	0.17
USD ALPHABET INC 1.99800% 16-15.08.26	1 025 000.00	1 021 963.26	0.17
USD AMERICAN EXPRESS CO 3.40000% 18-27.02.23	700 000.00	727 063.75	0.12
USD APPLE INC 2.00000% 15-06.05.20	1 525 000.00	1 526 001.46	0.26
USD APPLE INC 2.40000% 13-03.05.23	1 350 000.00	1 370 588.31	0.23
USD APPLE INC 2.45000% 16-04.08.26	600 000.00	609 302.88	0.10
USD APPLE INC 2.85000% 16-23.02.23	750 000.00	769 911.15	0.13
USD APPLE INC 3.20000% 17-11.05.27	775 000.00	822 192.08	0.14
USD APPLE INC 3.25000% 16-23.02.26	2 425 000.00	2 574 207.82	0.44
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.62500% 19-30.01.24	525 000.00	544 290.91	0.09
USD BANK OF NOVA SCOTIA 2.00000% 19-15.11.22	330 000.00	329 566.93	0.06
USD BAYER US FINANCE II LLC-REG-S 3.87500% 18-15.12.23	500 000.00	524 605.15	0.09
USD BERKSHIRE HATHAWAY INC 2.20000% 16-15.03.21	525 000.00	527 646.00	0.09
USD BERKSHIRE HATHAWAY INC 3.12500% 16-15.03.26	525 000.00	553 124.61	0.09
USD BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 1.75000% 19-27.09.24	250 000.00	249 686.75	0.04
USD CHEVRON CORP 2.41900% 15-17.11.20	500 000.00	502 803.35	0.09
USD CHEVRON CORP 3.19100% 13-24.06.23	1 825 000.00	1 900 229.96	0.32
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 3.90000% 18-16.03.28	450 000.00	497 614.50	0.09
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 3.35000% 19-04.06.24	500 000.00	524 070.00	0.09
USD CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 4.37500% 12-15.06.22	625 000.00	655 506.25	0.11
USD COUNCIL OF EUROPE DEVELOPMENT BANK 1.62500% 16-16.03.21	200 000.00	199 487.27	0.03
USD DEXIA CREDIT LOCAL SA-REG-S 2.50000% 18-25.01.21	500 000.00	503 271.80	0.09
USD EQUINOR ASA 3.62500% 18-10.09.28	700 000.00	771 026.48	0.13
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.00000% 16-15.03.21	1 400 000.00	1 404 579.12	0.24

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)

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 比率 (%)
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.25000% 16-16.12.19	375 000.00	374 913.75	0.06
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.37500% 17-24.05.27	1 000 000.00	1 040 269.90	0.18
USD EXPORT DEVELOPMENT CANADA 2.00000% 17-17.05.22	200 000.00	201 626.50	0.03
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 2.50000% 15-10.05.21	1 000 000.00	1 005 312.50	0.17
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 3.25000% 15-10.11.25	700 000.00	739 812.50	0.13
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 2.75000% 17-25.01.22	700 000.00	710 718.75	0.12
USD EXXON MOBIL CORP 3.04300% 16-01.03.26	1 625 000.00	1 711 235.66	0.29
USD HSBC BANK PLC-REG-S 4.12500% 10-12.08.20	125 000.00	126 841.54	0.02
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.37500% 17-07.07.27	400 000.00	415 140.24	0.07
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.25000% 19-18.06.29	800 000.00	826 802.16	0.14
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.00000% 19-23.07.26	750 000.00	760 675.43	0.13
USD INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 2.85000% 19-13.05.22	400 000.00	407 650.68	0.07
USD INTL BK FOR RECONS & DEV WORLD BK 1.75000% 19-23.10.29	500 000.00	495 201.25	0.08
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.12500% 17-13.12.21	900 000.00	907 899.03	0.15
USD JOHNSON & JOHNSON 2.45000% 16-01.03.26	1 050 000.00	1 069 762.37	0.18
USD JOHNSON & JOHNSON 2.90000% 17-15.01.28	250 000.00	262 679.93	0.05
USD JOHNSON & JOHNSON 3.37500% 13-05.12.23	300 000.00	318 445.71	0.05
USD KOREA DEVELOPMENT BANK 2.75000% 17-19.03.23	400 000.00	407 500.00	0.07
USD KOREA EAST-WEST POWER CO LTD-REG-S 3.87500% 18-19.07.23	610 000.00	642 978.13	0.11
USD KOREA HYDRO&NUCLEAR POWER CO LTD-REG-S 3.00000% 12-19.09.22	200 000.00	204 250.00	0.04
USD KOREA HYDRO&NUCLEAR POWER CO LTD-REG-S 3.12500% 17-25.07.27	800 000.00	832 500.00	0.14
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.12500% 13-17.01.23	650 000.00	658 959.54	0.11
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.00000% 15-02.05.25	1 550 000.00	1 573 060.44	0.27
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 1.62500% 16-15.03.21	1 150 000.00	1 148 746.12	0.20
USD KUWAIT INTERNATIONAL GOVT BOND-REG-S 3.50000% 17-20.03.27	1 500 000.00	1 609 218.75	0.27
USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 2.00000% 15-13.01.25	775 000.00	785 047.48	0.13
USD MANITOBA, PROVINCE OF 2.12500% 17-04.05.22	1 275 000.00	1 284 750.82	0.22
USD MICROSOFT CORP 2.65000% 15-03.11.22	1 400 000.00	1 433 854.52	0.24
USD MICROSOFT CORP 2.87500% 17-06.02.24	1 425 000.00	1 479 444.54	0.25
USD MICROSOFT CORP 3.30000% 17-06.02.27	2 000 000.00	2 153 672.60	0.37
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD/NY 2.50000% 16-12.07.26	800 000.00	802 272.00	0.14
USD NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 3.00000% 18-10.01.28	425 000.00	443 286.34	0.08
USD NORDEA BANK AB-REG-S 4.87500% 10-27.01.20	300 000.00	301 309.20	0.05
USD NORDIC INVESTMENT BANK 2.25000% 14-30.09.21	200 000.00	201 535.08	0.03
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 2.40000% 12-21.09.22	850 000.00	863 119.07	0.15
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 3.10000% 17-17.05.27	850 000.00	898 975.73	0.15
USD QATAR, STATE OF-REG-S 2.37500% 16-02.06.21	1 750 000.00	1 756 562.50	0.30
USD QATAR, STATE OF-REG-S 3.37500% 19-14.03.24	300 000.00	313 593.75	0.05
USD QUEBEC, PROVINCE OF 2.50000% 16-20.04.26	1 650 000.00	1 702 470.16	0.29
USD ROCHE HOLDINGS INC-REG-S 3.00000% 15-10.11.25	1 305 000.00	1 373 600.72	0.23
USD ROCHE HOLDINGS INC-REG-S 3.62500% 18-17.09.28	800 000.00	888 504.40	0.15
USD SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 2.25000% 12-06.01.23	400 000.00	402 762.44	0.07
USD SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 1.87500% 16-10.05.21	200 000.00	200 097.44	0.03
USD SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 2.87500% 16-10.05.26	1 275 000.00	1 320 949.34	0.22
USD SINOPEC GROUP OVERSEAS DEV 2013-REG-S 4.37500% 13-17.10.23	300 000.00	320 046.00	0.06
USD TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.70000% 13-15.01.24	350 000.00	372 017.24	0.06
USD WALMART INC 2.55000% 13-11.04.23	750 000.00	765 125.18	0.13
USD WALMART INC 3.70000% 18-26.06.28	1 500 000.00	1 658 463.30	0.28
USD WELLS FARGO CO 3.50000% 12-08.03.22	300 000.00	309 284.70	0.05
USD WESTPAC BANKING CORP 2.85000% 16-13.05.26	1 641 000.00	1 676 150.22	0.28
USD WESTPAC BANKING CORP 3.35000% 17-08.03.27	300 000.00	316 365.00	0.05
米ドル合計		64 907 267.28	11.00
ノート、固定利付債合計		64 907 267.28	11.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)

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 比率 (%)
<b>中期債券、固定利付債</b>			
<b>米ドル</b>			
USD AFRICAN DEVELOPMENT BANK 2.37500% 14-23.09.21	475 000.00	480 619.53	0.08
USD ASB FINANCE LTD-REG-S 2.12500% 16-01.09.21	400 000.00	399 960.00	0.07
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.62500% 17-12.01.27	750 000.00	790 522.80	0.13
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.00000% 17-16.02.22	950 000.00	956 631.00	0.16
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.50000% 17-02.11.27	1 000 000.00	1 047 907.50	0.18
USD AUSTRALIA & NZ BANKING GRP-REG-S 5.10000% 10-13.01.20	225 000.00	225 767.70	0.04
USD BANK OF AMERICA CORP 3.24800% 16-21.10.27	725 000.00	755 870.50	0.13
USD BANK OF MONTREAL 1.90000% 16-27.08.21	300 000.00	299 757.14	0.05
USD BELGIUM, KINGDOM OF-REG-S 1.62500% 17-15.01.20	400 000.00	399 868.00	0.07
USD CAISSE D' AMOR DE LA DETTE SOCIALE-REG-S 3.37500% 14-20.03.24	400 000.00	425 915.20	0.07
USD CLIFFORD CAPITAL PTE LTD-REG-S 1.73300% 19-10.09.24	650 000.00	642 245.50	0.11
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 3.15000% 17-19.09.27	150 000.00	157 152.00	0.03
USD CPPIB CAPITAL INC-REG-S 2.75000% 17-02.11.27	1 000 000.00	1 054 534.50	0.18
USD FINNVERA OYJ-REG-S 1.87500% 17-05.10.20	200 000.00	200 030.00	0.03
USD IDB TRUST SERVICES LTD-REG-S 2.26100% 17-26.09.22	800 000.00	801 600.00	0.14
USD INTERNATIONAL FINANCE CORP 2.12500% 16-07.04.26	350 000.00	356 820.06	0.06
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 17-22.11.27	1 305 000.00	1 370 600.91	0.23
USD JAPAN TOBACCO INC-REG-S 2.80000% 16-13.04.26	400 000.00	403 672.00	0.07
USD KOMMUNEKREDIT-REG-S 1.62500% 16-01.06.21	225 000.00	224 365.05	0.04
USD LANDESKREDITBANK B-WUERTT FOERDBK-REG-S 1.37500% 16-21.07.21	250 000.00	248 376.00	0.04
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 3.00000% 17-19.04.24	600 000.00	614 437.50	0.10
USD MUNICIPALITY FINANCE PLC-REG-S 1.87500% 17-18.09.20	200 000.00	200 014.00	0.03
USD NEDERLANDSE WATERSCHAPS BK NV-REG-S 3.00000% 18-21.12.21	200 000.00	204 922.00	0.04
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 1.87500% 16-09.03.21	500 000.00	499 938.00	0.09
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 2.37500% 17-18.01.22	325 000.00	328 184.22	0.06
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 3.12500% 18-22.03.23	415 000.00	430 172.40	0.07
USD NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CORP-REG-S 2.60000% 17-28.09.22	100 000.00	100 539.47	0.02
USD NORDRHEIN-WESTFALEN, STATE OF-REG-S 2.25000% 15-16.04.25	200 000.00	203 568.80	0.03
USD SP POWERASSETS LTD-REG-S 3.25000% 15-24.11.25	400 000.00	420 328.00	0.07
USD SUMITOMO MITSUI BANKING CORP-REG-S 2.44000% 19-18.06.24	418 000.00	425 311.20	0.07
USD SVENSK EXPORTKREDIT AB 1.75000% 16-10.03.21	200 000.00	199 915.71	0.03
USD TORONTO-DOMINION BANK 2.50000% 15-14.12.20	1 200 000.00	1 207 391.88	0.20
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 2.60000% 17-11.01.22	350 000.00	355 030.51	0.06
USD TOYOTA MOTOR FINANCE NL BV-REG-S 2.76400% 19-26.04.21	450 000.00	453 728.88	0.08
<b>米ドル合計</b>		<b>16 885 697.96</b>	<b>2.86</b>
<b>中期債券、固定利付債合計</b>		<b>16 885 697.96</b>	<b>2.86</b>

**債券、固定利付債**

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 比率 (%)
<b>米ドル</b>			
USD AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT-REG-S 1.62500% 15-21.01.20	300 000.00	299 884.20	0.05
USD BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN NV-REG-S 2.62500% 14-28.04.21	350 000.00	353 998.05	0.06
USD BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN NV-REG-S 2.37500% 16-16.03.26	450 000.00	463 408.20	0.08
USD BANK OF NOVA SCOTIA 1.85000% 15-14.04.20	400 000.00	399 822.06	0.07
USD CAISSE D' AMORTIS DE LA DETTE SOC-REG-S 1.87500% 15-12.02.22	475 000.00	476 236.90	0.08
USD CANADIAN IMPERIAL BANK OF COM/CAN-REG-S 2.35000% 17-27.07.22	350 000.00	353 830.65	0.06
USD CENTRAL JAPAN RAILWAY CO-REG-S 3.40000% 18-06.09.23	400 000.00	414 640.00	0.07
USD DBS BANK LTD-REG-S 3.30000% 18-27.11.21	480 000.00	490 905.60	0.08
USD DNB BOLIGKREDITT AS-REG-S 2.50000% 17-28.03.22	500 000.00	506 130.00	0.09
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.87500% 15-10.02.25	1 750 000.00	1 768 163.42	0.30

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)

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 比率 (%)
USD FAB SUKUK CO LTD-REG-S 3.87500% 19-22.01.24	300 000.00	315 093.75	0.05
USD FMS WERTMANAGEMENT 2.00000% 17-01.08.22	375 000.00	378 021.60	0.06
USD ING BANK NV-REG-S 2.62500% 12-05.12.22	250 000.00	255 250.00	0.04
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 3.87500% 10-14.02.20	750 000.00	752 795.25	0.13
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.12500% 15-15.01.25	1 050 000.00	1 069 541.34	0.18
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 14-25.11.24	675 000.00	700 222.25	0.12
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT 2.50000% 15-29.07.25	1 450 000.00	1 510 295.50	0.26
USD KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 3.25000% 14-10.07.24	450 000.00	468 421.87	0.08
USD KOREA, REPUBLIC OF 3.87500% 13-11.09.23	600 000.00	641 625.00	0.11
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.50000% 14-20.11.24	1 125 000.00	1 167 757.65	0.20
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 2.75000% 16-11.05.23	500 000.00	505 625.00	0.08
USD MORGAN STANLEY 5.50000% 10-24.07.20	450 000.00	460 163.39	0.08
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 3.40000% 14-06.05.24	200 000.00	211 487.06	0.04
USD OESTERREICHISCHE KONTROLLBANK AG 2.37500% 14-01.10.21	325 000.00	328 663.49	0.06
USD ONTARIO, PROVINCE OF 3.20000% 14-16.05.24	1 050 000.00	1 110 879.00	0.19
USD ONTARIO, PROVINCE OF 2.50000% 16-27.04.26	700 000.00	721 710.71	0.12
USD ROYAL BANK OF CANADA 2.10000% 15-14.10.20	375 000.00	375 348.33	0.06
米ドル合計		16 499 920.27	2.80
債券、固定利付債合計		16 499 920.27	2.80
財務省証券(T-note)、固定利付債			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.62500% 19-15.02.29	5 000 000.00	5 359 570.00	0.91
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 15-31.01.22	5 000.00	4 987.31	0.00
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 17-15.02.27	4 050 000.00	4 192 857.27	0.71
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 13-15.05.23	25 000.00	25 112.30	0.01
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 17-15.05.20	25 000.00	24 981.45	0.00
米ドル合計		9 607 508.33	1.63
財務省証券(T-note)、固定利付債合計		9 607 508.33	1.63
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある証券および短期金融商品合計		280 550 060.73	47.55
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券および短期金融商品			
財務省短期証券(T-bills)、ゼロ・クーポン			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 06.12.18-05.12.19	1 600 000.00	1 599 812.10	0.27
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 11.07.19-09.01.20	1 600 000.00	1 597 354.08	0.27
米ドル合計		3 197 166.18	0.54
財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン合計		3 197 166.18	0.54
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD ALTRIA GROUP INC 2.85000% 12-09.08.22	500 000.00	507 197.20	0.09
USD FANNIE MAE 2.12500% 16-24.04.26	1 300 000.00	1 326 677.56	0.23
USD HSBC HOLDINGS PLC 4.87500% 11-14.01.22	275 000.00	290 451.02	0.05
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 2.45000% 15-23.11.20	250 000.00	251 315.28	0.04
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD NEW YORK 2.87500% 18-12.04.23	250 000.00	255 598.82	0.04

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)

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 比率 (%)
USD NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 1.95000% 17-28.09.20	200 000.00	200 121.22	0.03
USD PROCTER & GAMBLE CO 2.30000% 12-06.02.22	650 000.00	658 915.14	0.11
USD SANOFI 4.00000% 11-29.03.21	700 000.00	719 964.00	0.12
米ドル合計		4 210 240.24	0.71
ノート、固定利付債合計		4 210 240.24	0.71
ノート、変動利付債			
米ドル			
USD JPMORGAN CHASE BANK NA 3.086%/VAR 18-26.04.21	300 000.00	301 141.23	0.05
米ドル合計		301 141.23	0.05
ノート、変動利付債合計		301 141.23	0.05
中期債券、固定利付債			
米ドル			
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 3.85000% 14-08.07.24	350 000.00	370 466.18	0.06
USD GUARDIAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 2.00000% 16-26.04.21	450 000.00	450 198.86	0.08
USD MACQUARIE GROUP LTD-REG-S 6.25000% 11-14.01.21	500 000.00	521 065.00	0.09
米ドル合計		1 341 730.04	0.23
中期債券、固定利付債合計		1 341 730.04	0.23
中期債券、ゼロ・クーポン債			
米ドル			
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.00000% 00-01.05.30	500 000.00	392 502.17	0.07
米ドル合計		392 502.17	0.07
中期債券、ゼロ・クーポン債合計		392 502.17	0.07
債券、固定利付債			
米ドル			
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 1.62500% 19-17.10.22	250 000.00	248 150.00	0.04
USD FEDERAL HOME LOAN BANK SYSTEM 2.00000% 12-09.09.22	600 000.00	605 288.46	0.10
USD ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 3.35000% 18-22.10.21	500 000.00	513 329.10	0.09
米ドル合計		1 366 767.56	0.23
債券、固定利付債合計		1 366 767.56	0.23
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券および短期金融商品合計		10 809 547.42	1.83
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取引されていない譲渡性のある証券および短期金融商品			
優先株式			
イギリス			
GBP ROLLS ROYCE HLDGS NON CUM RED PREF GBPO.001 C	818 156.00	1 058.29	0.00
イギリス合計		1 058.29	0.00
優先株式合計		1 058.29	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)

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 比率 (%)
<b>ノート、固定利付債</b>			
米ドル			
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 2.95000% 18-11.01.25	350 000.00	359 777.00	0.06
USD SVENSKA HANDELSBANKEN AB 1.95000% 17-08.09.20	250 000.00	249 722.60	0.05
米ドル合計		609 499.60	0.11
<b>ノート、固定利付債合計</b>		609 499.60	0.11
<b>債券、固定利付債</b>			
米ドル			
USD HSBC BANK CANADA-REG-S 3.30000% 18-28.11.21	600 000.00	615 833.46	0.11
USD HSBC BANK CANADA-REG-S 1.65000% 19-10.09.22	300 000.00	297 943.59	0.05
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 2.75000% 17-22.06.24	250 000.00	254 914.93	0.04
USD SWEDBANK AB-REG-S 2.80000% 17-14.03.22	200 000.00	202 025.76	0.03
米ドル合計		1 370 717.74	0.23
<b>債券、固定利付債合計</b>		1 370 717.74	0.23
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取引されていない 譲渡性のある証券および短期金融商品合計		1 981 275.63	0.34
<b>ルクセンブルグ2010年12月17日法(改訂済)の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs</b>			
<b>投資信託、オープン・エンド型</b>			
アイルランド			
USD UBS (IRL) ETF PLC-MSCI USA UCITS-ACC-A-USD-ETF	5 456 430.00	93 086 695.80	15.78
USD UBS ETFS PLC - MSCI USA TRN INDEX SF (USD) A-ACC	847 139.00	71 625 602.45	12.14
USD XTRACKERS MSCI USA UCITS ETF DR-1C-USD CAP	260 060.00	22 341 754.60	3.78
アイルランド合計		187 054 052.85	31.70
ルクセンブルグ			
USD AQR UCITS FUNDS - GLOBAL RISK PARITY UCITS FUND-A2-CAP	100 059.10	11 946 055.95	2.03
EUR DB PLATINUM IV UBS MULTI-STRATEGY ALTERNATIVES-IOC-E-CAP	984.17	10 892 231.48	1.85
USD INVESCO FUNDS SICAV BAL RISK ALLOCATION-PI1-USD HDG-CAP	998 776.73	11 815 528.72	2.00
USD UBS (LUX) BOND FUND - EURO HIGH YIELD (EUR)(USD HEDGED) F-ACC	100 470.00	11 605 289.70	1.97
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD (USD) F-ACC	54 945.00	17 782 949.25	3.01
USD UBS (LUX) BOND SICAV - EMERG ECON CORPORATES (USD) F-ACC	102 108.00	11 582 110.44	1.96
USD UBS (LUX) EMERGING ECONOMIES FUND - GLOBAL BONDS (USD) F-ACC	8 829.00	17 748 585.54	3.01
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD U-X-ACC	1.00	11 088.70	0.00
ルクセンブルグ合計		93 383 839.78	15.83
<b>投資信託、オープン・エンド型合計</b>		280 437 892.63	47.53
ルクセンブルグ2010年12月17日法(改訂済)の第41条(1)e)に規定され たUCITS/その他のUCIs合計		280 437 892.63	47.53
<b>投資有価証券合計</b>		573 778 776.41	97.25

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)

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 比率 (%)
<b>派生商品</b>			
公認の証券取引所に上場されている派生商品			
<b>債券に係る金融先物</b>			
USD	US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 20.03.20	-111.00	71 109.38 0.01
USD	US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.20	-291.00	61 382.96 0.01
USD	US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.20	-210.00	24 609.48 0.01
USD	US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 20.03.20	-148.00	64 750.00 0.01
USD	US LONG BOND FUTURE 20.03.20	-15.00	15 000.00 0.00
債券に係る金融先物合計			236 851.82 0.04
<b>指数に係る金融先物</b>			
EUR	EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 20.12.19	225.00	187 508.16 0.03
CHF	SWISS MARKET INDEX FUTURE 20.12.19	20.00	54 546.17 0.01
GBP	FTSE 100 INDEX FUTURE 20.12.19	47.00	34 298.34 0.01
SGD	MSCI SINGAPORE INDEX FUTURE 30.12.19	17.00	-2 610.70 0.00
USD	S&P500 EMINI FUTURE 20.12.19	387.00	2 033 191.57 0.34
JPY	TOPIX INDX FUTURE 12.12.19	46.00	167 219.30 0.03
USD	MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 20.12.19	714.00	257 510.09 0.04
AUD	SPI 200 INDEX FUTURE 19.12.19	18.00	33 356.70 0.01
CAD	S&P/TSX 60 INDEX FUTURE 19.12.19	21.00	118 755.42 0.02
HKD	HANG SENG INDEX FUTURE 30.12.19	7.00	-35 367.76 -0.01
指数に係る金融先物合計			2 848 407.29 0.48
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計			3 085 259.11 0.52
派生商品合計			3 085 259.11 0.52
<b>先渡為替契約</b>			
<b>先渡為替契約(購入/売却)</b>			
USD	11 413 177.82	CHF	11 312 000.00 9.1.2020 53 846.06 0.01
USD	10 432 144.00	GBP	8 224 000.00 9.1.2020 -223 541.91 -0.04
USD	6 032 559.33	CAD	7 975 000.00 9.1.2020 26 116.67 0.00
USD	6 330 632.94	AUD	9 335 000.00 9.1.2020 9 444.66 0.00
JPY	70 270 000.00	USD	652 782.99 9.1.2020 -8 982.24 0.00
USD	184 982.11	HKD	1 450 000.00 9.1.2020 -176.50 0.00
USD	43 835.33	SGD	60 000.00 9.1.2020 -58.36 0.00
USD	32 440 107.33	EUR	29 285 000.00 9.1.2020 51 719.26 0.01
USD	370 143.14	JPY	40 000 000.00 9.1.2020 3 670.53 0.00
USD	468 375.18	EUR	420 000.00 9.1.2020 3 866.97 0.00
HKD	2 000 000.00	USD	255 182.60 9.1.2020 208.59 0.00
USD	410 370.86	JPY	44 500 000.00 9.1.2020 2 670.09 0.00
USD	368 792.29	CHF	365 000.00 9.1.2020 2 265.05 0.00
USD	14 821 464.01	GBP	11 476 000.00 15.1.2020 -50 163.95 -0.01
USD	6 288 093.17	AUD	9 065 000.00 15.1.2020 148 863.10 0.03
USD	6 134 993.17	CAD	8 049 000.00 15.1.2020 72 728.37 0.01
HKD	550 000.00	USD	70 199.73 15.1.2020 31.45 0.00
USD	44 260.48	SGD	60 000.00 15.1.2020 363.78 0.00
USD	13 082 909.18	CHF	12 888 000.00 15.1.2020 135 723.85 0.02
USD	2 469 713.41	JPY	267 630 000.00 15.1.2020 16 980.71 0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)

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 比率 (%)
先渡為替契約(続き)			
先渡為替契約(購入/売却)			
USD	41 873 447.91	EUR 37 442 000.00 15.1.2020	448 608.05 0.08
USD	784 698.77	EUR 705 000.00 9.1.2020	4 988.56 0.00
USD	784 992.05	EUR 705 000.00 15.1.2020	4 998.67 0.00
USD	170 228.73	CAD 225 000.00 15.1.2020	765.49 0.00
USD	170 226.93	CAD 225 000.00 9.1.2020	766.17 0.00
USD	38 250.36	HKD 300 000.00 9.1.2020	-58.32 0.00
USD	38 247.81	HKD 300 000.00 15.1.2020	-60.11 0.00
EUR	750 000.00	USD 828 124.50 9.1.2020	1 354.45 0.00
EUR	750 000.00	USD 828 441.75 15.1.2020	1 338.44 0.00
GBP	7 463 500.00	USD 9 631 410.90 16.1.2020	40 719.02 0.01
SEK	2 830 400.00	USD 295 254.22 16.1.2020	1 314.05 0.00
EUR	144 551 900.00	USD 159 813 689.60 16.1.2020	124 395.30 0.02
CHF	95 237 100.00	USD 95 867 910.85 16.1.2020	-186 974.87 -0.03
SGD	16 708 200.00	USD 12 245 104.36 16.1.2020	-21 050.21 0.00
USD	573 722.75	EUR 519 200.00 16.1.2020	-741.19 0.00
JPY	25 000 000.00	USD 230 253.68 15.1.2020	-1 137.67 0.00
JPY	25 000 000.00	USD 230 176.30 9.1.2020	-1 130.92 0.00
CHF	2 356 700.00	USD 2 368 039.83 16.1.2020	-356.84 0.00
USD	33 068.71	SGD 45 200.00 16.1.2020	-0.52 0.00
USD	361 355.99	CAD 480 000.00 15.1.2020	-165.58 0.00
USD	233 403.54	AUD 345 000.00 9.1.2020	-212.95 0.00
USD	361 353.81	CAD 480 000.00 9.1.2020	-162.49 0.00
USD	265 568.48	GBP 205 000.00 15.1.2020	-88.87 0.00
USD	265 524.20	GBP 205 000.00 9.1.2020	-90.54 0.00
USD	233 438.73	AUD 345 000.00 15.1.2020	-210.95 0.00
USD	275 970.87	CHF 275 000.00 9.1.2020	-179.79 0.00
USD	276 084.46	CHF 275 000.00 15.1.2020	-178.42 0.00
先渡為替契約(購入/売却)合計			662 024.14 0.11
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産			13 756 444.12 2.33
当座借越およびその他の短期負債			-2 249.11 0.00
その他の資産および負債			-1 281 527.56 -0.21
純資産総額			589 998 727.11 100.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・メディアム(米ドル)

## 2019年11月30日現在の投資有価証券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 比率 (%)
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある証券および短期金融商品			
無記名株式			
オーストリア			
EUR ANDRITZ AG NPV(BR)	2 440.00	95 238.18	0.00
EUR ERSTE GROUP BK AG NPV	10 745.00	385 041.70	0.02
EUR OMV AG NPV(VAR)	5 470.00	312 055.43	0.01
EUR RAIFFEISEN BK INTL NPV (REGD)	5 630.00	132 284.77	0.01
EUR VERBUND AG CLASS ' A ' NPV	2 236.00	116 318.21	0.01
EUR VOESTALPINE AG NPV	3 896.00	103 312.30	0.00
オーストリア合計		1 144 250.59	0.05
ベルギー			
EUR ANHEUSER-BUSCH IN NPV	27 014.00	2 140 693.69	0.09
EUR COLRUYT SA NPV	2 407.00	124 736.04	0.01
EUR GALAPAGOS NV NPV	894.00	176 296.81	0.01
EUR GPE BRUXELLES LAM NPV	3 213.00	326 278.41	0.01
EUR PROXIMUS SA NPV	5 957.00	179 836.99	0.01
EUR SOLVAY SA NPV	2 864.00	328 416.02	0.01
EUR UMICORE NPV	6 847.00	294 279.60	0.01
ベルギー合計		3 570 537.56	0.15
カナダ			
CAD 1ST CAP REALTY INC COM NPV	5 200.00	84 484.10	0.00
CAD AIR CANADA VAR VTG SHS NPV	4 156.00	156 602.90	0.01
CAD ALTAGAS LTD COM NPV	8 004.00	118 711.69	0.01
CAD ATCO LTD CL 1 NON VTG	2 200.00	83 461.70	0.00
CAD AURORA CANNABIS IN COM NPV	24 100.00	60 238.66	0.00
CAD BOMBARDIER INC CLASS ' B ' SUB-VTG NPV	77 597.00	115 088.34	0.01
CAD CAE INC COM NPV	9 600.00	257 951.44	0.01
CAD CAMECO CORP COM	11 338.00	103 286.13	0.00
CAD CANADIAN UTILS LTD CL A	4 004.00	117 746.09	0.01
CAD CANOPY GROWTH CORP COM NPV	6 900.00	127 324.68	0.01
CAD CI FINANCIAL CORP COM NPV	6 731.00	106 013.57	0.01
CAD EMERA INC COM	7 613.00	313 060.09	0.01
CAD EMPIRE LTD CL A	5 200.00	139 253.91	0.01
CAD HUSKY ENERGY INC COM	10 304.00	75 015.76	0.00
CAD HYDRO ONE INC COM NPV	10 095.00	190 157.65	0.01
CAD IGM FINANCIAL INC COM	2 364.00	67 987.80	0.00
CAD KEYERA CORPORATION COM NPV	6 370.00	155 431.36	0.01
CAD KINROSS GOLD CORP COM NPV	32 795.00	141 722.79	0.01
CAD KIRKLAND LAKE GOLD COM NPV	6 954.00	292 086.32	0.01
CAD LUNDIN MINING CORP COM	18 600.00	100 684.36	0.00
CAD METHANEX CORP COM	1 800.00	66 985.88	0.00
CAD ONEX CORP SUB VTG	2 900.00	172 700.92	0.01
CAD PRAIRIESKY ROYALTY COM NPV	6 100.00	62 917.37	0.00
CAD QUEBECOR INC CL B	4 203.00	104 232.50	0.00
CAD STARS GROUP INC(TH COM NPV)	7 313.00	175 247.72	0.01
CAD TELUS CORPORATION NPV	6 638.00	250 577.32	0.01
CAD WEST FRASER TIMBER COM NPV	1 600.00	69 589.31	0.00
CAD WSP GLOBAL INC COM NPV	3 400.00	219 448.15	0.01
カナダ合計		3 928 008.51	0.17

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・メディアム(米ドル)

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 比率 (%)
フィンランド			
EUR KONE CORPORATION NPV ORD 'B'	11 991.00	751 232.94	0.03
EUR METSO OYJ NPV	3 764.00	144 426.48	0.01
EUR WARTSILA OYJ ABP SER 'B' EUR3.50	16 724.00	168 466.77	0.01
フィンランド合計		1 064 126.19	0.05
フランス			
EUR ACCOR EUR3	6 399.00	273 966.52	0.01
EUR ADP EUR3	1 030.00	201 582.85	0.01
EUR AIR LIQUIDE(L') EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)	17 118.00	2 322 483.45	0.10
EUR AIRBUS EUR1	20 887.00	3 072 202.83	0.13
EUR ALSTOM EUR7.00	5 409.00	236 053.67	0.01
EUR AMUNDI EUR2.5 (AIW)	2 407.00	182 326.93	0.01
EUR ARKEMA EUR10	2 706.00	280 640.76	0.01
EUR ATOS SE EUR1	3 779.00	321 171.19	0.01
EUR AXA EUR2.29	69 175.00	1 883 545.81	0.08
EUR BIOMERIEUX NPV (POST SPLIT)	1 588.00	143 663.71	0.01
EUR BNP PARIBAS EUR2	40 917.00	2 299 515.84	0.10
EUR BOLLORE EURO.16	33 637.00	143 902.05	0.01
EUR BOUYGUES EUR1	8 318.00	340 076.51	0.01
EUR BUREAU VERITAS EURO.12	10 627.00	278 403.77	0.01
EUR CAPGEMINI EUR8	5 702.00	674 912.16	0.03
EUR CARREFOUR EUR2.50	21 512.00	355 312.59	0.02
EUR CASINO GUICH-PERR EUR1.53	2 102.00	92 567.55	0.00
EUR CIE DE ST-GOBAIN EUR4	17 536.00	710 568.36	0.03
EUR CNP ASSURANCES EUR1	5 515.00	108 968.63	0.00
EUR COVIVIO EUR3	1 518.00	168 044.18	0.01
EUR CREDIT AGRICOLE SA EUR3	40 451.00	553 724.80	0.02
EUR DANONE EURO.25	22 191.00	1 828 233.76	0.08
EUR DASSAULT AVIATION EUR8	87.00	118 468.86	0.01
EUR DASSAULT SYSTEMES EURO.50	4 621.00	728 601.39	0.03
EUR EDENRED EUR2	8 916.00	442 876.71	0.02
EUR EDF EURO.5	20 231.00	207 987.67	0.01
EUR EIFFAGE EUR4	2 986.00	326 273.23	0.01
EUR ENGIE EUR1	64 552.00	1 022 073.51	0.04
EUR ESSILORLUXOTTICA EURO.18	10 172.00	1 581 406.26	0.07
EUR EURAZEO NPV	1 095.00	74 674.41	0.00
EUR EUTELSAT COMMUNICA EUR1	6 742.00	110 688.23	0.00
EUR FAURECIA EUR7	2 668.00	141 615.21	0.01
EUR GETLINK SE EURO.40	15 685.00	264 775.44	0.01
EUR HERMES INTL NPV	1 115.00	835 991.32	0.04
EUR ICADE NPV	1 043.00	104 478.57	0.00
EUR ILIAD NPV	970.00	123 583.27	0.01
EUR INGENICO GROUP EUR1	2 330.00	248 838.96	0.01
EUR IPSEN EUR1	1 427.00	161 274.55	0.01
EUR JC DECAUX SA NPV	2 102.00	60 259.30	0.00
EUR KERING EUR4	2 694.00	1 623 920.09	0.07
EUR KLEPIERRE EUR1.40	7 572.00	271 923.26	0.01
EUR L'OREAL EURO.20	9 008.00	2 569 465.52	0.11
EUR LEGRAND SA EUR4	9 749.00	770 506.05	0.03
EUR LVMH MOET HENNESSY EURO.30	9 938.00	4 463 046.28	0.19
EUR NATIXIS EUR1.6	31 695.00	132 553.62	0.01
EUR ORANGE EUR4	72 465.00	1 198 498.64	0.05
EUR PERNOD RICARD EUR1.55	7 464.00	1 371 908.73	0.06
EUR PEUGEOT SA EUR1	20 453.00	494 328.40	0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・メディアム(米ドル)

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 比率 (%)
EUR PUBLICIS GROUPE SA EURO.40	7 440.00	327 641.56	0.01
EUR REMY COINTREAU EUR1.60	889.00	114 586.71	0.00
EUR RENAULT SA EUR3.81	6 796.00	325 620.03	0.01
EUR SAFRAN EURO.20	11 682.00	1 912 121.09	0.08
EUR SANOFI EUR2	40 205.00	3 746 331.09	0.16
EUR SARTORIUS STEDIM B EURO.20 (POST SUBD)	959.00	152 370.39	0.01
EUR SCHNEIDER ELECTRIC EUR8	19 560.00	1 889 256.59	0.08
EUR SCOR SE EUR7.876972 (POST CONS)	6 171.00	265 293.60	0.01
EUR SEB SA EUR1	902.00	140 230.87	0.01
EUR SOC GENERALE EUR1.25	27 185.00	856 062.61	0.04
EUR SODEXO EUR4	3 285.00	383 211.94	0.02
EUR SUEZ EUR4	10 553.00	156 326.14	0.01
EUR TELEPERFORMANCE EUR2.50	2 197.00	520 818.62	0.02
EUR THALES EUR3	3 724.00	365 112.85	0.02
EUR TOTAL EUR2.5	85 348.00	4 483 148.14	0.19
EUR UBISOFT ENTERTAIN EURO.31	3 035.00	184 386.15	0.01
EUR UNIBAIL-RODAMCO-WE NPV(1 ORD UNIBAIL-R & 1CLS)	5 115.00	800 287.48	0.03
EUR VALEO EUR1 (POST SUBD)	8 910.00	351 312.18	0.02
EUR VEOLIA ENVIRONNEME EUR5	18 930.00	485 070.35	0.02
EUR VINCI EUR2.50	18 253.00	1 992 047.51	0.09
EUR VIVENDI SA EUR5.50	32 851.00	902 640.09	0.04
EUR WENDEL EUR4	1 038.00	139 972.20	0.01
EUR WORLDLINE EURO.68	2 713.20	175 754.99	0.01
<b>フランス合計</b>		<b>56 591 488.58</b>	<b>2.43</b>
<b>ドイツ</b>			
EUR BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG EUR1	11 567.00	934 851.65	0.04
EUR BEIERSDORF AG NPV	3 749.00	437 546.58	0.02
EUR CARL ZEISS MEDITEC NPV	1 356.00	165 958.94	0.01
EUR COMMERZBANK AG NPV	38 869.00	225 470.46	0.01
EUR CONTINENTAL AG ORD NPV	3 935.00	514 573.50	0.02
EUR COVESTRO AG NPV	6 290.00	294 752.55	0.01
EUR DEUTSCHE WOHNEN AG NPV (BR)	12 885.00	503 638.18	0.02
EUR FRAPORT AG NPV	1 249.00	106 481.04	0.00
EUR FRESENIUS MED CARE NPV	7 649.00	561 352.89	0.02
EUR FRESENIUS SE & CO. KGAA NPV	14 801.00	810 104.08	0.03
EUR GEA GROUP AG NPV	6 073.00	195 324.94	0.01
EUR HEIDELBERGCEMENT NPV	5 726.00	423 635.02	0.02
EUR HENKEL AG & CO KGAA	3 641.00	352 478.95	0.02
EUR HOCHTIEF AG NPV	956.00	117 530.54	0.00
EUR KION GROUP AG NPV	2 235.00	148 400.81	0.01
EUR KNORR BREMSE AG NPV	1 624.00	158 076.14	0.01
EUR LANXESS AG NPV	3 266.00	217 866.04	0.01
EUR MERCK KGAA NPV	4 587.00	536 108.38	0.02
EUR METRO AG (NEW) NPV	7 047.00	113 636.58	0.00
EUR PUMA SE NPV	3 270.00	245 895.24	0.01
EUR RWE AG (NEU) NPV	20 012.00	593 775.37	0.03
EUR SAP AG ORD NPV	35 196.00	4 791 901.89	0.21
EUR SYMRISE AG NPV (BR)	4 558.00	442 458.30	0.02
EUR THYSSENKRUPP AG NPV	14 804.00	185 754.49	0.01
EUR VOLKSWAGEN AG ORD NPV	1 185.00	226 234.50	0.01
EUR WIRECARD AG NPV	4 080.00	538 933.24	0.02
EUR ZALANDO SE NPV	4 726.00	203 745.71	0.01
<b>ドイツ合計</b>		<b>14 046 486.01</b>	<b>0.60</b>

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

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 比率 (%)
<b>アイルランド</b>			
EUR AIB GROUP PLC ORD EURO.625	18 186.00	59 554.09	0.00
EUR BANK OF IRELAND GR EUR1	27 959.00	140 573.83	0.01
GBP DCC ORD EURO.25	3 023.00	258 389.35	0.01
EUR FLUTTER ENTERTAINM ORD EURO.09	2 511.00	287 937.37	0.01
EUR KERRY GROUP 'A' ORD EURO.125(DUBLIN LIST)	5 244.00	673 028.80	0.03
<b>アイルランド合計</b>		<b>1 419 483.44</b>	<b>0.06</b>
<b>イタリア</b>			
EUR ASSIC GENERALI SPA EUR1	39 869.00	814 570.64	0.04
EUR FINECOBANK SPA EURO.33	22 348.00	277 456.59	0.01
EUR LEONARDO SPA EUR4.40	14 358.00	168 047.45	0.01
EUR POSTE ITALIANE SPA NPV	21 023.00	245 475.77	0.01
EUR TELECOM ITALIA SPA DI RISP EURO.55	186 227.00	114 781.64	0.00
EUR TELECOM ITALIA SPA EURO.55	298 539.00	187 033.88	0.01
<b>イタリア合計</b>		<b>1 807 365.97</b>	<b>0.08</b>
<b>日本</b>			
JPY アコム	4 700.00	19 484.98	0.00
JPY アドバンテスト	4 500.00	219 842.94	0.01
JPY イオンフィナンシャルサービス	2 300.00	34 759.38	0.00
JPY エア・ウォーター	3 000.00	48 159.99	0.00
JPY アイシン精機	3 800.00	143 658.11	0.01
JPY アマダホールディングス	8 700.00	96 922.65	0.01
JPY あおぞら銀行	3 400.00	86 560.13	0.00
JPY 朝日インテック	3 600.00	104 867.13	0.01
JPY バンダイナムコホールディングス	3 900.00	236 364.71	0.01
JPY ベネッセホールディングス	1 600.00	42 195.23	0.00
JPY 京都銀行	1 100.00	45 352.02	0.00
JPY カルビー	2 400.00	77 253.22	0.00
JPY 東海旅客鉄道	3 000.00	605 287.18	0.03
JPY 千葉銀行	12 000.00	68 377.32	0.00
JPY 中外製薬	4 700.00	410 214.59	0.02
JPY コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	2 100.00	50 414.57	0.00
JPY コンコルディア・フィナンシャルグループ	21 100.00	85 548.35	0.00
JPY クレディセゾン	3 700.00	61 154.23	0.00
JPY サイバーエージェント	1 600.00	55 227.83	0.00
JPY 第一生命ホールディングス	20 400.00	328 419.32	0.01
JPY ダイセル	5 800.00	56 988.40	0.00
JPY ダイフク	2 200.00	127 970.05	0.01
JPY 第一三共	11 100.00	695 536.48	0.03
JPY ダイキン工業	4 900.00	704 506.43	0.03
JPY 大東建託	1 600.00	195 562.05	0.01
JPY 大和ハウス工業	10 800.00	330 282.16	0.02
JPY 大和ハウスリート投資法人	46.00	125 763.86	0.01
JPY 電通	3 700.00	134 133.87	0.01
JPY ディスコ	600.00	129 412.84	0.01
JPY エーザイ	4 500.00	333 257.23	0.02
JPY ファナック	4 000.00	763 583.23	0.03
JPY ファーストリテイリング	1 100.00	669 884.02	0.03
JPY 富士電機	3 000.00	92 320.34	0.00
JPY ふくおかフィナンシャルグループ	2 500.00	47 598.39	0.00
JPY GMOペイメントゲートウェイ	600.00	42 516.66	0.00
JPY 阪急阪神ホールディングス	4 100.00	175 965.66	0.01
JPY 光通信	400.00	93 215.23	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

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 比率 (%)
JPY ヒロセ電機	720.00	88 496.03	0.00
JPY 久光製薬	900.00	44 132.96	0.00
JPY 日立化成	1 300.00	46 771.98	0.00
JPY 日立ハイテクノロジーズ	1 200.00	78 239.43	0.00
JPY ホシザキ	900.00	78 650.35	0.00
JPY ヒューリック	6 800.00	76 438.68	0.00
JPY 出光興産	3 758.00	102 537.70	0.01
JPY I H I	2 500.00	58 282.35	0.00
JPY 三越伊勢丹ホールディングス	6 100.00	54 310.11	0.00
JPY いすゞ自動車	9 500.00	111 083.46	0.01
JPY 伊藤忠テクノソリューションズ	1 900.00	50 714.09	0.00
JPY J . フロント リテイリング	4 200.00	55 151.13	0.00
JPY 日本空港ビルディング	1 200.00	62 350.47	0.00
JPY 日本取引所グループ	10 300.00	175 036.98	0.01
JPY ジャパンリアルエステイト投資法人	22.00	149 666.70	0.01
JPY 日揮ホールディングス	3 700.00	53 754.90	0.00
JPY J S R	3 500.00	61 907.59	0.00
JPY ジェイテクト	4 400.00	54 643.41	0.00
JPY 鹿島建設	10 500.00	138 357.23	0.01
JPY カカクコム	3 300.00	79 584.51	0.00
JPY 上組	2 800.00	62 029.04	0.00
JPY 関西電力	14 100.00	160 686.69	0.01
JPY 関西ペイント	3 300.00	83 110.22	0.00
JPY 花王	9 600.00	754 955.71	0.03
JPY 川崎重工業	2 500.00	56 113.60	0.00
JPY 京阪ホールディングス	1 800.00	87 937.17	0.00
JPY 京浜急行電鉄	3 800.00	78 109.76	0.00
JPY 京王電鉄	1 900.00	121 797.10	0.01
JPY 京成電鉄	2 400.00	98 840.29	0.01
JPY キッコーマン	2 900.00	145 648.80	0.01
JPY 近鉄グループホールディングス	3 300.00	186 530.91	0.01
JPY キリンホールディングス	15 800.00	349 588.16	0.02
JPY 小林製薬	1 200.00	98 401.97	0.01
JPY 小糸製作所	1 900.00	97 854.08	0.01
JPY 小松製作所	19 500.00	457 095.24	0.02
JPY コーセー	700.00	111 414.48	0.01
JPY クラレ	5 100.00	61 613.55	0.00
JPY 栗田工業	1 800.00	50 296.78	0.00
JPY 九州電力	7 300.00	64 260.80	0.00
JPY 九州旅客鉄道	2 500.00	85 037.90	0.00
JPY L I N E	1 200.00	56 433.20	0.00
JPY ライオン	4 300.00	86 581.13	0.00
JPY エムスリー	8 300.00	228 134.42	0.01
JPY マキタ	4 100.00	135 531.00	0.01
JPY 丸井グループ	3 800.00	91 399.87	0.00
JPY 丸一鋼管	700.00	20 135.15	0.00
JPY 日本マクドナルドホールディングス	1 400.00	69 162.63	0.00
JPY めぶきフィナンシャルグループ	15 100.00	39 022.01	0.00
JPY 明治ホールディングス	2 300.00	156 259.70	0.01
JPY ミネベアミツミ	6 800.00	131 889.32	0.01
JPY ミスミグループ本社	6 500.00	160 852.89	0.01
JPY 三菱瓦斯化学	3 100.00	48 463.15	0.00
JPY 三菱自動車工業	11 500.00	51 456.49	0.00
JPY 三菱UFJリース	4 500.00	28 887.77	0.00
JPY 三井化学	4 500.00	107 784.68	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル)

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 比率 (%)
JPY 三井不動産	17 400.00	432 656.38	0.02
JPY MonotaRO	2 700.00	75 938.27	0.00
JPY ナブテスコ	1 800.00	55 227.83	0.00
JPY 名古屋鉄道	3 100.00	98 653.09	0.01
JPY 日本ハム	1 500.00	62 870.97	0.00
JPY 日本電産	4 400.00	650 497.67	0.03
JPY 日本ビルファンド投資法人	29.00	217 678.75	0.01
JPY 日本通運	1 100.00	69 710.53	0.00
JPY 日本ペイントホールディングス	2 600.00	138 654.00	0.01
JPY 日本製鉄	16 900.00	247 766.87	0.01
JPY 日産化学	2 000.00	79 170.85	0.00
JPY 日清製粉グループ本社	3 700.00	69 465.80	0.00
JPY 日清食品ホールディングス	1 500.00	112 318.51	0.01
JPY ニトリホールディングス	1 500.00	234 910.05	0.01
JPY 日東電工	3 700.00	207 451.37	0.01
JPY 野村不動産ホールディングス	2 700.00	65 213.22	0.00
JPY 日本精工	6 000.00	57 967.31	0.00
JPY 大林組	11 800.00	124 993.15	0.01
JPY オービック	1 400.00	185 754.72	0.01
JPY 小田急電鉄	6 900.00	169 554.37	0.01
JPY 王子ホールディングス	14 000.00	79 901.38	0.00
JPY オリンパス	24 600.00	364 810.52	0.02
JPY 小野薬品工業	6 900.00	154 684.50	0.01
JPY 日本オラクル	800.00	73 564.06	0.00
JPY オリエンタルランド	3 900.00	539 361.70	0.02
JPY パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	9 200.00	149 034.79	0.01
JPY ベプチドリーム	2 000.00	91 863.76	0.00
JPY パーソルホールディングス	3 200.00	58 822.03	0.00
JPY ピジョン	2 200.00	102 255.50	0.01
JPY ポーラ・オルビスホールディングス	1 700.00	41 882.93	0.00
JPY 楽天	16 600.00	143 853.53	0.01
JPY リクルートホールディングス	27 100.00	980 460.23	0.04
JPY リンナイ	700.00	53 693.73	0.00
JPY 良品計画	4 100.00	93 336.68	0.00
JPY SANKYO	1 600.00	54 058.99	0.00
JPY SBIホールディングス	5 400.00	112 082.91	0.01
JPY セコム	4 400.00	373 945.76	0.02
JPY 西武ホールディングス	4 000.00	70 459.32	0.00
JPY 積水ハウス	12 400.00	267 792.89	0.01
JPY セブン銀行	5 900.00	18 264.09	0.00
JPY シャープ	4 100.00	61 924.94	0.00
JPY シマノ	1 600.00	258 606.51	0.01
JPY 清水建設	13 800.00	132 064.65	0.01
JPY 信越化学工業	7 100.00	759 209.20	0.03
JPY 新生銀行	3 900.00	61 361.52	0.00
JPY 塩野義製薬	5 300.00	311 582.50	0.01
JPY 資生堂	7 900.00	570 262.99	0.03
JPY 静岡銀行	8 000.00	60 852.89	0.00
JPY 昭和電工	2 400.00	64 059.90	0.00
JPY SMC	1 100.00	498 319.79	0.02
JPY ソニーフィナンシャルホールディングス	3 600.00	83 499.23	0.00
JPY スタンレー電気	3 800.00	105 141.08	0.01
JPY 住友重機械工業	2 300.00	65 738.29	0.00
JPY 住友金属鉱山	4 100.00	124 149.39	0.01
JPY 住友ゴム工業	2 300.00	29 214.68	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・メディアム(米ドル)

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 比率 (%)
JPY サンドラッグ	1 400.00	49 091.41	0.00
JPY サントリー食品インターナショナル	3 000.00	130 125.10	0.01
JPY スズケン	1 400.00	61 172.50	0.00
JPY スズキ	7 200.00	319 269.47	0.01
JPY シスメックス	3 100.00	214 772.17	0.01
JPY T & Dホールディングス	11 100.00	130 552.46	0.01
JPY 太平洋セメント	2 000.00	57 802.94	0.00
JPY 大成建設	4 000.00	156 880.65	0.01
JPY 大正製薬ホールディングス	700.00	51 648.25	0.00
JPY 太陽日酸	1 900.00	42 281.98	0.00
JPY 帝人	5 700.00	107 171.03	0.01
JPY テルモ	13 200.00	462 982.37	0.02
JPY T H K	2 000.00	56 159.25	0.00
JPY 東武鉄道	2 600.00	95 087.21	0.00
JPY 東宝	2 900.00	117 710.71	0.01
JPY 東邦瓦斯	1 500.00	56 638.66	0.00
JPY 東北電力	7 300.00	72 326.73	0.00
JPY 東京センチュリー	700.00	37 329.92	0.00
JPY 東京瓦斯	8 500.00	205 262.08	0.01
JPY 東急	11 100.00	218 837.55	0.01
JPY 東レ	29 800.00	197 015.80	0.01
JPY 東ソー	4 600.00	68 468.63	0.00
JPY T O T O	2 500.00	109 350.74	0.01
JPY 東洋水産	1 700.00	73 271.85	0.00
JPY 豊田合成	1 900.00	44 363.98	0.00
JPY 豊田自動織機	2 700.00	158 533.47	0.01
JPY 豊田通商	3 800.00	132 727.60	0.01
JPY ツルハホールディングス	700.00	83 289.20	0.00
JPY ユー・エス・エス	6 100.00	118 201.08	0.01
JPY ウエルシアホールディングス	1 000.00	61 272.94	0.00
JPY ヤクルト本社	2 500.00	146 561.96	0.01
JPY ヤマハ	2 500.00	137 658.66	0.01
JPY ヤマトホールディングス	5 200.00	88 890.51	0.00
JPY Z O Z O	2 620.00	52 132.04	0.00
日本合計		28 263 397.97	1.21
ジャージー			
GBP GLENCORE XSTRATA ORD USD0.01	325 371.00	1 026 495.56	0.04
ジャージー合計		1 026 495.56	0.04
ルクセンブルグ			
EUR AROUNDTOWN SA EURO.01	33 956.00	295 101.18	0.01
EUR EUROFINS SCIENTIFI EURO.10	389.00	204 419.17	0.01
ルクセンブルグ合計		499 520.35	0.02
オランダ			
USD AERCAP HOLDINGS EURO.01	5 061.00	312 820.41	0.01
EUR AKZO NOBEL NV EURO.50(POST REV SPLIT)	8 002.00	766 895.61	0.03
EUR ALTICE EUROPE N.V. EURO.01 (COMMON SHARES A)	14 588.00	86 889.71	0.00
EUR EXOR NV EURO.01	4 136.00	316 670.95	0.01
EUR HEINEKEN HOLDING EUR1.6	3 985.00	382 265.91	0.02
EUR HEINEKEN NV EUR1.60	9 300.00	964 303.09	0.04
EUR ING GROEP N.V. EURO.01	138 740.00	1 597 668.02	0.07
EUR KON KPN NV EURO.04	122 065.00	376 310.48	0.02
EUR KONINKLIJKE AHOLD EURO.01	41 894.00	1 080 207.51	0.05

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル)

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 比率 (%)
EUR KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20	33 574.00	1 560 152.79	0.07
USD NXP SEMICONDUCTORS EURO.20	10 192.00	1 177 991.36	0.05
EUR QIAGEN NV EURO.01	8 507.00	364 499.74	0.02
EUR RANDSTAD N.V. EURO.10	4 166.00	242 808.79	0.01
GBP ROYAL DUTCH SHELL 'B' SHS EURO.07 (UK LIST)	113 374.00	3 210 885.75	0.14
EUR STMICROELECTRONICS EUR1.04	24 438.00	600 881.06	0.03
EUR VOPAK(KON) EURO.50	2 342.00	124 956.97	0.00
EUR WOLTERS KLUWER EURO.12	10 103.00	725 854.24	0.03
<b>オランダ合計</b>		<b>13 892 062.39</b>	<b>0.60</b>
<b>スペイン</b>			
EUR ACS ACTIVIDADES CO EURO.5	9 598.00	373 888.73	0.02
EUR AENA SME S.A. EUR10	2 448.00	449 950.77	0.02
EUR AMADEUS IT GROUP EURO.01	15 559.00	1 240 332.05	0.05
EUR BANKIA S.A. EUR1 (POST CONS)	51 663.00	100 170.54	0.00
EUR BCO DE SABADELL EURO.125	217 232.00	241 196.64	0.01
EUR CAIXABANK SA EUR1	129 434.00	382 330.62	0.02
EUR CELLNEX TELECOM SA EURO.25	8 680.00	373 252.15	0.02
EUR ENAGAS SA EUR1.50	8 279.00	206 393.70	0.01
EUR ENDESA SA EUR1.2	11 703.00	318 464.00	0.01
EUR FERROVIAL SA EURO.2	16 939.00	503 343.57	0.02
EUR GRIFOLS SA EURO.25 (CLASS A) POST SUBD	11 258.00	384 929.33	0.02
EUR IBERDROLA SA EURO.75 (POST SUBDIVISION)	213 510.00	2 101 795.17	0.09
EUR INDITEX EURO.03 (POST SUBD)	38 700.00	1 205 871.72	0.05
EUR NATURGY ENERGY GRO EUR1	11 335.00	294 952.12	0.01
EUR RED ELECTRICA CORP EURO.5	16 239.00	317 815.90	0.01
EUR REPSOL SA EUR1	51 748.00	815 349.46	0.04
EUR SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	8 273.00	132 129.42	0.01
EUR TELEFONICA SA EUR1	165 226.00	1 266 502.76	0.05
<b>スペイン合計</b>		<b>10 708 668.65</b>	<b>0.46</b>
<b>スイス</b>			
CHF PARGESA HLDGS SA CHF20(BR)	2 197.00	173 456.05	0.01
CHF SWATCH GROUP CHF2.25(BR)	1 483.00	415 510.08	0.02
CHF SWISS RE AG CHF0.10	16 196.00	1 755 167.66	0.07
CHF VIFOR PHARMA AG CHF0.01	2 376.00	423 916.35	0.02
<b>スイス合計</b>		<b>2 768 050.14</b>	<b>0.12</b>
<b>イギリス</b>			
GBP 3I GROUP ORD GBPO.738636	31 051.00	430 161.46	0.02
GBP ASTRAZENECA ORD USD0.25	39 856.00	3 844 877.63	0.16
GBP AVIVA ORD GBPO.25	119 546.00	624 407.05	0.03
GBP BAE SYSTEMS ORD GBPO.025	98 583.00	731 183.11	0.03
GBP BARRATT DEVEL ORD GBPO.10	32 083.00	276 717.73	0.01
GBP BRIT AMER TOBACCO ORD GBPO.25	69 603.00	2 754 963.30	0.12
GBP BRITISH LAND CO PLC REIT	29 357.00	218 574.19	0.01
GBP BT GROUP ORD GBPO.05	243 637.00	603 690.73	0.03
GBP BUNZL ORD GBPO.32142857	10 010.00	274 884.66	0.01
USD COCA-COLA EUROPEAN ORD EURO.01	8 791.00	443 593.86	0.02
GBP EVRAZ PLC ORD USD1	14 587.00	69 888.13	0.00
GBP HALMA ORD GBPO.10	10 871.00	296 138.11	0.01
GBP INFORMA PLC (GB) ORD GBPO.001	40 375.00	413 309.14	0.02
GBP ITV ORD GBPO.10	124 208.00	233 122.09	0.01
GBP JOHNSON MATTHEY ORD GBP1.109245	5 997.00	222 939.61	0.01
GBP KINGFISHER ORD GBPO.157142857	56 170.00	152 504.72	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・メディアム(米ドル)

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 比率 (%)
GBP LAND SECURITIES GP ORD GBPO.106666666	21 555.00	267 215.27	0.01
GBP LLOYDS BANKING GP ORD GBPO.1	2 164 291.00	1 711 900.62	0.07
GBP MARKS & SPENCER GP ORD GBPO.25	63 025.00	158 439.64	0.01
GBP MEGGITT ORD GBPO.05	19 913.00	165 620.50	0.01
GBP MELROSE INDUST PLC ORD GBPO.0685714	145 826.00	433 085.14	0.02
GBP NATIONAL GRID ORD GBPO.12431289	105 726.00	1 216 723.30	0.05
GBP OCADO GROUP PLC ORD GBPO.02	13 451.00	230 535.01	0.01
GBP RECKITT BENCK GRP ORD GBPO.10	21 479.00	1 685 322.03	0.07
GBP RELX PLC GBPO.1444	54 020.00	1 308 756.32	0.06
EUR RELX PLC GBPO.1444	5 137.00	124 495.96	0.01
GBP RENTOKIL INITIAL ORD GBPO.01	53 115.00	305 665.23	0.01
GBP ROLLS-ROYCE HLDGS ORD GBPO.20	53 657.00	493 888.32	0.02
GBP SAGE GROUP GBPO.01051948	33 348.00	325 156.43	0.01
GBP SEVERN TRENT ORD GBPO.9789	7 628.00	221 312.73	0.01
GBP SMITHS GROUP ORD GBPO.375	12 251.00	263 213.16	0.01
GBP SPIRAX-SARCO ENG ORD GBPO.269230769	2 146.00	247 744.70	0.01
GBP SSE PLC ORD GBPO.50	29 940.00	503 456.07	0.02
GBP ST JAMES ' S PLACE ORD GBPO.15	16 726.00	235 497.86	0.01
EUR UNILEVER EURO.16	52 067.00	3 088 608.19	0.13
GBP UNITED UTILITIES G ORD GBPO.05	21 066.00	232 541.86	0.01
GBP WEIR GROUP ORD GBPO.125	6 726.00	121 409.63	0.01
GBP WHITBREAD ORD GBPO.76797385	4 401.00	261 920.83	0.01
GBP WPP PLC ORD GBPO.10	40 117.00	519 172.86	0.02
イギリス合計		25 712 637.18	1.10
無記名株式合計		166 442 579.09	7.14
参加証券			
スイス			
CHF LINDT & SPRUENGLI PTG CERT CHF10	55.00	419 647.77	0.02
CHF SCHINDLER-HLDG AG PTG CERT CHF0.10(POST-SUBD)	2 137.00	533 100.62	0.02
スイス合計		952 748.39	0.04
参加証券合計		952 748.39	0.04
その他の株式			
スイス			
CHF ROCHE HLDGS AG GENUSSSCHEINE NPV	37 217.00	11 477 739.93	0.49
スイス合計		11 477 739.93	0.49
その他の株式合計		11 477 739.93	0.49
優先株式			
ドイツ			
EUR BAYERISCHE MOTORENWERKE AG EUR1	1 622.00	100 151.36	0.00
EUR FUCHS PETROLUB SE NON-VTG PRF NPV	2 221.00	95 995.89	0.00
EUR HENKEL AG&CO. KGAA NON-VTG PRF NPV	6 330.00	669 190.43	0.03
EUR PORSCHE AUTO HL SE NON VTG PRF NPV	5 447.00	403 473.83	0.02
EUR SARTORIUS AG NON VTG PRF NPV	1 189.00	250 792.65	0.01
EUR VOLKSWAGEN AG NON VTG PRF NPV	6 558.00	1 268 869.70	0.06
ドイツ合計		2 788 473.86	0.12
優先株式合計		2 788 473.86	0.12

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

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 比率 (%)
<b>記名株式</b>			
<b>オーストラリア</b>			
GBP BHP GROUP PLC ORD USD0.50	64 319.00	1 422 662.31	0.06
オーストラリア合計		1 422 662.31	0.06
<b>ベルギー</b>			
EUR AGEAS NPV	6 545.00	393 155.84	0.02
EUR KBC GROUP NV NPV	8 879.00	647 509.63	0.03
EUR TELENET GRP HLDG NPV	1 723.00	77 814.98	0.00
EUR UCB NPV	4 586.00	371 957.88	0.01
ベルギー合計		1 490 438.33	0.06
<b>カナダ</b>			
CAD 1ST QUANTUM MINLS COM NPV	23 700.00	216 792.77	0.01
CAD AGNICO EAGLE MINES LTD COM	7 787.00	462 676.48	0.02
CAD ALIMENTATION COUCHE TARD INC SUB VTG SH	28 020.00	916 807.23	0.04
CAD BANK NOVA SCOTIA HALIFAX COM	39 607.00	2 234 630.97	0.10
CAD BANK OF MONTREAL COM NPV	20 835.00	1 603 428.35	0.07
CAD BARRICK GOLD CORP COM NPV	56 514.00	943 708.28	0.04
CAD BCE INC COM NEW	4 883.00	235 060.43	0.01
CAD BLACKBERRY LTD NPV	15 010.00	82 833.28	0.00
CAD BROOKFIELD ASSET M LTD VTG SHS NPV CL 'A'	28 794.00	1 665 965.67	0.07
CAD CAN PACIFIC RYS COM NPV	4 526.00	1 071 894.46	0.05
CAD CANADIAN NAT RES LTD COM	39 088.00	1 092 080.32	0.05
CAD CANADIAN NATL RY CO COM	23 587.00	2 141 786.61	0.09
CAD CANADIAN TIRE LTD CL A	2 167.00	252 486.29	0.01
CAD CCL INDUSTRIES INC 'B' NON-VTG COM NPV	5 100.00	218 129.87	0.01
CAD CDN IMPERIAL BK OF COMMERCE COM	14 253.00	1 238 962.08	0.05
CAD CENOVUS ENERGY INC COM NPV	34 826.00	307 816.48	0.01
CAD CGI INC COM NPV SUB VOTING SHARES C	8 065.00	668 333.94	0.03
CAD CONSTELLATION SOFT COM STK NPV	643.00	687 420.61	0.03
CAD CRONOS GROUP INC COM NPV	5 200.00	35 351.78	0.00
CAD DOLLARAMA INC COM NPV	10 046.00	367 502.45	0.02
CAD ENBRIDGE INC COM NPV	66 226.00	2 507 937.36	0.11
CAD ENCANA CORP COM NPV	50 707.00	198 895.89	0.01
CAD FAIRFAX FINL HLDGS LTD SUB VTG	868.00	392 101.40	0.02
CAD FORTIS INC COM NPV	13 007.00	509 606.08	0.02
CAD FRANCO NEVADA CORP COM NPV	6 316.00	621 352.70	0.03
CAD GILDAN ACTIVEWEAR INC COM	6 300.00	184 980.24	0.01
CAD GREAT WEST LIFECO INC COM	10 026.00	252 489.89	0.01
CAD IA FINANCIAL CORP COM NPV	4 200.00	215 019.76	0.01
CAD IMPERIAL OIL LTD COM NEW	9 616.00	240 789.13	0.01
CAD INTACT FINL CORP COM NPV	4 720.00	486 729.46	0.02
CAD INTER PIPELINE LTD COM NPV	13 598.00	225 225.67	0.01
CAD LOBLAW COS LTD COM	5 739.00	309 363.75	0.01
CAD MAGNA INTL INC COM NPV	9 674.00	532 989.51	0.02
CAD MANULIFE FINL CORP COM	63 935.00	1 257 761.38	0.05
CAD METRO INC CL A SUB	8 386.00	367 323.53	0.02
CAD NATL BK OF CANADA COM NPV	10 630.00	569 414.27	0.02
CAD NUTRIEN LTD NPV	19 476.00	919 363.97	0.04
CAD OPEN TEXT CO COM NPV	9 300.00	404 907.96	0.02
CAD PEMBINA PIPELINE C COM NPV	16 798.00	586 554.67	0.02
CAD POWER CORP CDA COM	10 045.00	243 817.65	0.01
CAD POWER FINANCIAL CORP COM	7 963.00	194 721.05	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・メディアム(米ドル)

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 比率 (%)
CAD RESTAURANT BRANDS COM NPV	7 500.00	492 772.44	0.02
CAD ROGERS COMMS INC CLASS ' B ' COM CAD1.62478	11 260.00	546 108.94	0.02
CAD ROYAL BK OF CANADA COM NPV	46 572.00	3 812 364.81	0.16
CAD SAPUTO INC COM	8 222.00	248 532.51	0.01
CAD SHAW COMMUNICATIONS INC CL B CONV	16 077.00	332 251.95	0.01
CAD SHOPIFY INC COM NPV CL A	3 264.00	1 094 634.90	0.05
CAD SUN LIFE FINL INC COM	18 567.00	847 239.50	0.04
CAD SUNCOR ENERGY INC COM NPV ' NEW '	50 853.00	1 586 177.14	0.07
CAD TC ENERGY CORPORAT COM NPV	30 249.00	1 530 384.19	0.06
CAD TECK RESOURCES LTD CLASS ' B ' SUB-VTG COM NPV	15 232.00	238 528.59	0.01
CAD THOMSON-REUTERS CP COM NPV(POST REV SPLIT)	6 300.00	440 537.55	0.02
CAD TORONTO-DOMINION COM NPV	59 425.00	3 426 584.42	0.15
CAD WESTON GEORGE LTD COM	2 357.00	191 718.64	0.01
CAD WHEATON PRECIOUS M COM NPV	15 260.00	419 341.24	0.02
<b>カナダ合計</b>		<b>42 872 190.49</b>	<b>1.84</b>
<b>フィンランド</b>			
EUR ELISA CORPORATION EURO.50	5 160.00	275 993.57	0.01
EUR FORTUM OYJ EUR3.40	16 267.00	383 650.91	0.02
EUR NESTE OIL OYJ NPV	15 279.00	516 854.47	0.02
EUR NOKIA OYJ NPV	207 167.00	733 578.33	0.03
EUR NOKIAN RENKAAT OYJ NPV	4 725.00	127 952.32	0.00
EUR ORION CORP SER ' B ' NPV	3 599.00	156 746.17	0.01
EUR SAMPO OYJ SER ' A ' NPV	16 061.00	649 915.11	0.03
EUR STORA ENSO OYJ NPV SER ' R '	21 140.00	284 369.36	0.01
EUR UPM-KYMMENE CORP NPV	18 916.00	632 377.62	0.03
<b>フィンランド合計</b>		<b>3 761 437.86</b>	<b>0.16</b>
<b>フランス</b>			
EUR BOLLORE EURO.16 (RFD 01/01/2020)	195.00	819.18	0.00
EUR GECINA EUR7.50	1 420.00	245 500.50	0.01
EUR MICHELIN (CGDE) EUR2	6 361.00	763 785.24	0.03
<b>フランス合計</b>		<b>1 010 104.92</b>	<b>0.04</b>
<b>ドイツ</b>			
EUR ADIDAS AG NPV (REGD)	6 507.00	2 028 623.30	0.09
EUR ALLIANZ SE NPV(REGD)(VINKULIERT)	15 157.00	3 632 376.72	0.16
EUR AXEL SPRINGER SE NPV (ASD 02/08/19 TRAVIATA)	1 719.00	118 460.59	0.00
EUR BASF SE NPV	32 872.00	2 472 611.20	0.11
EUR BAYER AG NPV (REGD)	33 574.00	2 543 184.17	0.11
EUR BRENNTAG AG	5 798.00	309 479.07	0.01
EUR DAIMLER AG ORD NPV(REGD)	32 991.00	1 862 444.88	0.08
EUR DELIVERY HERO SE NPV	4 177.00	221 066.89	0.01
EUR DEUTSCHE BANK AG NPV(REGD)	70 032.00	505 309.90	0.02
EUR DEUTSCHE BOERSE AG NPV(REGD)	6 756.00	1 037 296.31	0.04
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA ORD NPV (REGD)(VINK)	8 203.00	155 748.49	0.01
EUR DEUTSCHE POST AG NPV(REGD)	36 251.00	1 352 596.73	0.06
EUR DEUTSCHE TELEKOM NPV(REGD)	118 749.00	1 994 889.81	0.09
EUR E.ON SE NPV	79 547.00	833 055.54	0.04
EUR EVONIK INDUSTRIES NPV	7 121.00	206 811.53	0.01
EUR HANNOVER RUECKVERS ORD NPV(REGD)	1 949.00	362 101.01	0.01
EUR INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)	45 840.00	979 931.25	0.04
EUR MTU AERO ENGINES H NPV (REGD)	1 855.00	502 944.93	0.02
EUR MUENCHENER RUECKVE NPV(REGD)	5 236.00	1 504 499.46	0.06
EUR SIEMENS AG NPV(REGD)	27 491.00	3 550 091.85	0.15

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

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 比率 (%)
EUR SIEMENS HEALTHINEE NPV	5 036.00	244 429.57	0.01
EUR TELEFONICA DEUTSCH NPV	30 268.00	92 477.96	0.00
GBP TUI AG NPV (REGD)	15 308.00	210 582.55	0.01
EUR UNIPER SE NPV	6 473.00	209 117.90	0.01
EUR UNITED INTERNET AG NPV(REGD)	4 232.00	143 485.75	0.01
EUR VONOVIA SE NPV	18 004.00	938 763.74	0.04
<b>ドイツ合計</b>		<b>28 012 381.10</b>	<b>1.20</b>
<b>アイルランド</b>			
EUR CRH ORD EURO.32	27 805.00	1 064 745.15	0.05
GBP EXPERIAN ORD USDO.10	27 750.00	919 979.24	0.04
EUR KINGSPAN GROUP ORD EURO.13(DUBLIN LISTING)	5 303.00	286 039.54	0.01
EUR SMURFIT KAPPA GRP ORD EURO.001	7 220.00	256 336.86	0.01
<b>アイルランド合計</b>		<b>2 527 100.79</b>	<b>0.11</b>
<b>マン島</b>			
GBP GVC HLDGS PLC ORD EURO.01	19 602.00	215 924.77	0.01
<b>マン島合計</b>		<b>215 924.77</b>	<b>0.01</b>
<b>イタリア</b>			
EUR ATLANTIA SPA EUR1	17 410.00	386 228.88	0.02
EUR DAVIDE DE CAMPARI EURO.05 (POST SUBD)	20 892.00	190 849.28	0.01
EUR ENEL EUR1	287 314.00	2 171 928.80	0.09
EUR ENI SPA EUR1	91 565.00	1 384 559.53	0.06
EUR FERRARI NV EURO.01(NEW)	4 320.00	730 679.79	0.03
EUR INTESA SANPAOLO NPV	527 043.00	1 336 861.06	0.06
EUR MEDIOBANCA SPA EURO.5	21 106.00	236 205.48	0.01
EUR MONCLER SPA NPV	6 896.00	302 392.37	0.01
EUR PIRELLI & C SPA NPV	11 220.00	63 711.53	0.00
EUR PRYSMIAN SPA EURO.10	7 571.00	172 715.66	0.01
EUR RECORDATI EURO.125	3 698.00	155 227.18	0.01
EUR SNAM EUR1	72 821.00	362 279.46	0.02
EUR TERNA SPA ORD EURO.22	51 514.00	331 140.13	0.01
EUR UNICREDIT SPA NPV (POST REV SPLIT)	73 068.00	1 012 054.73	0.04
<b>イタリア合計</b>		<b>8 836 833.88</b>	<b>0.38</b>
<b>日本</b>			
JPY エービーシー・マート	400.00	26 627.71	0.00
JPY イオン	11 800.00	240 611.81	0.01
JPY イオンモール	2 700.00	43 368.64	0.00
JPY A G C	3 600.00	131 330.47	0.01
JPY 味の素	9 400.00	156 566.52	0.01
JPY アルフレッサ ホールディングス	3 000.00	61 939.55	0.00
JPY アルプスアルパイン	5 300.00	119 589.99	0.01
JPY A N A ホールディングス	2 200.00	74 873.53	0.00
JPY アサヒグループホールディングス	7 700.00	370 269.38	0.02
JPY 旭化成	23 900.00	268 332.11	0.01
JPY アステラス製薬	36 500.00	622 443.15	0.03
JPY ブリヂストン	11 700.00	467 423.06	0.02
JPY ブラザー工業	3 600.00	71 335.95	0.00
JPY キヤノン	20 900.00	578 275.95	0.03
JPY カシオ計算機	4 300.00	81 947.77	0.00
JPY 中部電力	14 700.00	204 841.57	0.01
JPY 中国電力	5 700.00	75 316.41	0.00
JPY 大日本印刷	5 200.00	138 986.39	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

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 比率 (%)
JPY 大和証券グループ本社	27 700.00	140 384.44	0.01
JPY デンソー	9 100.00	406 180.25	0.02
JPY 東日本旅客鉄道	6 400.00	588 512.46	0.03
JPY 電源開発	2 600.00	62 323.08	0.00
JPY ファミリーマート	4 300.00	101 462.88	0.00
JPY 富士フイルムホールディングス	7 100.00	335 322.80	0.01
JPY 富士通	3 700.00	336 213.13	0.01
JPY 博報堂D Yホールディングス	4 100.00	66 230.48	0.00
JPY 浜松ホトニクス	2 300.00	93 146.74	0.00
JPY 日野自動車	4 800.00	46 943.66	0.00
JPY 日立建機	1 700.00	44 801.39	0.00
JPY 日立金属	5 100.00	71 346.91	0.00
JPY 日立製作所	18 900.00	742 124.00	0.03
JPY 本田技研工業	33 600.00	941 020.91	0.04
JPY H O Y A	7 500.00	684 184.09	0.03
JPY 飯田グループホールディングス	3 300.00	58 611.09	0.00
JPY 国際石油開発帝石	21 600.00	210 851.98	0.01
JPY 伊藤忠商事	26 300.00	573 503.79	0.03
JPY 日本航空	2 100.00	65 237.88	0.00
JPY ゆうちょ銀行	7 100.00	68 724.32	0.00
JPY 日本郵政	28 600.00	268 737.10	0.01
JPY 日本プライムリアルティ投資法人	15.00	68 281.44	0.00
JPY 日本リテールファンド投資法人	46.00	104 719.20	0.01
JPY 日本たばこ産業	23 000.00	523 911.06	0.02
JPY ジェイ エフ イー ホールディングス	10 500.00	133 754.91	0.01
JPY J X T Gホールディングス	68 700.00	305 263.63	0.01
JPY K D D I	34 700.00	994 642.49	0.04
JPY キーエンス	3 600.00	1 230 791.70	0.05
JPY コナミホールディングス	1 500.00	66 021.37	0.00
JPY コニカミノルタ	8 100.00	53 033.51	0.00
JPY クボタ	21 700.00	334 585.42	0.01
JPY 京セラ	6 600.00	448 819.28	0.02
JPY 協和キリン	4 500.00	95 457.04	0.00
JPY ローソン	500.00	27 212.13	0.00
JPY L I X I Lグループ	5 600.00	94 603.23	0.00
JPY 丸紅	29 500.00	217 714.36	0.01
JPY マツダ	8 800.00	77 947.22	0.00
JPY メディカルホールディングス	3 400.00	72 899.28	0.00
JPY メルカリ	1 600.00	35 269.84	0.00
JPY 三菱ケミカルホールディングス	22 600.00	167 513.65	0.01
JPY 三菱商事	26 600.00	696 151.95	0.03
JPY 三菱電機	35 200.00	485 844.21	0.02
JPY 三菱地所	23 500.00	430 579.40	0.02
JPY 三菱重工業	6 700.00	256 228.65	0.01
JPY 三菱マテリアル	2 000.00	53 401.52	0.00
JPY 田辺三菱製薬	4 600.00	84 136.61	0.00
JPY 三菱U F Jフィナンシャル・グループ	241 300.00	1 273 815.44	0.06
JPY 三井物産	32 600.00	577 369.19	0.03
JPY 商船三井	1 900.00	49 794.54	0.00
JPY みずほフィナンシャルグループ	483 300.00	746 729.61	0.03
JPY M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	9 500.00	307 181.99	0.01
JPY 村田製作所	11 100.00	643 031.68	0.03
JPY 日本電気	5 200.00	207 743.58	0.01
JPY ネクソン	10 800.00	147 241.35	0.01
JPY 日本碍子	4 200.00	69 226.55	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

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 比率 (%)
JPY 日本特殊陶業	2 800.00	56 020.45	0.00
JPY ニコン	5 500.00	75 385.81	0.00
JPY 任天堂	2 200.00	850 789.88	0.04
JPY 日本プロロジスリート投資法人	33.00	88 504.25	0.00
JPY 日本電信電話	13 400.00	676 301.70	0.03
JPY 日本郵船	1 700.00	29 169.03	0.00
JPY 日産自動車	48 600.00	301 248.10	0.01
JPY 野村ホールディングス	69 600.00	356 357.59	0.02
JPY 野村不動産マスターファンド投資法人	90.00	164 204.18	0.01
JPY 野村総合研究所	6 000.00	126 508.99	0.01
JPY エヌ・ティ・ティ・データ	13 600.00	185 290.84	0.01
JPY NTTドコモ	26 300.00	721 202.63	0.03
JPY オムロン	3 900.00	228 992.78	0.01
JPY オリックス	25 400.00	415 756.55	0.02
JPY 大阪瓦斯	7 100.00	133 039.90	0.01
JPY 大塚商会	2 800.00	112 117.61	0.01
JPY 大塚ホールディングス	8 300.00	361 831.79	0.02
JPY パナソニック	41 900.00	394 857.09	0.02
JPY パーク24	1 700.00	41 060.18	0.00
JPY ルネサスエレクトロニクス	13 700.00	89 198.25	0.00
JPY りそなホールディングス	39 200.00	166 128.39	0.01
JPY リコー	13 400.00	137 903.39	0.01
JPY ローム	1 700.00	142 818.01	0.01
JPY 参天製薬	8 600.00	160 989.86	0.01
JPY セガサミーホールディングス	3 800.00	54 791.34	0.00
JPY セイコーエプソン	7 100.00	108 013.88	0.01
JPY 積水化学工業	7 700.00	133 946.67	0.01
JPY セブン&アイ・ホールディングス	14 700.00	547 407.54	0.02
JPY SGホールディングス	1 500.00	35 969.32	0.00
JPY 島津製作所	4 000.00	120 354.30	0.01
JPY しまむら	400.00	32 070.13	0.00
JPY ソフトバンク	34 800.00	472 219.89	0.02
JPY ソフトバンクグループ	32 300.00	1 254 423.33	0.05
JPY 総合警備保障	1 100.00	57 154.60	0.00
JPY S O M P Oホールディングス	7 200.00	283 765.86	0.01
JPY ソニー	24 700.00	1 557 198.42	0.07
JPY S U B A R U	11 700.00	306 255.59	0.01
JPY S U M C O	3 600.00	55 589.45	0.00
JPY 住友化学	23 000.00	103 753.08	0.01
JPY 住友商事	24 000.00	361 391.65	0.02
JPY 大日本住友製薬	2 700.00	50 962.47	0.00
JPY 住友電気工業	16 800.00	250 673.00	0.01
JPY 三井住友フィナンシャルグループ	26 400.00	961 643.68	0.04
JPY 三井住友トラスト・ホールディングス	6 000.00	229 403.71	0.01
JPY 住友不動産	6 700.00	233 346.72	0.01
JPY 武田薬品工業	29 249.00	1 189 884.89	0.05
JPY T D K	2 400.00	252 250.93	0.01
JPY 東京海上ホールディングス	12 600.00	684 825.13	0.03
JPY 東京電力ホールディングス	30 000.00	131 494.84	0.01
JPY 東京エレクトロン	3 100.00	639 758.92	0.03
JPY 東急不動産ホールディングス	10 300.00	70 635.56	0.00
JPY 凸版印刷	5 200.00	103 373.21	0.01
JPY 東芝	10 500.00	376 814.90	0.02
JPY 東洋製罐グループホールディングス	3 400.00	59 207.38	0.00
JPY トヨタ自動車	44 900.00	3 131 642.75	0.13

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

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 比率 (%)
JPY トレンドマイクロ	2 700.00	145 712.72	0.01
JPY ユニ・チャーム	7 500.00	245 525.52	0.01
JPY ユナイテッド・アーバン投資法人	54.00	105 031.50	0.01
JPY 西日本旅客鉄道	3 500.00	308 003.83	0.01
JPY ヤマダ電機	10 000.00	49 858.46	0.00
JPY ヤマハ発動機	6 900.00	144 099.17	0.01
JPY 山崎製パン	3 200.00	58 646.70	0.00
JPY 安川電機	5 200.00	190 886.68	0.01
JPY 横河電機	3 800.00	69 504.15	0.00
JPY 横浜ゴム	3 000.00	61 775.18	0.00
JPY Zホールディングス	48 300.00	166 277.96	0.01
日本合計		42 132 082.63	1.81
<b>ルクセンブルグ</b>			
EUR ARCELORMITTAL NPV(POST STOCK SPLIT)	25 530.00	437 103.54	0.02
EUR TENARIS S.A. USD1	16 933.00	180 205.99	0.01
ルクセンブルグ合計		617 309.53	0.03
<b>オランダ</b>			
EUR ADYEN NV EURO.01	371.00	284 790.77	0.01
EUR AEGON NV EURO.12	70 006.00	315 855.81	0.01
EUR ASML HOLDING NV EURO.09	15 126.00	4 119 448.12	0.18
EUR CNH INDUSTRIAL NV COM EURO.01	36 639.00	392 993.31	0.02
EUR FIAT CHRYSLER AUTO EURO.01	37 896.00	560 743.02	0.02
EUR KONINKLIJKE DSM NV EUR1.5	6 663.00	854 412.35	0.04
EUR NN GROUP N.V. EURO.12	11 568.00	444 379.91	0.02
EUR PROSUS N.V. EURO.05	17 620.00	1 201 998.73	0.05
GBP ROYAL DUTCH SHELL PLC 'A' SHS EURO.07	131 707.00	3 766 726.03	0.16
オランダ合計		11 941 348.05	0.51
<b>ポルトガル</b>			
EUR EDP ENERGIAS PORTU EUR1(REGD)	93 687.00	379 108.38	0.02
EUR GALP ENERGIA EUR1-B	17 150.00	279 389.20	0.01
EUR JERONIMO MARTINS EUR5	10 013.00	160 029.64	0.01
ポルトガル合計		818 527.22	0.04
<b>南アフリカ</b>			
GBP MONDI ORD EURO.20	15 267.00	330 875.48	0.01
南アフリカ合計		330 875.48	0.01
<b>スペイン</b>			
EUR BANCO SANTANDER SA EURO.50(REGD)	599 427.00	2 337 703.08	0.10
EUR BANKINTER SA EURO.3(REGD)	22 667.00	158 653.25	0.01
EUR BBVA(BILB-VIZ-ARG) EURO.49	234 666.00	1 237 178.37	0.05
EUR MAPFRE SA EURO.10	39 599.00	111 730.69	0.01
スペイン合計		3 845 265.39	0.17
<b>スイス</b>			
CHF ABB LTD CHF0.12 (REGD)	97 099.00	2 124 936.34	0.09
CHF ADECCO GROUP AG CHF0.1 (REGD)	8 390.00	519 007.15	0.02
CHF ALCON AG CHF0.04	22 049.00	1 218 117.07	0.05
CHF BALOISE-HLDGS CHF0.1(REGD)	2 538.00	441 391.30	0.02
CHF BARRY CALLEBAUT AG CHF0.02 (REGD)	119.00	239 345.57	0.01
CHF CLARIANT CHF4.00(REGD)	10 325.00	213 453.24	0.01
GBP COCA-COLA HBC AG ORD CHF6.70	6 405.00	213 666.73	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

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 比率 (%)
CHF CREDIT SUISSE GRP CHF0.04(REGD)	135 411.00	1 775 715.37	0.08
CHF DUFREY AG CHF5 (REGD)	2 119.00	206 906.51	0.01
CHF EMS-CHEMIE HLDG AG CHF0.01(REGD)(POST RECON)	445.00	276 302.10	0.01
CHF GEBERIT CHF0.10(REGD)	1 969.00	1 057 646.67	0.05
CHF GIVAUDAN AG CHF10	485.00	1 426 342.12	0.06
CHF JULIUS BAER GRUPPE CHF0.02 (REGD)	11 676.00	550 063.62	0.02
CHF KUEHNE&NAGEL INTL CHF1(REGD)(POST-SUBD)	2 780.00	452 322.01	0.02
CHF LAFARGEHOLCIM LTD CHF2 (REGD)	25 427.00	1 311 868.83	0.06
CHF LINDT & SPRUENGLI CHF100(REGD)	6.00	512 132.89	0.02
CHF LONZA GROUP AG CHF1(REGD)	3 927.00	1 334 476.61	0.06
CHF NESTLE SA CHF0.10(REGD)	159 932.00	16 630 943.55	0.71
CHF NOVARTIS AG CHF0.50(REGD)	113 722.00	10 476 056.76	0.45
CHF PARTNERS GROUP HLG CHF0.01 (REGD)	964.00	813 373.49	0.03
CHF RICHEMONT(CIE FIN) CHF1.00 (REG) SER 'A'	27 469.00	2 093 399.75	0.09
CHF SCHINDLER-HLDG AG CHF0.1(REGD)(POST-SUBD)	1 056.00	252 759.49	0.01
CHF SGS LTD CHF1(REGD)	282.00	734 241.26	0.03
CHF SIKA AG CHF0.01 (REG)	6 682.00	1 163 758.54	0.05
CHF SONOVA HOLDING AG CHF0.05 (REGD)	2 942.00	672 095.46	0.03
CHF STRAUMANN HLDG CHF0.1(REGD)	535.00	515 004.75	0.02
CHF SWATCH GROUP CHF0.45(REGD)	2 713.00	144 696.95	0.01
CHF SWISS LIFE HLDG CHF5.1(REGD)	1 792.00	889 051.48	0.04
CHF SWISS PRIME SITE CHF15.3 (REGD)	4 140.00	437 468.35	0.02
CHF SWISSCOM AG CHF1(REGD)	1 347.00	697 660.68	0.03
CHF TEMENOS AG CHF5 (REGD)	3 406.00	517 026.27	0.02
CHF UBS GROUP CHF0.10 (REGD)	202 742.00	2 458 831.28	0.11
CHF ZURICH INSURANCE GRP CHF0.10	8 001.00	3 140 833.84	0.13
スイス合計		55 510 896.03	2.38

## アラブ首長国連邦

GBP NMC HEALTH PLC ORD GBPO.1	3 082.00	100 022.97	0.00
アラブ首長国連邦合計		100 022.97	0.00

## イギリス

GBP ADMIRAL GROUP ORD GBPO.001	4 898.00	135 581.05	0.01
GBP ANGLO AMERICAN USDO.54945	32 395.00	849 162.93	0.04
GBP ANTOFAGASTA ORD GBPO.05	10 546.00	118 406.06	0.00
GBP ASHTEAD GROUP ORD GBPO.10	14 188.00	431 276.18	0.02
GBP ASSOC BRIT FOODS ORD GBPO.0568	10 551.00	350 609.89	0.01
GBP AUTO TRADER GROUP ORD GBPO.01	30 420.00	221 137.28	0.01
GBP BARCLAYS ORD GBPO.25	527 874.00	1 171 283.73	0.05
GBP BERKELEY GP HLDGS ORD GBPO.05	4 010.00	237 872.84	0.01
GBP BP ORD USDO.25	616 193.00	3 827 413.20	0.16
GBP BURBERRY GROUP ORD GBPO.0005	12 468.00	339 319.61	0.01
GBP CARNIVAL PLC ORD USD1.66	4 473.00	188 212.90	0.01
GBP CENTRICA ORD GBPO.061728395	182 116.00	188 971.89	0.01
GBP COMPASS GROUP ORD GBPO.1105	48 276.00	1 183 020.64	0.05
GBP CRODA INTL ORD GBPO.10609756	4 027.00	259 404.44	0.01
GBP DIAGEO ORD GBPO.28 101/108	71 875.00	2 942 510.39	0.13
GBP DIRECT LINE INSURA ORD GBP 0.109090909	35 965.00	142 074.30	0.01
GBP EASYJET ORD GBPO.27285714	4 582.00	79 300.81	0.00
GBP FERGUSON PLC (NEW) ORD GBPO.10	6 689.00	581 602.33	0.02
GBP G4S ORD GBPO.25	43 137.00	116 673.01	0.00
GBP GLAXOSMITHKLINE ORD GBPO.25	151 436.00	3 435 778.45	0.15
GBP HARGREAVES LANSDOW ORD GBPO.004 (WI)	9 273.00	222 500.30	0.01
GBP HSBC HLDGS ORD USDO.50(UK REG)	613 676.00	4 574 611.23	0.20

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

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 比率 (%)
GBP IMPERIAL BRANDS PL GBPO.10	29 130.00	641 759.88	0.03
GBP INTERCONTL HOTELS ORD GBPO.208521303	5 090.00	329 656.62	0.01
GBP INTERTEK GROUP ORD GBPO.01	4 832.00	344 760.59	0.01
GBP LEGAL & GENERAL GP ORD GBPO.025	183 447.00	666 543.94	0.03
GBP LONDON STOCK EXCH ORD GBPO.06918604	9 715.00	863 559.74	0.04
GBP M&G PLC ORD GBPO.05	77 152.00	235 518.82	0.01
GBP MICRO FOCUS INTL ORD GBPO.10	10 149.00	148 710.94	0.01
GBP MORRISON(W)SUPRMKT ORD GBPO.10	57 051.00	146 336.41	0.01
GBP NEXT ORD GBPO.10	4 198.00	366 967.04	0.02
GBP PEARSON ORD GBPO.25	23 700.00	198 221.37	0.01
GBP PERSIMMON ORD GBPO.10	9 697.00	320 851.72	0.01
GBP PRUDENTIAL ORD GBPO.05	77 152.00	1 373 693.48	0.06
GBP RIO TINTO ORD GBPO.10	34 196.00	1 858 429.58	0.08
GBP ROYAL BK SCOT GRP ORD GBP1 (POST CONS)	139 009.00	406 726.02	0.02
GBP RSA INSURANCE GRP ORD GBP1.00	31 290.00	223 171.51	0.01
GBP SAINSBURY(J) ORD GBPO.28571428	61 156.00	169 522.63	0.01
GBP SCHROEDERS VTG SHS GBP1	4 128.00	176 152.35	0.01
GBP SMITH & NEPHEW ORD USDO.20	25 330.00	567 150.99	0.02
GBP STANDARD CHARTERED ORD USDO.50	86 255.00	778 095.06	0.03
GBP STD LIFE ABERDEEN ORD GBPO.1396825396	72 388.00	296 725.76	0.01
GBP TAYLOR WIMPEY ORD GBPO.01	100 039.00	225 480.28	0.01
GBP TESCO ORD GBPO.05	297 694.00	883 344.14	0.04
GBP UNILEVER PLC ORD GBPO.031111	33 536.00	1 985 882.20	0.08
GBP VODAFONE GROUP ORD USDO.2095238(POST CONS)	811 310.00	1 609 405.06	0.07
<b>イギリス合計</b>		<b>36 413 389.59</b>	<b>1.56</b>
<b>アメリカ合衆国</b>			
CAD BAUSCH HEALTH COMP COM NPV	10 500.00	296 600.79	0.01
<b>アメリカ合衆国合計</b>		<b>296 600.79</b>	<b>0.01</b>
<b>記名株式合計</b>		<b>242 155 392.13</b>	<b>10.38</b>
<b>預託証券</b>			
<b>ルクセンブルグ</b>			
EUR SES S.A. FDR EACH REP 1 'A' NPV	12 841.00	170 538.98	0.01
<b>ルクセンブルグ合計</b>		<b>170 538.98</b>	<b>0.01</b>
<b>オランダ</b>			
EUR ABN AMRO BANK N.V. DR EACH REP SHS	15 860.00	270 877.29	0.01
<b>オランダ合計</b>		<b>270 877.29</b>	<b>0.01</b>
<b>預託証券合計</b>		<b>441 416.27</b>	<b>0.02</b>
<b>投資信託証券</b>			
<b>アイルランド</b>			
USD STAR COMPASS PLC/UBS DYNMC DIVERSIFIED LTD NOTE DUE 31.03.21	49 150 000.00	69 768 425.00	2.99
<b>アイルランド合計</b>		<b>69 768 425.00</b>	<b>2.99</b>
<b>投資信託証券合計</b>		<b>69 768 425.00</b>	<b>2.99</b>

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

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 比率 (%)
<b>投資信託、クローズド・エンド型</b>			
<b>カナダ</b>			
CAD RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5 615.00	114 730.74	0.00
<b>カナダ合計</b>		<b>114 730.74</b>	<b>0.00</b>
<b>イギリス</b>			
GBP SEGRO PLC REIT	32 566.00	376 589.64	0.02
<b>イギリス合計</b>		<b>376 589.64</b>	<b>0.02</b>
<b>投資信託、クローズド・エンド型合計</b>		<b>491 320.38</b>	<b>0.02</b>
<b>ノート、固定利付債</b>			
<b>米ドル</b>			
USD 3M CO 2.25000% 16-19.09.26	1 500 000.00	1 507 919.10	0.06
USD ABU DHABI, GOVERNMENT OF-REG-S 3.12500% 17-11.10.27	5 675 000.00	5 937 468.75	0.25
USD ALBERTA, PROVINCE OF 3.30000% 18-15.03.28	3 600 000.00	3 933 376.20	0.17
USD ALPHABET INC 1.99800% 16-15.08.26	4 075 000.00	4 062 927.12	0.17
USD AMERICAN EXPRESS CO 3.40000% 18-27.02.23	3 100 000.00	3 219 853.75	0.14
USD APPLE INC 2.00000% 15-06.05.20	5 025 000.00	5 028 299.91	0.22
USD APPLE INC 2.40000% 13-03.05.23	5 700 000.00	5 786 928.42	0.25
USD APPLE INC 2.45000% 16-04.08.26	2 500 000.00	2 538 762.00	0.11
USD APPLE INC 2.85000% 16-23.02.23	5 150 000.00	5 286 723.23	0.23
USD APPLE INC 3.20000% 17-11.05.27	3 290 000.00	3 490 337.97	0.15
USD APPLE INC 3.25000% 16-23.02.26	9 400 000.00	9 978 372.60	0.43
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.62500% 19-30.01.24	2 800 000.00	2 902 884.88	0.12
USD BANK OF NOVA SCOTIA 2.00000% 19-15.11.22	1 260 000.00	1 258 346.48	0.05
USD BAYER US FINANCE II LLC-REG-S 3.87500% 18-15.12.23	2 100 000.00	2 203 341.63	0.09
USD BERKSHIRE HATHAWAY INC 2.20000% 16-15.03.21	2 075 000.00	2 085 458.00	0.09
USD BERKSHIRE HATHAWAY INC 3.12500% 16-15.03.26	2 100 000.00	2 212 498.47	0.09
USD BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 1.75000% 19-27.09.24	1 000 000.00	998 747.00	0.04
USD CHEVRON CORP 2.41900% 15-17.11.20	2 300 000.00	2 312 895.41	0.10
USD CHEVRON CORP 3.19100% 13-24.06.23	6 825 000.00	7 106 339.47	0.30
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 3.90000% 18-16.03.28	1 600 000.00	1 769 296.00	0.08
USD CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 4.37500% 12-15.06.22	2 800 000.00	2 936 668.00	0.13
USD COUNCIL OF EUROPE DEVELOPMENT BANK 1.62500% 16-16.03.21	1 000 000.00	997 436.36	0.04
USD DEXIA CREDIT LOCAL SA-REG-S 2.50000% 18-25.01.21	1 050 000.00	1 056 870.78	0.05
USD EQUINOR ASA 3.62500% 18-10.09.28	4 000 000.00	4 405 865.60	0.19
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.00000% 16-15.03.21	2 500 000.00	2 508 177.00	0.11
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.25000% 16-16.12.19	2 475 000.00	2 474 430.75	0.11
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.37500% 17-24.05.27	4 000 000.00	4 161 079.60	0.18
USD EXPORT DEVELOPMENT CANADA 2.00000% 17-17.05.22	1 000 000.00	1 008 132.51	0.04
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 2.50000% 15-10.05.21	3 200 000.00	3 217 000.00	0.14
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 3.25000% 15-10.11.25	3 400 000.00	3 593 375.00	0.15
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 2.75000% 17-25.01.22	2 975 000.00	3 020 554.69	0.13
USD EXXON MOBIL CORP 3.04300% 16-01.03.26	6 725 000.00	7 081 882.97	0.30
USD HSBC BANK PLC-REG-S 4.12500% 10-12.08.20	625 000.00	634 207.69	0.03
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.37500% 17-07.07.27	1 900 000.00	1 971 916.14	0.08
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.25000% 19-18.06.29	3 375 000.00	3 488 071.61	0.15
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.00000% 19-23.07.26	2 800 000.00	2 839 854.92	0.12
USD INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 2.85000% 19-13.05.22	2 000 000.00	2 038 253.40	0.09
USD INTL BK FOR RECONS & DEV WORLD BK 1.75000% 19-23.10.29	1 600 000.00	1 584 643.98	0.07
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.12500% 17-13.12.21	2 700 000.00	2 723 697.09	0.12
USD JOHNSON & JOHNSON 2.45000% 16-01.03.26	4 425 000.00	4 508 284.26	0.19

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・メディアム(米ドル)

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 比率 (%)
USD JOHNSON & JOHNSON 2.90000% 17-15.01.28	1 000 000.00	1 050 719.70	0.05
USD JOHNSON & JOHNSON 3.37500% 13-05.12.23	1 400 000.00	1 486 079.98	0.06
USD KOREA DEVELOPMENT BANK 2.75000% 17-19.03.23	1 950 000.00	1 986 562.50	0.09
USD KOREA EAST-WEST POWER CO LTD-REG-S 3.87500% 18-19.07.23	2 030 000.00	2 139 746.88	0.09
USD KOREA HYDRO&NUCLEAR POWER CO LTD-REG-S 3.00000% 12-19.09.22	800 000.00	817 000.00	0.03
USD KOREA HYDRO&NUCLEAR POWER CO LTD-REG-S 3.12500% 17-25.07.27	3 450 000.00	3 590 156.25	0.15
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.12500% 13-17.01.23	4 275 000.00	4 333 926.17	0.19
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.00000% 15-02.05.25	6 150 000.00	6 241 497.85	0.27
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 1.62500% 16-15.03.21	3 000 000.00	2 996 729.01	0.13
USD KUWAIT INTERNATIONAL GOVT BOND-REG-S 3.50000% 17-20.03.27	6 000 000.00	6 436 875.00	0.28
USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 2.00000% 15-13.01.25	3 875 000.00	3 925 237.44	0.17
USD MANITOBA, PROVINCE OF 2.12500% 17-04.05.22	4 925 000.00	4 962 664.92	0.21
USD MICROSOFT CORP 2.65000% 15-03.11.22	4 700 000.00	4 813 654.46	0.21
USD MICROSOFT CORP 2.87500% 17-06.02.24	7 000 000.00	7 267 446.90	0.31
USD MICROSOFT CORP 3.30000% 17-06.02.27	7 250 000.00	7 807 063.17	0.33
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD/NY 2.50000% 16-12.07.26	3 200 000.00	3 209 088.00	0.14
USD NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 3.00000% 18-10.01.28	1 700 000.00	1 773 145.39	0.08
USD NORDEA BANK AB-REG-S 4.87500% 10-27.01.20	1 400 000.00	1 406 109.60	0.06
USD NORDIC INVESTMENT BANK 2.25000% 14-30.09.21	800 000.00	806 140.32	0.03
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 2.40000% 12-21.09.22	3 450 000.00	3 503 247.99	0.15
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 3.10000% 17-17.05.27	2 310 000.00	2 443 098.73	0.10
USD QATAR, STATE OF-REG-S 2.37500% 16-02.06.21	6 450 000.00	6 474 187.50	0.28
USD QATAR, STATE OF-REG-S 3.37500% 19-14.03.24	1 400 000.00	1 463 437.50	0.06
USD QUEBEC, PROVINCE OF 2.50000% 16-20.04.26	5 450 000.00	5 623 310.55	0.24
USD ROCHE HOLDINGS INC-REG-S 3.00000% 15-10.11.25	3 675 000.00	3 868 185.93	0.17
USD ROCHE HOLDINGS INC-REG-S 3.62500% 18-17.09.28	3 000 000.00	3 331 891.50	0.14
USD SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 2.25000% 12-06.01.23	1 850 000.00	1 862 776.28	0.08
USD SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 1.87500% 16-10.05.21	900 000.00	900 438.48	0.04
USD SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 2.87500% 16-10.05.26	4 400 000.00	4 558 570.28	0.20
USD SINOPEC GROUP OVERSEAS DEV 2013-REG-S 4.37500% 13-17.10.23	1 275 000.00	1 360 195.50	0.06
USD TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.70000% 13-15.01.24	1 500 000.00	1 594 359.60	0.07
USD WALMART INC 2.55000% 13-11.04.23	2 925 000.00	2 983 988.18	0.13
USD WALMART INC 3.70000% 18-26.06.28	6 000 000.00	6 633 853.20	0.28
USD WELLS FARGO CO 3.50000% 12-08.03.22	1 300 000.00	1 340 233.70	0.06
USD WESTPAC BANKING CORP 2.85000% 16-13.05.26	6 755 000.00	6 899 692.10	0.30
USD WESTPAC BANKING CORP 3.35000% 17-08.03.27	1 200 000.00	1 265 460.00	0.05
米ドル合計		253 027 949.30	10.85

## ノート、固定利付債合計

253 027 949.30 10.85

## 中期債券、固定利付債

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額	純資産 比率 (%)
USD AFRICAN DEVELOPMENT BANK 2.37500% 14-23.09.21	2 150 000.00	2 175 435.79	0.09
USD ASB FINANCE LTD-REG-S 2.12500% 16-01.09.21	2 000 000.00	1 999 800.00	0.09
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.62500% 17-12.01.27	3 250 000.00	3 425 598.80	0.15
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.00000% 17-16.02.22	1 900 000.00	1 913 262.00	0.08
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.50000% 17-02.11.27	4 000 000.00	4 191 630.00	0.18
USD AUSTRALIA & NZ BANKING GRP-REG-S 5.10000% 10-13.01.20	1 125 000.00	1 128 838.50	0.05
USD BANK OF AMERICA CORP 3.24800% 16-21.10.27	2 950 000.00	3 075 611.00	0.13
USD BANK OF MONTREAL 1.90000% 16-27.08.21	1 300 000.00	1 298 947.63	0.06
USD BELGIUM, KINGDOM OF-REG-S 1.62500% 17-15.01.20	1 450 000.00	1 449 521.50	0.06
USD CAISSE D'AMOR DE LA DETTE SOCIALE-REG-S 3.37500% 14-20.03.24	1 750 000.00	1 863 379.00	0.08
USD CLIFFORD CAPITAL PTE LTD-REG-S 1.73300% 19-10.09.24	2 200 000.00	2 173 754.00	0.09
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 3.15000% 17-19.09.27	725 000.00	759 568.00	0.03

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

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 比率 (%)
USD	CPPIB CAPITAL INC-REG-S 2.75000% 17-02.11.27	3 025 000.00	0.14
USD	FINNVERA OYJ-REG-S 1.87500% 17-05.10.20	1 000 000.00	0.04
USD	IDB TRUST SERVICES LTD-REG-S 2.26100% 17-26.09.22	3 150 000.00	0.14
USD	INTERNATIONAL FINANCE CORP 2.12500% 16-07.04.26	1 700 000.00	0.07
USD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 17-22.11.27	6 200 000.00	0.28
USD	JAPAN TOBACCO INC-REG-S 2.80000% 16-13.04.26	1 800 000.00	0.08
USD	KOMMUNEKREDIT-REG-S 1.62500% 16-01.06.21	950 000.00	0.04
USD	LANDESKREDITBANK B-WUERTT FOERDBK-REG-S 1.37500% 16-21.07.21	1 100 000.00	0.05
USD	MDGH - GMTN BV-REG-S 3.00000% 17-19.04.24	2 300 000.00	0.10
USD	MUNICIPALITY FINANCE PLC-REG-S 1.87500% 17-18.09.20	975 000.00	0.04
USD	NEDERLANDSE WATERSCHAPSBK NV-REG-S 3.00000% 18-21.12.21	925 000.00	0.04
USD	NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 1.87500% 16-09.03.21	2 400 000.00	0.10
USD	NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 2.37500% 17-18.01.22	1 475 000.00	0.06
USD	NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 3.12500% 18-22.03.23	1 970 000.00	0.09
USD	NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CORP-REG-S 2.60000% 17-28.09.22	500 000.00	0.02
USD	NORDRHEIN-WESTFALEN, STATE OF-REG-S 2.25000% 15-16.04.25	900 000.00	0.04
USD	SP POWERASSETS LTD-REG-S 3.25000% 15-24.11.25	1 500 000.00	0.07
USD	SUMITOMO MITSUI BANKING CORP-REG-S 2.44000% 19-18.06.24	1 601 000.00	0.07
USD	SVENSK EXPORTKREDIT AB 1.75000% 16-10.03.21	1 100 000.00	0.05
USD	TORONTO-DOMINION BANK 2.50000% 15-14.12.20	3 850 000.00	0.17
USD	TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 2.60000% 17-11.01.22	1 550 000.00	0.07
USD	TOYOTA MOTOR FINANCE NL BV-REG-S 2.76400% 19-26.04.21	1 700 000.00	0.07
米ドル合計		67 996 213.88	2.92

中期債券、固定利付債合計	67 996 213.88	2.92
--------------	---------------	------

## 債券、固定利付債

## 米ドル

USD	AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT-REG-S 1.62500% 15-21.01.20	1 250 000.00	0.05
USD	BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN NV-REG-S 2.62500% 14-28.04.21	1 600 000.00	0.07
USD	BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN NV-REG-S 2.37500% 16-16.03.26	1 800 000.00	0.08
USD	BANK OF NOVA SCOTIA 1.85000% 15-14.04.20	1 675 000.00	0.07
USD	CAISSE D' AMORTIS DE LA DETTE SOC-REG-S 1.87500% 15-12.02.22	2 350 000.00	0.10
USD	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COM/CAN-REG-S 2.35000% 17-27.07.22	1 475 000.00	0.06
USD	CENTRAL JAPAN RAILWAY CO-REG-S 3.40000% 18-06.09.23	1 700 000.00	0.08
USD	DBS BANK LTD-REG-S 3.30000% 18-27.11.21	2 000 000.00	0.09
USD	DNB BOLIGKREDITT AS-REG-S 2.50000% 17-28.03.22	2 100 000.00	0.09
USD	EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.87500% 15-10.02.25	5 900 000.00	0.26
USD	FAB SUKUK CO LTD-REG-S 3.87500% 19-22.01.24	1 600 000.00	0.07
USD	FMS WERTMANAGEMENT 2.00000% 17-01.08.22	1 650 000.00	0.07
USD	ING BANK NV-REG-S 2.62500% 12-05.12.22	1 500 000.00	0.07
USD	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 3.87500% 10-14.02.20	2 300 000.00	0.10
USD	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.12500% 15-15.01.25	5 375 000.00	0.23
USD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 14-25.11.24	3 000 000.00	0.13
USD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT 2.50000% 15-29.07.25	5 850 000.00	0.26
USD	KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 3.25000% 14-10.07.24	2 200 000.00	0.10
USD	KOREA, REPUBLIC OF 3.87500% 13-11.09.23	2 000 000.00	0.09
USD	KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.50000% 14-20.11.24	4 025 000.00	0.18
USD	MDGH - GMTN BV-REG-S 2.75000% 16-11.05.23	2 000 000.00	0.09
USD	MORGAN STANLEY 5.50000% 10-24.07.20	1 849 000.00	0.08
USD	NOVARTIS CAPITAL CORP 3.40000% 14-06.05.24	1 000 000.00	0.05
USD	OESTERREICHISCHE KONTROLLBANK AG 2.37500% 14-01.10.21	1 275 000.00	0.06
USD	ONTARIO, PROVINCE OF 3.20000% 14-16.05.24	4 400 000.00	0.20

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

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 比率 (%)
USD ONTARIO, PROVINCE OF 2.50000% 16-27.04.26	3 500 000.00	3 608 553.55	0.15
USD ROYAL BANK OF CANADA 2.10000% 15-14.10.20	1 575 000.00	1 576 463.01	0.07
米ドル合計		68 708 833.84	2.95
<b>債券、固定利付債合計</b>		<b>68 708 833.84</b>	<b>2.95</b>
<b>財務省証券(T-note)、固定利付債</b>			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.62500% 19-15.02.29	21 900 000.00	23 474 916.60	1.01
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 15-31.01.22	300 000.00	299 238.28	0.01
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 17-15.02.27	11 850 000.00	12 267 989.79	0.53
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 13-15.05.23	50 000.00	50 224.61	0.00
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 17-15.05.20	3 755 000.00	3 752 213.07	0.16
米ドル合計		39 844 582.35	1.71
<b>財務省証券(T-note)、固定利付債合計</b>		<b>39 844 582.35</b>	<b>1.71</b>
<b>財務省証券(T-note)、変動利付債</b>			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.875%/CPI LINKED 99-15.04.29	3 500 000.00	7 297 380.37	0.31
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.375%/CPI LINKED 04-15.01.25	5 000 000.00	7 554 917.65	0.33
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.625%/CPI LINKED 16-15.01.26	5 950 000.00	6 594 490.05	0.28
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.125%/CPI LINKED 11-15.01.21	2 800 000.00	3 308 239.55	0.14
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 12-15.01.22	5 175 000.00	5 835 963.82	0.25
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 13-15.01.23	5 710 000.00	6 313 440.46	0.27
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI LINKED 17-15.01.27	8 225 000.00	8 845 099.44	0.38
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI LINKED 15-15.07.25	6 650 000.00	7 294 550.25	0.31
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.750%/CPI LINKED 18-15.07.28	10 300 000.00	11 056 626.39	0.48
米ドル合計		64 100 707.98	2.75
<b>財務省証券(T-note)、変動利付債合計</b>		<b>64 100 707.98</b>	<b>2.75</b>
<b>公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある証券および短期金融商品合計</b>		<b>988 196 382.40</b>	<b>42.38</b>
<b>他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券および短期金融商品</b>			
<b>財務省短期証券(T-bills)、ゼロ・クーポン</b>			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 06.12.18-05.12.19	10 000 000.00	9 998 825.60	0.43
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 11.07.19-09.01.20	10 000 000.00	9 983 463.00	0.43
米ドル合計		19 982 288.60	0.86
<b>財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン合計</b>		<b>19 982 288.60</b>	<b>0.86</b>
<b>ノート、固定利付債</b>			
米ドル			
USD ALTRIA GROUP INC 2.85000% 12-09.08.22	1 900 000.00	1 927 349.36	0.08
USD FANNIE MAE 2.12500% 16-24.04.26	5 000 000.00	5 102 606.00	0.22
USD HSBC HOLDINGS PLC 4.87500% 11-14.01.22	1 450 000.00	1 531 468.98	0.07
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 2.45000% 15-23.11.20	900 000.00	904 734.99	0.04
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD NEW YORK 2.87500% 18-12.04.23	800 000.00	817 916.24	0.04

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

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 比率 (%)
USD NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 1.95000% 17-28.09.20	1 000 000.00	1 000 606.10	0.04
USD PROCTER & GAMBLE CO 2.30000% 12-06.02.22	2 825 000.00	2 863 746.57	0.12
USD SANOFI 4.00000% 11-29.03.21	1 800 000.00	1 851 336.00	0.08
米ドル合計		15 999 764.24	0.69
ノート、固定利付債合計		15 999 764.24	0.69
ノート、変動利付債			
米ドル			
USD JPMORGAN CHASE BANK NA 3.086%/VAR 18-26.04.21	1 250 000.00	1 254 755.13	0.05
米ドル合計		1 254 755.13	0.05
ノート、変動利付債合計		1 254 755.13	0.05
中期債券、固定利付債			
米ドル			
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 3.85000% 14-08.07.24	1 500 000.00	1 587 712.20	0.07
USD GUARDIAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 2.00000% 16-26.04.21	2 000 000.00	2 000 883.80	0.08
USD MACQUARIE GROUP LTD-REG-S 6.25000% 11-14.01.21	2 150 000.00	2 240 579.50	0.10
米ドル合計		5 829 175.50	0.25
中期債券、固定利付債合計		5 829 175.50	0.25
中期債券、ゼロ・クーポン債			
米ドル			
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.00000% 00-01.05.30	1 908 000.00	1 497 788.28	0.06
米ドル合計		1 497 788.28	0.06
中期債券、ゼロ・クーポン債合計		1 497 788.28	0.06
債券、固定利付債			
米ドル			
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 1.62500% 19-17.10.22	1 000 000.00	992 600.00	0.04
USD ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 3.35000% 18-22.10.21	1 900 000.00	1 950 650.58	0.09
米ドル合計		2 943 250.58	0.13
債券、固定利付債合計		2 943 250.58	0.13
財務省証券(T-note)、変動利付債			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.625%/CPI LINKED 14-15.01.24	8 700 000.00	9 724 774.24	0.42
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.250%/CPI LINKED 15-15.01.25	7 665 000.00	8 330 539.29	0.36
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 16-15.04.21	1 417 000.00	1 524 765.71	0.06
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 12-15.07.22	3 475 000.00	3 873 577.87	0.17
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI INDEX 13-15.07.23	4 239 000.00	4 714 997.54	0.20
米ドル合計		28 168 654.65	1.21
財務省証券(T-note)、変動利付債合計		28 168 654.65	1.21
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券および短期金融商品合計		75 675 676.98	3.25

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

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 比率 (%)
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取引されていない 譲渡性のある証券および短期金融商品			
<b>優先株式</b>			
イギリス			
GBP ROLLS ROYCE HLDGS NON CUM RED PREF GBPO.001 C	2 468 222.00	3 192.64	0.00
イギリス合計		3 192.64	0.00
<b>優先株式合計</b>			
		3 192.64	0.00
<b>ノート、固定利付債</b>			
米ドル			
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 2.95000% 18-11.01.25	1 550 000.00	1 593 298.16	0.07
USD SVENSKA HANDELSBANKEN AB 1.95000% 17-08.09.20	1 250 000.00	1 248 613.00	0.05
米ドル合計		2 841 911.16	0.12
<b>ノート、固定利付債合計</b>			
		2 841 911.16	0.12
<b>債券、固定利付債</b>			
米ドル			
USD HSBC BANK CANADA-REG-S 3.30000% 18-28.11.21	1 350 000.00	1 385 625.29	0.06
USD HSBC BANK CANADA-REG-S 1.65000% 19-10.09.22	1 500 000.00	1 489 717.95	0.07
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 2.75000% 17-22.06.24	950 000.00	968 676.72	0.04
USD SWEDBANK AB-REG-S 2.80000% 17-14.03.22	1 000 000.00	1 010 128.80	0.04
米ドル合計		4 854 148.76	0.21
<b>債券、固定利付債合計</b>			
		4 854 148.76	0.21
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取引されていない 譲渡性のある証券および短期金融商品合計			
		7 699 252.56	0.33
<b>ルクセンブルグ2010年12月17日法(改訂済)の第41条(1)e)に規定されたUCITS / その他のUCIs</b>			
<b>投資信託、オープン・エンド型</b>			
アイルランド			
USD UBS (IRL) ETF PLC - MSCI USA UCITS-ACC-A-USD-ETF	14 275 324.00	243 537 027.44	10.45
USD UBS ETFS PLC - MSCI USA TRN INDEX SF (USD) A-ACC	978 817.00	82 758 977.35	3.55
USD XTRACKERS MSCI USA UCITS ETF DR-1C-USD CAP	1 922 118.00	165 129 157.38	7.08
アイルランド合計		491 425 162.17	21.08
ルクセンブルグ			
USD AQR UCITS FUNDS - GLOBAL RISK PARITY UCITS FUND-A2-CAP	381 969.46	45 603 333.83	1.96
EUR DB PLATINUM IV UBS MULTI-STRATEGY ALTERNATIVES-IOC-E-CAP	6 112.32	67 647 400.22	2.90
USD INVESCO FUNDS SICAV BAL RISK ALLOCATION-PI1-USD HDG-CAP	3 899 378.34	46 129 645.76	1.98
USD UBS (LUX) BOND FUND - EURO HIGH YIELD (EUR)(USD HEDGED) F-ACC	396 428.00	45 791 398.28	1.96
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD (USD) F-ACC	215 417.00	69 719 712.05	2.99
USD UBS (LUX) BOND SICAV USD - INVEST GRADE CORP USD F ACC	2 951.00	323 540 266.60	13.88
USD UBS (LUX) BOND SICAV - EMERG ECON CORPORATES (USD) F-ACC	401 336.00	45 523 542.48	1.95

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ  
- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・メディアム(米ドル)

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 比率 (%)
USD UBS (LUX) EMERGING ECONOMIES FUND - GLOBAL BONDS (USD) F-ACC	34 731.00	69 818 340.06	2.99
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD U-X-ACC	1.00	11 088.70	0.00
ルクセンブルグ合計		713 784 727.98	30.61
投資信託、オープン・エンド型合計		1 205 209 890.15	51.69
ルクセンブルグ2010年12月17日法(改訂済)の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs合計		1 205 209 890.15	51.69
投資有価証券合計		2 276 781 202.09	97.65

### 派生商品

公認の証券取引所に上場されている派生商品

#### 債券に係る金融先物

USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 20.03.20	-439.00	281 234.38	0.01
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.20	-907.00	191 320.77	0.01
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.20	-415.00	48 633.02	0.00
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 20.03.20	-584.00	255 500.00	0.01
USD US LONG BOND FUTURE 20.03.20	-58.00	58 000.00	0.01
債券に係る金融先物合計		834 688.17	0.04

#### 指数に係る金融先物

EUR EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 20.12.19	863.00	774 389.06	0.03
CHF SWISS MARKET INDEX FUTURE 20.12.19	85.00	254 300.20	0.01
GBP FTSE 100 INDEX FUTURE 20.12.19	177.00	111 695.64	0.00
SGD MSCI SINGAPORE INDEX FUTURE 30.12.19	51.00	-7 832.10	0.00
USD S&P500 EMINI FUTURE 20.12.19	1 201.00	6 261 349.02	0.27
JPY TOPIX INDX FUTURE 12.12.19	163.00	569 630.96	0.02
USD MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 20.12.19	1 684.00	362 077.84	0.02
AUD SPI 200 INDEX FUTURE 19.12.19	64.00	118 962.86	0.00
CAD S&P/TSX 60 INDEX FUTURE 19.12.19	74.00	372 628.10	0.02
HKD HANG SENG INDEX FUTURE 30.12.19	22.00	-111 155.82	0.00
指数に係る金融先物合計		8 706 045.76	0.37

公認の証券取引所に上場されている派生商品合計 9 540 733.93 0.41

派生商品合計 9 540 733.93 0.41

注記は当財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・メディアム(米ドル)

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 比率 (%)
<b>先渡為替契約</b>			
<b>先渡為替契約(購入/売却)</b>			
USD	32 775 555.30	CHF 32 485 000.00	9.1.2020 154 631.30 0.01
USD	29 765 352.50	GBP 23 465 000.00	9.1.2020 -637 817.48 -0.03
USD	23 789 842.12	CAD 31 450 000.00	9.1.2020 102 993.00 0.01
USD	203 460.00	AUD 300 000.00	9.1.2020 315.22 0.00
USD	701 656.27	HKD 5 500 000.00	9.1.2020 -669.50 0.00
JPY	358 500 000.00	USD 3 330 335.88	9.1.2020 -45 825.15 0.00
USD	182 647.20	SGD 250 000.00	9.1.2020 -243.16 0.00
USD	97 968 348.72	EUR 88 440 000.00	9.1.2020 156 190.93 0.01
USD	1 613 938.53	JPY 175 000 000.00	9.1.2020 10 620.88 0.00
USD	2 286 034.75	EUR 2 050 000.00	9.1.2020 18 792.29 0.00
CHF	1 000 000.00	USD 1 011 318.68	9.1.2020 -7 134.47 0.00
USD	24 200 028.98	CAD 31 750 000.00	15.1.2020 286 883.58 0.01
USD	7 977 601.07	JPY 864 500 000.00	15.1.2020 54 769.47 0.00
USD	43 020 474.57	GBP 33 310 000.00	15.1.2020 -145 604.83 -0.01
USD	184 418.69	SGD 250 000.00	15.1.2020 1 515.77 0.00
USD	409 245.24	AUD 590 000.00	15.1.2020 9 670.42 0.00
USD	1 340 176.66	HKD 10 500 000.00	15.1.2020 -600.41 0.00
USD	38 229 543.74	CHF 37 660 000.00	15.1.2020 396 598.40 0.02
USD	137 161 165.63	EUR 122 645 461.98	15.1.2020 1 469 465.89 0.06
USD	2 170 443.41	EUR 1 950 000.00	9.1.2020 13 798.14 0.00
USD	2 171 254.61	EUR 1 950 000.00	15.1.2020 13 826.11 0.00
AUD	78 696 500.00	USD 53 479 701.81	16.1.2020 -181 592.68 -0.01
GBP	58 419 900.00	USD 75 389 034.88	16.1.2020 318 724.56 0.01
SEK	186 056 700.00	USD 19 400 033.88	16.1.2020 94 918.80 0.01
CAD	57 249 300.00	USD 43 071 063.84	16.1.2020 47 492.41 0.00
CHF	308 908 800.00	USD 310 954 883.13	16.1.2020 -606 467.26 -0.03
EUR	336 997 200.00	USD 372 577 364.38	16.1.2020 290 005.63 0.01
SGD	86 425 000.00	USD 63 339 147.51	16.1.2020 -108 884.54 0.00
USD	365 010.83	SGD 498 200.00	16.1.2020 517.72 0.00
GBP	2 259 500.00	USD 2 917 016.76	16.1.2020 11 123.86 0.00
USD	2 464 551.54	EUR 2 233 800.00	16.1.2020 -7 015.38 0.00
USD	118 935.60	SEK 1 137 200.00	16.1.2020 -219.80 0.00
USD	2 143 822.46	EUR 1 941 200.00	16.1.2020 -3 999.95 0.00
USD	777 147.60	GBP 600 000.00	9.1.2020 -261.39 0.00
USD	1 016 389.39	CAD 1 350 000.00	15.1.2020 -390.02 0.00
USD	1 016 373.71	CAD 1 350 000.00	9.1.2020 -390.88 0.00
USD	777 274.80	GBP 600 000.00	15.1.2020 -258.90 0.00
USD	1 906 463.67	CHF 1 900 000.00	9.1.2020 -1 486.33 0.00
USD	1 907 249.65	CHF 1 900 000.00	15.1.2020 -1 475.69 0.00
USD	884 595.92	EUR 800 000.00	15.1.2020 -502.95 0.00
USD	884 265.92	EUR 800 000.00	9.1.2020 -511.63 0.00
<b>先渡為替契約(購入/売却)合計</b>			<b>1 701 501.98 0.07</b>
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産			51 011 680.29 2.19
その他の資産および負債			-7 493 872.73 -0.32
<b>純資産総額</b>			<b>2 331 541 245.56 100.00</b>

注記は当財務書類と不可分のものである。

[次へ](#)

## 5 販売及び買戻しの実績

2019年12月末日前1年間における販売および買戻しの実績ならびに2019年12月末日現在の発行済口数は以下のとおりである。

		販売口数	買戻し口数	発行済口数
ダイナミック・インカム(米ドル)	クラスP - m d i s t 投資証券	2,224,162.999 (256,866.499) (注3)	212,121.655 (15,304.815)	2,012,041.344 (241,561.684)
	クラスP - a c c 投資証券	674,003.710 (109,063.411)	81,687.383 (4,846.839)	592,316.327 (104,216.572)
フィクスト・インカム(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	42,835.413 (22,284.411)	47,998.178 (36,946.743)	365,129.008 (258,124.485)
	クラス(日本円・ヘッジ)P - a c c 投資証券	540,341.266 (540,341.266)	186,354.841 (186,354.838)	1,041,998.686 (1,037,494.770)
インカム(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	37,427.300 (0.000)	116,449.578 (18,200.000)	609,200.428 (12,056.837)
システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	1,222,407.136 (10,822.557)	670,212.434 (97,944.588)	3,276,564.109 (152,154.599)
システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	1,892,674.396 (113,184.347)	1,472,396.647 (183,369.418)	5,786,185.875 (459,701.241)
システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	529,073.757 (51,500.679)	355,148.466 (87,085.675)	1,475,728.764 (79,276.933)

(注1) ( )内の数字は本邦内における販売、買戻しおよび発行済口数であり、受渡し日を基準として算出している。一方、( )の上段の数字は約定日を基準として算出している。

(注2) ダイナミック・インカム(米ドル)は2019年1月28日に運用を開始した。

(注3) 2019年11月21日受渡日の買付約定において、適用された投資証券1口当たり純資産価格の訂正に伴う販売口数の増加分(12.771口)を含む。

[次へ](#)

(2) その他の訂正(下線の部分は訂正部分を示します。)

## 第二部ファンド情報

### 第1 ファンドの状況

#### 5 運用状況

##### (3) 運用実績

##### 純資産等の推移

<訂正前>

(前略)

(インカム(米ドル))

	資産総額		純資産総額		1口当たり純資産価格 (クラスP - a c c 投資証券)	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円
2014年5月末日に 終了する会計年度末	39,428.89	4,198	39,135.77	4,166	103.22	10,989
2015年5月末日に 終了する会計年度末	125,213.26	13,330	120,874.92	12,868	106.04	11,289
2016年5月末日に 終了する会計年度末	181,276.71	19,299	179,886.76	19,151	105.79	11,262
2017年5月末日に 終了する会計年度末	158,042.66	16,825	157,883.45	16,808	110.89	11,805
2018年5月末日に 終了する会計年度末	153,618.22	16,354	151,457.20	16,124	111.62	11,883
2019年5月末日に 終了する会計年度末	<u>138,527.54</u>	<u>14,748</u>	137,065.28	14,592	114.74	12,215
2018年9月末日	148,548.57	15,814	148,252.29	15,783	112.09	11,933
10月末日	147,387.46	15,691	146,295.74	15,575	110.26	11,738
11月末日	147,269.97	15,678	144,318.65	15,364	110.22	11,734
12月末日	139,806.56	14,884	135,210.40	14,394	109.26	11,632
2019年1月末日	140,781.13	14,988	138,748.11	14,771	112.39	11,965
2月末日	139,063.57	14,805	138,394.05	14,733	113.04	12,034
3月末日	139,112.37	14,810	138,080.67	14,700	114.36	12,175
4月末日	139,269.53	14,827	138,060.88	14,698	115.16	12,260
5月末日	<u>138,527.54</u>	<u>14,748</u>	137,065.28	14,592	114.74	12,215
6月末日	140,689.07	14,978	140,322.18	14,939	116.97	12,453
7月末日	141,308.20	15,044	140,678.56	14,977	117.23	12,480
8月末日	141,367.90	15,050	140,869.36	14,997	117.78	12,539

(注) インカム(米ドル)は2014年1月28日に運用を開始し、クラス(日本円・ヘッジ)P - a c c投資証券の初回純資産価格  
計算日は2016年6月7日であった。

## ( システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル) )

	資産総額		純資産総額		1口当たり純資産価格 (クラスP - a c c 投資証券)	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円
2018年5月末日に 終了する会計年度末	927,841.96	98,778	922,334.11	98,192	102.49	10,911
2019年5月末日に 終了する会計年度末	<u>1,090,530.33</u>	116,098	1,087,131.87	115,736	105.81	11,265
2018年9月末日	974,812.47	103,779	959,002.38	102,095	103.92	11,063
10月末日	939,960.80	100,068	934,797.63	99,519	101.40	10,795
11月末日	914,108.66	97,316	909,184.77	96,792	101.55	10,811
12月末日	920,445.40	97,991	905,504.59	96,400	102.05	10,864
2019年1月末日	943,395.14	100,434	937,386.64	99,794	103.41	11,009
2月末日	971,542.73	103,430	962,822.03	102,502	104.28	11,102
3月末日	1,021,920.52	108,794	1,014,781.69	108,034	105.66	11,249
4月末日	1,087,559.86	115,782	1,070,318.42	113,946	107.18	11,410
5月末日	<u>1,090,530.33</u>	116,098	1,087,131.87	115,736	105.81	11,265
6月末日	1,154,829.99	122,943	1,143,772.85	121,766	108.15	11,514
7月末日	1,193,362.71	127,045	1,186,545.63	126,320	108.65	11,567
8月末日	1,252,040.91	133,292	1,202,069.20	127,972	108.53	11,554

(注) システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル) は2017年6月1日に運用を開始した。

(後略)

&lt;訂正後&gt;

(前略)

## ( インカム(米ドル) )

	資産総額		純資産総額		1口当たり純資産価格 (クラスP - a c c 投資証券)	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円
2014年5月末日に 終了する会計年度末	39,428.89	4,198	39,135.77	4,166	103.22	10,989
2015年5月末日に 終了する会計年度末	125,213.26	13,330	120,874.92	12,868	106.04	11,289
2016年5月末日に 終了する会計年度末	181,276.71	19,299	179,886.76	19,151	105.79	11,262
2017年5月末日に 終了する会計年度末	158,042.66	16,825	157,883.45	16,808	110.89	11,805
2018年5月末日に 終了する会計年度末	153,618.22	16,354	151,457.20	16,124	111.62	11,883
2019年5月末日に 終了する会計年度末	<u>138,143.69</u>	<u>14,707</u>	137,065.28	14,592	114.74	12,215
2018年9月末日	148,548.57	15,814	148,252.29	15,783	112.09	11,933
10月末日	147,387.46	15,691	146,295.74	15,575	110.26	11,738
11月末日	147,269.97	15,678	144,318.65	15,364	110.22	11,734
12月末日	139,806.56	14,884	135,210.40	14,394	109.26	11,632
2019年1月末日	140,781.13	14,988	138,748.11	14,771	112.39	11,965
2月末日	139,063.57	14,805	138,394.05	14,733	113.04	12,034
3月末日	139,112.37	14,810	138,080.67	14,700	114.36	12,175
4月末日	139,269.53	14,827	138,060.88	14,698	115.16	12,260

5月末日	138,143.69	14,707	137,065.28	14,592	114.74	12,215
6月末日	140,689.07	14,978	140,322.18	14,939	116.97	12,453
7月末日	141,308.20	15,044	140,678.56	14,977	117.23	12,480
8月末日	141,367.90	15,050	140,869.36	14,997	117.78	12,539

(注) インカム(米ドル)は2014年1月28日に運用を開始し、クラス(日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券の初回純資産価格  
計算日は2016年6月7日であった。

(システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル))

	資産総額		純資産総額		1口当たり純資産価格 (クラス P - a c c 投資証券)	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円
2018年5月末日に 終了する会計年度末	927,841.96	98,778	922,334.11	98,192	102.49	10,911
2019年5月末日に 終了する会計年度末	1,090,530.13	116,098	1,087,131.87	115,736	105.81	11,265
2018年9月末日	974,812.47	103,779	959,002.38	102,095	103.92	11,063
10月末日	939,960.80	100,068	934,797.63	99,519	101.40	10,795
11月末日	914,108.66	97,316	909,184.77	96,792	101.55	10,811
12月末日	920,445.40	97,991	905,504.59	96,400	102.05	10,864
2019年1月末日	943,395.14	100,434	937,386.64	99,794	103.41	11,009
2月末日	971,542.73	103,430	962,822.03	102,502	104.28	11,102
3月末日	1,021,920.52	108,794	1,014,781.69	108,034	105.66	11,249
4月末日	1,087,559.86	115,782	1,070,318.42	113,946	107.18	11,410
5月末日	1,090,530.13	116,098	1,087,131.87	115,736	105.81	11,265
6月末日	1,154,829.99	122,943	1,143,772.85	121,766	108.15	11,514
7月末日	1,193,362.71	127,045	1,186,545.63	126,320	108.65	11,567
8月末日	1,252,040.91	133,292	1,202,069.20	127,972	108.53	11,554

(注) システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)は2017年6月1日に運用を開始した。

(後略)