

【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) ボンド・シキャブ
(UBS (Lux) Bond Sicav)

【代表者の役職氏名】 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)
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)

【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

【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
同 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) ボンド・シキャブ
- コーポレート・ボンド(米ドル)
- ハイ・イールド・ボンド(米ドル)
(UBS (Lux) Bond Sicav - USD Corporates (USD) / USD High
Yield (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】
届出の対象とした募集外国投資証券は、コーポレート・ボンド(米ドル)クラスP - a c c 投資証券およびハイ・イールド・ボンド(米ドル)クラスP - a c c 投資証券の2種類であり、いずれも記名式無額面投資証券である。
上限見込額は、以下の通りである。
コーポレート・ボンド(米ドル)について9億9,300万米ドル(約1,072億円)
ハイ・イールド・ボンド(米ドル)について15億3,250万米ドル(約1,654億円)

(注1) 米ドルの円貨換算は、便宜上、2019年9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=107.92円)による。

(注2) ファンドは、ルクセンブルグ法に基づいて設立されているが、投資証券は米ドル建てのため、以下の金額表示は別段の記載がない限り米ドルをもって行う。

【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29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、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外貨数字の円貨換算については、直近の為替レート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	追加 または 更新
5 運用状況	(1) 投資状況	2 外国投資法人の運用状況	(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 役員の状況		1 外国投資法人の概況	(4) 役員の状況	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) 役員の状況		(3) 役員の状況	更新
	(5) 事業の内容及び営業の概況		(4) 事業の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。

[次へ](#)

1 外国投資法人の概況

UBS (Lux) ボンド・シキャブ - コーポレート・ボンド (米ドル) / ハイ・イールド・ボンド (米ドル) (UBS (Lux) Bond Sicav - USD Corporates (USD) / USD High Yield (USD)) (以下、UBS (Lux) ボンド・シキャブを「本投資法人」、UBS (Lux) ボンド・シキャブ - コーポレート・ボンド (米ドル) / ハイ・イールド・ボンド (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。

(1) 主要な経営指標等の推移

コーポレート・ボンド (米ドル) (クラス P - a c c 投資証券)

(米ドル)

	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 ⁽¹⁾	2,611,016.30	266,934.04	- 1,468,941.48	5,346,024.13	6,610,360.89
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	2,611,016.30	266,934.04	- 1,468,941.48	5,346,024.13	6,610,360.89
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	2,611,016.30	266,934.04	- 1,468,941.48	5,346,024.13	6,610,360.89
(d) 出資総額 ⁽²⁾	114,209,317.50	95,230,459.96	83,464,773.44	97,699,572.91	107,459,288.90
(e) 発行済投資口総数	6,300,498.362口	5,382,104.762口	4,799,708.902口	5,187,714.688口	5,364,204.241口
(f) 純資産額	114,209,317.50	95,230,459.96	83,464,773.44	97,699,572.91	107,459,288.90
(g) 資産総額	116,102,400.20	96,820,475.80	84,519,159.22	99,779,204.01	110,565,980.73
(h) 1口当たり純資産価格	18.13	17.69	17.39	18.83	20.03
(i) 1口当たり当期純利益金額 または当期純損失金額	0.41	0.05	- 0.31	1.03	1.23
(j) 分配総額	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
(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	98.37%	98.36%	98.75%	97.92%	97.19%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾	6.02%	- 0.45%	- 4.08%	6.44%	15.18%

(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。以下各サブ・ファンドについて同様とする。

(2) ファンドは変動資本を有する傘型の会社型投資信託であり、純資産総額を記載している。以下各サブ・ファンドについて同様とする。

(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。以下各サブ・ファンドについて同様とする。

(注) 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)。以下各サブ・ファンドについて同様とする。

ハイ・イールド・ボンド(米ドル)(クラスP - a c c 投資証券)

(米ドル)

	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 ⁽¹⁾	3,287,818.23	2,781,301.63	- 86,973.51	4,974,863.28	3,569,192.08
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	3,287,818.23	2,781,301.63	- 86,973.51	4,974,863.28	3,569,192.08
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	3,287,818.23	2,781,301.63	- 86,973.51	4,974,863.28	3,569,192.08
(d) 出資総額 ⁽²⁾	146,969,053.36	116,043,040.51	92,701,719.59	90,198,624.32	89,152,931.38
(e) 発行済投資口総数	519,067.505口	411,401.970口	329,736.882口	304,680.852口	289,605.908口
(f) 純資産額	146,969,053.36	116,043,040.51	92,701,719.59	90,198,624.32	89,152,931.38
(g) 資産総額	148,370,352.73	116,526,676.99	92,757,093.73	90,783,903.92	89,771,913.86
(h) 1口当たり純資産価格	283.14	282.07	281.14	296.04	307.84
(i) 1口当たり当期純利益金額 または当期純損失金額	6.33	6.76	- 0.26	16.33	12.32
(j) 分配総額	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
(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	99.06%	99.58%	99.94%	99.36%	99.31%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾	8.39%	1.69%	- 0.71%	4.95%	9.50%

(2) 外国投資法人の出資総額

当該サブ・ファンドのクラス P - a c c 投資証券の2019年12月末日現在の発行済投資証券総数および各サブ・ファンドの出資総額は以下のとおりである。

なお、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 ^(注) (口)
	千米ドル	百万円	
コーポレート・ボンド(米ドル)	435,084.56	47,668	5,131,001.426
ハイ・イールド・ボンド(米ドル)	1,028,625.65	112,696	299,000.925

(注1) クラス P - a c c 投資証券の発行済投資証券総数である。

(注2) 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相場(1米ドル = 109.56円)による。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する。

(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	所有投資口
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 (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、1915年8月10日の商事会社に関する法律(改正済)(以下「1915年8月10日法」という。)に基づき、本投資法人の臨時投資主総会の決議により変更することができる。

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

定足数および多数決の要件に関する法律条件を満たす投資主総会は本投資法人を解散させるものとする。

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。本投資法人を解散する場合、解散は1名以上の清算人が実行する。投資主総会が、清算人を任命し、清算人の報酬および権限の範囲を決定する。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、サブ・ファンドの解散による正味収入を投資主の保有量に比例して当該サブ・ファンドの投資主に分配する。清算手続きの終了時(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供託金庫(Caisse de Consignation)に預託される。償還日の決められたサブ・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。

サブ・ファンドまたはサブ・ファンド内の投資証券クラスの純資産総額が、当該サブ・ファンドもしくは投資証券クラスの経済的で効率的な運営のため求められる金額を下回った場合、または当該金額に達しない場合、または政治、経済および金融環境に重大な変化がある場合、または合理化の一環として、本投資法人は、評価日または決定が有効となる時間の(投資対象の実際の換金価格および換金コストを勘案した)純資産価格で、該当する投資証券クラスのすべての投資証券を買い戻すことを決定することができる。

本投資法人の取締役会の権利に関係なく、本投資法人の取締役会の提案に応じて、サブ・ファンドの投資主総会はサブ・ファンドが発行した投資証券を消却し、投資主に対して保有する投資証券の純資産価額を返還することで、本投資法人の資本を減資することができる。かかる純資産価額は上記の決定が効力を発生する日に計算し、サブ・ファンドの資産の処分によって実現した実際価格およびかかる処分に起因する費用を織り込むものとする。

投資証券を消却する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」に記載されている方法で公告することによって各サブ・ファンドの投資主に通知する。買戻しのために投資主が提出しなかった清算する投資証券の純資産価額に相当する金額はルクセンブルグの供託金庫に遅滞なく預託される。

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) 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額の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別のUCITSまたは当該UCITSが設立した当該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額の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 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・ファンドまたは別の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」に記載されている方法で投資主に通知する。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確立された手続きに従って、買戻手数料またはその他の管理事務手数料を計算することなく、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、上記の決定を実施する日に計算した関係するサブ・ファンドの純資産価額に基づいて交換される。割当てする受益証券が契約型オープン投資信託の法形態を取る投資ファンド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、投資主総会または当該サブ・ファンドの投資主総会の定足数は要求されず、決定は総会の出席株式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

コーポレート・ボンド(米ドル)

(2019年12月末日現在)

資産の種類	国名	時価合計(米ドル)	投資比率(%)
債券	アメリカ合衆国	328,809,481.27	75.02
	オランダ	18,131,655.60	4.14
	イギリス	10,999,546.74	2.51
	カナダ	8,518,412.79	1.94
	アイルランド	5,740,794.94	1.31
	フランス	5,337,949.50	1.22
	イタリア	5,223,178.00	1.19
	フィンランド	3,212,805.08	0.73
	ガーンジー	3,053,141.02	0.70
	リベリア	2,436,464.47	0.56
	サウジアラビア	2,200,000.00	0.50
	スイス	1,541,325.60	0.35
	香港	1,522,843.35	0.35
	スペイン	1,254,572.40	0.29
	小計	397,982,170.76	90.80
モーゲージ・バック証券、 アセット・バック証券、 その他の割引債	アメリカ合衆国	13,680,441.42	3.12
投資信託	ルクセンブルグ	2,748,065.40	0.63
ポートフォリオ合計		414,410,677.58	94.55
現金・その他資産		23,908,459.33	5.45
資産総額		438,319,136.91	100.00
負債総額		3,234,580.90	0.74
合計(純資産総額)		435,084,556.01 (約47,668百万円)	99.26

(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。以下各サブ・ファンドについて同様とする。

ハイ・イールド・ボンド(米ドル)

(2019年12月末日現在)

資産の種類	国名	時価合計(米ドル)	投資比率(%)
債券	アメリカ合衆国	748,313,193.35	70.20
	カナダ	62,643,714.42	5.88
	ルクセンブルグ	36,679,861.88	3.44
	フランス	19,492,402.87	1.83
	イギリス	18,124,909.60	1.70
	オランダ	11,892,793.85	1.12
	ケイマン諸島	11,655,710.74	1.09
	アイルランド	4,587,841.91	0.43
	オーストラリア	4,157,854.98	0.39
	アラブ首長国連邦	3,856,725.00	0.36
	デンマーク	3,564,121.59	0.33
	リベリア	3,426,586.47	0.32
	ブラジル	2,667,187.50	0.25
	バミューダ	1,798,889.25	0.17
	スイス	958,500.00	0.09
	小計	933,820,293.41	87.60
投資信託	ルクセンブルグ	56,768,980.40	5.33
モーゲージ・バック証券、 アセット・バック証券、 その他の割引債	アメリカ合衆国	18,750,772.72	1.76
ポートフォリオ合計		1,009,340,046.53	94.68
現金・その他資産		56,696,644.99	5.32
資産総額		1,066,036,691.52	100.00
負債総額		37,411,046.10	3.51
合計(純資産総額)		1,028,625,645.42 (約112,696百万円)	96.49

(2) 運用実績

純資産等の推移

2019年12月末日および同日前1年以内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。

コーポレート・ボンド(米ドル)

	資産総額		純資産総額		1口当たり 純資産価格(注)	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円
2019年1月末日	668,224.04	73,211	648,598.55	71,060	18.02	1,974
2月末日	624,944.28	68,469	602,527.33	66,013	18.06	1,979
3月末日	604,292.59	66,206	597,740.85	65,488	18.53	2,030
4月末日	609,950.64	66,826	598,456.98	65,567	18.61	2,039
5月末日	588,226.42	64,446	576,063.45	63,114	18.83	2,063
6月末日	550,592.92	60,323	538,928.66	59,045	19.35	2,120
7月末日	554,450.96	60,746	542,886.42	59,479	19.45	2,131
8月末日	573,203.01	62,800	561,545.68	61,523	19.99	2,190
9月末日	531,968.83	58,283	519,150.80	56,878	19.86	2,176
10月末日	531,414.93	58,222	506,483.12	55,490	19.98	2,189
11月末日	423,808.71	46,432	412,012.37	45,140	20.03	2,194
12月末日	438,319.14	48,022	435,084.56	47,668	20.09	2,201

(注) クラスP - a c c 投資証券1口当たり純資産価格

ハイ・イールド・ボンド(米ドル)

	資産総額		純資産総額		1口当たり 純資産価格(注)	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円
2019年1月末日	993,300.87	108,826	979,711.41	107,337	287.94	31,547
2月末日	1,003,739.47	109,970	989,291.63	108,387	292.67	32,065
3月末日	977,371.51	107,081	972,158.56	106,510	295.43	32,367
4月末日	986,515.89	108,083	980,745.58	107,450	299.43	32,806
5月末日	971,262.33	106,412	965,150.66	105,742	296.04	32,434
6月末日	1,018,086.27	111,542	996,847.26	109,215	303.42	33,243
7月末日	1,044,656.02	114,453	1,014,135.33	111,109	304.51	33,362
8月末日	1,006,193.52	110,239	1,002,884.27	109,876	305.86	33,510
9月末日	1,015,327.11	111,239	1,002,944.88	109,883	306.50	33,580
10月末日	1,016,583.44	111,377	1,010,077.86	110,664	307.62	33,703
11月末日	1,013,912.05	111,084	1,006,909.70	110,317	307.84	33,727
12月末日	1,066,036.69	116,795	1,028,625.65	112,696	313.86	34,387

(注) クラスP - a c c 投資証券1口当たり純資産価格

各サブ・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

該当なし。

自己資本利益率（収益率）の推移

2019年1月1日から2019年12月末日における各サブ・ファンドのクラスP - a c c 投資証券の自己資本利益率（収益率）は以下のとおりである。

	収益率
コーポレート・ボンド（米ドル）	14.08%
ハイ・イールド・ボンド（米ドル）	14.19%

（注）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（当該期間の分配金の合計額を加えた額）

b = 2018年12月末日現在の1口当たり純資産価格（分配落の額）

（３）投資リスク

当中間計算期間において、2019年11月29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

A. 管理会社

a) 名称

UBS ファンド・マネジメント (ルクセンブルグ) エス・エイ

b) 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。

B. 投資運用会社

コーポレート・ボンド (米ドル) およびハイ・イールド・ボンド (米ドル) の投資運用会社

a) 名称

UBS アセット・マネジメント (アメリカス) インク

b) 資本金の額

2019年12月末日現在の資本金額は、164,467,980米ドル (約180億円)

(2) 大株主の状況

A. 管理会社

UBS ファンド・マネジメント (ルクセンブルグ) エス・エイ

(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・シュトラッセ45、CH-8001 チューリッヒ、スイス	6,500	100

B. 投資運用会社

コーポレート・ボンド (米ドル) およびハイ・イールド・ボンド (米ドル) の投資運用会社

UBS アセット・マネジメント (アメリカス) インク

(2019年12月末日現在)

名称	住所	所有株式数 (株)	比率 (%)
UBS アメリカス・インク (UBS Americas Inc.)	コーポレーション・サービス・ カンパニー、 251 リトル・フォールズ・ドライブ、 ウィルミントン、 デラウェア州、アメリカ合衆国	50	100

(3) 役員の状況

A . 管理会社

UBS ファンド・マネジメント (ルクセンブルグ) エス・エイ

(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・キストラー (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

B . 投資運用会社

コーポレート・ボンド (米ドル) およびハイ・イールド・ボンド (米ドル) の投資運用会社

UBS アセット・マネジメント (アメリカス) インク

(2019年12月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有株式
ウィリアム・ジェイ・フェ リ (William J. Ferri)	ディレクター / ボード・メンバー	2017年 2 月28日就任	非公開
デイビッド・ スクワイアーズ (David Squires)	ディレクター / ボード・メンバー	2016年 6 月21日就任	非公開

(4) 事業の内容及び営業の概況

A. 管理会社

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

B. 投資運用会社

各投資運用会社は、本投資法人と投資運用契約を締結し、当該契約に基づき、投資について本投資法人に対し投資顧問業務を提供し、本投資法人のためその他の一定の業務を遂行する。

コーポレート・ボンド(米ドル)およびハイ・イールド・ボンド(米ドル)の投資運用会社

UBS グローバル・アセット・マネジメント(アメリカス)インク

2019年12月末日現在、UBSアセット・マネジメント(アメリカス)インク(シカゴ)は45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) Real Estate Funds Selection - Global	変動資本を有する 投資法人	2008年4月24日	5,817,399,174
2	Focused Fund - Corporate Bond USD	契約型投資信託	2003年9月12日	3,291,352,685
3	UBS (Lux) Bond Sicav - USD Investment Grade Corporates (USD)	変動資本を有する 投資法人	2017年1月30日	2,508,374,577
4	UBS (Lux) Equity Sicav - Long Term Themes (USD)	変動資本を有する 投資法人	2016年1月28日	1,841,800,203
5	UBS (Lux) Equity Sicav - USA Growth (USD)	変動資本を有する 投資法人	2004年10月13日	1,488,137,340
6	UBS (Lux) Emerging Economies Fund - Global Bonds (USD)	契約型投資信託	1998年3月20日	1,404,222,438
7	UBS (Lux) Bond Sicav - 2023 (USD)	変動資本を有する 投資法人	2018年11月18日	1,364,700,864
8	UBS (Irl) Fund plc - UBS (Irl) Select Money Market Fund - US Treasury	公開有限責任会社	2018年12月14日	1,241,824,844
9	UBS (Lux) Bond Sicav - USD High Yield (USD)	変動資本を有する 投資法人	1996年12月3日	916,370,286
10	UBS (Lux) Equity Fund - Global Sustainable (USD)	契約型投資信託	1997年6月13日	863,390,547

(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。

[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 . 原文の中間財務書類は、UBS (Lux) ボンド・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。日本語の作成にあたっては関係するサブ・ファンドに関連する部分のみを翻訳している。ただし、各サブ・ファンドにはP - a c c 投資証券以外の投資証券も存在するが、その他の投資証券は日本で販売されていないため、P - a c c 投資証券に関連する部分を抜粋して日本語に記載している。
- 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

U B S (L u x) ボンド・シキャブ

連結純資産計算書	米ドル	千円
資産	2019年11月30日	2019年11月30日
投資有価証券、取得原価	15,977,038,495.87	1,750,444,338
投資有価証券、未実現評価益 (評価損)	372,650,015.53	40,827,536
投資有価証券合計(注1)	16,349,688,511.40	1,791,271,873
現金性銀行預金、要求払預金 および預金勘定	616,406,686.02 *	67,533,517
その他当座資産(証拠金)	34,825,349.92	3,815,465
有価証券売却に係る未収金(注1)	39,877,933.67	4,369,026
発行に係る未収金	39,680,989.27	4,347,449
有価証券に係る未収利息	152,990,821.75	16,761,674
当座資産に係る未収利息	12,075.94	1,323
分配に係る未収金	118,001.92	12,928
その他未収金	738,000.23	80,855
金融先物に係る未実現利益 (損失)(注1)	3,872,378.40	424,258
外国為替先物予約に係る 未実現利益(損失)(注1)	-24,112,542.60	-2,641,770
スワップに係る未実現利益 (損失)(注1)	-10,528,974.07	-1,153,554
資産合計	17,203,569,231.85	1,884,823,045
負債		
当座借越	-36,239,209.70	-3,970,368
その他短期負債(証拠金)	-55,139.51	-6,041
当座借越に係る未払利息	-299,671.74	-32,832
有価証券購入に係る未払金(注1)	-105,632,394.19	-11,573,085
未払買戻代金	-15,558,048.31	-1,704,540
報酬引当金(注2)	-2,737,288.97	-299,897
年次税引当金(注3)	-662,406.50	-72,573
その他の手数料および報酬に係る 引当金(注2)	-1,310,525.89	-143,581
引当金合計	-4,710,221.36	-516,052
負債合計	-162,494,684.81	-17,802,918
期末純資産	17,041,074,547.04	1,867,020,127

* 2019年11月30日現在、当該現金額は取引の相手方のために担保に供されており、ユービーエス・エイ・ジーについては573,352.00米ドル、HSBC銀行については850,000.00米ドル、パークレイズについては1,460,000.00米ドル、バンク・オブ・アメリカについては840,000.00米ドル、シティバンクについては380,000.00米ドルおよびゴールドマン・サックスについては380,000.00米ドルである。

注記は財務書類の不可分の一部である。

U B S (L u x) ボンド・シキャブ

連結運用計算書	米ドル	千円
	2019年6月1日 - 2019年11月30日	2019年6月1日 - 2019年11月30日
収益		
当座資産に係る利息	1,748,314.38	191,545
有価証券利息	264,444,492.31	28,972,539
配当金	2,907,661.15	318,563
スワップに係る受取利息(注1)	25,347,554.54	2,777,078
貸付証券に係る収益(注13)	1,228,852.31	134,633
その他収益(注4)	7,041,073.98	771,420
収益合計	302,717,948.67	33,165,778
費用		
スワップに係る支払利息(注1)	-25,983,931.61	-2,846,800
報酬(注2)	-33,908,120.69	-3,714,974
年次税(注3)	-1,941,874.10	-212,752
貸付証券に係る費用(注13)	-491,540.92	-53,853
その他の手数料および報酬(注2)	-979,929.57	-107,361
現金および当座借越に係る利息	-1,256,673.10	-137,681
費用合計	-64,562,069.99	-7,073,420
投資純利益(損失)	238,155,878.68	26,092,358
実現利益(損失)(注1)		
オプションなしの時価評価証券に係る 実現利益(損失)	92,575,898.59	10,142,615
オプションに係る実現利益(損失)	-235,150.27	-25,763
利回り評価証券および 金融市場商品に係る実現利益(損失)	332,786.42	36,460
金融先物に係る実現利益(損失)	-7,759,784.04	-850,162
外国為替先物予約に係る 実現利益(損失)	-68,788,872.07	-7,536,509
スワップに係る実現利益(損失)	-4,881,592.39	-534,827
外国為替に係る実現利益(損失)	-12,623,024.74	-1,382,979
実現利益(損失)合計	-1,379,738.50	-151,164
当期実現純利益(損失)	236,776,140.18	25,941,194
未実現評価益(評価損)の 変動(注1)		
オプションなしの時価評価証券に係る 未実現評価益(評価損)	339,236,113.40	37,166,709
オプションに係る未実現評価益 (評価損)	975,549.86	106,881
利回り評価証券および 金融市場商品に係る未実現評価益 (評価損)	-2,987,558.75	-327,317
金融先物に係る未実現評価益 (評価損)	3,820,670.17	418,593
外国為替先物予約に係る 未実現評価益(評価損)	-5,631,262.56	-616,961
スワップに係る未実現評価益 (評価損)	7,748,124.36	848,885
未実現評価益(評価損)の変動合計	343,161,636.48	37,596,789
運用活動による純資産の純増加(減少)	579,937,776.66	63,537,983

注記は財務書類の不可分の一部である。

U B S (L u x) ボンド・シキャブ - コーポレート・ボンド(米ドル)

純資産計算書	米ドル	千円
資産	2019年11月30日	2019年11月30日
投資有価証券、取得原価	390,814,324.58	42,817,617
投資有価証券、未実現評価益 (評価損)	25,587,897.89	2,803,410
投資有価証券合計(注1)	416,402,222.47	45,621,027
現金性銀行預金、要求払預金 および預金勘定	522,168.32	57,209
有価証券売却に係る未収金(注1)	1,296.00	142
発行に係る未収金	2,593,444.24	284,138
有価証券に係る未収利息	4,272,789.35	468,127
外国為替先物予約に係る 未実現利益(損失)(注1)	16,786.41	1,839
資産合計	423,808,706.79	46,432,482
負債		
当座借越	-9,349,432.67	-1,024,324
当座借越に係る未払利息	-9,568.68	-1,048
未払買戻代金	-2,282,132.60	-250,030
報酬引当金(注2)	-91,436.39	-10,018
年次税引当金(注3)	-22,470.11	-2,462
その他の手数料および 報酬に係る引当金(注2)	-41,292.57	-4,524
引当金合計	-155,199.07	-17,004
負債合計	-11,796,333.02	-1,292,406
期末純資産	412,012,373.77	45,140,076

注記は財務書類の不可分の一部である。

U B S (L u x) ボンド・シキャブ - コーポレート・ボンド(米ドル)

運用計算書	米ドル	千円
収益	2019年6月1日 - 2019年11月30日	2019年6月1日 - 2019年11月30日
当座資産に係る利息	12,145.84	1,331
有価証券利息	10,463,048.72	1,146,332
スワップに係る受取利息(注1)	273,201.39	29,932
貸付証券に係る収益(注13)	7,707.93	844
その他収益(注4)	344,556.61	37,750
収益合計	11,100,660.49	1,216,188
費用		
スワップに係る支払利息(注1)	-176,604.74	-19,349
報酬(注2)	-1,402,364.39	-153,643
年次税(注3)	-76,929.62	-8,428
貸付証券に係る費用(注13)	-3,083.17	-338
その他の手数料および報酬(注2)	-29,894.23	-3,275
現金および当座借越に係る利息	-73,337.42	-8,035
費用合計	-1,762,213.57	-193,068
投資純利益(損失)	9,338,446.92	1,023,120
実現利益(損失)(注1)		
オプションなしの時価評価証券に係る 実現利益(損失)	12,374,448.70	1,355,745
オプションに係る実現利益(損失)	-114,750.00	-12,572
金融先物に係る実現利益(損失)	-691,992.57	-75,815
外国為替先物予約に係る実現利益 (損失)	-1,815,243.21	-198,878
スワップに係る実現利益(損失)	-93,916.12	-10,289
外国為替に係る実現利益(損失)	-278,712.24	-30,536
実現利益(損失)合計	9,379,834.56	1,027,655
当期実現純利益(損失)	18,718,281.48	2,050,775
未実現評価益(評価損)の変動(注1)		
オプションなしの時価評価証券に係る 未実現評価益(評価損)	13,157,034.30	1,441,485
オプションに係る未実現評価益(評価損)	114,675.00	12,564
金融先物に係る未実現評価益(評価損)	-496,590.15	-54,406
外国為替先物予約に係る 未実現評価益(評価損)	-52,948.83	-5,801
未実現評価益(評価損)の変動合計	12,722,170.32	1,393,841
運用活動による純資産の純増加(減少)	31,440,451.80	3,444,616

注記は財務書類の不可分の一部である。

U B S (L u x) ボンド・シキャブ - コーポレート・ボンド(米ドル)

純資産変動計算書	米ドル	千円
	2019年6月1日 - 2019年11月30日	2019年6月1日 - 2019年11月30日
期首純資産	576,063,449.24	63,113,511
発行額	124,576,170.57	13,648,565
買戻額	-320,067,697.84	-35,066,617
合計純発行額(買戻額)	-195,491,527.27	-21,418,052
投資純収益(損失)	9,338,446.92	1,023,120
実現利益(損失)合計	9,379,834.56	1,027,655
未実現評価益(評価損)の変動合計	12,722,170.32	1,393,841
運用活動による純資産の純増加 (減少)	31,440,451.80	3,444,616
期末純資産	412,012,373.77	45,140,076

発行済投資証券口数の変動

	2019年6月1日 - 2019年11月30日
クラス	P-acc
期首発行済口数	5,187,714.6880
発行口数	2,303,223.9840
買戻口数	-2,126,734.4310
期末発行済口数	5,364,204.2410

注記は財務書類の不可分の一部である。

U B S (L u x) ボンド・シキャブ - ハイ・イールド・ボンド(米ドル)

純資産計算書	米ドル	千円
資産	2019年11月30日	2019年11月30日
投資有価証券、取得原価	974,130,901.85	106,725,782
投資有価証券、未実現評価益 (評価損)	10,142,657.43	1,111,230
投資有価証券合計(注1)	984,273,559.28	107,837,011
現金性銀行預金、要求払預金および 預金勘定	12,843,328.30	1,407,115
有価証券売却に係る未収金(注1)	2,394,022.78	262,289
発行に係る未収金	981,130.97	107,493
有価証券に係る未収利息	13,477,823.07	1,476,630
分配に係る未収金	2,121.54	232
外国為替先物予約に係る 未実現利益(損失)(注1)	-141,950.31	-15,552
スワップに係る未実現利益 (損失)(注1)	82,009.94	8,985
資産合計	1,013,912,045.57	111,084,204
負債		
当座借越	-25.16	-3
当座借越に係る未払利息	-3.06	0
有価証券購入に係る未払金(注1)	-6,089,502.00	-667,166
未払買戻代金	-638,546.23	-69,959
報酬引当金(注2)	-163,068.46	-17,866
年次税引当金(注3)	-33,673.32	-3,689
その他の手数料および報酬に係る 引当金(注2)	-77,528.96	-8,494
引当金合計	-274,270.74	-30,049
負債合計	-7,002,347.19	-767,177
期末純資産	1,006,909,698.38	110,317,027

注記は財務書類の不可分の一部である。

U B S (L u x) ボンド・シキャブ - ハイ・イールド・ボンド (米ドル)

運用計算書	米ドル	千円
収益	2019年6月1日 - 2019年11月30日	2019年6月1日 - 2019年11月30日
当座資産に係る利息	70,757.37	7,752
有価証券利息	28,150,885.45	3,084,211
配当金	26,780.78	2,934
スワップに係る受取利息(注1)	606,500.00	66,448
収益合計	28,854,923.60	3,161,345
費用		
スワップに係る支払利息(注1)	-783,977.16	-85,893
報酬(注2)	-2,119,050.49	-232,163
年次税(注3)	-103,871.76	-11,380
その他の手数料および報酬(注2)	-57,413.12	-6,290
現金および当座借越に係る利息	-3,462.10	-379
費用合計	-3,067,774.63	-336,105
投資純利益(損失)	25,787,148.97	2,825,240
実現利益(損失)(注1)		
オプションなしの時価評価証券に係る 実現利益(損失)	-4,386,602.50	-480,596
オプションに係る実現利益(損失)	420,477.00	46,067
金融先物に係る実現利益(損失)	1,077,306.26	118,030
外国為替先物予約に係る 実現利益(損失)	-295,522.18	-32,377
スワップに係る実現利益(損失)	1,469,948.87	161,048
外国為替に係る実現利益(損失)	476,143.10	52,166
実現利益(損失)合計	-1,238,249.45	-135,663
当期実現純利益(損失)	24,548,899.52	2,689,577
未実現評価益(評価損)の変動(注1)		
オプションなしの時価評価証券に係る 未実現評価益(評価損)	18,642,998.79	2,042,527
オプションに係る未実現評価益 (評価損)	307,380.00	33,677
金融先物に係る未実現評価益 (評価損)	-855,078.13	-93,682
外国為替先物予約に係る 未実現評価益(評価損)	-318,208.12	-34,863
スワップに係る未実現評価益 (評価損)	-528,499.84	-57,902
未実現評価益(評価損)の変動合計	17,248,592.70	1,889,756
運用活動による純資産の純増加(減少)	41,797,492.22	4,579,333

注記は財務書類の不可分の一部である。

U B S (L u x) ボンド・シキャブ - ハイ・イールド・ボンド (米ドル)

純資産変動計算書	米ドル	千円
	2019年 6 月 1 日 - 2019年11月30日	2019年 6 月 1 日 - 2019年11月30日
期首純資産	965,150,659.20	105,741,906
発行額	122,802,933.92	13,454,289
買戻額	-118,012,773.32	-12,929,479
合計純発行額(買戻額)	4,790,160.60	524,810
支払配当金	-4,828,613.64	-529,023
投資純収益(損失)	25,787,148.97	2,825,240
実現利益(損失)合計	-1,238,249.45	-135,663
未実現評価益(評価損)の変動合計	17,248,592.70	1,889,756
運用活動による純資産の純増加(減少)	41,797,492.22	4,579,333
期末純資産	1,006,909,698.38	110,317,027

発行済投資証券口数の変動

	2019年 6 月 1 日 - 2019年11月30日
クラス	P-acc
期首発行済口数	304,680.8520
発行口数	105,414.9420
買戻口数	-120,489.8860
期末発行済口数	289,605.9080

注記は財務書類の不可分の一部である。

財務書類の注記

(2019年11月30日現在)

注1 - 重要な会計方針の要約

当財務書類は、ルクセンブルグの投資信託に適用される、一般に公正妥当と認められている会計原則に従って作成されている。重要な会計方針は、以下の通りである。

a) 純資産価額の計算

サブ・ファンドまたは投資証券クラスの1口当たり純資産価格、発行価格、買戻価格および乗換価格は、当該サブ・ファンドまたは投資証券クラスの会計通貨で表示され、毎営業日、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、そのサブ・ファンドの投資証券クラスの発行済口数で除して計算される。

「営業日」という用語は、ルクセンブルグにおける通常の銀行営業日（即ち、通常の営業時間中銀行が営業している日）で、かつ12月24日および12月31日、ルクセンブルグにおける非法定の個別休日ならびに各サブ・ファンドの主たる投資先国の証券取引所が閉鎖されている日、またはサブ・ファンド投資資産の50%以上について適切な評価ができない日を除いた日をいう。

「法定外休日」とは、銀行および金融機関が閉鎖している日をいう。さらに、サブ・ファンドであるUBS (Lux) ボンド・シキャブ - チャイナ・フィクスト・インカム（人民元）に関して、中華人民共和国または香港の証券取引所が閉鎖されている日は、本サブ・ファンドの営業日とはみなされない。

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パーセンテージは、投資証券の発行または買戻しがある都度変動する。このパーセンテージは、各投資証券クラスの発行済投資証券が、その投資証券クラスに請求される報酬を考慮した上で計算されたサブ・ファンドの発行済投資証券総数に占める比率により決定される。

あるサブ・ファンドの全投資証券クラスにおける発行または買戻しの総額が、単一の取引日において資本の純流入または純流出をもたらす場合、そのサブ・ファンドの純資産価額はそれに伴い増加または減少する（いわゆるシングル・スイング・プライシング）。調整の最高限度は、純資産価額の2%である。この場合、サブ・ファンドに生ずるとされる予想取引コストおよび法人税負担額、ならびにサブ・ファンドの投資資産の予想呼び値スプレッドも考慮される。純変動により影響を受ける関連するサブ・ファンドの投資証券口数が増加した場合は、この調整により純資産価額が増加する。純変動により投資証券の価値が減少した場合は、純資産価額が減少する。本投資法人の取締役会は、各サブ・ファンドに関して限度額を設定することができる。これは、ファンドの純資産または当該サブ・ファンドの通貨で表示した絶対金額に対する、1取引日の純変動額ということができる。純資産価額は、1取引日にこの限度額の超過が発生した場合に調整される。本調整は、サブ・ファンドに有利であり、「その他収益」として運用計算書に開示される。

b) 評価の原則

- 流動資金 - 現金、銀行預金、為替手形および一覧払いの有価証券ならびに未収金、前払費用、現金配当および未受領の宣言または発生した利息のいずれかを問わない - は、その全額で評価される。ただし、当該価額が全額支払われないかまたは受領できない可能性がある場合を除くものとし、この場合、その価値はその正しい価値を表すために適切とみなす控除額を勘案して決定される。

- 証券取引所に上場されている証券、デリバティブおよびその他の投資資産は、入手可能な最新の市場価格で評価される。当該証券、デリバティブまたはその他の資産が、複数の証券取引所に上場されている場合は、その投資資産に関する代表的市場の取引所において入手可能な最終の価格が適用される。

証券取引所における取引が少ない証券、デリバティブおよびその他の資産で、証券取引者間で市場に連動する価格付がなされている流通市場が存在する場合、本投資法人は、かかる証券および投資資産を当該価格に基づいて評価することがある。

証券取引所に上場されていないものの、公認され、大衆に解放されている他の定期的に開かれる規制市場において取引されている証券、デリバティブおよびその他の投資資産は、当該市場で入手可能な最新の価格により評価される。

- 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、適切な価格が入手できない有価証券およびその他の投資資産は、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デリバティブ(店頭派生商品)は、独立した価格提供業者に基づいて評価される。デリバティブについて、利用できる独立した価格提供業者がただ1社だけの場合、入手した評価額の妥当性は、デリバティブが派生した原商品の市場価格に基づき、本投資法人が認めた計算方法により検証される。
- 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)の投資証券はこれらの最新の純資産価額で評価される。その他のUCITSおよび/またはUCIの特定の受益証券または投資証券は、ポートフォリオ・マネージャーまたは投資顧問会社から独立している信頼できるサービス提供業者が提供したその価値の見積り(価格見積り)に基づき評価することができる。
- 証券取引所または一般に公開されている他の規制市場で取引されていない金融市場商品は、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。各金融市場商品には、残余期間が最も近い金利が加えられる。このように計算された金利は、裏付けとなる借り主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。
- 関連するサブ・ファンドの会計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、金融市場商品、デリバティブおよびその他の資産は、ルクセンブルグの為替相場の仲値(買呼値と売呼値の中値)あるいは、もしルクセンブルグの為替相場の仲値が入手不能な場合は、それに最も近い、当該通貨の為替相場の仲値で評価される。
- 定期預金および信託投資資産は、その名目価額に累積利息を加算した金額で評価される。
- 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(ブルームバーグにより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、適用されるUBS評価方針に基づき決定される。

異常な状況の発生により上述した規則に準拠した評価が実行困難または不正確であることが明らかになった場合、本投資法人は、純資産の適切な評価を行うために、一般に認められかつ検証可能な他の評価基準を適用することを認められている。

異常な状況においては、追加評価は1日以内に行われる。新たな評価額は、それ以後に発行または買戻される投資証券の正式な価額となる。

c) 外国為替先物予約の評価

外国為替先物予約残高の未実現利益(損失)は、評価日の先物為替実勢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、評価日に適用可能な最新の公表価格に基づいて評価される。実現損益および未実現損益の増減は、運用計算書に計上される。実現損益はFIFO法に準拠して計算される(即ち、最初に取得した契約が最初に売却されたものとみなされる)。

e) オプションの評価

規制ある市場で取引されている未決済オプションは、当該商品の決済価格または入手可能な最終市場価格で評価される。公認の証券取引所に上場されていないオプション(OTCオプション)の時価は、ブルームバーグ・オプション・プライサー・ファンクショナリティーより取得し第三者値付機関に対して確認した日足価格に基づいている。オプションに係る実現損益および未実現評価損益の変動は、それぞれ、運用計算書および純資産変動計算書上のオプションに係る実現損益および未実現評価損益の項目において開示される。

f) 公正価額の価格形成原則

公正価額の価格形成原則が、アジア市場の有価証券に主として投資するファンドに関して適用される。公正価額の原則は、特定時のスナップショット価格でファンドの組入証券の全対象資産を再評価することによって、直近の入手可能な取引所の終値に反映されない重要な変更を考慮する。純資産額はその後、再評価価格に基づいて計算される。公正価額の原則は、ファンドに固有のベンチマークの乖離が3%を超える場合にのみ適用される。

g) 有価証券の売却に係る実現純利益(損失)

有価証券の売却に係る実現利益または損失は、売却された有価証券の平均取得原価に基づいて計算される。

h) 外国通貨の換算

種々のサブ・ファンドの参照通貨以外の通貨表示で保有されている銀行勘定、その他純資産、および保有投資有価証券の評価は、評価日における直物終値の仲値で換算される。異なるサブ・ファンドの参照通貨以外の通貨で表示されている収益および費用は、支払日の直物終値の仲値で換算される。外国為替損益は、運用計算書に計上されている。

種々のサブ・ファンドの参照通貨以外の通貨で表示されている有価証券の取得原価は、取得日の直物終値の仲値で換算されている。

i) 有価証券のポートフォリオ取引の会計処理

有価証券のポートフォリオ取引は取引日の翌銀行営業日に計上されている。

j) 連結財務書類

連結財務書類は米ドル建てで表示されている。投資会社の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に記載されたさまざまな項目の金額は、各サブ・ファンドの財務書類に計上された対応する項目の金額を、下記の為替レートで米ドルに転換した金額の総額に等しい。

下記の為替レートは、2019年11月30日現在の連結財務書類の換算に使用されたものである。

為替レート

1 米ドル = 0.906947ユーロ

1 米ドル = 0.999350スイスフラン

1 米ドル = 7.026500人民元

償還または統合したサブ・ファンドに関して、償還または統合された日付現在の為替レートが使用された。

k) 「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。

l) 有価証券売却に係る未収金、有価証券購入に係る未払金

「有価証券売却に係る未収金」という勘定は、外国通貨取引で生じた未収金も含んでいる。「有価証券購入に係る未払金」という勘定には、外国通貨取引により生じた未払金も含まれている。

外国為替取引による未収金および未払金は相殺される。

m) スワップ

本投資法人は、それぞれの分野で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しレート契約、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。

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益(評価損)」の変動の個所に含まれている。

スワップの手じまいまたは満期到来により生じた利益または損失は、運用計算書の「スワップに係る実現利益(損失)」に計上されている。

n) サブ・ファンド間投資

2019年11月30日現在、或るサブ・ファンド、UBS (Lux) ボンド・シキャブ - コーポレート・ボンド(米ドル) およびUBS (Lux) ボンド・シキャブ - ハイ・イールド・ボンド(米ドル) は、UBS (Lux) ボンド・シキャブの他のサブ・ファンドに以下の投資を行った。

UBS (Lux) ボンド・シキャブ - コーポレート・ボンド(米ドル)	金額(米ドル)
UBS (Lux) ボンド・シキャブ - マルチ・インカム(米ドル)	2,727,334.80
クラスU - X - ACC投資証券	
合計	2,727,334.80

UBS (Lux) ボンド・シキャブ - ハイ・イールド・ボンド(米ドル)	金額(米ドル)
UBS (Lux) ボンド・シキャブ - アジア・ハイ・イールド・ボンド(米ドル)	40,815,705.00
クラスU - X - ACC投資証券	
UBS (Lux) ボンド・シキャブ - マルチ・インカム(米ドル)	5,050,620.00
クラスU - X - ACC投資証券	
合計	45,866,325.00

サブ・ファンド間投資の総額は、76,590,796.48米ドルである。したがって、事業年度末現在の調整済み連結純資産は、16,964,483,750.56米ドルであった。

注2 - 報酬

本投資法人は、各投資証券クラスに対して、下の表に示されているように、サブ・ファンドの平均純資産価額に基づいて計算される月次報酬を支払う。

UBS (Lux) ボンド・シキャブ - コーポレート・ボンド (米ドル)

	上限年率報酬
名称に「P」が付く投資証券クラス	1.140%

UBS (Lux) ボンド・シキャブ - ハイ・イールド・ボンド (米ドル)

	上限年率報酬
名称に「P」が付く投資証券クラス	1.260%

上記の報酬の中から、以下の報酬が支払われる。

1. 本投資法人の運用、事務管理、ポートフォリオ管理および販売に関して（該当する場合）、また保管受託銀行のすべての職務（本投資法人の資産の保管および監督、決済取引の取扱い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」の項に記載されるその他一切の職務等）に関して、以下の規則に従って本投資法人の純資産価額に基づく上限報酬料率が本投資法人の資産から支払われる。当該報酬は、純資産価額の計算毎に比例按分ベースで本投資法人の資産に対し請求され、毎月支払われる（上限報酬料率）。

関連する上限報酬料率は、該当する投資証券クラスの運用が開始されるまで請求されない。上限報酬料率の概要は、販売目論見書の「サブ・ファンドおよび特別な投資方針」の項に記載されている。

2. 上限報酬料率は、以下の報酬および本投資法人にも請求される追加の費用を含まない。
 - 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および売呼値のスプレッド、仲介手数料）。かかる費用は、通常、各資産の売買時点で計算される。本書の記載にかかわらず、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カバーされる。
 - 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関する一切の手数料。
 - 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管理事務に関して監査人が提供するサービスに関して監査人に支払われるか、または法律によって許可される一切のその他の報酬。
 - d) 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、KIID、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、手数料、翻訳コストおよび外国の代表者または支払代理人に対する報酬を含む)。
- h) 本投資法人による議決権または債権者の権利の使用により発生した費用(外部顧問報酬を含む)。
- i) 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利用者の権利に関するコストおよび手数料。
- j) 管理会社、ポートフォリオ・マネジャーまたは保管受託銀行が投資者の利益の保護のために講じた特別措置に関して生じた一切の費用。
- k) 管理会社が投資者の利益につき集団訴訟に関与する場合、管理会社は、第三者に関して生じた費用(例えば、法律コストおよび保管受託銀行に関するコスト)を本投資法人の資産に対して請求することができる。さらに、管理会社は、すべての管理事務コストを請求することができる。ただし、かかるすべての管理事務コストは、証明可能かつ開示されており、本投資法人の総費用率(TER)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カバーするために手数料を支払うことができる。

運用管理手数料の中から本投資法人の販売業者および資産マネジャーに対し販売報酬が支払われる。

本投資法人はまた、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、特に年次税を支払う。

報酬制度を用いない他のファンド・プロバイダーとの一般的比較可能性を持たせることを目的に、「最大管理報酬」は報酬の80%と定める。

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。

個別サブ・ファンドに割り当てることができる全てのコストは、それぞれのサブ・ファンドに賦課される。

投資証券クラスに割り当てることができるコストは、それらの投資証券クラスに賦課される。しかしながら、コストが幾つかのサブ・ファンド/投資証券クラスまたは全てのサブ・ファンド/投資証券ク

ラスに関係するものである場合は、そのコストは関係するサブ・ファンド／投資証券クラスの純資産価額に比例した形で、それぞれのサブ・ファンドに賦課される。

それぞれの投資方針に基づきUCIまたはUCITSに投資することができるサブ・ファンドの場合、報酬はサブ・ファンド・レベルと同様に、各投資先ファンド・レベルでも発生する。サブ・ファンドの資産が投資される投資先ファンドの管理報酬の上限は、全ての販売報酬を考慮し3%である。

管理会社または、関連する別の会社によって、直接または間接的に、経営陣が共通であること、共通の支配下にあること、直接または間接に実質的に所有されることにより運用されているファンドの受益証券に対する投資の場合、サブ・ファンドによる投資には、投資対象ファンドの発行または買戻しに関する手数料が科せられないことがある。

本投資法人の現行の手数料については、KIIDで参照することができる。

注3 - 年次税

現在効力を有する法律および規則に従い、本投資法人はルクセンブルグにおいて、各四半期末の本投資法人純資産に基づき年率0.05%または、一定の投資証券クラスについては0.01%の軽減年率で計算され、四半期毎に支払うべき取得税を課せられる。

この年次税は、ルクセンブルグ法の規定に従い既に年次税を支払った他の集合投資会社のユニットまたは投資証券に投資された純資産部分には適用されない。

注4 - その他収益

その他収益は、主にシングル・スイング・プライシングから生じる収益で構成される。

注5 - 収益の分配

各サブ・ファンドの投資主総会では、取締役会の提案に基づき、かつサブ・ファンド別の年次会計報告終了後に、各サブ・ファンドの各投資証券クラスに関する分配金支払の可否および支払う分配金の程度が決定される。分配金の支払いにより、本投資法人の純資産価額が法に定められた最低資産価額を下回ることがあってはならない。分配を行う場合、その支払いは期末日後4ヶ月以内に行われる。

取締役会は中間配当を支払う権限を与えられており、分配金の支払いを停止する権限も与えられている。

分配金が実際の収益に対する権利に対応するように、収益均衡化額の計算が行われる。

注6 - 金融先物およびスワップに関する契約

2019年11月30日現在のサブ・ファンドによる金融先物およびスワップに関する契約ならびにその通貨は以下のとおりである。

a) 金融先物

UBS (Lux) ボンド・シキャブ	債券に係る金融先物 (買い)	債券に係る金融先物 (売り)
該当なし		

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

b) スワップ

UBS (Lux) ボンド・シキャブ	クレジット・デフォルト・スワップ（買い）	クレジット・デフォルト・スワップ（売り）
該当なし		
UBS (Lux) ボンド・シキャブ	金利に係るスワップおよび先渡しスワップ（買い）	金利に係るスワップおよび先渡しスワップ（売り）
該当なし		
UBS (Lux) ボンド・シキャブ	指数に係るスワップおよび先渡しスワップ（買い）	指数に係るスワップおよび先渡しスワップ（売り）
- ハイ・イールド・ボンド（米ドル）	-米ドル	20,082,010.05米ドル
UBS (Lux) ボンド・シキャブ	クロス・カレンシーに係るスワップおよび先渡しスワップ（買い）	クロス・カレンシーに係るスワップおよび先渡しスワップ（売り）
該当なし		
UBS (Lux) ボンド・シキャブ	通貨に係るスワップおよび先渡しスワップ（買い）	通貨に係るスワップおよび先渡しスワップ（売り）
該当なし		

注7 - ソフト・ダラー協定

2019年6月1日から2019年11月30日までの期間には、UBS (Lux) ボンド・シキャブのために締結された「ソフト・ダラー協定」はなく、「ソフト・ダラー」はゼロである。

注8 - 総費用比率（TER）

この比率は、スイス・ファンズ・アンド・アセット・マネジメント協会（SFAMA）の現行の「TERの計算と開示に関するガイドライン」に準拠して計算されたもので、純資産に対し継続的に賦課されている全てのコストおよび手数料（営業費用）の純資産に対するパーセンテージを過去に遡及して表示している。

過去12ヶ月のTER

UBS (Lux) ボンド・シキャブ	総費用比率（TER）
- コーポレート・ボンド（米ドル）クラスP - a c c 投資証券	1.20%
- ハイ・イールド・ボンド（米ドル）クラスP - a c c 投資証券	1.32%

本報告期間中に、適用される報酬は変動する場合がある（注記2を参照のこと。）。

運用期間が12か月未満の投資証券クラスに関するTERは、年率換算されている。

取引コストおよび為替ヘッジに関連して生じたその他コストは、TERに含まれていない。

注9 - 合併

以下の合併が生じた。

サブ・ファンド	合併先	日付
---------	-----	----

該当なし

注10 - 名称の変更

以下の名称の変更が生じた。

旧名称	新名称	日付
該当なし		

注11 - 当報告期間中における重要な事象

スイスUBSアセット・マネジメントの事業は、ユービーエス・エイ・ジーからUBSグループの一員であるUBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジーへ譲渡された。当該譲渡は、2019年6月17日付で効力が発生した。

UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジーは、スイス金融市場調査局により承認された集団投資スキームの資産運用管理会社である。

注12 - 適用ある法律、実行の場所、および正式言語

投資主、本投資法人および保管受託銀行の間で生じた全ての法的紛争の実行場所はルクセンブルグ地方裁判所であり、適用される法律はルクセンブルグ法である。しかしながら、他の国の投資家からクレームがあった場合は、本投資法人および／もしくは保管受託銀行は、本投資法人の投資証券が購入または販売された国の裁判管轄権に服することを選択することができる。

この財務書類の正式なものはドイツ語版である。しかしながら、本投資法人の投資証券の購入または販売が可能であった他国の投資家に対して売却された投資証券の場合は、本投資法人および保管受託銀行は関係する言語への承認された翻訳(即ち本投資法人および保管銀行が承認した翻訳)を、彼らならびに当行を拘束するものとして認めることがある。

注13 - 貸付証券

本投資法人は、第三者に本投資法人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により、それらの機関が設定した方法に従ってのみ行われる。貸付証券の収益およびコストは、運用計算書に別個に表示される。担保は、貸付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け証券から構成される。

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

貸付証券

UBS (Lux) ボンド・シキャブ	2019年11月30日現在の貸付証券による 相手方エクスポージャー		2019年11月30日現在の 担保内訳 (比重 %)		
	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
- コーポレート・ボンド(米ドル)	8,466,179.26 米ドル	8,969,369.85 米ドル	36.06	63.94	0.00

注記は財務書類の不可分の一部である。

[次へ](#)

(2) 投資有価証券明細表等

U B S (L u x) ボンド・シキャブ - コーポレート・ボンド (米ドル)

2019年11月30日現在の投資有価証券ならびにその他純資産明細書

内容	数量 / 名目金額	先物 / 為替先物予約 / スワップに係る 未実現利益 (損失) の 米ドル建て評価額 (注 1)	純資産額に 占める %
公認証券取引所に上場されている譲渡可能証券および金融市場商品			
ノート - 固定金利			
米ドル			
USD AERCAP IRE CAP LTD/GLB AVIA TRUST 5.00000% 15-01.10.21	1 500 000.00	1 572 371.70	0.38
USD ALLSTATE CORP 3.85000% 19-10.08.49	1 000 000.00	1 114 967.60	0.27
USD AMAZON.COM INC 4.80000% 14-05.12.34	1 750 000.00	2 176 566.88	0.53
USD AMERICAN EXPRESS CO-SUB 3.62500% 14-05.12.24	7 000 000.00	7 388 540.60	1.79
USD ANHEUSER-BUSCH COS 4.70000% 19-01.02.36	4 750 000.00	5 530 666.30	1.34
USD APPLE INC 2.20000% 19-11.09.29	5 750 000.00	5 675 053.01	1.38
USD AT&T INC 4.30000% 18-15.02.30	2 000 000.00	2 198 545.20	0.53
USD AT&T INC 4.85000% 19-01.03.39	3 750 000.00	4 268 904.75	1.04
USD AT&T INC 5.15000% 18-15.11.46	1 000 000.00	1 174 199.00	0.29
USD BALL CORP 4.37500% 15-15.12.20	3 800 000.00	3 876 000.00	0.94
USD BARCLAYS PLC 3.68400% 17-10.01.23	2 750 000.00	2 810 660.60	0.68
USD BARCLAYS PLC-SUB 4.37500% 14-11.09.24	2 250 000.00	2 347 051.73	0.57
USD BAT CAPITAL CORP 3.22200% 18-15.08.24	2 500 000.00	2 545 150.75	0.62
USD BERKSHIRE HATHAWAY 4.25000% 19-15.01.49	1 500 000.00	1 781 654.25	0.43
USD BERKSHIRE HATHAWAY ENERGY CO 4.45000% 19-15.01.49	1 000 000.00	1 191 757.00	0.29
USD BOEING CO 3.60000% 19-01.05.34	1 000 000.00	1 079 620.30	0.26
USD CENTERPOINT ENERGY INC 4.25000% 18-01.11.28	500 000.00	543 624.75	0.13
USD CITIGROUP INC 3.70000% 16-12.01.26	6 250 000.00	6 664 722.50	1.62
USD CITIGROUP INC-SUB 6.67500% 13-13.09.43	2 750 000.00	4 006 500.03	0.97
USD COMCAST CORP 4.60000% 18-15.10.38	7 750 000.00	9 311 864.48	2.26
USD CREDIT AGRICOLE SA-144A-SUB 4.37500% 15-17.03.25	2 000 000.00	2 134 895.60	0.52
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-144A 3.57400% 17-09.01.23	1 500 000.00	1 536 721.35	0.37
USD CREDIT SUISSE GRP FDNG GUERNSEY 4.55000% 16-17.04.26	2 750 000.00	3 055 315.72	0.74
USD CVS HEALTH CORP 5.05000% 18-25.03.48	2 000 000.00	2 366 258.80	0.57
USD DTE ENERGY CO 2.95000% 19-01.03.30	3 750 000.00	3 747 246.41	0.91
USD ELANCO ANIMAL HEALTH INC 4.90000% 19-28.08.28	1 500 000.00	1 621 972.50	0.39
USD EXELON CORP 4.95000% 16-15.06.35	1 750 000.00	2 043 550.60	0.50
USD FEDEX CORP 4.55000% 16-01.04.46	3 000 000.00	3 142 513.80	0.76
USD FISERV INC 3.50000% 19-01.07.29	3 000 000.00	3 151 525.80	0.76
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.54200% 19-01.08.26	1 500 000.00	1 508 969.85	0.37
USD FREEPORT-MCMORAN INC 3.55000% 12-01.03.22	1 484 000.00	1 491 420.00	0.36
USD GE CAPITAL INTL FUNDING CO 3.37300% 16-15.11.25	4 000 000.00	4 134 559.60	1.00
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 4.20000% 16-01.03.21	3 537 000.00	3 611 591.79	0.88
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 4.00000% 16-06.10.26	2 250 000.00	2 305 578.15	0.56
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO 3.85000% 18-05.01.28	1 000 000.00	1 007 081.00	0.24
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO 3.55000% 18-09.04.21	4 000 000.00	4 063 416.80	0.99
USD GILEAD SCIENCES INC 3.65000% 15-01.03.26	3 500 000.00	3 762 195.15	0.91
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC-SUB 6.75000% 07-01.10.37	1 750 000.00	2 407 431.08	0.58
USD HOME DEPOT INC/THE 4.50000% 18-06.12.48	2 000 000.00	2 498 102.00	0.61
USD HSBC HOLDINGS PLC-SUB 4.37500% 16-23.11.26	2 250 000.00	2 420 797.05	0.59
USD INTERNATIONAL LEASE FINANCE CORP 5.87500% 12-15.08.22	1 500 000.00	1 636 806.75	0.40
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 3.87500% 14-10.09.24	3 500 000.00	3 719 808.75	0.90
USD KINROSS GOLD CORP 5.95000% 14-15.03.24	3 500 000.00	3 875 655.00	0.94
USD KROGER CO 3.87500% 16-15.10.46	1 000 000.00	976 708.67	0.24
USD LINCOLN NATIONAL CORP 4.35000% 18-01.03.48	3 000 000.00	3 301 640.10	0.80
USD MARATHON OIL CORP 3.85000% 15-01.06.25	2 000 000.00	2 095 161.40	0.51
USD MICROSOFT CORP 3.70000% 16-08.08.46	6 000 000.00	6 859 158.60	1.66

内容	数量 / 名目金額	先物 / 為替先物予約 / スワップに係る 未実現利益 (損失) の 米ドル建て評価額 (注 1)	純資産額に 占める %
USD MPLX LP 4.87500% 16-01.12.24	2 500 000.00	2 704 823.75	0.66
USD NOBLE ENERGY INC 3.25000% 19-15.10.29	1 000 000.00	990 218.08	0.24
USD NOBLE ENERGY INC 3.90000% 14-15.11.24	926 000.00	970 862.20	0.24
USD NORFOLK SOUTHERN CORP 4.10000% 19-15.05.49	2 000 000.00	2 262 150.40	0.55
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 2.90000% 19-15.08.24	5 000 000.00	5 023 521.50	1.22
USD ORACLE CORP 4.00000% 16-15.07.46	2 000 000.00	2 237 897.80	0.54
USD PPL CAPITAL FUNDING INC 3.95000% 14-15.03.24	1 250 000.00	1 316 084.87	0.32
USD PRINCIPAL FINANCIAL GROUP 3.70000% 19-15.05.29	2 000 000.00	2 176 589.60	0.53
USD PRUDENTIAL FINANCIAL INC 3.93500% 18-07.12.49	2 396 000.00	2 603 487.85	0.63
USD QUALCOMM INC 4.30000% 17-20.05.47	500 000.00	564 911.00	0.14
USD RABOBANK NEDERLAND NV-SUB 3.75000% 16-21.07.26	1 000 000.00	1 044 177.50	0.25
USD RABOBANK NEDERLAND-SUB 4.62500% 13-01.12.23	2 250 000.00	2 429 374.27	0.59
USD ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC 4.80000% 16-05.04.26	2 000 000.00	2 216 453.40	0.54
USD ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD 5.25000% 12-15.11.22	2 250 000.00	2 438 658.00	0.59
USD SABINE PASS LIQUEFACTION LLC 5.00000% 17-15.03.27	1 750 000.00	1 915 764.03	0.47
USD SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 4.00000% 16-10.05.46	2 000 000.00	2 304 187.00	0.56
USD SOUTHWEST AIRLINES CO 3.45000% 17-16.11.27	5 000 000.00	5 282 798.00	1.28
USD STEEL DYNAMICS INC 5.00000% 17-15.12.26	4 500 000.00	4 778 100.00	1.16
USD SUNOCO LOGISTICS PARTNERS OPERATIONS LP 5.40000% 17-01.10.47	2 000 000.00	2 106 037.00	0.51
USD SUNTRUST BANK-SUB 3.30000% 16-15.05.26	4 000 000.00	4 166 012.80	1.01
USD T-MOBILE USA INC 5.12500% 17-15.04.25	2 000 000.00	2 067 500.00	0.50
USD T-MOBILE USA INC 5.37500% 17-15.04.27	1 000 000.00	1 068 750.00	0.26
USD TELEFONICA EMISIONES SA 5.52000% 19-01.03.49	1 000 000.00	1 234 141.60	0.30
USD THE HERSHEY CO 3.12500% 19-15.11.49	2 150 000.00	2 179 024.57	0.53
USD TIME WARNER CABLE LLC 7.30000% 08-01.07.38	1 000 000.00	1 282 357.50	0.31
USD TOLL BROTHERS FINANCE CORP 4.87500% 15-15.11.25	1 250 000.00	1 357 500.00	0.33
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 3.85000% 18-15.06.28	1 500 000.00	1 651 125.60	0.40
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 2.87500% 19-15.08.29	2 150 000.00	2 213 613.56	0.54
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 5.01200% 17-15.04.49	2 500 000.00	3 215 994.00	0.78
USD VIRGINIA ELECTRIC & POWER CO 4.60000% 18-01.12.48	2 000 000.00	2 463 377.00	0.60
USD VODAFONE GROUP PLC 4.87500% 19-19.06.49	1 000 000.00	1 133 588.00	0.28
USD WELLS FARGO & CO-SUB 4.12500% 13-15.08.23	2 500 000.00	2 650 163.25	0.64
USD WESTERN GAS PARTNERS LP 5.50000% 18-15.08.48	1 000 000.00	850 351.98	0.21
USD WESTERN MIDSTREAM OPERATING LP 5.37500% 11-01.06.21	2 112 000.00	2 174 486.27	0.53
米ドル合計		216 808 586.13	52.62
ノート合計 - 固定金利		216 808 586.13	52.62
中期債券 - 固定金利			
米ドル			
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 4.20000% 14-26.08.24	7 000 000.00	7 500 579.80	1.82
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 4.18300% 16-25.11.27	5 000 000.00	5 415 829.00	1.32
USD MCDONALD ' S CORP 4.45000% 17-01.03.47	2 000 000.00	2 318 425.20	0.56
USD MORGAN STANLEY-SUB 4.10000% 13-22.05.23	2 500 000.00	2 641 724.25	0.64
USD SAUDI ARABIAN OIL CO-144A 4.37500% 19-16.04.49	2 000 000.00	2 198 750.00	0.53
USD STANDARD CHARTERED BANK (HONG KONG)-SUB 5.87500% 10-24.06.20	1 500 000.00	1 526 050.50	0.37
米ドル合計		21 601 358.75	5.24
中期債券合計 - 固定金利		21 601 358.75	5.24
中期債券 - 変動金利			
米ドル			
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 6.750%/3M LIBOR+378BP 14-PRP	1 750 000.00	1 970 937.50	0.48
米ドル合計		1 970 937.50	0.48
中期債券合計 - 変動金利		1 970 937.50	0.48

内容	数量 / 名目金額	先物 / 為替先物予約 / スワップに係る 未実現利益 (損失) の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
長期債券 - 固定金利			
米ドル			
USD ALLY FINANCIAL INC 4.62500% 15-19.05.22	1 250 000.00	1 306 844.63	0.32
USD BALTIMORE GAS & ELECTRIC CO 3.50000% 16-15.08.46	1 250 000.00	1 298 388.12	0.32
USD CONSOLIDATED EDISON CO OF NEW YORK INC 4.65000% 18-01.12.48	1 500 000.00	1 849 988.25	0.45
USD DUKE ENERGY CAROLINAS LLC 6.05000% 08-15.04.38	925 000.00	1 290 908.17	0.31
USD DUKE ENERGY OHIO INC 4.30000% 19-01.02.49	3 000 000.00	3 542 202.00	0.86
USD ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LP 6.87500% 03-01.03.33	900 000.00	1 227 040.56	0.30
USD FLORIDA POWER & LIGHT CO 3.95000% 18-01.03.48	2 000 000.00	2 326 335.40	0.57
USD PRUDENTIAL FINANCIAL INC 6.62500% 10-21.06.40	516 000.00	741 070.37	0.18
USD SAN DIEGO GAS & ELECTRIC CO 4.10000% 19-15.06.49	1 000 000.00	1 116 147.00	0.27
USD TIME WARNER ENTERTAINMENT CO L P 8.37500% 93-15.03.23	1 300 000.00	1 541 954.57	0.37
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 5.25000% 17-16.03.37	5 000 000.00	6 318 256.50	1.53
米ドル合計		22 559 135.57	5.48
長期債券合計 - 固定金利		22 559 135.57	5.48
長期債券 - 変動金利			
米ドル			
USD DEUTSCHE TELEKOM INTL FIN 8.250%/RATING LINKED 00-15.06.30	2 750 000.00	4 047 345.50	0.98
米ドル合計		4 047 345.50	0.98
長期債券合計 - 変動金利		4 047 345.50	0.98
公認証券取引所に上場されている譲渡可能証券および金融市場商品 合計		266 987 363.45	64.80
他の規制市場で取引されている譲渡可能証券および金融市場商品			
モーゲージ担保証券 - 固定金利			
米ドル			
USD MORGAN STANLEY CAP BARC BK TST-144A-SUB 3.30890% 16-01.09.31	3 125 000.00	3 120 208.75	0.76
米ドル合計		3 120 208.75	0.76
モーゲージ担保証券合計 - 固定金利		3 120 208.75	0.76
モーゲージ担保証券 - 変動金利			
米ドル			
USD CG-CCRE CMCL MRTG TRUST-144A-SUB 1M LIBOR+175BP 14-15.06.31	2 375 000.00	2 374 691.25	0.58
USD CSWF TOP-144A-SUB FLR 18-15.08.35	2 000 000.00	1 999 356.40	0.48
USD JP MORGAN CHASE COMRCL MTG SEC-144A-SUB VAR 15-01.09.32	3 500 000.00	3 510 867.85	0.85
USD LONE STAR PORTFOLIO TRUST-144A 1M LIBOR+400BP 15-15.09.28	3 500 000.00	1 929 731.55	0.47
USD MORGAN STANLEY CAPITAL INC-144A-SUB FLR 14-01.07.29	750 000.00	758 633.55	0.18
米ドル合計		10 573 280.60	2.56
モーゲージ担保証券合計 - 変動金利		10 573 280.60	2.56

内容	数量 / 名目金額	先物 / 為替先物予約 / スワップに係る 未実現利益 (損失) の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
ノート - 固定金利			
米ドル			
USD ADT CORP 3.50000% 13-15.07.22	2 000 000.00	2 030 000.00	0.49
USD AT&T INC 3.55000% 19-01.06.24	2 250 000.00	2 355 456.60	0.57
USD AXA EQUITABLE HOLDINGS INC 5.00000% 19-20.04.48	1 500 000.00	1 617 792.00	0.39
USD BRISTOL-MYERS SQUIBB CO-144A 4.12500% 19-15.06.39	3 500 000.00	4 043 589.90	0.98
USD BROADCOM CORP/CAYMAN FIN LTD 3.87500% 18-15.01.27	2 000 000.00	2 041 608.00	0.50
USD BROADCOM INC-144A 3.62500% 19-15.10.24	2 000 000.00	2 056 228.60	0.50
USD CCO LLC/CAPITAL 6.38400% 16-23.10.35	2 500 000.00	3 119 115.25	0.76
USD CHENIERE ENERGY PARTNERS LP 5.25000% 18-01.10.25	3 500 000.00	3 605 000.00	0.88
USD GENERAL ELECTRIC CO 4.62500% 11-07.01.21	5 000 000.00	5 132 287.00	1.25
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 4.25000% 14-15.05.23	2 000 000.00	2 096 750.80	0.51
USD GLENCORE FUNDING LLC-144A 4.12500% 19-12.03.24	1 500 000.00	1 574 070.60	0.38
USD GLP CAPITAL LP / GLP FINANC II INC 5.37500% 14-01.11.23	500 000.00	546 125.00	0.13
USD HARLEY-DAVIDSON FIN.SERV INC-144A 3.35000% 18-15.02.23	2 500 000.00	2 556 833.75	0.62
USD HCA INC 5.00000% 14-15.03.24	2 250 000.00	2 443 775.40	0.59
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 3.62500% 16-01.12.27	8 000 000.00	8 447 079.20	2.05
USD KINDER MORGAN INC-144A 5.62500% 13-15.11.23	4 000 000.00	4 423 595.20	1.07
USD KKR GROUP FINANCE CO II LLC-144A 5.50000% 13-01.02.43	1 150 000.00	1 415 997.19	0.34
USD LENNAR CORP 2.95000% 18-29.11.20	2 000 000.00	2 010 000.00	0.49
USD METLIFE INC 4.05000% 15-01.03.45	1 000 000.00	1 137 073.30	0.28
USD MORGAN STANLEY 3.70000% 14-23.10.24	10 000 000.00	10 591 065.00	2.57
USD MORGAN STANLEY 3.87500% 14-29.04.24	3 500 000.00	3 718 816.15	0.90
USD NORDEA BANK ABP-144A-SUB 4.25000% 12-21.09.22	3 060 000.00	3 203 336.52	0.78
USD NOVA CHEMICALS CORP-144A 5.25000% 13-01.08.23	500 000.00	503 750.00	0.12
USD NOVA CHEMICALS CORP-144A 5.00000% 14-01.05.25	1 250 000.00	1 256 250.00	0.31
USD NOVA CHEMICALS CORP-144A 5.25000% 17-01.06.27	1 500 000.00	1 515 000.00	0.37
USD NXP BV / NXP FUNDING LLC-144A 5.55000% 18-01.12.28	6 000 000.00	6 936 192.00	1.68
USD OWENS-BROCKWAY GLASS CONTAINER INC-144A 5.37500% 14-15.01.25	750 000.00	759 375.00	0.18
USD PPL CAPITAL FUNDING INC 4.70000% 13-01.06.43	2 000 000.00	2 271 726.60	0.55
USD PUBLIC STORAGE 3.09400% 17-15.09.27	5 000 000.00	5 244 281.50	1.27
USD SABINE PASS LIQUEFACTION LLC STEP-UP/DOWN 14-01.02.21	2 000 000.00	2 057 651.00	0.50
USD SOCIETE GENERALE SA-144A 4.00000% 17-12.01.27	3 000 000.00	3 194 887.50	0.78
USD SUNCOR ENERGY INC 3.60000% 14-01.12.24	1 231 000.00	1 300 102.19	0.32
USD UNION PACIFIC CORP 3.60000% 17-15.09.37	2 000 000.00	2 102 282.80	0.51
USD UNITED TECHNOLOGIES CORP 4.50000% 12-01.06.42	3 500 000.00	4 222 036.70	1.02
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 4.01600% 19-03.12.29	500 000.00	557 558.80	0.14
USD VOLKSWAGEN GRP OF AMERICA FINANCE-144A 4.62500% 18-13.11.25	1 500 000.00	1 657 472.10	0.40
USD WALT DISNEY CO-REG-S 4.75000% 19-15.11.46	1 500 000.00	1 964 331.90	0.48
米ドル合計		105 708 493.55	25.66

ノート合計 - 固定金利	105 708 493.55	25.66
--------------	----------------	-------

中期債券 - 固定金利

米ドル			
USD INTESA SANPAOLO SPA-144A 6.50000% 11-24.02.21	5 000 000.00	5 226 743.50	1.27
米ドル合計		5 226 743.50	1.27

中期債券合計 - 固定金利	5 226 743.50	1.27
---------------	--------------	------

長期債券 - 固定金利

米ドル			
USD BURLINGTON NORTHERN SANTA FE LLC 4.05000% 18-15.06.48	2 000 000.00	2 287 251.80	0.56
USD EL PASO NATURAL GAS CO 8.37500% 03-15.06.32	1 050 000.00	1 452 097.81	0.35
USD ENERGY TRANSFER OPERATING LP 4.25000% 19-15.03.23	2 500 000.00	2 598 831.25	0.63

内容	数量 / 名目金額	先物 / 為替先物予約 / スワップに係る 未実現利益 (損失) の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
USD NEVADA POWER CO 6.65000% 06-01.04.36	1 174 000.00	1 663 107.18	0.40
USD NGPL PIPECO LLC-144A 4.87500% 17-15.08.27	2 500 000.00	2 649 396.50	0.64
USD RABOBANK NEDERLAND NV-SUB 3.95000% 12-09.11.22	1 250 000.00	1 303 970.75	0.32
米ドル合計		11 954 655.29	2.90

長期債券合計 - 固定金利		11 954 655.29	2.90
---------------	--	---------------	------

他の規制市場で取引されている譲渡可能証券および金融市場商品 合計		136 583 381.69	33.15
-------------------------------------	--	----------------	-------

公認証券取引所に上場されておらず他の規制市場において取引もされていない譲渡可能証券および金融市場商品

ノート - 固定金利			
米ドル			
USD CCO LLC/CAPITAL 4.20000% 17-15.03.28	1 000 000.00	1 060 034.40	0.26
USD FOX CORP-144A 4.70900% 19-25.01.29	2 000 000.00	2 269 761.80	0.55
USD GLP CAPITAL LP / GLP FINANC II INC 4.00000% 19- 15.01.30	2 000 000.00	2 018 190.00	0.49
USD NRG ENERGY INC-144A 3.75000% 19-15.06.24	425 000.00	438 133.65	0.11
USD T-MOBILE USA INC *ESCROW* 5.12500% 17-15.04.25	2 000 000.00	0.20	0.00
USD T-MOBILE USA INC *ESCROW* 5.37500% 17-15.04.27	800 000.00	0.08	0.00
米ドル合計		5 786 120.13	1.41

ノート合計 - 固定金利		5 786 120.13	1.41
--------------	--	--------------	------

公認証券取引所に上場されておらず他の規制市場において取引も されていない譲渡可能証券および金融市場商品合計		5 786 120.13	1.41
--	--	--------------	------

最近発行された譲渡可能証券および金融市場商品

ノート - 固定金利			
米ドル			
USD BRISTOL MYERS SQUIBB CO-144A 3.87500% 19-15.08.25	4 000 000.00	4 318 022.40	1.05
米ドル合計		4 318 022.40	1.05
ノート合計 - 固定金利		4 318 022.40	1.05
最近発行された譲渡可能証券および金融市場商品合計		4 318 022.40	1.05

ルクセンブルグ2010年12月17日法(改正済)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			
ルクセンブルグ			
USD UBS (LUX) BOND SICAV - MULTI INCOME (USD) U-X-ACC	270.00	2 727 334.80	0.66
ルクセンブルグ合計		2 727 334.80	0.66
投資信託、オープン・エンド型合計		2 727 334.80	0.66
ルクセンブルグ2010年12月17日法(改正済)の第41条(1)e)に規定 されたUCITS/その他のUCIs合計		2 727 334.80	0.66
投資有価証券合計		416 402 222.47	101.07

内容	数量 / 名目金額	先物 / 為替先物予約 / スワップに係る 未実現利益 (損失) の 米ドル建て評価額 (注 1)	純資産額に 占める %
外国為替先物予約			
外国為替先物予約 (買い / 売り)			
EUR 62 547 100.00	USD 69 150 822.82	16.1.2020	53 825.41 0.01
CHF 17 707 100.00	USD 17 824 384.45	16.1.2020	-34 763.58 -0.01
USD 1 410 336.80	EUR 1 275 500.00	16.1.2020	-928.13 0.00
USD 715 626.19	EUR 648 000.00	16.1.2020	-1 347.29 0.00
外国為替先物予約 (買い / 売り) 合計			16 786.41 0.00
現金性銀行預金、要求払預金および預金勘定およびその他の当座資産			522 168.32 0.13
当座借越およびその他の短期負債			-9 349 432.67 -2.27
その他の資産および負債			4 420 629.24 1.07
純資産合計			412 012 373.77 100.00

注記は財務書類の不可分の一部である。

U B S (L u x) ボンド・シキャブ - ハイ・イールド・ボンド (米ドル)

2019年11月30日現在の投資有価証券ならびにその他純資産明細書

内容	数量 / 名目金額	先物 / 為替先物予約 / スワップに係る 未実現利益 (損失) の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
公認証券取引所に上場されている譲渡可能証券および金融市場商品			
ノート - 固定金利			
ユーロ			
EUR ALTICE FRANCE-REG-S 5.87500% 18-01.02.27	2 000 000.00	2 453 505.52	0.24
EUR ALTICE LUXEMBOURG SA-REG-S 8.00000% 19-15.05.27	3 400 000.00	4 154 277.05	0.41
EUR ARD FINANCE SA-REG-S (PIK) 5.00000% 19-30.06.27	3 205 000.00	3 522 948.80	0.35
EUR ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-REG-S 2.12500% 19-15.08.26	1 670 000.00	1 894 280.58	0.19
EUR DKT FINANCE APS-REG-S 7.00000% 18-17.06.23	3 000 000.00	3 489 927.47	0.35
EUR INFOR US INC 5.75000% 16-15.05.22	3 300 000.00	3 682 242.96	0.36
EUR IQVIA INC-REG-S 2.25000% 19-15.01.28	1 040 000.00	1 175 142.26	0.12
EUR VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-REG-S 4.50000% 15-15.05.23	1 525 000.00	1 702 483.32	0.17
ユーロ合計		22 074 807.96	2.19
米ドル			
USD AECOM TECHNOLOGY CORP 5.87500% 15-15.10.24	4 500 000.00	4 916 250.00	0.49
USD AECOM TECHNOLOGY CORP 5.12500% 17-15.03.27	1 525 000.00	1 624 125.00	0.16
USD ALTICE FINANCING SA-144A 6.62500% 15-15.02.23	5 475 000.00	5 598 187.50	0.56
USD ALTICE FRANCE-144A 7.37500% 16-01.05.26	5 625 000.00	6 004 687.50	0.60
USD ALTICE LUXEMBOURG SA-144A 10.50000% 19-15.05.27	2 960 000.00	3 367 888.00	0.33
USD ARD FINANCE SA-144A (PIK) 6.50000% 19-30.06.27	1 000 000.00	996 450.00	0.10
USD BED BATH & BEYOND INC 5.16500% 14-01.08.44	3 750 000.00	2 552 325.00	0.25
USD BOMBARDIER INC-144A 8.75000% 16-01.12.21	2 250 000.00	2 435 625.00	0.24
USD BUCKEYE PARTNERS LP 5.85000% 13-15.11.43	1 200 000.00	1 024 485.77	0.10
USD BUCKEYE PARTNERS LP 4.12500% 17-01.12.27	5 010 000.00	4 609 213.97	0.46
USD CABLEVISION SYSTEMS CORP 5.87500% 12-15.09.22	3 500 000.00	3 771 250.00	0.37
USD CALLON PETROLEUM CO 6.12500% 17-01.10.24	1 550 000.00	1 472 500.00	0.15
USD CALPINE CORP 5.37500% 14-15.01.23	5 590 000.00	5 666 862.50	0.56
USD CENTURYLINK INC 7.50000% 16-01.04.24	4 425 000.00	4 978 125.00	0.49
USD CF INDUSTRIES INC 5.37500% 14-15.03.44	2 775 000.00	2 962 312.50	0.29
USD CHESAPEAKE 7.00000% 18-01.10.24	950 000.00	484 500.00	0.05
USD CINEMARK USA INC 4.87500% 13-01.06.23	2 950 000.00	2 994 250.00	0.30
USD CNO FINANCIAL GROUP INC 5.25000% 19-30.05.29	985 000.00	1 091 453.88	0.11
USD CODERE FINANCE 2 LUX SA-144A 7.62500% 16-01.11.21	4 000 000.00	3 607 728.00	0.36
USD COVANTA HOLDING CORP 5.87500% 17-01.07.25	3 475 000.00	3 631 375.00	0.36
USD CRESTWOOD MIDSTREAM PART LP/FIN 5.75000% 17-01.04.25	3 170 000.00	3 186 801.00	0.32
USD DANA INC 5.37500% 19-15.11.27	1 845 000.00	1 868 431.50	0.19
USD ENCOMPASS HEALTH CORP 4.50000% 19-01.02.28	2 510 000.00	2 572 750.00	0.26
USD EQUINIX INC 5.37500% 17-15.05.27	4 710 000.00	5 104 462.50	0.51
USD FREEPORT-MCMORAN INC 4.55000% 14-14.11.24	1 910 000.00	2 007 333.60	0.20
USD GANNETT CO INC 6.37500% 13-15.10.23	5 894 000.00	6 078 187.50	0.60
USD GEMS MENASA CAYMAN LTD/GEDL-144A 7.12500% 19-31.07.26	3 660 000.00	3 844 143.75	0.38
USD GENESIS ENERGY LP 6.25000% 17-15.05.26	3 095 000.00	2 698 236.47	0.27
USD HCA INC 5.25000% 16-15.06.26	2 400 000.00	2 681 613.36	0.27
USD HCA INC 7.50000% 11-15.02.22	3 265 000.00	3 615 987.50	0.36
USD HILTON GRAND VACATION BORROWER LLC 6.12500% 18-01.12.24	2 825 000.00	3 065 125.00	0.30
USD INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC-144A 6.50000% 15-15.02.25	4 550 000.00	5 084 625.00	0.51
USD INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC-144A 6.25000% 18-15.01.27	1 975 000.00	2 216 937.50	0.22
USD ISTAR INC 4.75000% 19-01.10.24	2 305 000.00	2 366 946.87	0.24
USD KB HOME 4.80000% 19-15.11.29	925 000.00	936 562.50	0.09
USD KB HOME 6.87500% 19-15.06.27	4 735 000.00	5 393 662.17	0.54
USD LEVEL 3 FINANCING INC 5.37500% 16-01.05.25	3 300 000.00	3 415 500.00	0.34

内容	数量 / 名目金額	先物 / 為替先物予約 / スワップに係る 未実現利益 (損失) の 米ドル建て評価額 (注 1)	純資産額に 占める %
USD NOBLE HOLDING INTERNATIONAL LTD 6.20000% 10-01.08.40	2 815 000.00	943 025.00	0.09
USD NRG ENERGY INC 7.25000% 17-15.05.26	2 615 000.00	2 863 372.70	0.28
USD PULTEGROUP INC 5.50000% 16-01.03.26	2 840 000.00	3 148 850.00	0.31
USD RANGE RESOURCES CORP 4.87500% 16-15.05.25	1 185 000.00	965 775.00	0.10
USD RHP HOTEL PROPERTIES/RHP FINANCE 5.00000% 15-15.04.23	2 375 000.00	2 428 437.50	0.24
USD SERVICE CORP INTERNATIONAL 5.12500% 19-01.06.29	2 375 000.00	2 535 312.50	0.25
USD SM ENERGY CO 6.12500% 15-15.11.22	1 607 000.00	1 566 825.00	0.16
USD SM ENERGY CO 6.62500% 18-15.01.27	870 000.00	791 700.00	0.08
USD SM ENERGY CO 6.75000% 16-15.09.26	2 250 000.00	2 047 500.00	0.20
USD SOUTHWESTERN ENERGY CO 7.50000% 17-01.04.26	3 075 000.00	2 694 468.75	0.27
USD SPRINGLEAF FINANCE CORP 5.62500% 17-15.03.23	3 325 000.00	3 561 906.25	0.35
USD SPRINGLEAF FINANCE CORP 6.87500% 18-15.03.25	2 155 000.00	2 461 074.65	0.24
USD SPRINGLEAF FINANCE CORP 7.12500% 18-15.03.26	2 470 000.00	2 846 675.00	0.28
USD SPRINGLEAF FINANCE CORP 6.12500% 19-15.03.24	2 500 000.00	2 737 525.00	0.27
USD SPRINGLEAF FINANCE CORP 5.37500% 19-15.11.29	925 000.00	952 750.00	0.09
USD T-MOBILE USA INC 6.37500% 14-01.03.25	4 625 000.00	4 798 437.50	0.48
USD TELECOM ITALIA CAPITAL 7.20000% 06-18.07.36	940 000.00	1 100 317.00	0.11
USD TENET HEALTHCARE CORP 4.62500% 17-15.07.24	3 870 000.00	4 005 450.00	0.40
USD TENET HEALTHCARE CORP III 5.12500% 17-01.05.25	3 360 000.00	3 452 400.00	0.34
USD TRANSDIGM INC-SUB 6.50000% 15-15.05.25	4 360 000.00	4 528 950.00	0.45
USD TRANSOCEAN LTD 6.80000% 07-15.03.38	1 350 000.00	832 720.50	0.08
USD TRANSOCEAN PHOENIX 2 LTD-144A 7.75000% 16-15.10.24	2 700 000.00	1 965 600.00	0.20
USD TRIVIUM PACKAGING FINANCE BV-144A 5.50000% 19-15.08.26	200 000.00	210 003.00	0.02
USD TRIVIUM PACKAGING FINANCE BV-144A 8.50000% 19-15.08.27	200 000.00	217 500.00	0.02
USD UNITED RENTALS NORTH AMERICA INC 6.50000% 18-15.12.26	1 815 000.00	1 981 263.07	0.20
USD UNITED RENTALS NORTH AMERICA INC 3.87500% 19-15.11.27	2 875 000.00	2 900 156.25	0.29
USD VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC-144A 5.50000% 16-15.08.26	2 325 000.00	2 444 109.75	0.24
USD WELLCARE HEALTH PLANS INC 5.25000% 17-01.04.25	3 780 000.00	3 954 825.00	0.39
USD WESTERN DIGITAL CORP 4.75000% 18-15.02.26	4 675 000.00	4 815 250.00	0.48
USD ZIGGO BV-144A 4.87500% 19-15.01.30	4 000 000.00	4 083 682.40	0.41
USD ZIGGO BV-144A 5.50000% 16-15.01.27	4 750 000.00	5 029 300.00	0.50
米ドル合計		198 792 062.66	19.75
ノート合計 - 固定金利		220 866 870.62	21.94
ノート - 変動金利			
米ドル			
USD CREDIT AGRICOLE SA-144A-SUB 8.125%/VAR 16-PRP	3 725 000.00	4 493 281.25	0.45
米ドル合計		4 493 281.25	0.45
ノート合計 - 変動金利		4 493 281.25	0.45
中期債券 - 固定金利			
ユーロ			
EUR COTT CORP-144A 5.50000% 16-01.07.24	2 000 000.00	2 295 172.16	0.23
ユーロ合計		2 295 172.16	0.23
米ドル			
USD NAVIENT CORP 7.25000% 12-25.01.22	2 525 000.00	2 739 625.00	0.27
USD SPRINT CAPITAL CORPORATION 8.75000% 02-15.03.32	880 000.00	1 049 400.00	0.10
米ドル合計		3 789 025.00	0.37
中期債券合計 - 固定金利		6 084 197.16	0.60

内容	数量 / 名目金額	先物 / 為替先物予約 / スワップに係る 未実現利益 (損失) の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
長期債券 - 固定金利			
ユーロ			
EUR ALTICE FRANCE-REG-S 3.37500% 19-15.01.28	5 545 000.00	6 227 073.38	0.62
EUR NETFLIX INC 4.62500% 18-15.05.29	4 100 000.00	5 004 099.38	0.50
ユーロ合計		11 231 172.76	1.12
米ドル			
USD DENBURY RESOURCES INC-144A 9.00000% 16-15.05.21	950 000.00	833 625.00	0.08
USD HCA INC 5.37500% 15-01.02.25	3 765 000.00	4 160 325.00	0.41
USD T-MOBILE USA INC 6.50000% 15-15.01.26	2 700 000.00	2 889 000.00	0.29
米ドル合計		7 882 950.00	0.78
長期債券合計 - 固定金利		19 114 122.76	1.90
長期債券 - 変動金利			
米ドル			
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 6.500%/VAR 14-PRP	2 250 000.00	2 548 125.00	0.25
USD CITIGROUP INC-SUB 5.950%/3M LIBOR+406.8BP 12-PRP	5 585 000.00	5 921 607.95	0.59
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 6.000%/3M LIBOR+330BP 13-PRP	1 950 000.00	2 090 634.00	0.21
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 6.100%/VAR 14-PRP	1 050 000.00	1 148 437.50	0.11
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 5.000%/VAR 14-PRP	3 900 000.00	3 915 600.00	0.39
USD ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC 7.64800%/VAR 01-PRP	1 940 000.00	2 776 625.00	0.28
USD STANDARD CHARTERED PLC-144A-SUB 7.014%/VAR 07-PRP	1 200 000.00	1 416 660.00	0.14
米ドル合計		19 817 689.45	1.97
長期債券合計 - 変動金利		19 817 689.45	1.97
中期財務省証券 - 変動金利			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3M USTMMR+3.6BP 18-31.10.20	8 100 000.00	8 093 640.61	0.80
米ドル合計		8 093 640.61	0.80
中期財務省証券合計 - 変動金利		8 093 640.61	0.80
公認証券取引所に上場されている譲渡可能証券および金融市場商品 合計		278 469 801.85	27.66
他の規制市場で取引されている譲渡可能証券および金融市場商品			
モーゲージ担保証券 - 固定金利			
米ドル			
USD PALISADES CENTER TRUST-144A-SUB 4.73700% 16-09.04.33	2 700 000.00	2 608 397.64	0.26
米ドル合計		2 608 397.64	0.26
モーゲージ担保証券合計 - 固定金利		2 608 397.64	0.26
モーゲージ担保証券 - 変動金利			
米ドル			
USD BX COMMERCIAL MORTGAGE TRUST-144A 1M LIBOR+180BP 18-15.11.35	1 000 000.00	768 702.20	0.08
USD CAESARS PALACE LAS VEGAS TRUST-144A-SUB VAR 17-01.10.34	3 025 000.00	3 134 332.87	0.31
USD CAMB COMM MORTGAGE TRUST-144A-SUB 1M LIBOR+175BP 19-15.12.37	2 780 000.00	2 789 530.95	0.28
USD CHT COSMO MORTGAGE TRUST-144A-SUB 1M LIBOR+300BP 17-15.11.36	3 475 000.00	3 478 233.84	0.34

内容	数量 / 名目金額	先物 / 為替先物予約 / スワップに係る 未実現利益 (損失) の 米ドル建て評価額 (注 1)	純資産額に 占める %
USD GS MORTGAGE SECURITIES TRUST-144A-SUB VAR 17-01.10.32	2 925 000.00	2 957 348.75	0.29
USD J.P. MORGAN CHASE COMMERCIAL-144A-SUB VAR 18-15.06.35	3 100 000.00	3 099 966.83	0.31
米ドル合計		16 228 115.44	1.61

モーゲージ担保証券合計 - 変動金利		16 228 115.44	1.61
--------------------	--	---------------	------

ノート - 固定金利

米ドル

USD 1011778 BC ULC/NEW RED FINANCE INC-144A 5.00000% 17-15.10.25	5 115 000.00	5 304 408.45	0.53
USD 1011778 BC ULC/NEW RED FINANCE INC-144A 3.87500% 19-15.01.28	460 000.00	462 903.75	0.05
USD ALBERTSONS COS LLC / SAFEWAY INC-144A 7.50000% 19-15.03.26	1 470 000.00	1 628 025.00	0.16
USD ALBERTSONS COS LLC / SAFEWAY INC 6.62500% 17-15.06.24	3 410 000.00	3 577 158.20	0.36
USD ALCOA NEDERLAND HOLDING BV-144A 6.75000% 16-30.09.24	765 000.00	805 162.50	0.08
USD ALLY FINANCIAL INC 8.00000% 08-01.11.31	3 150 000.00	4 343 062.50	0.43
USD AMSTED INDUSTRIES INC-144A 5.62500% 19-01.07.27	985 000.00	1 039 175.00	0.10
USD ANTERO RESOURCES FIN CORP 5.12500% 14-01.12.22	1 000 000.00	812 500.00	0.08
USD ARCHROCK PARTNERS LP/FIN CORP-144A 6.87500% 19-01.04.27	2 415 000.00	2 486 496.07	0.25
USD ASCENT RESOURCES UTICA HOLDINGS-144A 10.00000% 17-01.04.22	4 107 000.00	3 942 720.00	0.39
USD ASCENT RESOURCES UTICA HOLDINGS-144A 7.00000% 18-01.11.26	1 355 000.00	1 043 350.00	0.10
USD ASGN INC-144A 4.62500% 19-15.05.28	925 000.00	929 625.00	0.09
USD ASHTEAD CAPITAL INC-144A 5.25000% 18-01.08.26	1 300 000.00	1 388 556.00	0.14
USD AVON INTERNATIONAL OPERATIONS INC-144A 7.87500% 16-15.08.22	1 400 000.00	1 457 750.00	0.14
USD BEAZER HOMES USA INC 5.87500% 18-15.10.27	2 455 000.00	2 412 037.50	0.24
USD BOISE CASCADE CO-144A 5.62500% 16-01.09.24	3 686 000.00	3 833 440.00	0.38
USD BOMBARDIER INC-144A 7.50000% 15-15.03.25	2 950 000.00	2 986 875.00	0.30
USD BOMBARDIER INC-144A 7.50000% 17-01.12.24	2 500 000.00	2 569 939.00	0.26
USD BOMBARDIER INC-144A 7.87500% 19-15.04.27	3 215 000.00	3 234 161.40	0.32
USD BOOZ ALLEN HAMILTON INC-144A 5.12500% 17-01.05.25	3 350 000.00	3 463 062.50	0.34
USD BOYNE USA INC-144A 7.25000% 18-01.05.25	1 805 000.00	1 958 425.00	0.19
USD BRAND ENERGY & INFRASTRUCTURE SERV-144A 8.50000% 17-15.07.25	185 000.00	180 375.00	0.02
USD BUILDERS FIRSTSOURCE INC-144A 5.62500% 16-01.09.24	5 261 000.00	5 471 440.00	0.54
USD BUILDERS FIRSTSOURCE INC-144A 6.75000% 19-01.06.27	495 000.00	534 404.47	0.05
USD BWAY HOLDING CO-144A 7.25000% 17-15.04.25	2 800 000.00	2 653 000.00	0.26
USD CALFRAC HOLDINGS LP-144A 8.50000% 18-15.06.26	2 935 000.00	1 185 006.25	0.12
USD CALIFORNIA RESOURCES CORP-144A 8.00000% 15-15.12.22	1 500 000.00	375 000.00	0.04
USD CALLON PETROLEUM CO 6.37500% 18-01.07.26	950 000.00	885 875.00	0.09
USD CARRIZO OIL & GAS INC 6.25000% 15-15.04.23	1 080 000.00	1 039 500.00	0.10
USD CATALENT PHARMA SOLUTIONS INC-144A 5.00000% 19-15.07.27	2 485 000.00	2 578 187.50	0.26
USD CBS OUTDOOR AMERICAS CAPITAL LLC-144A 4.62500% 19-15.03.30	925 000.00	933 676.50	0.09
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.87500% 15-01.05.27	3 100 000.00	3 301 500.00	0.33
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.75000% 15-15.02.26	7 915 000.00	8 359 902.15	0.83
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.87500% 16-01.04.24	2 400 000.00	2 502 000.00	0.25
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.50000% 16-01.05.26	5 000 000.00	5 275 000.00	0.52
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.12500% 17-01.05.27	460 000.00	487 600.00	0.05
USD CDK GLOBAL INC-144A 5.25000% 19-15.05.29	925 000.00	980 638.75	0.10
USD CENTENE CORP-144A 4.25000% 19-15.12.27	1 845 000.00	1 898 043.75	0.19
USD CENTENE CORP-144A 4.62500% 19-15.12.29	2 215 000.00	2 322 981.25	0.23
USD CENTENE CORP-144A 5.37500% 18-01.06.26	1 175 000.00	1 246 968.75	0.12
USD CENTENNIAL RESOURCE PRODUCTION LLC-144A 6.87500% 19-01.04.27	1 730 000.00	1 686 940.30	0.17

内容	数量 / 名目金額	先物 / 為替先物予約 / スワップに係る 未実現利益 (損失) の 米ドル建て評価額 (注 1)	純資産額に 占める %
USD CHANGE HC HLDS LLC/CHNG HC FIN INC-144A 5.75000% 17-01.03.25	3 360 000.00	3 469 200.00	0.34
USD CHENIERE CORPUS CHRISTI HLDGS LLC 5.87500% 17-31.03.25	1 230 000.00	1 374 771.00	0.14
USD CHENIERE ENERGY PARTNERS LP-144A 4.50000% 19-01.10.29	920 000.00	924 876.00	0.09
USD CHOBANI LLC/FINANCE CORP-144A 7.50000% 17-15.04.25	2 750 000.00	2 605 625.00	0.26
USD CLEAN HARBORS INC-144A 4.87500% 19-15.07.27	985 000.00	1 032 083.00	0.10
USD CLEAN HARBORS INC-144A 5.12500% 19-15.07.29	1 975 000.00	2 086 972.62	0.21
USD COMMScope FINANCE LLC-144A 8.25000% 19-01.03.27	3 960 000.00	3 979 602.00	0.40
USD COMMScope TECHNOLOGIES LLC-144A 6.00000% 15-15.06.25	6 770 000.00	6 533 050.00	0.65
USD CONSTELLUM SE-144A 6.62500% 17-01.03.25	1 425 000.00	1 482 028.50	0.15
USD CRC ESCROW ISSUER LLC / FINCO INC-144A 5.25000% 17-15.10.25	3 345 000.00	3 456 923.70	0.34
USD CREDIT ACCEPTANCE CORP 7.37500% 15-15.03.23	3 420 000.00	3 522 600.00	0.35
USD CSC HOLDINGS INC-144A 5.37500% 18-01.02.28	1 300 000.00	1 374 750.00	0.14
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 5.37500% 18-15.07.23	2 800 000.00	2 876 539.12	0.29
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 5.50000% 18-15.05.26	5 475 000.00	5 783 844.75	0.57
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 7.50000% 18-01.04.28	1 325 000.00	1 492 281.25	0.15
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 6.50000% 19-01.02.29	3 000 000.00	3 346 230.00	0.33
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 10.87500% 15-15.10.25	2 525 000.00	2 840 625.00	0.28
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 6.62500% 15-15.10.25	1 925 000.00	2 048 007.50	0.20
USD CSN RESOURCES SA-144A 7.62500% 18-13.02.23	2 500 000.00	2 607 812.50	0.26
USD DANA FINANCING LUXEMBOURG SARL-144A 5.75000% 17-15.04.25	2 390 000.00	2 503 525.00	0.25
USD DCP MIDSTREAM OPERATING LP-144A 6.75000% 07-15.09.37	1 475 000.00	1 519 250.00	0.15
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP-144A 6.02000% 16-15.06.26	4 000 000.00	4 570 834.40	0.45
USD DISH DBS CORP 5.87500% 14-15.11.24	2 560 000.00	2 556 800.00	0.25
USD EAGLE HOLDING CO II LLC-144A (PIK) 7.62500% 17-15.05.22	915 000.00	926 437.50	0.09
USD ELDORADO RESORTS INC 6.00000% 19-15.09.26	3 225 000.00	3 550 080.00	0.35
USD ENDO FINANCE LLC-144A 6.00000% 15-15.07.23	1 800 000.00	1 170 000.00	0.12
USD ENERGIZER HOLDINGS INC-144A 6.37500% 18-15.07.26	1 400 000.00	1 494 500.00	0.15
USD ENTERCOM MEDIA CORP-144A 7.25000% 16-01.11.24	3 655 000.00	3 856 025.00	0.38
USD ENTERPRISE MERGER SUB INC-144A 8.75000% 18-15.10.26	1 975 000.00	804 812.50	0.08
USD FLEX ACQUISITION CO INC-144A 7.87500% 18-15.07.26	5 450 000.00	5 204 750.00	0.52
USD FREEPORT-MCMORAN INC 5.45000% 13-15.03.43	3 185 000.00	3 057 600.00	0.30
USD FRONTIER COMMUNICATIONS CORP 11.00000% 16-15.09.25	2 390 000.00	1 099 400.00	0.11
USD GENESIS ENERGY LP 5.62500% 14-15.06.24	1 700 000.00	1 534 250.00	0.15
USD GENESIS ENERGY LP 6.00000% 15-15.05.23	1 800 000.00	1 682 046.00	0.17
USD GFL ENVIRONMENTAL INC-144A 5.37500% 18-01.03.23	3 000 000.00	3 015 000.00	0.30
USD GOEASY LTD-144A 5.37500% 19-01.12.24	925 000.00	931 937.50	0.09
USD GOLDEN NUGGET INC-144A 6.75000% 17-15.10.24	2 950 000.00	3 045 875.00	0.30
USD GRAY ESCROW INC-144A 7.00000% 18-15.05.27	4 440 000.00	4 917 300.00	0.49
USD GREIF INC-144A 6.50000% 19-01.03.27	985 000.00	1 051 487.50	0.10
USD GULFPORT ENERGY CORP 6.37500% 17-15.05.25	3 055 000.00	1 985 750.00	0.20
USD HARSCO CORP-144A 5.75000% 19-31.07.27	985 000.00	1 036 712.50	0.10
USD HD SUPPLY INC-144A 5.37500% 18-15.10.26	1 820 000.00	1 929 200.00	0.19
USD HERC HOLDINGS INC-144A 5.50000% 19-15.07.27	2 430 000.00	2 542 387.50	0.25
USD HESS INFRASTRUCTURE PART/FIN CORP-144A 5.62500% 17-15.02.26	3 075 000.00	3 198 000.00	0.32
USD HILCORP ENERGY I LP/FINANCE CO-144A 5.75000% 15-01.10.25	3 225 000.00	2 801 460.75	0.28
USD HILCORP ENERGY I LP/FINANCE CO-144A 6.25000% 18-01.11.28	2 095 000.00	1 762 376.85	0.18
USD HILL-ROM HOLDINGS INC-144A 4.37500% 19-15.09.27	925 000.00	948 125.00	0.09
USD HILTON DOMESTIC OPERATING CO INC 4.25000% 17-01.09.24	3 125 000.00	3 179 687.50	0.32
USD HOLOGIC INC-144A 4.37500% 17-15.10.25	875 000.00	901 250.00	0.09
USD HOLOGIC INC-144A 4.62500% 18-01.02.28	850 000.00	896 750.00	0.09
USD HUB INTERNATIONAL LTD-144A 7.00000% 18-01.05.26	4 550 000.00	4 663 750.00	0.46
USD HUBBAY MINERALS INC-144A 7.25000% 16-15.01.23	2 405 000.00	2 465 125.00	0.25
USD IAA SPINCO INC-144A 5.50000% 19-15.06.27	2 490 000.00	2 618 496.45	0.26
USD INFOR US INC 6.50000% 16-15.05.22	2 625 000.00	2 674 350.00	0.27
USD INTELSAT JACKSON HOLDINGS SA 5.50000% 14-01.08.23	3 585 000.00	2 848 999.50	0.28

内容	数量 / 名目金額	先物 / 為替先物予約 / スワップに係る 未実現利益 (損失) の 米ドル建て評価額 (注 1)	純資産額に 占める %
USD INTELSAT JACKSON HOLDINGS SA-144A 9.75000% 17-15.07.25	2 660 000.00	2 234 400.00	0.22
USD INTELSAT JACKSON HOLDINGS SA-144A 8.50000% 18-15.10.24	1 975 000.00	1 628 082.36	0.16
USD IRON MOUNTAIN INC-144A 4.87500% 17-15.09.27	2 060 000.00	2 116 650.00	0.21
USD JACOBS ENTERTAINMENT INC-144A 7.87500% 17-01.02.24	3 300 000.00	3 498 000.00	0.35
USD JAGUAR HOLDINGS/PHARMA PROD DEV-144A 6.37500% 15-01.08.23	2 480 000.00	2 566 800.00	0.26
USD JBS USA LUX SA/FOOD/FINANCE INC-144A 6.50000% 19-15.04.29	2 470 000.00	2 743 651.30	0.27
USD JBS USA LUX SA/FOOD/FINANCE INC-144A 5.50000% 19-15.01.30	1 840 000.00	1 961 900.00	0.20
USD JELD-WEN INC-144A 4.62500% 17-15.12.25	830 000.00	837 262.50	0.08
USD JELD-WEN INC-144A 4.87500% 17-15.12.27	1 665 000.00	1 667 081.24	0.17
USD JSL EUROPE SA-144A 7.75000% 17-26.07.24	2 220 000.00	2 376 232.50	0.24
USD KAISER ALUMINUM CORP-144A 4.62500% 19-01.03.28	1 845 000.00	1 893 708.00	0.19
USD LADDER CAPITAL FIN HLDG LLLP/CORP-144A 5.25000% 17-01.10.25	6 245 000.00	6 338 675.00	0.63
USD LAMAR MEDIA CORPORATION-SUB 5.00000% 13-01.05.23	2 400 000.00	2 442 000.00	0.24
USD LENNAR CORP 5.25000% 18-01.06.26	2 280 000.00	2 490 900.00	0.25
USD LEVEL 3 FINANCING INC 5.25000% 17-15.03.26	5 410 000.00	5 633 162.50	0.56
USD MATTEL INC-144A 6.75000% 17-31.12.25	2 330 000.00	2 440 675.00	0.24
USD MEDNAX INC-144A 6.25000% 18-15.01.27	1 480 000.00	1 505 900.00	0.15
USD MEG ENERGY CORP-144A 6.50000% 17-15.01.25	3 600 000.00	3 741 984.00	0.37
USD MERITOR INC 6.25000% 14-15.02.24	3 245 000.00	3 342 350.00	0.33
USD MGM GROWTH POP LP/CO-ISSUER INC 4.50000% 17-01.09.26	3 457 000.00	3 638 492.50	0.36
USD MOLINA HEALTHCARE INC-144A 4.87500% 17-15.06.25	3 565 000.00	3 636 300.00	0.36
USD MSCI INC-144A 5.37500% 18-15.05.27	835 000.00	894 493.75	0.09
USD MSCI INC-144A 5.75000% 15-15.08.25	2 800 000.00	2 940 000.00	0.29
USD MUELLER WATER PRODUCTS INC-144A 5.50000% 18-15.06.26	2 695 000.00	2 829 750.00	0.28
USD NABORS INDUSTRIES INC 5.75000% 18-01.02.25	2 600 000.00	2 028 000.00	0.20
USD NCR CORP 6.37500% 14-15.12.23	5 153 000.00	5 277 444.95	0.52
USD NETFLIX INC 5.87500% 15-15.02.25	5 665 000.00	6 204 591.25	0.62
USD NEW ENTERPRISE STONE&LIME CO INC-144A 10.12500% 17-01.04.22	5 850 000.00	6 149 812.50	0.61
USD NEW ENTERPRISE STONE&LIME CO INC-144A 6.25000% 18-15.03.26	3 165 000.00	3 315 337.50	0.33
USD NEXSTAR BROADCASTING INC-144A 5.62500% 16-01.08.24	3 300 000.00	3 440 250.00	0.34
USD NEXSTAR ESCROW INC-144A 5.62500% 19-15.07.27	925 000.00	974 376.50	0.10
USD NIELSEN FINANCE LLC/CO-144A 5.00000% 14-15.04.22	5 050 000.00	5 081 562.50	0.50
USD NOBLE HOLDING INTERNATIONAL LTD-144A 7.87500% 18-01.02.26	2 600 000.00	1 636 375.00	0.16
USD NOVA CHEMICALS CORP-144A 5.25000% 17-01.06.27	6 355 000.00	6 418 550.00	0.64
USD NOVELIS CORP-144A 5.87500% 16-30.09.26	2 750 000.00	2 880 625.00	0.29
USD NRG ENERGY INC 6.62500% 17-15.01.27	2 960 000.00	3 204 200.00	0.32
USD NRG ENERGY INC-144A 5.25000% 19-15.06.29	925 000.00	991 415.00	0.10
USD OASIS PETROLEUM INC-144A 6.25000% 18-01.05.26	2 070 000.00	1 485 225.00	0.15
USD PANTHER BF AGGR 2/PANTHER FIN CO-144A 6.25000% 19-15.05.19	495 000.00	526 249.35	0.05
USD PANTHER BF AGGR 2/PANTHER FIN CO-144A 8.50000% 19-15.05.27	2 370 000.00	2 420 362.50	0.24
USD PAR PHARMACEUTICAL INC-144A 7.50000% 19-01.04.27	1 600 000.00	1 512 000.00	0.15
USD PARK AEROSPACE HOLDINGS LTD-144A 5.50000% 17-15.02.24	3 700 000.00	4 049 280.00	0.40
USD PARK AEROSPACE HOLDINGS LTD-144A 4.50000% 17-15.03.23	2 450 000.00	2 565 640.00	0.26
USD PATRICK INDUSTRIES INC-144A 7.50000% 19-15.10.27	2 510 000.00	2 646 305.55	0.26
USD PBF LOGISTICS LP/FINANCE CORP 6.87500% 15-15.05.23	2 840 000.00	2 926 194.00	0.29
USD PENN NATIONAL GAMING INC-144A 5.62500% 17-15.01.27	6 080 000.00	6 308 000.00	0.63
USD POST HOLDINGS INC-144A 5.50000% 17-01.03.25	3 930 000.00	4 121 587.50	0.41
USD POST HOLDINGS INC-144A 5.50000% 19-15.12.29	230 000.00	240 925.00	0.02
USD PRESTIGE BRANDS INC-144A 6.37500% 16-01.03.24	2 290 000.00	2 384 462.50	0.24

内容	数量 / 名目金額	先物 / 為替先物予約 / スワップに係る 未実現利益 (損失) の 米ドル建て評価額 (注 1)	純資産額に 占める %
USD PRIME SEC SER BORROWER LLC/FIN INC-144A 9.25000% 16-15.05.23	1 284 000.00	1 349 805.00	0.13
USD QEP RESOURCES INC 5.25000% 12-01.05.23	3 360 000.00	3 192 000.00	0.32
USD QORVO INC 5.50000% 19-15.07.26	2 670 000.00	2 840 212.50	0.28
USD QUICKEN LOANS INC -144A 5.75000% 15-01.05.25	2 925 000.00	3 037 978.12	0.30
USD ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD 7.50000% 97-15.10.27	2 700 000.00	3 457 378.62	0.34
USD RR DONNELLEY & SONS CO 7.87500% 13-15.03.21	886 000.00	917 010.00	0.09
USD SCIENTIFIC GAMES INTERNATIONAL 10.00000% 14-01.12.22	3 052 000.00	3 132 878.00	0.31
USD SCIENTIFIC GAMES INTERNATIONAL-144A 5.00000% 17-15.10.25	2 425 000.00	2 532 985.25	0.25
USD SCIENTIFIC GAMES INTERNATIONAL-144A 8.25000% 19-15.03.26	7 030 000.00	7 610 678.00	0.76
USD SCIENTIFIC GAMES INTERNATIONAL INC-144A 7.00000% 19-15.05.28	1 845 000.00	1 923 412.50	0.19
USD SERVICE CORP INTERNATIONAL/US 5.37500% 14-15.05.24	2 150 000.00	2 214 500.00	0.22
USD SHEA HOMES LP/FNDG CORP-144A 5.87500% 15-01.04.23	2 840 000.00	2 896 800.00	0.29
USD SHEA HOMES LP/FNDG CORP-144A 6.12500% 15-01.04.25	1 450 000.00	1 500 750.00	0.15
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 5.37500% 16-15.07.26	7 375 000.00	7 789 843.75	0.77
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 5.50000% 19-01.07.29	2 470 000.00	2 652 162.50	0.26
USD SPECTRUM BRANDS INC-144A 5.00000% 19-01.10.29	460 000.00	469 200.00	0.05
USD SPEEDWAY MOTO/ SPEEDWAY FUNDING II-144A 4.87500% 19-01.11.27	2 765 000.00	2 751 175.00	0.27
USD SPRINT CORP 7.62500% 15-15.02.25	2 345 000.00	2 568 478.50	0.26
USD SPRINT CORP 7.87500% 14-15.09.23	6 750 000.00	7 420 781.25	0.74
USD SPX FLOW INC-144A 5.62500% 16-15.08.24	2 680 000.00	2 793 900.00	0.28
USD SUMMIT MATERIALS LLC/FIN-144A 6.50000% 19-15.03.27	985 000.00	1 051 487.50	0.10
USD SUNOCO LP/FINANCE CORP 5.50000% 18-15.02.26	2 700 000.00	2 791 125.00	0.28
USD TALEN ENERGY SUPPLY LLC-144A 10.50000% 17-15.01.26	5 290 000.00	4 487 718.60	0.45
USD TALEN ENERGY SUPPLY LLC-144A 6.62500% 19-15.01.28	925 000.00	906 500.00	0.09
USD TALLGRASS ENRGY PART LP/FIN CORP-144A 5.50000% 17-15.01.28	2 345 000.00	2 169 171.90	0.22
USD TENET HEALTHCARE CORP 8.12500% 13-01.04.22	5 485 000.00	5 992 362.50	0.60
USD TENET HEALTHCARE CORP-144A 4.87500% 19-01.01.26	2 765 000.00	2 872 143.75	0.29
USD TENNANT CO 5.62500% 18-01.05.25	3 425 000.00	3 570 562.50	0.35
USD TERRAFORM POWER OPERATING LLC-144A 4.75000% 19-15.01.30	3 675 000.00	3 693 191.25	0.37
USD TMS INTERNATIONAL CORP-144A 7.25000% 17-15.08.25	4 000 000.00	3 400 000.00	0.34
USD TRANSDIGM INC-144A 6.25000% 19-15.03.26	3 500 000.00	3 758 125.00	0.37
USD TRANSOCEAN INC-144A 9.00000% 16-15.07.23	2 495 000.00	2 547 613.31	0.25
USD TRIDENT MERGER SUB INC-144A 6.62500% 17-01.11.25	2 615 000.00	2 340 425.00	0.23
USD USA COMPRESSION PARTNERS LLC 6.87500% 19-01.04.26	3 400 000.00	3 493 500.00	0.35
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 9.00000% 17-15.12.25	6 915 000.00	7 796 662.50	0.77
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 9.25000% 18-01.04.26	3 000 000.00	3 434 130.00	0.34
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 8.50000% 18-31.01.27	4 485 000.00	5 079 262.50	0.50
USD VIASAT INC-144A 5.62500% 17-15.09.25	2 525 000.00	2 562 875.00	0.25
USD VIASAT INC-144A 5.62500% 19-15.04.27	915 000.00	975 618.75	0.10
USD VIKING CRUISES LTD-144A 5.87500% 17-15.09.27	2 370 000.00	2 535 900.00	0.25
USD VISTRA OPERATIONS CO LLC-144A 5.50000% 18-01.09.26	6 915 000.00	7 278 037.50	0.72
USD VISTRA OPERATIONS CO LLC-144A 5.00000% 19-31.07.27	4 935 000.00	5 126 231.25	0.51
USD WASTE PRO USA INC-144A 5.50000% 18-15.02.26	2 766 000.00	2 855 895.00	0.28
USD WILLIAM CARTER COMPANY-144A 5.62500% 19-15.03.27	660 000.00	711 150.00	0.07
USD WILLIAMS SCOTSMAN INTNL INC-144A 6.87500% 18-15.08.23	2 470 000.00	2 595 153.67	0.26
USD WPX ENERGY INC 5.25000% 14-15.09.24	4 820 000.00	4 925 895.40	0.49
USD WR GRACE & CO-CONN-144A 5.62500% 14-01.10.24	2 300 000.00	2 501 250.00	0.25
USD WW INTERNATIONAL INC-144A 8.62500% 17-01.12.25	2 500 000.00	2 606 250.00	0.26
USD YUM BRANDS INC-144A 4.75000% 19-15.01.30	925 000.00	957 375.00	0.10
米ドル合計		533 613 790.05	53.00
ノート合計 - 固定金利		533 613 790.05	53.00

内容	数量 / 名目金額	先物 / 為替先物予約 / スワップに係る 未実現利益 (損失) の 米ドル建て評価額 (注 1)	純資産額に 占める %
長期債券 - 固定金利			
米ドル			
USD ALLISON TRANSMISSION INC-144A 5.00000% 16-01.10.24	3 105 000.00	3 178 743.75	0.31
USD INTELSAT JACKSON HOLDINGS SA-144A 8.00000% 16- 15.02.24	1 865 000.00	1 902 300.00	0.19
USD ISTAR INC 5.25000% 17-15.09.22	2 425 000.00	2 481 260.00	0.25
USD LIBERTY INTERACTIVE LLC 8.25000% 00-01.02.30	2 345 000.00	2 342 068.75	0.23
米ドル合計		9 904 372.50	0.98
長期債券合計 - 固定金利		9 904 372.50	0.98
他の規制市場で取引されている譲渡可能証券および金融市場商品			
合計		562 354 675.63	55.85
公認証券取引所に上場されておらず他の規制市場において取引もされていない譲渡可能証券および金融市場商品			
ノート - 固定金利			
米ドル			
USD ALLISON TRANSMISSION INC-144A 5.87500% 19-01.06.29	985 000.00	1 062 568.75	0.10
USD ASHTEAD CAPITAL INC-144A 4.00000% 19-01.05.28	1 800 000.00	1 806 750.00	0.18
USD CASCADES INC/CASCADES USA INC-144A 5.12500% 19- 15.01.26	2 150 000.00	2 175 098.88	0.22
USD CDW LLC/CDW FINANCE CORP 4.25000% 19-01.04.28	460 000.00	480 562.00	0.05
USD CHARLES RIVER LABORATORIES INTER-144A 4.25000% 19- 01.05.28	925 000.00	931 937.50	0.09
USD CHESAPEAKE ENERGY CORP 8.00000% 18-15.06.27	1 360 000.00	649 400.00	0.06
USD CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC-144A 8.62500% 18- 15.01.24	2 320 000.00	2 389 600.00	0.24
USD FRONTIER COMMUNICATIONS CORP-144A 8.00000% 19- 01.04.27	985 000.00	1 017 012.50	0.10
USD HUSBAY MINERALS INC-144A 7.62500% 16-15.01.25	886 000.00	888 215.00	0.09
USD INSTALLED BUILDING PRODUCTS INC-144A 5.75000% 19- 01.02.28	925 000.00	970 093.75	0.10
USD JACK OHIO FIN/ JO FINANCE 1 CORP-144A 6.75000% 16- 15.11.21	192 000.00	195 840.01	0.02
USD JACK OHIO FIN/ JO FINANCE 1 CORP-144A 10.25000% 16- 15.11.22	1 865 000.00	1 976 900.00	0.20
USD JBS USA LLC/JBS USA FINANCE INC-144A 6.75000% 18- 15.02.28	3 100 000.00	3 425 500.00	0.34
USD JEFFERIES FINANCE LLC-144A 7.25000% 17-15.08.24	1 955 000.00	1 994 100.00	0.20
USD KFC HLDG/PIZZA HUT HLDG/TACO BELL-144A 4.75000% 17- 01.06.27	2 175 000.00	2 262 000.00	0.22
USD PARSLEY ENERGY LLC/FINANCE CORP-144A 5.37500% 16- 15.01.25	2 445 000.00	2 499 963.60	0.25
USD PARTY CITY HOLDINGS INC-144A 6.62500% 18-01.08.26	8 700 000.00	5 220 000.00	0.52
USD PRECISION DRILLING CORP 7.75000% 17-15.12.23	1 600 000.00	1 516 000.00	0.15
USD PRECISION DRILLING CORP-144A 7.12500% 17-15.01.26	1 025 000.00	896 162.63	0.09
USD SUNOCO LP/FINANCE CORP 5.87500% 18-15.03.28	1 640 000.00	1 722 000.00	0.17
USD T-MOBILE USA INC *ESCROW* 6.37500% 14-01.03.25	4 625 000.00	0.46	0.00
USD TALEN ENERGY SUPPLY LLC-144A 7.25000% 19-15.05.27	460 000.00	469 455.30	0.05
USD TARGA RESOURCES PARTNERS 5.12500% 16-01.02.25	4 745 000.00	4 875 013.00	0.48
USD USA COMPRESSION PRTRN/FIN CORP-144A 6.87500% 19- 01.09.27	1 480 000.00	1 513 744.00	0.15
USD VOC ESCROW LTD-144A 5.00000% 18-15.02.28	2 595 000.00	2 722 596.15	0.27
USD WEEKLEY HOMES LLC/FINANCE CORP 6.62500% 17-15.08.25	3 890 000.00	3 977 525.00	0.39
米ドル合計		47 638 038.53	4.73
ノート合計 - 固定金利		47 638 038.53	4.73

内容	数量 / 名目金額	先物 / 為替先物予約 / スワップに係る 未実現利益 (損失) の 米ドル建て評価額 (注 1)	純資産額に 占める %
長期債券 - 固定金利			
米ドル			
USD DELEK LOGISTICS PARTNERS LP 6.75000% 18-15.05.25	3 595 000.00	3 595 000.00	0.36
USD T-MOBILE USA INC *ESCROW* 6.50000% 15-15.01.26	2 700 000.00	0.27	0.00
米ドル合計		3 595 000.27	0.36
長期債券合計 - 固定金利		3 595 000.27	0.36
公認証券取引所に上場されておらず他の規制市場において取引も されていない譲渡可能証券および金融市場商品合計		51 233 038.80	5.09
最近発行された譲渡可能証券および金融市場商品			
ノート - 固定金利			
米ドル			
USD ALBERTSONS COS INC / SAFEWAY INC-144A 5.87500% 19-15.02.28	920 000.00	962 550.00	0.10
USD AMERICAN BUILDER & CONTRACT SUPPLY-144A 4.00000% 19-15.01.28	925 000.00	926 156.25	0.09
USD AVON INTERNATIONAL CAPITAL PLC-144A 6.50000% 19-15.08.22	6 124 000.00	6 353 650.00	0.63
USD BEACON ROOFING SUPPLY INC-144A 4.50000% 19-15.11.26	460 000.00	464 600.00	0.05
USD BOYD GAMING CORP-144A 4.75000% 19-01.12.27	1 845 000.00	1 863 689.85	0.18
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.37500% 19-01.06.29	1 400 000.00	1 499 750.00	0.15
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 4.75000% 19-01.03.30	1 840 000.00	1 890 600.00	0.19
USD CRESTWOOD MIDSTREAM PART LP/FIN-144A 5.62500% 19-01.05.27	1 840 000.00	1 775 554.00	0.18
USD GFL ENVIRONMENTAL INC-144A 8.50000% 19-01.05.27	2 525 000.00	2 696 489.66	0.27
USD GRAPHIC PACKAGING INTERNATIONAL-144A 4.75000% 19-15.07.27	985 000.00	1 044 100.00	0.10
USD GW B-CR SECURITY CORP-144A 9.50000% 19-01.11.27	2 145 000.00	2 230 800.00	0.22
USD HERTZ CORP/THE-144A 7.12500% 19-01.08.26	1 840 000.00	1 959 600.00	0.19
USD IQVIA INC-144A 5.00000% 19-15.05.27	2 440 000.00	2 562 000.00	0.25
USD LCPR SENIOR SECURED FINANCING DAC-144A 6.75000% 19-15.10.27	2 500 000.00	2 578 125.00	0.26
USD MSCI INC-144A 4.00000% 19-15.11.29	1 400 000.00	1 407 000.00	0.14
USD NCR CORP-144A 6.12500% 19-01.09.29	1 380 000.00	1 455 900.00	0.14
USD PERFORMANCE FOOD GROUP INC-144A 5.50000% 19-15.10.27	925 000.00	982 812.50	0.10
USD QORVO INC-144A 4.37500% 19-15.10.29	2 765 000.00	2 809 931.25	0.28
USD SELECT MEDICAL CORP-144A 6.25000% 19-15.08.26	3 505 000.00	3 759 112.50	0.37
USD SILGAN HOLDINGS INC-144A 4.12500% 19-01.02.28	2 330 000.00	2 334 380.40	0.23
USD TELESAT CANADA / TELESAT LLC-144A 6.50000% 19-15.10.27	1 840 000.00	1 903 491.59	0.19
USD TENET HEALTHCARE CORP-144A 5.12500% 19-01.11.27	2 765 000.00	2 889 425.00	0.29
米ドル合計		46 349 718.00	4.60
ノート合計 - 固定金利		46 349 718.00	4.60
最近発行された譲渡可能証券および金融市場商品合計		46 349 718.00	4.60

内容	数量 / 名目金額	先物 / 為替先物予約 / スワップに係る 未実現利益 (損失) の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
ルクセンブルグ2010年12月17日法(改正済)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			
ルクセンブルグ			
USD UBS (LUX) BOND SICAV - ASIAN HIGH YIELD (USD) U-X-ACC	3 500.00	40 815 705.00	4.05
USD UBS (LUX) BOND SICAV - MULTI INCOME (USD) U-X-ACC	500.00	5 050 620.00	0.50
ルクセンブルグ合計		45 866 325.00	4.55
投資信託、オープン・エンド型合計		45 866 325.00	4.55
ルクセンブルグ2010年12月17日法(改正済)の第41条(1)e)に規定 されたUCITS/その他のUCIS合計			
		45 866 325.00	4.55
投資有価証券合計		984 273 559.28	97.75

デリバティブ商品

公認証券取引所に上場されておらず他の規制市場において取引もされていないデリバティブ商品

スワップおよび指数に係るスワップ先渡契約

USD BOA/IBOXX USD LIQUID HY TR EQS REC PERF 19-20.03.20	20 000 000.11	82 009.94	0.01
USD BOA/IBOXX USD LIQUID HY TR EQS PAYER 3ML 19-20.03.20			
スワップおよび指数に係るスワップ先渡契約合計		82 009.94	0.01

公認証券取引所に上場されておらず他の規制市場において取引も
されていないデリバティブ商品合計

		82 009.94	0.01
--	--	-----------	------

デリバティブ商品合計		82 009.94	0.01
------------	--	-----------	------

外国為替先物予約

外国為替先物予約(買い/売り)

USD 38 546 046.70	EUR 34 865 000.00	16.1.2020	-30 003.35	0.00
EUR 7 139 000.00	USD 7 892 735.62	16.1.2020	6 143.52	0.00
CHF 59 916 800.00	USD 60 313 663.91	16.1.2020	-117 632.06	-0.01
USD 2 989 143.97	EUR 2 702 000.00	16.1.2020	-458.42	0.00
外国為替先物予約(買い/売り)合計			-141 950.31	-0.01

現金性銀行預金、要求払預金および預金勘定およびその他の当座資産	12 843 328.30	1.28
当座借越およびその他の短期負債	-25.16	0.00
その他の資産および負債	9 852 776.33	0.97
純資産合計	1 006 909 698.38	100.00

注記は財務書類の不可分の一部である。

[次へ](#)

5 販売及び買戻しの実績

2019年12月末日前1年間における各サブ・ファンドのクラスP - a c c 投資証券の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
コーポレート・ボンド(米ドル)	4,383,175.084 (215,386.228)	4,056,573.009 (16,800.000)	5,131,001.426 (453,708.228)(注2)
ハイ・イールド・ボンド(米ドル)	186,295.032 (0.000)	213,709.801 (10.000)	299,000.925 (23,371.000)

(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。以下各サブ・ファンドについて同様とする。

(注2) コーポレート・ボンド(米ドル)のクラスP - a c c 投資証券の本邦内における発行済口数には海外の口座から移管された9,896.000口を含む。