

【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3年2月26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

9億9,840万米ドル(約1,052億円)

クラスP - a c c 投資証券

10億8,140万米ドル(約1,139億円)

フィクスト・インカム(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

25億7,240万米ドル(約2,710億円)

クラス(日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券

1,048億3,000万円

インカム(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

12億2,860万米ドル(約1,294億円)

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

11億480万米ドル(約1,164億円)

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

11億860万米ドル(約1,168億円)

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

11億940万米ドル(約1,169億円)

(注1) 上限見込額は、便宜上、ファンドの投資証券の2020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99.84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108.14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257.24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10,483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122.86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110.48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110.86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110.94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、2020年8月31日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=105.36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、2020年11月30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、申込取扱場所が変更されますので、これに関する記載を訂正するため、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			(3) 投資リスク	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。(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	2020年5月末日に 終了する 会計年度末	2020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	- 24,848,715.02	59,726,564.32
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	- 2,696,078.13	23,031,370.03	- 24,848,715.02	59,726,564.32
(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	- 24,848,715.02	59,726,564.32
(d) 出資総額 <sup>(2)</sup>	326,403,802.47	501,866,143.45	488,867,866.14	509,560,086.69
(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	2,316,940.942口	2,292,205.461口
(e) 発行済投資口総数 (クラス P - a c c 投資証券)	369,590.500口	602,725.332口	626,008.150口	526,114.338口
(f) 純資産額	326,403,802.47	501,866,143.45	488,867,866.14	509,560,086.69
(g) 資産総額	326,809,163.84	514,490,856.98	490,373,794.28	512,062,762.45
(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	93.87	102.59
(h) 1口当たり純資産価格 (クラス P - a c c 投資証券)	101.24	107.26	100.50	112.51
(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	- 4.55	11.10
(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)	- 1.25	4.21	- 5.34	12.83
(j) 分配総額	3,289,469.20	9,162,256.65	20,227,465.10	9,800,706.34
(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	5.36	2.38
(k) 1口当たり分配金額 (クラス P - a c c 投資証券)	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	99.88%	97.55%	99.69%	99.51%
(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%	- 0.61%	4.49%
(m) 自己資本利益率 <sup>(3)</sup> (クラス P - a c c 投資証券)	1.24%	7.26%	- 0.73%	4.89%

(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)

	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	2020年5月末日 に終了する 会計年度末	2020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>	- 4,581,042.37	4,825,480.58	2,445,729.76	4,659,313.29	5,135,953.19
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	- 4,581,042.37	4,825,480.58	2,445,729.76	4,659,313.29	5,135,953.19
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	- 4,581,042.37	4,825,480.58	2,445,729.76	4,659,313.29	5,135,953.19
(d) 出資総額 <sup>(2)</sup>	156,155,313.94	153,368,218.52	160,989,751.98	104,821,036.41	115,577,961.48
(e) 発行済投資口総数 (クラスP - a c c 投資証券)	375,034.422口	344,431.076口	369,527.950口	238,985.170口	264,768.036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)	700,557.737口	684,496.658口	675,913.442口	418,030.888口	412,007.866口
(f) 純資産額	156,155,313.94	153,368,218.52	160,989,751.98	104,821,036.41	115,577,961.48
(g) 資産総額	156,239,761.73	155,016,977.33	164,938,100.58	104,966,265.09	115,728,454.87
(h) 1口当たり純資産価格 (クラスP - a c c 投資証券)	227.64	239.06	244.88	250.24	259.09
(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)	9,647円	9,984円	10,102円	10,214円	10,545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)	- 1.08	10.72	5.42	12.26	8.72
(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)	- 5.93円	1.00円	0.34円	3.25円	6.38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%	98.94%	97.61%	99.86%	99.87%
(m) 自己資本利益率 <sup>(3)</sup> (クラスP - a c c 投資証券)	- 2.12%	4.55%	7.57%	4.68%	5.80%
(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)	- 4.55%	1.64%	4.72%	2.30%	4.39%

(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)

	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	2020年5月末日 に終了する 会計年度末	2020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>	- 1,866,369.24	3,708,775.95	4,912,568.00	3,635,272.03	8,076,810.62
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	- 1,866,369.24	3,708,775.95	4,912,568.00	3,635,272.03	8,076,810.62
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	- 1,866,369.24	3,708,775.95	4,912,568.00	3,635,272.03	8,076,810.62
(d) 出資総額 <sup>(2)</sup>	144,318,647.93	137,065,284.80	139,056,923.59	124,799,844.54	127,891,521.32
(e) 発行済投資口総数 (クラスP - a c c 投資証券)	757,626.540口	634,957.585口	613,977.915口	584,895.742口	581,003.760口
(f) 純資産額	144,318,647.93	137,065,284.80	139,056,923.59	124,799,844.54	127,891,521.32
(g) 資産総額	147,269,972.75	138,143,693.29	139,235,786.51	124,917,288.25	128,186,013.64
(h) 1口当たり純資産価格 (クラスP - a c c 投資証券)	110.22	114.74	118.76	117.41	124.95
(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)	- 1.38	2.96	4.14	5.50	7.62
(j) 分配総額	74,775.91	74,775.91	134,207.94	134,207.94	123,453.56
(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	98.00%	99.22%	99.87%	99.91%	99.77%
(m) 自己資本利益率 <sup>(3)</sup> (クラスP - a c c 投資証券)	- 2.19%	2.80%	7.75%	2.33%	5.21%

(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) )

( 別段の記載がない限り金額は米ドル表示 )

	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	2020年5月末日に 終了する 会計年度末	2020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>	- 26,236,915.98	776,359.25	30,547,510.91	739,156.51	89,028,421.65
( b ) 経常利益金額または 経常損失金額	- 26,236,915.98	776,359.25	30,547,510.91	739,156.51	89,028,421.65
( c ) 当期純利益金額または 当期純損失金額	- 26,236,915.98	776,359.25	30,547,510.91	739,156.51	89,028,421.65
( d ) 出資総額 <sup>(2)</sup>	909,184,772.94	1,087,131,873.23	1,187,843,431.51	1,089,453,896.73	1,082,302,425.23
( e ) 発行済投資口総数 (クラスP - a c c 投資証券)	2,796,739.017口	3,109,847.070口	3,305,422.535口	3,251,483.088口	2,995,552.319口
( f ) 純資産額	909,184,772.94	1,087,131,873.23	1,187,843,431.51	1,089,453,896.73	1,082,302,425.23
( g ) 資産総額	914,108,658.13	1,090,530,133.34	1,192,659,119.25	1,093,297,414.19	1,086,164,069.06
( h ) 1口当たり純資産価格 (クラスP - a c c 投資証券)	101.55	105.81	109.41	106.66	112.46
( 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)	- 0.91	2.89	3.50	0.70	5.95
( j ) 分配総額	3,388,469.56	6,857,835.39	4,515,771.12	8,432,873.58	3,125,195.72
( 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	99.46%	99.69%	99.60%	99.65%	99.64%
( m ) 自己資本利益率 <sup>(3)</sup> (クラスP - a c c 投資証券)	- 1.01%	3.24%	7.74%	0.80%	2.79%

(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。

## ( 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 )

	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	2020年5月末日に 終了する 会計年度末	2020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>	- 61,236,999.30	- 20,663,473.77	90,028,031.11	- 55,697,519.57	210,322,670.84
( b ) 経常利益金額または 経常損失金額	- 61,236,999.30	- 20,663,473.77	90,028,031.11	- 55,697,519.57	210,322,670.84
( c ) 当期純利益金額または 当期純損失金額	- 61,236,999.30	- 20,663,473.77	90,028,031.11	- 55,697,519.57	210,322,670.84
( d ) 出資総額 <sup>(2)</sup>	1,850,506,840.95	2,120,118,601.72	2,331,541,245.56	2,011,788,426.80	1,948,978,139.54
( e ) 発行済投資口総数 ( クラス P - a c c 投資証券 )	5,367,267.848口	5,559,346.912口	5,898,082.209口	5,432,559.813口	4,824,142.965口
( f ) 純資産額	1,850,506,840.95	2,120,118,601.72	2,331,541,245.56	2,011,788,426.80	1,948,978,139.54
( g ) 資産総額	1,854,944,036.42	2,124,607,994.28	2,345,840,197.41	2,019,595,290.10	1,964,783,089.97
( h ) 1口当たり純資産価格 ( クラス P - a c c 投資証券 )	103.59	107.15	112.07	105.57	114.11
( 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 )	- 1.87	1.61	4.74	- 2.42	9.00
( j ) 分配総額	6,989,575.03	13,445,368.29	6,778,479.23	13,334,473.37	5,147,609.68
( 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	99.76%	99.79%	99.39%	99.61%	99.20%
( m ) 自己資本利益率 <sup>(3)</sup> ( クラス P - a c c 投資証券 )	- 1.16%	1.70%	8.19%	- 1.47%	1.82%

(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 )

	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	2020年5月末日に 終了する 会計年度末	2020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>	- 22,342,754.96	- 16,073,905.69	27,354,123.21	- 23,565,442.73	59,019,376.07
( b ) 経常利益金額または 経常損失金額	- 22,342,754.96	- 16,073,905.69	27,354,123.21	- 23,565,442.73	59,019,376.07
( c ) 当期純利益金額または 当期純損失金額	- 22,342,754.96	- 16,073,905.69	27,354,123.21	- 23,565,442.73	59,019,376.07
( d ) 出資総額 <sup>(2)</sup>	477,370,229.06	531,905,248.10	589,998,727.11	490,288,568.55	469,328,444.71
( e ) 発行済投資口総数 ( クラス P - a c c 投資証券 )	1,314,682.370口	1,335,014.930口	1,471,146.212口	1,456,136.297口	1,179,426.030口
( f ) 純資産額	477,370,229.06	531,905,248.10	589,998,727.11	490,288,568.55	469,328,444.71
( g ) 資産総額	481,826,528.54	533,623,132.20	592,698,228.35	493,104,881.97	473,110,713.66
( h ) 1口当たり純資産価格 ( クラス P - a c c 投資証券 )	105.48	108.42	114.54	104.88	115.22
( 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 )	- 2.62	0.52	5.80	- 5.33	11.26
( j ) 分配総額	498,177.35	955,886.60	706,571.76	1,306,084.97	408,504.22
( 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	99.08%	99.68%	99.54%	99.43%	99.20%
( m ) 自己資本利益率 <sup>(3)</sup> ( クラス P - a c c 投資証券 )	- 0.93%	0.55%	8.59%	- 3.27%	0.59%

(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

2020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)	508,998,684.82	52,681	クラスP - m d i s t 投資証券	2,201,574.642
			クラスP - a c c 投資証 券	525,054.800
フィクスト・インカム (米ドル)	116,380,858.33	12,045	クラスP - a c c 投資証 券	264,338.603
			クラス(日本円・ヘッ ジ) P - a c c 投資証券	412,097.913
インカム(米ドル)	131,248,295.80	13,584	クラスP - a c c 投資証 券	593,816.645
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)	1,090,845,729.79	112,903	クラスP - a c c 投資証 券	2,953,855.829
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)	1,978,292,881.83	204,753	クラスP - a c c 投資証 券	4,758,079.585
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)	478,223,188.39	49,496	クラスP - a c c 投資証 券	1,150,682.575

(注) 米ドルの円貨換算は、便宜上、2020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=103.50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(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

(2020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
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 もしくはは海外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 買い戻し手続等」と題する項に記載する手続に従って、買い戻し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。買い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))

(2020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	1,498,466.72	0.24
従来型 オプション	スイス	- 1,820.70	0.00
	フランス	- 27,909.94	0.00
	アメリカ合衆国	- 195,725.64	- 0.03
	イギリス	- 289,107.02	- 0.05
	カナダ	- 341,951.90	- 0.06
	小計	- 856,515.20	- 0.14
投資信託	ルクセンブルグ	169,139,507.92	27.27
	アイルランド	76,221,859.44	12.29
	アメリカ合衆国	112,611.34	0.02
	イギリス	73,379.98	0.01
	小計	245,547,358.68	39.59
短期金融商品	アメリカ合衆国	23,994,652.55	3.87
株式	アメリカ合衆国	131,412,528.04	21.19
	日本	18,002,528.87	2.90
	フランス	13,297,641.66	2.14
	イギリス	13,203,696.95	2.13
	ドイツ	12,201,001.56	1.97
	オーストラリア	10,670,621.92	1.72
	オランダ	5,802,580.42	0.94
	スイス	5,365,543.48	0.87
	スペイン	3,285,721.07	0.53
	アイルランド	2,948,728.35	0.48
	イタリア	2,462,188.24	0.40
	フィンランド	1,558,120.00	0.25
	カナダ	1,546,309.24	0.25
	ベルギー	1,016,918.57	0.16
	香港	894,811.96	0.14
	シンガポール	446,064.38	0.07
	ルクセンブルグ	298,036.85	0.05
	ポルトガル	278,521.58	0.04
	アルゼンチン	234,530.80	0.04
	オーストリア	193,324.19	0.03
	ジャージー	175,025.89	0.03
	バミューダ	170,551.47	0.03

	ニュージーランド	170,308.96	0.03
	スウェーデン	141,589.80	0.02
	ノルウェー	106,914.39	0.02
	イスラエル	81,726.17	0.01
	デンマーク	76,858.27	0.01
	パプアニューギニア	50,150.91	0.01
	マン島	47,319.83	0.01
	メキシコ	17,585.83	0.00
	小計	226,157,449.65	36.46
ワラント	アメリカ合衆国	503.94	0.00
ポートフォリオ合計		496,341,916.34	80.02
現金・その他資産		123,940,207.46	19.98
資産総額		620,282,123.80	100.00
負債総額		111,283,438.98	17.94
合計(純資産総額)		508,998,684.82 (約52,681百万円)	82.06

(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))

(2020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	26,385,597.87	22.65
	カナダ	3,882,427.92	3.33
	オランダ	3,397,337.94	2.92
	ドイツ	3,069,013.33	2.64
	ルクセンブルグ	2,228,286.74	1.91
	韓国	2,018,355.60	1.73
	国際機関	1,979,938.32	1.70
	フランス	1,967,724.93	1.69
	オーストラリア	1,348,621.12	1.16
	フィリピン	1,056,089.85	0.91
	クウェート	1,024,593.75	0.88
	カタール	928,015.63	0.80
	アラブ首長国連邦	903,500.00	0.78
	シンガポール	889,344.00	0.76
	ノルウェー	843,174.94	0.72
	ジャージー	771,538.05	0.66
	日本	512,655.84	0.44
	ニュージーランド	404,640.00	0.35
	スウェーデン	401,142.04	0.34
	オーストリア	50,796.06	0.04
	小計	54,062,793.93	46.42
投資信託	ルクセンブルグ	58,742,069.96	50.44
ポートフォリオ合計		112,804,863.89	96.85
現金・その他資産		3,664,364.88	3.15
資産総額		116,469,228.77	100.00
負債総額		88,370.44	0.08
合計(純資産総額)		116,380,858.33 (約12,045百万円)	99.92

(インカム(米ドル))

(2020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	19,214,725.24	14.63
	オランダ	2,156,835.15	1.64
	カナダ	2,123,710.37	1.62
	フィリピン	1,423,882.58	1.08
	ドイツ	1,354,305.18	1.03
	オーストラリア	1,300,829.75	0.99
	ルクセンブルグ	1,255,524.20	0.96
	韓国	1,216,932.65	0.93
	国際機関	1,170,736.94	0.89
	カタール	1,114,875.00	0.85
	クウェート	910,750.00	0.69
	シンガポール	555,840.00	0.42
	フランス	521,003.70	0.40
	アラブ首長国連邦	451,750.00	0.34
	日本	428,734.10	0.33
	ノルウェー	395,277.75	0.30
	ニュージーランド	202,320.00	0.15
		小計	35,798,032.61
従来型 オプション	ドイツ	26,869.15	0.02
	アメリカ合衆国	1,820.00	0.00
	小計	28,689.15	0.02
投資信託	ルクセンブルグ	86,770,611.78	66.05
	アイルランド	6,052,510.25	4.61
	小計	92,823,122.03	70.66
ポートフォリオ合計		128,649,843.79	97.93
現金・その他資産		2,713,031.96	2.07
資産総額		131,362,875.75	100.00
負債総額		114,579.95	0.09
合計(純資産総額)		131,248,295.80 (約13,584百万円)	99.91

(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))

(2020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	175,634,771.08	13.86
	カナダ	24,808,424.26	1.96
	韓国	17,286,477.79	1.36
	ドイツ	11,222,214.24	0.89
	オランダ	10,702,334.15	0.84
	ルクセンブルグ	10,168,605.76	0.80
	オーストラリア	9,624,320.58	0.76
	フィリピン	9,435,777.56	0.74
	カタール	8,270,953.13	0.65
	フランス	6,636,958.13	0.52
	ノルウェー	5,900,784.15	0.47
	アラブ首長国連邦	5,026,882.81	0.40
	クウェート	5,009,125.00	0.40
	国際機関	4,914,355.40	0.39
	日本	4,669,289.84	0.37
	シンガポール	3,663,851.74	0.29
	ジャージー	1,851,691.32	0.15
	サウジアラビア	1,795,625.00	0.14
	イギリス	1,317,838.96	0.10
	ケイマン諸島	1,186,281.25	0.09
	スウェーデン	812,850.72	0.06
	ニュージーランド	708,120.00	0.06
	オーストリア	457,164.54	0.04
	デンマーク	427,381.70	0.03
	英領バージン諸島	272,197.50	0.02
	小計	321,804,276.61	25.39
投資信託	ルクセンブルグ	455,807,296.39	35.96
	アイルランド	141,793,123.27	11.19
	シンガポール	57,398.70	0.00
	イギリス	57,020.06	0.00
	カナダ	21,829.48	0.00
	小計	597,736,667.90	47.16
短期金融商品	アメリカ合衆国	5,019,238.64	0.40
その他の有価証券	アイルランド	45,780,130.00	3.61
株式	日本	14,559,892.43	1.15
	イギリス	7,024,811.88	0.55
	フランス	6,226,305.59	0.49
	カナダ	5,799,533.21	0.46
	スイス	5,613,933.18	0.44

ドイツ	5,387,310.79	0.43
オーストラリア	4,143,517.28	0.33
オランダ	3,050,273.11	0.24
スウェーデン	1,808,970.95	0.14
香港	1,794,095.22	0.14
スペイン	1,429,623.47	0.11
デンマーク	1,426,950.79	0.11
イタリア	1,209,668.27	0.10
フィンランド	724,470.04	0.06
アイルランド	626,185.97	0.05
ベルギー	541,195.70	0.04
シンガポール	516,918.24	0.04
ノルウェー	310,926.38	0.02
ニュージーランド	213,386.79	0.02
ルクセンブルグ	158,035.18	0.01
イスラエル	152,928.07	0.01
ジャージー	116,312.78	0.01
オーストリア	107,294.47	0.01
ポルトガル	101,896.20	0.01
アメリカ合衆国	53,896.03	0.00
マカオ	51,818.91	0.00
マン島	32,522.71	0.00
パプアニューギニア	21,058.91	0.00
メキシコ	9,680.70	0.00
小計	63,213,413.25	4.99
ポートフォリオ合計	1,033,553,726.40	81.55
現金・その他資産	233,877,852.48	18.45
資産総額	1,267,431,578.88	100.00
負債総額	176,585,849.09	13.93
合計(純資産総額)	1,090,845,729.79 (約112,903百万円)	86.07

(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))

(2020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	205,050,950.80	9.08
	カナダ	24,894,662.88	1.10
	韓国	18,195,695.83	0.81
	オランダ	14,223,298.25	0.63
	フィリピン	13,859,163.38	0.61
	ルクセンブルグ	12,697,348.69	0.56
	ドイツ	12,448,047.91	0.55
	オーストラリア	10,591,550.10	0.47
	フランス	8,163,130.37	0.36
	クウェート	6,830,625.00	0.30
	アラブ首長国連邦	6,379,945.32	0.28
	国際機関	5,832,983.17	0.26
	ノルウェー	5,617,212.47	0.25
	日本	4,998,390.60	0.22
	カタール	4,863,640.63	0.22
	シンガポール	4,662,970.55	0.21
	サウジアラビア	2,218,125.00	0.10
	ケイマン諸島	1,725,500.00	0.08
	ジャージー	1,594,511.97	0.07
	スウェーデン	1,580,842.00	0.07
	イギリス	1,318,866.12	0.06
	ニュージーランド	1,011,600.00	0.04
	英領バージン諸島	734,933.25	0.03
	オーストリア	685,746.81	0.03
	デンマーク	351,961.40	0.02
小計	370,531,702.50	16.41	
投資信託	ルクセンブルグ	668,546,916.80	29.61
	アイルランド	483,360,641.24	21.41
	イギリス	210,658.19	0.01
	シンガポール	201,983.13	0.01
	カナダ	71,916.21	0.00
	小計	1,152,392,115.57	51.04
短期金融商品	アメリカ合衆国	4,099,378.17	0.18
その他の有価証券	アイルランド	64,185,770.00	2.84
株式	日本	53,215,476.97	2.36
	イギリス	25,715,976.77	1.14
	フランス	23,525,260.67	1.04
	カナダ	20,916,948.25	0.93
	スイス	20,436,460.25	0.91

ドイツ	19,552,748.02	0.87
オーストラリア	14,977,604.06	0.66
オランダ	11,062,524.30	0.49
スウェーデン	6,558,668.13	0.29
香港	6,511,258.09	0.29
デンマーク	5,170,238.79	0.23
スペイン	5,156,456.44	0.23
イタリア	4,397,124.57	0.19
フィンランド	2,613,566.22	0.12
アイルランド	2,247,400.01	0.10
ベルギー	1,930,503.60	0.09
シンガポール	1,876,563.38	0.08
ノルウェー	1,119,429.18	0.05
ニュージーランド	745,672.95	0.03
イスラエル	571,983.09	0.03
ルクセンブルグ	565,535.18	0.03
ジャージー	423,852.57	0.02
オーストリア	381,134.49	0.02
ポルトガル	368,330.04	0.02
マカオ	190,536.58	0.01
アメリカ合衆国	183,752.31	0.01
マン島	116,207.84	0.01
パプアニューギニア	76,903.97	0.00
メキシコ	21,291.35	0.00
アラブ首長国連邦	0.04	0.00
小計	230,629,408.11	10.21
ポートフォリオ合計	1,821,838,374.35	80.68
現金・その他資産	436,152,397.99	19.32
資産総額	2,257,990,772.34	100.00
負債総額	279,697,890.51	12.39
合計(純資産総額)	1,978,292,881.83 (約204,753百万円)	87.61

(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))

(2020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	42,477,040.12	7.64
	カナダ	7,855,110.49	1.41
	韓国	5,384,208.15	0.97
	オランダ	4,788,397.20	0.86
	ドイツ	4,363,563.99	0.78
	フィリピン	3,616,563.88	0.65
	オーストラリア	3,210,788.33	0.58
	ルクセンブルグ	3,196,649.61	0.57
	フランス	2,367,895.49	0.43
	国際機関	2,159,608.23	0.39
	アラブ首長国連邦	2,134,875.00	0.38
	カタール	1,963,796.88	0.35
	日本	1,757,218.41	0.32
	シンガポール	1,697,047.70	0.31
	ノルウェー	1,414,442.72	0.25
	クウェート	1,366,125.00	0.25
	ジャージー	822,973.92	0.15
	サウジアラビア	633,750.00	0.11
	イギリス	598,830.95	0.11
	スウェーデン	406,425.36	0.07
	ニュージーランド	404,640.00	0.07
	英領バージン諸島	326,637.00	0.06
	ケイマン諸島	323,531.25	0.06
	デンマーク	226,260.90	0.04
	オーストリア	177,786.21	0.03
	小計	93,674,166.79	16.84
投資信託	アイルランド	169,106,743.63	30.40
	ルクセンブルグ	66,815,548.25	12.01
	イギリス	75,258.20	0.01
	シンガポール	62,066.36	0.01
	カナダ	26,068.88	0.00
	小計	236,085,685.32	42.44
短期金融商品	アメリカ合衆国	4,499,361.68	0.81
その他の有価証券	アイルランド	10,372,670.00	1.86
株式	日本	19,385,839.32	3.48
	イギリス	9,348,507.19	1.68
	フランス	8,452,987.90	1.52
	カナダ	7,640,504.51	1.37
	スイス	7,417,307.75	1.33

ドイツ	7,118,944.19	1.28
オーストラリア	5,535,788.60	1.00
オランダ	4,012,901.67	0.72
スウェーデン	2,387,916.63	0.43
香港	2,362,929.01	0.42
デンマーク	1,883,636.47	0.34
スペイン	1,871,587.25	0.34
イタリア	1,599,016.28	0.29
フィンランド	945,482.88	0.17
アイルランド	815,922.91	0.15
ベルギー	695,190.17	0.12
シンガポール	690,830.41	0.12
ノルウェー	407,554.54	0.07
ニュージーランド	260,965.82	0.05
イスラエル	220,115.63	0.04
ルクセンブルグ	204,445.60	0.04
ジャージー	153,972.14	0.03
オーストリア	139,279.34	0.03
ポルトガル	131,811.15	0.02
マカオ	68,144.73	0.01
アメリカ合衆国	63,381.88	0.01
マン島	42,841.96	0.01
パプアニューギニア	28,528.02	0.01
メキシコ	7,395.62	0.00
アラブ首長国連邦	0.01	0.00
小計	83,893,729.58	15.08
ポートフォリオ合計	428,525,613.37	77.03
現金・その他資産	127,782,948.27	22.97
資産総額	556,308,561.64	100.00
負債総額	78,085,373.25	14.04
合計(純資産総額)	478,223,188.39 (約49,496百万円)	85.96

## (2) 運用実績

## 純資産等の推移

2020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
2020年1月末日	572,315.79	59,235	566,504.76	58,633	103.20	10,681	108.48	11,228
2月末日	573,945.51	59,403	570,522.79	59,049	98.43	10,188	103.91	10,755
3月末日	462,424.44	47,861	460,168.40	47,627	85.75	8,875	91.01	9,420
4月末日	483,323.13	50,024	481,583.80	49,844	91.17	9,436	97.22	10,062
5月末日	490,373.79	50,754	488,867.87	50,598	93.87	9,716	100.50	10,402
6月末日	490,656.98	50,783	489,356.67	50,648	94.97	9,829	102.06	10,563
7月末日	496,030.84	51,339	492,525.24	50,976	97.71	10,113	105.38	10,907
8月末日	504,512.70	52,217	499,516.78	51,700	99.84	10,333	108.14	11,192
9月末日	481,913.14	49,878	480,748.45	49,757	97.75	10,117	106.32	11,004
10月末日	474,735.66	49,135	473,610.86	49,019	96.29	9,966	105.18	10,886
11月末日	512,062.76	52,998	509,560.09	52,739	102.59	10,618	112.51	11,645
12月末日	620,282.12	64,199	508,998.68	52,681	104.87	10,854	115.50	11,954

## (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
2020年1月末日	147,214.19	15,237	147,092.48	15,224	248.90	25,761	10,244
2月末日	149,324.17	15,455	149,214.25	15,444	250.40	25,916	10,287
3月末日	102,232.91	10,581	102,179.20	10,576	239.22	24,759	9,782
4月末日	104,928.53	10,860	104,781.20	10,845	245.87	25,448	10,040
5月末日	104,966.27	10,864	104,821.04	10,849	250.24	25,900	10,214
6月末日	113,458.51	11,743	112,895.52	11,685	253.16	26,202	10,327
7月末日	114,594.66	11,861	114,539.53	11,855	257.18	26,618	10,483
8月末日	114,383.53	11,839	114,308.36	11,831	257.24	26,624	10,483
9月末日	122,467.26	12,675	121,482.18	12,573	256.22	26,519	10,435
10月末日	116,070.88	12,013	114,906.53	11,893	255.84	26,479	10,415
11月末日	115,728.45	11,978	115,577.96	11,962	259.09	26,816	10,545
12月末日	116,469.23	12,055	116,380.86	12,045	260.28	26,939	10,582

## (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
2020年1月末日	141,146.20	14,609	140,805.96	14,573	120.52	12,474
2月末日	129,809.31	13,435	128,936.19	13,345	119.08	12,325
3月末日	120,547.61	12,477	117,676.33	12,180	110.12	11,397
4月末日	123,173.39	12,748	122,052.80	12,632	114.95	11,897
5月末日	124,917.29	12,929	124,799.84	12,917	117.41	12,152
6月末日	128,894.68	13,341	127,245.29	13,170	118.89	12,305
7月末日	130,750.33	13,533	130,211.02	13,477	121.64	12,590
8月末日	130,423.62	13,499	130,304.03	13,486	122.86	12,716
9月末日	128,851.75	13,336	128,660.88	13,316	121.61	12,587
10月末日	124,189.76	12,854	123,654.39	12,798	120.80	12,503
11月末日	128,186.01	13,267	127,891.52	13,237	124.95	12,932
12月末日	131,362.88	13,596	131,248.30	13,584	126.63	13,106

## (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
2020年1月末日	1,203,213.61	124,533	1,185,539.28	122,703	111.17	11,506
2月末日	1,164,003.10	120,474	1,152,822.24	119,317	108.43	11,223
3月末日	1,070,875.68	110,836	1,057,890.00	109,492	103.11	10,672
4月末日	1,077,859.42	111,558	1,071,745.64	110,926	105.17	10,885
5月末日	1,093,297.41	113,156	1,089,453.90	112,758	106.66	11,039
6月末日	1,086,568.13	112,460	1,082,808.04	112,071	107.52	11,128
7月末日	1,106,048.16	114,476	1,101,876.94	114,044	109.09	11,291
8月末日	1,119,930.81	115,913	1,111,314.58	115,021	110.48	11,435
9月末日	1,073,889.52	111,148	1,068,614.73	110,602	109.51	11,334
10月末日	1,053,017.01	108,987	1,050,379.49	108,714	108.49	11,229
11月末日	1,086,164.07	112,418	1,082,302.43	112,018	112.46	11,640
12月末日	1,267,431.58	131,179	1,090,845.73	112,903	114.12	11,811

## ( 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) )

	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
2020年1月末日	2,422,128.82	250,690	2,397,746.44	248,167	113.90	11,789
2月末日	2,286,501.63	236,653	2,274,254.53	235,385	108.09	11,187
3月末日	2,041,251.06	211,269	1,993,290.33	206,306	101.98	10,555
4月末日	2,023,793.17	209,463	2,011,768.81	208,218	104.10	10,774
5月末日	2,019,595.29	209,028	2,011,788.43	208,220	105.57	10,926
6月末日	2,020,848.68	209,158	2,010,723.43	208,110	106.37	11,009
7月末日	2,036,916.71	210,821	2,026,374.57	209,730	108.05	11,183
8月末日	2,095,170.08	216,850	2,072,284.81	214,481	110.86	11,474
9月末日	1,984,597.96	205,406	1,972,211.27	204,124	109.30	11,313
10月末日	1,902,390.51	196,897	1,884,924.62	195,090	107.67	11,144
11月末日	1,964,783.09	203,355	1,948,978.14	201,719	114.11	11,810
12月末日	2,257,990.77	233,702	1,978,292.88	204,753	116.93	12,102

## ( 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) )

	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
2020年1月末日	634,503.69	65,671	624,506.47	64,636	116.44	12,052
2月末日	566,888.11	58,673	562,906.53	58,261	107.71	11,148
3月末日	501,101.07	51,864	484,123.96	50,107	101.56	10,511
4月末日	492,657.98	50,990	485,005.52	50,198	103.57	10,719
5月末日	493,104.88	51,036	490,288.57	50,745	104.88	10,855
6月末日	486,778.00	50,382	479,211.72	49,598	105.40	10,909
7月末日	489,025.53	50,614	486,940.56	50,398	106.95	11,069
8月末日	503,726.73	52,136	497,897.13	51,532	110.94	11,482
9月末日	471,487.32	48,799	466,640.26	48,297	108.79	11,260
10月末日	448,881.83	46,459	441,884.34	45,735	106.63	11,036
11月末日	473,110.71	48,967	469,328.44	48,575	115.22	11,925
12月末日	556,308.56	57,578	478,223.19	49,496	119.04	12,321

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

2020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
2020年1月	0.45	47
2月	0.45	47
3月	0.42	43
4月	0.36	37
5月	0.36	37
6月	0.35	36
7月	0.41	42
8月	0.42	43
9月	0.42	43
10月	0.42	43
11月	0.43	45
12月	0.45	47

(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

2020年1月1日から2020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	6.11
フィクスト・インカム(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	5.98
	クラス(日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券	4.65
インカム(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	5.73
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	3.10
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	2.57
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	1.65

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

a = 2020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 = 2019年12月末日現在の1口当たり純資産価格(分配額の額)

## (3) 投資リスク

当中間計算期間において、2020年11月30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

2020年12月末日現在の株主資本総額は、13,000,000ユーロ (約17億円)

(注) ユーロの円貨換算は、便宜上、2020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 = 126.95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

2020年12月末日現在の株主資本総額は、500,000スイス・フラン (約5,858万円)

(注) スイス・フランの円貨換算は、便宜上、2020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 = 117.15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

2020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12億円)

## (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

(2020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

UBS アセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー (チューリッヒ)

(2020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・シュトラッセ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)

(2020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・シュトラッセ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

(2020年12月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有株式
アンドレ・ヴァレンテ (André Valente)	チェアマン	UBSファンド・マネジメント (スイス) エイ・ジー、バーゼル、 チーフ・エグゼクティブ・ オフィサー	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、 デュドランジュ、 インディペンデント・ディレクター	該当なし
クリスティアン・マウラー (Christian Maurer)	ディレクター/ ボード・メンバー	UBSアセット・マネジメント・ スイス・エイ・ジー、チューリッ ヒ、 プロダクト・マネジメント・ヘッド	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、 ルクセンブルグ、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)

(2020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
ケッター・レト・ユー (Ketterer Reto U.)	ディレクター/ ボード・メンバー	2020年9月24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
イヴァノビッチ・アレクサン ダー (Ivanovic Aleksandar)	チェアマン	2020年9月24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)

(2020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 (2019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
ロジャー・フォン・メントレン (Roger von Mentlen)	ディレクター/ ボード・メンバー	2020年4月24日就任	非公開
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
クリスチャン・エッケハート・ブルーム (Christian Ecke hard 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
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

## (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。

2020年12月末日現在、管理会社は以下のとおり、405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	366	542,113,652.79 オーストラリア・ドル
			2,973,991,155.17 カナダ・ドル
			12,537,509,397.32 スイス・フラン
			7,108,109,321.35 中国元
			830,727,756.84 デンマーク・クローネ
			47,025,901,912.68 ユーロ
			2,023,869,112.84 英ポンド
			259,788,578.05 香港ドル
			365,063,616,660.94 日本円
			73,198,753.09 シンガポール・ドル
			142,747,162,719.00 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	39	482,966,738.79 オーストラリア・ドル
			376,091,149.02 スイス・フラン
			2,579,256,028.52 ユーロ
			2,044,237,415.66 英ポンド
			22,564,824,636.97 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)

2020年11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142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	4,348,487,647
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	3,975,735,324
3	UBS (Lux) Money Market Fund - USD	契約型投資信託	1988年11月29日	3,151,060,169
4	UBS ETF Sicav - MSCI EMU Socially Responsible UCITS ETF	変動資本を有する 投資法人	2011年8月18日	1,808,898,523

5	UBS ETF Sicav - MSCI Switzerland 20/35 UCITS ETF	変動資本を有する 投資法人	2013年10月31日	1,699,092,408
6	UBS (Lux) Money Market Fund - EUR	契約型投資信託	1989年10月11日	1,666,437,314
7	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	1,629,307,925
8	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	1,628,373,840
9	UBS (Lux) Equity Sicav - Global Emerging Markets Opportunity (USD)	変動資本を有する 投資法人	2008年9月25日	1,467,745,185
10	UBS (Lux) Strategy Fund - Yield (CHF)	契約型投資信託	1991年9月13日	1,461,177,794

(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)

2020年11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107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	7	23億スイス・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	37億スイス・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	289億スイス・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	45	193億スイス・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	2億スイス・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
  - 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
- 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、2020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=103.50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

	2020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	438,594,381.91	45,394,519
投資有価証券、未実現評価(損)益	56,506,082.52	5,848,380
投資有価証券合計(注1)	495,100,464.43	51,242,898
現金預金、要求払預金および預託金勘定	10,879,650.86	1,126,044
有価証券売却未収金(注1)	374,366.63	38,747
発行未収金	2,449,999.75	253,575
有価証券に係る未収利息	3,212.72	333
配当金に係る未収金	330,992.32	34,258
その他の未収金	87,458.73	9,052
先渡為替契約に係る未実現利益(注1)	169,352.42	17,528
スワップに係る未実現利益(注1)	2,667,264.59	276,062
<b>資産合計</b>	<b>512,062,762.45</b>	<b>52,998,496</b>
<b>負 債</b>		
有価証券購入未払金(注1)	(1,411,646.01)	(146,105)
買戻未払金	(793,412.77)	(82,118)
定率報酬引当金(注2)	(236,580.44)	(24,486)
年次税引当金(注3)	(28,525.42)	(2,952)
その他の手数料および報酬引当金(注2)	(32,511.12)	(3,365)
引当金合計	(297,616.98)	(30,803)
<b>負債合計</b>	<b>(2,502,675.76)</b>	<b>(259,027)</b>
<b>期末現在純資産</b>	<b>509,560,086.69</b>	<b>52,739,469</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)

## 純資産計算書

	2020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	103,741,138.42	10,737,208
投資有価証券、未実現評価(損)益	8,473,269.32	876,983
投資有価証券合計(注1)	112,214,407.74	11,614,191
現金預金、要求払預金および預託金勘定	3,073,286.55	318,085
その他の流動資産(マージン)	113,591.05	11,757
有価証券に係る未収利息	307,763.35	31,854
その他の未収金	15,988.27	1,655
流動資産に係る未収利息	2.73	0
金融先物に係る未実現利益(注1)	3,415.18	353
<b>資産合計</b>	<b>115,728,454.87</b>	<b>11,977,895</b>
<b>負 債</b>		
先渡為替契約に係る未実現損失(注1)	(40,495.23)	(4,191)
当座借越	(0.79)	(0)
買戻未払金	(42,726.75)	(4,422)
定率報酬引当金(注2)	(51,133.97)	(5,292)
年次税引当金(注3)	(4,757.53)	(492)
その他の手数料および報酬引当金(注2)	(11,379.12)	(1,178)
引当金合計	(67,270.62)	(6,963)
<b>負債合計</b>	<b>(150,493.39)</b>	<b>(15,576)</b>
<b>期末現在純資産</b>	<b>115,577,961.48</b>	<b>11,962,319</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

	2020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	107,405,110.45	11,116,429
投資有価証券、未実現評価(損)益	16,290,257.68	1,686,042
投資有価証券合計(注1)	123,695,368.13	12,802,471
現金預金、要求払預金および預託金勘定	2,894,145.65	299,544
その他の流動資産(マージン)	1,367,101.23	141,495
有価証券に係る未収利息	179,919.06	18,622
その他の未収金	30,723.36	3,180
流動資産に係る未収利息	1,196.06	124
先渡為替契約に係る未実現利益(注1)	17,560.15	1,817
<b>資産合計</b>	128,186,013.64	13,267,252
<b>負 債</b>		
金融先物に係る未実現損失(注1)	(218,781.69)	(22,644)
当座借越	(0.79)	(0)
当座借越に係る未払利息	(12.34)	(1)
定率報酬引当金(注2)	(59,385.64)	(6,146)
年次税引当金(注3)	(3,571.00)	(370)
その他の手数料および報酬引当金(注2)	(12,740.86)	(1,319)
引当金合計	(75,697.50)	(7,835)
<b>負債合計</b>	(294,492.32)	(30,480)
<b>期末現在純資産</b>	127,891,521.32	13,236,772

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)

## 純資産計算書

	2020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	941,921,537.03	97,488,879
投資有価証券、未実現評価(損)益	106,990,390.62	11,073,505
投資有価証券合計(注1)	1,048,911,927.65	108,562,385
現金預金、要求払預金および預託金勘定	22,499,891.52	2,328,739
その他の流動資産(マージン)	7,871,106.44	814,660
有価証券売却未収金(注1)	1,049,833.11	108,658
発行未収金	590,486.89	61,115
有価証券に係る未収利息	1,646,501.97	170,413
配当金に係る未収金	65,929.22	6,824
その他の未収金	347,418.08	35,958
金融先物に係る未実現利益(注1)	2,045,450.62	211,704
先渡為替契約に係る未実現利益(注1)	1,135,523.56	117,527
<b>資産合計</b>	<b>1,086,164,069.06</b>	<b>112,417,981</b>
<b>負 債</b>		
当座借越	(336.79)	(35)
有価証券購入未払金(注1)	(1,666,465.09)	(172,479)
買戻未払金	(1,512,371.58)	(156,530)
その他の負債	(20,402.98)	(2,112)
定率報酬引当金(注2)	(525,094.13)	(54,347)
年次税引当金(注3)	(51,017.89)	(5,280)
その他の手数料および報酬引当金(注2)	(85,955.37)	(8,896)
引当金合計	(662,067.39)	(68,524)
<b>負債合計</b>	<b>(3,861,643.83)</b>	<b>(399,680)</b>
<b>期末現在純資産</b>	<b>1,082,302,425.23</b>	<b>112,018,301</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

	2020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	390,962,091.17	40,464,576
投資有価証券、未実現評価(損)益	60,463,867.74	6,258,010
投資有価証券合計(注1)	451,425,958.91	46,722,587
現金預金、要求払預金および預託金勘定	11,752,589.62	1,216,393
その他の流動資産(マージン)	6,069,712.65	628,215
有価証券売却未収金(注1)	344,636.90	35,670
発行未収金	477,282.38	49,399
有価証券に係る未収利息	512,339.02	53,027
配当金に係る未収金	299,865.94	31,036
その他の未収金	259,003.07	26,807
金融先物に係る未実現利益(注1)	1,911,341.91	197,824
先渡為替契約に係る未実現利益(注1)	57,983.26	6,001
<b>資産合計</b>	<b>473,110,713.66</b>	<b>48,966,959</b>
<b>負 債</b>		
当座借越	(139.10)	(14)
有価証券購入未払金(注1)	(977,176.02)	(101,138)
買戻未払金	(2,382,853.06)	(246,625)
その他の負債	(113,671.55)	(11,765)
定率報酬引当金(注2)	(261,461.27)	(27,061)
年次税引当金(注3)	(33,412.18)	(3,458)
その他の手数料および報酬引当金(注2)	(13,555.77)	(1,403)
引当金合計	(308,429.22)	(31,922)
<b>負債合計</b>	<b>(3,782,268.95)</b>	<b>(391,465)</b>
<b>期末現在純資産</b>	<b>469,328,444.71</b>	<b>48,575,494</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

	2020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	1,667,258,272.03	172,561,231
投資有価証券、未実現評価(損)益	236,675,391.32	24,495,903
投資有価証券合計(注1)	1,903,933,663.35	197,057,134
現金預金、要求払預金および預託金勘定	30,320,945.70	3,138,218
その他の流動資産(マージン)	19,403,602.05	2,008,273
有価証券売却未収金(注1)	1,309,329.92	135,516
発行未収金	1,392,576.12	144,132
有価証券に係る未収利息	1,735,757.05	179,651
配当金に係る未収金	715,709.86	74,076
その他の未収金	851,019.61	88,081
金融先物に係る未実現利益(注1)	4,740,025.31	490,593
先渡為替契約に係る未実現利益(注1)	380,461.00	39,378
<b>資産合計</b>	<b>1,964,783,089.97</b>	<b>203,355,050</b>
<b>負 債</b>		
当座借越	(8,610.85)	(891)
有価証券購入未払金(注1)	(2,259,013.99)	(233,808)
買戻未払金	(11,967,235.16)	(1,238,609)
その他の負債	(96,292.20)	(9,966)
定率報酬引当金(注2)	(1,065,411.24)	(110,270)
年次税引当金(注3)	(106,251.15)	(10,997)
その他の手数料および報酬引当金(注2)	(302,135.84)	(31,271)
引当金合計	(1,473,798.23)	(152,538)
<b>負債合計</b>	<b>(15,804,950.43)</b>	<b>(1,635,812)</b>
<b>期末現在純資産</b>	<b>1,948,978,139.54</b>	<b>201,719,237</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2020年6月1日 至2020年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
<b>収 益</b>		
流動資産に係る利息	1,440.80	149
有価証券に係る利息	17,212.28	1,781
配当金	1,647,155.84	170,481
貸付証券に係る収益(注13)	70,477.53	7,294
その他の収益(注4)	140,921.01	14,585
<b>収益合計</b>	<b>1,877,207.46</b>	<b>194,291</b>
<b>費 用</b>		
貸付証券に係るコスト(注13)	(28,191.01)	(2,918)
定率報酬(注2)	(2,856,567.21)	(295,655)
年次税(注3)	(84,988.59)	(8,796)
その他の手数料および報酬(注2)	(49,277.78)	(5,100)
現金および当座借越に係る利息	(4,739.41)	(491)
<b>費用合計</b>	<b>(3,023,764.00)</b>	<b>(312,960)</b>
<b>投資純(損)益</b>	<b>(1,146,556.54)</b>	<b>(118,669)</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	1,157,592.24	119,811
オプションに係る実現(損)益	(6,535,710.59)	(676,446)
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	111,342.36	11,524
先渡為替契約に係る実現(損)益	(2,481,851.78)	(256,872)
スワップに係る実現(損)益	599,000.12	61,997
為替差(損)益	12,869.96	1,332
<b>実現(損)益合計</b>	<b>(7,136,757.69)</b>	<b>(738,654)</b>
<b>当期実現純(損)益</b>	<b>(8,283,314.23)</b>	<b>(857,323)</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	62,394,331.48	6,457,813
オプションに係る未実現評価(損)益	1,806,900.85	187,014
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	(94,648.88)	(9,796)
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	1,413,594.44	146,307
スワップに係る未実現評価(損)益	2,489,700.66	257,684
<b>未実現評価(損)益の変動合計</b>	<b>68,009,878.55</b>	<b>7,039,022</b>
<b>運用の結果による純資産の純増(減)</b>	<b>59,726,564.32</b>	<b>6,181,699</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2020年6月1日 至2020年11月30日

	(米ドル)	(千円)
<b>収 益</b>		
流動資産に係る利息	2.73	0
有価証券に係る利息	642,105.56	66,458
スワップに係る受取利息(注1)	6,297.22	652
配当金	206,327.25	21,355
貸付証券に係る収益(注13)	10,728.37	1,110
その他の収益(注4)	83,346.75	8,626
<b>収益合計</b>	<b>948,807.88</b>	<b>98,202</b>
<b>費 用</b>		
スワップに係る支払利息(注1)	(1.67)	(0)
貸付証券に係るコスト(注13)	(4,291.35)	(444)
定率報酬(注2)	(622,923.96)	(64,473)
年次税(注3)	(15,374.51)	(1,591)
その他の手数料および報酬(注2)	(11,224.20)	(1,162)
現金および当座借越に係る利息	(83.67)	(9)
<b>費用合計</b>	<b>(653,899.36)</b>	<b>(67,679)</b>
<b>投資純(損)益</b>	<b>294,908.52</b>	<b>30,523</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	1,155,627.86	119,607
金融先物に係る実現(損)益	(12,818.08)	(1,327)
先渡為替契約に係る実現(損)益	1,322,839.67	136,914
スワップに係る実現(損)益	32,971.16	3,413
為替差(損)益	(378,202.76)	(39,144)
<b>実現(損)益合計</b>	<b>2,120,417.85</b>	<b>219,463</b>
<b>当期実現純(損)益</b>	<b>2,415,326.37</b>	<b>249,986</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	2,445,262.24	253,085
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	4,277.37	443
金融先物に係る未実現評価(損)益	852.68	88
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	302,770.09	31,337
スワップに係る未実現評価(損)益	(32,535.56)	(3,367)
<b>未実現評価(損)益の変動合計</b>	<b>2,720,626.82</b>	<b>281,585</b>
<b>運用の結果による純資産の純増(減)</b>	<b>5,135,953.19</b>	<b>531,571</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2020年6月1日 至2020年11月30日

	(米ドル)	(千円)
<b>収 益</b>		
流動資産に係る利息	1,262.28	131
有価証券に係る利息	404,529.74	41,869
スワップに係る受取利息(注1)	7,625.00	789
配当金	242,022.33	25,049
貸付証券に係る収益(注13)	8,205.32	849
その他の収益(注4)	19,824.52	2,052
<b>収益合計</b>	<b>683,469.19</b>	<b>70,739</b>
<b>費 用</b>		
スワップに係る支払利息(注1)	(1.99)	(0)
貸付証券に係るコスト(注13)	(3,282.13)	(340)
定率報酬(注2)	(732,703.02)	(75,835)
年次税(注3)	(11,075.53)	(1,146)
その他の手数料および報酬(注2)	(12,574.06)	(1,301)
現金および当座借越に係る利息	(4,022.28)	(416)
<b>費用合計</b>	<b>(763,659.01)</b>	<b>(79,039)</b>
<b>投資純(損)益</b>	<b>(80,189.82)</b>	<b>(8,300)</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	2,070,689.73	214,316
オプションに係る実現(損)益	377,939.11	39,117
金融先物に係る実現(損)益	(353,376.00)	(36,574)
先渡為替契約に係る実現(損)益	(104,026.53)	(10,767)
スワップに係る実現(損)益	39,574.48	4,096
為替差(損)益	125,795.67	13,020
<b>実現(損)益合計</b>	<b>2,156,596.46</b>	<b>223,208</b>
<b>当期実現純(損)益</b>	<b>2,076,406.64</b>	<b>214,908</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	6,129,441.87	634,397
オプションに係る未実現評価(損)益	(180,277.81)	(18,659)
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	1,734.07	179
金融先物に係る未実現評価(損)益	(75,174.88)	(7,781)
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	163,723.40	16,945
スワップに係る未実現評価(損)益	(39,042.67)	(4,041)
<b>未実現評価(損)益の変動合計</b>	<b>6,000,403.98</b>	<b>621,042</b>
<b>運用の結果による純資産の純増(減)</b>	<b>8,076,810.62</b>	<b>835,950</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2020年6月1日 至2020年11月30日

	(米ドル)	(千円)
<b>収 益</b>		
流動資産に係る利息	13,416.17	1,389
有価証券に係る利息	3,598,922.95	372,489
配当金	938,038.11	97,087
貸付証券に係る収益(注13)	136,408.55	14,118
その他の収益(注4)	328,366.54	33,986
<b>収益合計</b>	<b>5,015,152.32</b>	<b>519,068</b>
<b>費 用</b>		
貸付証券に係るコスト(注13)	(54,563.42)	(5,647)
定率報酬(注2)	(6,527,075.10)	(675,552)
年次税(注3)	(158,346.90)	(16,389)
その他の手数料および報酬(注2)	(109,645.05)	(11,348)
現金および当座借越に係る利息	(40,877.91)	(4,231)
<b>費用合計</b>	<b>(6,890,508.38)</b>	<b>(713,168)</b>
<b>投資純(損)益</b>	<b>(1,875,356.06)</b>	<b>(194,099)</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	12,145,838.12	1,257,094
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	15.22	2
金融先物に係る実現(損)益	(40,980,684.21)	(4,241,501)
先渡為替契約に係る実現(損)益	22,522,015.77	2,331,029
為替差(損)益	3,580,074.83	370,538
<b>実現(損)益合計</b>	<b>(2,732,740.27)</b>	<b>(282,839)</b>
<b>当期実現純(損)益</b>	<b>(4,608,096.33)</b>	<b>(476,938)</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	65,170,739.23	6,745,172
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	16,068.38	1,663
金融先物に係る未実現評価(損)益	33,986,273.99	3,517,579
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	(5,536,563.62)	(573,034)
<b>未実現評価(損)益の変動合計</b>	<b>93,636,517.98</b>	<b>9,691,380</b>
<b>運用の結果による純資産の純増(減)</b>	<b>89,028,421.65</b>	<b>9,214,442</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2020年6月1日 至2020年11月30日

	(米ドル)	(千円)
<b>収 益</b>		
流動資産に係る利息	3.65	0
有価証券に係る利息	1,172,883.42	121,393
配当金	1,392,182.50	144,091
貸付証券に係る収益(注13)	78,972.20	8,174
その他の収益(注4)	117,960.66	12,209
<b>収益合計</b>	<b>2,762,002.43</b>	<b>285,867</b>
<b>費 用</b>		
貸付証券に係るコスト(注13)	(31,588.88)	(3,269)
定率報酬(注2)	(3,290,235.20)	(340,539)
年次税(注3)	(102,366.25)	(10,595)
その他の手数料および報酬(注2)	(52,665.77)	(5,451)
現金および当座借越に係る利息	(29,287.15)	(3,031)
<b>費用合計</b>	<b>(3,506,143.25)</b>	<b>(362,886)</b>
<b>投資純(損)益</b>	<b>(744,140.82)</b>	<b>(77,019)</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	8,159,106.36	844,468
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	501.71	52
金融先物に係る実現(損)益	(34,319,296.70)	(3,552,047)
先渡為替契約に係る実現(損)益	6,607,024.66	683,827
為替差(損)益	2,542,725.93	263,172
<b>実現(損)益合計</b>	<b>(17,009,938.04)</b>	<b>(1,760,529)</b>
<b>当期実現純(損)益</b>	<b>(17,754,078.86)</b>	<b>(1,837,547)</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	51,489,688.14	5,329,183
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	6,089.50	630
金融先物に係る未実現評価(損)益	27,501,301.79	2,846,385
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	(2,223,624.50)	(230,145)
<b>未実現評価(損)益の変動合計</b>	<b>76,773,454.93</b>	<b>7,946,053</b>
<b>運用の結果による純資産の純増(減)</b>	<b>59,019,376.07</b>	<b>6,108,505</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2020年6月1日 至2020年11月30日

	(米ドル)	(千円)
<b>収 益</b>		
流動資産に係る利息	36.44	4
有価証券に係る利息	4,004,437.40	414,459
配当金	3,543,334.84	366,735
貸付証券に係る収益(注13)	295,398.57	30,574
その他の収益(注4)	267,813.01	27,719
<b>収益合計</b>	<b>8,111,020.26</b>	<b>839,491</b>
<b>費 用</b>		
貸付証券に係るコスト(注13)	(118,159.43)	(12,230)
定率報酬(注2)	(13,405,309.52)	(1,387,450)
年次税(注3)	(331,057.27)	(34,264)
その他の手数料および報酬(注2)	(201,501.83)	(20,855)
現金および当座借越に係る利息	(100,182.81)	(10,369)
<b>費用合計</b>	<b>(14,156,210.86)</b>	<b>(1,465,168)</b>
<b>投資純(損)益</b>	<b>(6,045,190.60)</b>	<b>(625,677)</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	33,418,720.95	3,458,838
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	3,214.67	333
金融先物に係る実現(損)益	(103,565,661.43)	(10,719,046)
先渡為替契約に係る実現(損)益	34,087,069.36	3,528,012
為替差(損)益	6,977,031.93	722,123
<b>実現(損)益合計</b>	<b>(29,079,624.52)</b>	<b>(3,009,741)</b>
<b>当期実現純(損)益</b>	<b>(35,124,815.12)</b>	<b>(3,635,418)</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	171,367,294.43	17,736,515
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	21,976.30	2,275
金融先物に係る未実現評価(損)益	82,991,507.52	8,589,621
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	(8,933,292.29)	(924,596)
<b>未実現評価(損)益の変動合計</b>	<b>245,447,485.96</b>	<b>25,403,815</b>
<b>運用の結果による純資産の純増(減)</b>	<b>210,322,670.84</b>	<b>21,768,396</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2020年6月1日 至2020年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	488,867,866.14	50,597,824
発行額	52,638,110.47	5,448,044
買戻額	(81,871,747.90)	(8,473,726)
純発行(買戻)合計	(29,233,637.43)	(3,025,681)
支払配当金	(9,800,706.34)	(1,014,373)
投資純(損)益	(1,146,556.54)	(118,669)
実現(損)益合計	(7,136,757.69)	(738,654)
未実現評価(損)益の変動合計	68,009,878.55	7,039,022
運用の結果による純資産の純増(減)	59,726,564.32	6,181,699
<b>期末現在純資産</b>	<b>509,560,086.69</b>	<b>52,739,469</b>

## 発行済投資証券数の変動表

	自2020年6月1日 至2020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	626,008.1500	
期中発行投資証券数	18,494.2580	
期中買戻投資証券数	(118,388.0700)	
<b>期末現在発行済投資証券数</b>	<b>526,114.3380</b>	
<b>クラスP - m d i s t</b>		
期首現在発行済投資証券数	2,316,940.9420	
期中発行投資証券数	258,876.1420	
期中買戻投資証券数	(283,611.6230)	
<b>期末現在発行済投資証券数</b>	<b>2,292,205.4610</b>	

注記は当財務書類と不可分のものである。

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	2020年6月15日	2020年6月18日	米ドル	0.36
P - m d i s t	2020年7月15日	2020年7月20日	米ドル	0.35
P - m d i s t	2020年8月17日	2020年8月20日	米ドル	0.41
P - m d i s t	2020年9月15日	2020年9月18日	米ドル	0.42
P - m d i s t	2020年10月15日	2020年10月20日	米ドル	0.42
P - m d i s t	2020年11月16日	2020年11月19日	米ドル	0.42

<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	2020年11月30日	2020年5月31日	2019年5月31日
純資産額 (米ドル)		509 560 086.69	488 867 866.14	326 403 802.47
クラス P - a c c	LU1917362490			
発行済投資証券数 (口)		526 114.3380	626 008.1500	369 590.5000
1口当たり純資産価格 (米ドル)		112.51	100.50	101.24
1口当たり発行・買戻価格 (米ドル)		112.51	99.95	101.49
クラス P - m d i s t	LU1917361179			
発行済投資証券数 (口)		2 292 205.4610	2 316 940.9420	1 276 793.6250
1口当たり純資産価格 (米ドル)		102.59	93.87	99.84
1口当たり発行・買戻価格 (米ドル) <sup>1</sup>		102.59	93.35	100.09

<sup>1</sup> 注記1を参照

## 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 百分率 %)	業種別分布表	(純資産に対する 百分率 %)
ルクセンブルグ	32.50	投資信託	51.81
アメリカ合衆国	29.44	インターネット・ソフトウェア・ITサービス	5.46
アイルランド	19.97	国債・中央政府債	4.51
日本	3.38	金融・持株会社	3.40
フランス	2.57	小売り・百貨店	3.18
オーストラリア	2.11	銀行・金融機関	2.71
ドイツ	2.07	コンピュータハードウェア・ネットワーク装置供給業	2.68
イギリス	1.55	医薬品・化粧品・医療品	2.61
オランダ	1.07	電子機器・半導体	2.22
スペイン	1.04	通信	1.78
イタリア	0.55	エネルギー・水道	1.53
フィンランド	0.33	建築業・資材	1.48
ベルギー	0.16	不動産	1.15
オーストリア	0.14	石油	1.06
スイス	0.11	バイオテクノロジー	1.03
ポルトガル	0.07	交通・運輸	0.99
アルゼンチン	0.03	食品・清涼飲料	0.91
バミューダ	0.03	保険	0.87
ジャージー	0.02	化学	0.73
マン島	0.01	自動車	0.71
イスラエル	0.01	機械工学・産業機器	0.70
合計	97.16	その他の消費財	0.58
		その他のサービス業	0.51
		たばこ・アルコール	0.49
		宿泊・仕出し・レジャー	0.42
		繊維・衣服・革製品	0.42
		グラフィックデザイン・出版・メディア	0.41
		航空宇宙産業	0.38
		ヘルスケア・社会福祉	0.37
		鉱業・石炭・鉄鋼	0.33
		基金属・宝石	0.31
		非鉄金属	0.29
		電子部品・デバイス	0.28
		各種貿易会社	0.25
		写真・光学	0.16
		林業・紙・パルプ製品	0.12
		各種資本財	0.10
		その他の非分類会社	0.05
		環境サービス・リサイクル	0.05
		ゴム・タイヤ	0.05
		包装業	0.04
		農業・漁業	0.03
		合計	97.16

## 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2020年6月1日 至2020年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	104,821,036.41	10,848,977
発行額	16,635,727.49	1,721,798
買戻額	(11,014,755.61)	(1,140,027)
純発行(買戻)合計	5,620,971.88	581,771
投資純(損)益	294,908.52	30,523
実現(損)益合計	2,120,417.85	219,463
未実現評価(損)益の変動合計	2,720,626.82	281,585
運用の結果による純資産の純増(減)	5,135,953.19	531,571
<b>期末現在純資産</b>	<b>115,577,961.48</b>	<b>11,962,319</b>

## 発行済投資証券数の変動表

	自2020年6月1日 至2020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	238,985.1700	
期中発行投資証券数	65,291.4020	
期中買戻投資証券数	(39,508.5360)	
<b>期末現在発行済投資証券数</b>	<b>264,768.0360</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	418,030.8880	
期中発行投資証券数	0.0000	
期中買戻投資証券数	(6,023.0220)	
<b>期末現在発行済投資証券数</b>	<b>412,007.8660</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	2020年11月30日	2020年5月31日	2019年5月31日
純資産額 (米ドル)		115 577 961.48	104 821 036.41	153 368 218.52
クラス P - a c c	LU0042745397			
発行済投資証券数 (口)		264 768.0360	238 985.1700	344 431.0760
1口当たり純資産価格 (米ドル)		259.09	250.24	239.06
1口当たり発行・買戻価格 (米ドル) <sup>2</sup>		259.09	250.24	239.06
クラス (日本円・ヘッジ) P - a c c	LU1203193534			
発行済投資証券数 (口)		412 007.8660	418 030.8880	684 496.6580
1口当たり純資産価格 (日本円)		10 545	10 214	9 984
1口当たり発行・買戻価格 (日本円) <sup>2</sup>		10 545	10 214	9 984

<sup>2</sup> 注記1を参照

## 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	52.27		投資信託	50.33	
アメリカ合衆国	23.31		国債・中央政府債	8.13	
カナダ	3.37		金融・持株会社	8.07	
オランダ	2.94		銀行・金融機関	6.48	
ドイツ	2.28		国際機関	6.17	
韓国	1.75		郡・連邦州	3.38	
フランス	1.70		コンピュータハードウェア・ネットワーク装置供給業	3.01	
国際機関	1.44		その他のサービス業	2.05	
オーストラリア	1.16		公共・非営利機関	1.87	
フィリピン	0.92		石油	1.85	
クウェート	0.89		医薬品・化粧品・医療品	1.85	
ノルウェー	0.86		インターネット・ソフトウェア・ITサービス	1.50	
カタール	0.80		小売り・百貨店	1.34	
アラブ首長国連邦	0.78		バイオテクノロジー	0.67	
シンガポール	0.77		その他の消費財	0.20	
ジャージー	0.67		たばこ・アルコール	0.19	
日本	0.44		合計	97.09	
ニュージーランド	0.35				
スウェーデン	0.35				
オーストリア	0.04				
合計	97.09				

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - インカム (米ドル)

	自2020年6月1日 至2020年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	124,799,844.54	12,916,784
発行額	2,722,678.05	281,797
買戻額	(7,584,358.33)	(784,981)
純発行(買戻)合計	(4,861,680.28)	(503,184)
支払配当金	(123,453.56)	(12,777)
投資純(損)益	(80,189.82)	(8,300)
実現(損)益合計	2,156,596.46	223,208
未実現評価(損)益の変動合計	6,000,403.98	621,042
運用の結果による純資産の純増(減)	8,076,810.62	835,950
<b>期末現在純資産</b>	<b>127,891,521.32</b>	<b>13,236,772</b>

## 発行済投資証券数の変動表

クラスP - a c c	自2020年6月1日 至2020年11月30日	
	(口)	
期首現在発行済投資証券数	584,895.7420	
期中発行投資証券数	19,863.9960	
期中買戻投資証券数	(23,755.9780)	
<b>期末現在発行済投資証券数</b>	<b>581,003.7600</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	2020年11月30日	2020年5月31日	2019年5月31日
純資産額 (米ドル)		127 891 521.32	124 799 844.54	137 065 284.80
クラス P - a c c	LU0994951548			
発行済投資証券数 (口)		581 003.7600	584 895.7420	634 957.5850
1口当たり純資産価格 (米ドル)		124.95	117.41	114.74
1口当たり発行・買戻価格 (米ドル) <sup>1</sup>		124.95	117.41	114.74

<sup>1</sup> 注記1を参照

## 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	67.30		投資信託	68.84	
アメリカ合衆国	15.52		国債・中央政府債	7.82	
アイルランド	2.53		国際機関	4.12	
オランダ	1.68		金融・持株会社	3.90	
カナダ	1.61		銀行・金融機関	2.91	
フィリピン	1.12		コンピュータハードウェア・ネットワーク装置供給業	2.33	
オーストラリア	1.01		郡・連邦州	1.60	
韓国	0.95		インターネット・ソフトウェア・ITサービス	1.23	
カタール	0.87		石油	1.20	
ドイツ	0.84		その他のサービス業	0.95	
国際機関	0.72		医薬品・化粧品・医療品	0.78	
クウェート	0.71		小売り・百貨店	0.64	
シンガポール	0.43		バイオテクノロジー	0.23	
アラブ首長国連邦	0.35		たばこ・アルコール	0.17	
日本	0.34		合計	96.72	
ノルウェー	0.31				
フランス	0.27				
ニュージーランド	0.16				
合計	96.72				

## 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2020年6月1日 至2020年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	1,089,453,896.73	112,758,478
発行額	73,018,734.05	7,557,439
買戻額	(166,073,431.48)	(17,188,600)
純発行(買戻)合計	(93,054,697.43)	(9,631,161)
支払配当金	(3,125,195.72)	(323,458)
投資純(損)益	(1,875,356.06)	(194,099)
実現(損)益合計	(2,732,740.27)	(282,839)
未実現評価(損)益の変動合計	93,636,517.98	9,691,380
運用の結果による純資産の純増(減)	89,028,421.65	9,214,442
<b>期末現在純資産</b>	<b>1,082,302,425.23</b>	<b>112,018,301</b>

## 発行済投資証券数の変動表

クラスP - a c c	自2020年6月1日 至2020年11月30日	
	(口)	
期首現在発行済投資証券数	3,251,483.0880	
期中発行投資証券数	199,525.4350	
期中買戻投資証券数	(455,456.2040)	
<b>期末現在発行済投資証券数</b>	<b>2,995,552.3190</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	2020年11月30日	2020年5月31日	2019年5月31日
純資産額(米ドル)		1 082 302 425.23	1 089 453 896.73	1 087 131 873.23
クラス P - a c c	LU1599185649			
発行済投資証券数(口)		2 995 552.3190	3 251 483.0880	3 109 847.0700
1口当たり純資産価格(米ドル)		112.46	106.66	105.81
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) <sup>1</sup>		112.46	105.86	106.02

<sup>1</sup> 注記1を参照

## 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	43.13		イタリア	0.36	
アメリカ合衆国	17.07		国際機関	0.34	
アイルランド	14.22		シンガポール	0.34	
カナダ	4.33		フィンランド	0.17	
スイス	3.02		ジャージー	0.17	
フランス	2.47		サウジアラビア	0.17	
ドイツ	2.34		ベルギー	0.16	
オランダ	1.72		イギリス	0.13	
韓国	1.60		ケイマン諸島	0.11	
オーストラリア	0.94		スウェーデン	0.08	
カタール	0.76		オーストリア	0.07	
フィリピン	0.68		ニュージーランド	0.07	
ノルウェー	0.60		デンマーク	0.04	
アラブ首長国連邦	0.46		ポルトガル	0.03	
クウェート	0.46		英領ヴァージン諸島	0.02	
日本	0.43		合計	96.91	
スペイン	0.42				

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	52.04	建築業・資材	0.30
金融・持株会社	8.64	自動車	0.27
国債・中央政府債	7.77	電子部品・デバイス	0.27
銀行・金融機関	5.02	バイオテクノロジー	0.26
国際機関	3.62	その他の消費財	0.21
インターネット・ソフトウェア・ITサービス	2.23	不動産	0.20
医薬品・化粧品・医療品	2.15	モーゲージ・資金調達機関	0.16
石油	1.97	基金属・宝石	0.14
郡・連邦州	1.88	機械工学・産業機器	0.13
コンピュータハードウェア・ネットワーク装置供給業	1.82	航空宇宙産業	0.12
小売り・百貨店	0.93	各種資本財	0.11
食品・清涼飲料	0.90	時計・宝飾品	0.11
その他のサービス業	0.89	鉱業・石炭・鉄鋼	0.11
エネルギー・水道	0.81	グラフィックデザイン・出版・メディア	0.06
保険	0.64	林業・紙・パルプ製品	0.04
化学	0.63	ゴム・タイヤ	0.04
交通・運輸	0.45	農業・漁業	0.04
たばこ・アルコール	0.43	宿泊・仕出し・レジャー	0.04
公共・非営利機関	0.37	その他の非分類会社	0.03
通信	0.37	非鉄金属	0.02
電子機器・半導体	0.36	ヘルスケア・社会福祉	0.01
繊維・衣服・革製品	0.32	合計	96.91

## 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2020年6月1日 至2020年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	490,288,568.55	50,744,867
発行額	18,186,304.09	1,882,282
買戻額	(97,757,299.78)	(10,117,881)
純発行(買戻)合計	(79,570,995.69)	(8,235,598)
支払配当金	(408,504.22)	(42,280)
投資純(損)益	(744,140.82)	(77,019)
実現(損)益合計	(17,009,938.04)	(1,760,529)
未実現評価(損)益の変動合計	76,773,454.93	7,946,053
運用の結果による純資産の純増(減)	59,019,376.07	6,108,505
<b>期末現在純資産</b>	<b>469,328,444.71</b>	<b>48,575,494</b>

## 発行済投資証券数の変動表

クラス P - a c c	自2020年6月1日 至2020年11月30日	
	(口)	
期首現在発行済投資証券数	1,456,136.2970	
期中発行投資証券数	51,530.8860	
期中買戻投資証券数	(328,241.1530)	
<b>期末現在発行済投資証券数</b>	<b>1,179,426.0300</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	2020年11月30日	2020年5月31日	2019年5月31日
純資産額 (米ドル)		469 328 444.71	490 288 568.55	531 905 248.10
クラス P - a c c	LU1599187934			
発行済投資証券数 (口)		1 179 426.0300	1 456 136.2970	1 335 014.9300
1口当たり純資産価格 (米ドル)		115.22	104.88	108.42
1口当たり発行・買戻価格 (米ドル) <sup>1</sup>		115.22	104.88	108.42

<sup>1</sup> 注記1を参照

## 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)

## 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	34.26	国際機関	0.37
ルクセンブルグ	14.88	シンガポール	0.36
アメリカ合衆国	9.86	ノルウェー	0.35
日本	5.62	フィンランド	0.31
カナダ	4.70	クウェート	0.29
イギリス	4.02	ベルギー	0.28
フランス	3.80	ジャージー	0.24
ドイツ	3.54	サウジアラビア	0.13
スイス	2.99	ニュージーランド	0.11
オーストラリア	2.93	オーストリア	0.10
オランダ	2.58	スウェーデン	0.09
韓国	1.15	英領ヴァージン諸島	0.07
スペイン	0.76	ケイマン諸島	0.07
フィリピン	0.68	ポルトガル	0.05
イタリア	0.64	デンマーク	0.05
アラブ首長国連邦	0.46	マン島	0.02
カタール	0.42	パプアニューギニア	0.01
		合計	96.19

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	45.89		機械工学・産業機器	0.56	
金融・持株会社	7.57		電子部品・デバイス	0.53	
銀行・金融機関	6.58		鉱業・石炭・鉄鋼	0.49	
医薬品・化粧品・医療品	3.19		その他の消費財	0.47	
国際機関	2.97		バイオテクノロジー	0.46	
国債・中央政府債	2.82		非鉄金属	0.35	
インターネット・ソフトウェア・ITサービス	2.40		公共・非営利機関	0.34	
石油	1.94		グラフィックデザイン・出版・メディア	0.34	
電子機器・半導体	1.63		基金属・宝石	0.31	
エネルギー・水道	1.43		航空宇宙産業	0.29	
食品・清涼飲料	1.38		宿泊・仕出し・レジャー	0.24	
郡・連邦州	1.37		各種貿易会社	0.23	
コンピュータハードウェア・ネットワーク装置供給業	1.29		各種資本財	0.20	
保険	1.25		モーゲージ・資金調達機関	0.18	
小売り・百貨店	1.19		林業・紙・パルプ製品	0.12	
化学	1.16		時計・宝飾品	0.11	
通信	0.94		ゴム・タイヤ	0.10	
たばこ・アルコール	0.94		ヘルスケア・社会福祉	0.09	
自動車	0.91		その他の非分類会社	0.07	
その他のサービス業	0.90		農業・漁業	0.06	
交通・運輸	0.85		写真・光学	0.04	
建築業・資材	0.72		包装業	0.02	
不動産	0.65		合計	96.19	
繊維・衣服・革製品	0.62				

## 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2020年6月1日 至2020年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	2,011,788,426.80	208,220,102
発行額	69,365,745.63	7,179,355
買戻額	(337,351,094.05)	(34,915,838)
純発行(買戻)合計	(267,985,348.42)	(27,736,484)
支払配当金	(5,147,609.68)	(532,778)
投資純(損)益	(6,045,190.60)	(625,677)
実現(損)益合計	(29,079,624.52)	(3,009,741)
未実現評価(損)益の変動合計	245,447,485.96	25,403,815
運用の結果による純資産の純増(減)	210,322,670.84	21,768,396
<b>期末現在純資産</b>	<b>1,948,978,139.54</b>	<b>201,719,237</b>

## 発行済投資証券数の変動表

クラスP - a c c	自2020年6月1日 至2020年11月30日	
	(口)	
期首現在発行済投資証券数	5,432,559.8130	
期中発行投資証券数	210,160.9350	
期中買戻投資証券数	(818,577.7830)	
<b>期末現在発行済投資証券数</b>	<b>4,824,142.9650</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	2020年11月30日	2020年5月31日	2019年5月31日
純資産額(米ドル)		1 948 978 139.54	2 011 788 426.80	2 120 118 601.72
クラス P - a c c	LU1599186969			
発行済投資証券数(口)		4 824 142.9650	5 432 559.8130	5 559 346.9120
1口当たり純資産価格(米ドル)		114.11	105.57	107.15
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) <sup>1</sup>		114.11	105.57	107.15

<sup>1</sup> 注記1を参照

## 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)

## 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	34.94		アラブ首長国連邦	0.33	
アイルランド	25.36		カタール	0.25	
アメリカ合衆国	10.82		フィンランド	0.24	
カナダ	4.39		シンガポール	0.24	
日本	3.44		ベルギー	0.22	
スイス	3.05		国際機関	0.21	
フランス	3.01		サウジアラビア	0.11	
ドイツ	2.70		ジャージー	0.11	
イギリス	2.05		ケイマン諸島	0.09	
オランダ	1.89		スウェーデン	0.08	
韓国	0.93		オーストリア	0.08	
フィリピン	0.60		ニュージーランド	0.05	
オーストラリア	0.60		ポルトガル	0.04	
スペイン	0.59		英領ヴァージン諸島	0.04	
イタリア	0.51		デンマーク	0.02	
クウェート	0.35		マン島	0.01	
ノルウェー	0.34		合計	97.69	

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	56.11		電子部品・デバイス	0.43	
金融・持株会社	6.86		不動産	0.39	
国債・中央政府債	5.45		機械工学・産業機器	0.37	
銀行・金融機関	4.33		その他の消費財	0.26	
医薬品・化粧品・医療品	2.64		バイオテクノロジー	0.23	
国際機関	2.47		鉱業・石炭・鉄鋼	0.22	
インターネット・ソフトウェア・ITサービス	1.80		基金属・宝石	0.21	
石油	1.53		航空宇宙産業	0.21	
食品・清涼飲料	1.14		グラフィックデザイン・出版・メディア	0.21	
電子機器・半導体	1.10		公共・非営利機関	0.18	
郡・連邦州	1.09		非鉄金属	0.17	
コンピュータハードウェア・ネットワーク装置供給業	1.08		各種資本財	0.16	
エネルギー・水道	1.08		モーゲージ・資金調達機関	0.15	
保険	0.96		宿泊・仕出し・レジャー	0.14	
小売り・百貨店	0.92		各種貿易会社	0.13	
化学	0.92		時計・宝飾品	0.11	
その他のサービス業	0.74		林業・紙・パルプ製品	0.09	
通信	0.68		ゴム・タイヤ	0.07	
自動車	0.66		その他の非分類会社	0.06	
交通・運輸	0.62		農業・漁業	0.06	
たばこ・アルコール	0.62		ヘルスケア・社会福祉	0.03	
建築業・資材	0.51		写真・光学	0.02	
繊維・衣服・革製品	0.48		合計	97.69	

## UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

## 財務書類に対する注記

2020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。

## 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。派生商品进行评估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。

報酬および手数料ならびに投資対象の売買スプレッドにより、サブ・ファンドの資産および投資対象の売買にかかる実際の費用は、直近で取得可能な価格、または該当する場合には投資証券1口当たり純資産価格の計算に使用される純資産価額と異なる場合がある。これらの費用は、サブ・ファンドの価額にマイナスの影響を与え、「希薄化」と呼ばれる。取締役会は、希薄化の影響を軽減するため、自らの裁量により、投資証券1口当たり純資産価格に対して希薄化の調整を行うことができる。

投資証券は、通常、単一価格すなわち純資産価格に基づき発行され、買い戻される。それにもかかわらず、希薄化の影響を軽減するために、投資証券1口当たり純資産価格は、以下に述べる通り、評価日に調整される。これは、サブ・ファンドが該当する評価日において正味発行または正味買戻ポジションにあるかどうかにかかわらず行われる。特定の評価日にサブ・ファンドまたはサブ・ファンドのクラスで取引が行われていない場合、未調整の投資証券1口当たり純資産価格が適用される。そのような希薄化の調整が行われるような状況は、取締役会の裁量で決定される。希薄化の調整を行うための要件は、一般的に、関連するサブ・ファンドの投資証券の発行または買戻しの規模に依拠する。取締役会は、その見解において、既存の投資主(発行の場合)または残りの投資主(買戻しの場合)が、希薄化の調整をしなければ不利になる可能性がある場合、希薄化の調整を適用する可能性がある。希薄化の調整は、以下の場合に行われる可能性がある。

- ( a ) サブ・ファンドが、一定して下落(すなわち、買戻しによる純流出)を記録する場合
- ( b ) サブ・ファンドが、その規模に比して相当量の正味発行を記録する場合
- ( c ) サブ・ファンドが、特定の評価日における正味発行ポジションまたは正味買戻ポジションを示す場合
- ( d ) 取締役会が投資主の利益のために希薄化の調整が必要であると考え他のすべての場合

評価の調整が行われる場合、サブ・ファンドが正味発行ポジションまたは正味買戻ポジションにあるかどうかに応じて、投資証券1口当たり純資産価格は増額または減額される。評価の調整の範囲は、取締役会の意見により、報酬および手数料ならびに売買スプレッドを適切にカバーするものとする。特に、それぞれのサブ・ファンドの純資産価格は、( )見積税金費用を反映した金額、( )サブ・ファンドが負担する可能性のある取引費用、および( )サブ・ファンドが投資する資産の見積買値・売値スプレッドを反映した金額が(上方または下方に)調整される。株式市場および国によっては、買い手側と売り手側に異なる報酬体系を示すことがあり、純流入と純流出の調整が異なる可能性がある。調整は、通常、その時点での投資証券1口当たり純資産価格の2%を上限とする。例外的な状況(例:市場のボラティリティおよび/または流動性の低い場合、異常な市況、市場の混乱など)の下では、取締役会は、いずれかのサブ・ファンドおよび/または評価日に関して、その時点での投資証券1口当たり純資産価格の2%を超える希薄化の調整を一時的に適用することを決定することができるが、これはその時点の市況を表わすものであり、投資主にとって最善の利益であることを取締役会が正当化できることを条件とする。この希薄化の調整は、取締役会によって決定された方法に従って計算される。投資主は、一時的措置が導入された時点およびその一時的措置が終了した時点で通常用いられている連絡経路を通じて通知を受ける。

サブ・ファンドの各クラスの純資産価額は別々に計算される。しかし、希薄化の調整は、各クラスの純資産価額にパーセント単位で同程度の影響を与える。希薄化の調整は、サブ・ファンドのレベルで行われ、資本取引に関係するが、個々の投資者取引の特殊な状況には関係しない。

スイング・プライシングの技法は、すべてのサブ・ファンドに適用される。

期末現在の純資産価額に対するスイング・プライシングの調整があった場合、サブ・ファンドの3年度比較数値の純資産価額の情報から参照することができる。1口当たり発行・買戻価格は調整済みの純資産価格を表す。

#### 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、運用計算書に記載される。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) オプションの評価

規制ある市場で取引される未決済オプションは、決済価格または当該商品の入手可能な直近の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るオプション(店頭オプション)は、ブルームバーグのOV(オプション評価)から入手した日足価格に基づき値洗いされ、第三者値付機関と照合される。オプションに係る実現損益およびオプションに係る未実現評価損益は、オプションに係る実現(損)益およびオプションに係る未実現評価(損)益のポジションに基づき、それぞれ運用計算書および純資産変動計算書に開示される。

オプションは投資有価証券に含まれる。

f) 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。

g) 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で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。

h) 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。

i) 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。

j) 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2020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、2020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 = 1.082920 スイス・フラン

1ユーロ = 1.196200 米ドル

償還または合併したサブ・ファンドについて、連結財務書類の換算に使用された為替レートは、償還日または合併日現在のものである。

k) 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。

l) 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。

m) 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
-------------

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
-------------

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 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 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。

- 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。

この報酬は「定率報酬」として運用計算書に表示される。

- 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。

これらの手数料および報酬は、「その他の手数料および報酬」として運用計算書に表示される。

### 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。

資産運用目的で投資証券クラス「K-B」に対し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・ジーまたはその承認された販売会社の一社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。

#### 注6 - ソフト・コミッション契約

2020年6月1日から2020年11月30日までの会計期間中に、UBS (Lux) ストラテジー・シキャブのために締結された「ソフト・コミッション契約」はなく、「ソフト・コミッション契約」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

2020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)
- フィクスト・インカム (米ドル)	4 624 409.95 米ドル	- 米ドル
- インカム (米ドル)	2 623 593.75 米ドル	5 167 281.25 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)	220 851.56 米ドル	107 547 218.75 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	93 752 562.43 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	293 008 265.48 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)	7 794 060.16 米ドル	7 429 372.25 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)	124 377 487.14 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)	106 749 457.68 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)	314 713 041.23 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)	22 322 813.19 米ドル
- インカム (米ドル)	590 684.96 米ドル

##### c) スワップ

## 指数に係るスワップおよび先渡しスワップ

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ	(購入)	(売却)
- ダイナミック・インカム(米ドル)	- 米ドル	22 120 626.29 米ドル

## 注8 - 総費用比率(TEER)

この比率は、スイス・アセット・マネジメント協会(AMAS)およびスイス・ファンド資産運用協会(FAMA)の「TEER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TEER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(TEER)
- ダイナミック・インカム(米ドル) P - a c c	1.43%
- ダイナミック・インカム(米ドル) P - m d i s t	1.43%
- フィクスト・インカム(米ドル) P - a c c	1.08%
- フィクスト・インカム(米ドル)(日本円・ヘッジ) P - a c c	1.13%
- インカム(米ドル) P - a c c	1.27%
- 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	1.52%
- 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	1.78%
- 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	1.68%

通貨ヘッジに関連して発生した取引費用、利息費用、貸付証券費用およびその他の費用は、TEER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TEER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。

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)

2020年3月17日以降、ファンドは参加していない。

#### 注10 - 合併

以下の合併が生じた。

サブ・ファンド	合併先	日付
UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - フィクスト・インカム(スイス・フラン)	UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - インカム(スイス・フラン)	2020年11月6日

#### 注11 - 制御不能な事象

2020年3月、世界保健機関はCOVID-19の感染拡大をパンデミックと宣言した。ワクチンの継続的な開発を含め、パンデミックに対する措置については2020年末に向けて進展が見られたものの、このパンデミックが世界的にも地域的にもどの程度の期間や深刻さで経済に影響を与えるかは依然として不透明である。このことは、本投資法人の資産価格のボラティリティーや、本報告書で取り上げる資産の評価に関し、継続的な不確実性を引き起こしている。

本投資法人の財務書類を作成するに当たり、取締役会によってなされた継続企業的前提が不適切であるという証拠はない。

#### 注12 - 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13 - 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。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ	2020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		2020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)	55 608 086.57 米ドル	58 832 207.40 米ドル	33.76	66.24	0.00
- フィクスト・インカム(米ドル)	15 955 188.43 米ドル	16 880 259.92 米ドル	33.76	66.24	0.00
- インカム(米ドル)	10 007 840.36 米ドル	10 588 088.46 米ドル	33.76	66.24	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)	109 157 790.99 米ドル	115 486 688.98 米ドル	33.76	66.24	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)	39 696 302.28 米ドル	41 997 868.16 米ドル	33.76	66.24	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)	166 427 323.58 米ドル	176 076 671.97 米ドル	33.76	66.24	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)

## 2020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 AFTERPAY LTD NPV	1 312.00	91 850.65	0.02
AUD AGL ENERGY NPV	71 745.00	713 681.59	0.14
AUD AMP LIMITED NPV(POST RECON)	18 239.00	22 981.39	0.00
AUD APA GROUP NPV	7 579.00	57 800.47	0.01
AUD ARISTOCRAT LEISURE NPV	8 783.00	207 484.42	0.04
AUD ASX LTD NPV	1 264.00	71 818.59	0.01
AUD AURIZON HOLDINGS NPV	13 143.00	41 158.78	0.01
AUD AUSNET SERVICES NPV	12 564.00	17 173.19	0.00
AUD AUST & NZ BANK GRP NPV	16 810.00	280 429.19	0.06
AUD BLUESCOPE STEEL NPV	2 536.00	31 953.94	0.01
AUD BRAMBLES LTD NPV	9 031.00	72 933.24	0.01
AUD CIMIC GROUP LTD NPV	688.00	12 962.78	0.00
AUD CMNWLTH BK OF AUST NPV	10 418.00	606 981.12	0.12
AUD COCA-COLA AMATIL NPV	2 873.00	26 779.67	0.00
AUD COCHLEAR LTD NPV	425.00	69 027.00	0.01
AUD COMPUTERSHARE LTD NPV(POST REC)	2 623.00	27 599.78	0.01
AUD CROWN RESORTS LTD NPV	2 241.00	15 918.35	0.00
AUD CSL NPV	2 673.00	585 719.66	0.11
AUD DEXUS NPV (STAPLED)	5 548.00	39 940.19	0.01
AUD EVOLUTION MINING NPV	9 914.00	36 306.50	0.01
AUD FORTESCUE METALS G NPV	76 504.00	1 027 661.06	0.20
AUD GOODMAN GROUP (STAPLED SECURITY)	9 442.00	129 963.07	0.03
AUD GPT GROUP NPV (STAPLED SECURITIES)	11 712.00	40 733.54	0.01
AUD INSURANCE AUST GRP NPV	13 751.00	52 181.99	0.01
AUD LEND LEASE GROUP NPV	3 948.00	41 192.63	0.01
AUD MACQUARIE GP LTD NPV	2 025.00	206 912.45	0.04
AUD MAGELLAN FINANCIAL NPV	697.00	30 393.93	0.01
AUD MEDIBANK PRIVATE L NPV	16 619.00	34 900.27	0.01
AUD MIRVAC GROUP STAPLED SECURITIES	22 449.00	42 677.19	0.01
AUD NATL AUSTRALIA BK NPV	18 818.00	317 393.73	0.06
AUD NEWCREST MINING NPV	4 864.00	96 518.15	0.02
AUD NTHN STAR RES LTD NPV	4 039.00	37 529.09	0.01
AUD ORICA LIMITED NPV	2 918.00	34 724.57	0.01
AUD ORIGIN ENERGY NPV	10 672.00	40 733.78	0.01
AUD QANTAS AIRWAYS NPV	6 554.00	25 981.71	0.01
AUD QBE INS GROUP NPV	7 663.00	56 464.82	0.01
AUD RAMSAY HEALTH CARE NPV	1 197.00	55 610.70	0.01
AUD REA GROUP LIMITED NPV	397.00	42 486.98	0.01
AUD RIO TINTO LIMITED NPV	13 620.00	1 017 639.96	0.20
AUD SANTOS LIMITED NPV	10 827.00	49 143.71	0.01
AUD SCENTRE GROUP NPV STAPLED UNIT	30 014.00	61 924.28	0.01
AUD SEEK LIMITED NPV	1 816.00	34 858.02	0.01
AUD SONIC HEALTHCARE NPV	13 039.00	316 480.51	0.06
AUD SOUL PATTINSON(WH) NPV	396.00	8 473.66	0.00
AUD SOUTH32 LTD NPV	27 246.00	48 182.92	0.01
AUD STOCKLAND NPV (STAPLED)	234 733.00	786 981.70	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 - 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 SUNCORP GROUP LTD NPV	6 374.00	47 389.52	0.01
AUD SYDNEY AIRPORT NPV(STAPLED SECURITY)	6 690.00	33 077.12	0.01
AUD TABCORP HLDGS LTD NPV	10 125.00	28 648.73	0.01
AUD TELSTRA CORP NPV	218 262.00	493 736.91	0.10
AUD TRANSURBAN GROUP STAPLED UNITS NPV	16 279.00	168 172.44	0.03
AUD TREASURY WINE ESTA NPV	3 922.00	24 824.46	0.00
AUD VICINITY CENTRES NPV (STAPLED SECURITY)	20 759.00	25 238.84	0.00
AUD WESFARMERS LTD NPV	6 833.00	248 975.61	0.05
AUD WESTPAC BKG CORP NPV	21 162.00	313 891.51	0.06
AUD WISETECH GLOBAL LT NPV	778.00	17 714.02	0.00
AUD WOODSIDE PETROLEUM NPV	6 145.00	101 290.09	0.02
AUD WOOLWORTHS GRP LTD NPV	7 240.00	197 280.68	0.04
オーストラリア合計		9 368 484.85	1.84
オーストリア			
EUR ANDRITZ AG NPV(BR)	275.00	11 625.27	0.00
EUR ERSTE GROUP BK AG NPV	1 719.00	49 556.05	0.01
EUR OMV AG NPV(VAR)	17 555.00	596 379.86	0.12
EUR RAIFFEISEN BK INTL NPV (REGD)	919.00	17 654.88	0.00
EUR VERBUND AG CLASS 'A' NPV	354.00	24 920.31	0.01
EUR VOESTALPINE AG NPV	653.00	20 965.22	0.00
オーストリア合計		721 101.59	0.14
ベルギー			
EUR ANHEUSER-BUSCH IN NPV	3 912.00	261 492.38	0.05
EUR COLRUYT SA NPV	304.00	18 189.51	0.00
EUR ELIA SYS OPERATOR NPV	132.00	14 968.77	0.00
EUR GALAPAGOS NV NPV	196.00	24 184.05	0.01
EUR GPE BRUXELLES LAM NPV	558.00	54 519.73	0.01
EUR PROXIMUS SA NPV	1 095.00	22 935.28	0.00
EUR SOFINA NPV	86.00	27 364.27	0.01
EUR SOLVAY SA NPV	403.00	46 201.45	0.01
EUR UMICORE NPV	892.00	40 087.58	0.01
ベルギー合計		509 943.02	0.10
バミューダ			
USD MARVELL TECH GROUP COM USDO.002	1 638.00	75 823.02	0.01
バミューダ合計		75 823.02	0.01
カナダ			
USD WASTE CONNECTIONS COM NPV (POST REV SPLT)	657.00	68 314.86	0.01
カナダ合計		68 314.86	0.01
フィンランド			
EUR KESKO OYJ EUR2 SER 'B'	230.00	6 052.77	0.00
EUR KONE CORPORATION NPV ORD 'B'	1 797.00	151 157.86	0.03
EUR WARTSILA OYJ ABP SER 'B' EUR3.50	2 360.00	22 251.14	0.01
フィンランド合計		179 461.77	0.04
フランス			
EUR ACCOR EUR3	809.00	27 822.12	0.01
EUR ADP EUR3	159.00	20 141.74	0.00
EUR AIR LIQUIDE(L') EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)	2 377.00	391 389.52	0.08
EUR AIRBUS EUR1	3 031.00	318 081.10	0.06
EUR ALSTOM EUR7.00	863.00	46 144.73	0.01
EUR AMUNDI EUR2.5 (AIW)	342.00	27 327.91	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 (%)
EUR ARKEMA EUR10	325.00	37 990.12	0.01
EUR ATOS SE EUR1	5 234.00	481 338.82	0.09
EUR AXA EUR2.29	9 538.00	224 901.22	0.04
EUR BIOMERIEUX NPV (POST SPLIT)	214.00	30 923.21	0.01
EUR BNP PARIBAS EUR2	15 841.00	814 143.97	0.16
EUR BOLLORE EURO.16	4 362.00	16 978.80	0.00
EUR BOUYGUES EUR1	1 313.00	52 426.98	0.01
EUR BUREAU VERITAS EURO.12	1 283.00	33 211.44	0.01
EUR CAPGEMINI EUR8	839.00	116 720.05	0.02
EUR CARREFOUR EUR2.50	25 590.00	420 285.71	0.08
EUR CIE DE ST-GOBAIN EUR4	20 862.00	993 713.05	0.20
EUR CNP ASSURANCES EUR1	25 890.00	413 444.40	0.08
EUR COVIVIO EUR3	214.00	17 535.10	0.00
EUR CREDIT AGRICOLE SA EUR3	5 639.00	65 254.73	0.01
EUR DANONE EURO.25	3 074.00	198 049.62	0.04
EUR DASSAULT AVIATION EUR8	16.00	16 555.41	0.00
EUR DASSAULT SYSTEMES EURO.50	685.00	127 047.50	0.03
EUR EDENRED EUR2	1 300.00	74 534.03	0.01
EUR EDF EURO.5	3 305.00	50 268.01	0.01
EUR EIFFAGE EUR4	5 233.00	514 172.96	0.10
EUR ENGIE EUR1	41 801.00	618 529.15	0.12
EUR ESSILORLUXOTTICA EURO.18	1 431.00	207 722.34	0.04
EUR EURAZEO NPV	237.00	14 656.92	0.00
EUR FAURECIA EUR7	548.00	27 335.08	0.01
EUR GETLINK SE EURO.40	1 917.00	31 988.96	0.01
EUR HERMES INTL NPV	153.00	149 599.40	0.03
EUR ICADE NPV	77.00	5 706.05	0.00
EUR ILIAD NPV	79.00	16 083.87	0.00
EUR INGENICO GROUP EUR1	221.00	33 520.87	0.01
EUR IPSEN EUR1	145.00	14 023.35	0.00
EUR JC DECAUX SA NPV	7.00	157.75	0.00
EUR KERING EUR4	375.00	271 387.87	0.05
EUR KLEPIERRE EUR1.40	1 348.00	29 830.84	0.01
EUR L'OREAL EURO.20	1 274.00	467 550.56	0.09
EUR LEGRAND SA EUR4	1 348.00	114 453.66	0.02
EUR LVMH MOET HENNESSY EURO.30	1 414.00	816 790.00	0.16
EUR NATIXIS EUR1.6	166 936.00	515 197.22	0.10
EUR ORANGE EUR4	9 311.00	117 949.49	0.02
EUR ORPEA EUR2.5	256.00	32 092.61	0.01
EUR PERNOD RICARD EUR1.55	1 064.00	203 641.09	0.04
EUR PEUGEOT SA EUR1	6 950.00	164 318.11	0.03
EUR PUBLICIS GROUPE SA EURO.40	1 029.00	46 884.59	0.01
EUR REMY COINTREAU EUR1.60	133.00	23 705.10	0.00
EUR RENAULT SA EUR3.81	863.00	34 433.06	0.01
EUR SAFRAN EURO.20	1 603.00	234 511.30	0.05
EUR SANOFI EUR2	9 767.00	989 691.11	0.19
EUR SARTORIUS STEDIM B EURO.20 (POST SUBD)	144.00	52 192.60	0.01
EUR SCHNEIDER ELECTRIC EUR8	2 746.00	383 167.86	0.08
EUR SCOR SE EUR7.876972 (POST CONS)	722.00	24 735.12	0.01
EUR SEB SA EUR1	116.00	20 702.87	0.00
EUR SOC GENERALE EUR1.25	4 318.00	86 186.39	0.02
EUR SODEXO EUR4	394.00	32 689.56	0.01
EUR SUEZ EUR4	1 739.00	33 563.90	0.01
EUR TELEPERFORMANCE EUR2.50	292.00	97 521.88	0.02
EUR THALES EUR3	617.00	56 874.55	0.01
EUR TOTAL SE EUR2.5	12 572.00	538 758.79	0.11
EUR UBISOFT ENTERTAIN EURO.31	511.00	48 766.18	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 (%)
EUR UNIBAIL-RODAMCO-WE NPV(1 ORD UNIBAIL-R & 1CLS)	920.00	65 479.99	0.01
EUR VALEO EUR1 (POST SUBD)	1 156.00	44 968.89	0.01
EUR VEOLIA ENVIRONNEME EUR5	12 805.00	295 011.99	0.06
EUR VINCI EUR2.50	2 578.00	263 665.21	0.05
EUR VIVENDI SA EUR5.50	3 976.00	119 758.38	0.02
EUR WENDEL EUR4	167.00	18 927.77	0.00
EUR WORLDLINE EURO.68	717.00	66 469.84	0.01
<b>フランス合計</b>		<b>12 961 604.37</b>	<b>2.54</b>
<b>ドイツ</b>			
EUR BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG EUR1	1 671.00	145 996.02	0.03
EUR BEIERSDORF AG NPV	494.00	55 393.10	0.01
EUR CARL ZEISS MEDITEC NPV	244.00	32 631.38	0.01
EUR COMMERZBANK AG NPV	6 188.00	38 564.87	0.01
EUR CONTINENTAL AG ORD NPV	566.00	77 319.02	0.01
EUR COVESTRO AG NPV	885.00	49 491.28	0.01
EUR DEUTSCHE WOHNEN AG NPV (BR)	1 832.00	92 128.07	0.02
EUR FRAPORT AG NPV	213.00	12 122.94	0.00
EUR FRESENIUS MED CARE NPV	1 057.00	89 139.03	0.02
EUR FRESENIUS SE & CO. KGAA NPV	2 161.00	96 937.06	0.02
EUR GEA GROUP AG NPV	5 700.00	195 754.54	0.04
EUR HEIDELBERGCEMENT NPV	7 050.00	502 113.32	0.10
EUR HENKEL AG & CO KGAA	448.00	43 354.12	0.01
EUR HOCHTIEF AG NPV	1 388.00	134 320.34	0.03
EUR KION GROUP AG NPV	362.00	27 904.09	0.00
EUR KNORR BREMSE AG NPV	395.00	50 689.69	0.01
EUR LANXESS AG NPV	494.00	34 663.53	0.01
EUR MERCK KGAA NPV	622.00	99 589.27	0.02
EUR METRO AG (NEW) NPV	426.00	3 903.39	0.00
EUR NEMETSCHEK SE ORD NPV	344.00	27 281.97	0.00
EUR PUMA SE NPV	508.00	50 655.34	0.01
EUR RATIONAL AG NPV	7.00	6 238.18	0.00
EUR RIWE AG (NEU) NPV	3 223.00	134 050.61	0.03
EUR SAP AG ORD NPV	5 328.00	649 954.60	0.13
EUR SYMRISE AG NPV (BR)	676.00	84 906.28	0.02
EUR TEAMVIEWER AG NPV	820.00	39 166.70	0.01
EUR THYSSENKRUPP AG NPV	2 375.00	15 915.14	0.00
EUR VOLKSWAGEN AG ORD NPV	164.00	30 505.49	0.00
EUR ZALANDO SE NPV	764.00	77 498.45	0.01
<b>ドイツ合計</b>		<b>2 898 187.82</b>	<b>0.57</b>
<b>アイルランド</b>			
GBP DCC ORD EURO.25	227.00	17 219.66	0.00
EUR FLUTTER ENTERTAINM ORD EURO.09	724.00	134 670.59	0.03
EUR KERRY GROUP 'A' ORD EURO.125(DUBLIN LIST)	725.00	101 814.56	0.02
USD SEAGATE TECH PLC COM USD0.00001	8 792.00	517 057.52	0.10
<b>アイルランド合計</b>		<b>770 762.33</b>	<b>0.15</b>
<b>イスラエル</b>			
USD SOLAREEDGE TECHNOLO USD0.0001	89.00	24 740.22	0.00
<b>イスラエル合計</b>		<b>24 740.22</b>	<b>0.00</b>
<b>イタリア</b>			
EUR AMPLIFON EURO.02	140.00	5 621.90	0.00
EUR ASSIC GENERALI SPA EUR1	5 822.00	99 728.44	0.02
EUR DIASORIN SPA EUR1	1 423.00	300 607.21	0.06
EUR FINECOBANK SPA EURO.33	2 685.00	42 186.96	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 (%)
EUR INFRASTRUTTURA WIR NPV	1 963.00	25 336.44	0.00
EUR LEONARDO SPA EUR4.40	2 104.00	15 261.91	0.00
EUR POSTE ITALIANE SPA NPV	2 598.00	26 552.42	0.01
EUR TELECOM ITALIA SPA DI RISP EURO.55	28 392.00	14 451.05	0.00
EUR TELECOM ITALIA SPA EURO.55	46 221.00	21 701.15	0.01
イタリア合計		551 447.48	0.11
日本			
JPY アドバンテスト	400.00	27 849.44	0.01
JPY エア・ウォーター	600.00	9 902.66	0.00
JPY アイシン精機	400.00	11 872.45	0.00
JPY アマダ	900.00	8 682.81	0.00
JPY あおぞら銀行	400.00	7 269.24	0.00
JPY 朝日インテック	600.00	22 009.11	0.01
JPY アズビル	100.00	4 492.93	0.00
JPY バンダイナムコホールディングス	500.00	45 696.48	0.01
JPY ベネッセホールディングス	100.00	2 102.13	0.00
JPY 京都銀行	200.00	9 992.81	0.00
JPY カルビー	300.00	8 875.57	0.00
JPY カブコン	100.00	5 638.94	0.00
JPY 東海旅客鉄道	300.00	38 264.21	0.01
JPY 千葉銀行	1 500.00	8 515.94	0.00
JPY 中外製薬	1 500.00	72 558.14	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	300.00	4 620.47	0.00
JPY コンコルディア・フィナンシャルグループ	2 500.00	8 894.75	0.00
JPY コスモス薬品	100.00	17 262.05	0.01
JPY サイバーエージェント	200.00	13 713.74	0.00
JPY 第一生命ホールディングス	2 100.00	33 118.68	0.01
JPY ダイフク	200.00	23 207.86	0.01
JPY 第一三共	4 000.00	141 702.23	0.03
JPY ダイキン工業	600.00	136 168.78	0.03
JPY 大東建託	4 300.00	422 268.04	0.08
JPY 大和ハウス工業	1 200.00	36 825.70	0.01
JPY 大和ハウスリート投資法人	6.00	14 459.84	0.00
JPY ディスコ	100.00	31 886.84	0.01
JPY エーザイ	600.00	45 381.92	0.01
JPY ファナック	400.00	97 300.41	0.02
JPY ファーストリテイリング	100.00	82 416.69	0.02
JPY 富士電機	100.00	3 557.90	0.00
JPY ふくおかフィナンシャルグループ	500.00	8 933.11	0.00
JPY G L P 投資法人	7.00	10 599.86	0.00
JPY G M O ペイメントゲートウェイ	100.00	14 039.80	0.00
JPY 阪急阪神ホールディングス	500.00	16 351.00	0.00
JPY 光通信	100.00	24 042.20	0.01
JPY ヒロセ電機	100.00	14 154.88	0.00
JPY ホシザキ	100.00	9 906.50	0.00
JPY ヒューリック	700.00	7 095.66	0.00
JPY イビデン	100.00	4 689.52	0.00
JPY 出光興産	600.00	12 509.23	0.00
JPY いすゞ自動車	1 600.00	15 620.24	0.00
JPY 伊藤園	200.00	15 459.12	0.00
JPY 伊藤忠テクノソリューションズ	100.00	3 533.92	0.00
JPY 日本取引所グループ	1 200.00	29 731.00	0.01
JPY かんぽ生命保険	600.00	10 011.99	0.00
JPY ジャパンリアルエステイト投資法人	3.00	15 593.38	0.00
JPY J S R	600.00	16 600.34	0.00
JPY 鹿島建設	1 400.00	18 433.95	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 カカクコム	300.00	8 426.76	0.00
JPY 関西電力	1 400.00	12 825.89	0.00
JPY 関西ペイント	300.00	9 105.73	0.00
JPY 花王	1 100.00	82 366.82	0.02
JPY 京阪ホールディングス	300.00	14 140.49	0.00
JPY 京浜急行電鉄	400.00	6 854.95	0.00
JPY 京王電鉄	300.00	21 318.63	0.01
JPY 京成電鉄	300.00	10 083.91	0.00
JPY キッコーマン	300.00	18 671.78	0.01
JPY 近鉄グループホールディングス	300.00	13 320.55	0.00
JPY キリンホールディングス	1 600.00	34 884.68	0.01
JPY 小林製薬	100.00	12 035.48	0.00
JPY 神戸物産	400.00	13 963.08	0.00
JPY 小糸製作所	300.00	18 067.61	0.01
JPY 小松製作所	1 900.00	46 281.47	0.01
JPY コーセー	100.00	15 286.50	0.00
JPY クラレ	600.00	5 961.16	0.00
JPY 九州電力	1 200.00	10 138.58	0.00
JPY 九州旅客鉄道	200.00	4 215.78	0.00
JPY レーザーテック	100.00	10 549.03	0.00
JPY L I N E	200.00	10 318.87	0.00
JPY ライオン	400.00	9 467.27	0.00
JPY エムスリー	1 000.00	92 275.23	0.02
JPY マキタ	500.00	25 893.07	0.01
JPY 丸井グループ	200.00	3 655.72	0.00
JPY 日本マクドナルドホールディングス	200.00	9 724.29	0.00
JPY 明治ホールディングス	300.00	21 232.32	0.01
JPY ミネベアミツミ	1 100.00	22 933.59	0.01
JPY ミスミグループ本社	800.00	25 125.87	0.01
JPY 三菱瓦斯化学	600.00	12 739.39	0.00
JPY 三井化学	400.00	11 251.02	0.00
JPY 三井不動産	2 400.00	50 209.54	0.01
JPY 三浦工業	200.00	10 529.85	0.00
JPY M o n o t a R O	200.00	12 217.69	0.00
JPY ナブテスコ	300.00	12 399.90	0.00
JPY 名古屋鉄道	400.00	11 017.02	0.00
JPY 日本ハム	300.00	12 817.07	0.00
JPY 日本電産	1 000.00	127 595.30	0.03
JPY 日本M & Aセンター	300.00	21 002.16	0.00
JPY 日本ビルファンド投資法人	3.00	16 600.34	0.01
JPY 日本通運	200.00	13 387.68	0.00
JPY 日本ペイントホールディングス	300.00	38 465.60	0.01
JPY 日本酸素ホールディングス	300.00	5 017.50	0.00
JPY 日本新薬	100.00	7 154.16	0.00
JPY 日本製鉄	9 200.00	112 623.35	0.02
JPY 日産化学	200.00	11 968.35	0.00
JPY 日清製粉グループ本社	600.00	9 764.56	0.00
JPY 日清食品ホールディングス	200.00	16 533.21	0.00
JPY ニトリホールディングス	200.00	42 637.26	0.01
JPY 日東電工	8 900.00	737 434.67	0.15
JPY 野村不動産ホールディングス	14 400.00	312 097.82	0.06
JPY 大林組	84 300.00	743 764.09	0.15
JPY オービック	200.00	45 015.58	0.01
JPY 小田急電鉄	700.00	21 246.70	0.01
JPY 王子ホールディングス	1 300.00	5 909.37	0.00
JPY オリンパス	36 500.00	789 856.15	0.17
JPY 小野薬品工業	900.00	28 508.27	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 日本オラクル	100.00	11 095.66	0.00
JPY オリエンタルランド	500.00	85 183.41	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	1 000.00	23 658.60	0.01
JPY ベプチドリーム	300.00	15 305.68	0.00
JPY パーソルホールディングス	300.00	5 500.84	0.00
JPY ビジョン	300.00	13 406.86	0.00
JPY ポーラ・オルビスホールディングス	600.00	11 997.12	0.00
JPY 楽天	1 800.00	20 179.33	0.01
JPY リクルートホールディングス	3 000.00	126 588.35	0.02
JPY リンナイ	100.00	11 680.65	0.00
JPY 良品計画	400.00	8 235.91	0.00
JPY S B Iホールディングス	400.00	10 855.91	0.00
JPY セコム	500.00	49 844.16	0.01
JPY 西武ホールディングス	600.00	5 955.41	0.00
JPY 積水ハウス	1 500.00	27 015.10	0.01
JPY シャープ	500.00	6 713.02	0.00
JPY シマノ	200.00	47 451.45	0.01
JPY 清水建設	1 800.00	13 688.80	0.00
JPY 信越化学工業	800.00	131 460.08	0.03
JPY 塩野義製薬	500.00	26 818.51	0.01
JPY 資生堂	900.00	63 524.33	0.01
JPY 静岡銀行	900.00	6 404.22	0.00
JPY S M C	100.00	63 601.06	0.01
JPY スクウェア・エニックス・ホールディングス	200.00	12 294.41	0.00
JPY スタンレー電気	100.00	2 944.14	0.00
JPY 住友金属鉱山	600.00	22 365.86	0.01
JPY サンドラッグ	300.00	12 601.29	0.00
JPY サントリー食品インターナショナル	200.00	7 317.19	0.00
JPY スズケン	200.00	7 652.84	0.00
JPY スズキ	800.00	42 994.01	0.01
JPY シスメックス	400.00	41 927.60	0.01
JPY T & Dホールディングス	1 700.00	19 873.41	0.01
JPY 太平洋セメント	300.00	8 072.88	0.00
JPY 大成建設	500.00	17 693.60	0.01
JPY 帝人	200.00	3 421.72	0.00
JPY テルモ	1 600.00	63 631.74	0.01
JPY T H K	400.00	12 371.13	0.00
JPY T I S	500.00	9 964.04	0.00
JPY 東武鉄道	500.00	15 008.39	0.00
JPY 東宝	200.00	8 477.58	0.00
JPY 東邦瓦斯	100.00	6 549.99	0.00
JPY 東北電力	1 000.00	8 391.27	0.00
JPY 東京センチュリー	200.00	13 253.42	0.00
JPY 東京瓦斯	800.00	17 987.05	0.00
JPY 東急	1 000.00	12 150.56	0.00
JPY 東レ	2 400.00	13 029.39	0.00
JPY 東ソー	500.00	7 892.59	0.00
JPY T O T O	200.00	11 335.41	0.00
JPY 東洋水産	300.00	14 759.05	0.00
JPY 豊田合成	100.00	2 715.90	0.00
JPY 豊田自動織機	300.00	21 692.64	0.01
JPY 豊田通商	500.00	17 310.00	0.00
JPY ツルハホールディングス	100.00	14 653.56	0.00
JPY ユー・エス・エス	700.00	14 661.23	0.00
JPY ウエルシアホールディングス	200.00	8 046.03	0.00
JPY ヤクルト本社	300.00	14 313.11	0.00
JPY ヤマハ	300.00	17 146.97	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 (%)
JPY ヤマトホールディングス	500.00	12 644.45	0.00
JPY Z O Z O	238.00	5 943.44	0.00
日本合計		6 801 955.52	1.33
ジャージー			
GBP GLENCORE XSTRATA ORD USD0.01	32 426.00	91 710.57	0.02
ジャージー合計		91 710.57	0.02
ルクセンブルグ			
EUR AROUNDTOWN SA EURO.01	5 289.00	36 808.75	0.01
ルクセンブルグ合計		36 808.75	0.01
オランダ			
USD AERCAP HOLDINGS EURO.01	430.00	15 806.80	0.00
EUR AKZO NOBEL NV EURO.50(POST REV SPLIT)	1 056.00	112 499.45	0.02
EUR ALTICE EUROPE N.V. EURO.01 (COMMON SHARES A)	3 332.00	17 609.00	0.00
EUR ARGEN X NV EURO.10	207.00	59 229.12	0.01
EUR EXOR NV EURO.01	503.00	35 126.58	0.01
EUR HEINEKEN HOLDING EUR1.6	587.00	54 383.02	0.01
EUR HEINEKEN NV EUR1.60	1 312.00	138 924.56	0.03
EUR ING GROEP N.V. EURO.01	20 119.00	196 742.40	0.04
EUR JUST EAT TAKEAWAY EURO.04	693.00	73 811.19	0.01
EUR KON KPN NV EURO.04	16 884.00	50 471.41	0.01
EUR KONINKLIJKE AHOLD EURO.01	37 139.00	1 065 771.87	0.21
EUR KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20	13 111.00	680 031.28	0.13
USD NXP SEMICONDUCTORS EURO.20	621.00	98 378.82	0.02
EUR QIAGEN NV EURO.01	1 137.00	54 960.81	0.01
EUR RANDSTAD N.V. EURO.10	566.00	35 206.56	0.01
GBP ROYAL DUTCH SHELL 'B' SHS EURO.07 (UK LIST)	28 207.00	464 772.01	0.09
EUR STMICROELECTRONICS EUR1.04	3 332.00	130 811.94	0.03
EUR VOPAK(KON) EURO.50	493.00	25 965.66	0.01
EUR WOLTERS KLUWER EURO.12	1 401.00	117 814.10	0.02
オランダ合計		3 428 316.58	0.67
パプアニューギニア			
AUD OIL SEARCH LTD PGK0.10	7 812.00	20 952.83	0.01
パプアニューギニア合計		20 952.83	0.01
スペイン			
EUR ACS ACTIVIDADES CO EURO.5	17 613.00	558 109.08	0.11
EUR AENA SME S.A. EUR10	384.00	62 745.95	0.01
EUR AMADEUS IT GROUP EURO.01	2 279.00	156 643.99	0.03
EUR CAIXABANK SA EUR1	322 019.00	827 022.52	0.16
EUR CELLNEX TELECOM SA EURO.25	1 662.00	105 129.90	0.02
EUR ENAGAS SA EUR1.50	31 990.00	781 400.66	0.15
EUR ENDESA SA EUR1.2	1 798.00	51 553.90	0.01
EUR FERROVIAL SA EURO.2	2 348.00	65 498.36	0.01
EUR GRIFOLS SA EURO.25 (CLASS A) POST SUBD	1 448.00	41 137.32	0.01
EUR IBERDROLA SA EURO.75 (POST SUBDIVISION)	82 783.00	1 133 341.41	0.22
EUR INDITEX EURO.03 (POST SUBD)	5 402.00	179 963.15	0.04
EUR NATURGY ENERGY GRO EUR1	1 831.00	42 348.34	0.01
EUR RED ELECTRICA CORP EURO.5	22 550.00	462 204.80	0.09
EUR REPSOL SA EUR1	7 751.00	74 711.73	0.02
EUR SIEMENS GAMESA REN EURO.17	1 387.00	49 657.74	0.01
EUR TELEFONICA SA EUR1	21 981.00	96 155.96	0.02
スペイン合計		4 687 624.81	0.92

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>イギリス</b>			
GBP 3I GROUP ORD GBPO.738636	2 576.00	36 815.45	0.01
GBP ASTRAZENECA ORD USDO.25	4 016.00	418 469.82	0.08
GBP AVEVA GROUP ORD GBPO.03556	174.00	7 879.57	0.00
GBP AVIVA ORD GBPO.25	9 949.00	42 663.11	0.01
GBP BAE SYSTEMS ORD GBPO.025	8 868.00	59 669.69	0.01
GBP BARRATT DEVEL ORD GBPO.10	25 696.00	212 693.76	0.04
GBP BRIT AMER TOBACCO ORD GBPO.25	6 710.00	236 451.31	0.05
GBP BRITISH LAND CO PLC REIT	3 031.00	19 087.52	0.00
GBP BT GROUP ORD GBPO.05	26 056.00	40 630.12	0.01
GBP BUNZL ORD GBPO.32142857	1 104.00	34 769.19	0.01
USD COCA-COLA EUROPEAN ORD EURO.01	1 079.00	48 209.72	0.01
GBP EVRAZ PLC ORD USD1	40 236.00	207 509.05	0.04
GBP HALMA ORD GBPO.10	1 194.00	35 324.14	0.01
GBP HIKMA PHARMACEUTIC ORD GBPO.10	489.00	17 026.05	0.00
USD IHS MARKIT LTD COM	815.00	81 059.90	0.02
GBP INFORMA PLC (GB) ORD GBPO.001	3 641.00	25 772.58	0.01
GBP JD SPORTS FASHION ORD GBPO.0025	10 543.00	109 253.51	0.02
GBP JOHNSON MATTHEY ORD GBP1.109245	496.00	14 726.99	0.00
GBP KINGFISHER ORD GBPO.157142857	6 300.00	23 011.99	0.00
GBP LAND SECURITIES GP ORD GBPO.106666666	1 876.00	16 469.95	0.00
USD LIBERTY GLOBAL INC USDO.01 A	4 593.00	103 434.36	0.02
GBP LLOYDS BANKING GP ORD GBPO.1	216 219.00	102 821.83	0.02
GBP MELROSE INDUST PLC ORD GBPO.0685714	14 117.00	28 930.00	0.01
GBP NATIONAL GRID ORD GBPO.12431289	10 215.00	115 700.85	0.02
GBP OCADO GROUP PLC ORD GBPO.02	1 260.00	37 125.34	0.01
GBP RECKITT BENCK GRP ORD GBPO.10	2 051.00	180 282.27	0.04
GBP RELX PLC GBPO.1444	5 944.00	138 673.51	0.03
GBP RENTOKIL INITIAL ORD GBPO.01	5 533.00	36 734.72	0.01
GBP ROLLS-ROYCE HLDGS ORD GBPO.20	33 366.00	47 084.36	0.01
GBP SAGE GROUP GBPO.01051948	3 342.00	26 993.51	0.01
GBP SEVERN TRENT ORD GBPO.9789	633.00	20 189.12	0.00
GBP SMITHS GROUP ORD GBPO.375	1 595.00	31 068.02	0.01
GBP SPIRAX-SARCO ENG ORD GBPO.269230769	171.00	25 420.49	0.00
GBP SSE PLC ORD GBPO.50	2 939.00	52 616.98	0.01
GBP ST JAMES ' S PLACE ORD GBPO.15	1 658.00	22 577.83	0.00
GBP UNITED UTILITIES G ORD GBPO.05	1 870.00	22 478.88	0.00
GBP WHITBREAD ORD GBPO.76797385	3 072.00	124 309.60	0.02
USD WILLIS TOWERS WATS COM USDO.000304635	290.00	60 375.10	0.01
GBP WPP PLC ORD GBPO.10	3 714.00	35 977.97	0.01
<b>イギリス合計</b>		<b>2 900 288.16</b>	<b>0.57</b>
<b>アメリカ合衆国</b>			
USD 3M CO COM	1 272.00	219 712.56	0.04
USD AFLAC INC COM USDO.10	1 708.00	75 032.44	0.01
USD AKAMAI TECHNOLOGIES INC COM	1 983.00	205 260.33	0.04
USD ALBEMARLE CORP COM USDO.01	197.00	26 786.09	0.01
USD ALIGN TECHNOLOGY INC COM	179.00	86 150.91	0.02
USD ALLEGHANY CORP DEL COM	14.00	8 052.80	0.00
USD ALLIANT ENERGY CORP COM	476.00	25 037.60	0.01
USD ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC COM	220.00	28 580.20	0.01
USD ALPHABET INC CAP STK USDO.001 CL C	1 073.00	1 889 274.02	0.37
USD ALTICE USA INC COM USDO.01 CL A	899.00	30 494.08	0.01
USD AMER ELEC PWR INC COM USD6.50	1 158.00	98 198.40	0.02
USD AMERICAN WATER WOR COM STK USDO.01	376.00	57 670.88	0.01
USD ANSYS INC COM	187.00	63 217.22	0.01
USD ARISTA NETWORKS IN COM USDO.0001	163.00	44 124.10	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 ARROW ELECTRS INC COM	219.00	20 071.35	0.00
USD BAKER HUGHES COMPA COM USDO.0001 CL A	1 556.00	29 128.32	0.01
USD BERKLEY(WR)CORP COM USDO.20	363.00	23 642.19	0.00
USD BERKSHIRE HATHAWAY CLASS ' B ' COM USDO.0033	3 163.00	724 042.33	0.14
USD BIO RAD LABS INC CL A	32.00	17 232.00	0.00
USD BIOMARIN PHARMA COM USDO.001	387.00	30 456.90	0.01
USD BLACK KNIGHT INC COM USDO.0001 WI	416.00	38 113.92	0.01
USD BLACKROCK INC COM STK USDO.01	326.00	227 662.10	0.04
USD BOOZ ALLEN HAMILTO COM USDO.01 CLASS ' A '	241.00	20 916.39	0.00
USD BOSTON PPTYS INC COM USDO.01	257.00	25 227.12	0.00
USD BOSTON SCIENTIFIC COM USDO.01	3 206.00	106 278.90	0.02
USD BROADRIDGE FIN SOL COM STK USDO.01	233.00	34 223.04	0.01
USD BROWN & BROWN INC COM	514.00	23 145.42	0.00
USD BROWN FORMAN CORP CL B	616.00	49 686.56	0.01
USD CABLE ONE INC COM USD1 ' WI '	3.00	5 942.01	0.00
USD CABOT OIL & GAS CO COM USDO.10	721.00	12 631.92	0.00
USD CADENCE DESIGN SYS COM USDO.01	7 535.00	876 320.50	0.17
USD CAMPBELL SOUP CO CAP USDO.0375	11 885.00	594 487.70	0.12
USD CARVANA CO COM USDO.001 CL A	100.00	25 021.00	0.01
USD CATALENT INC COM USDO.01	354.00	34 033.56	0.01
USD CDK GLOBAL INC COM USDO.01	142.00	6 801.80	0.00
USD CDW CORP COM USDO.01	271.00	35 362.79	0.01
USD CERNER CORP COM	812.00	60 770.08	0.01
USD CHENIERE ENERGY INC COM NEW	465.00	26 360.85	0.01
USD CINCINNATI FINL CORP COM	399.00	30 463.65	0.01
USD CINTAS CORP COM	198.00	70 349.40	0.01
USD CLOROX CO DEL COM	3 569.00	724 364.24	0.14
USD CME GROUP INC COM STK USDO.01 CLASS ' A '	780.00	136 523.40	0.03
USD CMS ENERGY CORP COM	607.00	37 354.78	0.01
USD COCA-COLA CO COM USDO.25	9 209.00	475 184.40	0.09
USD COGNEX CORP COM	457.00	34 338.98	0.01
USD COLGATE-PALMOLIVE COM USD1	1 898.00	162 544.72	0.03
USD CONSTELLATION BRDS CLASS ' A ' COM USDO.01	394.00	81 100.96	0.02
USD COPART INC COM	496.00	57 263.20	0.01
USD COSTAR GROUP INC COM	83.00	75 577.31	0.02
USD COUPA SOFTWARE INC COM USDO.0001	145.00	47 691.95	0.01
USD CSX CORP COM USD1	1 716.00	154 525.80	0.03
USD DEERE & CO COM USD1	647.00	169 268.14	0.03
USD DEXCOM INC COM	191.00	61 058.88	0.01
USD DIGITAL REALTY TRU COM STK USDO.01	580.00	78 155.00	0.02
USD DISCOVERY INC COM USDO.01 SER A	31 974.00	860 420.34	0.17
USD DISCOVERY INC COM USDO.01 SER C	833.00	20 008.66	0.00
USD DOMINION ENERGY IN COM STK NPV	1 873.00	147 011.77	0.03
USD DROPBOX INC COM USDO.00001 CL A	450.00	8 986.50	0.00
USD DUKE ENERGY CORP COM USDO.001 (POST REV SPLT)	1 599.00	148 163.34	0.03
USD ECOLAB INC COM	553.00	122 848.95	0.02
USD EDWARDS LIFESCENCES CORP COM	1 447.00	121 388.83	0.02
USD EOG RESOURCES INC COM USDO.01	1 213.00	56 865.44	0.01
USD EPAM SYS INC COM USDO.001	125.00	40 291.25	0.01
USD EQUIFAX INC COM	250.00	41 725.00	0.01
USD EQUITY LIFESTYLE PPTYS INC	311.00	18 221.49	0.00
USD EQUITY RESIDENTIAL SBI USDO.01	877.00	50 795.84	0.01
USD ERIE INDY CO CL A	28.00	6 317.08	0.00
USD ESSEX PROP TRUST COM USDO.0001	147.00	36 144.36	0.01
USD EXACT SCIENCES CORP COM	288.00	34 865.28	0.01
USD EXPEDTRS INTL WASH COM USDO.01	8 213.00	733 995.81	0.14
USD F M C CORP COM NEW	339.00	39 327.39	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 - 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 F5 NETWORK INC COM STK NPV	140.00	22 793.40	0.00
USD FACTSET RESH SYS INC COM	89.00	29 704.64	0.01
USD FAIR ISAAC CORP COM	1 675.00	791 906.50	0.16
USD FASTENAL COM USDO.01	1 452.00	71 801.40	0.01
USD FIDELITY NATL FINL FNF GROUP COM USDO.0001	484.00	17 419.16	0.00
USD FLIR SYS INC COM	277.00	10 592.48	0.00
USD FORTINET INC COM USDO.001	4 719.00	581 522.37	0.11
USD FORTIVE CORP COM USDO.01	722.00	50 633.86	0.01
USD FRANKLIN RES INC COM	882.00	19 395.18	0.00
USD GALLAGHER ARTHUR J & CO COM	392.00	45 240.72	0.01
USD GARTNER INC COM	145.00	22 040.00	0.00
USD GEN DYNAMICS CORP COM USD1	490.00	73 181.50	0.01
USD GEN ELEC CO COM USDO.06	19 370.00	197 186.60	0.04
USD GENERAC HLDGS INC COM USDO.01	112.00	24 147.20	0.00
USD GUIDEWIRE SOFTWARE COM USDO.0001	212.00	25 965.76	0.01
USD HEICO CORP NEW CL A	206.00	22 814.50	0.00
USD HEICO CORP NEW COM	69.00	8 527.02	0.00
USD HENRY JACK & ASSOC COM USDO.01	163.00	26 220.18	0.01
USD HONEYWELL INTL INC COM USD1	1 564.00	318 930.88	0.06
USD HUNT J B TRANS SVCS INC COM	159.00	21 509.52	0.00
USD IDEX CORP COM	208.00	40 175.20	0.01
USD IDEXX LABORATORIES COM USDO.10	178.00	82 054.44	0.02
USD ILLINOIS TOOL WKS COM NPV	735.00	155 151.15	0.03
USD ILLUMINA INC COM USDO.01	332.00	106 933.88	0.02
USD INCYTE CORPORATION COM USDO.001	522.00	44 129.88	0.01
USD INSULET CORP COM STK USDO.001	122.00	31 440.62	0.01
USD INTERCONTINENTAL E COM USDO.01	1 186.00	125 134.86	0.02
USD INTERNATIONAL FLAVORS&FRAGRANC COM	175.00	19 617.50	0.00
USD INTERPUBLIC GROUP COM USDO.10	27 198.00	605 971.44	0.12
USD INTUITIVE SURGICAL COM USDO.001	262.00	190 225.10	0.04
USD INVITATION HOMES I COM USDO.01	1 403.00	40 097.74	0.01
USD IONIS PHARMACEUTIC COM USDO.001	325.00	16 422.25	0.00
USD IPG PHOTONICS CORP COM USDO.0001	77.00	15 939.77	0.00
USD JOHNSON & JOHNSON COM USD1	5 988.00	866 343.84	0.17
USD JP MORGAN CHASE & COM USD1	7 602.00	896 123.76	0.18
USD JUNIPER NETWORKS COM USDO.00001	13 610.00	296 289.70	0.06
USD KRAFT HEINZ CO COM USDO.01	1 692.00	55 734.48	0.01
USD LAMB WESTON HLDGS COM USD1.00 WI	289.00	20 917.82	0.00
USD LEIDOS HLDGS INC COM USDO.0001	308.00	31 015.60	0.01
USD LENNOX INTL INC COM	85.00	24 465.55	0.01
USD LIBERTY BROADBAND COM USDO.01 CL 'A'	100.00	15 677.00	0.00
USD LIBERTY BROADBAND COM USDO.01 CL 'C'	271.00	42 641.85	0.01
USD LIBERTY MEDIA CORP COM USDO.01 SER A SIRIUSXM	152.00	6 222.88	0.00
USD LIBERTY MEDIA CORP COM USDO.01 SER C SIRIUSXM	318.00	13 041.18	0.00
USD LIBERTY MEDIA CORP COM USDO.01 SER C FORMULA	534.00	22 310.52	0.00
USD LIVE NATION INC COM	386.00	25 340.90	0.00
USD LOCKHEED MARTIN CORP COM	561.00	204 765.00	0.04
USD LOEWS CORP COM	573.00	24 014.43	0.00
USD LYONDELLBASELL IND COM USDO.01	669.00	56 931.90	0.01
USD M & T BANK CORP COM USDO.50	311.00	36 228.39	0.01
USD MARKEL CORP COM	22.00	21 424.26	0.00
USD MARKETAXESS HLDGS INC COM	91.00	49 065.38	0.01
USD MARSH & MCLENNAN COM USD1	1 120.00	128 396.80	0.03
USD MARTIN MARIETTA M. COM USDO.01	125.00	33 203.75	0.01
USD MASIMO CORPORATION COM STK USDO.001	93.00	23 667.57	0.00
USD MAXIM INTEGRATED COM USDO.001	573.00	47 581.92	0.01
USD MEDICAL PROP TST COM USDO.001	1 567.00	30 399.80	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 METTLER TOLEDO INTERNATIONAL COM	57.00	65 552.28	0.01
USD MOLINA HEALTHCARE INC COM	117.00	23 883.21	0.00
USD MONGODB INC COM USDO.001 CL A	100.00	28 731.00	0.01
USD MONOLITHIC PWR SYS INC COM	79.00	25 276.84	0.00
USD MONSTER BEV CORP USDO.005(NEW)	996.00	84 440.88	0.02
USD MOODYS CORP COM USDO.01	391.00	110 394.94	0.02
USD NASDAQ INC COM STK USDO.01	300.00	38 397.00	0.01
USD NEUROCRINE BIOSCIENCES INC COM	1 903.00	180 670.82	0.04
USD NEWS CORP NEW COM USDO.01 CL 'A'	1 357.00	23 951.05	0.00
USD NEXTERA ENERGY INC COM USDO.01	4 336.00	319 086.24	0.06
USD NORDSON CORP COM	73.00	14 878.13	0.00
USD NORTHROP GRUMMAN COM USD1	340.00	102 768.40	0.02
USD OKTA INC COM USDO.0001 CL A	237.00	58 074.48	0.01
USD OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	571.00	20 110.62	0.00
USD PAYCOM SOFTWARE IN COM USDO.01	110.00	45 878.80	0.01
USD PEOPLE 'S UNITED FINANCIAL INC COM STK USDO.01	643.00	7 973.20	0.00
USD PEPSICO INC CAP USDO.016666	3 069.00	442 641.87	0.09
USD PERKINELMER INC COM USD1	228.00	30 324.00	0.01
USD PHILIP MORRIS INTL COM STK NPV 'WI'	10 094.00	764 620.50	0.15
USD PIONEER NATURAL RE COM STK USDO.01	356.00	35 806.48	0.01
USD POOL CORPORATION COM USDO.001	73.00	25 266.03	0.00
USD PPG INDS INC COM	564.00	82 778.28	0.02
USD PROGRESSIVE CP(OH) COM USD1	1 358.00	118 295.38	0.02
USD PTC INC COM USDO.01	182.00	19 628.70	0.00
USD PUBLIC STORAGE COM USDO.10	365.00	81 927.90	0.02
USD PULTE GROUP INC COM USDO.01	15 891.00	693 324.33	0.14
USD QORVO INC COM USD 0.0001	273.00	42 773.64	0.01
USD RALPH LAUREN CORP CLASS 'A' COM USDO.01	158.00	13 548.50	0.00
USD REALTY INCOME CORP	941.00	56 431.77	0.01
USD RESMED INC COM USDO.004	2 179.00	456 718.40	0.09
USD RINGCENTRAL INC COM USDO.0001 CL 'A'	171.00	50 795.55	0.01
USD ROKU INC COM USDO.0001 CLASS A	207.00	60 768.99	0.01
USD ROLLINS INC COM	291.00	16 639.38	0.00
USD ROPER TECHNOLOGIES COM USDO.01	247.00	105 469.00	0.02
USD RPM INTERNATIONAL COM USDO.01	328.00	28 867.28	0.01
USD S&P GLOBAL INC COM USD1	555.00	195 237.90	0.04
USD SAREPTA THERA INC COM USDO.0001	157.00	22 115.02	0.00
USD SEMPRA ENERGY COM NPV	629.00	80 184.92	0.02
USD SHERWIN-WILLIAMS COM USD1	178.00	133 078.14	0.03
USD SMITH A O COM	222.00	12 500.82	0.00
USD SNAP INC COM USDO.00001 CL A	2 071.00	91 993.82	0.02
USD SOUTHERN CO COM	2 454.00	146 871.90	0.03
USD SPLUNK INC COM USDO.001	360.00	73 504.80	0.01
USD SS&C TECH HLDGS COM USDO.01	554.00	38 165.06	0.01
USD STRYKER CORP COM USDO.10	788.00	183 919.20	0.04
USD SUN COMMUNITIES COM USDO.01	232.00	32 248.00	0.01
USD SUNRUN INC COM USDO.0001	283.00	18 134.64	0.00
USD SVB FINL GROUP COM	103.00	35 520.58	0.01
USD SYNOPSIS INC COM USDO.01	1 985.00	451 587.50	0.09
USD TAKE TWO INTERACTI COM USDO.01	268.00	48 376.68	0.01
USD TELADOC HEALTH INC COM USDO.001	237.00	47 108.49	0.01
USD TELEDYNE TECHNOLOGIES INC COM	83.00	31 369.02	0.01
USD TERADYNE INC COM USDO.125	1 697.00	187 246.98	0.04
USD THE TRADE DESK INC COM USDO.000001 CL A	94.00	84 700.58	0.02
USD TRANSUNION COM USDO.01	457.00	41 628.13	0.01
USD TRIMBLE INC COM NPV	733.00	43 884.71	0.01
USD TWILIO INC COM USDO.001 CL A	268.00	85 784.12	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 TYLER TECHNOLOGIES INC COM	91.00	38 911.60	0.01
USD UDR INC	651.00	25 043.97	0.00
USD UNITED PARCEL SERVICE INC CL B	3 576.00	611 746.32	0.12
USD VEEVA SYSTEMS INC COM USDO.00001 CL 'A'	323.00	89 429.01	0.02
USD VERISIGN INC COM	207.00	41 549.04	0.01
USD VERISK ANALYTICS I CL A USDO.001	330.00	65 442.30	0.01
USD VERTEX PHARMACEUTI COM USDO.01	601.00	136 877.75	0.03
USD VICI PPTYS INC COM USDO.01	1 220.00	30 853.80	0.01
USD VMWARE INC COM STK USDO.01 CLASS 'A'	177.00	24 760.53	0.00
USD VORNADO REALTY TR COM USDO.04	257.00	9 999.87	0.00
USD VULCAN MATERIALS COM STK USD1	273.00	38 124.45	0.01
USD W P CAREY INC COM USDO.001	332.00	22 977.72	0.00
USD WABTEC CORP COM	458.00	33 571.40	0.01
USD WATERS CORP COM	113.00	26 217.13	0.01
USD WAYFAIR INC COM USDO.001 A	131.00	33 321.16	0.01
USD WEC ENERGY GROUP COM USDO.01	720.00	68 364.00	0.01
USD WEST PHARMACEUTICA COM USDO.25	180.00	49 528.80	0.01
USD WESTERN UN CO COM	36 509.00	823 643.04	0.16
USD XCEL ENERGY INC COM	1 121.00	75 510.56	0.01
USD ZEBRA TECHNOLOGIES CORP CL A	112.00	42 383.04	0.01
USD ZILLOW GROUP INC COM USDO.0001 CLASS C WI	332.00	35 792.92	0.01
USD ZOETIS INC COM USDO.01 CL 'A'	1 105.00	177 219.90	0.03
USD ZSCALER INC COM USDO.001	200.00	31 150.00	0.01
アメリカ合衆国合計		26 509 196.69	5.20
無記名株式合計		72 606 725.24	14.24
その他の株式			
アメリカ合衆国			
USD CAMDEN PROP TST SBI USDO.01	292.00	28 858.36	0.01
アメリカ合衆国合計		28 858.36	0.01
その他の株式合計		28 858.36	0.01
優先株式			
ドイツ			
EUR BAYERISCHE MOTORENWERKE AG EUR1	322.00	21 338.77	0.00
EUR FUCHS PETROLUB SE NON-VTG PRF NPV	382.00	21 896.97	0.01
EUR HENKEL AG&CO. KGAA NON-VTG PRF NPV	922.00	99 525.37	0.02
EUR PORSCHE AUTO HL SE NON VTG PRF NPV	4 851.00	309 287.44	0.06
EUR SARTORIUS AG NON VTG PRF NPV	183.00	83 621.56	0.02
EUR VOLKSWAGEN AG NON VTG PRF NPV	951.00	160 786.43	0.03
ドイツ合計		696 456.54	0.14
優先株式合計		696 456.54	0.14
記名株式			
アルゼンチン			
USD MERCADOLIBRE INC COM STK USDO.001	94.00	146 013.02	0.03
アルゼンチン合計		146 013.02	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 (%)
<b>オーストラリア</b>			
AUD AMPOL LTD NPV	1 452.00	32 792.63	0.01
AUD BHP GROUP LTD NPV	31 924.00	895 528.20	0.18
GBP BHP GROUP PLC ORD USD0.50	6 438.00	145 995.55	0.03
AUD COLES GROUP LTD NPV	24 059.00	316 619.83	0.06
AUD VODAFONE HUTCHISON NPV	1 414.00	7 991.42	0.00
<b>オーストラリア合計</b>		<b>1 398 927.63</b>	<b>0.28</b>
<b>ベルギー</b>			
EUR AGEAS NPV	809.00	39 889.66	0.01
EUR KBC GROUP NV NPV	2 795.00	195 253.33	0.04
EUR TELENET GRP HLDG NPV	340.00	14 560.15	0.00
EUR UCB NPV	694.00	74 349.38	0.01
<b>ベルギー合計</b>		<b>324 052.52</b>	<b>0.06</b>
<b>バミューダ</b>			
USD ARCH CAPITAL GROUP COM USD0.01	885.00	28 492.58	0.01
USD EVEREST RE GROUP COM USD0.01	87.00	19 777.71	0.00
USD RENAISSANCE RE HLG COM USD1	122.00	20 086.08	0.00
<b>バミューダ合計</b>		<b>68 356.37</b>	<b>0.01</b>
<b>カナダ</b>			
USD LULULEMON ATHLETIC COM STK USD0.01	261.00	96 627.42	0.02
<b>カナダ合計</b>		<b>96 627.42</b>	<b>0.02</b>
<b>フィンランド</b>			
EUR ELISA OYJ NPV	754.00	40 587.07	0.01
EUR FORTUM OYJ EUR3.40	39 639.00	910 627.59	0.18
EUR NESTE OIL OYJ NPV	2 123.00	142 670.94	0.03
EUR NOKIA OYJ NPV	26 800.00	107 314.69	0.02
EUR ORION CORP SER ' B ' NPV	540.00	25 489.11	0.00
EUR SAMPO PLC SER ' A ' NPV	2 524.00	109 385.93	0.02
EUR STORA ENSO OYJ NPV SER ' R '	3 205.00	54 325.24	0.01
EUR UPM-KYMMENE CORP NPV	2 702.00	89 271.50	0.02
<b>フィンランド合計</b>		<b>1 479 672.07</b>	<b>0.29</b>
<b>フランス</b>			
EUR GECINA EUR7.50	221.00	33 653.05	0.01
EUR LA FRANCAISE DES EURO.40 (PROMESSES)	568.00	23 753.28	0.00
EUR MICHELIN (CGDE) EUR2	858.00	107 201.17	0.02
<b>フランス合計</b>		<b>164 607.50</b>	<b>0.03</b>
<b>ドイツ</b>			
EUR ADIDAS AG NPV (REGD)	977.00	312 390.14	0.06
EUR ALLIANZ SE NPV(REGD)(VINKULIERT)	6 770.00	1 600 704.84	0.31
EUR BASF SE NPV	4 739.00	347 667.00	0.07
EUR BAYER AG NPV (REGD)	9 071.00	523 764.75	0.10
EUR BRENNTAG AG	885.00	67 816.29	0.01
EUR DAIMLER AG ORD NPV(REGD)	4 428.00	299 002.87	0.06
EUR DELIVERY HERO SE NPV	656.00	79 451.60	0.02
EUR DEUTSCHE BANK AG NPV(REGD)	9 955.00	111 258.05	0.02
EUR DEUTSCHE BOERSE AG NPV(REGD)	980.00	163 825.57	0.03
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA ORD NPV (REGD)(VINK)	2 013.00	23 227.09	0.00
EUR DEUTSCHE POST AG NPV(REGD)	24 723.00	1 197 732.93	0.24
EUR DEUTSCHE TELEKOM NPV(REGD)	16 979.00	306 989.89	0.06
EUR E.ON SE NPV	11 964.00	129 889.69	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 (%)
EUR EVONIK INDUSTRIES NPV	1 131.00	34 241.95	0.01
EUR HANNOVER RUECKVERS ORD NPV(REGD)	279.00	46 823.69	0.01
EUR INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)	6 339.00	223 841.65	0.04
EUR LEG IMMOBILIEN AG NPV	358.00	51 157.50	0.01
EUR MTU AERO ENGINES H NPV (REGD)	281.00	66 537.37	0.01
EUR MUENCHENER RUECKVE NPV(REGD)	696.00	194 484.89	0.04
EUR SCOUT24 AG NPV	638.00	48 919.56	0.01
EUR SIEMENS AG NPV(REGD)	3 849.00	515 667.47	0.10
EUR SIEMENS ENERGY AG NPV	2 183.00	65 021.48	0.01
EUR SIEMENS HEALTHINEE NPV	3 870.00	178 459.28	0.04
EUR TELEFONICA DEUTSCH NPV	3 760.00	10 407.71	0.00
EUR UNIPER SE NPV	3 956.00	134 393.55	0.03
EUR UNITED INTERNET AG NPV(REGD)	501.00	20 034.47	0.00
EUR VONOVIA SE NPV	2 694.00	185 232.91	0.04
<b>ドイツ合計</b>		<b>6 938 944.19</b>	<b>1.36</b>
<b>アイルランド</b>			
USD ACCENTURE PLC SHS CL A 'NEW'	5 531.00	1 377 716.79	0.27
USD ALLEGION PLC CIM USDO.01	171.00	19 500.84	0.00
USD APTIV PLC COM USDO.01	593.00	70 389.10	0.01
EUR CRH ORD EURO.32	11 208.00	440 018.06	0.09
USD EATON CORP PLC COM USDO.01	866.00	104 881.26	0.02
GBP EXPERIAN ORD USDO.10	2 730.00	96 438.40	0.02
USD JAZZ PHARMA PLC COM USDO.0001	4 095.00	576 207.45	0.11
EUR KINGSPAN GROUP ORD EURO.13(DUBLIN LISTING)	592.00	51 801.20	0.01
USD MEDTRONIC PLC USDO.0001	3 061.00	348 035.70	0.07
USD PENTAIR PLC COM USDO.01	381.00	19 743.42	0.01
USD PERRIGO CO LTD COM EURO.001	333.00	16 057.26	0.00
EUR SMURFIT KAPPA GRP ORD EURO.001	935.00	39 861.45	0.01
USD STERIS PLC ORD USDO.001	166.00	32 172.46	0.01
<b>アイルランド合計</b>		<b>3 192 823.39</b>	<b>0.63</b>
<b>マン島</b>			
GBP GVC HLDGS PLC ORD EURO.01	1 921.00	26 556.76	0.01
<b>マン島合計</b>		<b>26 556.76</b>	<b>0.01</b>
<b>イタリア</b>			
EUR ATLANTIA SPA EUR1	2 661.00	48 637.59	0.01
EUR DAVIDE CAMPARI MIL EURO.05	2 854.00	33 094.88	0.01
EUR ENEL EUR1	41 087.00	411 371.01	0.08
EUR ENI SPA EUR1	12 479.00	123 942.04	0.02
EUR FERRARI NV EURO.01(NEW)	599.00	126 681.41	0.03
EUR INTESA SANPAOLO NPV	482 152.00	1 110 474.88	0.22
EUR MEDIOBANCA SPA EURO.5	2 575.00	23 021.53	0.00
EUR MONCLER SPA NPV	893.00	43 967.38	0.01
EUR NEXI SPA NPV	2 481.00	46 890.80	0.01
EUR PIRELLI & C SPA NPV	1 172.00	6 308.76	0.00
EUR PRYSMIAN SPA EURO.10	1 291.00	42 359.99	0.01
EUR RECORDATI EURO.125	428.00	22 849.38	0.00
EUR SNAM EUR1	10 359.00	58 276.93	0.01
EUR TERNA SPA ORD EURO.22	6 538.00	49 051.78	0.01
EUR UNICREDIT SPA NPV (POST REV SPLIT)	11 550.00	119 412.64	0.02
<b>イタリア合計</b>		<b>2 266 341.00</b>	<b>0.44</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 イオン	1 500.00	44 665.55	0.01
JPY A G C	500.00	16 662.67	0.00
JPY 味の素	1 000.00	20 911.05	0.01
JPY アルフレッサ ホールディングス	400.00	8 017.26	0.00
JPY A N Aホールディングス	100.00	2 414.29	0.00
JPY アサヒグループホールディングス	1 100.00	42 586.43	0.01
JPY 旭化成	2 900.00	26 617.98	0.01
JPY アステラス製薬	4 200.00	59 752.58	0.01
JPY プリヂストーン	1 300.00	45 429.87	0.01
JPY ブラザー工業	10 900.00	209 062.58	0.04
JPY キヤノン	2 200.00	39 105.25	0.01
JPY カシオ計算機	500.00	8 990.65	0.00
JPY 中部電力	1 500.00	18 089.19	0.00
JPY 中国電力	800.00	10 180.77	0.00
JPY 大日本印刷	500.00	9 379.05	0.00
JPY 大和証券グループ本社	4 600.00	20 032.22	0.01
JPY デンソー	900.00	42 542.32	0.01
JPY 電通グループ	500.00	16 303.04	0.00
JPY 東日本旅客鉄道	700.00	43 554.06	0.01
JPY 電源開発	400.00	5 385.76	0.00
JPY E N E O Sホールディングス	7 000.00	24 066.17	0.01
JPY 富士フイルムホールディングス	5 500.00	296 691.44	0.06
JPY 富士通	1 500.00	208 655.00	0.04
JPY 博報堂D Yホールディングス	600.00	8 688.56	0.00
JPY 浜松ホトニクス	400.00	22 517.38	0.01
JPY 日野自動車	1 100.00	9 546.87	0.00
JPY 日立建機	400.00	11 089.91	0.00
JPY 日立金属	700.00	10 291.06	0.00
JPY 日立製作所	2 100.00	79 871.49	0.02
JPY 本田技研工業	3 700.00	101 889.71	0.02
JPY H O Y A	5 400.00	720 345.24	0.14
JPY 飯田グループホールディングス	200.00	4 023.98	0.00
JPY 国際石油開発帝石	3 500.00	19 602.01	0.00
JPY 伊藤忠商事	32 700.00	865 048.67	0.17
JPY ゆうちょ銀行	200.00	1 576.60	0.00
JPY 日本郵政	4 900.00	36 310.05	0.01
JPY 日本リテールファンド投資法人	7.00	11 177.18	0.00
JPY 日本たばこ産業	3 200.00	65 058.74	0.01
JPY ジェイ エフ イー ホールディングス	200.00	1 833.61	0.00
JPY K D D I	25 500.00	729 357.47	0.14
JPY キーエンス	400.00	204 421.00	0.04
JPY コナミホールディングス	200.00	10 491.49	0.00
JPY クボタ	2 300.00	45 669.14	0.01
JPY 京セラ	700.00	40 029.73	0.01
JPY 協和キリン	400.00	10 875.09	0.00
JPY ローソン	12 200.00	553 402.06	0.11
JPY L I X I L	4 300.00	103 298.97	0.02
JPY 丸紅	5 000.00	29 177.66	0.01
JPY マツダ	2 000.00	11 834.09	0.00
JPY メディカルホールディングス	13 000.00	244 727.88	0.05
JPY メルカリ	200.00	9 168.07	0.00
JPY 三菱ケミカルホールディングス	2 600.00	14 399.42	0.00
JPY 三菱商事	3 300.00	76 997.36	0.02
JPY 三菱電機	13 900.00	204 417.65	0.04
JPY 三菱地所	2 500.00	43 251.02	0.01
JPY 三菱重工業	700.00	15 785.66	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 (%)
JPY 三菱UFJフィナンシャル・グループ	28 400.00	122 152.00	0.03
JPY 三井物産	3 800.00	64 866.94	0.01
JPY みずほフィナンシャルグループ	5 830.00	74 220.33	0.02
JPY MS & A Dインシュアランスグループホールディングス	900.00	26 195.16	0.01
JPY 村田製作所	1 300.00	113 811.56	0.02
JPY 日本電気	600.00	32 395.11	0.01
JPY ネクソン	1 100.00	33 282.19	0.01
JPY 日本碍子	800.00	12 727.88	0.00
JPY 日本特殊陶業	700.00	12 694.32	0.00
JPY 任天堂	300.00	170 491.49	0.03
JPY 日本プロロジスリート投資法人	4.00	12 562.93	0.00
JPY 日本電信電話	32 600.00	770 644.93	0.15
JPY 日本郵船	4 800.00	104 769.12	0.02
JPY 日産自動車	5 500.00	25 976.98	0.01
JPY 野村ホールディングス	56 100.00	281 912.25	0.06
JPY 野村不動産マスターファンド投資法人	11.00	14 346.68	0.00
JPY 野村総合研究所	600.00	20 282.91	0.01
JPY エヌ・ティ・ティ・データ	1 400.00	18 635.34	0.00
JPY オムロン	400.00	36 173.58	0.01
JPY オリックス	2 800.00	41 701.27	0.01
JPY オリックス不動産投資法人	7.00	10 472.31	0.00
JPY 大阪瓦斯	1 000.00	19 218.41	0.00
JPY 大塚商会	200.00	9 705.11	0.00
JPY 大塚ホールディングス	900.00	36 612.80	0.01
JPY パナソニック	4 700.00	50 143.85	0.01
JPY ルネサスエレクトロニクス	11 800.00	105 014.63	0.02
JPY リそなホールディングス	3 900.00	13 677.58	0.00
JPY リコー	1 700.00	11 363.22	0.00
JPY ローム	200.00	16 705.83	0.00
JPY 参天製薬	1 000.00	16 638.70	0.00
JPY セガサミーホールディングス	900.00	12 661.71	0.00
JPY セイコーエプソン	700.00	10 452.17	0.00
JPY 積水化学工業	600.00	10 374.49	0.00
JPY セブン&アイ・ホールディングス	1 600.00	50 834.81	0.01
JPY S Gホールディングス	600.00	17 952.53	0.00
JPY 島津製作所	500.00	18 005.27	0.00
JPY ソフトバンク	6 600.00	81 301.37	0.02
JPY ソフトバンクグループ	3 600.00	251 059.22	0.05
JPY 総合警備保障	200.00	10 721.65	0.00
JPY S O M P Oホールディングス	800.00	30 764.80	0.01
JPY ソニー	10 600.00	986 453.13	0.19
JPY S U B A R U	1 400.00	27 832.17	0.01
JPY S U M C O	500.00	10 136.66	0.00
JPY 住友商事	2 400.00	29 610.17	0.01
JPY 大日本住友製薬	500.00	6 343.80	0.00
JPY 住友電気工業	1 500.00	17 175.74	0.00
JPY 三井住友フィナンシャルグループ	3 100.00	90 138.58	0.02
JPY 三井住友トラスト・ホールディングス	600.00	17 555.50	0.00
JPY 住友不動産	900.00	29 388.64	0.01
JPY 武田薬品工業	3 600.00	129 292.74	0.03
JPY T D K	300.00	42 349.56	0.01
JPY 東京海上ホールディングス	1 500.00	74 658.36	0.02
JPY 東京電力ホールディングス	1 300.00	3 391.03	0.00
JPY 東京エレクトロン	300.00	102 047.47	0.02
JPY 東急不動産ホールディングス	1 500.00	7 278.83	0.00
JPY 凸版印刷	600.00	8 199.47	0.00
JPY 東芝	1 000.00	28 022.06	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 トヨタ自動車	4 800.00	322 178.85	0.06
JPY トレンドマイクロ	300.00	16 312.63	0.00
JPY ユニ・チャーム	800.00	38 843.44	0.01
JPY ユナイテッド・アーバン投資法人	10.00	11 316.23	0.00
JPY 西日本旅客鉄道	400.00	18 274.75	0.00
JPY ヤマダホールディングス	2 200.00	10 464.64	0.00
JPY ヤマハ発動機	900.00	17 348.36	0.00
JPY 山崎製パン	200.00	3 321.99	0.00
JPY 安川電機	500.00	24 118.92	0.01
JPY 横河電機	200.00	3 536.80	0.00
JPY 横浜ゴム	500.00	7 302.81	0.00
JPY Zホールディングス	5 300.00	33 393.43	0.01
日本合計		10 425 080.19	2.05
<b>ルクセンブルグ</b>			
EUR ARCELORMITTAL NPV (POST STOCK SPLIT)	4 177.00	76 696.70	0.02
EUR EUROFINS SCIENTIFI EURO.01	660.00	53 732.83	0.01
EUR TENARIS S.A. USD1	2 646.00	20 529.14	0.00
ルクセンブルグ合計		150 958.67	0.03
<b>オランダ</b>			
EUR ADYEN NV EURO.01	94.00	180 133.37	0.04
EUR AEGON NV EURO.12	9 140.00	34 286.73	0.01
EUR ASML HOLDING NV EURO.09	2 178.00	947 946.99	0.19
EUR CNH INDUSTRIAL NV COM EURO.01	5 411.00	59 341.15	0.01
EUR FIAT CHRYSLER AUTO EURO.01	5 330.00	83 305.50	0.02
EUR KONINKLIJKE DSM NV EUR1.5	907.00	148 964.10	0.03
EUR NN GROUP N.V. EURO.12	1 453.00	59 181.58	0.01
EUR PROSUS N.V. EURO.05	2 543.00	276 329.52	0.05
GBP ROYAL DUTCH SHELL PLC 'A' SHS EURO.07	13 151.00	223 187.66	0.04
オランダ合計		2 012 676.60	0.40
<b>ポルトガル</b>			
EUR EDP ENERGIAS PORTU EUR1 (REGD)	58 360.00	311 912.12	0.06
EUR GALP ENERGIA EUR1-B	3 426.00	37 063.95	0.01
EUR JERONIMO MARTINS EUR5	1 212.00	20 819.05	0.00
ポルトガル合計		369 795.12	0.07
<b>スペイン</b>			
EUR BANCO SANTANDER SA EURO.50 (REGD)	139 685.00	403 942.97	0.08
EUR BANKINTER SA EURO.3 (REGD)	2 848.00	14 134.72	0.00
EUR BBVA (BILB-VIZ-ARG) EURO.49	33 085.00	155 534.77	0.03
EUR MAPFRE SA EURO.10	3 305.00	6 353.19	0.00
スペイン合計		579 965.65	0.11
<b>スウェーデン</b>			
USD AUTOLIV INC COM	216.00	19 234.80	0.00
スウェーデン合計		19 234.80	0.00
<b>スイス</b>			
USD CHUBB LIMITED ORD CHF24.15	1 001.00	147 977.83	0.03
GBP COCA-COLA HBC AG ORD CHF6.70	524.00	15 124.62	0.00
USD GARMIN LTD COM CHF10.00	2 951.00	344 558.76	0.07
USD TE CONNECTIVITY LT COM CHF0.57	761.00	86 731.17	0.02
スイス合計		594 392.38	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 - 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>イギリス</b>			
GBP ADMIRAL GROUP ORD GBPO.001	587.00	22 389.58	0.01
USD AMCOR PLC ORD USDO.01	3 701.00	41 932.33	0.01
GBP ANGLO AMERICAN USDO.54945	3 691.00	109 073.97	0.02
GBP ANTOFAGASTA ORD GBPO.05	1 038.00	17 370.78	0.00
USD AON PLC COM USDO.01 CL A	547.00	112 074.83	0.02
GBP ASHTEAD GROUP ORD GBPO.10	1 488.00	63 192.30	0.01
GBP ASSOCD BRIT FOODS ORD GBPO.0568	856.00	24 113.14	0.01
GBP AUTO TRADER GROUP ORD GBPO.01	2 829.00	21 173.05	0.00
GBP BARCLAYS ORD GBPO.25	55 462.00	99 634.34	0.02
GBP BERKELEY GP HLDGS ORD GBPO.05	306.00	18 890.21	0.00
GBP BP ORD USDO.25	60 611.00	200 395.20	0.04
GBP BURBERRY GROUP ORD GBPO.0005	981.00	22 644.44	0.00
GBP COMPASS GROUP ORD GBPO.1105	5 265.00	93 064.47	0.02
GBP CRODA INTL ORD GBPO.10609756	374.00	29 738.83	0.01
GBP DIAGEO ORD GBPO.28 101/108	7 113.00	273 490.87	0.05
GBP DIRECT LINE INSURA ORD GBP 0.109090909	2 305.00	9 102.62	0.00
GBP FERGUSON PLC (NEW) ORD GBPO.10	725.00	81 536.84	0.02
GBP GLAXOSMITHKLINE ORD GBPO.25	15 835.00	289 625.08	0.06
GBP HARGREAVES LANSLOW ORD GBPO.004 (WI)	763.00	14 566.60	0.00
GBP HSBC HLDGS ORD USDO.50(UK REG)	62 606.00	324 507.67	0.06
GBP IMPERIAL BRANDS PL GBPO.10	2 594.00	47 133.06	0.01
GBP INTERCONTL HOTELS ORD GBPO.208521303	516.00	31 984.97	0.01
GBP INTERTEK GROUP ORD GBPO.01	415.00	30 594.41	0.01
GBP LEGAL & GENERAL GP ORD GBPO.025	19 059.00	64 298.80	0.01
USD LIBERTY GLOBAL INC USDO.01 C	826.00	17 874.64	0.00
USD LINDE PLC COM EURO.001	1 194.00	306 165.48	0.06
GBP LONDON STOCK EXCH ORD GBPO.06918604	1 003.00	108 543.81	0.02
GBP M&G PLC ORD GBPO.05	9 777.00	24 473.98	0.01
GBP MONDI ORD EURO.20	1 477.00	32 693.59	0.01
GBP MORRISON(W)SUPRMKT ORD GBPO.10	46 260.00	111 074.30	0.02
GBP NATWEST GROUP PLC ORD GBP1	14 914.00	30 782.30	0.01
GBP NEXT ORD GBPO.10	1 604.00	140 305.85	0.03
GBP PEARSON ORD GBPO.25	1 780.00	15 375.24	0.00
GBP PERSIMMON ORD GBPO.10	4 351.00	154 281.80	0.03
GBP PHOENIX GP HLDGS ORD GBPO.10	549.00	5 253.73	0.00
GBP PRUDENTIAL ORD GBPO.05	8 514.00	132 932.57	0.03
GBP RIO TINTO ORD GBPO.10	3 431.00	221 424.10	0.04
GBP RSA INSURANCE GRP ORD GBP1.00	4 459.00	40 123.14	0.01
GBP SAINSBURY(J) ORD GBPO.28571428	136 413.00	384 451.46	0.08
GBP SCHRODERS VTC SHS GBP1	291.00	12 505.80	0.00
GBP SMITH & NEPHEW ORD USDO.20	2 761.00	53 484.92	0.01
GBP STANDARD CHARTERED ORD USDO.50	6 736.00	40 665.88	0.01
GBP STD LIFE ABERDEEN ORD GBPO.1396825396	8 759.00	31 678.24	0.01
GBP TAYLOR WIMPEY ORD GBPO.01	10 289.00	21 147.09	0.00
GBP TESCO ORD GBPO.05	27 420.00	83 098.05	0.02
GBP UNILEVER PLC ORD GBPO.031111	3 590.00	219 080.24	0.04
EUR UNILEVER PLC ORD GBPO.031111	3 770.00	229 181.63	0.04
GBP VODAFONE GROUP ORD USDO.2095238(POST CONS)	343 312.00	566 873.28	0.11
<b>イギリス合計</b>		<b>5 025 999.51</b>	<b>0.99</b>
<b>アメリカ合衆国</b>			
USD ABBOTT LABS COM	6 550.00	708 841.00	0.14
USD ABBVIE INC COM USDO.01	3 965.00	414 659.70	0.08
USD ABIOMED INC COM	115.00	31 521.50	0.01
USD ACTIVISION BLIZZAR COM STK USDO.000001	1 835.00	145 845.80	0.03
USD ADOBE INC COM USDO.0001	1 536.00	734 929.92	0.14

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 ADVANCE AUTO PARTS COM USDO.0001	156.00	23 041.20	0.00
USD ADVANCED MICRO DEV COM USDO.01	2 592.00	240 174.72	0.05
USD AES CORP COM	1 352.00	27 634.88	0.01
USD AGILENT TECHNOLOGIES INC COM	666.00	77 855.40	0.02
USD AGNC INV CORP COM USDO.01	55 061.00	841 332.08	0.17
USD AIR PRODS & CHEMS COM USD1	487.00	136 428.18	0.03
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQ INC COM	289.00	47 317.97	0.01
USD ALEXION PHARMACEUT COM USDO.0001	6 789.00	829 004.79	0.16
USD ALLSTATE CORP COM	748.00	76 557.80	0.02
USD ALLY FINANCIAL INC COM USDO.01	1 067.00	31 636.55	0.01
USD ALPHABET INC CAP STK USDO.001 CL A	1 052.00	1 845 628.80	0.36
USD ALTRIA GROUP INC COM USDO.333333	4 249.00	169 237.67	0.03
USD AMAZON COM INC COM USDO.01	1 445.00	4 577 817.80	0.90
USD AMER EXPRESS CO COM USDO.20	1 616.00	191 641.44	0.04
USD AMER FINL GP OHIO COM NPV	182.00	16 272.62	0.00
USD AMER INTL GRP COM USD2.50	1 786.00	68 653.84	0.01
USD AMER TOWER CORP COM NEW USDO.01	1 000.00	231 200.00	0.05
USD AMEREN CORP COM	551.00	42 856.78	0.01
USD AMERIPRISE FINL INC COM	4 654.00	862 106.96	0.17
USD AMERISOURCEBERGEN COM STK USDO.01	369.00	38 047.59	0.01
USD AMETEK INC COM USDO.01	518.00	61 398.54	0.01
USD AMGEN INC COM USDO.0001	5 124.00	1 137 732.96	0.22
USD AMPHENOL CORP NEW CL A	708.00	92 613.48	0.02
USD ANALOG DEVICES INC COM	814.00	113 211.12	0.02
USD ANNALY CAPITAL MAN COM USDO.01	2 751.00	22 008.00	0.00
USD ANTHEM INC COM USDO.01	559.00	174 139.68	0.03
USD APOLLO GLOBAL MANA COM USDO.00001 CLASS A	310.00	13 522.20	0.00
USD APPLE INC COM NPV	75 735.00	9 016 251.75	1.77
USD APPLIED MATLS INC COM	9 564.00	788 838.72	0.15
USD ARAMARK COM USDO.01	612.00	21 420.00	0.00
USD ARCHER DANIELS MIDLAND CO COM	5 484.00	272 938.68	0.05
USD ASSURANT INC COM	175.00	22 596.00	0.00
USD AT&T INC COM USD1	16 292.00	468 395.00	0.09
USD ATHENE HOLDING LTD COM USDO.001 CL A	414.00	18 360.90	0.00
USD ATMOS ENERGY CORP COM	239.00	22 917.71	0.00
USD AUTO DATA PROCESS COM USDO.10	6 507.00	1 131 437.16	0.22
USD AUTODESK INC COM USDO.01	479.00	134 230.17	0.03
USD AUTOZONE INC COM USDO.01	51.00	58 020.15	0.01
USD AVALARA INC COM USDO.0001	200.00	34 350.00	0.01
USD AVALONBAY COMMUNI COM USDO.01	290.00	48 311.10	0.01
USD AVANTOR INC COM USDO.01	1 272.00	34 700.16	0.01
USD AVERY DENNISON CORP COM	200.00	29 868.00	0.01
USD AXALTA COATING SYS COM USD1.00	730.00	20 885.30	0.00
USD BALL CORP COM NPV	780.00	74 887.80	0.01
USD BAXTER INTL INC COM USD1	1 140.00	86 719.80	0.02
USD BECTON DICKINSON COM USD1	632.00	148 418.88	0.03
USD BEST BUY CO INC COM USDO.10	7 265.00	790 432.00	0.16
USD BIOGEN INC COM STK USDO.0005	3 279.00	787 517.43	0.15
USD BK OF AMERICA CORP COM USDO.01	17 621.00	496 207.36	0.10
USD BK OF NY MELLON CP COM STK USDO.01	1 649.00	64 508.88	0.01
USD BLACKSTONE GRP INC COM USDO.00001 CLASS A	1 500.00	89 325.00	0.02
USD BOEING CO COM USD5	1 207.00	254 326.97	0.05
USD BOOKING HLDGS INC COM USDO.008	92.00	186 617.40	0.04
USD BORG WARNER INC COM	580.00	22 533.00	0.00
USD BRISTOL-MYRS SQUIB COM STK USDO.10	5 133.00	320 299.20	0.06
USD BROADCOM CORP COM USD1.00	884.00	354 996.72	0.07
USD BUNGE LIMITED COM USDO.01	410.00	24 144.90	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 BURLINGTON STORES COM USD0.0001	160.00	34 966.40	0.01
USD CAPITAL ONE FINL COM USD0.01	944.00	80 844.16	0.02
USD CARDINAL HEALTH INC COM	654.00	35 701.86	0.01
USD CARLYLE GROUP INC COM USD0.01	200.00	5 682.00	0.00
USD CARMAX INC COM USD0.50	353.00	32 998.44	0.01
USD CARNIVAL CORP COM USD0.01(PAIRE STOCK)	1 388.00	27 732.24	0.01
USD CARRIER GLOBAL COR COM USD0.01	1 911.00	72 751.77	0.01
USD CATERPILLAR INC DEL COM	1 233.00	214 036.47	0.04
USD CBOE GLOBAL MARKET COM USD0.01	1 266.00	115 611.12	0.02
USD CBRE GROUP INC CLASS 'A' USD0.01	11 680.00	714 115.20	0.14
USD CELANESE CORP COM SERIES 'A' USD0.0001	253.00	32 720.49	0.01
USD CENTENE CORP DEL COM	1 321.00	81 439.65	0.02
USD CENTERPOINT ENERGY INC COM	936.00	21 705.84	0.00
USD CERIDIAN HCM HLDG COM USD0.01	300.00	28 926.00	0.01
USD CF INDS HLDGS INC COM	530.00	19 769.00	0.00
USD CH ROBINSON WORLDW COM USD0.1	5 746.00	539 951.62	0.11
USD CHARTER COMMUN INC COM USD0.001 CLASS 'A'	328.00	213 852.72	0.04
USD CHEVRON CORP COM USD0.75	4 343.00	378 622.74	0.07
USD CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC CL A	64.00	82 523.52	0.02
USD CHURCH & DWIGHT INC COM	5 459.00	479 136.43	0.09
USD CIGNA CORP COM USD0.25	832.00	174 004.48	0.03
USD CISCO SYSTEMS COM USD0.001	35 694.00	1 535 555.88	0.30
USD CITIGROUP INC COM USD0.01	4 795.00	264 060.65	0.05
USD CITIZENS FINL GP COM USD0.01	20 115.00	656 955.90	0.13
USD CITRIX SYSTEMS INC COM USD0.001	6 694.00	829 520.48	0.16
USD COGNIZANT TECHNOLO COM CL 'A' USD0.01	1 263.00	98 678.19	0.02
USD COMCAST CORP COM CLS 'A' USD0.01	10 260.00	515 462.40	0.10
USD COMERICA INC COM	231.00	11 365.20	0.00
USD CONAGRA BRANDS IN COM USD5	1 178.00	43 067.68	0.01
USD CONCHO RES INC COM USD0.001	558.00	32 073.84	0.01
USD CONOCOPHILLIPS COM USD0.01	2 444.00	96 684.64	0.02
USD CONSOLIDATED EDISON INC COM	759.00	57 873.75	0.01
USD COOPER COS INC COM USD0.10	118.00	39 555.96	0.01
USD CORNING INC COM USD0.50	1 872.00	70 050.24	0.01
USD CORTEVA INC COM USD0.01	1 471.00	56 368.72	0.01
USD COSTCO WHSL CORP NEW COM	1 008.00	394 904.16	0.08
USD CROWDSTRIKE HOLDIN COM USD0.0005 CL A	364.00	55 793.92	0.01
USD CROWN CASTLE INTL COM USD0.01	909.00	152 321.13	0.03
USD CROWN HOLDINGS INC COM USD5	371.00	34 966.75	0.01
USD CUMMINS INC COM	3 734.00	863 188.78	0.17
USD CVS HEALTH CORP COM STK USD0.01	4 621.00	313 257.59	0.06
USD D R HORTON INC COM	10 850.00	808 325.00	0.16
USD DANAHER CORP COM USD0.01	1 453.00	326 387.39	0.06
USD DARDEN RESTAURANTS INC COM	230.00	24 835.40	0.00
USD DATADOG INC COM USD0.00001 CL A	300.00	29 676.00	0.01
USD DAVITA INC COM USD0.001	7 224.00	793 556.40	0.16
USD DELL TECHNOLOGIES COM USD0.01 CL C	3 244.00	223 933.32	0.04
USD DELTA AIRLINES INC COM USD0.0001	331.00	13 322.75	0.00
USD DENTSPLY SIRONA IN COM NPV	453.00	23 053.17	0.00
USD DIAMONDBACK ENERGY COM USD0.01	343.00	13 706.28	0.00
USD DISCOVER FINL SVCS COM STK USD0.01	718.00	54 690.06	0.01
USD DISH NETWORK CORPO CLASS 'A' COM USD0.01	653.00	23 423.11	0.00
USD DOCUSIGN INC COM USD0.0001	385.00	87 733.80	0.02
USD DOLLAR GENERAL CP COM USD0.875	2 480.00	542 078.40	0.11
USD DOLLAR TREE INC	591.00	64 560.84	0.01
USD DOMINOS PIZZA INC COM USD0.01	89.00	34 938.73	0.01
USD DOVER CORP COM	283.00	34 534.49	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 DOW INC COM USDO.01	1 684.00	89 268.84	0.02
USD DTE ENERGY CO COM	437.00	54 978.97	0.01
USD DUPONT DE NEMOURS COM USDO.01	1 708.00	108 355.52	0.02
USD DYNATRACE INC COM USDO.001	350.00	13 307.00	0.00
USD EAST WEST BANCORP INC COM	37.00	1 580.64	0.00
USD EASTMAN CHEM CO COM	2 074.00	202 007.60	0.04
USD EBAY INC COM USDO.001	18 243.00	919 994.49	0.18
USD EDISON INTL COM	830.00	50 928.80	0.01
USD ELANCO ANIMAL HEAL COM NPV	1 018.00	31 140.62	0.01
USD ELECTRONIC ARTS INC COM	6 596.00	842 639.00	0.17
USD ELI LILLY AND CO COM NPV	5 084.00	740 484.60	0.15
USD EMERSON ELEC CO COM	1 358.00	104 321.56	0.02
USD ENTERGY CORP NEW COM	452.00	49 200.20	0.01
USD EQUINIX INC COM USDO.001 NEW	205.00	143 046.95	0.03
USD EQUITABLE HOLDINGS COM USDO.01	728.00	18 476.64	0.00
USD ESSENTIAL UTILS IN COM USDO.50	584.00	26 443.52	0.01
USD ESTEE LAUDER COS CLASS 'A' COM USDO.01	538.00	131 982.16	0.03
USD EVERGY INC COM NPV	460.00	25 488.60	0.01
USD EVERSOURCE ENERGY COM USD5	818.00	71 583.18	0.01
USD EXELON CORP COM NPV	2 243.00	92 120.01	0.02
USD EXPEDIA GROUP INC COM USDO.001	346.00	43 073.54	0.01
USD EXTRA SPACE STORAG COM USDO.01	334.00	37 651.82	0.01
USD EXXON MOBIL CORP COM NPV	9 629.00	367 153.77	0.07
USD FACEBOOK INC COM USDO.000006 CL 'A'	6 919.00	1 916 355.43	0.38
USD FED REALTY INV TR SBI USDO.01	66.00	5 756.52	0.00
USD FEDEX CORP COM USDO.10	552.00	158 192.16	0.03
USD FIDELITY NATL INF COM STK USDO.01	1 431.00	212 374.71	0.04
USD FIFTH THIRD BANCORP COM	21 272.00	539 032.48	0.11
USD FIRST REPUBLIC BAN COM USDO.01	403.00	52 212.68	0.01
USD FIRSTENERGY CORP COM USDO.10	1 283.00	34 076.48	0.01
USD FISERV INC COM USDO.01	1 239.00	142 708.02	0.03
USD FLEETCOR TECHNOLOG COM STK USDO.001	177.00	46 942.17	0.01
USD FORD MOTOR CO COM STK USDO.01	8 239.00	74 810.12	0.01
USD FORTUNE BRANDS HOME USDO.01 WI	344.00	28 724.00	0.01
USD FOX CORP COM USDO.01 CL A	879.00	25 350.36	0.00
USD FOX CORP COM USDO.01 CL B	245.00	6 953.10	0.00
USD FREEPORT-MCMORAN COM STK USDO.10	2 885.00	67 480.15	0.01
USD GENERAL MLS INC COM	7 799.00	474 335.18	0.09
USD GENERAL MOTORS CO COM USDO.01	2 997.00	131 388.48	0.03
USD GENUINE PARTS CO COM STK USD1	295.00	29 019.15	0.01
USD GILEAD SCIENCES COM USDO.001	2 837.00	172 120.79	0.03
USD GLOBAL PAYMENTS COM NPV	663.00	129 410.97	0.03
USD GLOBE LIFE INC COM USD1.00	253.00	23 554.30	0.00
USD GODADDY INC COM CL A USDO.001	431.00	34 281.74	0.01
USD GOLDMAN SACHS GRP COM USDO.01	738.00	170 168.04	0.03
USD GRAINGER W W INC COM	99.00	41 411.70	0.01
USD HALLIBURTON COM STK USD2.50	1 870.00	31 023.30	0.01
USD HARTFORD FINL SVCS COM USDO.01	722.00	31 912.40	0.01
USD HASBRO INC COM	258.00	24 001.74	0.00
USD HCA HEALTHCARE INC COM USDO.01	3 875.00	581 676.25	0.11
USD HD SUPPLY INC COM USDO.01	429.00	23 929.62	0.00
USD HEALTHPEAK PPTYS I COM USD1	1 521.00	43 896.06	0.01
USD HERSHEY COMPANY COM USD1.00	4 876.00	721 111.64	0.14
USD HESS CORPORATION COM USD1	765.00	36 092.70	0.01
USD HEWLETT PACKARD EN COM USDO.01	3 112.00	34 356.48	0.01
USD HILTON WORLDWIDE H COM USDO.01	638.00	66 115.94	0.01
USD HOLOGIC INC COM USDO.01	3 859.00	266 772.67	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 - 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 HOME DEPOT INC COM USDO.05	7 147.00	1 982 649.27	0.39
USD HORMEL FOODS CORP COM USDO.0586	689.00	32 507.02	0.01
USD HOST HOTELS & RESO COM STK USDO.01	1 544.00	21 662.32	0.00
USD HOWMET AEROSPACE I COM USD1.00	991.00	23 248.86	0.00
USD HP INC COM USDO.01	11 638.00	255 221.34	0.05
USD HUMANA INC COM USDO.166	286.00	114 548.72	0.02
USD HUNTINGTON BANCSHARES INC COM	1 924.00	23 241.92	0.00
USD HUNTINGTON INGALLS COM USDO.01	73.00	11 693.87	0.00
USD IAC/INTERACTIVECOR COM USDO.001	193.00	27 404.07	0.01
USD INGERSOLL RAND INC COM USD1.00	929.00	41 126.83	0.01
USD INGREDION INC COM USDO.01	106.00	8 177.90	0.00
USD INTEL CORP COM USDO.001	30 062.00	1 453 497.70	0.29
USD INTL BUSINESS MCHN COM USDO.20	5 522.00	682 077.44	0.13
USD INTL PAPER CO COM USD1.00	969.00	47 946.12	0.01
USD INTUIT INC COM USDO.01	579.00	203 819.58	0.04
USD INVESCO LTD COM STK USDO.20	1 093.00	17 739.39	0.00
USD IQVIA HOLDINGS INC COM USDO.01	413.00	69 792.87	0.01
USD IRON MTN INC NEW COM NPV	5 455.00	150 012.50	0.03
USD JACOBS ENG GROUP COM USD1	294.00	31 704.96	0.01
USD JOHNSON CTLS INTL COM USDO.01	1 721.00	79 234.84	0.02
USD JONES LANG LASALLE INC COM	80.00	10 583.20	0.00
USD KANSAS CITY STHN I COM USDO.01	222.00	41 329.74	0.01
USD KELLOGG CO COM USDO.25	532.00	34 000.12	0.01
USD KEURIG DR PEPPER COM USDO.01	1 083.00	32 977.35	0.01
USD KEYCORP NEW COM	2 509.00	38 789.14	0.01
USD KEYSIGHT TECHNOLOG COM USDO.01 'WD'	393.00	47 175.72	0.01
USD KIMBERLY-CLARK CP COM USD1.25	807.00	112 423.17	0.02
USD KINDER MORGAN INC USDO.01	12 352.00	177 621.76	0.03
USD KKR & CO INC COM NPV CLASS A	1 067.00	40 471.31	0.01
USD KLA CORPORATION COM USDO.001	3 171.00	798 996.87	0.16
USD KNIGHT SWIFT TRANS CL A COM STK USDO.01	10 993.00	453 900.97	0.09
USD KROGER CO COM USD1	26 233.00	865 689.00	0.17
USD L3HARRIS TECHNOLOG COM USD1.00	457.00	87 739.43	0.02
USD LAB CORP AMER HLDG COM USDO.1	611.00	122 102.24	0.02
USD LAM RESEARCH CORP COM USDO.001	314.00	142 135.24	0.03
USD LAS VEGAS SANDS CORP COM	827.00	46 072.17	0.01
USD LEAR CORP COM USDO.01	161.00	23 014.95	0.00
USD LENNAR CORP COM CL 'A' USDO.10	2 828.00	214 532.08	0.04
USD LINCOLN NATL CORP COM NPV	538.00	25 404.36	0.00
USD LKQ CORP COM	579.00	20 392.38	0.00
USD LOWE 'S COS INC COM USDO.50	8 016.00	1 249 053.12	0.25
USD LUMEN TECHNOLOGIES COM USD1.00	61 581.00	643 521.45	0.13
USD MARATHON PETROLEUM COM USDO.01	1 318.00	51 243.84	0.01
USD MARRIOTT INTL INC COM USDO.01 CLASS 'A'	643.00	81 577.41	0.02
USD MASCO CORP COM	580.00	31 128.60	0.01
USD MASTERCARD INC COM USDO.0001 CLASS 'A'	2 899.00	975 542.49	0.19
USD MATCH GRP INC NEW COM NPV	516.00	71 832.36	0.01
USD MCCORMICK & CO INC COM N/VTG NPV	244.00	45 623.12	0.01
USD MCDONALD 'S CORP COM USDO.01	1 692.00	367 908.48	0.07
USD MCKESSON CORP COM USDO.01	357.00	64 227.87	0.01
USD MERCK & CO INC COM USDO.50	5 703.00	458 464.17	0.09
USD METLIFE INC COM USDO.01	1 696.00	78 304.32	0.02
USD MGM RESORTS INTL COM STK USDO.01	907.00	25 622.75	0.01
USD MICROCHIP TECHNLY COM USDO.001	553.00	74 317.67	0.01
USD MICRON TECHNOLOGY COM USDO.10	2 534.00	162 404.06	0.03
USD MICROSOFT CORP COM USDO.0000125	26 886.00	5 755 486.02	1.13
USD MID-AMER APARTMENT COM STK USDO.01	203.00	25 610.48	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 MODERNA INC COM USDO.0001	600.00	91 644.00	0.02
USD MOHAWK INDS COM USDO.01	129.00	16 232.07	0.00
USD MOLSON COORS BEVER COM USDO.01 CLASS B	463.00	21 298.00	0.00
USD MONDELEZ INTL INC COM USDO.01	3 311.00	190 216.95	0.04
USD MORGAN STANLEY COM STK USDO.01	5 022.00	310 510.26	0.06
USD MOSAIC CO COM USDO.01	984.00	21 608.64	0.00
USD MOTOROLA SOLUTIONS COM USDO.01	383.00	65 695.99	0.01
USD MSCI INC COM STK USSO.01	2 113.00	865 104.46	0.17
USD NATIONAL OILWELL VARCO INC COM	820.00	10 053.20	0.00
USD NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	149.00	5 617.30	0.00
USD NETAPP INC COM USDO.001	10 394.00	554 104.14	0.11
USD NETFLIX INC COM USDO.001	993.00	487 265.10	0.10
USD NEWELL BRANDS INC COM USD1	1 127.00	23 960.02	0.00
USD NEWMONT CORPORATIO COM USD1.60	5 415.00	318 510.30	0.06
USD NIELSEN HLDGS PLC COM EURO.07	97.00	1 568.49	0.00
USD NIKE INC CLASS ' B ' COM NPV	2 825.00	380 527.50	0.07
USD NISOURCE INC COM NPV	1 085.00	26 257.00	0.01
USD NORFOLK STHN CORP COM USD1	555.00	131 546.10	0.03
USD NORTHERN TRUST CP COM USD1.666	495.00	46 094.40	0.01
USD NORTONLIFELOCK INC COM USDO.01	1 176.00	21 438.48	0.00
USD NRG ENERGY INC COM USDO.01	628.00	20 567.00	0.00
USD NUCOR CORP COM	713.00	38 288.10	0.01
USD NVIDIA CORP COM USDO.001	1 371.00	734 938.26	0.14
USD NVR INC COM STK USDO.01	34.00	135 904.12	0.03
USD OCCIDENTAL PETRLM COM USDO.20	1 702.00	26 823.52	0.01
USD OGE ENERGY CORP COM USDO.01	483.00	15 644.37	0.00
USD OLD DOMINION FGHT LINES INC COM	210.00	42 705.60	0.01
USD OMNICOM GROUP INC COM USDO.15	412.00	25 956.00	0.01
USD ON SEMICONDUCTOR COM USDO.01	1 121.00	32 228.75	0.01
USD ONEOK INC	821.00	29 449.27	0.01
USD ORACLE CORP COM USDO.01	22 085.00	1 274 746.20	0.25
USD OREILLY AUTO NEW COM USDO.01	157.00	69 463.08	0.01
USD OTIS WORLDWIDE COR COM USDO.01	1 005.00	67 274.70	0.01
USD OWENS CORNING COM STK USDO.01	154.00	11 221.98	0.00
USD PACCAR INC COM STK USD1	772.00	67 210.32	0.01
USD PACKAGING CORP AMER COM	245.00	31 850.00	0.01
USD PALO ALTO NETWORKS COM USDO.0001	219.00	64 368.48	0.01
USD PARKER-HANNIFIN COM STK USDO.50	292.00	78 039.92	0.02
USD PAYCHEX INC COM	9 730.00	906 349.50	0.18
USD PAYPAL HOLDINGS IN COM USDO.0001	2 511.00	537 655.32	0.11
USD PELOTON INTERACTIV COM USDO.000025 CL A	500.00	58 175.00	0.01
USD PFIZER INC COM USDO.05	26 275.00	1 006 595.25	0.20
USD PG&E CORP COM	1 869.00	23 736.30	0.00
USD PHILLIPS 66 COM USDO.01	1 100.00	66 638.00	0.01
USD PINNACLE WEST CAP CORP COM	244.00	19 971.40	0.00
USD PINTEREST INC COM USDO.00001 CL A	800.00	56 016.00	0.01
USD PNC FINANCIAL SVCS COM USD5	956.00	131 994.92	0.03
USD PPL CORP COM USDO.01	1 912.00	54 339.04	0.01
USD PRINCIPAL FINL GP COM USDO.01	541.00	26 936.39	0.01
USD PROCTER & GAMBLE COM NPV	5 617.00	780 032.79	0.15
USD PROLOGIS INC COM USDO.01	1 724.00	172 486.20	0.03
USD PRUDENTIAL FINL COM USDO.01	913.00	69 041.06	0.01
USD PUBLIC SVC ENTERPRISE GROUP COM	1 180.00	68 770.40	0.01
USD QUALCOMM INC COM USDO.0001	9 860.00	1 451 096.20	0.28
USD QUEST DIAGNOSTICS INC COM	281.00	34 838.38	0.01
USD RAYMOND JAMES FINANCIAL INC COM	249.00	22 646.55	0.00
USD RAYTHEON TECHNOLOG COM USD1.00	3 452.00	247 577.44	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 - 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 REGENCY CENTERS COM USDO.01	546.00	24 886.68	0.00
USD REGENERON PHARMACE COM USDO.001	1 660.00	856 609.80	0.17
USD REGIONS FINANCIAL CORP NEW COM	15 271.00	233 188.17	0.05
USD REINSURANCE GROUP COM USDO.01	120.00	13 833.60	0.00
USD REPUBLIC SERVICES COM USDO.01	588.00	56 871.36	0.01
USD ROBERT HALF INTL COM USDO.001	300.00	19 254.00	0.00
USD ROCKWELL AUTOMATIO COM USD1	240.00	61 334.40	0.01
USD ROSS STORES INC COM USDO.01	819.00	88 058.88	0.02
USD ROYAL CARIBBEAN GR COM USDO.01	364.00	28 686.84	0.01
USD SALESFORCE.COM INC COM USDO.001	2 040.00	501 432.00	0.10
USD SBA COMMUNICATIONS COM USDO.01 CL A	235.00	67 487.30	0.01
USD SCHEIN HENRY INC COM	327.00	21 029.37	0.00
USD SCHLUMBERGER COM USDO.01	2 645.00	54 989.55	0.01
USD SCHWAB(CHARLES)CP COM USDO.01	3 504.00	170 925.12	0.03
USD SEAGEN INC COM USDO.001	280.00	47 686.80	0.01
USD SEALED AIR CORP NEW COM	262.00	11 805.72	0.00
USD SEI INVESTMENT COM USDO.01	353.00	18 620.75	0.00
USD SENSATA TECHNO PLC COM EURO.01	357.00	17 432.31	0.00
USD SERVICENOW INC COM USDO.001	416.00	222 372.80	0.04
USD SIGNATURE BK COM USDO.01	155.00	17 389.45	0.00
USD SIMON PROP GROUP COM USDO.0001	725.00	59 863.25	0.01
USD SIRIUS XM HLDGS IN COM USDO.001	121 366.00	787 665.34	0.15
USD SKYWORKS SOLUTIONS INC COM	375.00	52 938.75	0.01
USD SLACK TECHNOLOGIES COM USDO.0001 CL A	857.00	36 748.16	0.01
USD SMUCKER(JM)CO COM NPV	260.00	30 472.00	0.01
USD SNAP-ON INC COM USD1	69.00	12 133.65	0.00
USD SNOWFLAKE INC COM USDO.0001 CLASS A	100.00	32 584.00	0.01
USD SOUTHWEST AIRLINES COM USD1	453.00	20 992.02	0.00
USD SQUARE INC COM USDO.0000001 CL A	789.00	166 447.44	0.03
USD STANLEY BLACK & DE COM USD2.50	362.00	66 720.22	0.01
USD STARBUCKS CORP COM USDO.001	2 703.00	264 948.06	0.05
USD STATE STREET CORP COM STK USD1	692.00	48 772.16	0.01
USD STEEL DYNAMICS INC COM	485.00	17 561.85	0.00
USD SYNCHRONY FINANCIA COM USDO.001	1 393.00	42 444.71	0.01
USD SYSCO CORP COM USD1	1 076.00	76 708.04	0.02
USD T ROWE PRICE GROUP COM USDO.20	1 520.00	217 983.20	0.04
USD T-MOBILE US INC COM USDO.0001	1 258.00	167 238.52	0.03
USD TARGET CORP COM STK USDO.0833	1 095.00	196 585.35	0.04
USD TELEFLEX INC COM	107.00	40 954.25	0.01
USD TESLA INC COM USDO.001	1 675.00	950 730.00	0.19
USD TEXAS INSTRUMENTS COM USD1	4 189.00	675 476.25	0.13
USD THERMO FISHER SCIE COM USD1	874.00	406 392.52	0.08
USD TIFFANY & CO NEW COM	294.00	38 655.12	0.01
USD TJX COS INC COM USD1	2 651.00	168 365.01	0.03
USD TRACTOR SUPPLY CO COM USDO.008	252.00	35 484.12	0.01
USD TRADEWEB MARKETS I COM USDO.00001 CL A	200.00	11 930.00	0.00
USD TRANE TECHNOLOGIES COM USD1	549.00	80 285.76	0.02
USD TRANSDIGM GROUP INC COM	129.00	74 715.51	0.01
USD TRAVELERS CO INC COM NPV	596.00	77 271.40	0.02
USD TRUIST FINL CORP COM USD5	3 181.00	147 662.02	0.03
USD TWITTER INC COM USDO.000005	1 691.00	78 648.41	0.02
USD TYSON FOODS INC CL A	704.00	45 900.80	0.01
USD UBER TECHNOLOGIES COM USDO.00001	2 100.00	104 286.00	0.02
USD UGI CORP NEW COM	422.00	14 972.56	0.00
USD ULTA BEAUTY INC COM STK USD0.01	111.00	30 569.40	0.01
USD UNION PACIFIC CORP COM USD2.50	1 528.00	311 834.24	0.06
USD UNITED RENTALS INC COM	163.00	36 997.74	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 UNITEDHEALTH GRP COM USDO.01	2 149.00	722 794.66	0.14
USD UNIVERSAL HEALTH S CLASS 'B' COM USDO.01	1 659.00	216 632.22	0.04
USD US BANCORP COM USDO.01	2 972.00	128 420.12	0.03
USD VAIL RESORTS INC COM	98.00	27 032.32	0.01
USD VALERO ENERGY CORP NEW COM	7 407.00	398 274.39	0.08
USD VARIAN MEDICAL SYS COM USD1	201.00	34 969.98	0.01
USD VEREIT INC COM USDO.001	1 844.00	13 073.96	0.00
USD VERIZON COMMUN COM USDO.10	9 450.00	570 874.50	0.11
USD VF CORP COM NPV	758.00	63 217.20	0.01
USD VIACOMCBS INC COM USDO.001 CL B	1 378.00	48 615.84	0.01
USD VIATRIS INC COM USDO.01	11 553.00	194 321.46	0.04
USD VISA INC COM STK USDO.0001	3 801.00	799 540.35	0.16
USD VISTRA CORP COM USDO.01	38 495.00	719 086.60	0.14
USD VONTIER CORP COM USDO.0001	0.80	26.54	0.00
USD VOYA FINL INC COM USDO.01	284.00	16 366.92	0.00
USD WALGREENS BOOTS AL COM USDO.01	1 868.00	71 002.68	0.01
USD WALMART INC COM USDO.10	3 193.00	487 858.47	0.10
USD WALT DISNEY CO. DISNEY COM USDO.01	4 071.00	602 548.71	0.12
USD WASTE MGMT INC DEL COM	965.00	114 960.45	0.02
USD WELLS FARGO & CO COM USD1 2/3	8 599.00	235 182.65	0.05
USD WELLTOWER INC COM USD1	9 349.00	588 800.02	0.12
USD WESTERN DIGITAL CORP COM	799.00	35 859.12	0.01
USD WESTROCK CO COM USDO.01	3 276.00	138 279.96	0.03
USD WEYERHAEUSER CO COM USD1.25	1 722.00	50 006.88	0.01
USD WHIRLPOOL CORP COM	1 055.00	205 313.55	0.04
USD WILLIAMS COS INC COM USD1	2 990.00	62 730.20	0.01
USD WORKDAY INC COM USDO.001 CL A	381.00	85 644.99	0.02
USD WYNN RESORTS LTD COM	288.00	28 944.00	0.01
USD XILINX INC COM USDO.01	634.00	92 278.70	0.02
USD XPO LOGISTICS INC COM USDO.001	163.00	17 388.84	0.00
USD XYLEM INC COM USDO.01 WI	368.00	35 316.96	0.01
USD YUM BRANDS INC COM	5 575.00	589 835.00	0.12
USD ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC COM USDO.01	467.00	69 639.04	0.01
USD ZIONS BANCORPORATI COM USDO.001	143.00	5 518.37	0.00
USD ZOOM VIDEO COMMUNI COM USDO.001 CL A	400.00	191 344.00	0.04
アメリカ合衆国合計		99 690 543.34	19.56
記名株式合計		134 971 568.13	26.49
預託証券			
アイルランド			
AUD JAMES HARDIE ID PLC CUFS EURO.5	2 473.00	71 886.98	0.01
アイルランド合計		71 886.98	0.01
ルクセンブルグ			
EUR SES S.A. FDR EACH REP 1 'A' NPV	1 857.00	16 939.96	0.00
ルクセンブルグ合計		16 939.96	0.00
オランダ			
EUR ABN AMRO BANK N.V. DR EACH REP SHS	2 041.00	21 118.49	0.01
オランダ合計		21 118.49	0.01
預託証券合計		109 945.43	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 (%)
<b>投資信託、クローズド・エンド型</b>			
イギリス			
GBP SEGRO PLC REIT	4 009.00	48 812.20	0.01
イギリス合計		48 812.20	0.01
アメリカ合衆国			
USD DUKE REALTY CORP REIT	764.00	29 077.84	0.00
USD VENTAS INC REIT	16 928.00	811 020.48	0.16
アメリカ合衆国合計		840 098.32	0.16
投資信託、クローズド・エンド型合計		888 910.52	0.17
<b>新株引受権</b>			
フランス			
EUR ALSTOM SA RIGHTS 30.11.20	863.00	4 859.13	0.00
フランス合計		4 859.13	0.00
スペイン			
EUR BANCO SANTANDER SA RIGHTS 30.11.20	83 133.00	10 411.76	0.00
スペイン合計		10 411.76	0.00
イギリス			
GBP AVEVA GROUP PLC RIGHTS 09.12.20	135.33	2 023.58	0.00
イギリス合計		2 023.58	0.00
新株引受権合計		17 294.47	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	150 000.00	169 048.82	0.03
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.12500% 18-15.11.28	400 000.00	475 375.00	0.09
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.00000% 16-15.11.26	170 000.00	185 067.58	0.04
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 17-15.02.27	220 000.00	243 349.21	0.05
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.50000% 14-15.05.24	63 000.00	67 924.33	0.01
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.37500% 17-15.05.27	300 000.00	335 015.61	0.07
米ドル合計		1 475 780.55	0.29
財務省証券 (T-note)、固定利付債合計		1 475 780.55	0.29
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		210 795 539.24	41.36
<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>財務省証券 (T-bill)、ゼロ・クーポン</b>			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 11.06.20-10.12.20	6 000 000.00	5 999 921.22	1.18
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 23.07.20-21.01.21	6 000 000.00	5 999 320.02	1.18
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 13.08.20-11.02.21	6 000 000.00	5 999 010.00	1.18
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 05.12.19-03.12.20	3 500 000.00	3 499 989.78	0.68
米ドル合計		21 498 241.02	4.22
財務省証券 (T-bill)、ゼロ・クーポン合計		21 498 241.02	4.22
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		21 498 241.02	4.22

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 譲渡性のある証券および短期金融商品			
記名株式			
アラブ首長国連邦 GBP NMC HEALTH PLC ORD GBPO.1	225.00	0.00	0.00
アラブ首長国連邦合計		0.00	0.00
記名株式合計			
		0.00	0.00
新株引受権			
ドイツ EUR KION GROUP AG RIGHTS 03.12.20	362.00	0.00	0.00
ドイツ合計		0.00	0.00
新株引受権合計			
		0.00	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 譲渡性のある証券および短期金融商品合計			
		0.00	0.00
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 NEUBERGER BERMAN EUROPE LTD-STRATEGIC INC FD-I-ACC	1 837 479.00	24 070 974.90	4.72
USD PIMCO GIS DIVERSIFIED INCOME FUND-INSTITUTIONAL CLASS-USD-ACC	2 654 598.00	73 665 094.50	14.46
アイルランド合計		97 736 069.40	19.18
ルクセンブルグ			
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD U-X-ACC	1 654.00	34 600 108.70	6.79
USD UBS (LUX) BOND SICAV - ASIAN HIGH YIELD U-X-ACC	2 540.00	31 153 531.80	6.11
USD UBS (LUX) BOND SICAV-SHORT DURATION H Y SUST (USD) I-X-ACC	201 472.00	25 659 473.92	5.04
USD UBS (LUX) BOND SICAV-ASIAN INVST GRADE BONDS (USD)-U-X-CAP	443.00	5 702 198.54	1.12
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD INVEST GRADE CORP USD U X ACC	122.00	1 499 327.54	0.30
USD UBS (LUX) EMERGING ECONOMIES FUND-GLOBAL BONDS (USD)-U-X ACC	1 213.00	17 440 659.56	3.42
USD UBS (LUX) INSTITUTIONAL SICAV - E MARKETS EQUITY PASS FA USD	2 080.71	31 918 321.34	6.26
USD UBS LUX BOND SICAV-EMERGING ECONOMIES CORP USD-I-X-ACC	135 441.00	17 412 294.96	3.42
ルクセンブルグ合計		165 385 916.36	32.46
投資信託、オープン・エンド型合計			
		263 121 985.76	51.64
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			
		263 121 985.76	51.64
公認の証券取引所に上場されている派生商品			
ワラント債			
アメリカ合衆国 USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP CALL WARRANT 22.00000 20-03.08.27	74.00	380.36	0.00
アメリカ合衆国合計		380.36	0.00
ワラント債合計			
		380.36	0.00
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計			
		380.36	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 (%)
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			
<b>豪ドル</b>			
AUD GOLDMAN SACHS/S&P/ASX 200 INDEX CALL 6772.75200 09.12.20	-980.00	-3 669.83	0.00
AUD MORGAN STANLEY/S&P/ASX 200 INDEX CALL 6961.17770 23.12.20	-1 000.00	-4 423.48	0.00
<b>豪ドル合計</b>		<b>-8 093.31</b>	<b>0.00</b>
<b>ユーロ</b>			
EUR GOLDMAN SACHS/EURO STOXX 50 CALL 3647.94630 09.12.20	-4 620.00	-9 175.17	0.00
EUR HSBC/EURO STOXX 50 CALL 3662.91170 23.12.20	-4 500.00	-44 836.01	-0.01
<b>ユーロ合計</b>		<b>-54 011.18</b>	<b>-0.01</b>
<b>英ポンド</b>			
GBP GOLDMAN SACHS/FTSE 100 INDEX CALL 6690.99360 09.12.20	-490.00	-399.86	0.00
GBP MORGAN STANLEY/FTSE 100 INDEX CALL 6663.35040 23.12.20	-400.00	-4 883.00	0.00
<b>英ポンド合計</b>		<b>-5 282.86</b>	<b>0.00</b>
<b>日本円</b>			
JPY GOLDMAN SACHS/TOPIX INDEX (TOKYO) CALL 1831.71310 09.12.20	-493 580.00	-7 264.55	0.00
JPY GOLDMAN SACHS/TOPIX INDEX (TOKYO) CALL 1883.91240 23.12.20	-470 150.00	-10 003.43	0.00
<b>日本円合計</b>		<b>-17 267.98</b>	<b>0.00</b>
<b>米ドル</b>			
USD UBS/S&P 500 INDEX CALL 3694.73840 02.12.20	-8 320.00	-3 604.63	0.00
USD BNP/MSCI EM INDEX CALL 1240.35170 09.12.20	-12 380.00	-36 513.06	-0.01
USD CIBC/S&P 500 INDEX CALL 3747.72030 09.12.20	-8 250.00	-13 533.37	0.00
USD CIBC/S&P 500 INDEX CALL 3721.20500 16.12.20	-8 280.00	-90 686.25	-0.02
USD CIBC/S&P 500 INDEX CALL 3789.35460 23.12.20	-8 370.00	-51 094.59	-0.01
USD UBS/MSCI EM INDEX CALL 1282.42710 23.12.20	-12 010.00	-35 594.72	-0.01
<b>米ドル合計</b>		<b>-231 026.62</b>	<b>-0.05</b>
<b>指数に係るオプション、従来型合計</b>		<b>-315 681.95</b>	<b>-0.06</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 取引されていない派生商品合計		-315 681.95	-0.06
<b>投資有価証券合計</b>		<b>495 100 464.43</b>	<b>97.16</b>

## 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 20-29.01.21	19 453 361.70	2 667 264.59	0.52
USD UBS/FTSE EEPRA NAREIT DVLPD TR EQS PAYER 3ML 20-29.01.21			
<b>指数に係るスワップおよび先渡スワップ合計</b>		<b>2 667 264.59</b>	<b>0.52</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 取引されていない派生商品合計		2 667 264.59	0.52
<b>派生商品合計</b>		<b>2 667 264.59</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 - 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					
購入通貨 / 購入額 / 売却通貨 / 売却額 / 満期日 (日 - 月 - 年)					
EUR	400 000.00	USD 472 183.20	8.1.2021	6 911.65	0.00
USD	38 692.45	HKD 300 000.00	8.1.2021	-7.37	0.00
USD	5 566 284.52	AUD 7 898 000.00	8.1.2021	-255 737.94	-0.05
USD	123 666.45	GBP 95 438.00	8.1.2021	-3 828.52	0.00
USD	658 481.46	CAD 867 500.00	8.1.2021	-11 145.29	0.00
USD	681 522.93	SGD 925 000.00	8.1.2021	-8 947.68	0.00
USD	1 299 210.54	HKD 10 072 500.00	8.1.2021	-135.81	0.00
USD	4 492 407.25	JPY 473 708 172.00	8.1.2021	-54 540.74	-0.01
USD	485 872.99	SEK 4 280 000.00	8.1.2021	-15 217.21	-0.01
USD	20 749 896.99	EUR 17 585 344.00	8.1.2021	-312 722.52	-0.06
USD	264 193.94	CHF 239 500.00	8.1.2021	-773.05	0.00
JPY	27 058 100.00	USD 259 085.63	8.1.2021	634.98	0.00
AUD	240 438.78	USD 170 781.74	8.1.2021	6 458.06	0.00
EUR	43 707.34	USD 51 897.53	8.1.2021	452.37	0.00
GBP	40 000.00	USD 52 400.76	8.1.2021	1 034.97	0.00
USD	234 822.72	AUD 330 000.00	8.1.2021	-8 437.27	0.00
USD	569 377.44	EUR 480 000.00	8.1.2021	-5 536.38	0.00
USD	253 144.24	JPY 26 500 000.00	8.1.2021	-1 219.37	0.00
EUR	1 040 000.00	USD 1 216 818.72	8.1.2021	28 827.90	0.01
USD	577 434.63	EUR 495 000.00	8.1.2021	-15 445.25	0.00
SGD	86 642 700.00	USD 63 639 249.56	4.12.2020	1 033 880.39	0.19
SGD	241 900.00	USD 178 862.83	4.12.2020	1 699.76	0.00
SGD	1 632 800.00	USD 1 211 918.96	4.12.2020	6 859.85	0.00
SGD	345 300.00	USD 255 655.06	4.12.2020	2 088.89	0.00
SGD	850 000.00	USD 630 451.08	4.12.2020	4 018.53	0.00
USD	256 954.04	GBP 195 000.00	8.1.2021	-3 545.13	0.00
USD	20 228 105.02	EUR 17 010 343.41	4.2.2021	-157 445.29	-0.03
USD	5 839 245.22	AUD 7 968 000.00	4.2.2021	-35 345.84	-0.01
USD	252 019.92	GBP 190 438.85	4.2.2021	-2 417.74	0.00
USD	4 542 696.35	JPY 473 148 172.00	4.2.2021	-319.74	0.00
USD	1 338 077.70	HKD 10 372 500.00	4.2.2021	-11.96	0.00
USD	663 335.84	CAD 867 500.00	4.2.2021	-6 335.10	0.00
USD	252 676.22	CHF 229 500.00	4.2.2021	-1 415.92	0.00
USD	497 477.86	SEK 4 280 000.00	4.2.2021	-3 767.09	0.00
USD	680 952.02	SGD 915 000.00	4.2.2021	-2 081.57	0.00
USD	260 684.92	SGD 350 000.00	4.12.2020	-567.27	0.00
USD	536 238.57	SGD 719 800.00	4.12.2020	-1 045.23	0.00
SGD	1 499 300.00	USD 1 114 431.19	4.12.2020	4 698.57	0.00
USD	1 308 541.96	EUR 1 100 000.00	4.2.2021	-9 720.98	0.00
USD	1 307 765.58	EUR 1 100 000.00	8.1.2021	-9 745.27	0.00
USD	595 815.44	SGD 799 800.00	4.12.2020	-1 183.15	0.00
USD	299 599.26	SGD 400 800.00	4.12.2020	428.18	0.00
先渡為替契約合計				169 352.42	0.03
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				10 879 650.86	2.14
その他の資産および負債				743 354.39	0.15
純資産総額				509 560 086.69	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 - フィクスト・インカム (米ドル)

## 2020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 ALBERTA, PROVINCE OF 3.30000% 18-15.03.28	200 000.00	231 140.00	0.20
USD AMERICAN EXPRESS CO 3.40000% 18-27.02.23	230 000.00	244 755.42	0.21
USD APPLE INC 1.65000% 20-11.05.30	375 000.00	387 863.03	0.34
USD APPLE INC 2.20000% 19-11.09.29	500 000.00	539 823.15	0.47
USD APPLE INC 2.25000% 16-23.02.21	195 000.00	195 557.70	0.17
USD APPLE INC 2.40000% 13-03.05.23	200 000.00	209 959.08	0.18
USD APPLE INC 2.45000% 16-04.08.26	600 000.00	653 146.20	0.56
USD APPLE INC 3.25000% 16-23.02.26	500 000.00	560 476.00	0.48
USD APPLE INC 3.45000% 14-06.05.24	400 000.00	440 359.20	0.38
USD BAYER US FINANCE II LLC-REG-S 3.87500% 18-15.12.23	200 000.00	218 512.28	0.19
USD BERKSHIRE HATHAWAY FINANCE CORP 1.85000% 20-12.03.30	200 000.00	210 334.16	0.18
USD BERKSHIRE HATHAWAY INC 2.75000% 16-15.03.23	700 000.00	735 900.48	0.64
USD BERKSHIRE HATHAWAY INC 3.12500% 16-15.03.26	175 000.00	196 443.52	0.17
USD CHEVRON CORP 2.23600% 20-11.05.30	500 000.00	537 533.25	0.46
USD EQUINOR ASA 2.37500% 20-22.05.30	300 000.00	320 374.92	0.28
USD EQUINOR ASA 3.62500% 18-10.09.28	580 000.00	677 744.27	0.59
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.37500% 17-24.05.27	300 000.00	332 100.12	0.29
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.62500% 19-20.05.22	340 000.00	352 144.97	0.30
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.87500% 20-17.05.30	501 000.00	498 790.66	0.43
USD EXXON MOBIL CORP 3.04300% 16-01.03.26	550 000.00	608 307.37	0.53
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.25000% 19-18.06.29	800 000.00	886 752.88	0.77
USD INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 2.85000% 19-13.05.22	475 000.00	492 774.79	0.43
USD JOHNSON & JOHNSON 1.30000% 20-01.09.30	350 000.00	351 394.58	0.30
USD JOHNSON & JOHNSON 2.45000% 16-01.03.26	200 000.00	217 740.30	0.19
USD JOHNSON & JOHNSON 2.90000% 17-15.01.28	500 000.00	563 369.90	0.49
USD JOHNSON & JOHNSON 3.37500% 13-05.12.23	550 000.00	600 584.05	0.52
USD KOREA DEVELOPMENT BANK 4.62500% 11-16.11.21	700 000.00	727 781.25	0.63
USD KOREA HYDRO&NUCLEAR POWER CO LTD-REG-S 3.12500% 17-25.07.27	600 000.00	665 812.50	0.58
USD KOREA RESOURCES CORP-REG-S 3.00000% 17-24.04.22	400 000.00	411 875.00	0.36
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.12500% 13-17.01.23	190 000.00	197 676.95	0.17
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.00000% 15-02.05.25	350 000.00	374 649.45	0.32
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.87500% 18-03.04.28	580 000.00	668 731.65	0.58
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 1.75000% 19-14.09.29	600 000.00	644 174.52	0.56
USD KUWAIT INTERNATIONAL GOVT BOND-REG-S 3.50000% 17-20.03.27	900 000.00	1 024 875.00	0.89
USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 2.00000% 15-13.01.25	500 000.00	532 108.25	0.46
USD MICROSOFT CORP 3.30000% 17-06.02.27	850 000.00	970 762.05	0.84
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 3.10000% 17-17.05.27	475 000.00	535 233.75	0.46
USD ONTARIO, PROVINCE OF 2.00000% 19-02.10.29	475 000.00	508 616.55	0.44
USD PROCTER & GAMBLE CO 1.85000% 16-02.02.21	225 000.00	225 582.05	0.19
USD QATAR, STATE OF-REG-S 2.37500% 16-02.06.21	450 000.00	452 812.50	0.39
USD QATAR, STATE OF-REG-S 4.00000% 19-14.03.29	400 000.00	472 500.00	0.41
USD QUEBEC, PROVINCE OF 2.50000% 16-20.04.26	300 000.00	327 437.73	0.28
USD QUEBEC, PROVINCE OF 2.75000% 17-12.04.27	630 000.00	702 640.58	0.61
USD ROCHE HOLDINGS INC-REG-S 3.62500% 18-17.09.28	650 000.00	769 807.03	0.67
USD SANOFI 4.00000% 11-29.03.21	400 000.00	404 994.76	0.35
USD SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 2.87500% 16-10.05.26	850 000.00	939 328.45	0.81
USD STATE STREET CORP 2.40000% 20-24.01.30	260 000.00	285 444.54	0.25
USD TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.45500% 19-19.02.29	475 000.00	548 518.79	0.47
USD VISA INC 2.05000% 20-15.04.30	400 000.00	426 563.28	0.37

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 VISA INC 3.15000% 15-14.12.25	350 000.00	390 704.90	0.34
USD WALMART INC 3.05000% 19-08.07.26	425 000.00	477 442.74	0.41
USD WALMART INC 3.12500% 18-23.06.21	475 000.00	482 688.83	0.42
USD WALMART INC 3.70000% 18-26.06.28	500 000.00	590 284.35	0.51
USD WESTPAC BANKING CORP 2.85000% 16-13.05.26	725 000.00	798 819.50	0.69
USD WESTPAC BANKING CORP 2.65000% 18-25.01.21	300 000.00	300 990.00	0.26
米ドル合計		27 122 739.23	23.47
ノート、固定利付債合計		27 122 739.23	23.47
ノート、変動利付債			
米ドル			
USD CITIGROUP INC 3M LIBOR+143BP 16-01.09.23	165 000.00	167 922.15	0.15
米ドル合計		167 922.15	0.15
ノート、変動利付債合計		167 922.15	0.15
中期債券、固定利付債			
米ドル			
USD ABU DHABI, EMIRATE OF-REG-S 3.12500% 20-16.04.30	800 000.00	903 000.00	0.78
USD ASB FINANCE LTD-REG-S 2.12500% 16-01.09.21	400 000.00	405 276.00	0.35
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.00000% 15-22.01.25	325 000.00	346 313.50	0.30
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.62500% 17-12.01.27	425 000.00	474 703.75	0.41
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.00000% 17-16.02.22	440 000.00	449 622.80	0.39
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.75000% 18-19.01.28	630 000.00	715 913.10	0.62
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.75000% 19-19.09.29	125 000.00	133 879.19	0.11
USD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GRP/NY 2.30000% 16-01.06.21	420 000.00	423 868.20	0.37
USD CAISSE D' AMOR DE LA DETTE SOCIALE-REG-S 3.37500% 14-20.03.24	925 000.00	1 016 319.70	0.88
USD CPPIB CAPITAL INC-REG-S 2.75000% 17-02.11.27	600 000.00	677 758.32	0.59
USD IDB TRUST SERVICES LTD-REG-S 2.26100% 17-26.09.22	750 000.00	772 222.50	0.67
USD JAPAN TOBACCO INC-REG-S 2.80000% 16-13.04.26	200 000.00	216 452.00	0.19
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 3.00000% 17-19.04.24	275 000.00	292 101.57	0.25
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 2.87500% 20-21.05.30	500 000.00	536 093.75	0.46
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 2.37500% 17-18.01.22	800 000.00	817 857.60	0.71
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 3.12500% 18-22.03.23	200 000.00	212 191.20	0.18
USD NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CORP-REG-S 2.60000% 17-28.09.22	75 000.00	76 477.59	0.06
USD SP POWERASSETS LTD-REG-S 3.25000% 15-24.11.25	800 000.00	888 672.00	0.77
USD SUMITOMO MITSUI BANKING CORP-REG-S 2.44000% 19-18.06.24	279 000.00	296 429.63	0.26
USD SVENSK EXPORTKREDIT AB 1.75000% 16-10.03.21	400 000.00	401 676.72	0.35
USD TORONTO-DOMINION BANK 2.50000% 15-14.12.20	210 000.00	210 157.59	0.18
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 2.60000% 17-11.01.22	700 000.00	717 563.00	0.62
米ドル合計		10 984 549.71	9.50
中期債券、固定利付債合計		10 984 549.71	9.50
債券、固定利付債			
米ドル			
USD BNG BANK NV-REG-S 2.62500% 14-28.04.21	720 000.00	726 787.08	0.63
USD BNG BANK NV-REG-S 2.37500% 16-16.03.26	250 000.00	272 970.00	0.24
USD BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 2.25000% 16-02.06.26	400 000.00	435 324.00	0.38
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 3.25000% 14-29.01.24	225 000.00	245 841.75	0.21
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.87500% 15-10.02.25	450 000.00	477 657.45	0.41
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.12500% 16-13.04.26	300 000.00	325 688.82	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 - 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 ING BANK NV-REG-S 2.62500% 12-05.12.22	600 000.00	626 911.86	0.54
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 3.00000% 14-21.02.24	550 000.00	597 239.50	0.52
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 7.62500% 93-19.01.23	225 000.00	260 162.10	0.23
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 15-29.07.25	650 000.00	710 859.50	0.62
USD KOREA, REPUBLIC OF 3.87500% 13-11.09.23	200 000.00	218 312.50	0.19
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.50000% 14-20.11.24	200 000.00	217 059.24	0.19
USD MICROSOFT CORP 2.40000% 16-08.08.26	700 000.00	763 315.28	0.66
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 3.40000% 14-06.05.24	500 000.00	548 641.50	0.47
USD OESTERREICHISCHE KONTROLLBANK AG 2.37500% 14-01.10.21	50 000.00	50 885.42	0.04
USD ONTARIO, PROVINCE OF 1.12500% 20-07.10.30	700 000.00	693 831.95	0.60
USD ONTARIO, PROVINCE OF 3.20000% 14-16.05.24	100 000.00	109 481.81	0.09
米ドル合計		7 280 969.76	6.30

債券、固定利付債合計		7 280 969.76	6.30
------------	--	--------------	------

## 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	5 000.00	7 243.95	0.01
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 17-15.08.27	5 000.00	5 553.32	0.01
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 17-15.11.27	5 000.00	5 566.02	0.01
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.62500% 19-15.02.29	300 000.00	345 738.27	0.30
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 15-31.01.22	400 000.00	406 421.84	0.35
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.12500% 16-31.07.21	5 000.00	5 034.76	0.00
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 12-15.05.22	5 000.00	5 117.38	0.00
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.37500% 16-30.09.23	5 000.00	5 169.14	0.00
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 17-15.02.27	380 000.00	420 330.46	0.36
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.50000% 13-15.08.23	400 000.00	425 140.60	0.37
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.37500% 17-15.05.27	385 000.00	429 936.70	0.37
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.12500% 15-15.05.25	5 000.00	5 399.42	0.01
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 19-15.11.29	5 000.00	5 429.88	0.01
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 19-30.11.24	5 000.00	5 243.55	0.00
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.62500% 20-15.05.30	575 000.00	565 207.03	0.49
米ドル合計		2 642 532.32	2.29

財務省証券(T-note)、固定利付債合計		2 642 532.32	2.29
-----------------------	--	--------------	------

## 財務省証券(T-note)、変動利付債

米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.875%/CPI LINKED 99-15.04.29	200 000.00	451 976.94	0.39
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.375%/CPI LINKED 04-15.01.25	340 000.00	542 737.02	0.47
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.625%/CPI LINKED 16-15.01.26	380 000.00	457 860.93	0.40
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.125%/CPI LINKED 11-15.01.21	155 000.00	184 508.05	0.16
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI LINKED 17-15.01.27	377 000.00	446 638.25	0.39
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI INDEX 13-15.07.23	390 000.00	457 739.90	0.39
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI LINKED 15-15.07.25	499 000.00	593 529.43	0.51
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.750%/CPI LINKED 18-15.07.28	386 000.00	459 571.12	0.40
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 20-15.01.30	470 000.00	523 821.66	0.45
米ドル合計		4 118 383.30	3.56

財務省証券(T-note)、変動利付債合計		4 118 383.30	3.56
-----------------------	--	--------------	------

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		52 317 096.47	45.27
-------------------------------------	--	---------------	-------

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>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 SCENTRE GROUP TRUST 1 / 2-REG-S 3.75000% 17-23.03.27	225 000.00	244 149.75	0.21
米ドル合計		244 149.75	0.21
<b>ノート、固定利付債合計</b>		244 149.75	0.21
<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	352 419.45	0.31
米ドル合計		352 419.45	0.31
<b>中期債券、固定利付債合計</b>		352 419.45	0.31
<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	324 846.07	0.28
米ドル合計		324 846.07	0.28
<b>中期債券、ゼロ・クーポン債合計</b>		324 846.07	0.28
<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	325 000.00	335 951.14	0.29
米ドル合計		335 951.14	0.29
<b>中期債券、変動利付債合計</b>		335 951.14	0.29
<b>財務省証券 (T-note)、変動利付債</b>			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 12-15.07.22	400 000.00	463 979.54	0.40
米ドル合計		463 979.54	0.40
<b>財務省証券 (T-note)、変動利付債合計</b>		463 979.54	0.40
<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>		1 721 345.95	1.49

## 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

<b>ルクセンブルグ</b>			
EUR UBS (LUX) BOND FUND - EURO HIGH YIELD (EUR) I-X-ACC	14 786.00	2 421 882.72	2.09
USD UBS (LUX) BOND SICAV - SHORT TERM USD CORPORATES (USD) U-X-A	1 062.00	12 064 033.26	10.44
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD CORPORATES U-X-ACC	313.00	4 147 437.80	3.59
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD U-X-ACC	169.00	3 535 319.45	3.06
USD UBS (LUX) BOND SICAV - EMERGING ECONOMIES CORP (USD)-I-X-DIS	45 174.00	4 964 622.60	4.29
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD INVEST GRADE CORP USD U X ACC	1 692.00	20 793 952.44	17.99

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) EMERGING ECONOMIES FUND-GLOBAL BONDS (USD)-U-X ACC	556.00	7 994 234.72	6.92
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD U-X-ACC	201.00	2 254 482.33	1.95
ルクセンブルグ合計		58 175 965.32	50.33
投資信託、オープン・エンド型合計		58 175 965.32	50.33
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		58 175 965.32	50.33
投資有価証券合計		112 214 407.74	97.09

## 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

EUR EURO BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 08.12.20	13.00	-1 866.07	0.00
USD US LONG BOND FUTURE 22.03.21	13.00	5 281.25	0.00
債券に係る金融先物合計		3 415.18	0.00

公認の証券取引所に上場されている派生商品合計

派生商品合計		3 415.18	0.00
--------	--	----------	------

## 先渡為替契約

購入通貨 / 購入額 / 売却通貨 / 売却額 / 満期日(日 - 月 - 年)

USD	42 411.06	EUR	36 000.00	8.1.2021	-707.48	0.00
GBP	6 202.76	USD	8 037.40	8.1.2021	248.82	0.00
USD	373 528.84	AUD	530 000.00	8.1.2021	-17 161.45	-0.01
SGD	520 000.00	USD	383 126.41	8.1.2021	5 030.04	0.00
USD	1 305 614.40	EUR	1 106 496.02	8.1.2021	-19 676.97	-0.02
JPY	4 289 833 500.00	USD	41 177 087.45	14.1.2021	2 330.94	0.00
USD	388 403.61	AUD	530 000.00	4.2.2021	-2 351.07	0.00
USD	13 223.90	GBP	9 992.64	4.2.2021	-126.86	0.00
SGD	530 000.00	USD	394 431.23	4.2.2021	1 205.71	0.00
USD	1 308 664.54	EUR	1 100 670.78	4.2.2021	-10 402.28	-0.01
USD	793 387.26	TWD	22 460 000.00	22.1.2021	1 691.95	0.00
INR	57 350 000.00	USD	770 150.14	22.1.2021	960.44	0.00
IDR	11 288 720 000.00	USD	794 029.68	22.1.2021	-508.42	0.00
USD	309 525.22	JPY	32 351 700.00	14.1.2021	-1 028.60	0.00
先渡為替契約合計					-40 495.23	-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		3 186 877.60	2.76
当座借越およびその他の短期負債		-0.79	0.00
その他の資産および負債		213 756.98	0.19
純資産総額		115 577 961.48	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)

## 2020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	ALBERTA, PROVINCE OF 3.30000% 18-15.03.28	325 000.00	375 602.50	0.29
USD	ALPHABET INC 1.99800% 16-15.08.26	330 000.00	353 568.53	0.28
USD	AMERICAN EXPRESS CO 3.40000% 18-27.02.23	115 000.00	122 377.71	0.10
USD	APPLE INC 1.65000% 20-11.05.30	371 000.00	383 725.82	0.30
USD	APPLE INC 2.20000% 19-11.09.29	400 000.00	431 858.52	0.34
USD	APPLE INC 2.45000% 16-04.08.26	380 000.00	413 659.26	0.32
USD	APPLE INC 2.90000% 17-12.09.27	650 000.00	728 263.44	0.57
USD	APPLE INC 3.20000% 17-11.05.27	750 000.00	850 694.40	0.67
USD	APPLE INC 3.25000% 16-23.02.26	150 000.00	168 142.80	0.13
USD	BERKSHIRE HATHAWAY FINANCE CORP 1.85000% 20-12.03.30	250 000.00	262 917.70	0.21
USD	BERKSHIRE HATHAWAY INC 3.12500% 16-15.03.26	300 000.00	336 760.32	0.26
USD	CHEVRON CORP 2.23600% 20-11.05.30	250 000.00	268 766.62	0.21
USD	CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 4.37500% 12-15.06.22	225 000.00	235 854.00	0.18
USD	EQUINOR ASA 2.37500% 20-22.05.30	120 000.00	128 149.97	0.10
USD	EQUINOR ASA 3.62500% 18-10.09.28	230 000.00	268 760.66	0.21
USD	EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.37500% 17-24.05.27	450 000.00	498 150.18	0.39
USD	EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.87500% 20-17.05.30	600 000.00	597 354.08	0.47
USD	EXXON MOBIL CORP 3.04300% 16-01.03.26	200 000.00	221 202.68	0.17
USD	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.25000% 19-18.06.29	600 000.00	665 064.66	0.52
USD	JOHNSON & JOHNSON 1.30000% 20-01.09.30	250 000.00	250 996.12	0.20
USD	JOHNSON & JOHNSON 2.45000% 16-01.03.26	475 000.00	517 133.21	0.40
USD	JOHNSON & JOHNSON 2.90000% 17-15.01.28	200 000.00	225 347.96	0.18
USD	KOREA HYDRO&NUCLEAR POWER CO LTD-REG-S 3.12500% 17-25.07.27	300 000.00	332 906.25	0.26
USD	KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.00000% 15-02.05.25	95 000.00	101 690.56	0.08
USD	KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.87500% 18-03.04.28	680 000.00	784 030.20	0.61
USD	KUWAIT INTERNATIONAL GOVT BOND-REG-S 3.50000% 17-20.03.27	800 000.00	911 000.00	0.71
USD	LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 0.87500% 20-03.09.30	100 000.00	98 987.50	0.08
USD	MICROSOFT CORP 3.30000% 17-06.02.27	880 000.00	1 005 024.24	0.79
USD	NOVARTIS CAPITAL CORP 3.10000% 17-17.05.27	440 000.00	495 795.47	0.39
USD	QATAR, STATE OF-REG-S 2.37500% 16-02.06.21	400 000.00	402 500.00	0.31
USD	QATAR, STATE OF-REG-S 4.00000% 19-14.03.29	600 000.00	708 750.00	0.55
USD	ROCHE HOLDINGS INC-REG-S 3.62500% 18-17.09.28	250 000.00	296 079.63	0.23
USD	SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 2.87500% 16-10.05.26	250 000.00	276 273.07	0.22
USD	STATE STREET CORP 2.40000% 20-24.01.30	139 000.00	152 603.04	0.12
USD	TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.45500% 19-19.02.29	300 000.00	346 432.92	0.27
USD	VISA INC 2.05000% 20-15.04.30	150 000.00	159 961.23	0.13
USD	VISA INC 3.15000% 15-14.12.25	150 000.00	167 444.96	0.13
USD	WALMART INC 3.05000% 19-08.07.26	100 000.00	112 339.47	0.09
USD	WALMART INC 3.70000% 18-26.06.28	600 000.00	708 341.22	0.55
USD	WESTPAC BANKING CORP 2.85000% 16-13.05.26	850 000.00	936 547.00	0.73
米ドル合計			16 301 057.90	12.75

## ノート、固定利付債合計

16 301 057.90 12.75

## 中期債券、固定利付債

## 米ドル

USD	ABU DHABI, EMIRATE OF-REG-S 3.12500% 20-16.04.30	400 000.00	451 500.00	0.35
USD	ASB FINANCE LTD-REG-S 2.12500% 16-01.09.21	200 000.00	202 638.00	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 - 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 ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.62500% 17-12.01.27	550 000.00	614 322.50	0.48
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.75000% 18-19.01.28	250 000.00	284 092.50	0.22
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.75000% 19-19.09.29	760 000.00	813 985.46	0.64
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 3.15000% 17-19.09.27	175 000.00	196 813.75	0.15
USD CPPIB CAPITAL INC-REG-S 2.75000% 17-02.11.27	250 000.00	282 399.30	0.22
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 17-22.11.27	500 000.00	559 200.00	0.44
USD JAPAN TOBACCO INC-REG-S 2.80000% 16-13.04.26	200 000.00	216 452.00	0.17
USD KOREA DEVELOPMENT BANK 1.75000% 20-18.02.25	225 000.00	233 970.00	0.18
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 3.00000% 17-19.04.24	550 000.00	584 203.12	0.46
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 2.87500% 20-21.05.30	400 000.00	428 875.00	0.33
USD QUEBEC, PROVINCE OF 7.50000% 99-15.09.29	400 000.00	608 359.36	0.48
USD SP POWERASSETS LTD-REG-S 3.25000% 15-24.11.25	500 000.00	555 420.00	0.43
USD SUMITOMO MITSUI BANKING CORP-REG-S 2.44000% 19-18.06.24	200 000.00	212 494.36	0.17
USD TORONTO-DOMINION BANK 2.50000% 15-14.12.20	175 000.00	175 131.32	0.14
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 2.60000% 17-11.01.22	500 000.00	512 545.00	0.40
<b>米ドル合計</b>		<b>6 932 401.67</b>	<b>5.42</b>
<b>中期債券、固定利付債合計</b>		<b>6 932 401.67</b>	<b>5.42</b>
<b>債券、固定利付債</b>			
<b>米ドル</b>			
USD BNG BANK NV-REG-S 2.62500% 14-28.04.21	200 000.00	201 885.30	0.16
USD BNG BANK NV-REG-S 2.37500% 16-16.03.26	80 000.00	87 350.40	0.07
USD BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 2.25000% 16-02.06.26	200 000.00	217 662.00	0.17
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 3.25000% 14-29.01.24	150 000.00	163 894.50	0.13
USD ING BANK NV-REG-S 2.62500% 12-05.12.22	550 000.00	574 669.20	0.45
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 15-29.07.25	275 000.00	300 748.25	0.23
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.87500% 20-14.05.30	400 000.00	397 499.44	0.31
USD KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 3.25000% 14-10.07.24	600 000.00	650 062.50	0.51
USD MICROSOFT CORP 2.40000% 16-08.08.26	200 000.00	218 090.08	0.17
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 3.40000% 14-06.05.24	200 000.00	219 456.60	0.17
USD ONTARIO, PROVINCE OF 1.12500% 20-07.10.30	400 000.00	396 475.40	0.31
<b>米ドル合計</b>		<b>3 427 793.67</b>	<b>2.68</b>
<b>債券、固定利付債合計</b>		<b>3 427 793.67</b>	<b>2.68</b>
<b>財務省証券 (T-note)、固定利付債</b>			
<b>米ドル</b>			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 5.37500% 01-15.02.31	163 000.00	236 152.61	0.19
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 17-15.08.27	225 000.00	249 899.40	0.20
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 17-15.11.27	230 000.00	256 036.72	0.20
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 18-31.05.25	25 000.00	27 851.56	0.02
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.62500% 19-15.02.29	512 000.00	590 059.98	0.46
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.75000% 14-15.02.24	50 000.00	54 068.35	0.04
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 15-31.01.22	101 000.00	102 621.51	0.08
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.12500% 16-31.07.21	65 000.00	65 451.95	0.05
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 12-15.05.22	50 000.00	51 173.82	0.04
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.37500% 16-30.09.23	25 000.00	25 845.70	0.02
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 17-15.02.27	161 000.00	178 087.38	0.14
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.50000% 13-15.08.23	101 000.00	107 348.00	0.08
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.12500% 15-15.05.25	140 000.00	151 183.60	0.12
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 19-15.11.29	95 000.00	103 167.77	0.08
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.62500% 20-15.05.30	610 000.00	599 610.93	0.47
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.25000% 20-31.07.25	40 000.00	39 846.88	0.03
<b>米ドル合計</b>		<b>2 838 406.16</b>	<b>2.22</b>
<b>財務省証券 (T-note)、固定利付債合計</b>		<b>2 838 406.16</b>	<b>2.22</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 - 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	225 000.00	508 474.07	0.40
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.375%/CPI LINKED 04-15.01.25	395 000.00	630 532.72	0.49
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.625%/CPI LINKED 16-15.01.26	425 000.00	512 081.30	0.40
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.125%/CPI LINKED 11-15.01.21	170 000.00	202 363.66	0.16
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI LINKED 17-15.01.27	425 000.00	503 504.66	0.39
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI INDEX 13-15.07.23	435 000.00	510 556.04	0.40
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI LINKED 15-15.07.25	560 000.00	666 085.13	0.52
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.750%/CPI LINKED 18-15.07.28	430 000.00	511 957.46	0.40
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 20-15.01.30	520 000.00	579 547.36	0.45
米ドル合計		4 625 102.40	3.61
<b>財務省証券(T-note)、変動利付債合計</b>		4 625 102.40	3.61
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		34 124 761.80	26.68
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			
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD NESTLE HOLDINGS INC-144A 3.62500% 18-24.09.28	300 000.00	351 963.48	0.27
USD SCENTRE GROUP TRUST 1 / 2-REG-S 3.75000% 17-23.03.27	150 000.00	162 766.50	0.13
米ドル合計		514 729.98	0.40
ノート、固定利付債合計		514 729.98	0.40
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	151 036.91	0.12
米ドル合計		151 036.91	0.12
中期債券、固定利付債合計		151 036.91	0.12
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	131 694.35	0.10
米ドル合計		131 694.35	0.10
中期債券、ゼロ・クーポン債合計		131 694.35	0.10
財務省証券(T-note)、変動利付債			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 12-15.07.22	440 000.00	510 377.49	0.40
米ドル合計		510 377.49	0.40
財務省証券(T-note)、変動利付債合計		510 377.49	0.40
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		1 307 838.73	1.02

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 - 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>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 SOURCE MARKETS PLC - MSCI USA SOURCE ETF-A	16 075.00	1 616 341.25	1.27
USD UBS(IRL)FUND SOLUTION PLC-MSCI USA SF UCITS SHS-A-ETF-ACC	16 075.00	1 616 180.50	1.26
<b>アイルランド合計</b>		<b>3 232 521.75</b>	<b>2.53</b>
<b>ルクセンブルグ</b>			
EUR UBS (LUX) BOND FUND - EURO HIGH YIELD (EUR) I-X-ACC	16 106.00	2 638 093.00	2.06
USD UBS (LUX) BOND SICAV - SHORT TERM USD CORPORATES (USD) U-X-A	1 367.00	15 528 750.91	12.14
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD CORPORATES U-X-ACC	560.00	7 420 336.00	5.80
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD U-X-ACC	185.00	3 870 024.25	3.03
USD UBS (LUX) BOND SICAV - EMERGING ECONOMIES CORP (USD)-I-X-DIS	49 368.00	5 425 543.20	4.24
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD INVEST GRADE CORP USD U X ACC	1 659.00	20 388 396.63	15.94
USD UBS (LUX) EMERGING ECONOMIES FUND-GLOBAL BONDS (USD)-U-X ACC	612.00	8 799 409.44	6.88
USD UBS (LUX) EQUITY FUND - GLOBAL SUSTAINABLE (USD) U-X-ACC	329.00	4 219 306.56	3.30
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - GLB EM OPP(USD)-U-X-ACC	15.00	541 511.40	0.42
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV-GLOBAL QUANTITATIVE (USD) U-X-ACC	250.00	4 085 585.00	3.20
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - GLOBAL OPPORTUNITY (USD) U-X-ACC	359.00	3 902 243.84	3.05
USD UBS (LUX) INST FUND-KEY SEL. GLOBAL EQUITY FA-USD	156.00	4 538 670.24	3.55
USD UBS (LUX) INSTITUTION SICAV-EQUITIES GLB (EX USA) PASSIVE XA	14 259.00	1 552 092.15	1.22
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD U-X-ACC	169.00	1 895 559.77	1.48
<b>ルクセンブルグ合計</b>		<b>84 805 522.39</b>	<b>66.31</b>
<b>投資信託、オープン・エンド型合計</b>		<b>88 038 044.14</b>	<b>68.84</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>88 038 044.14</b>	<b>68.84</b>
<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>			
<b>ユーロ</b>			
EUR EURO STOXX 50 INDEX CALL 3400.00000 18.12.20	62.00	99 899.45	0.08
EUR EURO STOXX 50 INDEX CALL 3725.00000 18.12.20	-62.00	-2 669.92	0.00
EUR EURO STOXX 50 INDEX PUT 3000.00000 18.12.20	-62.00	-3 189.07	0.00
<b>ユーロ合計</b>		<b>94 040.46</b>	<b>0.08</b>
<b>米ドル</b>			
USD S&P 500 INDEX PUT 2300.00000 15.01.21	7.00	805.00	0.00
USD S&P 500 INDEX CALL 3450.00000 18.12.20	7.00	126 777.00	0.10
USD S&P 500 INDEX PUT 3000.00000 18.12.20	-7.00	-1 470.00	0.00
USD S&P 500 INDEX CALL 3800.00000 18.12.20	-7.00	-2 639.00	0.00
USD S&P 500 INDEX PUT 3200.00000 15.01.21	7.00	12 950.00	0.01
USD S&P 500 INDEX PUT 2750.00000 15.01.21	-14.00	-5 740.00	-0.01
<b>米ドル合計</b>		<b>130 683.00</b>	<b>0.10</b>
<b>指数に係るオプション、従来型合計</b>		<b>224 723.46</b>	<b>0.18</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>224 723.46</b>	<b>0.18</b>
<b>投資有価証券合計</b>		<b>123 695 368.13</b>	<b>96.72</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)

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 LONG BOND FUTURE 22.03.21	15.00	6 093.75	0.00
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.21	-41.00	-6 085.92	0.00
<b>債券に係る金融先物合計</b>		<b>7.83</b>	<b>0.00</b>
<b>指数に係る金融先物</b>			
EUR EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 18.12.20	-106.00	-263 780.04	-0.20
CHF SWISS MARKET INDEX FUTURE 18.12.20	17.00	24 522.26	0.02
GBP FTSE 100 INDEX FUTURE 18.12.20	65.00	233 026.30	0.18
USD S&P500 EMINI FUTURE 18.12.20	-4.00	-14 040.00	-0.01
AUD SPI 200 INDEX FUTURES 17.12.20	-3.00	-35 092.48	-0.03
CAD S&P/TSX 60 INDEX FUTURE 17.12.20	-4.00	-35 099.93	-0.03
USD MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 18.12.20	6.00	27 800.00	0.02
JPY NIKKEI 225 (OSE) INDEX FUTURE 10.12.20	-5.00	-156 125.63	-0.12
<b>指数に係る金融先物合計</b>		<b>-218 789.52</b>	<b>-0.17</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>-218 781.69</b>	<b>-0.17</b>
<b>派生商品合計</b>		<b>-218 781.69</b>	<b>-0.17</b>

## 先渡為替契約

購入通貨 / 購入額 / 売却通貨 / 売却額 / 満期日 (日 - 月 - 年)

JPY 6 500 000.00	USD 61 771.42	8.1.2021	619.65	0.00
GBP 31 000.00	USD 40 255.64	8.1.2021	1 157.05	0.00
NOK 350 000.00	USD 37 611.63	8.1.2021	1 916.55	0.00
CHF 40 000.00	USD 43 974.79	8.1.2021	278.57	0.00
USD 52 880.40	HKD 410 000.00	8.1.2021	-9.35	0.00
GBP 2 063 441.42	USD 2 673 761.79	8.1.2021	82 775.48	0.07
CAD 276 118.20	USD 209 589.30	8.1.2021	3 547.45	0.00
AUD 29 876.66	USD 21 056.22	8.1.2021	967.40	0.00
USD 165 001.49	DKK 1 040 000.00	8.1.2021	-2 339.28	0.00
SGD 575 000.00	USD 423 649.39	8.1.2021	5 562.07	0.00
USD 662 365.65	JPY 69 844 073.00	8.1.2021	-8 041.55	-0.01
USD 149 623.65	HKD 1 160 000.00	8.1.2021	-15.64	0.00
USD 79 169.65	SEK 697 396.45	8.1.2021	-2 479.54	0.00
USD 74 439.91	NOK 692 981.75	8.1.2021	-3 823.82	0.00
USD 2 317 564.77	EUR 1 964 114.51	8.1.2021	-34 928.11	-0.03
USD 366 199.39	CHF 331 971.10	8.1.2021	-1 071.53	0.00
USD 65 472.39	GBP 50 500.00	8.1.2021	-1 990.21	0.00
USD 80 733.30	GBP 62 000.00	8.1.2021	-2 092.08	0.00
GBP 97 000.00	USD 125 173.24	8.1.2021	4 408.40	0.00
USD 87 592.19	EUR 75 000.00	8.1.2021	-2 238.10	0.00
CHF 60 000.00	USD 65 622.73	8.1.2021	757.31	0.00
USD 112 415.31	EUR 95 000.00	8.1.2021	-1 369.72	0.00
USD 410 670.50	GBP 312 000.00	8.1.2021	-6 128.16	0.00
EUR 100 000.00	USD 118 420.79	8.1.2021	1 352.92	0.00
USD 93 249.16	CHF 85 000.00	8.1.2021	-789.23	0.00
USD 1 221 976.73	AUD 1 667 460.47	4.2.2021	-7 396.81	-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 - 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)					
購入通貨 / 購入額 / 売却通貨 / 売却額 / 満期日(日-月-年)					
GBP	1 338 432.41	USD 1 771 233.27	4.2.2021	16 992.25	0.01
NZD	5 000.00	USD 3 446.77	4.2.2021	67.51	0.00
USD	608 366.72	JPY 63 364 922.00	4.2.2021	-42.82	0.00
USD	201 243.79	HKD 1 560 000.00	4.2.2021	-1.80	0.00
USD	182 839.56	DKK 1 145 000.00	4.2.2021	-1 503.38	0.00
USD	475 653.81	CHF 432 025.42	4.2.2021	-2 665.42	0.00
USD	588 489.98	CAD 769 617.78	4.2.2021	-5 620.30	0.00
SGD	585 000.00	USD 435 362.77	4.2.2021	1 330.84	0.00
USD	81 676.80	SEK 702 697.98	4.2.2021	-618.48	0.00
USD	38 090.21	NOK 344 521.10	4.2.2021	-819.31	0.00
USD	2 583 641.62	EUR 2 173 008.25	4.2.2021	-20 536.79	-0.02
IDR	12 926 780 000.00	USD 909 248.08	22.1.2021	-582.20	0.00
INR	65 670 000.00	USD 881 878.98	22.1.2021	1 099.78	0.00
USD	908 544.99	TWD 25 720 000.00	22.1.2021	1 937.54	0.00
USD	67 158.52	JPY 7 000 000.00	4.2.2021	-53.22	0.00
USD	67 136.62	JPY 7 000 000.00	8.1.2021	-53.77	0.00
先渡為替契約合計				17 560.15	0.01
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				4 261 246.88	3.33
当座借越およびその他の短期負債				-0.79	0.00
その他の資産および負債				136 128.64	0.11
純資産総額				127 891 521.32	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・ディフェンシブ(米ドル)

## 2020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)	941.00	39 779.56	0.00
EUR ERSTE GROUP BK AG NPV	3 395.00	97 872.49	0.01
EUR OMV AG NPV(VAR)	1 727.00	58 669.79	0.01
EUR RAIFFEISEN BK INTL NPV (REGD)	1 858.00	35 693.99	0.00
EUR VERBUND AG CLASS ' A ' NPV	829.00	58 358.59	0.01
EUR VOESTALPINE AG NPV	1 411.00	45 301.58	0.00
オーストリア合計		335 676.00	0.03
ベルギー			
EUR ANHEUSER-BUSCH IN NPV	9 286.00	620 710.19	0.06
EUR COLRUYT SA NPV	642.00	38 413.37	0.00
EUR ELIA SYS OPERATOR NPV	336.00	38 102.32	0.00
EUR GALAPAGOS NV NPV	526.00	64 902.10	0.01
EUR GPE BRUXELLES LAM NPV	1 439.00	140 598.38	0.01
EUR PROXIMUS SA NPV	2 156.00	45 158.42	0.00
EUR SOFINA NPV	179.00	56 955.87	0.01
EUR SOLVAY SA NPV	889.00	101 918.35	0.01
EUR UMICORE NPV	2 354.00	105 791.66	0.01
ベルギー合計		1 212 550.66	0.11
カナダ			
CAD AIR CANADA VAR VTG SHS NPV	2 332.00	44 448.18	0.00
CAD ALGONQUIN PWR&UTIL COM NPV	9 000.00	141 330.35	0.01
CAD ALTAGAS LTD COM NPV	4 943.00	71 099.25	0.01
CAD ATCO LTD CL 1 NON VTG	1 233.00	37 145.09	0.00
CAD B2GOLD CORP COM NPV	15 500.00	86 596.19	0.01
CAD CAE INC COM NPV	3 987.00	96 667.59	0.01
CAD CAMECO CORP COM	5 987.00	60 013.22	0.01
CAD CANADIAN UTILS LTD CL A	2 162.00	54 120.90	0.01
CAD CI FINANCIAL CORP COM NPV	3 056.00	40 136.68	0.00
CAD EMERA INC COM	3 696.00	153 584.07	0.01
CAD EMPIRE LTD CL A	2 535.00	69 522.26	0.01
CAD HYDRO ONE INC COM NPV	5 288.00	123 641.02	0.01
CAD IGM FINANCIAL INC COM	1 349.00	35 757.50	0.00
CAD KEYERA CORPORATION COM NPV	3 127.00	54 075.21	0.00
CAD KINROSS GOLD CORP COM NPV	18 559.00	132 472.22	0.01
CAD KIRKLAND LAKE GOLD COM NPV	3 898.00	160 052.92	0.01
CAD LUNDIN MINING CORP COM	9 720.00	77 856.01	0.01
CAD NORTHLAND POWER IN COM NPV	200.00	6 869.36	0.00
CAD ONEX CORP SUB VTG	1 458.00	78 047.27	0.01
CAD PAN AMER SILVER COM NPV	3 151.00	92 932.49	0.01
CAD QUEBECOR INC CL B	2 622.00	65 433.66	0.01
CAD RITCHIE BROS AUCTIONEERS COM	1 628.00	117 348.16	0.01
CAD SSR MINING INC COM NPV	3 300.00	61 217.69	0.01
CAD TELUS CORPORATION COM NPV	716.00	13 840.42	0.00
CAD TELUS CORPORATION NPV	5 502.00	106 545.79	0.01
CAD TMX GROUP LTD COM NPV	857.00	84 509.63	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 (%)
CAD TOROMONT INDS LTD COM	100.00	6 855.47	0.00
CAD WSP GLOBAL INC COM NPV	1 700.00	126 525.97	0.01
CAD YAMANA GOLD INC COM	14 198.00	74 282.31	0.01
カナダ合計		2 272 926.88	0.21
フィンランド			
EUR KESKO OYJ EUR2 SER ' B '	263.00	6 921.21	0.00
EUR KONE CORPORATION NPV ORD ' B '	4 048.00	340 504.74	0.03
EUR WARTSILA OYJ ABP SER ' B ' EUR3.50	6 068.00	57 211.83	0.01
フィンランド合計		404 637.78	0.04
フランス			
EUR ACCOR EUR3	2 238.00	76 966.50	0.01
EUR ADP EUR3	405.00	51 304.42	0.01
EUR AIR LIQUIDE(L ' ) EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)	5 651.00	930 476.31	0.09
EUR AIRBUS EUR1	7 140.00	749 290.35	0.07
EUR ALSTOM EUR7.00	2 298.00	122 874.39	0.01
EUR AMUNDI EUR2.5 (AIW)	727.00	58 091.78	0.01
EUR ARKEMA EUR10	813.00	95 033.74	0.01
EUR ATOS SE EUR1	1 154.00	106 126.29	0.01
EUR AXA EUR2.29	22 889.00	539 711.03	0.05
EUR BIOMERIEUX NPV (POST SPLIT)	489.00	70 660.97	0.01
EUR BNP PARIBAS EUR2	13 358.00	686 530.84	0.06
EUR BOLLORE EURO.16	12 148.00	47 285.30	0.00
EUR BOUYGUES EUR1	2 700.00	107 808.72	0.01
EUR BUREAU VERITAS EURO.12	3 533.00	91 454.42	0.01
EUR CAPGEMINI EUR8	1 921.00	267 245.79	0.02
EUR CARREFOUR EUR2.50	7 155.00	117 512.48	0.01
EUR CIE DE ST-GOBAIN EUR4	6 157.00	293 274.44	0.03
EUR CNP ASSURANCES EUR1	2 290.00	36 569.63	0.00
EUR COVIVIO EUR3	664.00	54 407.96	0.01
EUR CREDIT AGRICOLE SA EUR3	13 573.00	157 067.28	0.01
EUR DANONE EURO.25	7 375.00	475 151.57	0.04
EUR DASSAULT AVIATION EUR8	31.00	32 076.10	0.00
EUR DASSAULT SYSTEMES EURO.50	1 568.00	290 818.23	0.03
EUR EDENRED EUR2	2 903.00	166 440.22	0.02
EUR EDF EURO.5	7 417.00	112 810.22	0.01
EUR EIFFAGE EUR4	1 004.00	98 648.89	0.01
EUR ENGIE EUR1	21 741.00	321 701.45	0.03
EUR ESSILORLUXOTTICA EURO.18	3 485.00	505 878.66	0.05
EUR EURAZEO NPV	535.00	33 086.29	0.00
EUR FAURECIA EUR7	977.00	48 734.26	0.00
EUR GETLINK SE EURO.40	5 369.00	89 592.45	0.01
EUR HERMES INTL NPV	377.00	368 620.75	0.03
EUR ICADE NPV	366.00	27 122.28	0.00
EUR ILIAD NPV	166.00	33 796.48	0.00
EUR INGENICO GROUP EUR1	879.00	133 325.10	0.01
EUR IPSEN EUR1	427.00	41 296.35	0.00
EUR JC DECAUX SA NPV	585.00	13 183.80	0.00
EUR KERING EUR4	919.00	665 081.22	0.06
EUR KLEPIERRE EUR1.40	2 283.00	50 522.11	0.00
EUR L ' OREAL EURO.20	3 035.00	1 113 827.28	0.10
EUR LEGRAND SA EUR4	3 167.00	268 898.18	0.03
EUR LVMH MOET HENNESSY EURO.30	3 345.00	1 932 222.46	0.18
EUR NATIXIS EUR1.6	13 219.00	40 796.42	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 (%)
EUR ORANGE EUR4	24 018.00	304 254.21	0.03
EUR ORPEA EUR2.5	633.00	79 353.99	0.01
EUR PERNOD RICARD EUR1.55	2 528.00	483 838.98	0.05
EUR PEUGEOT SA EUR1	6 961.00	164 578.18	0.02
EUR PUBLICIS GROUPE SA EURO.40	2 600.00	118 464.47	0.01
EUR REMY COINTREAU EUR1.60	272.00	48 479.60	0.00
EUR RENAULT SA EUR3.81	2 338.00	93 284.45	0.01
EUR SAFRAN EURO.20	3 910.00	572 014.47	0.05
EUR SANOFI EUR2	13 759.00	1 394 200.87	0.13
EUR SARTORIUS STEDIM B EURO.20 (POST SUBD)	346.00	125 407.22	0.01
EUR SCHNEIDER ELECTRIC EUR8	6 642.00	926 802.96	0.09
EUR SCOR SE EUR7.876972 (POST CONS)	1 901.00	65 126.68	0.01
EUR SEB SA EUR1	252.00	44 975.21	0.00
EUR SOC GENERALE EUR1.25	9 754.00	194 687.82	0.02
EUR SODEXO EUR4	1 064.00	88 278.41	0.01
EUR SUEZ EUR4	4 108.00	79 287.22	0.01
EUR TELEPERFORMANCE EUR2.50	701.00	234 119.31	0.02
EUR THALES EUR3	1 263.00	116 422.29	0.01
EUR TOTAL SE EUR2.5	29 820.00	1 277 902.25	0.12
EUR UBISOFT ENTERTAIN EURO.31	1 089.00	103 926.36	0.01
EUR UNIBAIL-RODAMCO-WE NPV(1 ORD UNIBAIL-R & 1CLS)	1 700.00	120 995.63	0.01
EUR VALEO EUR1 (POST SUBD)	2 739.00	106 548.26	0.01
EUR VEOLIA ENVIRONNEME EUR5	6 415.00	147 793.98	0.01
EUR VINCI EUR2.50	6 259.00	640 139.85	0.06
EUR VIVENDI SA EUR5.50	9 884.00	297 709.20	0.03
EUR WENDEL EUR4	305.00	34 568.68	0.00
EUR WORLDLINE EURO.68	2 891.00	268 011.60	0.03
フランス合計		19 654 495.56	1.82

## ドイツ

EUR BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG EUR1	4 042.00	353 151.35	0.03
EUR BEIERSDORF AG NPV	1 207.00	135 343.07	0.01
EUR CARL ZEISS MEDITEC NPV	467.00	62 454.32	0.01
EUR COMMERZBANK AG NPV	11 972.00	74 611.92	0.01
EUR CONTINENTAL AG ORD NPV	1 324.00	180 866.40	0.02
EUR COVESTRO AG NPV	2 193.00	122 637.71	0.01
EUR DEUTSCHE WOHNEN AG NPV (BR)	4 072.00	204 773.75	0.02
EUR FRAPORT AG NPV	600.00	34 149.12	0.00
EUR FRESENIUS MED CARE NPV	2 555.00	215 468.52	0.02
EUR FRESENIUS SE & CO. KGAA NPV	5 021.00	225 229.51	0.02
EUR GEA GROUP AG NPV	1 875.00	64 392.94	0.01
EUR HEIDELBERGCEMENT NPV	1 766.00	125 777.61	0.01
EUR HENKEL AG & CO KGAA	1 242.00	120 191.54	0.01
EUR HOCHTIEF AG NPV	340.00	32 902.68	0.00
EUR KION GROUP AG NPV	770.00	59 354.01	0.01
EUR KNORR BREMSE AG NPV	871.00	111 773.98	0.01
EUR LANXESS AG NPV	1 000.00	70 169.09	0.01
EUR MERCK KGAA NPV	1 564.00	250 414.18	0.02
EUR METRO AG (NEW) NPV	1 918.00	17 574.43	0.00
EUR NEMETSCHEK SE ORD NPV	708.00	56 150.10	0.00
EUR PUMA SE NPV	1 170.00	116 666.82	0.01
EUR RATIONAL AG NPV	8.00	7 129.35	0.00
EUR RWI AG (NEU) NPV	7 629.00	317 304.41	0.03
EUR SAP AG ORD NPV	12 618.00	1 539 250.59	0.14
EUR SYMRISE AG NPV (BR)	1 542.00	193 676.74	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 (%)
EUR TEAMVIEWER AG NPV	1 811.00	86 501.08	0.01
EUR THYSSENKRUPP AG NPV	5 220.00	34 979.81	0.00
EUR VOLKSWAGEN AG ORD NPV	383.00	71 241.49	0.01
EUR ZALANDO SE NPV	1 812.00	183 805.22	0.02
<b>ドイツ合計</b>		<b>5 067 941.74</b>	<b>0.47</b>
<b>アイルランド</b>			
EUR FLUTTER ENTERTAINM ORD EURO.09	1 191.00	221 536.84	0.02
GBP FLUTTER ENTERTAINM ORD EURO.09	934.00	170 892.67	0.02
EUR KERRY GROUP 'A' ORD EURO.125(DUBLIN LIST)	1 917.00	269 211.75	0.02
<b>アイルランド合計</b>		<b>661 641.26</b>	<b>0.06</b>
<b>イタリア</b>			
EUR AMPLIFON EURO.02	160.00	6 425.03	0.00
EUR ASSIC GENERALI SPA EUR1	13 124.00	224 808.66	0.02
EUR DIASORIN SPA EUR1	306.00	64 642.17	0.01
EUR FINECOBANK SPA EURO.33	7 342.00	115 358.14	0.01
EUR INFRASTRUTTURE WIR NPV	3 398.00	43 857.98	0.00
EUR LEONARDO SPA EUR4.40	4 289.00	31 111.37	0.00
EUR POSTE ITALIANE SPA NPV	5 883.00	60 126.22	0.01
EUR TELECOM ITALIA SPA DI RISP EURO.55	60 912.00	31 003.18	0.00
EUR TELECOM ITALIA SPA EURO.55	104 236.00	48 939.69	0.01
<b>イタリア合計</b>		<b>626 272.44</b>	<b>0.06</b>
<b>ルクセンブルグ</b>			
EUR AROUNDTOWN SA EURO.01	12 326.00	85 782.70	0.01
<b>ルクセンブルグ合計</b>		<b>85 782.70</b>	<b>0.01</b>
<b>オランダ</b>			
USD AERCAP HOLDINGS EURO.01	1 649.00	60 617.24	0.01
EUR AKZO NOBEL NV EURO.50(POST REV SPLIT)	2 295.00	244 494.55	0.02
EUR ALTICE EUROPE N.V. EURO.01 (COMMON SHARES A)	8 788.00	46 442.92	0.00
EUR ARGEN X NV EURO.10	548.00	156 799.81	0.02
EUR EXOR NV EURO.01	1 295.00	90 435.23	0.01
EUR HEINEKEN HOLDING EUR1.6	1 405.00	130 167.19	0.01
EUR HEINEKEN NV EUR1.60	3 193.00	338 099.18	0.03
EUR ING GROEP N.V. EURO.01	47 798.00	467 413.54	0.04
EUR JUST EAT TAKEAWAY EURO.04	1 526.00	162 533.72	0.02
EUR KON KPN NV EURO.04	42 652.00	127 499.79	0.01
EUR KONINKLIJKE AHOLD EURO.01	13 123.00	376 588.61	0.04
EUR KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20	11 174.00	579 564.45	0.05
EUR QIAGEN NV EURO.01	2 816.00	136 121.05	0.01
EUR RANDSTAD N.V. EURO.10	1 444.00	89 820.27	0.01
EUR STMICROELECTRONICS EUR1.04	7 603.00	298 488.34	0.03
EUR VOPAK(KON) EURO.50	830.00	43 715.01	0.00
EUR WOLTERS KLUWER EURO.12	3 367.00	283 140.66	0.03
<b>オランダ合計</b>		<b>3 631 941.56</b>	<b>0.34</b>
<b>スペイン</b>			
EUR ACS ACTIVIDADES CO EURO.5	3 219.00	102 001.54	0.01
EUR AENA SME S.A. EUR10	806.00	131 701.14	0.01
EUR AMADEUS IT GROUP EURO.01	5 402.00	371 299.19	0.03
EUR CAIXABANK SA EUR1	43 250.00	111 076.44	0.01
EUR CELLNEX TELECOM SA EURO.25	3 984.00	252 008.14	0.02
EUR ENAGAS SA EUR1.50	2 877.00	70 274.76	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 ENDESA SA EUR1.2	3 737.00	107 150.68	0.01
EUR FERROVIAL SA EURO.2	5 783.00	161 319.01	0.01
EUR GRIFOLS SA EURO.25 (CLASS A) POST SUBD	3 650.00	103 695.59	0.01
EUR IBERDROLA SA EURO.75 (POST SUBDIVISION)	71 755.00	982 362.48	0.09
EUR INDITEX EURO.03 (POST SUBD)	13 343.00	444 510.97	0.04
EUR NATURGY ENERGY GRO EUR1	3 462.00	80 070.96	0.01
EUR RED ELECTRICA CORP EURO.5	5 104.00	104 616.11	0.01
EUR REPSOL SA EUR1	17 952.00	173 038.97	0.02
EUR SIEMENS GAMESA REN EURO.17	2 862.00	102 466.09	0.01
EUR TELEFONICA SA EUR1	58 598.00	256 337.15	0.02
スペイン合計		3 553 929.22	0.32
スイス			
CHF SWATCH GROUP CHF2.25(BR)	638.00	158 002.43	0.01
CHF SWISS RE AG CHF0.10	6 632.00	608 183.63	0.06
CHF VIFOR PHARMA AG CHF0.01	1 044.00	153 722.74	0.01
スイス合計		919 908.80	0.08
イギリス			
USD COCA-COLA EUROPEAN ORD EURO.01	2 485.00	111 029.80	0.01
イギリス合計		111 029.80	0.01
無記名株式合計		38 538 734.40	3.56
参加証券			
スイス			
CHF LINDT & SPRUENGLI PTG CERT CHF10	24.00	205 589.31	0.02
CHF SCHINDLER-HLDG AG PTG CERT CHF0.10(POST-SUBD)	897.00	245 726.28	0.02
スイス合計		451 315.59	0.04
参加証券合計		451 315.59	0.04
その他の株式			
スイス			
CHF ROCHE HLDGS AG GENUSSSCHEINE NPV	15 690.00	5 182 916.71	0.48
スイス合計		5 182 916.71	0.48
その他の株式合計		5 182 916.71	0.48
優先株式			
ドイツ			
EUR BAYERISCHE MOTORENWERKE AG EUR1	639.00	42 346.20	0.00
EUR FUCHS PETROLUB SE NON-VTG PRF NPV	841.00	48 207.72	0.00
EUR HENKEL AG&CO. KGAA NON-VTG PRF NPV	2 132.00	230 138.93	0.02
EUR PORSCHE AUTO HL SE NON VTG PRF NPV	1 840.00	117 313.73	0.01
EUR SARTORIUS AG NON VTG PRF NPV	428.00	195 573.92	0.02
EUR VOLKSWAGEN AG NON VTG PRF NPV	2 263.00	382 607.46	0.04
ドイツ合計		1 016 187.96	0.09
優先株式合計		1 016 187.96	0.09

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>記名株式</b>			
<b>ベルギー</b>			
EUR AGEAS NPV	2 085.00	102 805.85	0.01
EUR KBC GROUP NV NPV	2 988.00	208 735.94	0.02
EUR TELENET GRP HLDG NPV	501.00	21 454.80	0.00
EUR UCB NPV	1 541.00	165 089.91	0.02
<b>ベルギー合計</b>		<b>498 086.50</b>	<b>0.05</b>
<b>カナダ</b>			
CAD 1ST QUANTUM MINLS COM NPV	8 730.00	124 156.11	0.01
CAD AGNICO EAGLE MINES LTD COM	3 732.00	245 104.19	0.02
CAD ALIMENTATION COUCHE TARD INC SUB VTG SH	13 088.00	435 593.36	0.04
CAD BANK NOVA SCOTIA HALIFAX COM	18 209.00	888 038.27	0.08
CAD BANK OF MONTREAL COM NPV	9 605.00	691 746.77	0.06
CAD BARRICK GOLD CORP COM NPV	26 713.00	614 487.63	0.06
CAD BCE INC COM NEW	2 273.00	98 749.82	0.01
CAD BLACKBERRY LTD NPV	9 065.00	53 512.81	0.00
CAD BROOKFIELD ASSET M LTD VTG SHS NPV CL 'A'	20 080.50	812 734.19	0.07
CAD CAN PACIFIC RYS COM NPV	2 032.00	657 895.08	0.06
CAD CANADIAN NAT RES LTD COM	17 491.00	399 921.54	0.04
CAD CANADIAN NATL RY CO COM	10 593.00	1 111 696.89	0.10
CAD CANADIAN TIRE LTD CL A	878.00	112 448.23	0.01
CAD CCL INDUSTRIES INC 'B' NON-VTG COM NPV	2 273.00	100 433.66	0.01
CAD CDN IMPERIAL BK OF COMMERCE COM	6 697.00	565 774.80	0.05
CAD CENOVUS ENERGY INC COM NPV	15 869.00	78 861.30	0.01
CAD CGI INC COM NPV SUB VOTING SHARES C	3 440.00	254 595.57	0.02
CAD CONSTELLATION SOFT COM STK NPV	360.00	446 778.92	0.04
CAD DOLLARAMA INC COM NPV	4 383.00	179 798.04	0.02
CAD ENBRIDGE INC COM NPV	30 476.00	953 859.53	0.09
CAD FAIRFAX FINL HLDGS SUB-VTG COM NPV	407.00	139 885.64	0.01
CAD FORTIS INC COM NPV	6 982.00	281 726.05	0.03
CAD FRANCO NEVADA CORP COM NPV	2 814.00	375 380.96	0.03
CAD GILDAN ACTIVEWEAR INC COM	3 023.00	79 219.91	0.01
CAD GREAT WEST LIFECO INC COM	4 086.00	95 252.77	0.01
CAD IA FINANCIAL CORP COM NPV	1 644.00	72 146.21	0.01
CAD IMPERIAL OIL LTD COM NEW	3 828.00	66 404.38	0.01
CAD INTACT FINL CORP COM NPV	2 136.00	239 477.92	0.02
CAD INTER PIPELINE LTD COM NPV	6 287.00	62 777.82	0.01
CAD LOBLAW COS LTD COM	2 675.00	132 521.80	0.01
CAD MAGNA INTL INC COM NPV	4 236.00	260 324.90	0.02
CAD MANULIFE FINL CORP COM	28 783.00	491 525.42	0.05
CAD METRO INC CL A SUB	3 795.00	174 712.32	0.02
CAD NATL BK OF CANADA COM NPV	5 151.00	285 950.26	0.03
CAD NUTRIEN LTD NPV	8 682.00	429 443.79	0.04
CAD OPEN TEXT CO COM NPV	4 064.00	179 789.43	0.02
CAD PARKLAND CORP. COM NPV	2 200.00	67 532.99	0.01
CAD PEMBINA PIPELINE C COM NPV	8 252.00	210 900.72	0.02
CAD POWER CORP CDA COM	8 316.00	187 637.81	0.02
CAD RESTAURANT BRANDS COM NPV	4 245.00	242 435.72	0.02
CAD ROGERS COMMS INC CLASS 'B' COM CAD1.62478	5 305.00	250 778.84	0.02
CAD ROYAL BK OF CANADA COM NPV	21 290.00	1 742 431.82	0.16
CAD SAPUTO INC COM	3 711.00	103 177.20	0.01
CAD SHAW COMMUNICATIONS INC CL B CONV	7 046.00	122 770.80	0.01
CAD SHOPIFY INC COM NPV CL A	1 607.00	1 733 325.40	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・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 (%)
CAD SUN LIFE FINL INC COM	8 898.00	395 977.82	0.04
CAD SUNCOR ENERGY INC COM NPV 'NEW'	22 689.00	363 647.29	0.03
CAD TC ENERGY CORPORAT COM NPV	14 143.00	623 496.87	0.06
CAD TECK RESOURCES LTD CLASS 'B' SUB-VTG COM NPV	7 010.00	111 000.23	0.01
CAD THOMSON-REUTERS CP COM NPV(POST REV SPLIT)	2 550.00	202 559.61	0.02
CAD TORONTO-DOMINION COM NPV	27 018.00	1 444 407.01	0.13
CAD WESTON GEORGE LTD COM	1 162.00	86 179.35	0.01
CAD WHEATON PRECIOUS M COM NPV	6 582.00	254 615.06	0.02
<b>カナダ合計</b>		<b>20 335 600.83</b>	<b>1.88</b>
<b>フィンランド</b>			
EUR ELISA OYJ NPV	1 699.00	91 455.47	0.01
EUR FORTUM OYJ EUR3.40	5 316.00	122 124.58	0.01
EUR NESTE OIL OYJ NPV	5 050.00	339 372.71	0.03
EUR NOKIA OYJ NPV	67 840.00	271 650.32	0.03
EUR ORION CORP SER 'B' NPV	1 338.00	63 156.35	0.01
EUR SAMPO PLC SER 'A' NPV	5 644.00	244 601.51	0.02
EUR STORA ENSO OYJ NPV SER 'R'	6 926.00	117 396.77	0.01
EUR UPM-KYMMENE CORP NPV	6 702.00	221 427.67	0.02
<b>フィンランド合計</b>		<b>1 471 185.38</b>	<b>0.14</b>
<b>フランス</b>			
EUR GECINA EUR7.50	628.00	95 629.49	0.01
EUR LA FRANCAISE DES EURO.40 (PROMESSES)	877.00	36 675.40	0.00
EUR MICHELIN (CGDE) EUR2	2 034.00	254 134.25	0.02
<b>フランス合計</b>		<b>386 439.14</b>	<b>0.03</b>
<b>ドイツ</b>			
EUR ADIDAS AG NPV (REGD)	2 308.00	737 969.75	0.07
EUR ALLIANZ SE NPV(REGD)(VINKULIERT)	5 030.00	1 189 297.69	0.11
EUR BASF SE NPV	11 153.00	818 216.94	0.08
EUR BAYER AG NPV (REGD)	12 046.00	695 542.95	0.06
EUR BRENTAG AG	1 855.00	142 146.00	0.01
EUR DAIMLER AG ORD NPV(REGD)	10 346.00	698 618.72	0.07
EUR DELIVERY HERO SE NPV	1 560.00	188 939.79	0.02
EUR DEUTSCHE BANK AG NPV(REGD)	23 497.00	262 604.74	0.02
EUR DEUTSCHE BOERSE AG NPV(REGD)	2 333.00	390 005.16	0.04
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA ORD NPV (REGD)(VINK)	3 710.00	42 808.00	0.00
EUR DEUTSCHE POST AG NPV(REGD)	11 997.00	581 207.86	0.05
EUR DEUTSCHE TELEKOM NPV(REGD)	40 354.00	729 623.04	0.07
EUR E.ON SE NPV	26 819.00	291 166.13	0.03
EUR EVONIK INDUSTRIES NPV	2 507.00	75 901.49	0.01
EUR HANNOVER RUECKVERS ORD NPV(REGD)	720.00	120 835.34	0.01
EUR INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)	15 308.00	540 553.40	0.05
EUR LEG IMMOBILIEN AG NPV	816.00	116 604.81	0.01
EUR MTU AERO ENGINES H NPV (REGD)	640.00	151 544.19	0.01
EUR MUENCHENER RUECKVE NPV(REGD)	1 707.00	476 990.97	0.04
EUR SCOUT24 AG NPV	1 284.00	98 452.52	0.01
EUR SIEMENS AG NPV(REGD)	9 238.00	1 237 655.51	0.12
EUR SIEMENS ENERGY AG NPV	4 836.00	144 042.10	0.01
EUR SIEMENS HEALTHINEE NPV	3 211.00	148 070.48	0.01
EUR TELEFONICA DEUTSCH NPV	13 761.00	38 090.54	0.00
EUR UNIPER SE NPV	2 446.00	83 095.70	0.01
EUR UNITED INTERNET AG NPV(REGD)	1 187.00	47 466.90	0.01
EUR VONOVIA SE NPV	6 172.00	424 371.76	0.04
<b>ドイツ合計</b>		<b>10 471 822.48</b>	<b>0.97</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>アイルランド</b>			
EUR CRH ORD EURO.32	9 364.00	367 623.94	0.03
EUR KINGSPAN GROUP ORD EURO.13(DUBLIN LISTING)	1 846.00	161 528.75	0.02
EUR SMURFIT KAPPA GRP ORD EURO.001	2 644.00	112 720.51	0.01
<b>アイルランド合計</b>		<b>641 873.20</b>	<b>0.06</b>
<b>イタリア</b>			
EUR ATLANTIA SPA EUR1	5 966.00	109 046.17	0.01
EUR DAVIDE CAMPARI MIL EURO.05	6 824.00	79 130.86	0.01
EUR ENEL EUR1	98 046.00	981 655.57	0.09
EUR ENI SPA EUR1	31 202.00	309 899.79	0.03
EUR FERRARI NV EURO.01(NEW)	1 501.00	317 443.73	0.03
EUR INTESA SANPAOLO NPV	196 172.00	451 816.19	0.04
EUR MEDIOBANCA SPA EURO.5	7 319.00	65 434.77	0.01
EUR MONCLER SPA NPV	2 328.00	114 620.46	0.01
EUR NEXI SPA NPV	5 299.00	100 150.89	0.01
EUR PIRELLI & C SPA NPV	5 939.00	31 969.04	0.00
EUR PRYSMIAN SPA EURO.10	2 863.00	93 940.09	0.01
EUR RECORDATI EURO.125	1 308.00	69 829.42	0.01
EUR SNAM EUR1	23 826.00	134 038.61	0.01
EUR TERNA SPA ORD EURO.22	16 686.00	125 187.82	0.01
EUR UNICREDIT SPA NPV (POST REV SPLIT)	25 365.00	262 242.57	0.02
<b>イタリア合計</b>		<b>3 246 405.98</b>	<b>0.30</b>
<b>ルクセンブルグ</b>			
EUR ARCELORMITTAL NPV(POST STOCK SPLIT)	9 155.00	168 101.09	0.02
EUR EUROFINS SCIENTIFI EURO.01	1 600.00	130 261.40	0.01
EUR TENARIS S.A. USD1	6 757.00	52 424.54	0.00
<b>ルクセンブルグ合計</b>		<b>350 787.03</b>	<b>0.03</b>
<b>オランダ</b>			
EUR ADYEN NV EURO.01	222.00	425 421.35	0.04
EUR AEGON NV EURO.12	21 409.00	80 311.22	0.01
EUR ASML HOLDING NV EURO.09	5 143.00	2 238 425.79	0.21
EUR CNH INDUSTRIAL NV COM EURO.01	12 314.00	135 044.70	0.01
EUR FIAT CHRYSLER AUTO EURO.01	13 080.00	204 434.50	0.02
EUR KONINKLIJKE DSM NV EUR1.5	2 052.00	337 016.91	0.03
EUR NN GROUP N.V. EURO.12	3 429.00	139 665.26	0.01
EUR PROSUS N.V. EURO.05	5 937.00	645 131.09	0.06
<b>オランダ合計</b>		<b>4 205 450.82</b>	<b>0.39</b>
<b>ポルトガル</b>			
EUR EDP ENERGIAS PORTU EUR1(REGD)	39 647.00	211 898.22	0.02
EUR GALP ENERGIA EUR1-B	6 028.00	65 213.51	0.01
EUR JERONIMO MARTINS EUR5	2 815.00	48 354.47	0.00
<b>ポルトガル合計</b>		<b>325 466.20</b>	<b>0.03</b>
<b>スペイン</b>			
EUR BANCO SANTANDER SA EURO.50(REGD)	199 923.00	578 140.03	0.05
EUR BANKINTER SA EURO.3(REGD)	8 430.00	41 838.37	0.00
EUR BBVA(BILB-VIZ-ARG) EURO.49	82 374.00	387 245.61	0.04
EUR MAPFRE SA EURO.10	12 919.00	24 834.12	0.00
<b>スペイン合計</b>		<b>1 032 058.13</b>	<b>0.09</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>スイス</b>			
CHF ABB LTD CHF0.12 (REGD)	40 950.00	1 084 249.97	0.10
CHF ADECCO GROUP AG CHF0.1 (REGD)	3 420.00	207 927.54	0.02
CHF ALCON AG CHF0.04	11 053.00	707 890.14	0.06
CHF BALOISE-HLDGS CHF0.1(REGD)	1 033.00	178 803.82	0.02
CHF BARRY CALLEBAUT AG CHF0.02 (REGD)	67.00	144 390.81	0.01
CHF BQE CANT VAUDOISE CHF1	668.00	69 065.28	0.01
CHF CLARIANT CHF4.00(REGD)	4 384.00	88 328.91	0.01
CHF CREDIT SUISSE GRP CHF0.04(REGD)	53 665.00	680 519.39	0.06
CHF EMS-CHEMIE HLDG AG CHF0.01(REGD)(POST RECON)	180.00	165 127.58	0.01
CHF GEBERIT CHF0.10(REGD)	830.00	501 502.26	0.05
CHF GIVAUDAN AG CHF10	206.00	842 841.05	0.08
CHF JULIUS BAER GRUPPE CHF0.02 (REGD)	4 946.00	286 499.77	0.03
CHF KUEHNE&NAGEL INTL CHF1(REGD)(POST-SUBD)	1 174.00	266 753.34	0.02
CHF LAFARGEHOLCIM LTD CHF2 (REGD)	11 729.00	617 479.44	0.06
CHF LINDT & SPRUENGLI CHF100(REGD)	2.00	178 504.36	0.02
CHF LOGITECH INTL CHF0.25(REGD) (POST-SUBD)	3 634.00	322 656.49	0.03
CHF LONZA GROUP AG CHF1(REGD)	1 677.00	1 055 141.06	0.10
CHF NESTLE SA CHF0.10(REGD)	66 277.00	7 407 386.35	0.68
CHF NOVARTIS AG CHF0.50(REGD)	49 605.00	4 507 901.63	0.42
CHF PARTNERS GROUP HLG CHF0.01 (REGD)	421.00	453 413.23	0.04
CHF RICHEMONT(CIE FIN) CHF1.00 (REG) SER 'A'	11 658.00	971 993.64	0.09
CHF SCHINDLER-HLDG AG CHF0.1(REGD)(POST-SUBD)	445.00	118 266.87	0.01
CHF SGS LTD CHF1(REGD)	136.00	388 936.26	0.04
CHF SIKA AG CHF0.01 (REG)	3 166.00	810 996.80	0.07
CHF SONOVA HOLDING AG CHF0.05 (REGD)	1 212.00	301 359.99	0.03
CHF STRAUMANN HLDG CHF0.1(REGD)	229.00	263 578.92	0.02
CHF SWATCH GROUP CHF0.45(REGD)	1 192.00	57 381.38	0.00
CHF SWISS LIFE HLDG CHF5.1(REGD)	701.00	314 222.69	0.03
CHF SWISS PRIME SITE CHF15.3 (REGD)	1 698.00	153 425.83	0.01
CHF SWISSCOM AG CHF1(REGD)	559.00	296 387.94	0.03
CHF TEMENOS AG CHF5 (REGD)	1 475.00	187 042.97	0.02
CHF UBS GROUP CHF0.10 (REGD)	81 581.00	1 161 580.79	0.11
CHF ZURICH INSURANCE GRP CHF0.10	3 346.00	1 363 458.96	0.13
<b>スイス合計</b>		<b>26 155 015.46</b>	<b>2.42</b>
<b>アメリカ合衆国</b>			
CAD BAUSCH HEALTH COMP COM NPV	4 923.00	91 591.58	0.01
CAD BROOKFIELD RENEWA. CLASS A SUB VOTING SHARES	100.00	7 863.26	0.00
<b>アメリカ合衆国合計</b>		<b>99 454.84</b>	<b>0.01</b>
<b>記名株式合計</b>		<b>69 219 645.99</b>	<b>6.40</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	5 062.00	46 176.68	0.00
<b>ルクセンブルグ合計</b>		<b>46 176.68</b>	<b>0.00</b>
<b>オランダ</b>			
EUR ABN AMRO BANK N.V. DR EACH REP SHS	4 905.00	50 752.67	0.01
<b>オランダ合計</b>		<b>50 752.67</b>	<b>0.01</b>
<b>預託証券合計</b>		<b>96 929.35</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・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>投資信託証券</b>			
アイルランド			
USD STAR COMPASS PLC/UBS DYNMC DIVERSIFIED LTD NOTE DUE 31.03.21	29 350 000.00	45 577 615.00	4.21
アイルランド合計		45 577 615.00	4.21
投資信託証券合計		45 577 615.00	4.21
<b>投資信託、クローズド・エンド型</b>			
カナダ			
CAD RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3 301.00	44 679.02	0.01
カナダ合計		44 679.02	0.01
投資信託、クローズド・エンド型合計		44 679.02	0.01
<b>ノート、固定利付債</b>			
米ドル			
USD 3M CO 2.25000% 16-19.09.26	1 150 000.00	1 239 292.21	0.11
USD ABU DHABI, GOVERNMENT OF-REG-S 3.12500% 17-11.10.27	2 475 000.00	2 774 320.32	0.26
USD ALBERTA, PROVINCE OF 3.30000% 18-15.03.28	2 800 000.00	3 235 960.00	0.30
USD ALPHABET INC 1.10000% 20-15.08.30	2 000 000.00	1 983 411.00	0.18
USD ALPHABET INC 1.99800% 16-15.08.26	2 150 000.00	2 303 552.57	0.21
USD AMERICAN EXPRESS CO 3.40000% 18-27.02.23	1 000 000.00	1 064 154.00	0.10
USD APPLE INC 1.65000% 20-11.05.30	1 789 000.00	1 850 365.21	0.17
USD APPLE INC 2.20000% 19-11.09.29	3 300 000.00	3 562 832.79	0.33
USD APPLE INC 2.40000% 13-03.05.23	3 475 000.00	3 648 039.02	0.34
USD APPLE INC 2.45000% 16-04.08.26	3 075 000.00	3 347 374.27	0.31
USD APPLE INC 2.85000% 16-23.02.23	750 000.00	789 192.60	0.07
USD APPLE INC 3.20000% 17-11.05.27	4 850 000.00	5 501 157.12	0.51
USD BANK OF NOVA SCOTIA 2.00000% 19-15.11.22	1 410 000.00	1 456 475.01	0.13
USD BAYER US FINANCE II LLC-REG-S 3.87500% 18-15.12.23	1 000 000.00	1 092 561.40	0.10
USD BERKSHIRE HATHAWAY FINANCE CORP 1.85000% 20-12.03.30	500 000.00	525 835.40	0.05
USD BERKSHIRE HATHAWAY INC 2.20000% 16-15.03.21	950 000.00	953 604.11	0.09
USD BERKSHIRE HATHAWAY INC 3.12500% 16-15.03.26	575 000.00	645 457.28	0.06
USD BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 1.75000% 19-27.09.24	500 000.00	525 966.55	0.05
USD CHEVRON CORP 2.23600% 20-11.05.30	2 571 000.00	2 763 995.97	0.26
USD CHEVRON CORP 3.19100% 13-24.06.23	2 150 000.00	2 292 423.10	0.21
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 3.90000% 18-16.03.28	1 000 000.00	1 185 410.00	0.11
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 3.35000% 19-04.06.24	500 000.00	545 420.00	0.05
USD CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 4.37500% 12-15.06.22	1 150 000.00	1 205 476.00	0.11
USD COUNCIL OF EUROPE DEVELOPMENT BANK 1.62500% 16-16.03.21	400 000.00	401 559.08	0.04
USD DEXIA CREDIT LOCAL SA-REG-S 2.50000% 18-25.01.21	1 000 000.00	1 003 230.00	0.09
USD EQUINOR ASA 2.37500% 20-22.05.30	1 000 000.00	1 067 916.40	0.10
USD EQUINOR ASA 3.62500% 18-10.09.28	4 000 000.00	4 674 098.40	0.43
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.37500% 17-24.05.27	4 000 000.00	4 428 001.60	0.41
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.87500% 20-17.05.30	5 800 000.00	5 774 422.75	0.53
USD EXPORT DEVELOPMENT CANADA 2.00000% 17-17.05.22	200 000.00	205 160.00	0.02
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 2.50000% 15-10.05.21	800 000.00	806 250.00	0.07
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 3.25000% 15-10.11.25	1 200 000.00	1 342 500.00	0.12
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 2.75000% 17-25.01.22	2 775 000.00	2 846 109.37	0.26
USD EXXON MOBIL CORP 3.04300% 16-01.03.26	3 050 000.00	3 373 340.87	0.31
USD EXXON MOBIL CORP 3.48200% 20-19.03.30	1 500 000.00	1 737 900.90	0.16
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.37500% 17-07.07.27	900 000.00	994 410.00	0.09

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 INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.25000% 19-18.06.29	2 450 000.00	2 715 680.70	0.25
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.00000% 19-23.07.26	1 500 000.00	1 613 143.50	0.15
USD INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 2.85000% 19-13.05.22	700 000.00	726 194.42	0.07
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.12500% 17-13.12.21	900 000.00	917 487.00	0.09
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 1.75000% 19-23.10.29	1 900 000.00	2 034 273.00	0.19
USD JOHNSON & JOHNSON 1.30000% 20-01.09.30	2 500 000.00	2 509 961.25	0.23
USD JOHNSON & JOHNSON 2.45000% 16-01.03.26	2 075 000.00	2 259 055.61	0.21
USD JOHNSON & JOHNSON 2.90000% 17-15.01.28	1 000 000.00	1 126 739.80	0.10
USD JOHNSON & JOHNSON 3.37500% 13-05.12.23	775 000.00	846 277.53	0.08
USD KOREA DEVELOPMENT BANK 2.75000% 17-19.03.23	850 000.00	893 031.25	0.08
USD KOREA EAST-WEST POWER CO LTD-REG-S 3.87500% 18-19.07.23	1 360 000.00	1 475 600.00	0.14
USD KOREA HYDRO&NUCLEAR POWER CO LTD-REG-S 3.00000% 12-19.09.22	1 150 000.00	1 198 515.62	0.11
USD KOREA HYDRO&NUCLEAR POWER CO LTD-REG-S 3.12500% 17-25.07.27	2 575 000.00	2 857 445.31	0.26
USD KOREA SOUTH-EAST POWER CO LTD-REG-S 2.12500% 20-03.02.25	800 000.00	840 495.04	0.08
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.12500% 13-17.01.23	625 000.00	650 253.12	0.06
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.00000% 15-02.05.25	1 075 000.00	1 150 709.03	0.11
USD KUWAIT INTERNATIONAL GOVT BOND-REG-S 3.50000% 17-20.03.27	4 400 000.00	5 010 500.00	0.46
USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 2.00000% 15-13.01.25	3 200 000.00	3 405 492.80	0.32
USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 0.87500% 20-03.09.30	1 000 000.00	989 874.97	0.09
USD MANITOBA, PROVINCE OF 2.12500% 17-04.05.22	1 300 000.00	1 333 956.00	0.12
USD MICROSOFT CORP 2.65000% 15-03.11.22	2 950 000.00	3 074 772.31	0.28
USD MICROSOFT CORP 2.87500% 17-06.02.24	2 575 000.00	2 763 705.53	0.26
USD MICROSOFT CORP 3.30000% 17-06.02.27	6 475 000.00	7 394 922.68	0.68
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD/NY 2.50000% 16-12.07.26	2 300 000.00	2 492 280.00	0.23
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 1.25000% 20-15.09.30	762 000.00	762 199.18	0.07
USD NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 3.00000% 18-10.01.28	1 900 000.00	2 119 173.36	0.20
USD NORDIC INVESTMENT BANK 2.25000% 14-30.09.21	450 000.00	457 518.78	0.04
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 2.40000% 12-21.09.22	1 700 000.00	1 761 317.47	0.16
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 3.10000% 17-17.05.27	2 600 000.00	2 929 700.55	0.27
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 2.20000% 20-14.08.30	1 500 000.00	1 621 022.25	0.15
USD QATAR, STATE OF-REG-S 2.37500% 16-02.06.21	3 250 000.00	3 270 312.50	0.30
USD QATAR, STATE OF-REG-S 3.37500% 19-14.03.24	1 000 000.00	1 079 687.50	0.10
USD QATAR, STATE OF-REG-S 4.00000% 19-14.03.29	3 300 000.00	3 898 125.00	0.36
USD QUEBEC, PROVINCE OF 2.50000% 16-20.04.26	4 125 000.00	4 502 268.79	0.42
USD ROCHE HOLDINGS INC-REG-S 3.62500% 18-17.09.28	2 000 000.00	2 368 637.00	0.22
USD SANOFI 4.00000% 11-29.03.21	1 500 000.00	1 518 730.35	0.14
USD SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 2.25000% 12-06.01.23	600 000.00	623 335.74	0.06
USD SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 1.87500% 16-10.05.21	450 000.00	453 180.47	0.04
USD SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 2.87500% 16-10.05.26	1 675 000.00	1 851 029.60	0.17
USD SINOPEC GROUP OVERSEAS DEV 2013-REG-S 4.37500% 13-17.10.23	250 000.00	272 845.00	0.03
USD STATE STREET CORP 2.40000% 20-24.01.30	872 000.00	957 337.06	0.09
USD TEMASEK FINANCIAL I LTD-REG-S 2.37500% 12-23.01.23	850 000.00	885 139.00	0.08
USD TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.70000% 13-15.01.24	650 000.00	712 914.61	0.07
USD TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.45500% 19-19.02.29	1 500 000.00	1 732 164.60	0.16
USD VISA INC 2.05000% 20-15.04.30	1 300 000.00	1 386 330.66	0.13
USD VISA INC 3.15000% 15-14.12.25	1 375 000.00	1 534 912.08	0.14
USD WALMART INC 2.55000% 13-11.04.23	1 375 000.00	1 440 106.38	0.13
USD WALMART INC 3.70000% 18-26.06.28	5 000 000.00	5 902 843.50	0.55
USD WESTPAC BANKING CORP 2.85000% 16-13.05.26	2 500 000.00	2 754 550.00	0.25
USD WESTPAC BANKING CORP 3.35000% 17-08.03.27	1 000 000.00	1 133 440.00	0.11
米ドル合計		171 356 363.20	15.83
ノート、固定利付債合計		171 356 363.20	15.83

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、固定利付債</b>			
<b>米ドル</b>			
USD ABU DHABI, EMIRATE OF-REG-S 3.12500% 20-16.04.30	2 000 000.00	2 257 500.00	0.21
USD AFRICAN DEVELOPMENT BANK 2.37500% 14-23.09.21	925 000.00	941 213.86	0.09
USD ASB FINANCE LTD-REG-S 2.12500% 16-01.09.21	700 000.00	709 233.00	0.06
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.62500% 17-12.01.27	1 550 000.00	1 731 272.50	0.16
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.00000% 17-16.02.22	200 000.00	204 374.00	0.02
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.50000% 17-02.11.27	2 900 000.00	3 242 584.25	0.30
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.75000% 19-19.09.29	2 000 000.00	2 142 067.00	0.20
USD BANK OF MONTREAL 1.90000% 16-27.08.21	750 000.00	759 175.28	0.07
USD CAISSE D' AMOR DE LA DETTE SOCIALE-REG-S 3.37500% 14-20.03.24	650 000.00	714 170.60	0.07
USD CLIFFORD CAPITAL PTE LTD-REG-S 1.73300% 19-10.09.24	1 200 000.00	1 236 636.00	0.11
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 3.15000% 17-19.09.27	625 000.00	702 906.25	0.06
USD CPPIB CAPITAL INC-REG-S 2.75000% 17-02.11.27	3 125 000.00	3 529 991.25	0.33
USD IDB TRUST SERVICES LTD-REG-S 2.26100% 17-26.09.22	1 800 000.00	1 853 334.00	0.17
USD INTERNATIONAL FINANCE CORP 2.12500% 16-07.04.26	1 000 000.00	1 085 090.00	0.10
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 17-22.11.27	3 195 000.00	3 573 288.00	0.33
USD JAPAN TOBACCO INC-REG-S 2.80000% 16-13.04.26	1 800 000.00	1 948 068.00	0.18
USD KOMMUNEKREDIT-REG-S 1.62500% 16-01.06.21	425 000.00	427 947.80	0.04
USD KOREA DEVELOPMENT BANK 1.75000% 20-18.02.25	375 000.00	389 950.01	0.03
USD MACQUARIE GROUP LTD-REG-S 6.25000% 11-14.01.21	800 000.00	804 880.00	0.07
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 3.00000% 17-19.04.24	1 000 000.00	1 062 187.50	0.10
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 2.87500% 19-07.11.29	2 500 000.00	2 681 250.00	0.25
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 2.87500% 20-21.05.30	1 500 000.00	1 608 281.25	0.15
USD NEDERLANDSE WATERSCHAPS BK NV-REG-S 3.00000% 18-21.12.21	425 000.00	437 149.05	0.04
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 1.87500% 16-09.03.21	800 000.00	802 673.60	0.07
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 2.37500% 17-18.01.22	650 000.00	664 509.29	0.06
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 3.12500% 18-22.03.23	1 330 000.00	1 411 071.48	0.13
USD NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CORP-REG-S 2.60000% 17-28.09.22	400 000.00	407 880.44	0.04
USD NORDRHEIN-WESTFALEN, STATE OF-REG-S 2.25000% 15-16.04.25	700 000.00	751 677.36	0.07
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 2.50000% 20-03.02.27	1 700 000.00	1 789 250.00	0.16
USD SP POWERASSETS LTD-REG-S 3.25000% 15-24.11.25	1 000 000.00	1 110 840.00	0.10
USD SUMITOMO MITSUI BANKING CORP-REG-S 2.44000% 19-18.06.24	586 000.00	622 608.47	0.06
USD SVENSK EXPORTKREDIT AB 1.75000% 16-10.03.21	400 000.00	401 676.72	0.04
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 2.60000% 17-11.01.22	1 225 000.00	1 255 735.25	0.12
USD TOYOTA MOTOR FINANCE NL BV-REG-S 2.76400% 19-26.04.21	600 000.00	605 605.56	0.06
<b>米ドル合計</b>		<b>43 866 077.77</b>	<b>4.05</b>
<b>中期債券、固定利付債合計</b>		<b>43 866 077.77</b>	<b>4.05</b>

**債券、固定利付債**

<b>米ドル</b>			
USD BNG BANK NV-REG-S 2.62500% 14-28.04.21	550 000.00	555 184.57	0.05
USD BNG BANK NV-REG-S 2.37500% 16-16.03.26	1 000 000.00	1 091 880.00	0.10
USD CAISSE D' AMORTIS DE LA DETTE SOC-REG-S 1.87500% 15-12.02.22	550 000.00	560 613.90	0.05
USD CANADIAN IMPERIAL BANK OF COM/CAN-REG-S 2.35000% 17-27.07.22	875 000.00	903 039.64	0.08
USD CENTRAL JAPAN RAILWAY CO-REG-S 3.40000% 18-06.09.23	1 400 000.00	1 494 383.10	0.14
USD DBS BANK LTD-REG-S 3.30000% 18-27.11.21	420 000.00	432 146.61	0.04
USD DNB BOLIGKREDIT AS-REG-S 2.50000% 17-28.03.22	750 000.00	771 225.00	0.07
USD FAB SUKUK CO LTD-REG-S 3.87500% 19-22.01.24	1 100 000.00	1 186 281.25	0.11
USD FMS WERTMANAGEMENT 2.00000% 17-01.08.22	475 000.00	488 837.89	0.04
USD ING BANK NV-REG-S 2.62500% 12-05.12.22	300 000.00	313 455.93	0.03
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 14-25.11.24	625 000.00	677 825.00	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 (%)
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 15-29.07.25	3 500 000.00	3 827 705.00	0.35
USD KOREA GAS CORP-REG-S 2.87500% 19-16.07.29	1 600 000.00	1 767 500.00	0.16
USD KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 3.25000% 14-10.07.24	1 550 000.00	1 679 328.12	0.16
USD KOREA, REPUBLIC OF 3.87500% 13-11.09.23	1 100 000.00	1 200 718.75	0.11
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.50000% 14-20.11.24	1 250 000.00	1 356 620.26	0.13
USD NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S 1.70000% 20-13.02.23	1 283 000.00	1 318 441.34	0.12
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 3.40000% 14-06.05.24	450 000.00	493 777.35	0.05
USD OESTERREICHISCHE KONTROLLBANK AG 2.37500% 14-01.10.21	450 000.00	457 968.78	0.04
USD ONTARIO, PROVINCE OF 1.12500% 20-07.10.30	2 800 000.00	2 775 327.80	0.26
USD ONTARIO, PROVINCE OF 3.20000% 14-16.05.24	2 000 000.00	2 189 636.20	0.20
USD ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 3.35000% 18-22.10.21	800 000.00	821 528.00	0.08
USD SWEDBANK AB-REG-S 2.80000% 17-14.03.22	400 000.00	411 870.28	0.04
米ドル合計		26 775 294.77	2.47
債券、固定利付債合計		26 775 294.77	2.47
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	6 628 000.00	7 638 510.85	0.71
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 15-31.01.22	5 000.00	5 080.28	0.00
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 17-15.02.27	1 850 000.00	2 046 345.68	0.19
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 13-15.05.23	1 000.00	1 038.71	0.00
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.62500% 20-15.05.30	10 501 000.00	10 322 154.84	0.95
米ドル合計		20 013 130.36	1.85
財務省証券 (T-note)、固定利付債合計		20 013 130.36	1.85
財務省証券 (T-note)、変動利付債			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.875%/CPI LINKED 99-15.04.29	1 922 000.00	4 343 498.46	0.40
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.375%/CPI LINKED 04-15.01.25	3 425 000.00	5 467 277.37	0.50
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.625%/CPI LINKED 16-15.01.26	2 758 000.00	3 323 106.39	0.31
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.125%/CPI LINKED 11-15.01.21	1 468 000.00	1 747 469.73	0.16
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI LINKED 17-15.01.27	3 731 000.00	4 420 178.57	0.41
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI INDEX 13-15.07.23	3 754 000.00	4 406 039.97	0.41
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI LINKED 15-15.07.25	4 636 000.00	5 514 233.34	0.51
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.750%/CPI LINKED 18-15.07.28	3 709 000.00	4 415 930.78	0.41
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 20-15.01.30	4 345 000.00	4 842 564.06	0.45
米ドル合計		38 480 298.67	3.56
財務省証券 (T-note)、変動利付債合計		38 480 298.67	3.56
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		460 619 188.79	42.56
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			
財務省証券 (T-bill)、ゼロ・クーポン			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 23.04.20-22.04.21	2 510 000.00	2 509 096.58	0.23
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 13.08.20-11.02.21	2 510 000.00	2 509 585.85	0.23
米ドル合計		5 018 682.43	0.46
財務省証券 (T-bill)、ゼロ・クーポン合計		5 018 682.43	0.46

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>ノート、固定利付債</b>			
米ドル			
USD ALTRIA GROUP INC 2.85000% 12-09.08.22	1 000 000.00	1 040 572.40	0.10
USD FANNIE MAE 2.12500% 16-24.04.26	1 625 000.00	1 765 510.50	0.16
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD NEW YORK 2.87500% 18-12.04.23	500 000.00	527 638.60	0.05
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-144A 3.50000% 17-10.01.27	2 000 000.00	2 273 920.00	0.21
USD PROCTER & GAMBLE CO 2.30000% 12-06.02.22	625 000.00	640 355.00	0.06
米ドル合計		6 247 996.50	0.58
<b>ノート、固定利付債合計</b>		6 247 996.50	0.58
<b>中期債券、固定利付債</b>			
米ドル			
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 3.85000% 14-08.07.24	1 000 000.00	1 100 994.90	0.10
USD GUARDIAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 2.00000% 16-26.04.21	1 400 000.00	1 409 677.78	0.13
米ドル合計		2 510 672.68	0.23
<b>中期債券、固定利付債合計</b>		2 510 672.68	0.23
<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	1 229 147.28	0.11
米ドル合計		1 229 147.28	0.11
<b>中期債券、ゼロ・クーポン債合計</b>		1 229 147.28	0.11
<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	767 249.10	0.07
USD HSBC BANK CANADA-REG-S 1.65000% 19-10.09.22	600 000.00	613 431.00	0.06
米ドル合計		1 380 680.10	0.13
<b>債券、固定利付債合計</b>		1 380 680.10	0.13
<b>財務省証券(T-note)、変動利付債</b>			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 12-15.07.22	3 786 000.00	4 391 566.33	0.41
米ドル合計		4 391 566.33	0.41
<b>財務省証券(T-note)、変動利付債合計</b>		4 391 566.33	0.41
<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>		20 778 745.32	1.92

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 (%)
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>新株引受権</b>			
ドイツ			
EUR KION GROUP AG RIGHTS 03.12.20	770.00	0.00	0.00
ドイツ合計		0.00	0.00
<b>新株引受権合計</b>			
		0.00	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	1 196 096.44	0.11
USD US BANK NA/CINCINNATI OH 2.65000% 19-23.05.22	900 000.00	929 505.60	0.09
米ドル合計		2 125 602.04	0.20
<b>ノート、固定利付債合計</b>			
		2 125 602.04	0.20
<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	1 338 142.00	0.12
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 2.75000% 17-22.06.24	800 000.00	859 265.04	0.08
米ドル合計		2 197 407.04	0.20
<b>債券、固定利付債合計</b>			
		2 197 407.04	0.20
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			
		4 323 009.08	0.40
<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 MAN FUNDS VI PLC-MAN AHL TARGETRISK-INU-USD-CAP	141 403.81	19 109 310.61	1.77
USD UBS(IRL)FUND SOLUTION PLC-MSCI USA SF UCITS SHS-A-ETF-ACC	874 365.00	87 908 657.10	8.12
アイルランド合計		107 017 967.71	9.89
ルクセンブルグ			
EUR ALMA PLATINUM IV UBS MULTI-STRATEGY ALTERNATIVES-IOC-E-CAP	3 490.29	42 016 766.53	3.88
USD AQR UCITS FUNDS - GLOBAL RISK PARITY UCITS FUND-A2-CAP	117 587.89	14 703 189.77	1.36
USD INVESCO FUNDS SICAV BAL RISK ALLOCATION-P11-USD HDG-CAP	849 026.53	10 731 695.36	0.99
USD UBS (LUX) BOND FUND-EURO HIGH YIELD (EUR)(USD HEDGED) F-ACC	215 762.00	26 003 636.24	2.41
USD UBS (LUX) BOND SICAV - SHORT TERM USD CORPORATES (USD) F-ACC	226 295.00	26 001 295.50	2.40
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD CORPORATES (USD) F-ACC	728 028.00	17 021 294.64	1.57
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD (USD) F-ACC	114 124.00	38 864 928.20	3.59
USD UBS (LUX) BOND SICAV USD - INVEST GRADE CORP USD F ACC	1 655.08	194 409 083.29	17.96
USD UBS (LUX) BOND SICAV - EMERG ECON CORPORATES (USD) F-ACC	281 940.00	34 661 703.60	3.20
USD UBS (LUX) EMERGING ECONOMIES FUND - GLOBAL BONDS (USD) F-ACC	24 507.00	51 653 894.04	4.77
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD U-X-ACC	9.00	100 946.97	0.01
ルクセンブルグ合計		456 168 434.14	42.14
<b>投資信託、オープン・エンド型合計</b>			
		563 186 401.85	52.03
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			
		563 186 401.85	52.03

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 (%)
公認の証券取引所に上場されている派生商品			
ワラント債			
スイス			
CHF CIE FINANCIERE RICHEMO 67.00000 WARRANT 27.11.23	23 048.00	4 582.61	0.00
スイス合計		4 582.61	0.00
ワラント債合計		4 582.61	0.00
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		4 582.61	0.00
投資有価証券合計		1 048 911 927.65	96.91

## 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 LONG BOND FUTURE 22.03.21	-19.00	-7 125.00	0.00
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.21	1.00	78.12	0.00
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.21	-325.00	-48 242.03	0.00
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 22.03.21	-225.00	-140 625.00	-0.01
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 22.03.21	-202.00	-55 234.27	-0.01
債券に係る金融先物合計		-251 148.18	-0.02

## 指数に係る金融先物

EUR EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 18.12.20	169.00	83 064.13	0.00
CHF SWISS MARKET INDEX FUTURE 18.12.20	7.00	-4 584.12	0.00
GBP FTSE 100 INDEX FUTURE 18.12.20	48.00	-10 293.24	0.00
SGD MSCI SINGAPORE INDEX FUTURE 30.12.20	13.00	-7 520.34	0.00
USD S&P500 EMINI FUTURE 18.12.20	475.00	2 498 512.50	0.23
HKD HANG SENG INDEX FUTURE 30.12.20	6.00	-6 733.31	0.00
AUD SPI 200 INDEX FUTURES 17.12.20	17.00	-2 044.76	0.00
CAD S&P/TSX 60 INDEX FUTURE 17.12.20	11.00	7 068.45	0.00
USD MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 18.12.20	228.00	-221 935.00	-0.02
JPY TOPIX INDX FUTURE 10.12.20	45.00	-38 935.51	0.00
指数に係る金融先物合計		2 296 598.80	0.21

公認の証券取引所に上場されている派生商品合計 2 045 450.62 0.19

派生商品合計 2 045 450.62 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・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			
購入通貨 / 購入額 / 売却通貨 / 売却額 / 満期日(日 - 月 - 年)			
USD	13 944 625.77	CAD 18 371 000.00 8.1.2021	-236 023.18 -0.02
USD	2 160 061.76	GBP 1 667 000.00 8.1.2021	-66 872.13 -0.01
USD	296 003.99	AUD 420 000.00 8.1.2021	-13 599.64 0.00
USD	73 678.16	SGD 100 000.00 8.1.2021	-967.31 0.00
USD	478 916.30	JPY 50 500 000.00 8.1.2021	-5 814.36 0.00
USD	741 668.96	HKD 5 750 000.00 8.1.2021	-77.53 0.00
USD	60 841 968.10	EUR 51 563 000.00 8.1.2021	-916 951.71 -0.07
USD	20 769 284.23	CHF 18 828 000.00 8.1.2021	-60 772.34 -0.01
EUR	1 530 000.00	USD 1 800 020.52 8.1.2021	32 517.29 0.00
CHF	500 000.00	USD 546 740.28 8.1.2021	6 426.72 0.00
USD	770 075.87	EUR 650 000.00 8.1.2021	-8 453.27 0.00
USD	534 957.75	EUR 450 000.00 8.1.2021	-4 023.96 0.00
USD	2 359 895.08	EUR 1 995 000.00 8.1.2021	-29 590.50 0.00
USD	13 850 976.95	CAD 18 110 000.00 4.2.2021	-129 127.68 -0.01
USD	49 806 986.86	EUR 41 884 000.00 4.2.2021	-387 672.27 -0.04
USD	219 851.10	AUD 300 000.00 4.2.2021	-1 330.79 0.00
GBP	1 030 000.00	USD 1 363 064.92 4.2.2021	13 076.51 0.00
USD	340 835.56	JPY 35 500 000.00 4.2.2021	-23.99 0.00
HKD	4 250 000.00	USD 548 260.32 4.2.2021	4.91 0.00
USD	74 420.99	SGD 100 000.00 4.2.2021	-227.49 0.00
USD	17 914 556.27	CHF 16 270 000.00 4.2.2021	-98 860.21 -0.01
EUR	2 500 000.00	USD 2 973 775.00 8.1.2021	20 567.83 0.00
EUR	2 500 000.00	USD 2 975 512.50 4.2.2021	20 539.64 0.00
CHF	2 000 000.00	USD 2 200 374.94 8.1.2021	12 293.06 0.00
CHF	2 000 000.00	USD 2 202 097.50 4.2.2021	12 213.07 0.00
EUR	1 500 000.00	USD 1 776 075.00 8.1.2021	20 530.70 0.00
EUR	1 500 000.00	USD 1 777 140.00 4.2.2021	20 491.28 0.00
CAD	3 000 000.00	USD 2 291 315.05 8.1.2021	24 397.04 0.00
CAD	3 000 000.00	USD 2 291 482.01 4.2.2021	24 382.92 0.00
CHF	500 000.00	USD 548 754.66 4.2.2021	4 822.98 0.00
CHF	500 000.00	USD 548 324.98 8.1.2021	4 842.02 0.00
GBP	15 991 200.00	USD 21 396 001.72 21.1.2021	-32 185.34 0.00
CHF	152 571 100.00	USD 167 678 054.30 21.1.2021	1 176 849.62 0.11
SGD	29 645 000.00	USD 22 088 024.26 21.1.2021	41 055.16 0.00
EUR	222 435 500.00	USD 264 796 561.49 21.1.2021	1 695 900.69 0.16
USD	1 055 800.00	EUR 888 264.44 21.1.2021	-8 399.63 0.00
USD	329 720.40	GBP 246 200.00 21.1.2021	803.77 0.00
USD	443 608.74	CHF 401 300.00 21.1.2021	-521.72 0.00
EUR	1 189 100.00	USD 1 418 526.14 21.1.2021	6 094.42 0.00
GBP	1 496 200.00	USD 1 999 674.29 21.1.2021	-791.02 0.00
先渡為替契約合計			1 135 523.56 0.10
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			30 370 997.96 2.81
当座借越およびその他の短期負債			-336.79 0.00
その他の資産および負債			-161 137.77 -0.01
純資産総額			1 082 302 425.23 100.00

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)

## 2020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 AFTERPAY LTD NPV	1 941.00	135 885.76	0.03
AUD AGL ENERGY NPV	5 671.00	56 412.13	0.01
AUD AMP LIMITED NPV(POST RECON)	32 666.00	41 159.60	0.01
AUD APA GROUP NPV	11 816.00	90 113.51	0.02
AUD ARISTOCRAT LEISURE NPV	5 263.00	124 330.01	0.03
AUD ASX LTD NPV	1 772.00	100 682.39	0.02
AUD AURIZON HOLDINGS NPV	18 656.00	58 423.36	0.01
AUD AUSNET SERVICES NPV	11 781.00	16 102.94	0.00
AUD AUST & NZ BANK GRP NPV	25 926.00	432 504.89	0.09
AUD BLUESCOPE STEEL NPV	4 807.00	60 568.85	0.01
AUD BRAMBLES LTD NPV	14 196.00	114 645.14	0.02
AUD CIMIC GROUP LTD NPV	1 223.00	23 042.85	0.01
AUD CMNWLTH BK OF AUST NPV	16 306.00	950 032.07	0.20
AUD COCA-COLA AMATIL NPV	4 481.00	41 768.08	0.01
AUD COCHLEAR LTD NPV	601.00	97 612.30	0.02
AUD COMPUTERSHARE LTD NPV(POST REC)	4 018.00	42 278.27	0.01
AUD CROWN RESORTS LTD NPV	2 877.00	20 436.00	0.00
AUD CSL NPV	4 206.00	921 637.45	0.20
AUD DEXUS NPV (STAPLED)	10 868.00	78 239.00	0.02
AUD EVOLUTION MINING NPV	14 980.00	54 858.92	0.01
AUD FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD NPV	1.00	12.61	0.00
AUD FORTESCUE METALS G NPV	16 100.00	216 267.69	0.05
AUD GOODMAN GROUP (STAPLED SECURITY)	15 395.00	211 902.29	0.05
AUD GPT GROUP NPV (STAPLED SECURITIES)	19 052.00	66 261.56	0.01
AUD INSURANCE AUST GRP NPV	24 124.00	91 545.21	0.02
AUD LEND LEASE GROUP NPV	6 192.00	64 606.06	0.01
AUD MACQUARIE GP LTD NPV	3 150.00	321 863.82	0.07
AUD MAGELLAN FINANCIAL NPV	1 231.00	53 679.95	0.01
AUD MEDIBANK PRIVATE L NPV	32 647.00	68 559.43	0.01
AUD MIRVAC GROUP STAPLED SECURITIES	39 554.00	75 195.04	0.02
AUD NATL AUSTRALIA BK NPV	30 134.00	508 255.01	0.11
AUD NEWCREST MINING NPV	7 512.00	149 063.40	0.03
AUD NTHN STAR RES LTD NPV	7 354.00	68 331.01	0.01
AUD ORICA LIMITED NPV	3 098.00	36 866.59	0.01
AUD ORIGIN ENERGY NPV	17 859.00	68 165.71	0.01
AUD QANTAS AIRWAYS NPV	8 134.00	32 245.23	0.01
AUD QBE INS GROUP NPV	13 150.00	96 895.77	0.02
AUD RAMSAY HEALTH CARE NPV	1 671.00	77 631.97	0.02
AUD REA GROUP LIMITED NPV	464.00	49 657.32	0.01
AUD RIO TINTO LIMITED NPV	3 306.00	247 013.05	0.05
AUD SANTOS LIMITED NPV	15 694.00	71 235.00	0.02
AUD SCENTRE GROUP NPV STAPLED UNIT	46 725.00	96 402.09	0.02
AUD SEEK LIMITED NPV	3 034.00	58 237.46	0.01
AUD SONIC HEALTHCARE NPV	4 164.00	101 067.94	0.02
AUD SOUL PATTINSON(WH) NPV	1 286.00	27 517.99	0.01
AUD SOUTH32 LTD NPV	45 967.00	81 289.88	0.02
AUD STOCKLAND NPV (STAPLED)	20 671.00	69 302.99	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 (%)
AUD SUNCORP GROUP LTD NPV	11 262.00	83 730.90	0.02
AUD SYDNEY AIRPORT NPV(STAPLED SECURITY)	12 402.00	61 318.76	0.01
AUD TABCORP HLDGS LTD NPV	21 968.00	62 158.54	0.01
AUD TELSTRA CORP NPV	44 778.00	101 293.63	0.02
AUD TRANSURBAN GROUP STAPLED UNITS NPV	25 832.00	266 861.01	0.06
AUD TREASURY WINE ESTA NPV	7 155.00	45 287.87	0.01
AUD VICINITY CENTRES NPV (STAPLED SECURITY)	42 121.00	51 210.82	0.01
AUD WESFARMERS LTD NPV	10 567.00	385 032.24	0.08
AUD WESTPAC BKG CORP NPV	34 037.00	504 863.69	0.11
AUD WISETECH GLOBAL LT NPV	1 108.00	25 227.68	0.01
AUD WOODSIDE PETROLEUM NPV	8 797.00	145 003.89	0.03
AUD WOOLWORTHS GRP LTD NPV	11 946.00	325 513.13	0.07
オーストラリア合計		8 527 307.75	1.82
オーストリア			
EUR ANDRITZ AG NPV(BR)	760.00	32 128.02	0.01
EUR ERSTE GROUP BK AG NPV	2 576.00	74 262.01	0.01
EUR OMV AG NPV(VAR)	1 415.00	48 070.49	0.01
EUR RAIFFEISEN BK INTL NPV (REGD)	1 627.00	31 256.25	0.01
EUR VERBUND AG CLASS 'A' NPV	684.00	48 151.12	0.01
EUR VOESTALPINE AG NPV	1 101.00	35 348.72	0.01
オーストリア合計		269 216.61	0.06
ベルギー			
EUR ANHEUSER-BUSCH IN NPV	7 067.00	472 384.12	0.10
EUR COLRUYT SA NPV	524.00	31 352.98	0.01
EUR ELIA SYS OPERATOR NPV	242.00	27 442.74	0.00
EUR GALAPAGOS NV NPV	352.00	43 432.59	0.01
EUR GPE BRUXELLES LAM NPV	1 093.00	106 792.24	0.02
EUR PROXIMUS SA NPV	1 430.00	29 952.01	0.01
EUR SOFINA NPV	130.00	41 364.60	0.01
EUR SOLVAY SA NPV	749.00	85 868.21	0.02
EUR UMICORE NPV	1 918.00	86 197.29	0.02
ベルギー合計		924 786.78	0.20
カナダ			
CAD AIR CANADA VAR VTG SHS NPV	1 697.00	32 345.01	0.01
CAD ALGONQUIN PWR&UTIL COM NPV	5 800.00	91 079.56	0.02
CAD ALTAGAS LTD COM NPV	2 628.00	37 800.69	0.01
CAD ATCO LTD CL 1 NON VTG	606.00	18 256.22	0.00
CAD B2GOLD CORP COM NPV	10 600.00	59 220.62	0.01
CAD CAE INC COM NPV	2 617.00	63 450.99	0.01
CAD CAMECO CORP COM	3 511.00	35 193.99	0.01
CAD CANADIAN UTILS LTD CL A	1 170.00	29 288.37	0.01
CAD CANOPY GROWTH CORP COM NPV	1 800.00	51 837.33	0.01
CAD CI FINANCIAL CORP COM NPV	1 954.00	25 663.31	0.01
CAD EMERA INC COM	2 330.00	96 821.13	0.02
CAD EMPIRE LTD CL A	1 760.00	48 267.92	0.01
CAD HYDRO ONE INC COM NPV	3 401.00	79 520.26	0.02
CAD IGM FINANCIAL INC COM	630.00	16 699.21	0.00
CAD KEYERA CORPORATION COM NPV	2 042.00	35 312.31	0.01
CAD KINROSS GOLD CORP COM NPV	11 658.00	83 213.60	0.02
CAD KIRKLAND LAKE GOLD COM NPV	2 886.00	118 499.93	0.02
CAD LUNDIN MINING CORP COM	6 272.00	50 237.95	0.01
CAD NORTHLAND POWER IN COM NPV	200.00	6 869.36	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 (%)
CAD ONEX CORP SUB VTG	901.00	48 230.86	0.01
CAD PAN AMER SILVER COM NPV	2 096.00	61 817.36	0.01
CAD QUEBECOR INC CL B	1 656.00	41 326.52	0.01
CAD RITCHIE BROS AUCTIONEERS COM	1 052.00	75 829.40	0.02
CAD SSR MINING INC COM NPV	2 200.00	40 811.79	0.01
CAD TELUS CORPORATION COM NPV	329.00	6 359.63	0.00
CAD TELUS CORPORATION NPV	3 661.00	70 894.98	0.01
CAD TMX GROUP LTD COM NPV	567.00	55 912.44	0.01
CAD TOROMONT INDS LTD COM	100.00	6 855.47	0.00
CAD WSP GLOBAL INC COM NPV	1 121.00	83 432.71	0.02
CAD YAMANA GOLD INC COM	8 909.00	46 610.87	0.01
<b>カナダ合計</b>		<b>1 517 659.79</b>	<b>0.32</b>
<b>フィンランド</b>			
EUR KESKO OYJ EUR2 SER 'B'	273.00	7 184.38	0.00
EUR KONE CORPORATION NPV ORD 'B'	3 181.00	267 575.49	0.06
EUR WARTSILA OYJ ABP SER 'B' EUR3.50	3 825.00	36 063.82	0.01
<b>フィンランド合計</b>		<b>310 823.69</b>	<b>0.07</b>
<b>フランス</b>			
EUR ACCOR EUR3	1 736.00	59 702.34	0.01
EUR ADP EUR3	269.00	34 076.27	0.01
EUR AIR LIQUIDE(L') EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)	4 392.00	723 173.24	0.15
EUR AIRBUS EUR1	5 456.00	572 566.97	0.12
EUR ALSTOM EUR7.00	1 798.00	96 139.31	0.02
EUR AMUNDI EUR2.5 (AIW)	533.00	42 589.98	0.01
EUR ARKEMA EUR10	663.00	77 499.84	0.02
EUR ATOS SE EUR1	854.00	78 537.13	0.02
EUR AXA EUR2.29	17 806.00	419 856.49	0.09
EUR BIOMERIEUX NPV (POST SPLIT)	423.00	61 123.91	0.01
EUR BNP PARIBAS EUR2	10 412.00	535 121.96	0.11
EUR BOLLORE EURO.16	7 562.00	29 434.59	0.01
EUR BOUYGUES EUR1	2 246.00	89 680.88	0.02
EUR BUREAU VERITAS EURO.12	2 713.00	70 228.09	0.01
EUR CAPGEMINI EUR8	1 568.00	218 137.12	0.05
EUR CARREFOUR EUR2.50	5 628.00	92 433.29	0.02
EUR CIE DE ST-GOBAIN EUR4	4 756.00	226 541.05	0.05
EUR CNP ASSURANCES EUR1	2 167.00	34 605.41	0.01
EUR COVIVIO EUR3	422.00	34 578.55	0.01
EUR CREDIT AGRICOLE SA EUR3	10 612.00	122 802.48	0.03
EUR DANONE EURO.25	5 735.00	369 490.75	0.08
EUR DASSAULT AVIATION EUR8	21.00	21 728.97	0.00
EUR DASSAULT SYSTEMES EURO.50	1 218.00	225 903.45	0.05
EUR EDENRED EUR2	2 255.00	129 287.87	0.03
EUR EDF EURO.5	5 829.00	88 657.25	0.02
EUR EIFFAGE EUR4	802.00	78 801.21	0.02
EUR ENGIE EUR1	16 975.00	251 178.97	0.05
EUR ESSILORLUXOTTICA EURO.18	2 633.00	382 203.30	0.08
EUR EURAZEO NPV	360.00	22 263.67	0.00
EUR FAURECIA EUR7	646.00	32 223.47	0.01
EUR GETLINK SE EURO.40	4 654.00	77 661.25	0.02
EUR HERMES INTL NPV	291.00	284 532.20	0.06
EUR ICADE NPV	290.00	21 490.33	0.00
EUR ILIAD NPV	133.00	27 077.90	0.00
EUR INGENICO GROUP EUR1	594.00	90 096.83	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 (%)
EUR IPSEN EUR1	360.00	34 816.60	0.01
EUR JC DECAUX SA NPV	477.00	10 749.87	0.00
EUR KERING EUR4	703.00	508 761.80	0.11
EUR KLEPIERRE EUR1.40	1 822.00	40 320.31	0.01
EUR L' OREAL EURO.20	2 340.00	858 766.33	0.18
EUR LEGRAND SA EUR4	2 434.00	206 661.88	0.04
EUR LVMH MOET HENNESSY EURO.30	2 579.00	1 489 746.40	0.32
EUR NATIXIS EUR1.6	10 119.00	31 229.22	0.01
EUR ORANGE EUR4	18 481.00	234 112.84	0.05
EUR ORPEA EUR2.5	489.00	61 301.90	0.01
EUR PERNOD RICARD EUR1.55	1 970.00	377 042.24	0.08
EUR PEUGEOT SA EUR1	5 360.00	126 725.91	0.03
EUR PUBLICIS GROUPE SA EURO.40	2 122.00	96 685.23	0.02
EUR REMY COINTREAU EUR1.60	206.00	36 716.16	0.01
EUR RENAULT SA EUR3.81	2 169.00	86 541.48	0.02
EUR SAFRAN EURO.20	2 968.00	434 204.33	0.09
EUR SANOFI EUR2	10 526.00	1 066 600.65	0.23
EUR SARTORIUS STEDIM B EURO.20 (POST SUBD)	247.00	89 524.80	0.02
EUR SCHNEIDER ELECTRIC EUR8	5 121.00	714 567.59	0.15
EUR SCOR SE EUR7.876972 (POST CONS)	1 417.00	48 545.24	0.01
EUR SEB SA EUR1	225.00	40 156.43	0.01
EUR SOC GENERALE EUR1.25	7 788.00	155 446.87	0.03
EUR SODEXO EUR4	887.00	73 593.00	0.01
EUR SUEZ EUR4	2 903.00	56 029.90	0.01
EUR TELEPERFORMANCE EUR2.50	526.00	175 672.98	0.04
EUR THALES EUR3	924.00	85 173.55	0.02
EUR TOTAL SE EUR2.5	22 971.00	984 396.14	0.21
EUR UBISOFT ENTERTAIN EURO.31	787.00	75 105.64	0.02
EUR UNIBAIL-RODAMCO-WE NPV(1 ORD UNIBAIL-R & 1CLS)	1 287.00	91 600.81	0.02
EUR VALEO EUR1 (POST SUBD)	2 297.00	89 354.27	0.02
EUR VEOLIA ENVIRONNEME EUR5	5 243.00	120 792.49	0.02
EUR VINCI EUR2.50	4 756.00	486 420.38	0.10
EUR VIVENDI SA EUR5.50	7 717.00	232 438.48	0.05
EUR WENDEL EUR4	311.00	35 248.72	0.01
EUR WORLDLINE EURO.68	2 021.80	187 431.98	0.04
フランス合計		15 163 908.74	3.23
ドイツ			
EUR BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG EUR1	3 065.00	267 790.42	0.06
EUR BEIERSDORF AG NPV	895.00	100 357.95	0.02
EUR CARL ZEISS MEDITEC NPV	367.00	49 080.80	0.01
EUR COMMERZBANK AG NPV	9 209.00	57 392.35	0.01
EUR CONTINENTAL AG ORD NPV	1 032.00	140 977.43	0.03
EUR COVESTRO AG NPV	1 691.00	94 564.69	0.02
EUR DEUTSCHE WOHNEN AG NPV (BR)	3 131.00	157 452.50	0.03
EUR FRAPORT AG NPV	321.00	18 269.77	0.00
EUR FRESENIUS MED CARE NPV	1 988.00	167 652.21	0.04
EUR FRESENIUS SE & CO. KGAA NPV	3 762.00	168 753.91	0.04
EUR GEA GROUP AG NPV	1 451.00	49 831.55	0.01
EUR HEIDELBERGCEMENT NPV	1 342.00	95 579.59	0.02
EUR HENKEL AG & CO KGAA	1 039.00	100 546.71	0.02
EUR HOCHTIEF AG NPV	197.00	19 064.20	0.01
EUR KION GROUP AG NPV	569.00	43 860.30	0.01
EUR KNORR BREMSE AG NPV	647.00	83 028.43	0.02
EUR LANXESS AG NPV	767.00	53 819.69	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 MERCK KGAA NPV	1 209.00	193 574.64	0.04
EUR METRO AG (NEW) NPV	1 423.00	13 038.80	0.00
EUR NEMETSCHEK SE ORD NPV	535.00	42 429.81	0.01
EUR PUMA SE NPV	875.00	87 250.83	0.02
EUR RATIONAL AG NPV	8.00	7 129.35	0.00
EUR RWE AG (NEU) NPV	5 989.00	249 093.73	0.05
EUR SAP AG ORD NPV	9 703.00	1 183 654.18	0.25
EUR SYMRISE AG NPV (BR)	1 203.00	151 098.00	0.03
EUR TEAMVIEWER AG NPV	1 465.00	69 974.65	0.02
EUR THYSSENKRUPP AG NPV	3 536.00	23 695.13	0.01
EUR VOLKSWAGEN AG ORD NPV	329.00	61 196.99	0.01
EUR ZALANDO SE NPV	1 405.00	142 520.05	0.03
ドイツ合計		3 892 678.66	0.83
アイルランド			
GBP DCC ORD EURO.25	1 054.00	79 953.85	0.02
EUR FLUTTER ENTERTAINM ORD EURO.09	941.00	175 034.56	0.04
GBP FLUTTER ENTERTAINM ORD EURO.09	591.00	108 134.44	0.02
EUR KERRY GROUP 'A' ORD EURO.125(DUBLIN LIST)	1 498.00	210 369.95	0.04
アイルランド合計		573 492.80	0.12
イタリア			
EUR AMPLIFON EURO.02	166.00	6 665.97	0.00
EUR ASSIC GENERALI SPA EUR1	9 971.00	170 799.08	0.04
EUR DIASORIN SPA EUR1	235.00	49 643.50	0.01
EUR FINECOBANK SPA EURO.33	5 982.00	93 989.70	0.02
EUR INFRASTRUTTURE WIR NPV	2 695.00	34 784.36	0.01
EUR LEONARDO SPA EUR4.40	4 490.00	32 569.37	0.01
EUR POSTE ITALIANE SPA NPV	4 479.00	45 776.88	0.01
EUR TELECOM ITALIA SPA DI RISP EURO.55	46 703.00	23 771.04	0.00
EUR TELECOM ITALIA SPA EURO.55	79 287.00	37 225.92	0.01
イタリア合計		495 225.82	0.11
日本			
JPY アコム	1 600.00	7 687.37	0.00
JPY アドバンテスト	1 300.00	90 510.67	0.02
JPY エア・ウォーター	1 100.00	18 154.88	0.00
JPY アイシン精機	1 000.00	29 681.13	0.01
JPY アマダ	2 700.00	26 048.43	0.01
JPY 朝日インテック	1 300.00	47 686.41	0.01
JPY アズビル	800.00	35 943.42	0.01
JPY バンダイナムコホールディングス	1 200.00	109 671.54	0.02
JPY 京都銀行	300.00	14 989.21	0.00
JPY カルビー	600.00	17 751.14	0.00
JPY カブコン	500.00	28 194.68	0.01
JPY 東海旅客鉄道	900.00	114 792.62	0.02
JPY 千葉銀行	3 000.00	17 031.89	0.00
JPY 中外製薬	4 100.00	198 325.58	0.04
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	10 781.11	0.00
JPY コンコルディア・フィナンシャルグループ	7 000.00	24 905.30	0.01
JPY コスモス薬品	100.00	17 262.05	0.00
JPY サイバーエージェント	600.00	41 141.21	0.01
JPY 第一生命ホールディングス	7 000.00	110 395.59	0.02
JPY ダイフク	700.00	81 227.52	0.02
JPY 第一三共	10 900.00	386 138.58	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・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	ダイキン工業	1 600.00	363 116.76	0.08
JPY	大東建託	400.00	39 280.75	0.01
JPY	大和ハウス工業	3 400.00	104 339.49	0.02
JPY	大和ハウスリート投資法人	15.00	36 149.60	0.01
JPY	ディスコ	200.00	63 773.68	0.01
JPY	エーザイ	1 600.00	121 018.46	0.03
JPY	ファナック	1 200.00	291 901.22	0.06
JPY	ファーストリテイリング	400.00	329 666.75	0.07
JPY	富士電機	1 000.00	35 579.00	0.01
JPY	ふくおかフィナンシャルグループ	1 000.00	17 866.22	0.00
JPY	GLP投資法人	20.00	30 285.30	0.01
JPY	GMOペイメントゲートウェイ	300.00	42 119.40	0.01
JPY	阪急阪神ホールディングス	1 400.00	45 782.79	0.01
JPY	ハーモニック・ドライブ・システムズ	200.00	15 976.98	0.00
JPY	光通信	100.00	24 042.20	0.01
JPY	ヒロセ電機	210.00	29 725.25	0.01
JPY	久光製薬	300.00	17 607.29	0.00
JPY	ホシザキ	300.00	29 719.49	0.01
JPY	ヒューリック	2 000.00	20 273.32	0.00
JPY	イビデン	700.00	32 826.66	0.01
JPY	出光興産	1 292.00	26 936.54	0.01
JPY	いすゞ自動車	4 000.00	39 050.59	0.01
JPY	伊藤園	300.00	23 188.68	0.00
JPY	伊藤忠テクノソリューションズ	600.00	21 203.55	0.00
JPY	日本空港ビルデング	400.00	23 322.94	0.00
JPY	日本取引所グループ	3 300.00	81 760.25	0.02
JPY	かんぽ生命保険	1 300.00	21 692.64	0.00
JPY	ジャパンリアルエステイト投資法人	8.00	41 582.35	0.01
JPY	JSR	1 300.00	35 967.39	0.01
JPY	鹿島建設	3 000.00	39 501.32	0.01
JPY	カカクコム	700.00	19 662.43	0.00
JPY	関西電力	4 000.00	36 645.41	0.01
JPY	関西ペイント	1 200.00	36 422.92	0.01
JPY	花王	3 000.00	224 636.78	0.05
JPY	京阪ホールディングス	700.00	32 994.49	0.01
JPY	京浜急行電鉄	1 500.00	25 706.07	0.01
JPY	京王電鉄	700.00	49 743.47	0.01
JPY	京成電鉄	700.00	23 529.13	0.01
JPY	キッコーマン	900.00	56 015.34	0.01
JPY	近鉄グループホールディングス	1 000.00	44 401.82	0.01
JPY	麒麟ホールディングス	5 300.00	115 555.50	0.02
JPY	小林製薬	300.00	36 106.45	0.01
JPY	神戸物産	600.00	20 944.62	0.00
JPY	コーエーテクモホールディングス	300.00	15 967.39	0.00
JPY	小糸製作所	700.00	42 157.76	0.01
JPY	小松製作所	5 800.00	141 280.27	0.03
JPY	コーセー	200.00	30 573.00	0.01
JPY	クラレ	2 400.00	23 844.64	0.01
JPY	栗田工業	800.00	29 537.28	0.01
JPY	九州電力	2 200.00	18 587.39	0.00
JPY	九州旅客鉄道	700.00	14 755.21	0.00
JPY	レーザーテック	500.00	52 745.15	0.01
JPY	LINE	200.00	10 318.87	0.00
JPY	ライオン	1 600.00	37 869.10	0.01
JPY	エムスリー	2 900.00	267 598.18	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・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 マキタ	1 500.00	77 679.21	0.02
JPY 丸井グループ	1 100.00	20 106.45	0.00
JPY 日本マクドナルドホールディングス	400.00	19 448.57	0.00
JPY 明治ホールディングス	800.00	56 619.52	0.01
JPY ミネベアミツミ	2 500.00	52 121.79	0.01
JPY ミスミグループ本社	2 000.00	62 814.67	0.01
JPY 三菱瓦斯化学	1 000.00	21 232.32	0.00
JPY 三菱UFJリース	3 900.00	17 915.13	0.00
JPY 三井化学	1 200.00	33 753.06	0.01
JPY 三井不動産	6 000.00	125 523.86	0.03
JPY 三浦工業	700.00	36 854.47	0.01
JPY MonotaRO	800.00	48 870.77	0.01
JPY ナブテスコ	700.00	28 933.11	0.01
JPY 名古屋鉄道	1 400.00	38 559.58	0.01
JPY 日本ハム	500.00	21 361.78	0.00
JPY 日本電産	2 900.00	370 026.37	0.08
JPY 日本M&Aセンター	1 100.00	77 007.91	0.02
JPY 日本ビルファンド投資法人	10.00	55 334.45	0.01
JPY 日本通運	500.00	33 469.19	0.01
JPY 日本ペイントホールディングス	900.00	115 396.79	0.02
JPY 日本酸素ホールディングス	1 400.00	23 415.01	0.00
JPY 日本新薬	200.00	14 308.32	0.00
JPY 日本製鉄	5 100.00	62 432.51	0.01
JPY 日産化学	700.00	41 889.24	0.01
JPY 日清製粉グループ本社	1 000.00	16 274.27	0.00
JPY 日清食品ホールディングス	300.00	24 799.81	0.01
JPY ニトリホールディングス	500.00	106 593.14	0.02
JPY 日東電工	1 000.00	82 857.83	0.02
JPY 野村不動産ホールディングス	800.00	17 338.77	0.00
JPY 日本精工	1 800.00	14 586.43	0.00
JPY 大林組	5 100.00	44 996.40	0.01
JPY オービック	500.00	112 538.96	0.02
JPY 小田急電鉄	1 800.00	54 634.38	0.01
JPY 王子ホールディングス	5 700.00	25 910.33	0.01
JPY オリンパス	7 600.00	164 463.20	0.04
JPY 小野薬品工業	2 400.00	76 022.06	0.02
JPY 日本オラクル	300.00	33 286.98	0.01
JPY オリエンタルランド	1 300.00	221 476.87	0.05
JPY バン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	2 700.00	63 878.21	0.01
JPY ペプチドリーム	600.00	30 611.36	0.01
JPY パーソルホールディングス	800.00	14 668.90	0.00
JPY ビジョン	600.00	26 813.71	0.01
JPY ポーラ・オルビスホールディングス	400.00	7 998.08	0.00
JPY 楽天	4 900.00	54 932.63	0.01
JPY リクルートホールディングス	8 100.00	341 788.54	0.07
JPY リンナイ	200.00	23 361.30	0.00
JPY 良品計画	1 400.00	28 825.70	0.01
JPY SBIホールディングス	1 700.00	46 137.62	0.01
JPY SCSK	400.00	23 898.35	0.01
JPY セコム	1 300.00	129 594.82	0.03
JPY 西武ホールディングス	1 100.00	10 918.25	0.00
JPY 積水ハウス	3 700.00	66 637.26	0.01
JPY シャープ	1 900.00	25 509.47	0.01
JPY シマノ	500.00	118 628.63	0.03
JPY 清水建設	4 000.00	30 419.56	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

- 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 信越化学工業	2 300.00	377 947.74	0.08
JPY 新生銀行	1 300.00	15 484.06	0.00
JPY 塩野義製薬	1 600.00	85 819.23	0.02
JPY 資生堂	2 600.00	183 514.75	0.04
JPY 静岡銀行	3 000.00	21 347.40	0.00
JPY S M C	400.00	254 404.23	0.05
JPY スクウェア・エニックス・ホールディングス	600.00	36 883.24	0.01
JPY スタンレー電気	700.00	20 608.97	0.00
JPY 住友金属鉱山	1 300.00	48 459.36	0.01
JPY サンドラッグ	400.00	16 801.73	0.00
JPY サントリー食品インターナショナル	900.00	32 927.36	0.01
JPY スズケン	400.00	15 305.68	0.00
JPY スズキ	2 300.00	123 607.77	0.03
JPY シスメックス	1 000.00	104 818.99	0.02
JPY T & Dホールディングス	3 800.00	44 422.92	0.01
JPY 太平洋セメント	700.00	18 836.73	0.00
JPY 大成建設	1 100.00	38 925.92	0.01
JPY 大正製薬ホールディングス	200.00	12 735.56	0.00
JPY 帝人	1 500.00	25 662.91	0.01
JPY テルモ	4 200.00	167 033.33	0.04
JPY T H K	700.00	21 649.48	0.00
JPY T I S	1 100.00	21 920.88	0.00
JPY 東武鉄道	1 300.00	39 021.82	0.01
JPY 東宝	700.00	29 671.54	0.01
JPY 東邦瓦斯	500.00	32 749.94	0.01
JPY 東北電力	2 400.00	20 139.06	0.00
JPY 東京センチュリー	200.00	13 253.42	0.00
JPY 東京瓦斯	2 300.00	51 712.78	0.01
JPY 東急	3 700.00	44 957.09	0.01
JPY 東レ	8 200.00	44 517.09	0.01
JPY 東ソー	1 600.00	25 256.29	0.01
JPY T O T O	900.00	51 009.35	0.01
JPY 東洋水産	600.00	29 518.10	0.01
JPY 豊田合成	300.00	8 147.69	0.00
JPY 豊田自動織機	1 000.00	72 308.80	0.02
JPY 豊田通商	1 500.00	51 929.99	0.01
JPY ツルハホールディングス	200.00	29 307.12	0.01
JPY ユー・エス・エス	1 400.00	29 322.46	0.01
JPY ウエルシアホールディングス	600.00	24 138.10	0.01
JPY ヤクルト本社	800.00	38 168.31	0.01
JPY ヤマハ	1 000.00	57 156.56	0.01
JPY ヤマトホールディングス	1 700.00	42 991.13	0.01
JPY Z O Z O	540.00	13 485.11	0.00
日本合計		10 814 531.75	2.30
ジャージー			
GBP GLENCORE XSTRATA ORD USD0.01	98 456.00	278 463.45	0.06
ジャージー合計		278 463.45	0.06
ルクセンブルグ			
EUR AROUNDTOWN SA EURO.01	8 888.00	61 855.96	0.01
ルクセンブルグ合計		61 855.96	0.01
メキシコ			
GBP FRESNILLO PLC ORD USD0.50	479.00	6 730.63	0.00
メキシコ合計		6 730.63	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>オランダ</b>			
USD AERCAP HOLDINGS EURO.01	999.00	36 723.24	0.01
EUR AKZO NOBEL NV EURO.50(POST REV SPLIT)	1 779.00	189 523.22	0.04
EUR ALTICE EUROPE N.V. EURO.01 (COMMON SHARES A)	5 028.00	26 572.03	0.01
EUR ARGEN X NV EURO.10	401.00	114 738.55	0.02
EUR EXOR NV EURO.01	1 060.00	74 024.21	0.02
EUR HEINEKEN HOLDING EUR1.6	1 142.00	105 801.38	0.02
EUR HEINEKEN NV EUR1.60	2 395.00	253 600.86	0.05
EUR ING GROEP N.V. EURO.01	36 126.00	353 273.81	0.08
EUR JUST EAT TAKEAWAY EURO.04	1 173.00	124 935.82	0.03
EUR KON KPN NV EURO.04	34 734.00	103 830.48	0.02
EUR KONINKLIJKE AHOLD EURO.01	10 310.00	295 864.40	0.06
EUR KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20	8 501.00	440 923.34	0.09
EUR QIAGEN NV EURO.01	2 311.00	111 710.14	0.02
EUR RANDSTAD N.V. EURO.10	1 211.00	75 327.11	0.02
GBP ROYAL DUTCH SHELL 'B' SHS EURO.07 (UK LIST)	36 459.00	600 741.77	0.13
EUR STMICROELECTRONICS EUR1.04	5 913.00	232 140.14	0.05
EUR VOPAK(KON) EURO.50	613.00	32 285.90	0.01
EUR WOLTERS KLUWER EURO.12	2 511.00	211 157.17	0.04
<b>オランダ合計</b>		<b>3 383 173.57</b>	<b>0.72</b>
<b>パプアニューギニア</b>			
AUD OIL SEARCH LTD PGKO.10	16 951.00	45 464.85	0.01
<b>パプアニューギニア合計</b>		<b>45 464.85</b>	<b>0.01</b>
<b>スペイン</b>			
EUR ACS ACTIVIDADES CO EURO.5	2 428.00	76 936.86	0.02
EUR AENA SME S.A. EUR10	638.00	104 249.79	0.02
EUR AMADEUS IT GROUP EURO.01	4 182.00	287 444.13	0.06
EUR CAIXABANK SA EUR1	36 079.00	92 659.58	0.02
EUR CELLNEX TELECOM SA EURO.25	2 942.00	186 096.37	0.04
EUR ENAGAS SA EUR1.50	2 207.00	53 909.07	0.01
EUR ENDESA SA EUR1.2	2 934.00	84 126.33	0.02
EUR FERROVIAL SA EURO.2	4 487.00	125 166.59	0.03
EUR GRIFOLS SA EURO.25 (CLASS A) POST SUBD	2 744.00	77 956.35	0.02
EUR IBERDROLA SA EURO.75 (POST SUBDIVISION)	55 337.00	757 591.70	0.16
EUR INDITEX EURO.03 (POST SUBD)	10 101.00	336 506.43	0.07
EUR NATURGY ENERGY GRO EUR1	2 920.00	67 535.30	0.01
EUR RED ELECTRICA CORP EURO.5	3 846.00	78 831.03	0.02
EUR REPSOL SA EUR1	14 862.00	143 254.52	0.03
EUR SIEMENS GAMESA REN EURO.17	2 188.00	78 335.36	0.02
EUR TELEFONICA SA EUR1	44 883.00	196 340.83	0.04
<b>スペイン合計</b>		<b>2 746 940.24</b>	<b>0.59</b>
<b>スイス</b>			
CHF SWATCH GROUP CHF2.25(BR)	263.00	65 132.66	0.01
CHF SWISS RE AG CHF0.10	2 807.00	257 414.27	0.06
CHF VIFOR PHARMA AG CHF0.01	441.00	64 934.61	0.01
<b>スイス合計</b>		<b>387 481.54</b>	<b>0.08</b>
<b>イギリス</b>			
GBP 3I GROUP ORD GBPO.738636	9 499.00	135 756.96	0.03
GBP ASTRAZENECA ORD USDO.25	12 989.00	1 353 462.28	0.29
GBP AVEVA GROUP ORD GBPO.03556	697.00	31 563.57	0.01
GBP AVIVA ORD GBPO.25	37 336.00	160 103.51	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 (%)	
GBP	BAE SYSTEMS ORD GBPO.025	31 509.00	212 013.10	0.04
GBP	BARRATT DEVEL ORD GBPO.10	10 971.00	90 810.37	0.02
GBP	BRIT AMER TOBACCO ORD GBPO.25	22 687.00	799 459.14	0.17
GBP	BRITISH LAND CO PLC REIT	8 296.00	52 243.48	0.01
GBP	BT GROUP ORD GBPO.05	92 010.00	143 474.73	0.03
GBP	BUNZL ORD GBPO.32142857	3 478.00	109 535.54	0.02
USD	COCA-COLA EUROPEAN ORD EURO.01	2 144.00	95 793.92	0.02
GBP	EVRAZ PLC ORD USD1	5 080.00	26 199.07	0.01
GBP	HALMA ORD GBPO.10	3 875.00	114 640.74	0.02
GBP	HIKMA PHARMACEUTIC ORD GBPO.10	1 760.00	61 279.86	0.01
GBP	INFORMA PLC (GB) ORD GBPO.001	14 434.00	102 170.13	0.02
GBP	JD SPORTS FASHION ORD GBPO.0025	4 805.00	49 792.57	0.01
GBP	JOHNSON MATTHEY ORD GBP1.109245	2 141.00	63 569.53	0.01
GBP	KINGFISHER ORD GBPO.157142857	22 357.00	81 663.34	0.02
GBP	LAND SECURITIES GP ORD GBPO.106666666	7 382.00	64 808.71	0.01
GBP	LLOYDS BANKING GP ORD GBPO.1	695 683.00	330 828.43	0.07
GBP	MELROSE INDUST PLC ORD GBPO.0685714	51 497.00	105 532.90	0.02
GBP	NATIONAL GRID ORD GBPO.12431289	34 678.00	392 782.59	0.08
GBP	OCADO GROUP PLC ORD GBPO.02	4 487.00	132 207.45	0.03
GBP	RECKITT BENCK GRP ORD GBPO.10	7 043.00	619 077.53	0.13
GBP	RELX PLC GBPO.1444	19 014.00	443 596.60	0.09
GBP	RENTOKIL INITIAL ORD GBPO.01	18 107.00	120 216.06	0.03
GBP	ROLLS-ROYCE HLDGS ORD GBPO.20	80 499.00	113 595.99	0.02
GBP	SAGE GROUP GBPO.01051948	10 415.00	84 122.50	0.02
GBP	SEVERN TRENT ORD GBPO.9789	2 300.00	73 356.99	0.02
GBP	SMITHS GROUP ORD GBPO.375	3 672.00	71 524.61	0.02
GBP	SPIRAX-SARCO ENG ORD GBPO.269230769	717.00	106 587.66	0.02
GBP	SSE PLC ORD GBPO.50	10 250.00	183 505.96	0.04
GBP	ST JAMES ' S PLACE ORD GBPO.15	5 582.00	76 012.94	0.02
GBP	UNITED UTILITIES G ORD GBPO.05	6 455.00	77 594.20	0.02
GBP	WHITBREAD ORD GBPO.76797385	1 923.00	77 814.90	0.02
GBP	WPP PLC ORD GBPO.10	12 314.00	119 287.22	0.03
イギリス合計			6 875 985.08	1.46
無記名株式合計			56 275 727.71	11.99
参加証券				
スイス				
CHF	LINDT & SPRUENGLI PTG CERT CHF10	11.00	94 228.43	0.02
CHF	SCHINDLER-HLDG AG PTG CERT CHF0.10(POST-SUBD)	385.00	105 467.80	0.02
スイス合計			199 696.23	0.04
参加証券合計			199 696.23	0.04
その他の株式				
スイス				
CHF	ROCHE HLDGS AG GENUSSSCHEINE NPV	6 701.00	2 213 557.99	0.47
スイス合計			2 213 557.99	0.47
その他の株式合計			2 213 557.99	0.47

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	532.00	35 255.36	0.01
EUR FUCHS PETROLUB SE NON-VTG PRF NPV	543.00	31 125.80	0.01
EUR HENKEL AG&CO. KGAA NON-VTG PRF NPV	1 664.00	179 620.63	0.04
EUR PORSCHE AUTO HL SE NON VTG PRF NPV	1 392.00	88 750.38	0.02
EUR SARTORIUS AG NON VTG PRF NPV	333.00	152 163.82	0.03
EUR VOLKSWAGEN AG NON VTG PRF NPV	1 720.00	290 801.96	0.06
<b>ドイツ合計</b>		<b>777 717.95</b>	<b>0.17</b>
<b>優先株式合計</b>		<b>777 717.95</b>	<b>0.17</b>
<b>記名株式</b>			
<b>オーストラリア</b>			
AUD AMPOL LTD NPV	2 280.00	51 492.55	0.01
AUD BHP GROUP LTD NPV	27 272.00	765 030.86	0.16
GBP BHP GROUP PLC ORD USD0.50	20 807.00	471 843.65	0.10
AUD COLES GROUP LTD NPV	12 645.00	166 409.98	0.04
AUD VODAFONE HUTCHISON NPV	4 194.00	23 702.98	0.01
<b>オーストラリア合計</b>		<b>1 478 480.02</b>	<b>0.32</b>
<b>ベルギー</b>			
EUR AGEAS NPV	1 596.00	78 694.55	0.02
EUR KBC GROUP NV NPV	2 325.00	162 420.04	0.03
EUR TELENET GRP HLDG NPV	335.00	14 346.03	0.00
EUR UCB NPV	1 174.00	125 772.58	0.03
<b>ベルギー合計</b>		<b>381 233.20</b>	<b>0.08</b>
<b>カナダ</b>			
CAD 1ST QUANTUM MINLS COM NPV	5 674.00	80 694.36	0.02
CAD AGNICO EAGLE MINES LTD COM	2 243.00	147 312.08	0.03
CAD ALIMENTATION COUCHE TARD INC SUB VTG SH	8 216.00	273 444.00	0.06
CAD BANK NOVA SCOTIA HALIFAX COM	11 620.00	566 698.05	0.12
CAD BANK OF MONTREAL COM NPV	6 128.00	441 335.16	0.09
CAD BARRICK GOLD CORP COM NPV	16 839.00	387 352.87	0.08
CAD BCE INC COM NEW	1 607.00	69 815.65	0.02
CAD BLACKBERRY LTD NPV	6 340.00	37 426.50	0.01
CAD BROOKFIELD ASSET M LTD VTG SHS NPV CL 'A'	12 786.50	517 518.27	0.11
CAD CAN PACIFIC RYS COM NPV	1 298.00	420 249.91	0.09
CAD CANADIAN NAT RES LTD COM	11 332.00	259 099.59	0.06
CAD CANADIAN NATL RY CO COM	6 791.00	712 690.79	0.15
CAD CANADIAN TIRE LTD CL A	499.00	63 908.50	0.01
CAD CCL INDUSTRIES INC 'B' NON-VTG COM NPV	1 472.00	65 041.07	0.01
CAD CDN IMPERIAL BK OF COMMERCE COM	4 257.00	359 639.14	0.08
CAD CENOVUS ENERGY INC COM NPV	10 129.00	50 336.26	0.01
CAD CGI INC COM NPV SUB VOTING SHARES C	2 193.00	162 304.68	0.03
CAD CONSTELLATION SOFT COM STK NPV	224.00	277 995.77	0.06
CAD CRONOS GROUP INC COM NPV	1 300.00	11 747.05	0.00
CAD DOLLARAMA INC COM NPV	2 706.00	111 004.68	0.02
CAD ENBRIDGE INC COM NPV	19 389.00	606 850.71	0.13
CAD FAIRFAX FINL HLDGS SUB-VTG COM NPV	260.00	89 361.83	0.02
CAD FORTIS INC COM NPV	4 469.00	180 325.65	0.04
CAD FRANCO NEVADA CORP COM NPV	1 783.00	237 847.99	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 (%)
CAD GILDAN ACTIVEWEAR INC COM	1 860.00	48 742.65	0.01
CAD GREAT WEST LIFE CO INC COM	2 691.00	62 732.55	0.01
CAD IA FINANCIAL CORP COM NPV	1 000.00	43 884.56	0.01
CAD IMPERIAL OIL LTD COM NEW	2 567.00	44 529.79	0.01
CAD INTACT FINL CORP COM NPV	1 379.00	154 606.77	0.03
CAD INTER PIPELINE LTD COM NPV	4 073.00	40 670.28	0.01
CAD LOBLAW COS LTD COM	1 725.00	85 457.98	0.02
CAD MAGNA INTL INC COM NPV	2 705.00	166 236.75	0.04
CAD MANULIFE FINL CORP COM	18 413.00	314 437.61	0.07
CAD METRO INC CL A SUB	2 441.00	112 377.54	0.02
CAD NATL BK OF CANADA COM NPV	3 217.00	178 587.07	0.04
CAD NUTRIEN LTD NPV	5 447.00	269 428.74	0.06
CAD OPEN TEXT CO COM NPV	2 655.00	117 455.94	0.03
CAD PARKLAND CORP. COM NPV	1 400.00	42 975.54	0.01
CAD PEMBINA PIPELINE C COM NPV	5 679.00	145 141.20	0.03
CAD POWER CORP CDA COM	5 338.00	120 443.80	0.03
CAD RESTAURANT BRANDS COM NPV	2 679.00	153 000.07	0.03
CAD ROGERS COMMS INC CLASS ' B ' COM CAD1.62478	3 397.00	160 583.55	0.03
CAD ROYAL BK OF CANADA COM NPV	13 632.00	1 115 680.16	0.24
CAD SAPUTO INC COM	2 540.00	70 619.80	0.02
CAD SHAW COMMUNICATIONS INC CL B CONV	4 353.00	75 847.47	0.02
CAD SHOPIFY INC COM NPV CL A	1 030.00	1 110 967.74	0.24
CAD SUN LIFE FINL INC COM	5 502.00	244 849.40	0.05
CAD SUNCOR ENERGY INC COM NPV ' NEW '	14 645.00	234 722.32	0.05
CAD TC ENERGY CORPORAT COM NPV	8 956.00	394 826.98	0.08
CAD TECK RESOURCES LTD CLASS ' B ' SUB-VTG COM NPV	4 314.00	68 310.27	0.01
CAD THOMSON-REUTERS CP COM NPV(POST REV SPLIT)	1 660.00	131 862.34	0.03
CAD TORONTO-DOMINION COM NPV	17 337.00	926 851.89	0.20
CAD WESTON GEORGE LTD COM	806.00	59 776.73	0.01
CAD WHEATON PRECIOUS M COM NPV	4 174.00	161 465.10	0.03
<b>カナダ合計</b>		<b>12 987 073.15</b>	<b>2.77</b>
<b>フィンランド</b>			
EUR ELISA OYJ NPV	1 254.00	67 501.57	0.01
EUR FORTUM OYJ EUR3.40	4 129.00	94 855.61	0.02
EUR NESTE OIL OYJ NPV	3 935.00	264 441.90	0.06
EUR NOKIA OYJ NPV	52 600.00	210 625.10	0.04
EUR ORION CORP SER ' B ' NPV	910.00	42 953.87	0.01
EUR SAMPO PLC SER ' A ' NPV	4 414.00	191 295.37	0.04
EUR STORA ENSO OYJ NPV SER ' R '	5 135.00	87 039.04	0.02
EUR UPM-KYMMENE CORP NPV	4 999.00	165 162.18	0.04
<b>フィンランド合計</b>		<b>1 123 874.64</b>	<b>0.24</b>
<b>フランス</b>			
EUR GECINA EUR7.50	429.00	65 326.52	0.01
EUR LA FRANCAISE DES EURO.40 (PROMESSES)	953.00	39 853.65	0.01
EUR MICHELIN (CGDE) EUR2	1 539.00	192 287.42	0.04
<b>フランス合計</b>		<b>297 467.59</b>	<b>0.06</b>
<b>ドイツ</b>			
EUR ADIDAS AG NPV (REGD)	1 767.00	564 988.11	0.12
EUR ALLIANZ SE NPV(REGD)(VINKULIERT)	3 865.00	913 844.05	0.20
EUR BASF SE NPV	8 523.00	625 272.39	0.13
EUR BAYER AG NPV (REGD)	9 150.00	528 326.25	0.11

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 BRENNTAG AG	1 415.00	108 429.43	0.02
EUR DAIMLER AG ORD NPV(REGD)	7 949.00	536 760.12	0.11
EUR DELIVERY HERO SE NPV	1 207.00	146 186.11	0.03
EUR DEUTSCHE BANK AG NPV(REGD)	18 313.00	204 667.86	0.04
EUR DEUTSCHE BOERSE AG NPV(REGD)	1 769.00	295 721.87	0.06
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA ORD NPV (REGD)(VINK)	3 251.00	37 511.82	0.01
EUR DEUTSCHE POST AG NPV(REGD)	9 152.00	443 378.71	0.09
EUR DEUTSCHE TELEKOM NPV(REGD)	30 975.00	560 045.44	0.12
EUR E.ON SE NPV	20 981.00	227 784.66	0.05
EUR EVONIK INDUSTRIES NPV	1 953.00	59 128.68	0.01
EUR HANNOVER RUECKVERS ORD NPV(REGD)	562.00	94 318.70	0.02
EUR INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)	11 646.00	411 241.50	0.09
EUR LEG IMMOBILIEN AG NPV	629.00	89 882.87	0.02
EUR MTU AERO ENGINES H NPV (REGD)	490.00	116 026.02	0.03
EUR MUENCHENER RUECKVE NPV(REGD)	1 302.00	363 820.88	0.08
EUR SCOUT24 AG NPV	1 079.00	82 733.86	0.02
EUR SIEMENS AG NPV(REGD)	7 101.00	951 352.21	0.20
EUR SIEMENS ENERGY AG NPV	3 929.00	117 026.76	0.03
EUR SIEMENS HEALTHINEE NPV	2 568.00	118 419.49	0.03
EUR TELEFONICA DEUTSCH NPV	10 238.00	28 338.85	0.01
EUR UNIPER SE NPV	2 018.00	68 555.65	0.01
EUR UNITED INTERNET AG NPV(REGD)	858.00	34 310.53	0.01
EUR VONOVIA SE NPV	4 784.00	328 936.24	0.07
<b>ドイツ合計</b>		<b>8 057 009.06</b>	<b>1.72</b>
<b>アイルランド</b>			
EUR CRH ORD EURO.32	7 257.00	284 904.62	0.06
GBP EXPERIAN ORD USDO.10	8 969.00	316 833.72	0.07
EUR KINGSPAN GROUP ORD EURO.13(DUBLIN LISTING)	1 387.00	121 365.32	0.02
EUR SMURFIT KAPPA GRP ORD EURO.001	2 168.00	92 427.41	0.02
<b>アイルランド合計</b>		<b>815 531.07</b>	<b>0.17</b>
<b>マン島</b>			
GBP GVC HLDGS PLC ORD EURO.01	5 636.00	77 914.56	0.02
<b>マン島合計</b>		<b>77 914.56</b>	<b>0.02</b>
<b>イタリア</b>			
EUR ATLANTIA SPA EUR1	4 576.00	83 639.84	0.02
EUR DAVIDE CAMPARI MIL EURO.05	4 647.00	53 886.44	0.01
EUR ENEL EUR1	75 542.00	756 341.16	0.16
EUR ENI SPA EUR1	25 043.00	248 728.29	0.05
EUR FERRARI NV EURO.01(NEW)	1 178.00	249 133.05	0.05
EUR INTESA SANPAOLO NPV	153 081.00	352 570.57	0.08
EUR MEDIOBANCA SPA EURO.5	6 206.00	55 484.11	0.01
EUR MONCLER SPA NPV	1 848.00	90 987.37	0.02
EUR NEXI SPA NPV	4 341.00	82 044.73	0.02
EUR PIRELLI & C SPA NPV	2 844.00	15 308.97	0.00
EUR PRYSMIAN SPA EURO.10	2 468.00	80 979.44	0.02
EUR RECORDATI EURO.125	933.00	49 809.52	0.01
EUR SNAM EUR1	18 866.00	106 135.00	0.02
EUR TERNA SPA ORD EURO.22	13 075.00	98 096.06	0.02
EUR UNICREDIT SPA NPV (POST REV SPLIT)	19 822.00	204 934.84	0.05
<b>イタリア合計</b>		<b>2 528 079.39</b>	<b>0.54</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 (%)
日本			
JPY エービーシー・マート	300.00	15 650.92	0.00
JPY イオン	4 000.00	119 108.13	0.03
JPY イオンモール	1 200.00	19 275.95	0.00
JPY A G C	1 300.00	43 322.94	0.01
JPY 味の素	3 300.00	69 006.47	0.01
JPY アルフレッサ ホールディングス	1 200.00	24 051.79	0.01
JPY A N Aホールディングス	900.00	21 728.60	0.00
JPY アサヒグループホールディングス	2 800.00	108 401.82	0.02
JPY 旭化成	8 000.00	73 428.91	0.02
JPY アステラス製薬	11 400.00	162 185.57	0.03
JPY ブリヂストン	3 200.00	111 827.38	0.02
JPY ブラザー工業	1 100.00	21 098.06	0.00
JPY キヤノン	6 500.00	115 538.24	0.02
JPY カシオ計算機	1 300.00	23 375.69	0.00
JPY 中部電力	3 900.00	47 031.89	0.01
JPY 中国電力	2 100.00	26 724.53	0.01
JPY 大日本印刷	1 800.00	33 764.56	0.01
JPY 大和証券グループ本社	8 500.00	37 016.06	0.01
JPY デンソー	2 600.00	122 900.02	0.03
JPY 電通グループ	1 200.00	39 127.31	0.01
JPY 東日本旅客鉄道	1 800.00	111 996.16	0.02
JPY E N E O Sホールディングス	20 200.00	69 448.09	0.01
JPY 富士フイルムホールディングス	2 200.00	118 676.58	0.03
JPY 富士通	1 200.00	166 924.00	0.04
JPY 博報堂D Yホールディングス	1 400.00	20 273.32	0.00
JPY 浜松ホトニクス	1 000.00	56 293.45	0.01
JPY 日野自動車	1 100.00	9 546.87	0.00
JPY 日立建機	1 000.00	27 724.77	0.01
JPY 日立金属	1 600.00	23 522.42	0.00
JPY 日立製作所	6 200.00	235 811.08	0.05
JPY 本田技研工業	10 400.00	286 392.71	0.06
JPY H O Y A	2 400.00	320 153.44	0.07
JPY 飯田グループホールディングス	1 200.00	24 143.85	0.01
JPY 国際石油開発帝石	7 000.00	39 204.03	0.01
JPY 伊藤忠商事	8 600.00	227 505.16	0.05
JPY 日本航空	200.00	3 791.90	0.00
JPY ゆうちょ銀行	3 200.00	25 225.61	0.01
JPY 日本郵政	10 400.00	77 066.22	0.02
JPY 日本リテールファンド投資法人	19.00	30 338.05	0.01
JPY 日本たばこ産業	7 300.00	148 415.25	0.03
JPY ジェイ エフ イー ホールディングス	2 900.00	26 587.39	0.01
JPY K D D I	10 300.00	294 603.21	0.06
JPY キーエンス	1 200.00	613 263.01	0.13
JPY コナミホールディングス	600.00	31 474.47	0.01
JPY クボタ	6 900.00	137 007.43	0.03
JPY 京セラ	1 900.00	108 652.12	0.02
JPY 協和キリン	1 800.00	48 937.90	0.01
JPY ローソン	200.00	9 072.16	0.00
JPY L I X I L	1 700.00	40 839.13	0.01
JPY 丸紅	9 900.00	57 771.76	0.01
JPY マツダ	4 500.00	26 626.71	0.01
JPY メディカルホールディングス	1 100.00	20 707.74	0.00
JPY メルカリ	500.00	22 920.16	0.00
JPY 三菱ケミカルホールディングス	7 400.00	40 982.98	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 三菱商事	8 600.00	200 659.80	0.04
JPY 三菱電機	10 900.00	160 298.73	0.03
JPY 三菱地所	7 600.00	131 483.10	0.03
JPY 三菱重工業	1 800.00	40 591.70	0.01
JPY 三菱UFJフィナンシャル・グループ	78 200.00	336 348.12	0.07
JPY 三井物産	10 600.00	180 944.62	0.04
JPY みずほフィナンシャルグループ	14 740.00	187 651.41	0.04
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	2 600.00	75 674.90	0.02
JPY 村田製作所	3 700.00	323 925.20	0.07
JPY 日本電気	1 700.00	91 786.14	0.02
JPY ネクソン	3 200.00	96 820.90	0.02
JPY 日本碍子	1 600.00	25 455.77	0.01
JPY 日本特殊陶業	1 100.00	19 948.21	0.00
JPY 任天堂	700.00	397 813.48	0.08
JPY 日本プロロジスリート投資法人	13.00	40 829.54	0.01
JPY 日本電信電話	7 800.00	184 387.44	0.04
JPY 日本郵船	1 000.00	21 826.90	0.00
JPY 日産自動車	13 900.00	65 650.92	0.01
JPY 野村ホールディングス	19 600.00	98 493.41	0.02
JPY 野村不動産マスターファンド投資法人	28.00	36 518.82	0.01
JPY 野村総合研究所	2 200.00	74 370.65	0.02
JPY エヌ・ティ・ティ・データ	3 600.00	47 919.44	0.01
JPY NTTドコモ	3 200.00	118 854.95	0.03
JPY オムロン	1 200.00	108 520.74	0.02
JPY オリックス	8 600.00	128 082.47	0.03
JPY オリックス不動産投資法人	18.00	26 928.79	0.01
JPY 大阪瓦斯	2 200.00	42 280.51	0.01
JPY 大塚商会	700.00	33 967.87	0.01
JPY 大塚ホールディングス	2 500.00	101 702.23	0.02
JPY パナソニック	13 400.00	142 963.32	0.03
JPY ルネサスエレクトロニクス	5 100.00	45 387.68	0.01
JPY りそなホールディングス	14 700.00	51 553.96	0.01
JPY リコー	4 100.00	27 405.42	0.01
JPY ローム	500.00	41 764.56	0.01
JPY 参天製薬	2 200.00	36 605.13	0.01
JPY セガサミーホールディングス	1 300.00	18 289.14	0.00
JPY セイコーエプソン	1 900.00	28 370.18	0.01
JPY 積水化学工業	1 800.00	31 123.47	0.01
JPY セブン&アイ・ホールディングス	4 600.00	146 150.08	0.03
JPY S Gホールディングス	2 200.00	65 825.94	0.01
JPY 島津製作所	1 500.00	54 015.82	0.01
JPY しまむら	100.00	10 357.23	0.00
JPY ソフトバンク	17 600.00	216 803.64	0.05
JPY ソフトバンクグループ	10 000.00	697 386.72	0.15
JPY 総合警備保障	400.00	21 443.30	0.00
JPY S O M P Oホールディングス	2 300.00	88 448.81	0.02
JPY ソニー	8 000.00	744 492.93	0.16
JPY S U B A R U	4 000.00	79 520.50	0.02
JPY S U M C O	1 500.00	30 409.97	0.01
JPY 住友化学	9 000.00	31 934.79	0.01
JPY 住友商事	7 400.00	91 298.01	0.02
JPY 大日本住友製薬	1 100.00	13 956.37	0.00
JPY 住友電気工業	5 400.00	61 832.65	0.01
JPY 三井住友フィナンシャルグループ	7 900.00	229 707.98	0.05
JPY 三井住友トラスト・ホールディングス	2 000.00	58 518.34	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・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 住友不動産	2 100.00	68 573.48	0.01
JPY 武田薬品工業	10 109.00	363 061.19	0.08
JPY TDK	800.00	112 932.15	0.02
JPY 東京海上ホールディングス	4 100.00	204 066.17	0.04
JPY 東京電力ホールディングス	11 900.00	31 041.00	0.01
JPY 東京エレクトロン	900.00	306 142.41	0.07
JPY 東急不動産ホールディングス	5 000.00	24 262.77	0.01
JPY 凸版印刷	1 800.00	24 598.42	0.01
JPY 東芝	2 500.00	70 055.14	0.01
JPY トヨタ自動車	13 500.00	906 128.03	0.19
JPY トレンドマイクロ	900.00	48 937.90	0.01
JPY ユニ・チャーム	2 500.00	121 385.76	0.03
JPY ユナイテッド・アーバン投資法人	14.00	15 842.72	0.00
JPY 西日本旅客鉄道	1 000.00	45 686.89	0.01
JPY ヤマダホールディングス	5 700.00	27 112.92	0.01
JPY ヤマハ発動機	1 700.00	32 769.12	0.01
JPY 山崎製パン	900.00	14 948.93	0.00
JPY 安川電機	1 400.00	67 532.97	0.01
JPY 横河電機	1 400.00	24 757.61	0.01
JPY Zホールディングス	18 100.00	114 041.72	0.02
日本合計		13 825 643.97	2.95
<b>ルクセンブルグ</b>			
EUR ARCELORMITTAL NPV(POST STOCK SPLIT)	6 715.00	123 298.61	0.03
EUR EUROFINS SCIENTIFI EURO.01	1 310.00	106 651.52	0.02
EUR TENARIS S.A. USD1	3 182.00	24 687.71	0.00
ルクセンブルグ合計		254 637.84	0.05
<b>オランダ</b>			
EUR ADYEN NV EURO.01	168.00	321 940.48	0.07
EUR AEGON NV EURO.12	19 090.00	71 612.00	0.01
EUR ASML HOLDING NV EURO.09	3 945.00	1 717 011.42	0.37
EUR CNH INDUSTRIAL NV COM EURO.01	9 990.00	109 557.95	0.02
EUR FIAT CHRYSLER AUTO EURO.01	9 700.00	151 606.63	0.03
EUR KONINKLIJKE DSM NV EUR1.5	1 599.00	262 616.98	0.06
EUR NN GROUP N.V. EURO.12	2 591.00	105 533.01	0.02
EUR PROSUS N.V. EURO.05	4 525.00	491 699.21	0.10
GBP ROYAL DUTCH SHELL PLC 'A' SHS EURO.07	40 347.00	684 735.21	0.15
オランダ合計		3 916 312.89	0.83
<b>ポルトガル</b>			
EUR EDP ENERGIAS PORTU EUR1(REGD)	28 435.00	151 974.32	0.03
EUR GALP ENERGIA EUR1-B	4 024.00	43 533.38	0.01
EUR JERONIMO MARTINS EUR5	2 167.00	37 223.50	0.01
ポルトガル合計		232 731.20	0.05
<b>スペイン</b>			
EUR BANCO SANTANDER SA EURO.50(REGD)	157 538.00	455 570.52	0.10
EUR BANKINTER SA EURO.3(REGD)	4 511.00	22 388.25	0.01
EUR BBVA(BILB-VIZ-ARG) EURO.49	62 202.00	292 415.71	0.06
EUR MAPFRE SA EURO.10	7 470.00	14 359.53	0.00
スペイン合計		784 734.01	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・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 (%)
スイス			
CHF ABB LTD CHF0.12 (REGD)	17 594.00	465 843.57	0.10
CHF ADECCO GROUP AG CHF0.1 (REGD)	1 455.00	88 460.40	0.02
CHF ALCON AG CHF0.04	4 679.00	299 666.87	0.06
CHF BALOISE-HLDGS CHF0.1 (REGD)	512.00	88 623.00	0.02
CHF BARRY CALLEBAUT AG CHF0.02 (REGD)	28.00	60 342.43	0.01
CHF BQE CANT VAUDOISE CHF1	207.00	21 401.97	0.00
CHF CLARIANT CHF4.00 (REGD)	2 010.00	40 497.51	0.01
GBP COCA-COLA HBC AG ORD CHF6.70	1 871.00	54 004.13	0.01
CHF CREDIT SUISSE GRP CHF0.04 (REGD)	23 722.00	300 815.82	0.06
CHF EMS-CHEMIE HLDG AG CHF0.01 (REGD) (POST RECON)	78.00	71 555.29	0.01
CHF GEBERIT CHF0.10 (REGD)	351.00	212 081.08	0.04
CHF GIVAUDAN AG CHF10	88.00	360 048.60	0.08
CHF JULIUS BAER GRUPPE CHF0.02 (REGD)	2 120.00	122 802.17	0.03
CHF KUEHNE&NAGEL INTL CHF1 (REGD) (POST-SUBD)	517.00	117 471.44	0.02
CHF LAFARGEHOLCIM LTD CHF2 (REGD)	4 947.00	260 437.45	0.06
CHF LINDT & SPRUENGLI CHF100 (REGD)	1.00	89 252.18	0.02
CHF LOGITECH INTL CHF0.25 (REGD) (POST-SUBD)	1 572.00	139 575.12	0.03
CHF LONZA GROUP AG CHF1 (REGD)	711.00	447 349.61	0.10
CHF NESTLE SA CHF0.10 (REGD)	28 371.00	3 170 858.04	0.68
CHF NOVARTIS AG CHF0.50 (REGD)	21 182.00	1 924 934.43	0.41
CHF PARTNERS GROUP HLG CHF0.01 (REGD)	177.00	190 627.42	0.04
CHF RICHEMONT(CIE FIN) CHF1.00 (REG) SER 'A'	4 962.00	413 710.11	0.09
CHF SCHINDLER-HLDG AG CHF0.1 (REGD) (POST-SUBD)	184.00	48 901.36	0.01
CHF SGS LTD CHF1 (REGD)	58.00	165 869.88	0.04
CHF SIKA AG CHF0.01 (REG)	1 346.00	344 788.91	0.07
CHF SONOVA HOLDING AG CHF0.05 (REGD)	521.00	129 545.01	0.03
CHF STRAUMANN HLDG CHF0.1 (REGD)	98.00	112 797.97	0.02
CHF SWATCH GROUP CHF0.45 (REGD)	546.00	26 283.75	0.01
CHF SWISS LIFE HLDG CHF5.1 (REGD)	287.00	128 647.52	0.03
CHF SWISS PRIME SITE CHF15.3 (REGD)	771.00	69 665.08	0.01
CHF SWISSCOM AG CHF1 (REGD)	246.00	130 431.90	0.03
CHF TEMENOS AG CHF5 (REGD)	591.00	74 944.00	0.02
CHF UBS GROUP CHF0.10 (REGD)	34 873.00	496 534.82	0.11
CHF ZURICH INSURANCE GRP CHF0.10	1 429.00	582 302.11	0.12
スイス合計		11 251 070.95	2.40

## イギリス

GBP ADMIRAL GROUP ORD GBPO.001	1 923.00	73 347.79	0.02
GBP ANGLO AMERICAN USD0.54945	12 051.00	356 123.11	0.08
GBP ANTOFAGASTA ORD GBPO.05	4 228.00	70 754.95	0.02
GBP ASHTEAD GROUP ORD GBPO.10	4 380.00	186 009.58	0.04
GBP ASSOC BRIT FOODS ORD GBPO.0568	3 831.00	107 917.57	0.02
GBP AUTO TRADER GROUP ORD GBPO.01	9 025.00	67 545.72	0.01
GBP BARCLAYS ORD GBPO.25	169 969.00	305 339.67	0.07
GBP BERKELEY GP HLDGS ORD GBPO.05	1 196.00	73 832.32	0.02
GBP BP ORD USD0.25	200 314.00	662 288.43	0.14
GBP BURBERRY GROUP ORD GBPO.0005	4 283.00	98 864.55	0.02
GBP COMPASS GROUP ORD GBPO.1105	17 515.00	309 596.23	0.07
GBP CRODA INTL ORD GBPO.10609756	1 362.00	108 300.22	0.02
GBP DIAGEO ORD GBPO.28 101/108	23 142.00	889 796.94	0.19
GBP DIRECT LINE INSURA ORD GBP 0.109090909	14 796.00	58 430.56	0.01
GBP FERGUSON PLC (NEW) ORD GBPO.10	2 198.00	247 197.22	0.05
GBP GLAXOSMITHKLINE ORD GBPO.25	49 629.00	907 723.59	0.19
GBP HARGREAVES LANSLOW ORD GBPO.004 (WI)	3 845.00	73 405.72	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 (%)
GBP HSBC HLDGS ORD USDO.50(UK REG)	201 620.00	1 045 063.32	0.22
GBP IMPERIAL BRANDS PL GBPO.10	9 270.00	168 436.18	0.04
GBP INTERCONTL HOTELS ORD GBPO.208521303	1 766.00	109 467.93	0.02
GBP INTERTEK GROUP ORD GBPO.01	1 686.00	124 294.38	0.03
GBP LEGAL & GENERAL GP ORD GBPO.025	58 022.00	195 747.15	0.04
GBP LONDON STOCK EXCH ORD GBPO.06918604	3 118.00	337 427.32	0.07
GBP M&G PLC ORD GBPO.05	26 919.00	67 384.15	0.01
GBP MONDI ORD EURO.20	4 667.00	103 304.65	0.02
GBP MORRISON(W)SUPRMTK ORD GBPO.10	25 148.00	60 382.55	0.01
GBP NATWEST GROUP PLC ORD GBP1	47 178.00	97 374.80	0.02
GBP NEXT ORD GBPO.10	1 291.00	112 926.97	0.02
GBP PEARSON ORD GBPO.25	8 268.00	71 417.11	0.02
GBP PERSIMMON ORD GBPO.10	3 066.00	108 717.07	0.02
GBP PHOENIX GP HLDGS ORD GBPO.10	651.00	6 229.84	0.00
GBP PRUDENTIAL ORD GBPO.05	25 689.00	401 092.89	0.09
GBP RIO TINTO ORD GBPO.10	11 072.00	714 546.10	0.15
GBP RSA INSURANCE GRP ORD GBP1.00	10 618.00	95 543.28	0.02
GBP SAINSBURY(J) ORD GBPO.28571428	20 114.00	56 687.09	0.01
GBP SCHROEDERS VTG SHS GBP1	1 178.00	50 624.86	0.01
GBP SMITH & NEPHEW ORD USDO.20	8 512.00	164 890.85	0.04
GBP STANDARD CHARTERED ORD USDO.50	26 311.00	158 842.03	0.03
GBP STD LIFE ABERDEEN ORD GBPO.1396825396	21 662.00	78 343.88	0.02
GBP TAYLOR WIMPEY ORD GBPO.01	37 721.00	77 528.33	0.02
GBP TESCO ORD GBPO.05	96 798.00	293 352.49	0.06
GBP UNILEVER PLC ORD GBPO.031111	11 559.00	705 389.54	0.15
EUR UNILEVER PLC ORD GBPO.031111	13 604.00	826 999.19	0.18
GBP VODAFONE GROUP ORD USDO.2095238(POST CONS)	263 802.00	435 587.18	0.09
<b>イギリス合計</b>		<b>11 264 075.30</b>	<b>2.40</b>
<b>アメリカ合衆国</b>			
CAD BAUSCH HEALTH COMP COM NPV	3 308.00	61 544.78	0.01
CAD BROOKFIELD RENEWA. CLASS A SUB VOTING SHARES	100.00	7 863.26	0.00
<b>アメリカ合衆国合計</b>		<b>69 408.04</b>	<b>0.01</b>
<b>記名株式合計</b>		<b>69 345 276.88</b>	<b>14.78</b>
<b>預託証券</b>			
<b>アイルランド</b>			
AUD JAMES HARDIE ID PLC CUFS EURO.5	4 270.00	124 123.49	0.02
<b>アイルランド合計</b>		<b>124 123.49</b>	<b>0.02</b>
<b>ルクセンブルグ</b>			
EUR SES S.A. FDR EACH REP 1 'A' NPV	4 038.00	36 835.53	0.01
<b>ルクセンブルグ合計</b>		<b>36 835.53</b>	<b>0.01</b>
<b>オランダ</b>			
EUR ABN AMRO BANK N.V. DR EACH REP SHS	3 458.00	35 780.38	0.01
<b>オランダ合計</b>		<b>35 780.38</b>	<b>0.01</b>
<b>預託証券合計</b>		<b>196 739.40</b>	<b>0.04</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>投資信託証券</b>			
アイルランド			
USD STAR COMPASS PLC/UBS DYNMC DIVERSIFIED LTD NOTE DUE 31.03.21	6 650 000.00	10 326 785.00	2.20
アイルランド合計		10 326 785.00	2.20
<b>投資信託証券合計</b>		<b>10 326 785.00</b>	<b>2.20</b>
<b>投資信託、クローズド・エンド型</b>			
カナダ			
CAD RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1 421.00	19 233.23	0.00
カナダ合計		19 233.23	0.00
イギリス			
GBP SEGRO PLC REIT	11 530.00	140 385.31	0.03
イギリス合計		140 385.31	0.03
<b>投資信託、クローズド・エンド型合計</b>		<b>159 618.54</b>	<b>0.03</b>
<b>新株引受権</b>			
フランス			
EUR ALSTOM SA RIGHTS 30.11.20	1 798.00	10 123.67	0.00
フランス合計		10 123.67	0.00
スペイン			
EUR BANCO SANTANDER SA RIGHTS 30.11.20	171 917.00	21 531.25	0.01
スペイン合計		21 531.25	0.01
イギリス			
GBP AVEVA GROUP PLC RIGHTS 09.12.20	542.11	8 105.94	0.00
イギリス合計		8 105.94	0.00
<b>新株引受権合計</b>		<b>39 760.86</b>	<b>0.01</b>
<b>ノート、固定利付債</b>			
米ドル			
USD 3M CO 2.25000% 16-19.09.26	350 000.00	377 175.89	0.08
USD ABU DHABI, GOVERNMENT OF-REG-S 3.12500% 17-11.10.27	1 000 000.00	1 120 937.50	0.24
USD ALBERTA, PROVINCE OF 3.30000% 18-15.03.28	900 000.00	1 040 130.00	0.22
USD ALPHABET INC 1.10000% 20-15.08.30	500 000.00	495 852.75	0.11
USD ALPHABET INC 1.99800% 16-15.08.26	525 000.00	562 495.39	0.12
USD AMERICAN EXPRESS CO 3.40000% 18-27.02.23	700 000.00	744 907.80	0.16
USD APPLE INC 1.65000% 20-11.05.30	950 000.00	982 586.33	0.21
USD APPLE INC 2.20000% 19-11.09.29	800 000.00	863 717.04	0.18
USD APPLE INC 2.40000% 13-03.05.23	500 000.00	524 897.70	0.11
USD APPLE INC 2.45000% 16-04.08.26	1 300 000.00	1 415 150.10	0.30
USD APPLE INC 2.85000% 16-23.02.23	475 000.00	499 821.97	0.11
USD APPLE INC 3.20000% 17-11.05.27	775 000.00	879 050.88	0.19
USD BANK OF NOVA SCOTIA 2.00000% 19-15.11.22	330 000.00	340 877.13	0.07
USD BAYER US FINANCE II LLC-REG-S 3.87500% 18-15.12.23	500 000.00	546 280.70	0.12
USD BERKSHIRE HATHAWAY FINANCE CORP 1.85000% 20-12.03.30	175 000.00	184 042.39	0.04
USD BERKSHIRE HATHAWAY INC 2.20000% 16-15.03.21	275 000.00	276 043.29	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・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	BERKSHIRE HATHAWAY INC 3.12500% 16-15.03.26	275 000.00	308 696.96	0.07
USD	BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 1.75000% 19-27.09.24	250 000.00	262 983.27	0.06
USD	CHEVRON CORP 2.23600% 20-11.05.30	821 000.00	882 629.60	0.19
USD	CHEVRON CORP 3.19100% 13-24.06.23	675 000.00	719 714.22	0.15
USD	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 3.90000% 18-16.03.28	450 000.00	533 434.50	0.11
USD	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 3.35000% 19-04.06.24	500 000.00	545 420.00	0.12
USD	CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 4.37500% 12-15.06.22	625 000.00	655 150.00	0.14
USD	DEXIA CREDIT LOCAL SA-REG-S 2.50000% 18-25.01.21	500 000.00	501 615.00	0.11
USD	EQUINOR ASA 2.37500% 20-22.05.30	300 000.00	320 374.92	0.07
USD	EQUINOR ASA 3.62500% 18-10.09.28	700 000.00	817 967.22	0.17
USD	EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.37500% 17-24.05.27	1 000 000.00	1 107 000.40	0.24
USD	EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.87500% 20-17.05.30	2 110 000.00	2 100 695.18	0.45
USD	EXPORT DEVELOPMENT CANADA 2.00000% 17-17.05.22	200 000.00	205 160.00	0.04
USD	EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 2.50000% 15-10.05.21	300 000.00	302 343.75	0.06
USD	EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 3.25000% 15-10.11.25	700 000.00	783 125.00	0.17
USD	EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 2.75000% 17-25.01.22	200 000.00	205 125.00	0.04
USD	EXXON MOBIL CORP 3.04300% 16-01.03.26	525 000.00	580 657.04	0.12
USD	EXXON MOBIL CORP 3.48200% 20-19.03.30	90 000.00	104 274.05	0.02
USD	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.37500% 17-07.07.27	400 000.00	441 960.00	0.09
USD	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.25000% 19-18.06.29	800 000.00	886 752.88	0.19
USD	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.00000% 19-23.07.26	450 000.00	483 943.05	0.10
USD	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 2.85000% 19-13.05.22	400 000.00	414 968.24	0.09
USD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 1.75000% 19-23.10.29	500 000.00	535 335.00	0.11
USD	JOHNSON & JOHNSON 1.30000% 20-01.09.30	500 000.00	501 992.25	0.11
USD	JOHNSON & JOHNSON 2.45000% 16-01.03.26	750 000.00	816 526.12	0.17
USD	JOHNSON & JOHNSON 2.90000% 17-15.01.28	250 000.00	281 684.95	0.06
USD	JOHNSON & JOHNSON 3.37500% 13-05.12.23	300 000.00	327 591.30	0.07
USD	KOREA DEVELOPMENT BANK 2.75000% 17-19.03.23	400 000.00	420 250.00	0.09
USD	KOREA EAST-WEST POWER CO LTD-REG-S 3.87500% 18-19.07.23	610 000.00	661 850.00	0.14
USD	KOREA HYDRO&NUCLEAR POWER CO LTD-REG-S 3.00000% 12-19.09.22	200 000.00	208 437.50	0.04
USD	KOREA HYDRO&NUCLEAR POWER CO LTD-REG-S 3.12500% 17-25.07.27	800 000.00	887 750.01	0.19
USD	KOREA SOUTH-EAST POWER CO LTD-REG-S 2.12500% 20-03.02.25	200 000.00	210 123.76	0.05
USD	KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.12500% 13-17.01.23	650 000.00	676 263.25	0.14
USD	KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.00000% 15-02.05.25	750 000.00	802 820.25	0.17
USD	KUWAIT INTERNATIONAL GOVT BOND-REG-S 3.50000% 17-20.03.27	1 200 000.00	1 366 500.00	0.29
USD	LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 2.00000% 15-13.01.25	775 000.00	824 767.79	0.18
USD	LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 0.87500% 20-03.09.30	300 000.00	296 962.49	0.06
USD	MICROSOFT CORP 2.65000% 15-03.11.22	500 000.00	521 147.85	0.11
USD	MICROSOFT CORP 2.87500% 17-06.02.24	1 425 000.00	1 529 429.27	0.33
USD	MICROSOFT CORP 3.30000% 17-06.02.27	1 500 000.00	1 713 109.50	0.37
USD	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD/NY 2.50000% 16-12.07.26	800 000.00	866 880.00	0.18
USD	NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 1.25000% 20-15.09.30	250 000.00	250 065.35	0.05
USD	NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 3.00000% 18-10.01.28	425 000.00	474 025.62	0.10
USD	NORDIC INVESTMENT BANK 2.25000% 14-30.09.21	200 000.00	203 341.68	0.04
USD	NOVARTIS CAPITAL CORP 2.40000% 12-21.09.22	850 000.00	880 658.74	0.19
USD	NOVARTIS CAPITAL CORP 3.10000% 17-17.05.27	850 000.00	957 786.71	0.20
USD	NOVARTIS CAPITAL CORP 2.20000% 20-14.08.30	600 000.00	648 408.90	0.14
USD	QATAR, STATE OF-REG-S 2.37500% 16-02.06.21	950 000.00	955 937.50	0.20
USD	QATAR, STATE OF-REG-S 3.37500% 19-14.03.24	300 000.00	323 906.25	0.07
USD	QATAR, STATE OF-REG-S 4.00000% 19-14.03.29	575 000.00	679 218.75	0.15
USD	QUEBEC, PROVINCE OF 2.50000% 16-20.04.26	1 150 000.00	1 255 177.97	0.27
USD	ROCHE HOLDINGS INC-REG-S 3.62500% 18-17.09.28	800 000.00	947 454.80	0.20
USD	SANOFI 4.00000% 11-29.03.21	350 000.00	354 370.42	0.08
USD	SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 2.25000% 12-06.01.23	400 000.00	415 557.16	0.09
USD	SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 1.87500% 16-10.05.21	200 000.00	201 413.54	0.04
USD	SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 2.87500% 16-10.05.26	1 025 000.00	1 132 719.61	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 SINOPEC GROUP OVERSEAS DEV 2013-REG-S 4.37500% 13-17.10.23	300 000.00	327 414.00	0.07
USD STATE STREET CORP 2.40000% 20-24.01.30	208 000.00	228 355.63	0.05
USD TEMASEK FINANCIAL I LTD-REG-S 2.37500% 12-23.01.23	300 000.00	312 402.00	0.07
USD TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.70000% 13-15.01.24	350 000.00	383 877.10	0.08
USD TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.45500% 19-19.02.29	400 000.00	461 910.56	0.10
USD VISA INC 2.05000% 20-15.04.30	350 000.00	373 242.87	0.08
USD VISA INC 3.15000% 15-14.12.25	400 000.00	446 519.88	0.10
USD WALMART INC 2.55000% 13-11.04.23	750 000.00	785 512.57	0.17
USD WALMART INC 3.70000% 18-26.06.28	1 250 000.00	1 475 710.88	0.31
USD WESTPAC BANKING CORP 2.85000% 16-13.05.26	991 000.00	1 091 903.62	0.23
USD WESTPAC BANKING CORP 3.35000% 17-08.03.27	300 000.00	340 032.00	0.07
米ドル合計		53 374 302.54	11.37
ノート、固定利付債合計		53 374 302.54	11.37

## 中期債券、固定利付債

## 米ドル

USD ABU DHABI, EMIRATE OF-REG-S 3.12500% 20-16.04.30	900 000.00	1 015 875.00	0.22
USD AFRICAN DEVELOPMENT BANK 2.37500% 14-23.09.21	475 000.00	483 326.04	0.10
USD ASB FINANCE LTD-REG-S 2.12500% 16-01.09.21	400 000.00	405 276.00	0.09
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.62500% 17-12.01.27	400 000.00	446 780.00	0.10
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.00000% 17-16.02.22	550 000.00	562 028.50	0.12
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.50000% 17-02.11.27	1 000 000.00	1 118 132.50	0.24
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.75000% 19-19.09.29	1 000 000.00	1 071 033.50	0.23
USD BANK OF MONTREAL 1.90000% 16-27.08.21	300 000.00	303 670.11	0.06
USD CAISSE D'AMOR DE LA DETTE SOCIALE-REG-S 3.37500% 14-20.03.24	400 000.00	439 489.60	0.09
USD CLIFFORD CAPITAL PTE LTD-REG-S 1.73300% 19-10.09.24	650 000.00	669 844.50	0.14
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 3.15000% 17-19.09.27	150 000.00	168 697.50	0.04
USD CPPIB CAPITAL INC-REG-S 2.75000% 17-02.11.27	1 000 000.00	1 129 597.20	0.24
USD IDB TRUST SERVICES LTD-REG-S 2.26100% 17-26.09.22	800 000.00	823 704.00	0.18
USD INTERNATIONAL FINANCE CORP 2.12500% 16-07.04.26	350 000.00	379 781.50	0.08
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 17-22.11.27	1 305 000.00	1 459 512.00	0.31
USD JAPAN TOBACCO INC-REG-S 2.80000% 16-13.04.26	400 000.00	432 904.00	0.09
USD KOMMUNEKREDIT-REG-S 1.62500% 16-01.06.21	225 000.00	226 560.60	0.05
USD KOREA DEVELOPMENT BANK 1.75000% 20-18.02.25	225 000.00	233 970.00	0.05
USD MACQUARIE GROUP LTD-REG-S 6.25000% 11-14.01.21	250 000.00	251 525.00	0.05
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 3.00000% 17-19.04.24	600 000.00	637 312.50	0.14
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 2.87500% 19-07.11.29	550 000.00	589 875.00	0.13
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 2.87500% 20-21.05.30	600 000.00	643 312.50	0.14
USD NEDERLANDSE WATERSCHAPS BK NV-REG-S 3.00000% 18-21.12.21	200 000.00	205 717.20	0.04
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 1.87500% 16-09.03.21	250 000.00	250 835.50	0.05
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 2.37500% 17-18.01.22	325 000.00	332 254.65	0.07
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 3.12500% 18-22.03.23	415 000.00	440 296.74	0.09
USD NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CORP-REG-S 2.60000% 17-28.09.22	100 000.00	101 970.11	0.02
USD NORDRHEIN-WESTFALEN, STATE OF-REG-S 2.25000% 15-16.04.25	200 000.00	214 764.96	0.05
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 2.50000% 20-03.02.27	600 000.00	631 500.00	0.13
USD SP POWERASSETS LTD-REG-S 3.25000% 15-24.11.25	200 000.00	222 168.00	0.05
USD SUMITOMO MITSUI BANKING CORP-REG-S 2.44000% 19-18.06.24	418 000.00	444 113.21	0.09
USD SVENSK EXPORTKREDIT AB 1.75000% 16-10.03.21	200 000.00	200 838.36	0.04
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 2.60000% 17-11.01.22	350 000.00	358 781.50	0.08
USD TOYOTA MOTOR FINANCE NL BV-REG-S 2.76400% 19-26.04.21	450 000.00	454 204.17	0.10
米ドル合計		17 349 651.95	3.70
中期債券、固定利付債合計		17 349 651.95	3.70

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>債券、固定利付債</b>			
<b>米ドル</b>			
USD BNG BANK NV-REG-S 2.62500% 14-28.04.21	200 000.00	201 885.30	0.04
USD BNG BANK NV-REG-S 2.37500% 16-16.03.26	450 000.00	491 346.00	0.10
USD CAISSE D' AMORTIS DE LA DETTE SOC-REG-S 1.87500% 15-12.02.22	225 000.00	229 342.05	0.05
USD CANADIAN IMPERIAL BANK OF COM/CAN-REG-S 2.35000% 17-27.07.22	350 000.00	361 215.85	0.08
USD CENTRAL JAPAN RAILWAY CO-REG-S 3.40000% 18-06.09.23	400 000.00	426 966.60	0.09
USD DBS BANK LTD-REG-S 3.30000% 18-27.11.21	480 000.00	493 881.84	0.11
USD DNB BOLIGKREDITT AS-REG-S 2.50000% 17-28.03.22	500 000.00	514 150.00	0.11
USD FAB SUKUK CO LTD-REG-S 3.87500% 19-22.01.24	300 000.00	323 531.25	0.07
USD FEDERAL HOME LOAN BANK SYSTEM 2.00000% 12-09.09.22	600 000.00	619 236.24	0.13
USD FMS WERTMANAGEMENT 2.00000% 17-01.08.22	375 000.00	385 924.65	0.08
USD ING BANK NV-REG-S 2.62500% 12-05.12.22	250 000.00	261 213.28	0.06
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 14-25.11.24	675 000.00	732 051.00	0.16
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 15-29.07.25	750 000.00	820 222.50	0.17
USD KOREA GAS CORP-REG-S 2.87500% 19-16.07.29	300 000.00	331 406.25	0.07
USD KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 3.25000% 14-10.07.24	450 000.00	487 546.88	0.10
USD KOREA, REPUBLIC OF 3.87500% 13-11.09.23	600 000.00	654 937.50	0.14
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.50000% 14-20.11.24	625 000.00	678 310.13	0.14
USD NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S 1.70000% 20-13.02.23	583 000.00	599 104.67	0.13
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 3.40000% 14-06.05.24	200 000.00	219 456.60	0.05
USD OESTERREICHISCHE KONTROLLBANK AG 2.37500% 14-01.10.21	175 000.00	178 098.97	0.04
USD ONTARIO, PROVINCE OF 1.12500% 20-07.10.30	700 000.00	693 831.95	0.15
USD ONTARIO, PROVINCE OF 3.20000% 14-16.05.24	750 000.00	821 113.58	0.18
USD ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 3.35000% 18-22.10.21	500 000.00	513 455.00	0.11
USD SWEDBANK AB-REG-S 2.80000% 17-14.03.22	200 000.00	205 935.14	0.04
<b>米ドル合計</b>		<b>11 244 163.23</b>	<b>2.40</b>
<b>債券、固定利付債合計</b>		<b>11 244 163.23</b>	<b>2.40</b>
<b>財務省証券 (T-note)、固定利付債</b>			
<b>米ドル</b>			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.62500% 19-15.02.29	902 000.00	1 039 519.73	0.22
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 15-31.01.22	5 000.00	5 080.28	0.00
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 17-15.02.27	905 000.00	1 001 050.18	0.21
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 13-15.05.23	10 000.00	10 387.11	0.00
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.62500% 20-15.05.30	2 081 000.00	2 045 557.97	0.44
<b>米ドル合計</b>		<b>4 101 595.27</b>	<b>0.87</b>
<b>財務省証券 (T-note)、固定利付債合計</b>		<b>4 101 595.27</b>	<b>0.87</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>225 604 593.55</b>	<b>48.07</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>財務省証券 (T-bill)、ゼロ・クーポン</b>			
<b>米ドル</b>			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 23.04.20-22.04.21	2 000 000.00	1 999 280.14	0.43
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 13.08.20-11.02.21	2 500 000.00	2 499 587.50	0.53
<b>米ドル合計</b>		<b>4 498 867.64</b>	<b>0.96</b>
<b>財務省証券 (T-bill)、ゼロ・クーポン合計</b>		<b>4 498 867.64</b>	<b>0.96</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>ノート、固定利付債</b>			
米ドル			
USD ALTRIA GROUP INC 2.85000% 12-09.08.22	500 000.00	520 286.20	0.11
USD FANNIE MAE 2.12500% 16-24.04.26	700 000.00	760 527.60	0.16
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD NEW YORK 2.87500% 18-12.04.23	250 000.00	263 819.30	0.06
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-144A 3.50000% 17-10.01.27	500 000.00	568 480.00	0.12
USD PROCTER & GAMBLE CO 2.30000% 12-06.02.22	650 000.00	665 969.20	0.14
米ドル合計		2 779 082.30	0.59
<b>ノート、固定利付債合計</b>		2 779 082.30	0.59
<b>中期債券、固定利付債</b>			
米ドル			
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 3.85000% 14-08.07.24	350 000.00	385 348.21	0.08
USD GUARDIAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 2.00000% 16-26.04.21	450 000.00	453 110.72	0.10
米ドル合計		838 458.93	0.18
<b>中期債券、固定利付債合計</b>		838 458.93	0.18
<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	500 000.00	438 981.17	0.09
米ドル		438 981.17	0.09
<b>中期債券、ゼロ・クーポン債合計</b>		438 981.17	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	250 000.00	255 749.70	0.05
USD HSBC BANK CANADA-REG-S 1.65000% 19-10.09.22	300 000.00	306 715.50	0.07
米ドル合計		562 465.20	0.12
<b>債券、固定利付債合計</b>		562 465.20	0.12
<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>		9 117 855.24	1.94
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>無記名株式</b>			
ニュージーランド			
AUD XERO LIMITED NPV	992.00	96 851.56	0.02
ニュージーランド合計		96 851.56	0.02
<b>無記名株式合計</b>		96 851.56	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 (%)
<b>記名株式</b>			
アラブ首長国連邦 GBP NMC HEALTH PLC ORD GBPO.1	997.00	0.01	0.00
アラブ首長国連邦合計		0.01	0.00
記名株式合計		0.01	0.00
<b>新株引受権</b>			
ドイツ EUR KION GROUP AG RIGHTS 03.12.20	569.00	0.00	0.00
ドイツ合計		0.00	0.00
新株引受権合計		0.00	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	350 000.00	380 576.14	0.08
USD US BANK NA/CINCINNATI OH 2.65000% 19-23.05.22	400 000.00	413 113.60	0.09
米ドル合計		793 689.74	0.17
ノート、固定利付債合計		793 689.74	0.17
<b>債券、固定利付債合計</b>			
米ドル USD HSBC BANK CANADA-REG-S 3.30000% 18-28.11.21	300 000.00	308 802.00	0.07
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 2.75000% 17-22.06.24	250 000.00	268 520.33	0.06
米ドル合計		577 322.33	0.13
債券、固定利付債合計		577 322.33	0.13
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		1 467 863.64	0.32
<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 MAN FUNDS VI PLC-MAN AHL TARGETRISK-INU-USD-CAP	62 028.38	8 382 515.54	1.79
USD UBS (IRL) ETF PLC-MSCI USA UCITS-ACC-A-USD-ETF	2 518 969.00	51 009 122.25	10.87
USD UBS(IRL)FUND SOLUTION PLC-MSCI USA SF UCITS SHS-A-ETF-ACC	890 854.00	89 566 461.16	19.08
アイルランド合計		148 958 098.95	31.74
ルクセンブルグ EUR ALMA PLATINUM IV UBS MULTI-STRATEGY ALTERNATIVES-IOC-E- CAP	742.37	8 936 827.40	1.91
USD AQR UCITS FUNDS - GLOBAL RISK PARITY UCITS FUND-A2-CAP	47 381.71	5 924 609.02	1.26
USD INVESCO FUNDS SICAV BAL RISK ALLOCATION-P11-USD HDG-CAP	350 966.66	4 436 218.63	0.95
USD UBS (LUX) BOND FUND-EURO HIGH YIELD (EUR)(USD HEDGED) F- ACC	63 210.00	7 618 069.20	1.62
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD (USD) F-ACC	33 131.00	11 282 762.05	2.40

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 UBS (LUX) BOND SICAV - EMERG ECON CORPORATES (USD) F-ACC	91 872.00	11 294 743.68	2.41
USD UBS (LUX) EMERGING ECONOMIES FUND - GLOBAL BONDS (USD) F-ACC	7 957.00	16 771 128.04	3.57
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD U-X-ACC	1.00	11 216.33	0.00
<b>ルクセンブルグ合計</b>		<b>66 275 574.35</b>	<b>14.12</b>
<b>投資信託、オープン・エンド型合計</b>		<b>215 233 673.30</b>	<b>45.86</b>
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		215 233 673.30	45.86
<b>公認の証券取引所に上場されている派生商品</b>			
<b>ワラント債</b>			
スイス			
CHF CIE FINANCIERE RICHEMO 67.00000 WARRANT 27.11.23	9 924.00	1 973.18	0.00
スイス合計		1 973.18	0.00
<b>ワラント債合計</b>		<b>1 973.18</b>	<b>0.00</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>1 973.18</b>	<b>0.00</b>
<b>投資有価証券合計</b>		<b>451 425 958.91</b>	<b>96.19</b>
<b>派生商品</b>			
<b>公認の証券取引所に上場されている派生商品</b>			
<b>債券に係る金融先物</b>			
USD US LONG BOND FUTURE 22.03.21	-9.00	-3 375.00	0.00
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.21	-142.00	-11 093.61	0.00
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.21	-265.00	-39 335.81	-0.01
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 22.03.21	-98.00	-61 250.00	-0.01
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 22.03.21	-87.00	-23 789.02	-0.01
<b>債券に係る金融先物合計</b>		<b>-138 843.44</b>	<b>-0.03</b>
<b>指数に係る金融先物</b>			
EUR EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 18.12.20	152.00	79 296.10	0.02
CHF SWISS MARKET INDEX FUTURE 18.12.20	15.00	7 875.84	0.00
GBP FTSE 100 INDEX FUTURE 18.12.20	30.00	-13 791.07	0.00
SGD MSCI SINGAPORE INDEX FUTURE 30.12.20	11.00	-6 363.36	0.00
USD S&P500 EMINI FUTURE 18.12.20	309.00	745 740.00	0.16
HKD HANG SENG INDEX FUTURE 30.12.20	5.00	-5 611.09	0.00
AUD SPI 200 INDEX FUTURES 17.12.20	10.00	-7 497.45	0.00
CAD S&P/TSX 60 INDEX FUTURE 17.12.20	12.00	7 608.61	0.00
USD MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 18.12.20	508.00	1 270 595.00	0.27
JPY TOPIX INDX FUTURE 10.12.20	32.00	-27 667.23	-0.01
<b>指数に係る金融先物合計</b>		<b>2 050 185.35</b>	<b>0.44</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>1 911 341.91</b>	<b>0.41</b>
<b>派生商品合計</b>		<b>1 911 341.91</b>	<b>0.41</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 (%)
先渡為替契約			
購入通貨/購入額/売却通貨/売却額/満期日(日-月-年)			
USD	2 923 274.94	GBP 2 256 000.00	8.1.2021 -90 500.02 -0.02
USD	8 026 262.75	CAD 10 574 000.00	8.1.2021 -135 850.47 -0.03
USD	5 155 402.79	AUD 7 315 000.00	8.1.2021 -236 860.35 -0.05
USD	77 362.06	SGD 105 000.00	8.1.2021 -1 015.68 0.00
USD	3 197 169.37	JPY 337 130 000.00	8.1.2021 -38 815.71 -0.01
HKD	250 000.00	USD 32 246.48	8.1.2021 3.37 0.00
USD	32 698 885.25	EUR 27 712 000.00	8.1.2021 -492 806.19 -0.10
USD	8 629 600.09	CHF 7 823 000.00	8.1.2021 -25 250.80 0.00
JPY	50 000 000.00	USD 478 849.69	8.1.2021 1 081.65 0.00
CHF	100 000.00	USD 110 460.74	8.1.2021 172.66 0.00
EUR	250 000.00	USD 296 154.50	8.1.2021 3 279.78 0.00
GBP	150 000.00	USD 194 472.45	8.1.2021 5 911.52 0.00
EUR	750 000.00	USD 881 799.75	8.1.2021 16 503.10 0.00
CAD	250 000.00	USD 188 097.49	8.1.2021 4 878.52 0.00
EUR	990 000.00	USD 1 164 719.16	8.1.2021 21 040.60 0.00
CHF	250 000.00	USD 275 040.51	8.1.2021 1 542.99 0.00
JPY	32 500 000.00	USD 311 980.43	8.1.2021 -25.06 0.00
USD	291 163.00	EUR 250 000.00	8.1.2021 -8 271.28 0.00
USD	770 075.87	EUR 650 000.00	8.1.2021 -8 453.27 0.00
USD	356 638.50	EUR 300 000.00	8.1.2021 -2 682.64 0.00
USD	1 727 041.01	EUR 1 460 000.00	8.1.2021 -21 655.20 0.00
USD	24 526 528.13	EUR 20 625 000.00	4.2.2021 -190 902.03 -0.04
USD	7 854 750.59	CAD 10 270 000.00	4.2.2021 -73 227.02 -0.02
GBP	1 176 000.00	USD 1 556 276.06	4.2.2021 14 930.08 0.00
USD	5 573 225.39	AUD 7 605 000.00	4.2.2021 -33 735.58 -0.01
USD	11 809.23	JPY 1 230 000.00	4.2.2021 -0.83 0.00
HKD	250 000.00	USD 32 250.61	4.2.2021 0.29 0.00
USD	78 142.04	SGD 105 000.00	4.2.2021 -238.86 0.00
USD	6 905 967.85	CHF 6 272 000.00	4.2.2021 -38 110.09 -0.01
GBP	500 000.00	USD 663 291.00	8.1.2021 4 655.58 0.00
GBP	500 000.00	USD 663 381.00	4.2.2021 4 648.82 0.00
EUR	750 000.00	USD 892 132.50	8.1.2021 6 170.35 0.00
EUR	750 000.00	USD 892 653.75	4.2.2021 6 161.89 0.00
CHF	400 000.00	USD 440 074.99	8.1.2021 2 458.61 0.00
CHF	400 000.00	USD 440 419.50	4.2.2021 2 442.61 0.00
JPY	65 000 000.00	USD 623 092.20	4.2.2021 1 016.83 0.00
JPY	65 000 000.00	USD 622 883.33	8.1.2021 1 027.42 0.00
EUR	500 000.00	USD 592 025.00	8.1.2021 6 843.57 0.00
AUD	500 000.00	USD 363 923.60	8.1.2021 4 652.14 0.00
EUR	500 000.00	USD 592 380.00	4.2.2021 6 830.43 0.00
AUD	500 000.00	USD 363 987.65	4.2.2021 4 648.84 0.00
CAD	600 000.00	USD 458 263.01	8.1.2021 4 879.41 0.00
CHF	30 000.00	USD 32 896.49	8.1.2021 293.53 0.00
USD	998 228.18	GBP 750 000.00	4.2.2021 -3 816.55 0.00
CAD	600 000.00	USD 458 296.40	4.2.2021 4 876.59 0.00
USD	998 105.10	GBP 750 000.00	8.1.2021 -3 814.77 0.00
CHF	20 000.00	USD 21 947.87	4.2.2021 195.24 0.00
GBP	5 786 300.00	USD 7 741 988.39	21.1.2021 -11 646.03 0.00
CHF	73 775 100.00	USD 81 080 002.86	21.1.2021 569 060.58 0.12
SGD	13 715 000.00	USD 10 218 831.26	21.1.2021 18 993.81 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)					
購入通貨/購入額/売却通貨/売却額/満期日(日-月-年)					
EUR	99 854 500.00	USD 118 870 990.69	21.1.2021	761 314.25	0.16
USD	962 731.79	EUR 809 600.00	21.1.2021	-7 222.63	0.00
USD	1 041 534.69	GBP 779 600.00	21.1.2021	9.90	0.00
EUR	396 600.00	USD 473 017.28	21.1.2021	2 135.79	0.00
EUR	298 000.00	USD 356 800.17	21.1.2021	223.57	0.00
<b>先渡為替契約合計</b>				<b>57 983.26</b>	<b>-0.01</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				17 822 302.27	3.80
当座借越およびその他の短期負債				-139.10	0.00
その他の資産および負債				-1 889 002.54	-0.39
<b>純資産総額</b>				<b>469 328 444.71</b>	<b>100.00</b>

## 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)

## 2020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 (%)
<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</b>			
<b>無記名株式</b>			
<b>オーストリア</b>			
EUR ANDRITZ AG NPV(BR)	1 946.00	82 264.64	0.00
EUR ERSTE GROUP BK AG NPV	9 310.00	268 392.59	0.01
EUR OMV AG NPV(VAR)	4 302.00	146 147.89	0.01
EUR RAIFFEISEN BK INTL NPV (REGD)	5 630.00	108 157.77	0.01
EUR VERBUND AG CLASS ' A ' NPV	2 236.00	157 406.28	0.01
EUR VOESTALPINE AG NPV	3 896.00	125 085.01	0.01
<b>オーストリア合計</b>		<b>887 454.18</b>	<b>0.05</b>
<b>ベルギー</b>			
EUR ANHEUSER-BUSCH IN NPV	23 129.00	1 546 026.92	0.08
EUR COLRUYT SA NPV	1 750.00	104 709.37	0.01
EUR ELIA SYS OPERATOR NPV	1 114.00	126 327.33	0.01
EUR GALAPAGOS NV NPV	1 478.00	182 367.51	0.01
EUR GPE BRUXELLES LAM NPV	3 412.00	333 371.56	0.02
EUR PROXIMUS SA NPV	4 184.00	87 635.81	0.00
EUR SOFINA NPV	401.00	127 593.87	0.01
EUR SOLVAY SA NPV	2 432.00	278 813.74	0.01
EUR UMICORE NPV	5 942.00	267 040.81	0.01
<b>ベルギー合計</b>		<b>3 053 886.92</b>	<b>0.16</b>
<b>カナダ</b>			
CAD AIR CANADA VAR VTG SHS NPV	6 550.00	124 843.74	0.01
CAD ALGONQUIN PWR&UTIL COM NPV	24 900.00	391 013.97	0.02
CAD ALTAGAS LTD COM NPV	11 079.00	159 358.41	0.01
CAD ATCO LTD CL 1 NON VTG	3 589.00	108 121.43	0.01
CAD B2GOLD CORP COM NPV	44 500.00	248 614.86	0.01
CAD CAE INC COM NPV	11 160.00	270 581.99	0.01
CAD CAMECO CORP COM	18 907.00	189 522.29	0.01
CAD CANADIAN UTILS LTD CL A	6 211.00	155 478.69	0.01
CAD CANOPY GROWTH CORP COM NPV	6 900.00	198 709.78	0.01
CAD CI FINANCIAL CORP COM NPV	7 930.00	104 150.47	0.00
CAD EMERA INC COM	9 815.00	407 853.81	0.02
CAD EMPIRE LTD CL A	6 818.00	186 983.35	0.01
CAD HYDRO ONE INC COM NPV	12 812.00	299 562.93	0.02
CAD IGM FINANCIAL INC COM	3 875.00	102 713.37	0.00
CAD KEYERA CORPORATION COM NPV	8 642.00	149 446.11	0.01
CAD KINROSS GOLD CORP COM NPV	50 571.00	360 970.56	0.02
CAD KIRKLAND LAKE GOLD COM NPV	10 693.00	439 057.43	0.02
CAD LUNDIN MINING CORP COM	26 625.00	213 262.98	0.01
CAD NORTHLAND POWER IN COM NPV	600.00	20 608.07	0.00
CAD ONEX CORP SUB VTG	3 231.00	172 956.61	0.01
CAD PAN AMER SILVER COM NPV	8 126.00	239 660.25	0.01
CAD QUEBECOR INC CL B	7 117.00	177 609.21	0.01
CAD RITCHIE BROS AUCTIONEERS COM	4 623.00	333 231.29	0.02
CAD SSR MINING INC COM NPV	7 700.00	142 841.27	0.01
CAD TELUS CORPORATION COM NPV	70.00	1 353.11	0.00
CAD TELUS CORPORATION NPV	17 904.00	346 709.53	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・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 (%)
CAD TMX GROUP LTD COM NPV	2 288.00	225 621.98	0.01
CAD TOROMONT INDS LTD COM	300.00	20 566.40	0.00
CAD WSP GLOBAL INC COM NPV	4 539.00	337 824.33	0.02
CAD YAMANA GOLD INC COM	39 617.00	207 271.60	0.01
<b>カナダ合計</b>		<b>6 336 499.82</b>	<b>0.33</b>
<b>フィンランド</b>			
EUR KESKO OYJ EUR2 SER 'B'	786.00	20 684.69	0.00
EUR KONE CORPORATION NPV ORD 'B'	10 228.00	860 346.47	0.04
EUR WARTSILA OYJ ABP SER 'B' EUR3.50	12 663.00	119 392.45	0.01
<b>フィンランド合計</b>		<b>1 000 423.61</b>	<b>0.05</b>
<b>フランス</b>			
EUR ACCOR EUR3	5 307.00	182 511.71	0.01
EUR ADP EUR3	743.00	94 121.44	0.00
EUR AIR LIQUIDE(L') EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)	14 481.00	2 384 397.00	0.12
EUR AIRBUS EUR1	17 897.00	1 878 158.18	0.10
EUR ALSTOM EUR7.00	5 736.00	306 704.72	0.02
EUR AMUNDI EUR2.5 (AIW)	1 943.00	155 257.67	0.01
EUR ARKEMA EUR10	1 982.00	231 681.26	0.01
EUR ATOS SE EUR1	2 848.00	261 913.06	0.01
EUR AXA EUR2.29	58 624.00	1 382 324.28	0.07
EUR BIOMERIEUX NPV (POST SPLIT)	1 328.00	191 897.27	0.01
EUR BNP PARIBAS EUR2	34 117.00	1 753 434.11	0.09
EUR BOLLORE EURO.16	33 832.00	131 688.86	0.01
EUR BOUYGUES EUR1	6 991.00	279 144.73	0.01
EUR BUREAU VERITAS EURO.12	9 051.00	234 292.09	0.01
EUR CAPGEMINI EUR8	4 909.00	682 930.55	0.03
EUR CARREFOUR EUR2.50	19 388.00	318 425.14	0.02
EUR CIE DE ST-GOBAIN EUR4	15 737.00	749 595.55	0.04
EUR CNP ASSURANCES EUR1	5 515.00	88 070.52	0.00
EUR COVIVIO EUR3	1 670.00	136 839.30	0.01
EUR CREDIT AGRICOLE SA EUR3	36 228.00	419 231.82	0.02
EUR DANONE EURO.25	18 859.00	1 215 035.05	0.06
EUR DASSAULT AVIATION EUR8	87.00	90 020.03	0.00
EUR DASSAULT SYSTEMES EURO.50	4 002.00	742 254.18	0.04
EUR EDENRED EUR2	7 489.00	429 373.32	0.02
EUR EDF EURO.5	18 609.00	283 037.00	0.01
EUR EIFFAGE EUR4	2 566.00	252 124.56	0.01
EUR ENGIE EUR1	55 335.00	818 791.66	0.04
EUR ESSILORLUXOTTICA EURO.18	8 698.00	1 262 591.85	0.06
EUR EURAZEO NPV	1 095.00	67 718.68	0.00
EUR FAURECIA EUR7	2 668.00	133 083.95	0.01
EUR GETLINK SE EURO.40	13 527.00	225 724.91	0.01
EUR HERMES INTL NPV	962.00	940 618.47	0.05
EUR ICADE NPV	1 043.00	77 291.09	0.00
EUR ILIAD NPV	497.00	101 185.84	0.01
EUR INGENICO GROUP EUR1	1 020.00	154 711.72	0.01
EUR IPSEN EUR1	1 065.00	102 999.10	0.01
EUR JC DECAUX SA NPV	1 208.00	27 223.98	0.00
EUR KERING EUR4	2 305.00	1 668 130.81	0.09
EUR KLEPIERRE EUR1.40	5 665.00	125 364.75	0.01
EUR L'OREAL EURO.20	7 679.00	2 818 148.15	0.14
EUR LEGRAND SA EUR4	8 128.00	690 118.21	0.04
EUR LVMH MOET HENNESSY EURO.30	8 472.00	4 893 808.27	0.25

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・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 NATIXIS EUR1.6	31 695.00	97 816.98	0.01
EUR ORANGE EUR4	61 151.00	774 646.07	0.04
EUR ORPEA EUR2.5	1 354.00	169 739.82	0.01
EUR PERNOD RICARD EUR1.55	6 457.00	1 235 818.14	0.06
EUR PEUGEOT SA EUR1	17 741.00	419 448.57	0.02
EUR PUBLICIS GROUPE SA EURO.40	6 528.00	297 436.95	0.02
EUR REMY COINTREAU EUR1.60	692.00	123 337.79	0.01
EUR RENAULT SA EUR3.81	5 735.00	228 822.21	0.01
EUR SAFRAN EURO.20	9 734.00	1 424 038.06	0.07
EUR SANOFI EUR2	34 517.00	3 497 611.13	0.18
EUR SARTORIUS STEDIM B EURO.20 (POST SUBD)	862.00	312 430.69	0.02
EUR SCHNEIDER ELECTRIC EUR8	16 747.00	2 336 821.62	0.12
EUR SCOR SE EUR7.876972 (POST CONS)	4 750.00	162 731.05	0.01
EUR SEB SA EUR1	677.00	120 826.25	0.01
EUR SOC GENERALE EUR1.25	25 686.00	512 687.25	0.03
EUR SODEXO EUR4	2 756.00	228 661.00	0.01
EUR SUEZ EUR4	10 398.00	200 688.54	0.01
EUR TELEPERFORMANCE EUR2.50	1 792.00	598 490.44	0.03
EUR THALES EUR3	3 207.00	295 618.60	0.02
EUR TOTAL SE EUR2.5	75 321.00	3 227 795.97	0.17
EUR UBISOFT ENTERTAIN EURO.31	2 654.00	253 278.75	0.01
EUR UNIBAIL-RODAMCO-WE NPV(1 ORD UNIBAIL-R & 1CLS)	4 241.00	301 848.51	0.02
EUR VALEO EUR1 (POST SUBD)	7 494.00	291 519.78	0.00
EUR VEOLIA ENVIRONNEME EUR5	17 116.00	394 332.31	0.02
EUR VINCI EUR2.50	15 734.00	1 609 196.42	0.08
EUR VIVENDI SA EUR5.50	25 349.00	763 519.89	0.04
EUR WENDEL EUR4	1 038.00	117 646.87	0.01
EUR WORLDLINE EURO.68	6 578.20	609 835.32	0.03
フランス合計		49 588 619.82	2.54
ドイツ			
EUR BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG EUR1	9 939.00	868 374.88	0.04
EUR BEIERSDORF AG NPV	3 089.00	346 375.10	0.02
EUR CARL ZEISS MEDITEC NPV	1 087.00	145 370.12	0.01
EUR COMMERZBANK AG NPV	30 225.00	188 368.31	0.01
EUR CONTINENTAL AG ORD NPV	3 524.00	481 399.68	0.02
EUR COVESTRO AG NPV	5 589.00	312 550.01	0.02
EUR DEUTSCHE WOHNEN AG NPV (BR)	10 329.00	519 427.31	0.03
EUR FRAPORT AG NPV	1 249.00	71 087.08	0.00
EUR FRESENIUS MED CARE NPV	6 473.00	545 881.68	0.03
EUR FRESENIUS SE & CO. KGAA NPV	12 789.00	573 682.57	0.03
EUR GEA GROUP AG NPV	4 933.00	169 413.54	0.01
EUR HEIDELBERGCEMENT NPV	4 548.00	323 916.51	0.02
EUR HENKEL AG & CO KGAA	3 260.00	315 478.61	0.02
EUR HOCHTIEF AG NPV	956.00	92 514.59	0.00
EUR KION GROUP AG NPV	1 810.00	139 520.46	0.01
EUR KNORR BREMSE AG NPV	2 141.00	274 750.97	0.01
EUR LANXESS AG NPV	2 572.00	180 474.90	0.01
EUR MERCK KGAA NPV	3 933.00	629 718.01	0.03
EUR METRO AG (NEW) NPV	5 047.00	46 245.12	0.00
EUR NEMETSCHEK SE ORD NPV	1 557.00	123 482.65	0.01
EUR PUMA SE NPV	2 816.00	280 798.09	0.01
EUR RATIONAL AG NPV	24.00	21 388.06	0.00
EUR RWE AG (NEU) NPV	19 472.00	809 876.97	0.04
EUR SAP AG ORD NPV	31 812.00	3 880 697.40	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 (%)
EUR SYMRISE AG NPV (BR)	3 940.00	494 867.94	0.03
EUR TEAMVIEWER AG NPV	4 991.00	238 391.46	0.01
EUR THYSSENKRUPP AG NPV	14 804.00	99 203.27	0.01
EUR VOLKSWAGEN AG ORD NPV	990.00	184 149.01	0.01
EUR ZALANDO SE NPV	4 631.00	469 758.27	0.02
ドイツ合計		12 827 162.57	0.66
アイルランド			
GBP DCC ORD EURO.25	2 432.00	184 485.54	0.01
EUR FLUTTER ENTERTAINM ORD EURO.09	2 553.00	474 881.23	0.02
GBP FLUTTER ENTERTAINM ORD EURO.09	2 474.00	452 664.32	0.02
EUR KERRY GROUP 'A' ORD EURO.125(DUBLIN LIST)	4 909.00	689 389.92	0.04
アイルランド合計		1 801 421.01	0.09
イタリア			
EUR AMPLIFON EURO.02	478.00	19 194.78	0.00
EUR ASSIC GENERALI SPA EUR1	34 037.00	583 039.65	0.03
EUR DIASORIN SPA EUR1	765.00	161 605.42	0.01
EUR FINECOBANK SPA EURO.33	17 234.00	270 782.11	0.01
EUR INFRASTRUTTURE WIR NPV	8 197.00	105 798.66	0.01
EUR LEONARDO SPA EUR4.40	14 358.00	104 149.44	0.01
EUR POSTE ITALIANE SPA NPV	16 833.00	172 038.86	0.01
EUR TELECOM ITALIA SPA DI RISP EURO.55	186 227.00	94 786.40	0.00
EUR TELECOM ITALIA SPA EURO.55	207 178.00	97 271.84	0.00
イタリア合計		1 608 667.16	0.08
日本			
JPY アコム	4 700.00	22 581.64	0.00
JPY アドバンテスト	3 000.00	208 870.78	0.01
JPY エア・ウォーター	3 000.00	49 513.31	0.00
JPY アイシン精機	2 600.00	77 170.94	0.00
JPY アマダ	4 700.00	45 343.56	0.00
JPY 朝日インテック	3 600.00	132 054.66	0.01
JPY アズビル	2 200.00	98 844.40	0.01
JPY バンダイナムコホールディングス	3 000.00	274 178.85	0.01
JPY 京都銀行	1 100.00	54 960.44	0.00
JPY カルビー	1 200.00	35 502.28	0.00
JPY カプコン	1 500.00	84 584.03	0.01
JPY 東海旅客鉄道	2 200.00	280 604.17	0.01
JPY 千葉銀行	5 300.00	30 089.67	0.00
JPY 中外製薬	10 000.00	483 720.93	0.03
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	32 343.32	0.00
JPY コンコルディア・フィナンシャルグループ	21 100.00	75 071.69	0.00
JPY コスモス薬品	300.00	51 786.14	0.00
JPY サイバーエージェント	1 600.00	109 709.90	0.01
JPY 第一生命ホールディングス	18 200.00	287 028.53	0.02
JPY ダイフク	1 700.00	197 266.84	0.01
JPY 第一三共	27 600.00	977 745.39	0.05
JPY ダイキン工業	3 900.00	885 097.10	0.05
JPY 大東建託	900.00	88 381.68	0.01
JPY 大和ハウス工業	9 500.00	291 536.80	0.02
JPY 大和ハウスリート投資法人	46.00	110 858.79	0.01
JPY ディスコ	500.00	159 434.19	0.01
JPY エーザイ	4 200.00	317 673.46	0.02
JPY ファナック	3 000.00	729 753.06	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・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 ファーストリテイリング	900.00	741 750.18	0.04
JPY 富士電機	2 000.00	71 158.00	0.00
JPY ふくおかフィナンシャルグループ	2 600.00	46 452.17	0.00
JPY GLP投資法人	69.00	104 484.30	0.01
JPY GMOペイメントゲートウェイ	600.00	84 238.79	0.01
JPY 阪急阪神ホールディングス	4 100.00	134 078.16	0.01
JPY ハーモニック・ドライブ・システムズ	700.00	55 919.44	0.00
JPY 光通信	300.00	72 126.59	0.00
JPY ヒロセ電機	520.00	73 605.37	0.00
JPY 久光製薬	900.00	52 821.87	0.00
JPY ホシザキ	900.00	89 158.48	0.01
JPY ヒューリック	6 800.00	68 929.27	0.00
JPY イビデン	1 800.00	84 411.41	0.00
JPY 出光興産	2 058.00	42 906.66	0.00
JPY いすゞ自動車	8 700.00	84 935.03	0.01
JPY 伊藤園	900.00	69 566.05	0.00
JPY 伊藤忠テクノソリューションズ	900.00	31 805.32	0.00
JPY 日本空港ビルデング	1 100.00	64 138.10	0.00
JPY 日本取引所グループ	8 800.00	218 027.33	0.01
JPY かんぽ生命保険	2 400.00	40 047.95	0.00
JPY ジャパンリアルエステイト投資法人	22.00	114 351.47	0.01
JPY JSR	3 500.00	96 835.29	0.00
JPY 鹿島建設	6 800.00	89 536.32	0.01
JPY カカクコム	1 800.00	50 560.54	0.00
JPY 関西電力	10 300.00	94 361.93	0.01
JPY 関西ペイント	1 900.00	57 669.62	0.00
JPY 花王	7 500.00	561 591.95	0.03
JPY 京阪ホールディングス	1 800.00	84 842.96	0.01
JPY 京浜急行電鉄	3 600.00	61 694.56	0.00
JPY 京王電鉄	1 900.00	135 017.98	0.01
JPY 京成電鉄	2 400.00	80 671.30	0.00
JPY キッコーマン	2 200.00	136 926.40	0.01
JPY 近鉄グループホールディングス	2 500.00	111 004.56	0.01
JPY キリンホールディングス	12 300.00	268 175.98	0.01
JPY 小林製薬	800.00	96 283.87	0.01
JPY 神戸物産	2 400.00	83 778.47	0.00
JPY コーエーテックモホールディングス	400.00	21 289.86	0.00
JPY 小糸製作所	1 900.00	114 428.20	0.01
JPY 小松製作所	13 300.00	323 970.27	0.02
JPY コーセー	500.00	76 432.51	0.00
JPY クラレ	5 100.00	50 669.86	0.00
JPY 栗田工業	1 800.00	66 458.88	0.00
JPY 九州電力	7 300.00	61 676.34	0.00
JPY 九州旅客鉄道	2 500.00	52 697.20	0.00
JPY レーザーテック	1 100.00	116 039.32	0.01
JPY LINE	500.00	25 797.17	0.00
JPY ライオン	4 200.00	99 406.38	0.01
JPY エムスリー	6 700.00	618 244.07	0.03
JPY マキタ	3 300.00	170 894.27	0.01
JPY 丸井グループ	3 900.00	71 286.50	0.00
JPY 日本マクドナルドホールディングス	700.00	34 035.00	0.00
JPY 明治ホールディングス	1 800.00	127 393.91	0.01
JPY ミネベアミツミ	4 800.00	100 073.84	0.01
JPY ミスミグループ本社	5 000.00	157 036.68	0.01
JPY 三菱瓦斯化学	3 100.00	65 820.19	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 三菱UFJリース	5 200.00	23 886.84	0.00
JPY 三井化学	2 800.00	78 757.13	0.00
JPY 三井不動産	13 900.00	290 796.93	0.02
JPY 三浦工業	1 100.00	57 914.17	0.00
JPY MonotaRO	2 000.00	122 176.94	0.01
JPY ナブテスコ	1 800.00	74 399.42	0.00
JPY 名古屋鉄道	3 100.00	85 381.92	0.01
JPY 日本ハム	1 500.00	64 085.35	0.00
JPY 日本電産	6 900.00	880 407.58	0.05
JPY 日本M&Aセンター	2 200.00	154 015.82	0.01
JPY 日本ビルファンド投資法人	29.00	160 469.91	0.01
JPY 日本通運	1 100.00	73 632.22	0.00
JPY 日本ペイントホールディングス	2 200.00	282 081.04	0.02
JPY 日本酸素ホールディングス	1 900.00	31 777.51	0.00
JPY 日本新薬	1 000.00	71 541.60	0.00
JPY 日本製鉄	13 300.00	162 814.19	0.01
JPY 日産化学	1 600.00	95 746.82	0.01
JPY 日清製粉グループ本社	3 700.00	60 214.82	0.00
JPY 日清食品ホールディングス	1 000.00	82 666.03	0.00
JPY ニトリホールディングス	1 200.00	255 823.54	0.01
JPY 日東電工	2 500.00	207 144.57	0.01
JPY 野村不動産ホールディングス	2 700.00	58 518.34	0.00
JPY 日本精工	6 200.00	50 242.15	0.00
JPY 大林組	7 600.00	67 053.46	0.00
JPY オービック	1 200.00	270 093.50	0.01
JPY 小田急電鉄	4 900.00	148 726.92	0.01
JPY 王子ホールディングス	13 200.00	60 002.88	0.00
JPY オリンパス	18 800.00	406 830.02	0.02
JPY 小野薬品工業	5 900.00	186 887.56	0.01
JPY 日本オラクル	500.00	55 478.30	0.00
JPY オリエンタルランド	3 300.00	562 210.50	0.03
JPY バン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	5 900.00	139 585.71	0.01
JPY ペプチドリーム	1 200.00	61 222.73	0.00
JPY パーソルホールディングス	3 200.00	58 675.62	0.00
JPY ビジョン	2 200.00	98 316.95	0.01
JPY ボーラ・オルビスホールディングス	1 700.00	33 991.85	0.00
JPY 楽天	13 100.00	146 860.71	0.01
JPY リクルートホールディングス	20 700.00	873 459.60	0.05
JPY リンナイ	700.00	81 764.57	0.00
JPY 良品計画	3 500.00	72 064.25	0.00
JPY SBIホールディングス	3 900.00	105 845.12	0.01
JPY SCSK	1 000.00	59 745.86	0.00
JPY セコム	3 400.00	338 940.30	0.02
JPY 西武ホールディングス	4 000.00	39 702.71	0.00
JPY 積水ハウス	8 500.00	153 085.59	0.01
JPY シャープ	4 100.00	55 046.75	0.00
JPY シマノ	1 300.00	308 434.43	0.02
JPY 清水建設	9 400.00	71 485.97	0.00
JPY 信越化学工業	5 700.00	936 653.08	0.05
JPY 新生銀行	900.00	10 719.73	0.00
JPY 塩野義製薬	3 900.00	209 184.37	0.01
JPY 資生堂	6 400.00	451 728.60	0.02
JPY 静岡銀行	8 000.00	56 926.40	0.00
JPY SMC	900.00	572 409.50	0.03
JPY スクウェア・エニックス・ホールディングス	1 400.00	86 060.90	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	スタンレー電気	2 400.00	70 659.31	0.00
JPY	住友金属鉱山	4 100.00	152 833.37	0.01
JPY	サンドラッグ	1 400.00	58 806.04	0.00
JPY	サントリー食品インターナショナル	2 000.00	73 171.90	0.00
JPY	スズケン	1 400.00	53 569.89	0.00
JPY	スズキ	6 000.00	322 455.05	0.02
JPY	シスメックス	2 700.00	283 011.27	0.02
JPY	T & Dホールディングス	8 200.00	95 859.99	0.01
JPY	太平洋セメント	2 000.00	53 819.23	0.00
JPY	大成建設	3 000.00	106 161.59	0.01
JPY	大正製薬ホールディングス	700.00	44 574.44	0.00
JPY	帝人	3 500.00	59 880.12	0.00
JPY	テルモ	10 600.00	421 560.30	0.02
JPY	THK	2 000.00	61 855.67	0.00
JPY	TIS	4 200.00	83 697.91	0.00
JPY	東武鉄道	2 500.00	75 041.96	0.00
JPY	東宝	1 900.00	80 537.04	0.00
JPY	東邦瓦斯	1 500.00	98 249.82	0.01
JPY	東北電力	7 300.00	61 256.29	0.00
JPY	東京センチュリー	700.00	46 386.96	0.00
JPY	東京瓦斯	6 500.00	146 144.81	0.01
JPY	東急	8 600.00	104 494.85	0.01
JPY	東レ	22 400.00	121 607.67	0.01
JPY	東ソー	4 600.00	72 611.84	0.00
JPY	TOTO	2 500.00	141 692.64	0.01
JPY	東洋水産	1 000.00	49 196.84	0.00
JPY	豊田合成	1 500.00	40 738.43	0.00
JPY	豊田自動織機	2 700.00	195 233.76	0.01
JPY	豊田通商	3 800.00	131 555.98	0.01
JPY	ツルハホールディングス	700.00	102 574.92	0.01
JPY	ユー・エス・エス	3 600.00	75 400.62	0.00
JPY	ウエルシアホールディングス	2 000.00	80 460.32	0.00
JPY	ヤクルト本社	2 000.00	95 420.76	0.01
JPY	ヤマハ	1 800.00	102 881.80	0.01
JPY	ヤマトホールディングス	4 100.00	103 684.49	0.01
JPY	ZOZO	920.00	22 974.63	0.00
日本合計			26 992 972.46	1.39
ジャージー				
GBP	GLENCORE XSTRATA ORD USD0.01	210 990.00	596 743.75	0.03
ジャージー合計			596 743.75	0.03
ルクセンブルグ				
EUR	AROUNDTOWN SA EURO.01	32 806.00	228 313.08	0.01
ルクセンブルグ合計			228 313.08	0.01
メキシコ				
GBP	FRESNILLO PLC ORD USD0.50	1 379.00	19 376.89	0.00
メキシコ合計			19 376.89	0.00
オランダ				
USD	AERCAP HOLDINGS EURO.01	3 800.00	139 688.00	0.01
EUR	AKZO NOBEL NV EURO.50(POST REV SPLIT)	5 897.00	628 228.47	0.03
EUR	ALTICE EUROPE N.V. EURO.01 (COMMON SHARES A)	21 989.00	116 207.72	0.01
EUR	ARGEN X NV EURO.10	1 366.00	390 855.00	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

## - 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 EXOR NV EURO.01	3 475.00	242 673.69	0.01
EUR HEINEKEN HOLDING EUR1.6	3 599.00	333 431.84	0.02
EUR HEINEKEN NV EUR1.60	7 856.00	831 853.17	0.04
EUR ING GROEP N.V. EURO.01	118 478.00	1 158 588.66	0.06
EUR JUST EAT TAKEAWAY EURO.04	3 866.00	411 766.29	0.02
EUR KON KPN NV EURO.04	108 588.00	324 602.52	0.02
EUR KONINKLIJKE AHOLD EURO.01	33 196.00	952 620.23	0.05
EUR KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20	27 846.00	1 444 294.94	0.07
EUR QIAGEN NV EURO.01	6 884.00	332 761.83	0.02
EUR RANDSTAD N.V. EURO.10	3 552.00	220 942.92	0.01
GBP ROYAL DUTCH SHELL 'B' SHS EURO.07 (UK LIST)	77 135.00	1 270 967.83	0.06
EUR STMICROELECTRONICS EUR1.04	19 330.00	758 881.96	0.04
EUR VOPAK(KON) EURO.50	2 321.00	122 244.02	0.00
EUR WOLTERS KLUWER EURO.12	8 406.00	706 884.58	0.04
<b>オランダ合計</b>		<b>10 387 493.67</b>	<b>0.53</b>
<b>スペイン</b>			
EUR ACS ACTIVIDADES CO EURO.5	7 653.00	242 503.20	0.01
EUR AENA SME S.A. EUR10	1 962.00	320 592.61	0.02
EUR AMADEUS IT GROUP EURO.01	13 810.00	949 211.73	0.05
EUR CAIXABANK SA EUR1	111 103.00	285 339.32	0.02
EUR CELLNEX TELECOM SA EURO.25	9 638.00	609 652.23	0.03
EUR ENAGAS SA EUR1.50	8 406.00	205 328.35	0.01
EUR ENDESA SA EUR1.2	8 925.00	255 905.76	0.01
EUR FERROVIAL SA EURO.2	13 927.00	388 499.01	0.02
EUR GRIFOLS SA EURO.25 (CLASS A) POST SUBD	8 878.00	252 221.76	0.01
EUR IBERDROLA SA EURO.75 (POST SUBDIVISION)	181 312.00	2 482 253.57	0.13
EUR INDITEX EURO.03 (POST SUBD)	33 359.00	1 111 327.40	0.06
EUR NATURGY ENERGY GRO EUR1	9 406.00	217 546.92	0.01
EUR RED ELECTRICA CORP EURO.5	12 492.00	256 047.11	0.01
EUR REPSOL SA EUR1	45 918.00	442 602.66	0.02
EUR SIEMENS GAMESA REN EURO.17	7 150.00	255 986.20	0.01
EUR TELEFONICA SA EUR1	151 819.00	664 132.73	0.04
<b>スペイン合計</b>		<b>8 939 150.56</b>	<b>0.46</b>
<b>スイス</b>			
CHF SWATCH GROUP CHF2.25(BR)	1 166.00	288 763.06	0.01
CHF SWISS RE AG CHFO.10	11 841.00	1 085 871.89	0.06
CHF VIFOR PHARMA AG CHFO.01	1 864.00	274 462.83	0.01
<b>スイス合計</b>		<b>1 649 097.78</b>	<b>0.08</b>
<b>イギリス</b>			
GBP 3I GROUP ORD GBPO.738636	18 341.00	262 124.26	0.01
GBP ASTRAZENECA ORD USDO.25	27 469.00	2 862 287.72	0.15
GBP AVEVA GROUP ORD GBPO.03556	1 205.00	54 568.30	0.00
GBP AVIVA ORD GBPO.25	83 768.00	359 212.32	0.02
GBP BAE SYSTEMS ORD GBPO.025	66 895.00	450 113.18	0.02
GBP BARRATT DEVEL ORD GBPO.10	19 623.00	162 425.65	0.01
GBP BRIT AMER TOBACCO ORD GBPO.25	47 999.00	1 691 419.72	0.09
GBP BRITISH LAND CO PLC REIT	18 455.00	116 219.09	0.01
GBP BT GROUP ORD GBPO.05	191 761.00	299 020.29	0.01
GBP BUNZL ORD GBPO.32142857	8 004.00	252 076.61	0.01
USD COCA-COLA EUROPEAN ORD EURO.01	6 237.00	278 669.16	0.01
GBP EVRAZ PLC ORD USD1	7 119.00	36 714.81	0.00
GBP HALMA ORD GBPO.10	7 911.00	234 044.62	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 HIKMA PHARMACEUTIC ORD GBPO.10	3 485.00	121 341.09	0.01
GBP INFORMA PLC (GB) ORD GBPO.001	28 156.00	199 300.42	0.01
GBP JD SPORTS FASHION ORD GBPO.0025	10 163.00	105 315.70	0.01
GBP JOHNSON MATTHEY ORD GBP1.109245	4 068.00	120 785.07	0.01
GBP KINGFISHER ORD GBPO.157142857	43 467.00	158 771.77	0.01
GBP LAND SECURITIES GP ORD GBPO.106666666	14 519.00	127 466.49	0.01
GBP LLOYDS BANKING GP ORD GBPO.1	1 488 861.00	708 020.12	0.04
GBP MELROSE INDUST PLC ORD GBPO.0685714	101 670.00	208 352.51	0.01
GBP NATIONAL GRID ORD GBPO.12431289	73 030.00	827 178.98	0.04
GBP OCADO GROUP PLC ORD GBPO.02	9 615.00	283 301.68	0.01
GBP RECKITT BENCK GRP ORD GBPO.10	14 880.00	1 307 947.42	0.07
GBP RELX PLC GBPO.1444	40 347.00	941 295.47	0.05
GBP RENTOKIL INITIAL ORD GBPO.01	37 463.00	248 724.49	0.01
GBP ROLLS-ROYCE HLDGS ORD GBPO.20	185 094.00	261 195.00	0.01
GBP SAGE GROUP GBPO.01051948	21 784.00	175 950.51	0.01
GBP SEVERN TRENT ORD GBPO.9789	4 913.00	156 696.91	0.01
GBP SMITHS GROUP ORD GBPO.375	7 932.00	154 502.51	0.01
GBP SPIRAX-SARCO ENG ORD GBPO.269230769	1 490.00	221 500.15	0.01
GBP SSE PLC ORD GBPO.50	23 179.00	414 974.11	0.02
GBP ST JAMES ' S PLACE ORD GBPO.15	10 780.00	146 796.76	0.01
GBP UNITED UTILITIES G ORD GBPO.05	13 498.00	162 256.62	0.01
GBP WHITBREAD ORD GBPO.76797385	4 178.00	169 064.30	0.01
GBP WPP PLC ORD GBPO.10	25 977.00	251 642.39	0.01
イギリス合計		14 531 276.20	0.75
無記名株式合計		140 448 559.48	7.21
参加証券			
スイス			
CHF LINDT & SPRUENGLI PTG CERT CHF10	45.00	385 479.95	0.02
CHF SCHINDLER-HLDG AG PTG CERT CHF0.10(POST-SUBD)	1 627.00	445 704.19	0.02
スイス合計		831 184.14	0.04
参加証券合計		831 184.14	0.04
その他の株式			
スイス			
CHF ROCHE HLDGS AG GENUSSSCHEINE NPV	28 449.00	9 397 628.91	0.48
スイス合計		9 397 628.91	0.48
その他の株式合計		9 397 628.91	0.48
優先株式			
ドイツ			
EUR BAYERISCHE MOTORENWERKE AG EUR1	1 622.00	107 489.10	0.01
EUR FUCHS PETROLUB SE NON-VTG PRF NPV	2 221.00	127 311.95	0.01
EUR HENKEL AG&CO. KGAA NON-VTG PRF NPV	5 376.00	580 312.79	0.03
EUR PORSCHE AUTO HL SE NON VTG PRF NPV	4 647.00	296 280.92	0.01
EUR SARTORIUS AG NON VTG PRF NPV	1 058.00	483 451.41	0.02
EUR VOLKSWAGEN AG NON VTG PRF NPV	5 592.00	945 444.52	0.05
ドイツ合計		2 540 290.69	0.13
優先株式合計		2 540 290.69	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・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>記名株式</b>			
<b>オーストラリア</b>			
GBP BHP GROUP PLC ORD USD0.50	44 185.00	1 001 990.28	0.05
<b>オーストラリア合計</b>		<b>1 001 990.28</b>	<b>0.05</b>
<b>ベルギー</b>			
EUR AGEAS NPV	5 608.00	276 515.70	0.02
EUR KBC GROUP NV NPV	7 460.00	521 141.28	0.03
EUR TELENET GRP HLDG NPV	1 723.00	73 785.68	0.00
EUR UCB NPV	3 863.00	413 849.65	0.02
<b>ベルギー合計</b>		<b>1 285 292.31</b>	<b>0.07</b>
<b>カナダ</b>			
CAD 1ST QUANTUM MINLS COM NPV	24 632.00	350 310.80	0.02
CAD AGNICO EAGLE MINES LTD COM	9 791.00	643 037.28	0.03
CAD ALIMENTATION COUCHE TARD INC SUB VTG SH	34 621.00	1 152 252.28	0.06
CAD BANK NOVA SCOTIA HALIFAX COM	48 979.00	2 388 666.41	0.12
CAD BANK OF MONTREAL COM NPV	25 697.00	1 850 683.70	0.09
CAD BARRICK GOLD CORP COM NPV	72 029.00	1 656 906.00	0.09
CAD BCE INC COM NEW	5 615.00	243 942.05	0.01
CAD BLACKBERRY LTD NPV	25 221.00	148 885.45	0.01
CAD BROOKFIELD ASSET M LTD VTG SHS NPV CL 'A'	53 893.00	2 181 254.61	0.11
CAD CAN PACIFIC RYS COM NPV	5 466.00	1 769 711.88	0.09
CAD CANADIAN NAT RES LTD COM	47 767.00	1 092 164.68	0.06
CAD CANADIAN NATL RY CO COM	28 734.00	3 015 528.98	0.15
CAD CANADIAN TIRE LTD CL A	2 511.00	321 591.69	0.02
CAD CCL INDUSTRIES INC 'B' NON-VTG COM NPV	6 402.00	282 875.62	0.01
CAD CDN IMPERIAL BK OF COMMERCE COM	17 969.00	1 518 053.95	0.08
CAD CENOVUS ENERGY INC COM NPV	42 656.00	211 979.81	0.01
CAD CGI INC COM NPV SUB VOTING SHARES C	9 360.00	692 736.79	0.04
CAD CONSTELLATION SOFT COM STK NPV	912.00	1 131 839.93	0.06
CAD CRONOS GROUP INC COM NPV	5 200.00	46 988.19	0.00
CAD DOLLARAMA INC COM NPV	11 935.00	489 593.80	0.02
CAD ENBRIDGE INC COM NPV	84 118.00	2 632 785.00	0.14
CAD FAIRFAX FINL HLDGS SUB-VTG COM NPV	1 089.00	374 288.60	0.02
CAD FIRSTSERVICE CORP COM NPV	100.00	13 667.72	0.00
CAD FORTIS INC COM NPV	18 584.00	749 870.64	0.04
CAD FRANCO NEVADA CORP COM NPV	7 587.00	1 012 087.88	0.05
CAD GILDAN ACTIVEWEAR INC COM	8 163.00	213 917.34	0.01
CAD GREAT WEST LIFECO INC COM	11 105.00	258 879.58	0.01
CAD IA FINANCIAL CORP COM NPV	4 298.00	188 615.83	0.01
CAD IMPERIAL OIL LTD COM NEW	10 263.00	178 032.44	0.01
CAD INTACT FINL CORP COM NPV	5 863.00	657 331.02	0.03
CAD INTER PIPELINE LTD COM NPV	16 802.00	167 773.66	0.01
CAD LOBLAW COS LTD COM	7 045.00	349 015.36	0.02
CAD MAGNA INTL INC COM NPV	11 265.00	692 294.62	0.04
CAD MANULIFE FINL CORP COM	78 151.00	1 334 579.54	0.07
CAD METRO INC CL A SUB	10 117.00	465 761.41	0.02
CAD NATL BK OF CANADA COM NPV	13 525.00	750 820.67	0.04
CAD NUTRIEN LTD NPV	22 974.00	1 136 378.89	0.06
CAD OPEN TEXT CO COM NPV	11 019.00	487 475.32	0.03
CAD PARKLAND CORP. COM NPV	5 900.00	181 111.20	0.01
CAD PEMBINA PIPELINE C COM NPV	22 294.00	569 779.52	0.03
CAD POWER CORP CDA COM	22 510.00	507 903.70	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・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	11 501.00	656 832.32	0.03
CAD ROGERS COMMS INC CLASS ' B ' COM CAD1.62478	14 402.00	680 813.74	0.03
CAD ROYAL BK OF CANADA COM NPV	57 240.00	4 684 678.14	0.24
CAD SAPUTO INC COM	10 165.00	282 618.22	0.01
CAD SHAW COMMUNICATIONS INC CL B CONV	20 339.00	354 390.48	0.02
CAD SHOPIFY INC COM NPV CL A	4 345.00	4 686 558.11	0.24
CAD SUN LIFE FINL INC COM	23 389.00	1 040 854.72	0.05
CAD SUNCOR ENERGY INC COM NPV ' NEW '	61 892.00	991 972.25	0.05
CAD TC ENERGY CORPORAT COM NPV	37 908.00	1 671 181.45	0.09
CAD TECK RESOURCES LTD CLASS ' B ' SUB-VTG COM NPV	18 760.00	297 056.25	0.02
CAD THOMSON-REUTERS CP COM NPV(POST REV SPLIT)	7 750.00	615 622.35	0.03
CAD TORONTO-DOMINION COM NPV	72 964.00	3 900 722.22	0.20
CAD WESTON GEORGE LTD COM	3 175.00	235 472.84	0.01
CAD WHEATON PRECIOUS M COM NPV	18 239.00	705 549.09	0.04
<b>カナダ合計</b>		<b>54 915 696.02</b>	<b>2.82</b>
<b>フィンランド</b>			
EUR ELISA OYJ NPV	4 277.00	230 226.63	0.01
EUR FORTUM OYJ EUR3.40	14 367.00	330 053.40	0.02
EUR NESTE OIL OYJ NPV	12 874.00	865 165.19	0.04
EUR NOKIA OYJ NPV	171 900.00	688 335.65	0.04
EUR ORION CORP SER ' B ' NPV	3 580.00	168 983.35	0.01
EUR SAMPO PLC SER ' A ' NPV	14 252.00	617 657.82	0.03
EUR STORA ENSO OYJ NPV SER ' R '	17 479.00	296 271.74	0.01
EUR UPM-KYMMENE CORP NPV	17 096.00	564 835.50	0.03
<b>フィンランド合計</b>		<b>3 761 529.28</b>	<b>0.19</b>
<b>フランス</b>			
EUR GECINA EUR7.50	1 420.00	216 232.29	0.01
EUR LA FRANCAISE DES EURO.40 (PROMESSES)	2 945.00	123 157.40	0.01
EUR MICHELIN (CGDE) EUR2	5 169.00	645 830.83	0.03
<b>フランス合計</b>		<b>985 220.52</b>	<b>0.05</b>
<b>ドイツ</b>			
EUR ADIDAS AG NPV (REGD)	5 822.00	1 861 551.08	0.10
EUR ALLIANZ SE NPV(REGD)(VINKULIERT)	12 650.00	2 990 977.28	0.15
EUR BASF SE NPV	28 138.00	2 064 286.57	0.11
EUR BAYER AG NPV (REGD)	30 050.00	1 735 104.25	0.09
EUR BRENNTAG AG	4 606.00	352 951.20	0.02
EUR DAIMLER AG ORD NPV(REGD)	25 952.00	1 752 421.52	0.09
EUR DELIVERY HERO SE NPV	3 950.00	478 405.24	0.02
EUR DEUTSCHE BANK AG NPV(REGD)	59 946.00	669 962.29	0.03
EUR DEUTSCHE BOERSE AG NPV(REGD)	5 768.00	964 230.50	0.05
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA ORD NPV (REGD)(VINK)	8 327.00	96 081.46	0.00
EUR DEUTSCHE POST AG NPV(REGD)	30 136.00	1 459 971.67	0.07
EUR DEUTSCHE TELEKOM NPV(REGD)	101 408.00	1 833 513.73	0.09
EUR E.ON SE NPV	67 375.00	731 470.91	0.04
EUR EVONIK INDUSTRIES NPV	6 073.00	183 865.07	0.01
EUR HANNOVER RUECKVERS ORD NPV(REGD)	1 925.00	323 066.71	0.02
EUR INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)	38 092.00	1 345 098.00	0.07
EUR LEG IMMOBILIEN AG NPV	2 229.00	318 519.76	0.02
EUR MTU AERO ENGINES H NPV (REGD)	1 610.00	381 228.34	0.02
EUR MUENCHENER RUECKVE NPV(REGD)	4 256.00	1 189 263.95	0.06
EUR SCOUT24 AG NPV	3 366.00	258 092.83	0.01
EUR SIEMENS AG NPV(REGD)	23 307.00	3 122 541.34	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・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 ENERGY AG NPV	12 782.00	380 716.73	0.02
EUR SIEMENS HEALTHINEE NPV	8 150.00	375 825.11	0.02
EUR TELEFONICA DEUTSCH NPV	30 268.00	83 782.03	0.00
EUR UNIPER SE NPV	6 681.00	226 967.46	0.01
EUR UNITED INTERNET AG NPV(REGD)	3 366.00	134 602.86	0.01
EUR VONOVIA SE NPV	15 719.00	1 080 800.34	0.06
<b>ドイツ合計</b>		<b>26 395 298.23</b>	<b>1.35</b>
<b>アイルランド</b>			
EUR CRH ORD EURO.32	23 892.00	937 982.81	0.05
GBP EXPERIAN ORD USDO.10	19 020.00	671 889.55	0.03
EUR KINGSPAN GROUP ORD EURO.13(DUBLIN LISTING)	4 506.00	394 284.15	0.02
EUR SMURFIT KAPPA GRP ORD EURO.001	7 220.00	307 807.14	0.02
<b>アイルランド合計</b>		<b>2 311 963.65</b>	<b>0.12</b>
<b>マン島</b>			
GBP GVC HLDGS PLC ORD EURO.01	12 956.00	179 109.48	0.01
<b>マン島合計</b>		<b>179 109.48</b>	<b>0.01</b>
<b>イタリア</b>			
EUR ATLANTIA SPA EUR1	15 218.00	278 153.63	0.01
EUR DAVIDE CAMPARI MIL EURO.05	17 460.00	202 465.51	0.01
EUR ENEL EUR1	247 165.00	2 474 663.93	0.13
EUR ENI SPA EUR1	78 275.00	777 431.11	0.04
EUR FERRARI NV EURO.01(NEW)	3 827.00	809 365.19	0.04
EUR INTESA SANPAOLO NPV	504 604.00	1 162 185.50	0.06
EUR MEDIOBANCA SPA EURO.5	21 106.00	188 696.05	0.01
EUR MONCLER SPA NPV	6 054.00	298 072.27	0.02
EUR NEXI SPA NPV	13 858.00	261 915.65	0.01
EUR PIRELLI & C SPA NPV	12 861.00	69 229.48	0.00
EUR PRYSMIAN SPA EURO.10	7 791.00	255 636.47	0.01
EUR RECORDATI EURO.125	3 000.00	160 159.22	0.01
EUR SNAM EUR1	58 790.00	330 736.58	0.02
EUR TERNA SPA ORD EURO.22	41 285.00	309 743.45	0.02
EUR UNICREDIT SPA NPV (POST REV SPLIT)	64 462.00	666 456.93	0.03
<b>イタリア合計</b>		<b>8 244 910.97</b>	<b>0.42</b>
<b>日本</b>			
JPY エービーシー・マート	400.00	20 867.90	0.00
JPY イオン	11 100.00	330 525.05	0.02
JPY イオンモール	2 400.00	38 551.91	0.00
JPY A G C	3 700.00	123 303.76	0.01
JPY 味の素	7 600.00	158 924.00	0.01
JPY アルフレッサ ホールディングス	3 300.00	66 142.41	0.00
JPY A N A ホールディングス	1 100.00	26 557.18	0.00
JPY アサヒグループホールディングス	7 600.00	294 233.52	0.02
JPY 旭化成	20 000.00	183 572.29	0.01
JPY アステラス製薬	28 200.00	401 195.88	0.02
JPY プリヂストーン	8 900.00	311 019.90	0.02
JPY ブラザー工業	3 600.00	69 048.19	0.00
JPY キヤノン	17 300.00	307 509.47	0.02
JPY カシオ計算機	2 500.00	44 953.25	0.00
JPY 中部電力	11 400.00	137 477.82	0.01
JPY 中国電力	3 000.00	38 177.90	0.00
JPY 大日本印刷	3 600.00	67 529.13	0.00
JPY 大和証券グループ本社	20 000.00	87 096.62	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 デンソー	6 800.00	321 430.83	0.02
JPY 電通グループ	3 700.00	120 642.53	0.01
JPY 東日本旅客鉄道	4 700.00	292 434.43	0.02
JPY E N E O S ホールディングス	48 400.00	166 400.38	0.01
JPY 富士フィルムホールディングス	5 400.00	291 297.05	0.02
JPY 富士通	3 100.00	431 220.33	0.02
JPY 博報堂D Y ホールディングス	4 100.00	59 371.85	0.00
JPY 浜松ホトニクス	2 400.00	135 104.29	0.01
JPY 日野自動車	4 800.00	41 659.07	0.00
JPY 日立建機	1 700.00	47 132.10	0.00
JPY 日立金属	2 500.00	36 753.78	0.00
JPY 日立製作所	15 900.00	604 741.31	0.03
JPY 本田技研工業	27 500.00	757 288.42	0.04
JPY H O Y A	5 900.00	787 043.88	0.04
JPY 飯田グループホールディングス	3 200.00	64 383.61	0.00
JPY 国際石油開発帝石	16 200.00	90 729.32	0.01
JPY 伊藤忠商事	22 400.00	592 571.57	0.03
JPY 日本航空	2 100.00	39 814.91	0.00
JPY ゆうちょ銀行	7 100.00	55 969.31	0.00
JPY 日本郵政	23 500.00	174 140.01	0.01
JPY 日本リテールファンド投資法人	46.00	73 450.01	0.00
JPY 日本たばこ産業	18 400.00	374 087.75	0.02
JPY ジェイ エフ イー ホールディングス	9 600.00	88 013.43	0.00
JPY K D D I	26 200.00	749 379.05	0.04
JPY キーエンス	3 000.00	1 533 157.52	0.08
JPY コナミホールディングス	1 500.00	78 686.17	0.00
JPY クボタ	16 400.00	325 640.85	0.02
JPY 京セラ	5 300.00	303 082.24	0.02
JPY 協和キリン	4 500.00	122 344.76	0.01
JPY ローソン	500.00	22 680.41	0.00
JPY L I X I L	4 100.00	98 494.36	0.01
JPY 丸紅	23 700.00	138 302.09	0.01
JPY マツダ	8 800.00	52 070.01	0.00
JPY メディパルホールディングス	3 400.00	64 005.75	0.00
JPY メルカリ	1 600.00	73 344.52	0.00
JPY 三菱ケミカルホールディングス	21 300.00	117 964.52	0.01
JPY 三菱商事	20 600.00	480 650.21	0.03
JPY 三菱電機	29 400.00	432 365.38	0.02
JPY 三菱地所	17 900.00	309 677.30	0.02
JPY 三菱重工業	5 300.00	119 520.02	0.01
JPY 三菱UFJフィナンシャル・グループ	189 600.00	815 493.65	0.04
JPY 三井物産	27 000.00	460 896.67	0.02
JPY みずほフィナンシャルグループ	36 830.00	468 873.89	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	6 800.00	197 918.96	0.01
JPY 村田製作所	9 400.00	822 945.10	0.04
JPY 日本電気	4 400.00	237 564.13	0.01
JPY ネクソン	7 300.00	220 872.69	0.01
JPY 日本碍子	4 200.00	66 821.39	0.00
JPY 日本特殊陶業	2 800.00	50 777.27	0.00
JPY 任天堂	1 800.00	1 022 948.94	0.05
JPY 日本プロロジスリート投資法人	33.00	103 644.21	0.01
JPY 日本電信電話	19 100.00	451 512.83	0.02
JPY 日本郵船	2 000.00	43 653.80	0.00
JPY 日産自動車	39 900.00	188 451.21	0.01
JPY 野村ホールディングス	50 600.00	254 273.80	0.01
JPY 野村不動産マスターファンド投資法人	62.00	80 863.10	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

## - 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 野村総合研究所	4 800.00	162 263.25	0.01
JPY エヌ・ティ・ティ・データ	10 400.00	138 433.95	0.01
JPY NTTドコモ	9 200.00	341 707.98	0.02
JPY オムロン	3 200.00	289 388.63	0.02
JPY オリックス	22 800.00	339 567.49	0.02
JPY オリックス不動産投資法人	29.00	43 385.28	0.00
JPY 大阪瓦斯	5 200.00	99 935.75	0.01
JPY 大塚商会	2 000.00	97 051.07	0.00
JPY 大塚ホールディングス	6 700.00	272 561.98	0.01
JPY パナソニック	34 700.00	370 210.98	0.02
JPY ルネサスエレクトロニクス	13 700.00	121 923.76	0.01
JPY リそなホールディングス	30 100.00	105 562.89	0.01
JPY リコー	13 400.00	89 568.93	0.00
JPY ローム	1 200.00	100 234.96	0.01
JPY 参天製薬	5 700.00	94 840.57	0.01
JPY セガサミーホールディングス	3 800.00	53 460.56	0.00
JPY セイコーエプソン	4 300.00	64 206.19	0.00
JPY 積水化学工業	5 400.00	93 370.42	0.01
JPY セブン&アイ・ホールディングス	11 600.00	368 552.39	0.02
JPY S Gホールディングス	5 400.00	161 572.76	0.01
JPY 島津製作所	4 000.00	144 042.20	0.01
JPY しまむら	400.00	41 428.91	0.00
JPY ソフトバンク	44 500.00	548 168.31	0.03
JPY ソフトバンクグループ	25 400.00	1 771 362.27	0.09
JPY 総合警備保障	1 100.00	58 969.07	0.00
JPY S O M P Oホールディングス	6 000.00	230 736.04	0.01
JPY ソニー	20 400.00	1 898 456.97	0.10
JPY S U B A R U	10 300.00	204 765.28	0.01
JPY S U M C O	3 400.00	68 929.27	0.00
JPY 住友化学	23 000.00	81 611.12	0.00
JPY 住友商事	17 400.00	214 673.70	0.01
JPY 大日本住友製薬	2 700.00	34 256.53	0.00
JPY 住友電気工業	13 100.00	150 001.44	0.01
JPY 三井住友フィナンシャルグループ	21 700.00	630 970.03	0.03
JPY 三井住友トラスト・ホールディングス	5 500.00	160 925.44	0.01
JPY 住友不動産	5 300.00	173 066.41	0.01
JPY 武田薬品工業	25 649.00	921 174.83	0.05
JPY T D K	1 800.00	254 097.34	0.01
JPY 東京海上ホールディングス	9 600.00	477 813.48	0.03
JPY 東京電力ホールディングス	30 000.00	78 254.62	0.00
JPY 東京エレクトロン	2 400.00	816 379.77	0.04
JPY 東急不動産ホールディングス	10 300.00	49 981.30	0.00
JPY 凸版印刷	2 600.00	35 531.05	0.00
JPY 東芝	6 900.00	193 352.19	0.01
JPY トヨタ自動車	33 800.00	2 268 676.10	0.12
JPY トレンドマイクロ	2 000.00	108 750.90	0.01
JPY ユニ・チャーム	6 200.00	301 036.68	0.02
JPY ユナイテッド・アーバン投資法人	24.00	27 158.95	0.00
JPY 西日本旅客鉄道	2 100.00	95 942.46	0.01
JPY ヤマダホールディングス	10 000.00	47 566.53	0.00
JPY ヤマハ発動機	4 400.00	84 814.19	0.00
JPY 山崎製パン	1 600.00	26 575.88	0.00
JPY 安川電機	4 000.00	192 951.33	0.01
JPY 横河電機	3 800.00	67 199.23	0.00
JPY Zホールディングス	43 400.00	273 448.09	0.01
日本合計		35 002 110.85	1.80

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>ルクセンブルグ</b>			
EUR ARCELORMITTAL NPV(POST STOCK SPLIT)	22 164.00	406 968.05	0.02
EUR EUROFINS SCIENTIFI EURO.01	4 110.00	334 608.96	0.02
EUR TENARIS S.A. USD1	11 554.00	89 642.32	0.00
<b>ルクセンブルグ合計</b>		<b>831 219.33</b>	<b>0.04</b>
<b>オランダ</b>			
EUR ADYEN NV EURO.01	550.00	1 053 971.82	0.05
EUR AEGON NV EURO.12	57 951.00	217 390.62	0.01
EUR ASML HOLDING NV EURO.09	12 936.00	5 630 230.62	0.29
EUR CNH INDUSTRIAL NV COM EURO.01	32 245.00	353 623.23	0.02
EUR FIAT CHRYSLER AUTO EURO.01	33 080.00	517 025.49	0.03
EUR KONINKLIJKE DSM NV EUR1.5	5 249.00	862 086.63	0.04
EUR NN GROUP N.V. EURO.12	8 785.00	357 818.41	0.02
EUR PROSUS N.V. EURO.05	14 883.00	1 617 228.57	0.08
GBP ROYAL DUTCH SHELL PLC 'A' SHS EURO.07	85 385.00	1 449 082.12	0.08
<b>オランダ合計</b>		<b>12 058 457.51</b>	<b>0.62</b>
<b>ポルトガル</b>			
EUR EDP ENERGIAS PORTU EUR1(REGD)	94 640.00	505 814.99	0.02
EUR GALP ENERGIA EUR1-B	17 406.00	188 305.64	0.01
EUR JERONIMO MARTINS EUR5	7 921.00	136 062.44	0.01
<b>ポルトガル合計</b>		<b>830 183.07</b>	<b>0.04</b>
<b>スペイン</b>			
EUR BANCO SANTANDER SA EURO.50(REGD)	505 240.00	1 461 059.85	0.07
EUR BANKINTER SA EURO.3(REGD)	18 450.00	91 567.97	0.01
EUR BBVA(BILB-VIZ-ARG) EURO.49	205 589.00	966 487.46	0.05
EUR MAPFRE SA EURO.10	28 768.00	55 300.54	0.00
<b>スペイン合計</b>		<b>2 574 415.82</b>	<b>0.13</b>
<b>スイス</b>			
CHF ABB LTD CHF0.12 (REGD)	73 886.00	1 956 309.97	0.10
CHF ADECCO GROUP AG CHF0.1 (REGD)	6 123.00	372 263.25	0.02
CHF ALCON AG CHF0.04	20 974.00	1 343 281.25	0.07
CHF BALOISE-HLDGS CHF0.1(REGD)	1 908.00	330 259.14	0.02
CHF BARRY CALLEBAUT AG CHF0.02 (REGD)	123.00	265 075.67	0.01
CHF BQE CANT VAUDOISE CHF1	968.00	100 082.62	0.01
CHF CLARIANT CHF4.00(REGD)	8 449.00	170 230.60	0.01
GBP COCA-COLA HBC AG ORD CHF6.70	4 049.00	116 869.45	0.01
CHF CREDIT SUISSE GRP CHF0.04(REGD)	97 543.00	1 236 931.01	0.06
CHF EMS-CHEMIE HLDG AG CHF0.01(REGD)(POST RECON)	302.00	277 047.39	0.01
CHF GEBERIT CHF0.10(REGD)	1 488.00	899 078.76	0.05
CHF GIVAUDAN AG CHF10	371.00	1 517 932.18	0.08
CHF JULIUS BAER GRUPPE CHF0.02 (REGD)	8 999.00	521 272.02	0.03
CHF KUEHNE&NAGEL INTL CHF1(REGD)(POST-SUBD)	2 097.00	476 475.09	0.02
CHF LAFARGEHOLCIM LTD CHF2 (REGD)	20 804.00	1 095 237.64	0.06
CHF LINDT & SPRUENGLI CHF100(REGD)	4.00	357 008.73	0.02
CHF LOGITECH INTL CHF0.25(REGD) (POST-SUBD)	6 624.00	588 133.35	0.03
CHF LONZA GROUP AG CHF1(REGD)	2 991.00	1 881 888.43	0.10
CHF NESTLE SA CHF0.10(REGD)	120 227.00	13 437 057.17	0.69
CHF NOVARTIS AG CHF0.50(REGD)	90 188.00	8 195 920.42	0.42
CHF PARTNERS GROUP HLG CHF0.01 (REGD)	743.00	800 204.35	0.04
CHF RICHEMONT(CIE FIN) CHF1.00 (REG) SER 'A'	20 989.00	1 749 972.08	0.09
CHF SCHINDLER-HLDG AG CHF0.1(REGD)(POST-SUBD)	921.00	244 772.56	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

## - 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 SGS LTD CHF1(REGD)	243.00	694 937.59	0.04
CHF SIKA AG CHF0.01 (REG)	5 682.00	1 455 490.78	0.07
CHF SONOVA HOLDING AG CHF0.05 (REGD)	2 200.00	547 023.09	0.03
CHF STRAUMANN HLDG CHF0.1(REGD)	413.00	475 362.86	0.02
CHF SWATCH GROUP CHF0.45(REGD)	1 922.00	92 522.66	0.00
CHF SWISS LIFE HLDG CHF5.1(REGD)	1 355.00	607 377.66	0.03
CHF SWISS PRIME SITE CHF15.3 (REGD)	3 195.00	288 689.94	0.00
CHF SWISSCOM AG CHF1(REGD)	1 021.00	541 345.41	0.03
CHF TEMENOS AG CHF5 (REGD)	2 796.00	354 557.38	0.02
CHF UBS GROUP CHF0.10 (REGD)	147 073.00	2 094 080.38	0.11
CHF ZURICH INSURANCE GRP CHF0.10	6 198.00	2 525 618.25	0.13
スイス合計		47 610 309.13	2.44

## イギリス

GBP ADMIRAL GROUP ORD GBPO.001	3 781.00	144 216.33	0.01
GBP ANGLO AMERICAN USDO.54945	25 815.00	762 867.64	0.04
GBP ANTOFAGASTA ORD GBPO.05	7 805.00	130 615.52	0.01
GBP ASHTEAD GROUP ORD GBPO.10	9 335.00	396 438.22	0.02
GBP ASSOC BRIT FOODS ORD GBPO.0568	7 045.00	198 454.51	0.01
GBP AUTO TRADER GROUP ORD GBPO.01	18 907.00	141 505.47	0.01
GBP BARCLAYS ORD GBPO.25	359 951.00	646 631.56	0.03
GBP BERKELEY GP HLDGS ORD GBPO.05	2 866.00	176 925.95	0.01
GBP BP ORD USDO.25	424 159.00	1 402 376.25	0.07
GBP BURBERRY GROUP ORD GBPO.0005	8 275.00	191 011.94	0.01
GBP COMPASS GROUP ORD GBPO.1105	37 530.00	663 382.61	0.03
GBP CRODA INTL ORD GBPO.10609756	2 633.00	209 364.52	0.01
GBP DIAGEO ORD GBPO.28 101/108	48 889.00	1 879 754.67	0.10
GBP DIRECT LINE INSURA ORD GBP 0.109090909	24 839.00	98 091.14	0.00
GBP FERGUSON PLC (NEW) ORD GBPO.10	4 635.00	521 273.48	0.03
GBP GLAXOSMITHKLINE ORD GBPO.25	105 181.00	1 923 779.95	0.10
GBP HARGREAVES LANSDOW ORD GBPO.004 (WI)	7 749.00	147 937.83	0.01
GBP HSBC HLDGS ORD USDO.50(UK REG)	426 607.00	2 211 245.56	0.11
GBP IMPERIAL BRANDS PL GBPO.10	18 969.00	344 667.31	0.02
GBP INTERCONTL HOTELS ORD GBPO.208521303	3 439.00	213 171.13	0.01
GBP INTERTEK GROUP ORD GBPO.01	3 339.00	246 155.96	0.01
GBP LEGAL & GENERAL GP ORD GBPO.025	118 491.00	399 749.70	0.02
GBP LONDON STOCK EXCH ORD GBPO.06918604	6 580.00	712 082.03	0.04
GBP M&G PLC ORD GBPO.05	54 664.00	136 835.95	0.01
GBP MONDI ORD EURO.20	10 191.00	225 579.10	0.01
GBP MORRISON(W)SUPRMKT ORD GBPO.10	55 984.00	134 422.47	0.01
GBP NATWEST GROUP PLC ORD GBP1	103 172.00	212 945.70	0.01
GBP NEXT ORD GBPO.10	2 779.00	243 086.01	0.01
GBP PEARSON ORD GBPO.25	15 473.00	133 652.27	0.01
GBP PERSIMMON ORD GBPO.10	6 271.00	222 362.94	0.01
GBP PHOENIX GP HLDGS ORD GBPO.10	1 876.00	17 952.64	0.00
GBP PRUDENTIAL ORD GBPO.05	54 480.00	850 618.56	0.04
GBP RIO TINTO ORD GBPO.10	23 492.00	1 516 087.16	0.08
GBP RSA INSURANCE GRP ORD GBP1.00	20 524.00	184 679.82	0.01
GBP SAINSBURY(J) ORD GBPO.28571428	35 662.00	100 505.87	0.01
GBP SCHRODERS VTG SHS GBP1	2 456.00	105 547.24	0.01
GBP SMITH & NEPHEW ORD USDO.20	18 290.00	354 306.12	0.02
GBP STANDARD CHARTERED ORD USDO.50	59 884.00	361 525.47	0.02
GBP STD LIFE ABERDEEN ORD GBPO.1396825396	48 130.00	174 069.39	0.01
GBP TAYLOR WIMPEY ORD GBPO.01	83 939.00	172 520.62	0.01
GBP TESCO ORD GBPO.05	202 729.00	614 383.11	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・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 UNILEVER PLC ORD GBPO.031111	24 505.00	1 495 420.95	0.08
EUR UNILEVER PLC ORD GBPO.031111	29 147.00	1 771 871.90	0.09
GBP VODAFONE GROUP ORD USDO.2095238(POST CONS)	559 736.00	924 230.39	0.05
イギリス合計		23 714 302.96	1.24
<b>アメリカ合衆国</b>			
CAD BAUSCH HEALTH COMP COM NPV	13 002.00	241 900.01	0.01
CAD BROOKFIELD RENEWA. CLASS A SUB VOTING SHARES	300.00	23 589.78	0.00
アメリカ合衆国合計		265 489.79	0.01
記名株式合計		221 967 499.20	11.40
<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	9 042.00	82 483.12	0.00
ルクセンブルグ合計		82 483.12	0.00
<b>オランダ</b>			
EUR ABN AMRO BANK N.V. DR EACH REP SHS	12 053.00	124 713.96	0.01
オランダ合計		124 713.96	0.01
預託証券合計		207 197.08	0.01
<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	41 150 000.00	63 901 835.00	3.28
アイルランド合計		63 901 835.00	3.28
投資信託証券合計		63 901 835.00	3.28
<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	7 748.00	104 869.14	0.01
カナダ合計		104 869.14	0.01
<b>イギリス</b>			
GBP SEGRO PLC REIT	25 897.00	315 312.96	0.02
イギリス合計		315 312.96	0.02
投資信託、クローズド・エンド型合計		420 182.10	0.03
<b>新株引受権</b>			
<b>イギリス</b>			
GBP AVEVA GROUP PLC RIGHTS 09.12.20	937.22	14 013.87	0.00
イギリス合計		14 013.87	0.00
新株引受権合計		14 013.87	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 (%)
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD 3M CO 2.25000% 16-19.09.26	1 500 000.00	1 616 468.10	0.08
USD ABU DHABI, GOVERNMENT OF-REG-S 3.12500% 17-11.10.27	2 675 000.00	2 998 507.81	0.15
USD ALBERTA, PROVINCE OF 3.30000% 18-15.03.28	3 600 000.00	4 160 520.00	0.21
USD ALPHABET INC 1.10000% 20-15.08.30	2 000 000.00	1 983 411.00	0.10
USD ALPHABET INC 1.99800% 16-15.08.26	2 075 000.00	2 223 196.09	0.11
USD AMERICAN EXPRESS CO 3.40000% 18-27.02.23	1 100 000.00	1 170 569.40	0.06
USD APPLE INC 1.65000% 20-11.05.30	3 470 000.00	3 589 025.86	0.18
USD APPLE INC 2.20000% 19-11.09.29	4 500 000.00	4 858 408.35	0.25
USD APPLE INC 2.40000% 13-03.05.23	1 000 000.00	1 049 795.40	0.05
USD APPLE INC 2.45000% 16-04.08.26	2 500 000.00	2 721 442.50	0.14
USD APPLE INC 2.85000% 16-23.02.23	150 000.00	157 838.52	0.01
USD APPLE INC 3.20000% 17-11.05.27	5 390 000.00	6 113 657.09	0.31
USD BANK OF NOVA SCOTIA 2.00000% 19-15.11.22	1 260 000.00	1 301 530.86	0.07
USD BAYER US FINANCE II LLC-REG-S 3.87500% 18-15.12.23	1 200 000.00	1 311 073.68	0.07
USD BERKSHIRE HATHAWAY FINANCE CORP 1.85000% 20-12.03.30	550 000.00	578 418.94	0.03
USD BERKSHIRE HATHAWAY INC 3.12500% 16-15.03.26	1 050 000.00	1 178 661.12	0.06
USD BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 1.75000% 19-27.09.24	700 000.00	736 353.17	0.04
USD CHEVRON CORP 2.23600% 20-11.05.30	2 076 000.00	2 231 838.05	0.11
USD CHEVRON CORP 3.19100% 13-24.06.23	725 000.00	773 026.39	0.04
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 3.90000% 18-16.03.28	1 600 000.00	1 896 656.00	0.10
USD CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 4.37500% 12-15.06.22	1 000 000.00	1 048 240.00	0.05
USD DEXIA CREDIT LOCAL SA-REG-S 2.50000% 18-25.01.21	1 050 000.00	1 053 391.50	0.05
USD EQUINOR ASA 2.37500% 20-22.05.30	1 300 000.00	1 388 291.32	0.07
USD EQUINOR ASA 3.62500% 18-10.09.28	4 000 000.00	4 674 098.40	0.24
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.37500% 17-24.05.27	4 000 000.00	4 428 001.60	0.23
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.87500% 20-17.05.30	8 350 000.00	8 313 177.59	0.43
USD EXPORT DEVELOPMENT CANADA 2.00000% 17-17.05.22	250 000.00	256 450.00	0.01
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 2.50000% 15-10.05.21	900 000.00	907 031.25	0.05
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 3.25000% 15-10.11.25	3 400 000.00	3 803 750.00	0.20
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 2.75000% 17-25.01.22	1 075 000.00	1 102 546.87	0.06
USD EXXON MOBIL CORP 3.04300% 16-01.03.26	2 425 000.00	2 682 082.49	0.14
USD EXXON MOBIL CORP 3.48200% 20-19.03.30	1 500 000.00	1 737 900.90	0.09
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.37500% 17-07.07.27	900 000.00	994 410.00	0.05
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.25000% 19-18.06.29	3 375 000.00	3 740 988.71	0.19
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.00000% 19-23.07.26	1 000 000.00	1 075 429.00	0.05
USD INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 2.85000% 19-13.05.22	1 000 000.00	1 037 420.60	0.05
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 1.75000% 19-23.10.29	1 600 000.00	1 713 072.00	0.09
USD JOHNSON & JOHNSON 1.30000% 20-01.09.30	2 000 000.00	2 007 969.00	0.10
USD JOHNSON & JOHNSON 2.45000% 16-01.03.26	4 425 000.00	4 817 504.14	0.25
USD JOHNSON & JOHNSON 2.90000% 17-15.01.28	1 000 000.00	1 126 739.80	0.06
USD JOHNSON & JOHNSON 3.37500% 13-05.12.23	1 000 000.00	1 091 971.00	0.06
USD KOREA DEVELOPMENT BANK 2.75000% 17-19.03.23	1 050 000.00	1 103 156.25	0.06
USD KOREA EAST-WEST POWER CO LTD-REG-S 3.87500% 18-19.07.23	1 030 000.00	1 117 550.00	0.06
USD KOREA HYDRO&NUCLEAR POWER CO LTD-REG-S 3.00000% 12-19.09.22	800 000.00	833 750.00	0.04
USD KOREA HYDRO&NUCLEAR POWER CO LTD-REG-S 3.12500% 17-25.07.27	2 950 000.00	3 273 578.12	0.17
USD KOREA SOUTH-EAST POWER CO LTD-REG-S 2.12500% 20-03.02.25	700 000.00	735 433.16	0.04
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.12500% 13-17.01.23	775 000.00	806 313.87	0.04
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.00000% 15-02.05.25	1 150 000.00	1 230 991.05	0.06
USD KUWAIT INTERNATIONAL GOVT BOND-REG-S 3.50000% 17-20.03.27	6 000 000.00	6 832 500.00	0.35
USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 2.00000% 15-13.01.25	3 875 000.00	4 123 838.95	0.21
USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 0.87500% 20-03.09.30	1 800 000.00	1 781 774.95	0.09
USD MICROSOFT CORP 2.65000% 15-03.11.22	1 500 000.00	1 563 443.55	0.08
USD MICROSOFT CORP 2.87500% 17-06.02.24	1 500 000.00	1 609 925.55	0.08
USD MICROSOFT CORP 3.30000% 17-06.02.27	6 250 000.00	7 137 956.25	0.37

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 NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD/NY 2.50000% 16-12.07.26	3 200 000.00	3 467 520.00	0.18
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 1.25000% 20-15.09.30	838 000.00	838 219.05	0.04
USD NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 3.00000% 18-10.01.28	1 700 000.00	1 896 102.48	0.10
USD NORDIC INVESTMENT BANK 2.25000% 14-30.09.21	500 000.00	508 354.20	0.03
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 2.40000% 12-21.09.22	750 000.00	777 051.83	0.04
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 3.10000% 17-17.05.27	2 310 000.00	2 602 926.25	0.13
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 2.20000% 20-14.08.30	1 830 000.00	1 977 647.15	0.10
USD QATAR, STATE OF-REG-S 2.37500% 16-02.06.21	1 050 000.00	1 056 562.50	0.05
USD QATAR, STATE OF-REG-S 3.37500% 19-14.03.24	1 600 000.00	1 727 500.00	0.09
USD QATAR, STATE OF-REG-S 4.00000% 19-14.03.29	1 750 000.00	2 067 187.50	0.11
USD QUEBEC, PROVINCE OF 2.50000% 16-20.04.26	4 450 000.00	4 856 993.00	0.25
USD ROCHE HOLDINGS INC-REG-S 3.62500% 18-17.09.28	3 000 000.00	3 552 955.50	0.18
USD SANOFI 4.00000% 11-29.03.21	1 100 000.00	1 113 735.59	0.06
USD SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 2.25000% 12-06.01.23	850 000.00	883 058.97	0.05
USD SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 1.87500% 16-10.05.21	450 000.00	453 180.47	0.02
USD SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 2.87500% 16-10.05.26	3 400 000.00	3 757 313.82	0.19
USD SINOPEC GROUP OVERSEAS DEV 2013-REG-S 4.37500% 13-17.10.23	675 000.00	736 681.50	0.04
USD STATE STREET CORP 2.40000% 20-24.01.30	785 000.00	861 822.93	0.04
USD TEMASEK FINANCIAL I LTD-REG-S 2.37500% 12-23.01.23	900 000.00	937 206.00	0.05
USD TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.70000% 13-15.01.24	900 000.00	987 112.53	0.05
USD TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.45500% 19-19.02.29	3 000 000.00	3 464 329.20	0.18
USD VISA INC 2.05000% 20-15.04.30	1 300 000.00	1 386 330.66	0.07
USD VISA INC 3.15000% 15-14.12.25	1 375 000.00	1 534 912.08	0.08
USD WALMART INC 2.55000% 13-11.04.23	1 425 000.00	1 492 473.89	0.08
USD WALMART INC 3.70000% 18-26.06.28	6 000 000.00	7 083 412.20	0.36
USD WESTPAC BANKING CORP 2.85000% 16-13.05.26	2 755 000.00	3 035 514.10	0.16
USD WESTPAC BANKING CORP 3.35000% 17-08.03.27	1 200 000.00	1 360 128.00	0.07
米ドル合計		178 217 307.60	9.14

## ノート、固定利付債合計

178 217 307.60 9.14

## 中期債券、固定利付債

## 米ドル

USD ABU DHABI, EMIRATE OF-REG-S 3.12500% 20-16.04.30	3 000 000.00	3 386 250.00	0.17
USD AFRICAN DEVELOPMENT BANK 2.37500% 14-23.09.21	750 000.00	763 146.38	0.04
USD ASB FINANCE LTD-REG-S 2.12500% 16-01.09.21	1 000 000.00	1 013 190.00	0.05
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.62500% 17-12.01.27	1 750 000.00	1 954 662.50	0.10
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.00000% 17-16.02.22	500 000.00	510 935.00	0.03
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.50000% 17-02.11.27	4 000 000.00	4 472 530.00	0.23
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.75000% 19-19.09.29	4 500 000.00	4 819 650.75	0.25
USD BANK OF MONTREAL 1.90000% 16-27.08.21	900 000.00	911 010.33	0.05
USD CAISSE D' AMOR DE LA DETTE SOCIALE-REG-S 3.37500% 14-20.03.24	850 000.00	933 915.40	0.05
USD CLIFFORD CAPITAL PTE LTD-REG-S 1.73300% 19-10.09.24	1 500 000.00	1 545 795.00	0.08
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 3.15000% 17-19.09.27	725 000.00	815 371.25	0.04
USD CPPIB CAPITAL INC-REG-S 2.75000% 17-02.11.27	3 025 000.00	3 417 031.53	0.19
USD IDB TRUST SERVICES LTD-REG-S 2.26100% 17-26.09.22	1 550 000.00	1 595 926.50	0.08
USD INTERNATIONAL FINANCE CORP 2.12500% 16-07.04.26	1 700 000.00	1 844 653.00	0.09
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 17-22.11.27	5 200 000.00	5 815 680.00	0.30
USD JAPAN TOBACCO INC-REG-S 2.80000% 16-13.04.26	1 800 000.00	1 948 068.00	0.10
USD KOMMUNEKREDIT-REG-S 1.62500% 16-01.06.21	350 000.00	352 427.60	0.02
USD KOREA DEVELOPMENT BANK 1.75000% 20-18.02.25	300 000.00	311 960.01	0.02
USD MACQUARIE GROUP LTD-REG-S 6.25000% 11-14.01.21	750 000.00	754 575.00	0.04
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 3.00000% 17-19.04.24	1 100 000.00	1 168 406.25	0.06
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 2.87500% 19-07.11.29	2 450 000.00	2 627 625.00	0.13
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 2.87500% 20-21.05.30	1 800 000.00	1 929 937.50	0.10
USD NEDERLANDSE WATERSCHAPS BK NV-REG-S 3.00000% 18-21.12.21	425 000.00	437 149.05	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・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 NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 1.87500% 16-09.03.21	1 000 000.00	1 003 342.00	0.05
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 2.37500% 17-18.01.22	875 000.00	894 531.75	0.04
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 3.12500% 18-22.03.23	1 370 000.00	1 453 509.72	0.07
USD NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CORP-REG-S 2.60000% 17-28.09.22	500 000.00	509 850.55	0.03
USD NORDRHEIN-WESTFALEN, STATE OF-REG-S 2.25000% 15-16.04.25	900 000.00	966 442.32	0.05
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 2.50000% 20-03.02.27	2 100 000.00	2 210 250.00	0.11
USD SP POWERASSETS LTD-REG-S 3.25000% 15-24.11.25	1 500 000.00	1 666 260.00	0.08
USD SUMITOMO MITSUI BANKING CORP-REG-S 2.44000% 19-18.06.24	801 000.00	851 039.91	0.04
USD SVENSK EXPORTKREDIT AB 1.75000% 16-10.03.21	550 000.00	552 305.49	0.03
USD TOYOTA MOTOR FINANCE NL BV-REG-S 2.76400% 19-26.04.21	700 000.00	706 539.82	0.04
米ドル合計		54 143 967.61	2.78

中期債券、固定利付債合計		54 143 967.61	2.78
--------------	--	---------------	------

## 債券、固定利付債

## 米ドル

USD BNG BANK NV-REG-S 2.62500% 14-28.04.21	550 000.00	555 184.57	0.03
USD BNG BANK NV-REG-S 2.37500% 16-16.03.26	1 800 000.00	1 965 384.00	0.10
USD CAISSE D' AMORTIS DE LA DETTE SOC-REG-S 1.87500% 15-12.02.22	600 000.00	611 578.80	0.03
USD CANADIAN IMPERIAL BANK OF COM/CAN-REG-S 2.35000% 17-27.07.22	1 075 000.00	1 109 448.70	0.06
USD CENTRAL JAPAN RAILWAY CO-REG-S 3.40000% 18-06.09.23	1 400 000.00	1 494 383.10	0.08
USD DBS BANK LTD-REG-S 3.30000% 18-27.11.21	500 000.00	514 460.25	0.02
USD DNB BOLIGKREDIT AS-REG-S 2.50000% 17-28.03.22	500 000.00	514 150.00	0.02
USD FAB SUKUK CO LTD-REG-S 3.87500% 19-22.01.24	1 600 000.00	1 725 500.00	0.09
USD FMS WERTMANAGEMENT 2.00000% 17-01.08.22	550 000.00	566 022.82	0.03
USD ING BANK NV-REG-S 2.62500% 12-05.12.22	400 000.00	417 941.24	0.02
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 14-25.11.24	800 000.00	867 616.00	0.04
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 15-29.07.25	3 350 000.00	3 663 660.50	0.19
USD KOREA GAS CORP-REG-S 2.87500% 19-16.07.29	1 000 000.00	1 104 687.50	0.06
USD KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 3.25000% 14-10.07.24	2 200 000.00	2 383 562.50	0.12
USD KOREA, REPUBLIC OF 3.87500% 13-11.09.23	1 400 000.00	1 528 187.50	0.08
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.50000% 14-20.11.24	1 225 000.00	1 329 487.85	0.07
USD NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S 1.70000% 20-13.02.23	1 284 000.00	1 319 468.96	0.07
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 3.40000% 14-06.05.24	1 000 000.00	1 097 283.00	0.05
USD OESTERREICHISCHE KONTROLLBANK AG 2.37500% 14-01.10.21	675 000.00	686 953.17	0.04
USD ONTARIO, PROVINCE OF 1.12500% 20-07.10.30	2 500 000.00	2 477 971.25	0.13
USD ONTARIO, PROVINCE OF 3.20000% 14-16.05.24	1 600 000.00	1 751 708.96	0.09
USD ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 3.35000% 18-22.10.21	950 000.00	975 564.50	0.05
USD SWEDBANK AB-REG-S 2.80000% 17-14.03.22	1 000 000.00	1 029 675.70	0.05
米ドル合計		29 689 880.87	1.52

債券、固定利付債合計		29 689 880.87	1.52
------------	--	---------------	------

## 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	62 000.00	71 452.58	0.00
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 15-31.01.22	5 000.00	5 080.28	0.00
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 17-15.02.27	5 000.00	5 530.66	0.00
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 13-15.05.23	5 000.00	5 193.55	0.00
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.62500% 20-15.05.30	9 501 000.00	9 339 186.09	0.48
米ドル合計		9 426 443.16	0.48

財務省証券(T-note)、固定利付債合計		9 426 443.16	0.48
-----------------------	--	--------------	------

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>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	3 590 000.00	8 112 986.20	0.42
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.375%/CPI LINKED 04-15.01.25	6 395 000.00	10 208 244.89	0.52
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.625%/CPI LINKED 16-15.01.26	5 230 000.00	6 301 612.19	0.32
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.125%/CPI LINKED 11-15.01.21	2 740 000.00	3 261 626.06	0.17
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI LINKED 17-15.01.27	6 165 000.00	7 303 779.40	0.38
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI INDEX 13-15.07.23	6 209 000.00	7 287 453.97	0.37
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI LINKED 15-15.07.25	7 845 000.00	9 331 139.03	0.48
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.750%/CPI LINKED 18-15.07.28	6 916 000.00	8 234 180.98	0.42
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 20-15.01.30	8 111 000.00	9 039 824.41	0.46
米ドル合計		69 080 847.13	3.54
<b>財務省証券(T-note)、変動利付債合計</b>		69 080 847.13	3.54
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		780 286 836.84	40.04
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>財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン</b>			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 23.04.20-22.04.21	2 050 000.00	2 049 262.14	0.10
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 13.08.20-11.02.21	2 050 000.00	2 049 661.75	0.11
米ドル合計		4 098 923.89	0.21
<b>財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン合計</b>		4 098 923.89	0.21
<b>ノート、固定利付債</b>			
米ドル			
USD ALTRIA GROUP INC 2.85000% 12-09.08.22	1 200 000.00	1 248 686.88	0.06
USD FANNIE MAE 2.12500% 16-24.04.26	2 500 000.00	2 716 170.00	0.14
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD NEW YORK 2.87500% 18-12.04.23	500 000.00	527 638.60	0.03
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-144A 3.50000% 17-10.01.27	1 500 000.00	1 705 440.00	0.09
USD PROCTER & GAMBLE CO 2.30000% 12-06.02.22	725 000.00	742 811.80	0.04
米ドル合計		6 940 747.28	0.36
<b>ノート、固定利付債合計</b>		6 940 747.28	0.36
<b>中期債券、固定利付債</b>			
米ドル			
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 3.85000% 14-08.07.24	1 000 000.00	1 100 994.90	0.06
USD GUARDIAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 2.00000% 16-26.04.21	1 000 000.00	1 006 912.70	0.05
米ドル合計		2 107 907.60	0.11
<b>中期債券、固定利付債合計</b>		2 107 907.60	0.11

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>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	1 908 000.00	1 675 152.14	0.08
米ドル合計		1 675 152.14	0.08
<b>中期債券、ゼロ・クーポン債合計</b>		1 675 152.14	0.08
<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	1 000 000.00	1 022 998.80	0.05
USD HSBC BANK CANADA-REG-S 1.65000% 19-10.09.22	750 000.00	766 788.75	0.04
米ドル合計		1 789 787.55	0.09
<b>債券、固定利付債合計</b>		1 789 787.55	0.09
<b>財務省証券(T-note)、変動利付債</b>			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 12-15.07.22	7 075 000.00	8 206 638.08	0.42
米ドル合計		8 206 638.08	0.42
<b>財務省証券(T-note)、変動利付債合計</b>		8 206 638.08	0.42
<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>		24 819 156.54	1.27
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>記名株式</b>			
アラブ首長国連邦			
GBP NMC HEALTH PLC ORD GBPO.1	3 082.00	0.04	0.00
アラブ首長国連邦合計		0.04	0.00
<b>記名株式合計</b>		0.04	0.00
<b>新株引受権</b>			
ドイツ			
EUR KION GROUP AG RIGHTS 03.12.20	1 810.00	0.00	0.00
ドイツ合計		0.00	0.00
<b>新株引受権合計</b>		0.00	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	1 685 408.62	0.09
USD US BANK NA/CINCINNATI OH 2.65000% 19-23.05.22	1 400 000.00	1 445 897.60	0.07
米ドル合計		3 131 306.22	0.16
<b>ノート、固定利付債合計</b>		3 131 306.22	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)

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	1 350 000.00	1 389 609.00	0.07
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 2.75000% 17-22.06.24	950 000.00	1 020 377.24	0.05
米ドル合計		2 409 986.24	0.12
<b>債券、固定利付債合計</b>			
		2 409 986.24	0.12
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			
		5 541 292.50	0.28
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>投資信託、オープン・エンド型</b>			
アイルランド			
USD MAN FUNDS VI PLC-MAN AHL TARGETRISK-INU-USD-CAP	261 251.83	35 305 571.63	1.81
USD SOURCE MARKETS PLC - MSCI USA SOURCE ETF-A	509 295.00	51 209 612.25	2.63
USD UBS (IRL) ETF PLC-MSCI USA UCITS-ACC-A-USD-ETF	7 061 473.00	142 994 828.25	7.34
USD UBS(IRL)FUND SOLUTION PLC-MSCI USA SF UCITS SHS-A-ETF-ACC	1 957 102.00	196 767 035.08	10.09
アイルランド合計		426 277 047.21	21.87
ルクセンブルグ			
EUR ALMA PLATINUM IV UBS MULTI-STRATEGY ALTERNATIVES-IOC-E-CAP	4 749.86	57 179 593.07	2.93
USD AQR UCITS FUNDS - GLOBAL RISK PARITY UCITS FUND-A2-CAP	202 975.00	25 379 994.00	1.30
USD INVESCO FUNDS SICAV BAL RISK ALLOCATION-PI1-USD HDG-CAP	1 509 872.25	19 084 785.23	0.98
USD UBS (LUX) BOND FUND-EURO HIGH YIELD (EUR)(USD HEDGED) F-ACC	392 137.00	47 260 351.24	2.43
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD (USD) F-ACC	205 724.00	70 059 308.20	3.60
USD UBS (LUX) BOND SICAV USD - INVEST GRADE CORP USD F ACC	2 487.00	292 128 344.86	14.99
USD UBS (LUX) BOND SICAV - EMERG ECON CORPORATES (USD) F-ACC	511 242.00	62 852 091.48	3.22
USD UBS (LUX) EMERGING ECONOMIES FUND - GLOBAL BONDS (USD) F-ACC	44 145.00	93 045 299.40	4.77
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD U-X-ACC	1.00	11 216.33	0.00
ルクセンブルグ合計		667 000 983.81	34.22
<b>投資信託、オープン・エンド型合計</b>			
		1 093 278 031.02	56.09
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			
		1 093 278 031.02	56.09
公認の証券取引所に上場されている派生商品			
<b>ワラント債</b>			
スイス			
CHF CIE FINANCIERE RICHEMO 67.00000 WARRANT 27.11.23	41 978.00	8 346.45	0.01
スイス合計		8 346.45	0.01
<b>ワラント債合計</b>			
		8 346.45	0.01
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計			
		8 346.45	0.01
<b>投資有価証券合計</b>			
		1 903 933 663.35	97.69

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>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 LONG BOND FUTURE 22.03.21	-34.00	-12 750.00 0.00
USD	US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.21	-292.00	-22 812.21 0.00
USD	US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.21	-855.00	-126 913.64 -0.01
USD	US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 22.03.21	-408.00	-255 000.00 -0.01
USD	US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 22.03.21	-367.00	-100 351.38 -0.01
<b>債券に係る金融先物合計</b>			<b>-517 827.23 -0.03</b>
<b>指数に係る金融先物</b>			
EUR	EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 18.12.20	451.00	232 828.37 0.01
CHF	SWISS MARKET INDEX FUTURE 18.12.20	39.00	3 567.88 0.00
GBP	FTSE 100 INDEX FUTURE 18.12.20	104.00	-44 256.91 0.00
SGD	MSCI SINGAPORE INDEX FUTURE 30.12.20	41.00	-23 718.00 0.00
USD	S&P500 EMINI FUTURE 18.12.20	966.00	2 607 535.00 0.13
HKD	HANG SENG INDEX FUTURE 30.12.20	16.00	-17 942.60 0.00
AUD	SPI 200 INDEX FUTURES 17.12.20	47.00	-28 202.93 0.00
CAD	S&P/TSX 60 INDEX FUTURE 17.12.20	30.00	26 498.96 0.00
USD	MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 18.12.20	1 266.00	2 568 625.00 0.13
JPY	TOPIX INDX FUTURE 10.12.20	103.00	-67 082.23 0.00
<b>指数に係る金融先物合計</b>			<b>5 257 852.54 0.27</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>4 740 025.31 0.24</b>
<b>派生商品合計</b>			<b>4 740 025.31 0.24</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・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 (%)		
先渡為替契約					
購入通貨 / 購入額 / 売却通貨 / 売却額 / 満期日(日-月-年)					
USD	8 757 768.60	GBP 6 760 000.00	8.1.2021	-272 869.13	-0.01
USD	33 891 869.83	CAD 44 650 000.00	8.1.2021	-573 645.14	-0.03
USD	1 085 347.96	AUD 1 540 000.00	8.1.2021	-49 865.33	0.00
USD	184 195.39	SGD 250 000.00	8.1.2021	-2 418.29	0.00
USD	9 241 662.11	JPY 974 500 000.00	8.1.2021	-112 199.77	0.00
USD	64 492.95	HKD 500 000.00	8.1.2021	-6.74	0.00
USD	124 981 272.80	EUR 105 920 461.98	8.1.2021	-1 883 597.69	-0.10
USD	36 854 779.37	CHF 33 410 000.00	8.1.2021	-107 839.61	0.00
EUR	700 000.00	USD 829 232.60	8.1.2021	9 183.39	0.00
JPY	50 000 000.00	USD 478 849.69	8.1.2021	1 081.65	0.00
CHF	500 000.00	USD 552 303.71	8.1.2021	863.29	0.00
EUR	2 500 000.00	USD 2 939 332.50	8.1.2021	55 010.33	0.00
GBP	550 000.00	USD 713 065.65	8.1.2021	21 675.59	0.00
CAD	1 500 000.00	USD 1 128 584.95	8.1.2021	29 271.10	0.00
EUR	3 500 000.00	USD 4 117 694.00	8.1.2021	74 385.97	0.00
CHF	1 000 000.00	USD 1 100 162.05	8.1.2021	6 171.95	0.00
JPY	100 000 000.00	USD 959 939.79	8.1.2021	-77.10	0.00
USD	2 132 517.78	EUR 1 800 000.00	8.1.2021	-23 409.06	0.00
USD	1 367 114.25	EUR 1 150 000.00	8.1.2021	-10 283.45	0.00
USD	5 855 378.76	EUR 4 950 000.00	8.1.2021	-73 420.05	0.00
USD	88 907 921.23	EUR 74 765 000.00	4.2.2021	-692 014.07	-0.03
USD	32 772 742.26	CAD 42 850 000.00	4.2.2021	-305 528.50	-0.02
USD	916 046.25	AUD 1 250 000.00	4.2.2021	-5 544.97	0.00
GBP	3 585 000.00	USD 4 744 259.94	4.2.2021	45 513.87	0.00
JPY	223 500 000.00	USD 2 145 823.85	4.2.2021	151.04	0.00
HKD	4 500 000.00	USD 580 510.93	4.2.2021	5.19	0.00
USD	186 052.47	SGD 250 000.00	4.2.2021	-568.73	0.00
USD	28 226 161.64	CHF 25 635 000.00	4.2.2021	-155 764.08	-0.01
EUR	2 000 000.00	USD 2 379 020.00	8.1.2021	16 454.27	0.00
EUR	2 000 000.00	USD 2 380 410.00	4.2.2021	16 431.71	0.00
GBP	1 000 000.00	USD 1 326 762.00	4.2.2021	9 297.64	0.00
GBP	1 000 000.00	USD 1 326 582.00	8.1.2021	9 311.16	0.00
CHF	2 000 000.00	USD 2 200 374.94	8.1.2021	12 293.06	0.00
CHF	2 000 000.00	USD 2 202 097.50	4.2.2021	12 213.07	0.00
CAD	2 500 000.00	USD 1 912 408.63	8.1.2021	17 351.45	0.00
CAD	2 500 000.00	USD 1 912 538.83	4.2.2021	17 348.61	0.00
JPY	225 000 000.00	USD 2 169 548.79	8.1.2021	-9 857.74	0.00
JPY	225 000 000.00	USD 2 170 247.74	4.2.2021	-9 870.33	0.00
USD	111 537.35	SGD 150 000.00	4.2.2021	-435.37	0.00
USD	111 531.05	SGD 150 000.00	8.1.2021	-437.16	0.00
EUR	1 000 000.00	USD 1 184 050.00	8.1.2021	13 687.13	0.00
EUR	1 000 000.00	USD 1 184 760.00	4.2.2021	13 660.86	0.00
USD	1 676 993.59	JPY 175 000 000.00	8.1.2021	-2 766.11	0.00
CAD	300 000.00	USD 229 131.50	8.1.2021	2 439.71	0.00
CAD	200 000.00	USD 152 765.47	4.2.2021	1 625.53	0.00
USD	1 677 555.92	JPY 175 000 000.00	4.2.2021	-2 737.62	0.00
USD	548 274.77	CHF 500 000.00	8.1.2021	-4 892.23	0.00
USD	548 696.85	CHF 500 000.00	4.2.2021	-4 880.79	0.00
USD	2 661 613.60	GBP 2 000 000.00	8.1.2021	-10 172.71	0.00
USD	2 661 941.80	GBP 2 000 000.00	4.2.2021	-10 177.48	0.00
AUD	64 417 400.00	USD 47 434 203.41	21.1.2021	54 946.55	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・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 (%)		
購入通貨 / 購入額 / 売却通貨 / 売却額 / 満期日(日-月-年)					
GBP	51 252 500.00	USD 68 575 127.47	21.1.2021	-103 155.44	0.00
SEK	88 768 800.00	USD 10 305 734.30	21.1.2021	88 608.94	0.00
CAD	44 645 700.00	USD 34 282 358.89	21.1.2021	180 932.00	0.01
CHF	253 852 900.00	USD 278 988 355.93	21.1.2021	1 958 081.76	0.10
SGD	74 334 400.00	USD 55 385 394.86	21.1.2021	102 945.20	0.01
EUR	261 954 200.00	USD 311 841 281.76	21.1.2021	1 997 200.57	0.10
USD	176 855.47	SGD 237 400.00	21.1.2021	-356.32	0.00
USD	864 300.00	EUR 726 647.53	21.1.2021	-6 271.87	0.00
USD	364 586.67	SGD 488 700.00	21.1.2021	-212.83	0.00
USD	293 504.61	AUD 399 200.00	21.1.2021	-789.61	0.00
USD	505 160.57	GBP 377 200.00	21.1.2021	1 231.44	0.00
CHF	6 437 900.00	USD 7 116 663.92	21.1.2021	8 348.52	0.00
EUR	6 683 500.00	USD 7 972 539.96	21.1.2021	34 735.73	0.00
CAD	1 236 100.00	USD 950 306.60	21.1.2021	3 874.29	0.00
AUD	1 765 600.00	USD 1 300 560.21	21.1.2021	1 057.73	0.00
SGD	2 052 600.00	USD 1 533 441.21	21.1.2021	-1 238.53	0.00
SEK	2 300 900.00	USD 270 231.60	21.1.2021	-808.74	0.00
GBP	1 361 300.00	USD 1 818 533.44	21.1.2021	127.03	0.00
HKD	2 955 000.00	USD 381 259.08	2.12.2020	-91.71	0.00
USD	729 285.44	CHF 658 800.00	21.1.2021	172.19	0.00
USD	398 405.68	AUD 539 100.00	21.1.2021	975.78	0.00
先渡為替契約合計				380 461.00	0.02
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				49 724 547.75	2.55
当座借越およびその他の短期負債				-8 610.85	0.00
その他の資産および負債				-9 791 947.02	-0.50
純資産総額				1 948 978 139.54	100.00

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

2020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2020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	1,035,932.341 (391,916.191)	846,399.043 (106,727.690)	2,201,574.642 (526,750.185)
	クラスP - a c c 投資証券	183,344.198 (4,068.396)	250,605.725 (6,971.715)	525,054.800 (101,313.253)
フィクスト・インカム(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	90,329.795 (88,328.741)	191,120.200 (168,273.436)	264,338.603 (178,179.790)
	クラス(日本円・ヘッジ)P - a c c 投資証券	5,180.246 (90.047)	635,081.019 (635,081.019)	412,097.913 (402,503.798)
インカム(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	43,721.662 (0.000)	59,105.445 (0.000)	593,816.645 (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	619,184.749 (59,593.733)	941,893.029 (3,362.097)	2,953,855.829 (208,386.235)
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	720,455.168 (63,469.213)	1,748,561.458 (87,145.226)	4,758,079.585 (436,025.228)
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	284,436.663 (6,442.952)	609,482.852 (4,477.340)	1,150,682.575 (81,242.545)

(注) ( )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。

[次へ](#)

## (2) その他の訂正

(下線の部分は訂正部分を示します。)

## 第一部 証券情報

## 第1 外国投資証券(外国新投資口予約権証券及び外国投資法人債券を除く。)

## (10) 申込取扱場所

## &lt;訂正前&gt;

UBS証券株式会社 東京都千代田区大手町一丁目5番1号  
大手町ファーストスクエア イーストタワー  
電話番号 0120-073-533  
ホームページ・アドレス www.ubs.com/jp/ja

(以下「UBS証券」または「日本における販売会社」という。)

(注)日本の販売会社の本支店において申込みの取扱いを行う。

## &lt;訂正後&gt;

UBS証券株式会社 東京都千代田区大手町一丁目5番1号  
大手町ファーストスクエア イーストタワー(注2)  
電話番号 0120-073-533  
ホームページ・アドレス www.ubs.com/jp/ja

(以下「UBS証券」または「日本における販売会社」という。)

(注1)日本の販売会社の本支店において申込みの取扱いを行う。

(注2)2021年3月8日に、東京都千代田区丸の内一丁目4番1号 丸の内永楽ビルディングに変更する予定である。

## 第二部 ファンド情報

## 第1 ファンドの状況

## 6 手続等の概要

## 販売手続等

## &lt;訂正前&gt;

申込取扱場所(販売会社)/払込取扱場所

UBS証券株式会社 東京都千代田区大手町一丁目5番1号  
大手町ファーストスクエア イーストタワー

## &lt;訂正後&gt;

申込取扱場所(販売会社)/払込取扱場所

UBS証券株式会社 東京都千代田区大手町一丁目5番1号  
大手町ファーストスクエア イーストタワー(注)

(注)申込取扱場所(販売会社)については、2021年3月8日に、UBS証券株式会社 東京都千代田区丸の内一丁目4番1号 丸の内永楽ビルディングに変更する予定である。

(後略)