

【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7月30日

【発行者名】 フォーカス・シキャブ
(Focused SICAV)

【代表者の役職氏名】 チェアマン・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ
ロバート・スティンガー (Robert Sütinger)
メンバー・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ
トーマス・ローズ (Thomas Rose)

【本店の所在の場所】 ルクセンブルグ大公国、ルクセンブルグL - 2010、B.P.91、L - 1855、
J.F.ケネディ通り33A
(33A avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg, B.P.91, L-2010
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
弁護士 中 野 恵 太
弁護士 金 光 由 以
弁護士 満 木 瑛 子

【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】
フォーカス・シキャブ
- USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル
クラスF - acc投資証券
- ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル
クラスF - acc投資証券
(Focused SICAV
- US Corporate Bond Sustainable USD Class F-acc
- World Bank Long Term Bond USD Class F-acc)

【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
USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル
クラスF - acc投資証券
ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル
クラスF - acc投資証券
上限見込額は以下のとおりである。

USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル

クラスF - acc投資証券：12億1,030万米ドル(約1,340億円)

ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル

クラスF - acc投資証券：11億7,530万米ドル(約1,301億円)

(注1) 上限見込額は、便宜上、USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル - クラスF - acc投資証券およびワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル - クラスF - acc投資証券の2021年2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(USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル - クラスF - acc投資証券については121.03米ドル(約13,399円)に1,000万口を、ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル - クラスF - acc投資証券については117.53米ドル(約13,012円)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、2021年3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=110.71円)による。

【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、2021年5月14日に提出した有価証券届出書（以下「原届出書」という。）の関係情報を新たな情報により更新および追加し、またファンドの代行協会および日本における販売会社であるUBS証券株式会社のウェルス・マネジメント本部の事業が会社分割され、2021年8月10日からは分割先であるUBS Sumi TRUSTウェルス・マネジメント株式会社が承継した業務を開始する予定のため、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外貨数字の円換算については、直近の為替レートを用いておりますので、訂正前の換算レートとは異なっております。

2【訂正の内容】

(1) 半期報告書に係る訂正

半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正内容は、下記のとおりです。

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

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

半期報告書の記載内容は以下のとおりです。

[次へ](#)

1 外国投資法人の概況

フォーカス・シキャブ（以下、フォーカス・シキャブを「本投資法人」、フォーカス・シキャブ - USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドルおよびフォーカス・シキャブ - ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドルを個別にまたは総称して「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F - acc投資証券以外の投資証券も存在するが、その他の投資証券は日本で販売されていないため、以下、ファンドについて「投資証券」というときは、上記のクラスF - acc投資証券を指すものとする。

(1) 主要な経営指標等の推移

（フォーカス・シキャブ - USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル）

（別段の記載がない限り金額は米ドル表示）

	2019年4月末日 に終了する 中間会計年度末	2019年10月末日 に終了する 会計年度末	2020年4月末日 に終了する 中間会計年度末	2020年10月末日 に終了する 会計年度末	2021年4月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	15,349,087.75	42,123,549.03	18,136,746.42	147,650,129.83	29,741,342.69
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	15,349,087.75	42,123,549.03	18,136,746.42	147,650,129.83	29,741,342.69
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	15,349,087.75	42,123,549.03	18,136,746.42	147,650,129.83	29,741,342.69
(d) 出資総額 ⁽²⁾	462,289,717.53	627,370,969.98	1,332,302,150.40	2,151,129,465.23	3,470,399,321.49
(e) 発行済投資口総数 (クラスF - acc投資証券)	1,657,779.000口	2,038,153.194口	4,061,303.295口	5,969,794.677口	10,359,913.296口
(f) 純資産額	462,289,717.53	627,370,969.98	1,332,302,150.40	2,151,129,465.23	3,470,399,321.49
(g) 資産総額	546,954,057.32	631,389,395.00	1,343,737,796.68	2,173,103,855.11	3,472,122,208.94
(h) 1口当たり純資産価格 (クラスF - acc投資証券)	107.10	112.41	115.23	120.59	120.71
(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F - acc投資証券)	5.16	9.14	2.02	5.17	- 0.27
(j) 分配総額	914,853.29	914,853.29	854,337.29	854,337.29	5,045,190.18
(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	84.52%	99.36%	99.15%	98.99%	99.95%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾ (クラスF - acc投資証券)	6.13%	10.86%	7.59%	7.28%	4.76%

(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) フォーカス・シキャブ - USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドルは2016年11月8日に運用を開始し、クラスF - acc投資証券は2016年11月8日に運用が開始された。

(フォーカス・シキャブ - ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル)

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	2019年4月末日 に終了する 中間会計年度末	2019年10月末日 に終了する 会計年度末	2020年4月末日 に終了する 中間会計年度末	2020年10月末日 に終了する 会計年度末	2021年4月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	7,638,358.50	36,638,727.77	34,393,973.82	47,579,961.92	- 21,845,117.03
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	7,638,358.50	36,638,727.77	34,393,973.82	47,579,961.92	- 21,845,117.03
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	7,638,358.50	36,638,727.77	34,393,973.82	47,579,961.92	- 21,845,117.03
(d) 出資総額 ⁽²⁾	405,351,639.75	671,094,948.89	453,676,129.31	599,434,453.33	1,326,293,487.91
(e) 発行済投資口総数 (クラスF - acc投資証券)	1,015,523.000口	1,623,706.832口	1,181,880.187口	1,569,503.347口	3,560,728.837口
(f) 純資産額	405,351,639.75	671,094,948.89	453,676,129.31	599,434,453.33	1,326,293,487.91
(g) 資産総額	408,870,085.90	681,601,508.46	476,738,436.36	609,378,205.22	1,345,921,581.01
(h) 1口当たり純資産価格 (クラスF - acc投資証券)	105.77	112.51	121.01	120.82	116.56
(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F - acc投資証券)	3.82	7.18	10.68	7.66	- 2.65
(j) 分配総額	247,241.75	247,241.75	413,569.19	413,569.19	325,890.18
(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	99.14%	98.46%	95.16%	98.37%	98.54%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾ (クラスF - acc投資証券)	6.27%	12.74%	14.41%	7.39%	- 3.68%

(注) フォーカス・シキャブ - ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドルは2018年2月14日に運用を開始し、クラスF - acc投資証券は2018年2月14日に運用が開始された。

(2) 外国投資法人の出資総額

2021年5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、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）	
	千米ドル	百万円		
フォーカス・シキャブ - USコーポレート・ボンド・ サステナブル・米ドル	3,647,962.30	400,400	クラス F - acc投資証券	10,859,237.077
フォーカス・シキャブ - ワールドバンク・ロング・ ターム・ボンド・米ドル	1,389,408.19	152,501	クラス F - acc投資証券	3,722,504.997

(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) 役員状況

（2021年5月末日現在）

氏名	役職名	略歴	所有株式
ロバート・スティンガー (Robert Süttinger)	取締役会長	UBSアセット・マネジメント・ スイス・エイ・ジー（チューリッヒ） マネージング・ディレクター	該当なし
トーマス・ローズ (Thomas Rose)	取締役会役員 (メンバー・オブ・ ザ・ボード・オブ・ ディレクターズ)	UBSアセット・マネジメント・ スイス・エイ・ジー（チューリッヒ） マネージング・ディレクター	該当なし
ラファエル・シュミット - リヒター (Raphael Schmidt - Richter)	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

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の規定を満たす投資主総会は、いつでも、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および報酬を決定する。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各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。

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に管理するため要求される価額を下回った場合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会は、該当する投資証券クラスのすべての投資証券を評価日または決定が効力を生じる時間における純資産価額にて(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。

本投資法人の取締役会の権限にかかわらず、本投資法人の取締役会の提案に基づいて、サブ・ファンドの投資主総会で当該サブ・ファンドが発行した投資証券を消却して本投資法人の資本を減資し、投資主に対して保有する投資証券の純資産価額を返還することができる。かかる純資産価額は上記の決定を実施する日に計算し、サブ・ファンドの資産の処分によって実現した実際価格およびかかる処分に起因する費用を織り込むものとする。

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、「報告書を受領する権利」に記載されているとおり関係するサブ・ファンドの投資主に通知される。投資主に支払われていない解散された投資証券の買戻対価としての純資産価額相当額は、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。

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

UCITS」に移転する取引。

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

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

前項の本投資法人の取締役会の権限にかかわらず、上記のサブ・ファンドを合併する決定もまた、当該サブ・ファンドの投資主総会において採択することができる。

合併の決定は「報告書を受領する権利」に記載されている方法で投資主に通知する。決定が公告されてから30日以内に投資主は保有する投資証券の一部または全部を、前記「第2 手続等 2 買戻し手続等」と題する項に記載する所定の手続きに従って、買戻手数料またはその他の管理料金を支払わずに、その時点の純資産価額で買い戻す権限を有する。買戻しのために提出されなかった投資証券は、交換比率が計算される日に計算した関係するサブ・ファンドの純資産価額に基づいて交換される。集合的投資ファンド(契約型オープン投資信託)の受益証券を割り当てる場合、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、決定は総会に出席したまたは委任状により代表され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

本書提出日前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

(フォーカス・シキャブ - USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル)

(2021年5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	2,748,107,943.82	74.64
	イギリス	218,573,015.05	5.94
	オーストラリア	130,221,230.41	3.54
	カナダ	82,304,101.22	2.24
	オランダ	72,585,019.74	1.97
	日本	54,708,895.00	1.49
	ケイマン諸島	38,175,803.17	1.04
	フランス	36,551,210.18	0.99
	アイルランド	32,722,341.71	0.89
	バミューダ	23,095,170.00	0.63
	イタリア	13,162,839.89	0.36
	ノルウェー	11,510,915.74	0.31
	スイス	10,122,257.75	0.27
	フィンランド	5,475,000.00	0.15
	ジャージー	5,432,321.70	0.15
	メキシコ	5,191,562.50	0.14
	スペイン	2,148,820.94	0.06
	大韓民国	1,040,061.10	0.03
ポートフォリオ合計		3,491,128,509.92	94.82
現金・その他資産		190,706,524.85	5.18
資産総額		3,681,835,034.77	100.00
負債総額		33,872,732.54	0.92
合計(純資産総額)		3,647,962,302.23 (約400,400百万円)	99.08

(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。

(フォーカス・シキャブ - ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル)

(2021年5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	889,347,055.53	62.50
	国際機関	492,939,894.28	34.64
ポートフォリオ合計		1,382,286,949.81	97.14
現金・その他資産		40,754,781.16	2.86
資産総額		1,423,041,730.97	100.00
負債総額		33,633,544.13	2.36
合計(純資産総額)		1,389,408,186.84 (約152,501百万円)	97.64

(2) 運用実績

純資産等の推移

2021年5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。

(フォーカス・シキャブ - USコーポレート・ボンド・サステナブル・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F - acc投資証券)	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円
2020年6月末日	1,724,333.77	189,263	1,720,340.45	188,825	119.18	13,081
7月末日	1,900,361.69	208,584	1,894,504.77	207,941	121.07	13,289
8月末日	2,006,280.91	220,209	1,989,073.93	218,321	120.94	13,274
9月末日	2,033,221.59	223,166	2,028,088.68	222,603	120.63	13,240
10月末日	2,173,103.86	238,520	2,151,129.47	236,108	120.59	13,236
11月末日	2,450,524.66	268,970	2,437,035.76	267,489	122.06	13,397
12月末日	2,736,044.10	300,308	2,720,919.74	298,648	122.60	13,457
2021年1月末日	3,001,958.87	329,495	2,988,012.52	327,964	122.08	13,400
2月末日	3,059,142.18	335,771	3,046,560.21	334,390	121.03	13,284
3月末日	3,254,215.64	357,183	3,202,364.91	351,492	119.87	13,157
4月末日	3,472,122.21	381,100	3,470,399.32	380,911	120.71	13,249
5月末日	3,681,835.03	404,118	3,647,962.30	400,400	121.27	13,311

(注1) フォーカス・シキャブ - USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドルは2016年11月8日に運用を開始し、クラスF - acc投資証券は2016年11月8日に運用が開始された。以下同じ。

(注2) 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。

(フォーカス・シキャブ - ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル)

	資産総額		純資産総額		1口当たり 純資産価格 (クラスF - acc投資証券)	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円
2020年6月末日	449,492.02	49,336	448,078.75	49,181	121.48	13,334
7月末日	495,270.36	54,361	492,573.56	54,065	122.59	13,455
8月末日	532,137.00	58,407	529,746.67	58,145	121.97	13,387
9月末日	573,686.08	62,968	562,202.68	61,707	122.02	13,393
10月末日	609,378.21	66,885	599,434.45	65,794	120.82	13,261
11月末日	732,809.17	80,433	689,643.81	75,695	121.31	13,315
12月末日	815,243.44	89,481	798,672.53	87,662	121.14	13,296
2021年1月末日	894,927.62	98,227	883,873.59	97,014	120.06	13,178
2月末日	868,726.95	95,351	863,887.45	94,820	117.53	12,900
3月末日	1,238,278.62	135,913	1,212,787.99	133,116	115.48	12,675
4月末日	1,345,921.58	147,728	1,326,293.49	145,574	116.56	12,794
5月末日	1,423,041.73	156,193	1,389,408.19	152,501	117.10	12,853

(注) フォーカス・シキャブ - ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドルは2018年2月14日に運用を開始し、クラスF - acc投資証券は2018年2月14日に運用が開始された。以下同じ。

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

USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル - クラスF - acc投資証券	該当事項なし。
ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル - クラスF - acc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6月1日から2021年5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)	
	フォーカス・シキャブ - USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル	クラスF - acc投資証券
フォーカス・シキャブ - ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル	クラスF - acc投資証券	- 3.45

(注) 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$

a = 2021年5月末日現在の1口当たり純資産価格(当該期間の分配金の合計金額を加えた額)

b = 2020年5月末日現在の1口当たり純資産価格(分配落の額)

(3) 投資リスク

当中間計算期間において、2021年5月14日提出の有価証券届出書「第二部 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、本書提出日現在、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

2021年5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、2021年5月31日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1ユーロ=133.74円)による。

UBSアセット・マネジメント(アメリカス)インク(シカゴ)(「投資運用会社」)

資本金(株主資本)の額

2021年5月末日現在の資本金額は、179,589,267米ドル(約197億円)

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

2021年5月末日現在の株主資本総額は、500,000スイスフラン(約6,096万円)

(注)スイスフランの円貨換算は、便宜上、2021年5月31日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1スイスフラン=121.91円)による。

(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

(2021年5月末日現在)

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

UBSアセット・マネジメント(アメリカス)インク(シカゴ)

(2021年5月末日現在)

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

UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)

(2021年5月末日現在)

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

(3) 役員状況

UBSファンド・マネジメント(ルクセンブルグ)エス・エイ

(2021年5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(アメリカス)インク(シカゴ)

(2021年5月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有株式
ウィリアム・ジェイ・フェリ (William J. Ferri)	ディレクター/ ボード・メンバー	2017年2月28日就任	非公開

UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)

(2021年5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

(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。

2021年5月末日現在、管理会社は以下のとおり、410本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	364	536,180,282.75オーストラリア・ドル
			205,184,210.25カナダ・ドル
			14,908,122,000.98スイス・フラン
			14,252,894,554.53中国元
			580,095,743.13デンマーク・クローネ
			44,072,413,203.87ユーロ
			1,659,224,547.19英ポンド
			288,471,524.61香港ドル
			9,913,391,617.43日本円
			80,624,902.86シンガポール・ドル
			144,511,089,742.96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	46	484,384,429.78オーストラリア・ドル
			206,360,097.90スイス・フラン
			2,582,574,139.85ユーロ
			2,172,699,479.85英ポンド
			1,797,790,177.00日本円
			32,103,387,051.40米ドル

UBSアセット・マネジメント(アメリカス)インク(シカゴ)

2021年5月末日現在、UBSアセット・マネジメント(アメリカス)インク(シカゴ)は47本のサブ・ファンドを運用しており、そのうち運用資産額上位10位のサブ・ファンドは、以下のとおりである。

	名称	基本的性格	設定日	純資産総額 (ユーロ)
1	UBS(Lux)Real Estate Funds Selection - Global	変動資本を有する 投資法人	2008年4月24日	6,184,002,655.78
2	UBS(Lux)Equity Sicav - Long Term Themes(USD)	変動資本を有する 投資法人	2016年1月28日	4,370,792,662.44
3	Focused Sicav - US Corporate Bond Sustainable USD	変動資本を有する 投資法人	2016年11月7日	2,983,652,150.71
4	Focused Fund - Corporate Bond USD	契約型投資信託	2003年9月12日	2,218,385,541.24
5	UBS(Lux)Bond Sicav - USD Investment Grade Corporates(USD)	変動資本を有する 投資法人	2017年1月30日	1,891,199,507.61
6	UBS(Lux)Equity Sicav - USA Growth(USD)	変動資本を有する 投資法人	2004年10月13日	1,389,166,236.67
7	UBS(Lux)Key Selection Sicav - Digital Transformation Themes (USD)	変動資本を有する 投資法人	2020年4月3日	1,174,814,511.66
8	UBS(Lux)Bond Sicav - USD High Yield(USD)	変動資本を有する 投資法人	2015年6月8日	1,158,645,599.47
9	UBS(Lux)Emerging Economies Fund - Global Bonds(USD)	契約型投資信託	1998年3月20日	1,075,341,750.70
10	UBS(Lux)Equity Fund - Global Sustainable(USD)	契約型投資信託	1997年6月13日	1,068,392,384.44

(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。

UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)

2021年5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167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	5,290,607,121
2	UBS(Lux)Fund Solutions - MSCI EMU UCITS ETF	変動資本を有する 投資法人	2002年9月20日	3,659,589,526
3	UBS(Lux)Money Market Fund - USD	契約型投資信託	1988年11月29日	3,018,741,838
4	UBS(Lux)Institutional Fund - Equities Europe(ex UK ex Switzerland)Passive II	契約型投資信託	2020年5月13日	2,474,952,698
5	UBS(Lux)Fund Solutions - MSCI Switzerland 20/35 UCITS ETF	変動資本を有する 投資法人	2013年10月31日	1,623,451,039
6	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	1,579,185,440
7	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	1,578,560,746
8	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	1,574,452,906
9	UBS(Lux)Institutional Fund - Equities Europe(ex UK ex Switzerland)Passive	契約型投資信託	2020年5月29日	1,530,539,410
10	UBS(Lux)Fund Solutions - Bloomberg Barclays MSCI Euro Area Liquid Corporates Sustainable UCITS ETF	変動資本を有する 投資法人	2017年1月17日	1,516,268,556

(注1) 一単位当たり純資産価格は開示していない。

(注2) 上記は管理会社から提供された情報に基づく。

[次へ](#)

4 外国投資法人の経理状況

- a . ファンドの日本語の中間財務書類は、ルクセンブルグにおける法令に準拠して作成された原文の中間財務書類を翻訳したものである。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。
- b . ファンドの原文の中間財務書類は、フォーカス・シキャブおよび全てのサブ・ファンドにつき一括して作成されている。日本語の作成にあたっては、関係するサブ・ファンド(フォーカス・シキャブ-USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドルおよびフォーカス・シキャブ-ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル)に関連する部分のみを翻訳している。なお、USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドルおよびワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドルには以下に記載した投資証券以外の投資証券も存在するが、以下に記載した投資証券に関連する部分を抜粋して日本語に記載している。
- USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル クラスF - acc投資証券
ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル クラスF - acc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、2021年5月31日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=109.76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

フォーカス・シキャブ - USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル

純資産計算書

2021年4月30日現在

	2021年4月30日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	3,316,687,612.52	364,039,632
投資有価証券、未実現評価(損)益	30,798,343.24	3,380,426
投資有価証券合計(注1)	3,347,485,955.76	367,420,059
現金預金、要求払預金および預託金勘定	81,402,676.50	8,934,758
その他の流動資産(マージン)	290,188.00	31,851
有価証券売却未収金(注1)	59,805.95	6,564
発行未収金	16,613,444.21	1,823,492
有価証券に係る未収利息	24,133,882.27	2,648,935
金融先物に係る未実現利益(注1)	35,937.50	3,945
先渡為替契約に係る未実現利益(注1)	2,100,318.75	230,531
資産合計	3,472,122,208.94	381,100,134
負 債		
買戻未払金	(1,272,916.99)	(139,715)
報酬引当金(注2)	(345,361.63)	(37,907)
年次税引当金(注3)	(28,602.21)	(3,139)
その他の手数料および報酬引当金(注2)	(76,006.62)	(8,342)
引当金合計	(449,970.46)	(49,389)
負債合計	(1,722,887.45)	(189,104)
期末現在純資産	3,470,399,321.49	380,911,030

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル

純資産計算書

2021年4月30日現在

	2021年4月30日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	1,308,744,296.41	143,647,774
投資有価証券、未実現評価(損)益	(14,797,038.87)	(1,624,123)
投資有価証券合計(注1)	1,293,947,257.54	142,023,651
現金預金、要求払預金および預託金勘定	18,290,524.53	2,007,568
その他の流動資産(マージン)	3,623,310.63	397,695
有価証券売却未収金(注1)	7,380,541.33	810,088
発行未収金	3,955,653.11	434,172
有価証券に係る未収利息	17,893.36	1,964
その他の未収金	18,706,400.51	2,053,215
資産合計	1,345,921,581.01	147,728,353
負 債		
有価証券購入未払金(注1)	(18,987,146.94)	(2,084,029)
買戻未払金	(523,327.08)	(57,440)
報酬引当金(注2)	(89,606.69)	(9,835)
年次税引当金(注3)	(10,930.99)	(1,200)
その他の手数料および報酬引当金(注2)	(17,081.40)	(1,875)
引当金合計	(117,619.08)	(12,910)
負債合計	(19,628,093.10)	(2,154,379)
期末現在純資産	1,326,293,487.91	145,573,973

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル

運用計算書

自2020年11月1日 至2021年4月30日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
有価証券に係る利息	38,162,340.66	4,188,699
貸付証券に係る収益(注11)	84,159.12	9,237
その他の収益(注4)	758,013.85	83,200
収益合計	39,004,513.63	4,281,135
費 用		
報酬(注2)	(3,526,374.38)	(387,055)
年次税(注3)	(160,569.43)	(17,624)
貸付証券に係るコスト(注11)	(33,663.65)	(3,695)
その他の手数料および報酬(注2)	(88,745.18)	(9,741)
現金資産および当座借越に係る利息	(71,096.52)	(7,804)
費用合計	(3,880,449.16)	(425,918)
投資純(損)益	35,124,064.47	3,855,217
実現(損)益(注1)		
無オプション市場価格証券に係る実現(損)益	(1,066,090.41)	(117,014)
金融先物に係る実現(損)益	2,175,995.33	238,837
先渡為替契約に係る実現(損)益	5,819,525.49	638,751
為替差(損)益	8,555,188.56	939,017
実現(損)益合計	15,484,618.97	1,699,592
当期実現純(損)益	50,608,683.44	5,554,809
未実現評価(損)益の変動(注1)		
無オプション市場価格証券に係る未実現評価(損)益	(42,771,491.96)	(4,694,599)
金融先物に係る未実現評価(損)益	(423,437.50)	(46,477)
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	22,327,588.71	2,450,676
未実現評価(損)益の変動合計	(20,867,340.75)	(2,290,399)
運用の結果による純資産の純増(減)	29,741,342.69	3,264,410

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル

運用計算書

自2020年11月1日 至2021年4月30日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
有価証券に係る利息	6,659,647.02	730,963
貸付証券に係る収益(注11)	121,790.70	13,368
その他の収益(注4)	151,742.10	16,655
収益合計	6,933,179.82	760,986
費 用		
報酬(注2)	(761,843.65)	(83,620)
年次税(注3)	(56,949.24)	(6,251)
貸付証券に係るコスト(注11)	(48,716.28)	(5,347)
その他の手数料および報酬(注2)	(28,471.84)	(3,125)
現金資産および当座借越に係る利息	(877.21)	(96)
費用合計	(896,858.22)	(98,439)
投資純(損)益	6,036,321.60	662,547
実現(損)益(注1)		
無オプション市場価格証券に係る実現(損)益	3,027,334.21	332,280
金融先物に係る実現(損)益	(47,491.10)	(5,213)
先渡為替契約に係る実現(損)益	(22,228,626.25)	(2,439,814)
為替差(損)益	12,320,722.11	1,352,322
実現(損)益合計	(6,928,061.03)	(760,424)
当期実現純(損)益	(891,739.43)	(97,877)
未実現評価(損)益の変動(注1)		
無オプション市場価格証券に係る未実現評価(損)益	(40,073,330.36)	(4,398,449)
利回り評価証券および短期金融商品に係る未実現評価(損)益	16,075.65	1,764
金融先物に係る未実現評価(損)益	28,593.72	3,138
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	19,075,283.39	2,093,703
未実現評価(損)益の変動合計	(20,953,377.60)	(2,299,843)
運用の結果による純資産の純増(減)	(21,845,117.03)	(2,397,720)

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル

純資産変動計算書

	自2020年11月1日 至2021年4月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	2,151,129,465.23	236,107,970
発行額	1,558,540,490.02	171,065,404
買戻額	(263,966,786.27)	(28,972,994)
純発行(買戻)合計	1,294,573,703.75	142,092,410
支払分配金	(5,045,190.18)	(553,760)
投資純(損)益	35,124,064.47	3,855,217
実現(損)益合計	15,484,618.97	1,699,592
未実現評価(損)益の変動合計	(20,867,340.75)	(2,290,399)
運用の結果による純資産の純増(減)	29,741,342.69	3,264,410
期末現在純資産	3,470,399,321.49	380,911,030

発行済投資証券数の変動表

クラスF - acc	自2020年11月1日 至2021年4月30日	
	(口)	
期首現在発行済投資証券数	5,969,794.6770	
期中発行投資証券数	4,966,802.6190	
期中買戻投資証券数	(576,684.0000)	
期末現在発行済投資証券数	10,359,913.2960	

年次分配金¹

フォーカス・シキャブ - USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル	分配落ち日	支払日	通貨	1口当たり 分配金額
該当なし				

¹ 注記5を参照

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル

最重要数値

日付	ISIN	2021年4月30日	2020年10月31日	2019年10月31日
純資産額(米ドル)		3,470,399,321.49	2,151,129,465.23	627,370,969.98
クラスF - acc	LU1484152423			
発行済受益証券口数(口)		10,359,913.2960	5,969,794.6770	2,038,153.1940
1口当たり純資産価格(米ドル)		120.71	120.59	112.41
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) ¹		120.71	120.59	112.41

¹ 注記1を参照

組入証券の構造

地域別分布表	(純資産に対する百分率 %)
アメリカ合衆国	75.59
イギリス	6.33
オーストラリア	3.50
カナダ	2.47
オランダ	1.85
日本	1.57
アイルランド	1.15
ケイマン諸島	1.10
フランス	0.74
バミューダ	0.57
イタリア	0.41
ノルウェー	0.33
スイス	0.29
フィンランド	0.16
ガンジー	0.16
メキシコ	0.15
スペイン	0.06
大韓民国	0.03
合計	96.46

注記は当財務書類の一部である。

業種別分布表	(純資産に対する百分率 %)
銀行および金融機関	26.90
金融および持株会社	18.53
国債および中央政府債	6.75
通信	4.40
インターネット、ソフトウェア・ITサービス	4.29
医薬品・化粧品・医療品	4.08
コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置供給業	3.47
エネルギー・水道	2.80
交通・運輸	2.77
保険	2.06
ヘルスケア・社会福祉	2.05
電気装置・部品	1.85
小売り・百貨店	1.67
食品・清涼飲料	1.59
その他の消費財	1.54
機械工学・産業機器	1.37
建築業・資材	1.30
電子機器・半導体	1.20
グラフィックデザイン・出版・メディア	1.15
不動産	1.12
モーゲージおよび貸付機関	0.83
石油	0.67
その他のサービス業	0.64
バイオテクノロジー	0.63
農業・漁業	0.54
鉱業・石炭・鋼鉄	0.42
その他の商社	0.38
化学	0.37
非鉄金属	0.36
繊維・衣服・革製品	0.31
林業・紙・パルプ製品	0.20
自動車	0.12
梱包業	0.10
合計	96.46

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル

純資産変動計算書

	自2020年11月1日 至2021年4月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	599,434,453.33	65,793,926
発行額	875,694,801.65	96,116,261
買戻額	(126,664,759.86)	(13,902,724)
純発行(買戻)合計	749,030,041.79	82,213,537
支払分配金	(325,890.18)	(35,770)
投資純(損)益	6,036,321.60	662,547
実現(損)益合計	(6,928,061.03)	(760,424)
未実現評価(損)益の変動合計	(20,953,377.60)	(2,299,843)
運用の結果による純資産の純増(減)	(21,845,117.03)	(2,397,720)
期末現在純資産	1,326,293,487.91	145,573,973

発行済投資証券数の変動表

	自2020年11月1日 至2021年4月30日
クラスF - acc	(口)
期首現在発行済投資証券数	1,569,503.3470
期中発行投資証券数	2,321,157.3690
期中買戻投資証券数	(329,931.8790)
期末現在発行済投資証券数	3,560,728.8370

年次分配金¹

フォーカス・シキャブ - ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル	分配落ち日	支払日	通貨	1口当たり 分配金額
該当なし				

¹ 注記5を参照

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル

最重要数値

日付	ISIN	2021年4月30日	2020年10月31日	2019年10月31日
純資産額(米ドル)		1,326,293,487.91	599,434,453.33	671,094,948.89
クラスF - acc	LU1739535000			
発行済受益証券口数(口)		3,560,728.8370	1,569,503.3470	1,623,706.8320
1口当たり純資産価格(米ドル)		116.56	120.82	112.51
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) ¹		116.56	120.82	112.51

¹ 注記1を参照

組入証券の構造

地域別分布表	(純資産に対する百分率 %)
アメリカ合衆国	63.63
国際	33.93
合計	97.56

業種別分布表	(純資産に対する百分率 %)
国際機関	97.56
合計	97.56

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ
財務書類に対する注記
2021年4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、発行価格および買戻価格は、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(すなわち、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日および31日、ルクセンブルグの個々の法定外休日ならびにサブ・ファンドが投資する主要各国の取引所の休業日またはサブ・ファンドの投資対象の50%以上を適切に評価することができない日等を含まない。

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

単一の取引日におけるサブ・ファンドの投資証券クラスのすべてに影響する購入または買戻しの合計が純資本の流入または流出をもたらす場合、それぞれのサブ・ファンドの純資産価額がこれに応じて増加または減少することがある(いわゆるシングル・スイング・プライシング)。かかる調整は、最大で純資産価額の1%に相当する。サブ・ファンドが負担する取引費用および税金の見積額ならびにサブ・ファンドが投資する資産の評価スプレッドが考慮される。該当サブ・ファンドの投資証券口数が純増する場合、調整は純資産価額の増加を導く。投資証券口数が純減する場合、調整は純資産価額の減少となる。本投資法人の取締役会は、各サブ・ファンドに関して限界値を設定することができる。これは、ファンドの純資産価額または該当サブ・ファンドの通貨の絶対量に関して一取引日における純増/純減について設けられる。純資産価額は、当該限界値が取引日に越えられた場合にのみ、調整が行われる。

シングル・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シングル・スイング・プライシングの調整があった場合、サブ・ファンドの最重要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額を表す。

b) 評価原則

- 流動資産は、現金、預金、為替手形、要求払約束手形および売掛金、前払費用、現金配当金ならびに宣言済または発生済で未受領の利息、いずれの形においても全額で評価が行なわれる。ただし、かかる評価額が完全には支払われないまたは受領できない可能性のある場合には、その真正価額を表すために適切と思われる控除が考慮された上で、評価額が決定される。

- 証券取引所に上場されている証券、派生商品およびその他の投資対象は、その最終市場価格で評価される。これらの証券、派生商品もしくはその他の資産が複数の証券取引所に上場されている場合には、当該投資対象の主要市場である証券取引所における入手可能な最新の価格が適用される。

証券取引所における取引がごく僅かな証券、派生商品およびその他の資産で、証券トレーダー間に市場と一致する値付が行われる流通市場が存在する場合、本投資法人は証券、派生商品およびその他の投資対象をそれらの価格に基づき評価できる。証券取引所に上場されていないが、定期的に運営され、認知され、公開されている他の規制ある市場で取引されている証券、派生商品およびその他の投資対象商品は、当該市場における入手可能な最終価格で評価される。
- 証券取引所に上場されておらずまたは他の規制ある市場でも取引されていない、適正価格を入手することができない証券およびその他の投資対象は、本投資法人が誠実に選択するその他の原則に従って予想売買価格に基づき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（OTC派生商品）は、独立の値付機関に基づき評価される。派生商品に利用可能である独立の値付機関が1社のみの場合、得られた評価の妥当性は、派生商品が由来する対象商品の市場価格に基づき本投資法人および本投資法人の監査人が認めた計算方法によって検証される。
- 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（UCIs）の受益証券は、その最終純資産価額で評価される。特定のその他のUCITSおよび/またはUCIsの受益証券は、ポートフォリオ・マネージャーまたは投資顧問会社から独立した、信頼できるサービス・プロバイダーによって提供される見積評価額（価値評価）に基づいて評価される。
- 証券取引所または公開されている他の規制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2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、残余期間が最も近い金利が補間される。このように計算された金利は、裏付けとなる借手手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、借手手の信用格付に重大な変更がある場合には調整される。
- 注文日から決済日までの間にサブ・ファンドが得た利息収入は、関連するサブ・ファンドの資産の評価に含まれる。そのため、評価日における投資証券1口当たりの資産価格は、予定される利息収入を含む。
- 関連するサブ・ファンドの参照通貨以外の通貨で表示され、為替取引によるヘッジを行わない証券、短期金融商品、派生商品およびその他の投資対象は、ルクセンブルグにおける為替相場の仲値（売買相場の仲値）または、入手不能な場合は、当該通貨の最も代表的な市場におけるレートで評価される。
- 定期預金および信託投資資産は、額面価額に累積利息を付して評価される。
- スワップの価値は、外部のサービス提供会社によって計算され、また別の外部サービス提供会社による第二の独立した評価も利用される。かかる計算は、流入および流出の両方の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。特定の場合に、（ブルームバーグより入手可能なモデルと市場データに基づいた）内部での算出額、および/またはブローカー・ステイトメントの評価を利用することもできる。評価方法は、各有価証券によって異なり、適用されるUBS評価方針に従って決定される。

特別な状況に起因して、上記の規則による評価が実行不可能または不正確になった場合、本投資法人は、誠実に純資産額の適切な評価を遂行するために他の一般に認められておりかつ精査が可能な評価基準を用いる権限を付与されている。

これらの評価基準は、取引または価格設定モデルによる市場の相場、ならびにポートフォリオの評価時点でこれらの証券の公正価値を判断する際に信頼性があり、かつ適切であると取締役会が考えるブローカーの声明を含むその他のあらゆるソースに基づき、取締役会によって慎重に決定される。

特別な状況のもとで、さらなる評価は、当該日に限り行うことができる。これらの新評価は、爾後に発行もしくは買戻される投資証券について正式なものとなる。

c) 先渡為替契約の評価

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

d) 金融先物契約の評価

金融先物契約は、評価日に適用される直近の入手可能な公表価格に基づいて評価される。実現損益および未実現損益の変動は、運用計算書に記帳される。実現損益は、先入先出法に従って計算される。すなわち、最初の取得契約が最初に売却されるものと考えられる。

e) 証券売買実現純(損)益

証券売買実現損益は、売却証券の平均原価に基づいて計算される。

f) 外貨換算

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

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

g) 組入証券取引の会計処理

組入証券取引は、取引日の翌銀行営業日に会計処理される。

h) 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2021年4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以下の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、2021年4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	=	1.097926	スイスフラン
1 ユーロ	=	0.869452	英ポンド
1 ユーロ	=	1.203800	米ドル

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) モーゲージ関連証券 - TBA証券

TBAポジションは、モーゲージ・プール(ジニー・メイ、ファニー・メイまたはフレディ・マック)からの証券が、将来日において定められた価格で取得される場合のモーゲージ・バック証券市場に係る一般的な取引慣行に関連する。かかる証券の正確な構成については購入時点では知ることは出来ないが、その主な特性についてはすでに定義されている。現時点で価格も設定されているものの、額面価格についてはまだ明確に設定されていない。

TBAポジションは、純資産計算書の「投資有価証券、未実現評価(損)益」の項目に含まれる。投資有価証券その他の純資産明細表において、TBAポジションは、「モーゲージ関連証券、固定利付債」の投資有価証券として個別に開示されている。

これらのTBAポジションは、「TBAモーゲージ担保証券に係る未実現(損)益」に含まれる。2021年4月30日現在、TBAポジションの価格は、サブ・ファンドのフォーカス・シキャブ - グローバル・ボンドにおける20,553,229.50米ドルである。

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」という項目には、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」という項目には、外貨取引による未払金が含まれる。

外貨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、金利スワップシジ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。

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」の変動の項目に含まれる。

手じま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」に計上される。

注2 - 報酬

本投資法人は、サブ・ファンドの平均純資産額で計算される月次定率報酬を、名称に「F」が付く投資証券クラスのために支払う。

フォーカス・シキャブ - USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル

フォーカス・シキャブ - ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル

名称に「F」が付く投資証券クラス	上限定率報酬	名称に「ヘッジ」が付く投資証券クラス の上限定率報酬
		2.000%

フォーカス・シキャブ	実効定率報酬	
	2020年10月31日	2021年4月30日
- USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル クラスF - acc	0.24%	0.24%
- ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル クラスF - acc	0.16%	0.16%

定率報酬は、当会計年度中に変更された。詳細については、上記の表を参照のこと。

上限定率報酬は、下記のように使用される。

1. 本投資法人の運用、管理事務、ポートフォリオ管理および販売に関して(該当する場合)、また保管受託銀行のすべての職務(本投資法人の資産の保管および監督、支払取引の取扱いならびに販売目論見書の「保管受託銀行および主たる支払代理人」の項に記載されているその他一切の職務等)に関して、管理会社は、本投資法人の資産から、本投資法人の純資産価額に基づく上限定率報酬を受領する。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(上限定率料率)。

当該報酬は、運用計算書において「報酬」として開示される。

2. 上限定率報酬は、以下の報酬および本投資法人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および売呼値スプレッド、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、受益証券の発行および買戻しの決済に関する資産の売買によって生じるかかる追加の費用は、販売目論見書の「純資産価額、発行、買戻しおよび転換価格」の項に基づくシングル・スイング・プライシングの原理の適用によりカバーされる。
 - b) 本投資法人の設立、変更、清算および合併に関する監督官庁への費用ならびに監督官庁およびサブ・ファンドが上場されている証券取引所に関する一切の手数料。

- c) 本投資法人の設立、変更、清算および合併に関する年次監査および認可に関する監査報酬ならびにファンドの管理事務に関して監査人が提供するサービスに関して監査法人に支払われ、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、KIID、年次報告書および半期報告書ならびに居住国および販売が行われる国で法的に要求されるその他の一切の文書)。
- g) 外国の監督官庁への本投資法人の登録に関するコスト(該当する場合、手数料、翻訳コストおよび外国の代表者または支払代理人に対する報酬を含む)。
- h) 本投資法人による議決権または債権者の権利により生じた費用(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利用者の権利に関するコストおよび手数料。
- j) 管理会社、ポートフォリオ・マネジャーまたは保管受託銀行が投資者の利益の保護のために講じた特別措置に関して生じた一切の費用。
- k) 管理会社が投資者の利益につき集団訴訟に関与する場合、管理会社は、第三者に関して生じる費用(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、証明可能かつ開示されており、本投資法人の総費用比率(TER)の開示において考慮される。

当該手数料および報酬は、運用計算書において「その他の手数料および報酬」として開示される。

3. 管理会社は、本投資法人の販売業務をカバーするために手数料を支払うことができる。

販売報酬は、運用手数料から本投資法人の販売会社および資産運用会社に支払われる。

保管受託銀行、管理事務代行会社および本投資法人は、投資者の利益のためこれらが行う特別手配に係る費用の払戻しを受ける権利を有するが、かかる費用は本投資法人に対し直接請求されることもある。

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。

本投資法人はまた、本投資法人資産の管理事務に関連して生じる一切の取引費用(市場に沿ったブローカー手数料、報酬、税金等)も負担する。

本投資法人の収益および資産に対し課せられる一切の税金、特に年次税("taxe d'abonnement")(申込み税)は、これもまた本投資法人が負担する。

個々のサブ・ファンドに割当てられる費用はすべて、当該サブ・ファンドに請求される。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する場合には、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・ファンドの場合、当該対象ファンドおよびサブ・ファンドの両段階で支払いが生じる。

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することにより、管理会社または他の関連会社によって直接的もしくは間接的に運営されるファンドの受益証券に投資を行う場合、投資を行うサブ・ファンドは、対象ファンドの発行または買戻手数料を請求されることはない。

本投資法人の現行の手数料の詳細は、KIIDに記載されている。

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本投資法人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本投資法人の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・ファンドおよび/または投資証券クラスから分配金を支払うか否か、またどの程度の分配金を支払うかを決定する。本投資法人の純資産が法律に規定されている最低資産額を下回る場合には、分配金の支払いは行われず。分配が行われる場合、支払いは会計年度が終了してから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。

収入調整金は、分配金と実際に収入を受け取る権利が一致するように計算される。

注6 - ソフト・コミッション協定

2020年11月1日から2021年4月30日までの期間において、フォーカス・シキャブのために締結された「ソフト・コミッション協定」はなく、「ソフト・コミッション協定」の金額はゼロである。

注7 - 金融先物契約およびオプション

2021年4月30日現在、サブ・ファンドごとの金融先物契約およびオプション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

フォーカス・シキャブ	債券に係る金融先物 (購入)	債券に係る金融先物 (売却)
- USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル	- 米ドル	26,406,250.00米ドル
- ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル	該当なし	該当なし

フォーカス・シキャブ	指数に係る金融先物 (購入)	指数に係る金融先物 (売却)
- USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル	該当なし	該当なし
- ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル	該当なし	該当なし

債券または指数に係る金融先物契約(もしあれば)は、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

フォーカス・シキャブ	指数オプション従来型(売却)
- USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル	該当なし
- ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル	該当なし

注8 - 総費用比率(TER)

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

過去12ヶ月のTERは、以下のとおりである。

フォーカス・シキャブ	総費用比率(TER)
- USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル クラスF - acc	0.26%
- ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド クラスF - acc	0.18%

運用が12ヶ月未満の投資証券クラスのTERは、年率換算されている。

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、TERに含まれていない。

定率報酬は、当会計年度中に変更される場合がある（注2を参照のこと。）。

注9 - 制御不能な事象

2020年3月、世界保健機関は新型コロナウイルス感染症（COVID-19）の発生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や、本報告書で取り上げられる資産の評価に関して、継続的な不確実性を引き起こしている。

取締役会および投資運用会社は、政府によるパンデミックに対する措置、ひいてはポートフォリオおよび本投資法人自体への経済的影響について、引き続き注視する。本投資法人の財務書類を作成する際に取締役会が行った継続企業の前提が不適切であるという証拠はない。

注10 - 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、本投資法人およびカストディアン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/またはカストディアンは、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、管理会社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、管理会社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11 - 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。貸付証券の収益および費用は、運用計算書に別個に計上される。担保は、貸付証券に関連して受領される。担保は、一般的に借入れられた証券の少なくとも時価に相当する金額の高格付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、証券の貸付機関として行為する。

	2021年4月30日現在の貸付有価証券からの 取引相手方エクスポージャー		2021年4月30日現在の 担保の内訳（%）		
	貸付有価証券の時価	担保 (ユービーエス・スイス・ エイ・ジー)	株式	債券	現金
フォーカス・シキャブ					
- USコーポレート・ボンド・ サステナブル・米ドル	210,519,830.29 米ドル	226,348,182.53 米ドル	40.90	59.10	0.00
- ワールドバンク・ロング・ ターム・ボンド・米ドル	369,775,145.15 米ドル	397,577,425.05 米ドル	40.90	59.10	0.00

(2) 投資有価証券明細表等

フォーカス・シキャブ - USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル

2021年4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 / 先渡し替契約 / 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有価証券および短期金融商品			
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD 3M CO 2.00000% 19-14.02.25	5 000 000.00	5 204 718.65	0.15
USD ABBOTT LABORATORIES 3.75000% 16-30.11.26	5 749 000.00	6 501 595.66	0.19
USD ABBOTT LABORATORIES 3.87500% 17-15.09.25	1 000 000.00	1 117 232.27	0.03
USD ABBVIE INC 2.60000% 20-21.11.24	5 000 000.00	5 294 886.80	0.15
USD ABBVIE INC 2.95000% 20-21.11.26	5 929 000.00	6 349 614.52	0.18
USD ABBVIE INC 3.20000% 15-06.11.22	2 000 000.00	2 073 253.46	0.06
USD ABBVIE INC 3.20000% 16-14.05.26	7 000 000.00	7 587 176.45	0.22
USD ABBVIE INC 3.20000% 20-21.11.29	5 000 000.00	5 344 820.50	0.15
USD ABBVIE INC 3.60000% 15-14.05.25	3 000 000.00	3 279 440.70	0.09
USD ABBVIE INC 4.25000% 18-14.11.28	1 000 000.00	1 143 558.73	0.03
USD ADOBE INC 2.30000% 20-01.02.30	10 000 000.00	10 163 604.50	0.29
USD AERCAP IRE CAP LTD/GLB AVIA TRUST 3.50000% 17-26.05.22	3 800 000.00	3 896 860.60	0.11
USD AERCAP IRE CAP LTD/GLB AVIA TRUST 4.12500% 18-03.07.23	5 000 000.00	5 313 984.40	0.15
USD AERCAP IRE CAP LTD/GLB AVIA TRUST 4.50000% 20-15.09.23	5 870 000.00	6 321 825.52	0.18
USD AERCAP IRELAND CAP/ GLBL AVIATION TRUST 6.50000% 20-15.07.25	8 250 000.00	9 709 780.99	0.28
USD AIR LEASE CORP 3.87500% 18-03.07.23	10 641 000.00	11 341 060.97	0.33
USD AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC 1.85000% 20-15.05.27	6 721 000.00	6 863 859.16	0.20
USD ALLY FINANCIAL INC 5.12500% 14-30.09.24	2 878 000.00	3 263 668.14	0.09
USD ALLY FINANCIAL INC 5.80000% 20-01.05.25	3 000 000.00	3 502 698.66	0.10
USD ALPHABET INC 0.45000% 20-15.08.25	5 000 000.00	4 959 498.55	0.14
USD ALPHABET INC 0.80000% 20-15.08.27	15 000 000.00	14 534 630.70	0.42
USD AMAZON.COM INC 1.20000% 20-03.06.27	7 500 000.00	7 448 966.70	0.21
USD AMAZON.COM INC 2.80000% 18-22.08.24	1 000 000.00	1 072 474.31	0.03
USD AMERICA MOVIL SAB DE CV 2.87500% 20-07.05.30	5 000 000.00	5 167 850.00	0.15
USD AMERICAN EXPRESS CO 3.00000% 17-30.10.24	5 000 000.00	5 398 278.90	0.16
USD AMERICAN EXPRESS CO 3.70000% 18-03.08.23	5 000 000.00	5 360 095.35	0.15
USD AMERICAN EXPRESS CO 2.50000% 19-30.07.24	1 000 000.00	1 061 480.43	0.03
USD AMERICAN INTERNATIONAL GROUP 4.87500% 12-01.06.22	2 000 000.00	2 094 081.80	0.06
USD AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC 4.25000% 19-15.03.29	2 400 000.00	2 710 827.29	0.08
USD AMERICAN INTL GROUP INC 2.50000% 20-30.06.25	3 000 000.00	3 162 194.70	0.09
USD AMGEN INC 2.20000% 20-21.02.27	7 000 000.00	7 257 654.53	0.21
USD AMGEN INC 2.70000% 15-01.05.22	2 050 000.00	2 085 615.55	0.06
USD ANTHEM INC 1.50000% 21-15.03.26	7 000 000.00	7 062 339.76	0.20
USD ANZ NEW ZEALAND INT ' L LTD/LDN-144A 3.40000% 19-19.03.24	5 000 000.00	5 393 443.00	0.16
USD AON CORP 2.80000% 20-15.05.30	5 000 000.00	5 159 680.35	0.15
USD AON CORP 3.50000% 14-14.06.24	2 000 000.00	2 150 496.58	0.06
USD APPLE INC 0.70000% 21-08.02.26	5 000 000.00	4 938 404.46	0.14
USD APPLE INC 1.12500% 20-11.05.25	7 000 000.00	7 083 888.56	0.20
USD APPLE INC 1.20000% 21-08.02.28	5 000 000.00	4 867 023.34	0.14
USD APPLE INC 1.65000% 21-08.02.31	5 000 000.00	4 818 955.46	0.14
USD APPLE INC 1.80000% 19-11.09.24	5 000 000.00	5 207 372.55	0.15
USD APPLE INC 2.05000% 19-11.09.26	3 000 000.00	3 134 137.20	0.09
USD APPLE INC 2.45000% 16-04.08.26	6 806 000.00	7 247 218.34	0.21
USD APPLE INC 2.50000% 15-09.02.25	3 000 000.00	3 194 499.06	0.09
USD APPLE INC 2.85000% 17-11.05.24	2 000 000.00	2 132 243.20	0.06
USD APPLE INC 3.20000% 15-13.05.25	3 000 000.00	3 282 961.95	0.09
USD ASHTEAD CAPITAL INC-144A 4.25000% 19-01.11.29	14 225 000.00	15 220 750.00	0.44
USD ASTRAZENCA PLC 2.37500% 17-12.06.22	1 533 000.00	1 564 779.09	0.05

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD ASTRAZENECA PLC 3.12500% 17-12.06.27	2 000 000.00	2 175 233.72	0.06
USD ASTRAZENECA PLC 3.37500% 15-16.11.25	5 110 000.00	5 599 969.64	0.16
USD ASTRAZENECA PLC 3.50000% 18-17.08.23	3 000 000.00	3 195 048.72	0.09
USD AT&T INC 1.65000% 20-01.02.28	6 059 000.00	5 902 149.40	0.17
USD AT&T INC 2.75000% 20-01.06.31	12 000 000.00	11 982 613.68	0.35
USD AT&T INC 2.95000% 19-15.07.26	5 000 000.00	5 397 262.30	0.16
USD AT&T INC 3.87500% 19-15.01.26	2 000 000.00	2 229 452.52	0.06
USD AT&T INC 4.25000% 17-01.03.27	4 000 000.00	4 529 345.80	0.13
USD AT&T INC 4.30000% 18-15.02.30	6 000 000.00	6 768 948.72	0.20
USD AT&T INC 4.35000% 19-01.03.29	1 500 000.00	1 702 559.75	0.05
USD AUTODESK INC 2.85000% 20-15.01.30	9 385 000.00	9 793 501.93	0.28
USD AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD-144A 5.12500% 18-01.10.23	5 000 000.00	5 375 294.90	0.16
USD BANK OF AMERICA CORP 4.00000% 14-01.04.24	1 000 000.00	1 098 081.05	0.03
USD BANK OF NOVA SCOTIA 2.00000% 19-15.11.22	10 000 000.00	10 261 700.00	0.30
USD BARCLAYS PLC 3.20000% 16-10.08.21	5 380 000.00	5 422 125.40	0.16
USD BARCLAYS PLC 3.68400% 17-10.01.23	4 100 000.00	4 186 691.39	0.12
USD BECTON DICKINSON AND CO 3.36300% 17-06.06.24	2 000 000.00	2 154 091.56	0.06
USD BP CAPITAL MARKETS AMERICA INC 4.23400% 18-06.11.28	3 000 000.00	3 425 331.45	0.10
USD BP CAPITAL MARKETS AMERICA INC 2.93700% 20-06.04.23	1 500 000.00	1 572 288.03	0.05
USD BP CAPITAL MARKETS PLC 3.21600% 18-28.11.23	3 574 000.00	3 811 724.97	0.11
USD BP CAPITAL MARKETS PLC 2.52000% 18-19.09.22	5 881 000.00	6 047 726.35	0.17
USD BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 2.60000% 20-16.05.22	4 900 000.00	5 022 500.00	0.14
USD BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 2.90000% 20-26.07.24	6 876 000.00	7 368 388.02	0.21
USD BROADCOM CORP/CAYMAN FIN LTD 3.87500% 18-15.01.27	2 000 000.00	2 191 188.44	0.06
USD BROADCOM INC 4.15000% 20-15.11.30	7 000 000.00	7 651 845.88	0.22
USD BROADCOM INC 5.00000% 20-15.04.30	20 800 000.00	23 923 068.63	0.69
USD CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD 3.85000% 17-01.06.27	2 000 000.00	2 187 339.86	0.06
USD CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 3.30000% 17-30.10.24	6 000 000.00	6 492 080.46	0.19
USD CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 3.20000% 18-30.01.23	2 000 000.00	2 094 379.24	0.06
USD CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 3.65000% 20-11.05.27	5 000 000.00	5 535 231.35	0.16
USD CCO LLC/CAPITAL 2.30000% 20-01.02.32	8 000 000.00	7 499 971.84	0.22
USD CCO LLC/CAPITAL 4.90800% 16-23.07.25	13 000 000.00	14 783 902.51	0.43
USD CCO LLC/CAPITAL 5.05000% 19-30.03.29	1 000 000.00	1 158 609.29	0.03
USD CENTENE CORP 3.00000% 20-15.10.30	10 000 000.00	9 925 000.00	0.29
USD CENTERPOINT ENERGY INC 4.25000% 18-01.11.28	3 000 000.00	3 392 752.02	0.10
USD CENTURYLINK INC 6.75000% 13-01.12.23	7 500 000.00	8 278 125.00	0.24
USD CIGNA CORP 2.37500% 21-15.03.31	15 000 000.00	14 812 232.10	0.43
USD CIGNA CORP 2.40000% 20-15.03.30	5 500 000.00	5 503 481.94	0.16
USD CIGNA CORP 3.75000% 19-15.07.23	1 590 000.00	1 697 755.65	0.05
USD CIGNA CORP 4.12500% 19-15.11.25	7 000 000.00	7 869 118.81	0.23
USD CIT GROUP INC 5.00000% 13-01.08.23	5 000 000.00	5 431 250.00	0.16
USD CITIGROUP INC 3.30000% 15-27.04.25	1 591 000.00	1 730 832.40	0.05
USD CITIGROUP INC-SUB 4.45000% 15-29.09.27	4 750 000.00	5 395 933.16	0.16
USD CITIGROUP INC-SUB 5.50000% 13-13.09.25	2 500 000.00	2 927 885.77	0.08
USD CMS ENERGY CORP 2.95000% 16-15.02.27	2 000 000.00	2 117 970.50	0.06
USD COCA-COLA CO/THE 1.45000% 20-01.06.27	5 000 000.00	5 021 901.90	0.14
USD COCA-COLA CO/THE 1.65000% 20-01.06.30	3 000 000.00	2 881 814.58	0.08
USD COMCAST CORP 1.50000% 20-15.02.31	2 000 000.00	1 863 113.04	0.05
USD COMCAST CORP 3.15000% 16-01.03.26	3 000 000.00	3 274 537.71	0.09
USD COMCAST CORP 3.95000% 18-15.10.25	11 836 000.00	13 290 154.63	0.38
USD COMCAST CORP 4.15000% 18-15.10.28	5 000 000.00	5 751 765.00	0.17
USD CREDIT AGRICOLE SA-144A-SUB 4.37500% 15-17.03.25	3 000 000.00	3 298 420.59	0.10
USD CREDIT SUISSE AG/NEW YORK NY 0.49500% 21-02.02.24	5 000 000.00	4 960 638.90	0.14
USD CREDIT SUISSE GROUP AG 3.75000% 16-26.03.25	5 000 000.00	5 420 671.35	0.16
USD CVS HEALTH CORP 1.30000% 20-21.08.27	7 000 000.00	6 828 011.54	0.20
USD CVS HEALTH CORP 2.87500% 16-01.06.26	11 821 000.00	12 609 236.46	0.36
USD CVS HEALTH CORP 3.70000% 18-09.03.23	408 000.00	431 827.44	0.01
USD CVS HEALTH CORP 4.30000% 18-25.03.28	3 666 000.00	4 171 099.06	0.12
USD DANONE SA-144A 2.07770% 16-02.11.21	2 000 000.00	2 014 607.89	0.06
USD DANONE-144A 2.94700% 16-02.11.26	3 018 000.00	3 243 605.88	0.09
USD DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC 3.62500% 20-15.05.30	5 000 000.00	5 350 840.95	0.15
USD DUPONT DE NEMOURS INC 4.20500% 18-15.11.23	10 000 000.00	10 845 260.00	0.31
USD DUPONT DE NEMOURS INC 2.16900% 20-01.05.23	3 936 000.00	3 950 465.62	0.11
USD EMERSON ELECTRIC CO 1.80000% 20-15.10.27	7 000 000.00	7 113 404.13	0.20

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD ENBRIDGE INC 3.12500% 19-15.11.29	6 830 000.00	7 166 598.45	0.21
USD ENI SPA-144A 4.75000% 18-12.09.28	850 000.00	982 900.31	0.03
USD ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC 3.12500% 19-31.07.29	2 000 000.00	2 117 855.82	0.06
USD EPR PROPERTIES 4.95000% 18-15.04.28	8 250 000.00	8 623 498.86	0.25
USD EQT CORP 3.90000% 17-01.10.27	5 000 000.00	5 212 950.00	0.15
USD EQUINIX INC 1.80000% 20-15.07.27	5 200 000.00	5 155 488.26	0.15
USD EQUINIX INC 2.62500% 19-18.11.24	12 000 000.00	12 647 146.92	0.36
USD EQUINIX INC 3.20000% 19-18.11.29	3 915 000.00	4 130 434.11	0.12
USD ESTEE LAUDER COS INC 2.60000% 20-15.04.30	6 150 000.00	6 387 430.96	0.18
USD FEDEX CORP 3.10000% 19-05.08.29	3 000 000.00	3 196 287.51	0.09
USD FIFTH THIRD BANK 1.80000% 20-30.01.23	3 000 000.00	3 073 539.30	0.09
USD FISERV INC 2.25000% 20-01.06.27	10 000 000.00	10 329 124.10	0.30
USD FISERV INC 3.50000% 19-01.07.29	5 000 000.00	5 418 936.85	0.16
USD FORD MOTOR CREDIT CO 3.37500% 20-13.11.25	5 000 000.00	5 115 550.00	0.15
USD GE CAPITAL INTL FUNDING CO 3.37300% 16-15.11.25	500 000.00	544 506.12	0.02
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 5.25000% 16-01.03.26	1 000 000.00	1 152 189.72	0.03
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 3.50000% 17-07.11.24	10 000 000.00	10 757 159.50	0.31
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO 3.85000% 18-05.01.28	3 730 000.00	4 038 753.40	0.12
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO 4.35000% 18-09.04.25	5 000 000.00	5 541 797.20	0.16
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 5.10000% 19-17.01.24	3 000 000.00	3 318 120.00	0.10
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 3.55000% 19-08.07.22	2 000 000.00	2 068 096.02	0.06
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 2.90000% 20-26.02.25	7 000 000.00	7 393 105.58	0.21
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 5.20000% 20-20.03.23	5 250 000.00	5 686 177.56	0.16
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 2.70000% 20-20.08.27	5 000 000.00	5 148 166.55	0.15
USD GILEAD SCIENCES INC 3.50000% 14-01.02.25	2 000 000.00	2 175 883.30	0.06
USD GILEAD SCIENCES INC 2.95000% 16-01.03.27	2 000 000.00	2 146 383.64	0.06
USD GLAXOSMITHKLINE CAPITAL INC 3.37500% 18-15.05.23	3 000 000.00	3 183 558.72	0.09
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC-SUB 4.25000% 15-21.10.25	2 000 000.00	2 240 384.94	0.07
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.60000% 20-07.02.30	2 000 000.00	2 042 084.78	0.06
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.80000% 20-15.03.30	5 000 000.00	5 553 231.80	0.16
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 3.50000% 16-16.11.26	6 000 000.00	6 548 342.16	0.19
USD HCA INC 4.75000% 12-01.05.23	4 500 000.00	4 848 310.71	0.14
USD HCA INC 5.25000% 16-15.06.26	7 000 000.00	8 124 228.00	0.23
USD HCP INC 3.25000% 19-15.07.26	2 000 000.00	2 174 454.84	0.06
USD HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO STEP-UP/DOWN 16-15.10.22	5 000 000.00	5 249 525.75	0.15
USD HOME DEPOT INC 2.70000% 20-15.04.30	10 000 000.00	10 503 347.80	0.30
USD HOME DEPOT INC/THE 3.90000% 18-06.12.28	5 372 000.00	6 163 795.84	0.18
USD HSBC HOLDINGS PLC 3.60000% 16-25.05.23	2 650 000.00	2 822 069.14	0.08
USD HUMANA INC 4.87500% 20-01.04.30	5 100 000.00	6 039 443.14	0.17
USD INTEL CORP 2.45000% 19-15.11.29	7 000 000.00	7 211 046.29	0.21
USD INTEL CORP 3.75000% 20-25.03.27	3 500 000.00	3 930 792.18	0.11
USD INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC 2.10000% 20-15.06.30	6 948 000.00	6 778 400.01	0.20
USD INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 3.37500% 13-01.08.23	2 000 000.00	2 140 953.00	0.06
USD INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 3.45000% 16-19.02.26	3 000 000.00	3 305 181.99	0.10
USD INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 3.50000% 19-15.05.29	5 000 000.00	5 497 173.75	0.16
USD INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 1.70000% 20-15.05.27	3 000 000.00	3 035 086.41	0.09
USD JOHNSON & JOHNSON 0.95000% 20-01.09.27	10 000 000.00	9 767 405.20	0.28
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.20000% 13-25.01.23	2 000 000.00	2 098 992.44	0.06
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.20000% 16-15.06.26	5 234 000.00	5 684 652.42	0.16
USD KB HOME 7.62500% 15-15.05.23	7 500 000.00	8 156 250.00	0.24
USD KENNAMETAL INC 2.80000% 21-01.03.31	5 000 000.00	4 957 443.65	0.14
USD KIA MOTORS CORP-144A 3.00000% 17-25.04.23	1 000 000.00	1 041 090.30	0.03
USD KIMBERLY-CLARK CORP 1.05000% 20-15.09.27	7 000 000.00	6 842 578.75	0.20
USD KINDER MORGAN INC 4.30000% 18-01.03.28	2 500 000.00	2 814 755.17	0.08
USD KINROSS GOLD CORP 5.95000% 14-15.03.24	11 000 000.00	12 305 752.47	0.36
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 3.00000% 16-01.06.26	4 625 000.00	4 889 762.94	0.14
USD KROGER CO 2.20000% 20-01.05.30	2 000 000.00	1 980 241.14	0.06
USD KROGER CO 3.50000% 16-01.02.26	3 000 000.00	3 303 077.79	0.10
USD LENNAR CORP 4.50000% 17-30.04.24	1 200 000.00	1 312 200.00	0.04
USD LENNAR CORP 4.75000% 15-30.05.25	3 000 000.00	3 374 190.00	0.10
USD LENNAR CORP 4.75000% 18-29.11.27	9 000 000.00	10 413 720.00	0.30
USD LINCOLN NATIONAL CORP 3.35000% 15-09.03.25	2 000 000.00	2 175 333.98	0.06
USD LINCOLN NATIONAL CORP 3.80000% 18-01.03.28	2 000 000.00	2 221 627.96	0.06
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.45000% 18-08.05.25	7 500 000.00	8 420 129.18	0.24

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD LOWE ' S COS INC 1.30000% 20-15.04.28	6 429 000.00	6 164 441.95	0.18
USD LOWE ' S COS INC 4.50000% 20-15.04.30	5 000 000.00	5 828 436.55	0.17
USD LSEGA FINANCING PLC-144A 2.00000% 21-06.04.28	20 000 000.00	19 957 303.80	0.58
USD LSEGA FINANCING PLC-144A 2.50000% 21-06.04.31	15 000 000.00	14 968 081.35	0.43
USD MASCO CORP 1.50000% 21-15.02.28	7 000 000.00	6 770 503.53	0.20
USD MASCO CORP 2.00000% 20-01.10.30	5 800 000.00	5 586 809.35	0.16
USD MASTERCARD INC 2.00000% 19-03.03.25	5 500 000.00	5 749 476.75	0.17
USD MASTERCARD INC 2.95000% 16-21.11.26	3 000 000.00	3 254 005.77	0.09
USD MERCK & CO INC 1.45000% 20-24.06.30	6 800 000.00	6 468 421.94	0.19
USD METLIFE INC 3.60000% 15-13.11.25	2 000 000.00	2 209 638.22	0.06
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 3.85000% 16-01.03.26	1 000 000.00	1 113 964.40	0.03
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 3.45500% 18-02.03.23	1 000 000.00	1 054 384.30	0.03
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 3.76100% 18-26.07.23	9 500 000.00	10 170 995.45	0.29
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GRP INC 2.19300% 20-25.02.25	5 000 000.00	5 177 240.00	0.15
USD MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 2.60100% 17-11.09.22	1 500 000.00	1 543 830.45	0.04
USD MORGAN STANLEY 3.62500% 17-20.01.27	4 000 000.00	4 435 351.64	0.13
USD MORGAN STANLEY-SUB 4.87500% 12-01.11.22	3 000 000.00	3 195 564.03	0.09
USD MPLX LP 4.80000% 18-15.02.29	1 000 000.00	1 152 602.11	0.03
USD MPLX LP 4.87500% 16-01.06.25	500 000.00	563 760.10	0.02
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD/NY 2.50000% 16-12.07.26	2 000 000.00	2 125 386.00	0.06
USD NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-144A 0.55000% 21-22.01.24	8 000 000.00	7 977 099.52	0.23
USD NATWEST GROUP PLC 3.87500% 16-12.09.23	10 180 000.00	10 926 295.19	0.32
USD NATWEST GROUP PLC 4.80000% 16-05.04.26	1 000 000.00	1 143 772.55	0.03
USD NATWEST GROUP PLC-SUB 6.12500% 12-15.12.22	1 500 000.00	1 626 666.88	0.05
USD NETFLIX INC 4.87500% 18-15.04.28	10 000 000.00	11 512 500.00	0.33
USD NEWELL BRANDS INC 3.85000% 16-01.04.23	15 000 000.00	15 810 150.00	0.46
USD NIKE INC 2.85000% 20-27.03.30	10 000 000.00	10 647 122.10	0.31
USD NOKIA OYJ 4.37500% 17-12.06.27	5 000 000.00	5 465 625.00	0.16
USD NUCOR CORP 2.00000% 20-01.06.25	5 000 000.00	5 173 717.50	0.15
USD NVIDIA CORP 2.85000% 20-01.04.30	3 000 000.00	3 181 942.62	0.09
USD ORACLE CORP 2.30000% 21-25.03.28	7 000 000.00	7 109 909.80	0.21
USD ORACLE CORP 2.50000% 15-15.05.22	2 000 000.00	2 038 076.20	0.06
USD ORACLE CORP 2.50000% 20-01.04.25	9 000 000.00	9 463 716.54	0.27
USD ORACLE CORP 2.65000% 16-15.07.26	1 500 000.00	1 581 568.52	0.05
USD ORACLE CORP 2.80000% 20-01.04.27	1 400 000.00	1 484 072.76	0.04
USD ORACLE CORP 2.87500% 21-25.03.31	7 000 000.00	7 116 413.78	0.21
USD ORACLE CORP 3.25000% 17-15.11.27	6 500 000.00	7 049 048.17	0.20
USD PAYPAL HOLDINGS INC 1.35000% 20-01.06.23	7 000 000.00	7 128 762.69	0.21
USD PAYPAL HOLDINGS INC 2.30000% 20-01.06.30	4 000 000.00	4 034 860.04	0.12
USD PEPSICO INC 2.25000% 20-19.03.25	3 000 000.00	3 168 158.04	0.09
USD PEPSICO INC 2.85000% 16-24.02.26	7 000 000.00	7 575 298.57	0.22
USD PERRIGO FINANCE UNLIMITED CO 3.15000% 20-15.06.30	6 750 000.00	6 710 753.74	0.19
USD PFIZER INC 0.80000% 20-28.05.25	9 000 000.00	9 005 207.13	0.26
USD PNC BANK NATIONAL ASSOCIATION-SUB 4.20000% 13-01.11.25	2 000 000.00	2 267 815.70	0.07
USD PNC FINANCIAL SERVICES GROUP 2.20000% 19-01.11.24	3 000 000.00	3 167 528.07	0.09
USD PRINCIPAL FINANCIAL GROUP 3.10000% 16-15.11.26	5 000 000.00	5 406 649.85	0.16
USD PROCTER & GAMBLE CO 1.20000% 20-29.10.30	15 000 000.00	14 031 072.60	0.40
USD PUBLIC STORAGE 3.09400% 17-15.09.27	2 200 000.00	2 381 642.38	0.07
USD QUALCOMM INC 3.25000% 17-20.05.27	5 000 000.00	5 517 634.80	0.16
USD QUANTA SERVICES INC 2.90000% 20-01.10.30	15 750 000.00	16 176 421.17	0.47
USD ROPER TECHNOLOGIES INC 2.95000% 19-15.09.29	4 000 000.00	4 201 405.72	0.12
USD ROPER TECHNOLOGIES INC 2.00000% 20-30.06.30	3 900 000.00	3 756 721.68	0.11
USD ROPER TECHNOLOGIES INC 1.00000% 20-15.09.25	4 500 000.00	4 462 874.10	0.13
USD ROPER TECHNOLOGIES INC 1.40000% 20-15.09.27	10 000 000.00	9 762 306.80	0.28
USD SABINE PASS LIQUEFACTION LLC 5.75000% 14-15.05.24	3 500 000.00	3 951 165.96	0.11
USD SABINE PASS LIQUEFACTION LLC 5.00000% 17-15.03.27	2 000 000.00	2 299 194.38	0.07
USD SABINE PASS LIQUEFACTION LLC 5.87500% 17-30.06.26	3 000 000.00	3 551 895.54	0.10
USD SANTANDER UK PLC 2.10000% 20-13.01.23	3 153 000.00	3 244 091.49	0.09
USD SANTANDER UK PLC 4.00000% 14-13.03.24	2 000 000.00	2 194 719.40	0.06
USD SEALED AIR CORP-144A 5.12500% 14-01.12.24	1 165 000.00	1 268 393.75	0.04
USD SEMPRA ENERGY 3.25000% 17-15.06.27	10 550 000.00	11 406 869.31	0.33
USD SEMPRA ENERGY 3.55000% 14-15.06.24	9 717 000.00	10 470 330.54	0.30
USD SHERWIN-WILLIAMS CO 3.45000% 17-01.06.27	1 000 000.00	1 099 882.98	0.03
USD SOUTHWEST AIRLINES CO 2.75000% 17-16.11.22	1 000 000.00	1 026 738.73	0.03

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD SOUTHWEST AIRLINES CO 3.45000% 17-16.11.27	1 000 000.00	1 075 495.83	0.03
USD SOUTHWEST AIRLINES CO 2.62500% 20-10.02.30	12 000 000.00	12 096 986.88	0.35
USD SOUTHWEST AIRLINES CO 4.75000% 20-04.05.23	7 404 000.00	8 007 700.77	0.23
USD SOUTHWEST AIRLINES CO 5.25000% 20-04.05.25	5 000 000.00	5 727 088.00	0.17
USD STEEL DYNAMICS INC 2.40000% 20-15.06.25	3 000 000.00	3 138 497.19	0.09
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 3.78400% 16-09.03.26	5 000 000.00	5 538 072.50	0.16
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 2.84600% 17-11.01.22	1 000 000.00	1 017 986.90	0.03
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 2.69600% 19-16.07.24	2 000 000.00	2 113 539.00	0.06
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 2.44800% 19-27.09.24	10 000 000.00	10 501 039.00	0.30
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 2.34800% 20-15.01.25	5 000 000.00	5 212 875.00	0.15
USD SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 0.94800% 21-12.01.26	5 000 000.00	4 907 201.00	0.14
USD SUNCOR ENERGY INC 3.10000% 20-15.05.25	5 000 000.00	5 357 778.40	0.15
USD T-MOBILE USA INC 2.25000% 21-15.02.26	10 000 000.00	10 063 300.00	0.29
USD TARGET CORP 2.25000% 20-15.04.25	5 000 000.00	5 263 484.55	0.15
USD TELECOM ITALIA SPA-144A 5.30300% 14-30.05.24	7 500 000.00	8 191 500.00	0.24
USD TELEFONICA EMISIONES SA 4.57000% 13-27.04.23	2 000 000.00	2 154 088.90	0.06
USD THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 2.95000% 16-19.09.26	3 825 000.00	4 128 779.32	0.12
USD TIME WARNER CABLE LLC 4.00000% 11-01.09.21	1 980 000.00	1 985 445.00	0.06
USD TOLL BROTHERS FINANCE CORP 4.37500% 13-15.04.23	2 000 000.00	2 100 000.00	0.06
USD TOTAL CAPITAL CANADA LTD 2.75000% 13-15.07.23	2 093 000.00	2 201 558.43	0.06
USD TRANSCANADA PIPELINES LTD 2.50000% 12-01.08.22	1 815 000.00	1 864 222.02	0.05
USD TRANSCANADA PIPELINES LTD 4.10000% 20-15.04.30	5 368 000.00	6 025 594.34	0.17
USD TRUIST BANK 3.20000% 19-01.04.24	5 500 000.00	5 906 510.50	0.17
USD TRUIST BANK 4.05000% 18-03.11.25	5 000 000.00	5 639 363.65	0.16
USD UNION PACIFIC CORP 3.25000% 15-15.08.25	2 000 000.00	2 170 777.10	0.06
USD UNION PACIFIC CORP 3.50000% 18-08.06.23	2 000 000.00	2 123 418.66	0.06
USD UNITED PARCEL SERVICE INC 2.40000% 16-15.11.26	2 000 000.00	2 125 986.66	0.06
USD UNITED PARCEL SERVICE INC 2.50000% 19-01.09.29	2 000 000.00	2 064 096.62	0.06
USD UNITED RENTALS NORTH AMERICA INC 4.00000% 20-15.07.30	8 000 000.00	8 204 640.00	0.24
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 3.70000% 18-15.12.25	4 000 000.00	4 476 239.80	0.13
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 2.87500% 19-15.08.29	3 540 000.00	3 756 881.92	0.11
USD US BANCORP 3.37500% 19-05.02.24	2 000 000.00	2 157 205.16	0.06
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.62500% 16-15.08.26	23 000 000.00	24 458 111.68	0.71
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 4.12500% 17-16.03.27	750 000.00	855 327.98	0.02
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 4.32900% 18-21.09.28	3 921 000.00	4 520 402.25	0.13
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 4.01600% 19-03.12.29	2 000 000.00	2 261 719.94	0.07
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.10000% 21-22.03.28	5 000 000.00	5 045 391.45	0.15
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.55000% 21-21.03.31	10 000 000.00	10 023 735.50	0.29
USD VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC-144A 5.50000% 16-15.08.26	7 500 000.00	7 782 075.00	0.22
USD VISA INC 1.10000% 20-15.02.31	3 000 000.00	2 783 077.35	0.08
USD VISA INC 1.90000% 20-15.04.27	12 000 000.00	12 401 952.96	0.36
USD VMWARE INC 2.95000% 17-21.08.22	6 000 000.00	6 179 739.06	0.18
USD VMWARE INC 3.90000% 17-21.08.27	5 000 000.00	5 544 220.15	0.16
USD VODAFONE GROUP PLC 4.37500% 18-30.05.28	2 000 000.00	2 301 373.64	0.07
USD WALT DISNEY CO 1.75000% 19-30.08.24	5 000 000.00	5 173 963.95	0.15
USD WALT DISNEY CO 2.00000% 19-01.09.29	5 000 000.00	4 969 195.15	0.14
USD WESTPAC BANKING CORP 3.65000% 18-15.05.23	3 000 000.00	3 192 925.20	0.09
USD WESTPAC BANKING CORP 3.30000% 19-26.02.24	2 000 000.00	2 154 386.60	0.06
USD WESTPAC BANKING CORP 2.35000% 19-19.02.25	5 000 000.00	5 241 814.50	0.15
USD WESTPAC BANKING CORP 2.65000% 20-16.01.30	7 000 000.00	7 374 660.30	0.21
USD WEYERHAEUSER CO 4.00000% 20-15.04.30	3 500 000.00	3 927 809.20	0.11
USD WILLIAMS COS INC/THE 4.30000% 14-04.03.24	2 000 000.00	2 179 594.66	0.06
USD ZOETIS INC 2.00000% 20-15.05.30	10 000 000.00	9 704 699.50	0.28
米ドル合計		1 569 107 356.99	45.21
ノート、固定利付債合計		1 569 107 356.99	45.21
ノート、変動利付債			
米ドル			
USD BANK OF AMERICA CORP 3.366%/VAR 18-23.01.26	5 026 000.00	5 428 741.67	0.16
USD BANK OF AMERICA CORP 3.419%/VAR 18-20.12.28	12 000 000.00	12 996 853.92	0.37
USD BANK OF AMERICA CORP 3.550%/3M LIBOR+78BP 18-05.03.24	7 000 000.00	7 373 360.26	0.21
USD BANK OF AMERICA CORP 4.271%/VAR 18-23.07.29	5 500 000.00	6 243 912.34	0.18

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD BARCLAYS PLC 1.007%/VAR 20-10.12.24	13 000 000.00	13 021 065.98	0.38
USD BARCLAYS PLC 2.852%/VAR 20-07.05.26	8 500 000.00	8 950 762.73	0.26
USD BARCLAYS PLC 4.610%/VAR 18-15.02.23	8 173 000.00	8 427 670.68	0.24
USD CITIGROUP INC 1.122%/VAR 21-28.01.27	10 000 000.00	9 835 662.90	0.28
USD CITIGROUP INC 2.572%/VAR 20-03.06.31	5 000 000.00	5 017 855.45	0.14
USD CITIGROUP INC 2.666%/VAR 20-29.01.31	19 000 000.00	19 265 696.00	0.55
USD CITIGROUP INC 2.876%/VAR 17-24.07.23	3 000 000.00	3 088 669.47	0.09
USD CITIGROUP INC 3.142%/3M LIBOR+72.2BP 18-24.01.23	17 787 000.00	18 126 553.12	0.52
USD CITIGROUP INC 3.520%/VAR 17-27.10.28	7 000 000.00	7 612 732.75	0.22
USD CREDIT SUISSE GROUP AG -144A 1.305%/VAR 21-02.02.27	5 000 000.00	4 867 600.10	0.14
USD CREDIT SUISSE GROUP-144A 2.593%/VAR 19-11.09.25	5 000 000.00	5 201 444.90	0.15
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.908%/VAR 17-05.06.23	7 004 000.00	7 187 574.84	0.21
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.272%/VAR 17-29.09.25	5 000 000.00	5 370 535.85	0.15
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 1.992%/VAR 21-27.01.32	5 000 000.00	4 749 112.40	0.14
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 1.431%/VAR 21-09.03.27	5 000 000.00	4 980 476.45	0.14
USD HSBC HOLDINGS PLC 2.633%/VAR 19-07.11.25	5 000 000.00	5 239 204.80	0.15
USD HSBC HOLDINGS PLC 2.099%/VAR 20-04.06.26	8 000 000.00	8 183 881.12	0.24
USD HSBC HOLDINGS PLC 3.262%/VAR 17-13.03.23	5 000 000.00	5 119 165.95	0.15
USD HSBC HOLDINGS PLC 3.033%/3M LIBOR+92.3BP 17-22.11.23	4 000 000.00	4 155 723.56	0.12
USD HSBC HOLDINGS PLC 3.950%/VAR 18-18.05.24	7 000 000.00	7 468 003.34	0.21
USD HSBC HOLDINGS PLC 3.803%/VAR 19-11.03.25	8 325 000.00	8 976 009.59	0.26
USD HSBC HOLDINGS PLC 4.583%/VAR 18-19.06.29	2 000 000.00	2 271 759.70	0.07
USD JP MORGAN CHASE & CO 4.493%/VAR 20-24.03.31	10 000 000.00	11 590 165.20	0.33
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.782%/VAR 17-01.02.28	6 500 000.00	7 216 247.02	0.21
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.540%/VAR 17-01.05.28	4 186 000.00	4 580 991.17	0.13
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.509%/3M LIBOR+94.5BP 18-23.01.29	2 000 000.00	2 183 971.66	0.06
USD JPMORGAN CHASE & CO 4.452%/3M LIBOR+133BP 18-05.12.29	3 657 000.00	4 218 999.09	0.12
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.960%/3M LIBOR+124.5BP 19-29.01.27	4 000 000.00	4 446 235.60	0.13
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.207%/VAR 19-01.04.23	5 000 000.00	5 130 589.65	0.15
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.702%/VAR 19-06.05.30	10 000 000.00	11 001 894.80	0.32
USD JPMORGAN CHASE & CO 2.739%/VAR 19-15.10.30	5 000 000.00	5 129 542.10	0.15
USD JPMORGAN CHASE & CO 2.182%/VAR 20-01.06.28	9 000 000.00	9 189 102.78	0.26
USD JPMORGAN CHASE & CO 1.040%/VAR 21-04.02.27	27 500 000.00	26 980 287.95	0.78
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 2.956%/VAR 20-13.05.31	7 000 000.00	7 190 840.58	0.21
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 2.907%/3M LIBOR+81BP 17-07.11.23	7 289 000.00	7 548 887.69	0.22
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 2.438%/VAR 20-05.02.26	3 513 000.00	3 662 675.90	0.11
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 3.870%/VAR 20-09.07.25	6 619 000.00	7 197 079.56	0.21
USD MIZUHO FINANCIAL GROUP INC VAR 20-10.07.24	5 000 000.00	5 050 042.50	0.15
USD NATIONWIDE BUIL SOC-144A 3.766%/3M LIBOR+106.4BP 18-08.03.24	9 230 000.00	9 747 709.78	0.28
USD NATWEST GROUP PLC 4.892%/VAR 18-18.05.29	3 000 000.00	3 451 675.14	0.10
USD WELLS FARGO & CO 2.188%/VAR 20-30.04.26	18 500 000.00	19 167 990.79	0.55
米ドル合計		353 844 958.83	10.20

ノート、変動利付債合計	353 844 958.83	10.20
-------------	----------------	-------

メディアム・ターム・ノート、固定利付債

米ドル

USD AIR LEASE CORP 3.00000% 20-01.02.30	2 000 000.00	1 997 466.48	0.06
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 4.25000% 14-22.10.26	3 000 000.00	3 391 139.34	0.10
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 4.45000% 16-03.03.26	9 000 000.00	10 193 683.41	0.29
USD BANK OF AMERICA CORP 3.50000% 16-19.04.26	9 000 000.00	9 929 727.54	0.29
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 4.18300% 16-25.11.27	5 500 000.00	6 150 378.30	0.18
USD BANK OF MONTREAL 2.90000% 19-26.03.22	5 000 000.00	5 118 866.75	0.15
USD BANK OF MONTREAL 3.30000% 19-05.02.24	4 000 000.00	4 302 607.28	0.13
USD BANK OF NEW YORK CO 1.85000% 20-27.01.23	10 000 000.00	10 275 701.20	0.30
USD BANK OF NEW YORK MELLON CORP 2.95000% 18-29.01.23	2 100 000.00	2 192 259.01	0.06
USD BB&T CORP 2.85000% 17-26.10.24	2 000 000.00	2 144 922.42	0.06
USD CATERPILLAR FINANCIAL SERVICES CORP 2.85000% 19-17.05.24	4 000 000.00	4 278 942.68	0.12
USD CATERPILLAR FINANCIAL SERVICES CORP 2.40000% 17-06.06.22	3 000 000.00	3 071 653.17	0.09
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.38900% 16-08.01.26	5 000 000.00	5 337 500.00	0.15
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 4.00000% 14-03.03.24	3 000 000.00	3 278 054.28	0.10
USD JOHN DEERE CAPITAL CORP 2.80000% 17-08.09.27	2 000 000.00	2 156 287.48	0.06
USD JOHN DEERE CAPITAL CORP 1.50000% 21-06.03.28	35 000 000.00	34 474 678.70	0.99

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD MORGAN STANLEY-SUB 4.35000% 14-08.09.26	3 000 000.00	3 394 745.28	0.10
USD MORGAN STANLEY-SUB 4.10000% 13-22.05.23	6 800 000.00	7 275 865.97	0.21
USD ROYAL BANK OF CANADA 3.70000% 18-05.10.23	3 000 000.00	3 236 970.09	0.09
USD ROYAL BANK OF CANADA 2.55000% 19-16.07.24	5 000 000.00	5 294 353.25	0.15
USD ROYAL BANK OF CANADA 1.15000% 20-10.06.25	3 500 000.00	3 522 335.70	0.10
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 3.01000% 16-19.10.26	1 000 000.00	1 072 995.80	0.03
USD TORONTO-DOMINION BANK 3.25000% 19-11.03.24	7 800 000.00	8 390 396.04	0.24
USD US BANCORP-SUB 3.60000% 14-11.09.24	2 000 000.00	2 194 474.92	0.06
USD WELLS FARGO & CO 3.75000% 19-24.01.24	4 000 000.00	4 328 919.60	0.13
米ドル合計		147 004 924.69	4.24
ミディアム・ターム・ノート、固定利付債合計		147 004 924.69	4.24
ミディアム・ターム・ノート、変動利付債			
米ドル			
USD BANK OF AMERICA CORP 2.881%/VAR 17-24.04.23	1 475 000.00	1 509 791.21	0.04
USD BANK OF AMERICA CORP 3.458%/3M LIBOR+97BP 19-15.03.25	16 141 000.00	17 304 474.60	0.50
USD BANK OF AMERICA CORP 3.559%/VAR 19-23.04.27	8 679 000.00	9 518 484.52	0.27
USD BANK OF AMERICA CORP 3.194%/VAR 19-23.07.30	15 000 000.00	15 903 951.30	0.46
USD BANK OF AMERICA CORP 2.456%/VAR 19-22.10.25	5 000 000.00	5 249 387.05	0.15
USD BANK OF AMERICA CORP 2.496%/3M LIBOR+99BP 20-13.02.31	9 000 000.00	9 026 063.55	0.26
USD MORGAN STANLEY 0.864%/VAR 20-21.10.25	5 000 000.00	4 993 379.45	0.14
USD MORGAN STANLEY 1.794%/VAR 20-13.02.32	5 000 000.00	4 701 355.40	0.14
USD MORGAN STANLEY 2.188%/VAR 20-28.04.26	20 000 000.00	20 795 936.80	0.60
USD MORGAN STANLEY 3.622%/VAR 20-01.04.31	4 000 000.00	4 380 325.16	0.13
USD MORGAN STANLEY 3.772%/VAR 18-24.01.29	22 000 000.00	24 285 648.20	0.70
USD WELLS FARGO & CO 1.654%/VAR 20-02.06.24	19 885 000.00	20 330 177.82	0.59
USD WELLS FARGO & CO 2.393%/VAR 20-02.06.28 16	552 000.00	17 041 464.65	0.49
USD WELLS FARGO & CO 3.196%/3M LIBOR+117BP 19-17.06.27	10 000 000.00	10 787 880.50	0.31
米ドル合計		165 828 320.21	4.78
ミディアム・ターム・ノート、変動利付債合計		165 828 320.21	4.78
債券、固定利付債			
米ドル			
USD ALLSTATE CORP 3.28000% 16-15.12.26	3 167 000.00	3 492 475.38	0.10
USD ALLY FINANCIAL INC 4.62500% 15-19.05.22	1 000 000.00	1 042 100.35	0.03
USD BALL CORP 4.87500% 18-15.03.26	2 000 000.00	2 240 000.00	0.06
USD BRANCH BANKING & TRUST CO-SUB 3.80000% 14-30.10.26	2 305 000.00	2 570 662.66	0.07
USD CITIGROUP INC-SUB 4.30000% 14-20.11.26	3 000 000.00	3 376 908.33	0.10
USD CONSUMERS ENERGY CO 3.80000% 18-15.11.28	1 500 000.00	1 691 420.13	0.05
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 3.45000% 17-14.01.22	4 340 000.00	4 415 395.74	0.13
USD GILEAD SCIENCES INC 3.70000% 14-01.04.24	3 000 000.00	3 243 435.30	0.09
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 3.85000% 17-26.01.27	10 000 000.00	11 069 219.50	0.32
USD KEYBANK NA/CLEVELAND OH 6.50000% 15-22.05.22	3 000 000.00	3 087 184.95	0.09
USD MICROSOFT CORP 2.40000% 16-08.08.26	10 000 000.00	10 647 667.00	0.31
USD MIZUHO FINANCE GROUP CAYMAN 3-144A-SUB 4.60000% 14-27.03.24	8 200 000.00	8 963 793.42	0.26
USD NATIONAL RURAL UTILITIES COOP FIN CORP 3.05000% 17-25.04.27	2 000 000.00	2 149 347.22	0.06
USD NATIONAL RURAL UTILITIES COOP FIN CORP 3.90000% 18-01.11.28	2 000 000.00	2 258 772.32	0.07
USD NATL RURAL UTIL COOPERATIVE FIN CORP 3.70000% 19-15.03.29	5 000 000.00	5 508 326.55	0.16
USD NEXTERA ENERGY 2.75000% 20-01.05.25	11 700 000.00	12 474 228.43	0.36
USD SEAGATE HDD CAYMAN 4.87500% 15-01.06.27	1 629 000.00	1 812 343.95	0.05
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 3.75000% 15-15.07.25	1 000 000.00	1 113 649.97	0.03
USD WESTPAC BANKING CORP-144A 2.00000% 20-16.01.25	10 000 000.00	10 457 972.00	0.30
米ドル合計		91 614 903.20	2.64
債券、固定利付債合計		91 614 903.20	2.64

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
債券、変動利付債			
米ドル			
USD BP CAPITAL MARKETS PLC-SUB 4.375%/VAR 20-PRP	5 000 000.00	5 325 000.00	0.15
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 4.223%/VAR 18-01.05.29	10 500 000.00	11 869 592.07	0.34
USD WESTPAC BANKING CORP-SUB 4.322%/VAR 16-23.11.31	5 307 000.00	5 892 079.24	0.17
米ドル合計		23 086 671.31	0.66
債券、変動利付債合計		23 086 671.31	0.66
財務省証券(T-note)、固定利付債			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.12500% 20-15.12.23	235 000 000.00	234 137 108.21	6.75
米ドル合計		234 137 108.21	6.75
財務省証券(T-note)、固定利付債合計		234 137 108.21	6.75
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		2 584 624 243.44	74.48
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD AETNA INC 2.75000% 12-15.11.22	1 045 000.00	1 075 105.48	0.03
USD AKER BP ASA-144A 3.00000% 20-15.01.25	1 500 000.00	1 558 983.29	0.05
USD ALBERTSONS COS LLC / SAFEWAY INC-144A 3.50000% 20-15.02.23	15 020 000.00	15 433 050.00	0.44
USD AT&T INC 4.12500% 16-17.02.26	1 000 000.00	1 125 866.93	0.03
USD AXA EQUITABLE HOLDINGS INC 3.90000% 19-20.04.23	1 948 000.00	2 069 368.86	0.06
USD AXA EQUITABLE HOLDINGS INC 4.35000% 19-20.04.28	1 500 000.00	1 691 304.24	0.05
USD BRANCH BANKING & TRUST CO-SUB 3.62500% 15-16.09.25	5 000 000.00	5 501 705.10	0.16
USD BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 3.87500% 20-15.08.25	3 543 000.00	3 955 930.52	0.11
USD BROADCOM INC 4.25000% 20-15.04.26	11 409 000.00	12 733 065.22	0.37
USD CARRIER GLOBAL CORP 2.70000% 20-15.02.31	17 800 000.00	17 991 172.53	0.52
USD COO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.75000% 15-15.02.26	1 983 000.00	2 052 405.00	0.06
USD CENTENE CORP 3.37500% 20-15.02.30	2 000 000.00	2 007 500.00	0.06
USD CHENIERE CORPUS CHRISTI HLDGS LLC 5.12500% 17-30.06.27	5 000 000.00	5 764 366.95	0.17
USD CHENIERE CORPUS CHRISTI HLDGS LLC 3.70000% 20-15.11.29	5 000 000.00	5 318 862.85	0.15
USD CHENIERE ENERGY INC-144A 4.62500% 20-15.10.28	9 239 000.00	9 633 043.35	0.28
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 5.50000% 18-15.05.26	7 500 000.00	7 713 000.00	0.22
USD DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC-144A 2.20000% 16-30.10.21	1 000 000.00	1 009 264.47	0.03
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP-144A 4.00000% 19-15.07.24	10 000 000.00	10 889 311.10	0.32
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP-144A 5.30000% 19-01.10.29	6 000 000.00	7 104 660.12	0.20
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP-144A 5.45000% 16-15.06.23	12 500 000.00	13 637 715.88	0.39
USD DEUTSCHE TELEKOM INTL FINANCE BV-144A 3.60000% 17-19.01.27	3 500 000.00	3 858 438.99	0.11
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-144A 4.87500% 18-14.06.29	3 000 000.00	3 520 222.17	0.10
USD FIFTH THIRD BANK-SUB 3.85000% 16-15.03.26	2 000 000.00	2 209 229.78	0.06
USD FIVE CORNERS FUNDING TRUST II -144A 2.85000% 20-15.05.30	4 000 000.00	4 157 802.36	0.12
USD GE CAPITAL FUNDING LLC-144A 3.45000% 20-15.05.25	3 000 000.00	3 255 372.03	0.09
USD GE CAPITAL FUNDING LLC-144A 4.05000% 20-15.05.27	11 000 000.00	12 305 771.83	0.35
USD GENERAL MILLS INC 3.15000% 11-15.12.21	2 250 000.00	2 272 819.61	0.07
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.75000% 15-22.05.25	2 000 000.00	2 193 298.10	0.06
USD GRAPHIC PACKAGING INTERNATIONAL INC-144A 3.50000% 20-15.03.28	7 881 000.00	7 838 363.79	0.23
USD HARLEY-DAVIDSON FIN. SERV INC-144A 3.35000% 18-15.02.23	5 200 000.00	5 434 458.95	0.16
USD HCA INC 5.00000% 14-15.03.24	13 000 000.00	14 481 819.69	0.42
USD HUMANA INC 3.85000% 14-01.10.24	2 000 000.00	2 182 509.08	0.06
USD INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 2.87500% 15-09.11.22	3 000 000.00	3 122 771.04	0.09
USD INTESA SANPAOLO SPA-144A 3.37500% 18-12.01.23	4 800 000.00	5 003 358.43	0.14
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 3.37500% 13-01.05.23	4 000 000.00	4 229 579.24	0.12
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 3.62500% 16-01.12.27	1 000 000.00	1 096 366.50	0.03
USD LAMB WESTON HOLDINGS INC-144A 4.62500% 16-01.11.24	7 500 000.00	7 781 250.00	0.22
USD LENNAR CORP 5.00000% 18-15.06.27	1 000 000.00	1 155 000.00	0.03

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD LENNAR CORP 5.25000% 18-01.06.26	3 000 000.00	3 461 250.00	0.10
USD LEVEL 3 FINANCING INC-144A 3.40000% 19-01.03.27	5 722 000.00	6 072 472.50	0.17
USD LEVEL 3 FINANCING INC-144A 3.87500% 19-15.11.29	10 161 000.00	10 796 062.50	0.31
USD LGI HOMES INC-144A 6.87500% 18-15.07.26	7 500 000.00	7 799 999.99	0.23
USD LITHIA MOTORS INC-144A 4.62500% 19-15.12.27	2 000 000.00	2 100 000.00	0.06
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-144A 3.45000% 16-18.12.26	3 695 000.00	4 089 603.83	0.12
USD MORGAN STANLEY 3.87500% 14-29.04.24	1 000 000.00	1 091 639.78	0.03
USD MPLX LP 3.50000% 20-01.12.22	500 000.00	520 816.70	0.02
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-144A 3.50000% 17-10.01.27	4 000 000.00	4 438 472.00	0.13
USD NETFLIX INC 5.75000% 14-01.03.24	7 500 000.00	8 451 562.50	0.24
USD NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-144A 1.10000% 20-05.05.23	5 000 000.00	5 071 293.95	0.15
USD NOVA CHEMICALS CORP-144A 4.87500% 17-01.06.24	2 000 000.00	2 108 520.00	0.06
USD NRG ENERGY INC-144A 3.75000% 19-15.06.24	2 100 000.00	2 250 450.22	0.07
USD NXP BV / NXP FDNG LLC / NXP USA-144A 3.87500% 19-18.06.26	7 177 000.00	7 941 148.11	0.23
USD NXP BV / NXP FDNG LLC / NXP USA-144A 3.15000% 20-01.05.27	2 000 000.00	2 143 473.80	0.06
USD NXP BV / NXP FUNDING LLC-144A 5.55000% 18-01.12.28	2 000 000.00	2 427 705.62	0.07
USD NXP BV / NXP FUNDING LLC-144A 4.87500% 18-01.03.24	4 200 000.00	4 660 822.57	0.13
USD ONCOR ELECTRIC DELIVERY CO 4.10000% 12-01.06.22	2 000 000.00	2 059 947.40	0.06
USD ONCOR ELECTRIC DELIVERY CO 3.70000% 19-15.11.28	2 345 000.00	2 634 826.19	0.08
USD OTIS WORLDWIDE CORP 2.56500% 20-15.02.30	5 000 000.00	5 088 031.60	0.15
USD PENSKE TRUCK LEASING/PTL FIN CORP-144A 1.20000% 20-15.11.25	17 000 000.00	16 829 729.02	0.48
USD PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC STEP-UP 12-09.11.22	6 580 000.00	6 826 861.73	0.20
USD PRICOA GLOBAL FUNDING I-144A 2.40000% 19-23.09.24	5 000 000.00	5 279 022.60	0.15
USD PRINCIPAL FINANCIAL GROUP 3.30000% 12-15.09.22	2 000 000.00	2 075 884.56	0.06
USD RABOBANK NEDERLAND NV-144A 3.87500% 18-26.09.23	11 570 000.00	12 484 716.10	0.36
USD SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCH NV-144A 2.35000% 16-15.10.26	8 420 000.00	8 791 041.79	0.25
USD SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCH NV-144A 3.12500% 17-16.03.24	1 000 000.00	1 070 712.53	0.03
USD SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCH NV-144A 1.20000% 21-11.03.26	10 000 000.00	9 982 083.30	0.29
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 4.62500% 19-15.07.24	7 500 000.00	7 696 875.00	0.22
USD SOCIETE GENERALE SA-144A 4.00000% 17-12.01.27	500 000.00	551 136.98	0.02
USD SYDNEY AIRPORT FINANCE CO PTY LTD-144A 3.90000% 12-22.03.23	16 089 000.00	17 000 387.15	0.49
USD TEGNA INC-144A 4.75000% 20-15.03.26	7 500 000.00	7 976 250.00	0.23
USD TENNESSEE GAS PIPELINE CO LLC-144A 2.90000% 20-01.03.30	6 900 000.00	7 003 500.20	0.20
USD TRI POINTE HOLDINGS INC 5.87500% 15-15.06.24	7 500 000.00	8 338 125.00	0.24
USD TRITON CONTAINER INTERNATIONAL LTD-144A 2.05000% 21-15.04.26	20 000 000.00	19 985 200.00	0.58
USD UNION PACIFIC CORP 3.75000% 14-15.03.24	1 000 000.00	1 082 428.67	0.03
USD UPJOHN INC-144A 2.30000% 20-22.06.27	1 500 000.00	1 519 656.39	0.04
USD VICI PROPERTIES LP /VCI NTE CO INC-144A 4.25000% 19-01.12.26	1 000 000.00	1 031 250.00	0.03
USD VICI PROPERTIES LP /VCI NTE CO INC-144A 3.75000% 20-15.02.27	5 000 000.00	5 040 150.00	0.15
USD VICI PROPERTIES LP /VCI NTE CO INC-144A 4.12500% 20-15.08.30	5 000 000.00	5 078 150.00	0.15
USD VISTRA OPERATIONS CO LLC-144A 5.50000% 18-01.09.26	5 700 000.00	5 888 841.00	0.17
米ドル合計		451 104 214.76	13.00
ノート、固定利付債合計		451 104 214.76	13.00
ノート、変動利付債			
米ドル			
USD BNP PARIBAS-144A 3.052%/VAR 20-13.01.31	7 000 000.00	7 254 382.94	0.21
米ドル合計		7 254 382.94	0.21
ノート、変動利付債合計		7 254 382.94	0.21
メディアム・ターム・ノート、固定利付債			
米ドル			
USD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GRP/NY 2.62500% 17-09.11.22	5 000 000.00	5 176 898.00	0.15
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-144A 3.15000% 17-19.09.27	10 000 000.00	10 948 732.90	0.32
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 3.85000% 14-08.07.24	3 000 000.00	3 266 641.53	0.09
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-144A-SUB 2.33200% 20-21.08.30	11 380 000.00	10 850 230.27	0.31
USD SOCIETE GENERALE SA-144A 2.62500% 20-22.01.25	9 000 000.00	9 396 944.01	0.27
米ドル合計		39 639 446.71	1.14
メディアム・ターム・ノート、固定利付債合計		39 639 446.71	1.14

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
メディアム・ターム・ノート、変動利付債			
米ドル			
USD AUSTRALIA & NEWZEALAND BKG-144A-SUB 2.950%/VAR 20-22.07.30	15 000 000.00	15 562 626.00	0.45
USD COMMONWEALTH BANK AUSTRALIA-144A-SUB 3.610%/VAR 19-12.09.34	5 000 000.00	5 195 660.00	0.15
USD COOPERATIEVE RABOBANK UA-144A 1.339%/VAR 20-24.06.26	7 300 000.00	7 315 048.59	0.21
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-144A-SUB 3.933%/VAR 19-02.08.34	5 811 000.00	6 194 990.88	0.18
米ドル合計		34 268 325.47	0.99
メディアム・ターム・ノート、変動利付債合計		34 268 325.47	0.99
債券、固定利付債			
米ドル			
USD ANTHEM INC 3.30000% 12-15.01.23	4 239 000.00	4 446 162.55	0.13
USD BMW US CAPITAL LLC-144A 3.45000% 18-12.04.23	5 000 000.00	5 278 811.90	0.15
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP-144A 4.90000% 19-01.10.26	2 000 000.00	2 297 518.64	0.07
USD DNB BANK ASA-144A 1.12700% 20-16.09.26	10 000 000.00	9 884 880.00	0.28
USD FIFTH THIRD BANCORP-SUB 4.30000% 13-16.01.24	1 000 000.00	1 090 564.72	0.03
USD FIVE CORNERS FUNDING TRUST-144A 4.41900% 13-15.11.23	8 000 000.00	8 752 798.96	0.25
USD METLIFE INC 4.36800% 13-15.09.23	7 949 000.00	8 667 488.81	0.25
USD PRINCIPAL LIFE GLOBAL FUNDING II-144A 2.25000% 19-21.11.24	7 975 000.00	8 356 728.24	0.24
USD SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 3.50000% 13-01.10.23	8 015 000.00	8 514 347.56	0.25
米ドル合計		57 289 301.38	1.65
債券、変動利付債合計		57 289 301.38	1.65
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		589 555 671.26	16.99
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有価証券および短期金融商品			
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD ABBVIE INC 3.25000% 20-01.10.22	3 000 000.00	3 100 408.14	0.09
USD ABBVIE INC 3.45000% 20-15.03.22	1 863 000.00	1 902 848.02	0.05
USD AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD-144A 2.75000% 21-21.02.28	22 000 000.00	21 198 760.00	0.61
USD CENTENE CORP-144A 5.37500% 20-15.08.26	1 500 000.00	1 573 500.00	0.05
USD COSTCO WHOLESALE CORP 1.37500% 20-20.06.27	10 000 000.00	10 040 056.10	0.29
USD EXELON CORP 4.05000% 20-15.04.30	7 322 000.00	8 227 614.90	0.24
USD EXPEDIA GROUP INC-144A 2.95000% 21-15.03.31	15 500 000.00	15 423 689.78	0.44
USD FOX CORP 4.70900% 20-25.01.29	2 000 000.00	2 322 457.72	0.07
USD MATTEL INC-144A 3.75000% 21-01.04.29	6 000 000.00	6 148 920.00	0.18
USD TECK RESOURCES LTD 3.90000% 20-15.07.30	6 000 000.00	6 375 215.16	0.18
米ドル合計		76 313 469.82	2.20
ノート、固定利付債合計		76 313 469.82	2.20
債券、固定利付債			
米ドル			
USD SAN DIEGO GAS & ELECTRIC 1.70000% 20-01.10.30	5 000 000.00	4 774 473.40	0.14
米ドル合計		4 774 473.40	0.14
債券、固定利付債合計		4 774 473.40	0.14
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有価証券および短期金融商品合計		81 087 943.22	2.34

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD ALCON FINANCE CORP-144A 2.60000% 20-27.05.30	6 000 000.00	6 050 045.82	0.17
USD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK-144A-SUB 2.57000% 20-25.11.35	1 500 000.00	1 426 380.00	0.04
USD BERRY GLOBAL INC-144A 0.95000% 21-15.02.24	15 000 000.00	14 961 900.00	0.43
USD GE CAPITAL FUNDING LLC-144A 4.40000% 20-15.05.30	7 000 000.00	7 961 415.35	0.23
USD HILTON DOMESTIC OPERATING CO INC-144A 4.00000% 20-01.05.31	6 000 000.00	6 060 000.00	0.17
USD HILTON DOMESTIC OPERATING CO INC-144A 3.62500% 21-15.02.32	5 000 000.00	4 917 100.00	0.14
USD MACQUARIE BANK LTD-144A-SUB 3.62400% 20-03.06.30	15 020 000.00	15 502 867.46	0.45
USD NESTLE HOLDINGS INC-144A 1.00000% 20-15.09.27	25 000 000.00	24 217 677.50	0.70
USD ROCHE HOLDINGS INC-144A 0.45000% 21-05.03.24	5 000 000.00	4 991 315.15	0.14
USD SEAGATE HDD CAYMAN-144A 4.09100% 20-01.06.29	5 992 000.00	6 129 396.56	0.18
米ドル合計		92 218 097.84	2.65
ノート、固定利付債合計		92 218 097.84	2.65
最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		92 218 097.84	2.65
投資有価証券合計		3 347 485 955.76	96.46
金融派生商品			
公認の証券取引所に上場されている金融派生商品			
債券関連金融先物			
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.06.21	-200.00	35 937.50	0.00
債券関連金融先物合計		35 937.50	0.00
公認の証券取引所に上場されている金融派生商品合計		35 937.50	0.00
金融派生商品合計		35 937.50	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			
GBP 315 206 100.00 USD 438 536 160.33 27.5.2021		-2 091 516.13	-0.06
EUR 710 667 600.00 USD 855 188 963.14 27.5.2021		743 385.21	0.02
CHF 741 217 300.00 USD 809 678 004.30 27.5.2021		3 547 205.82	0.10
CHF 9 469 700.00 USD 10 345 129.70 27.5.2021		44 534.40	0.00
EUR 13 540 600.00 USD 16 375 084.94 27.5.2021		-66 704.54	0.00
CHF 9 553 800.00 USD 10 469 030.95 27.5.2021		12 903.31	0.00
GBP 4 521 500.00 USD 6 290 672.07 27.5.2021		-30 055.73	0.00
EUR 7 608 900.00 USD 9 223 638.69 27.5.2021		-59 433.59	0.00
先渡為替契約合計		2 100 318.75	0.06
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産		81 692 864.50	2.35
その他の資産および負債		39 084 244.98	1.13
純資産総額		3 470 399 321.49	100.00

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル

2021年4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 INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 1.75000% 19-23.10.29	101 967 000.00	103 358 438.62	7.79
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.75000% 20-24.11.27	250 000 000.00	241 230 472.50	18.19
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 4.75000% 05-15.02.35	5 126 000.00	6 719 795.86	0.51
米ドル合計		351 308 706.98	26.49
ノート、固定利付債合計			26.49
ミディアム・ターム・ノート、固定利付債			
米ドル			
USD INTERNATIONAL BK FOR RECONSTR & DEVE 1.37500% 21-20.04.28	110 000 000.00	109 917 500.00	8.29
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 1.87500% 16-27.10.26	168 000 000.00	175 449 506.40	13.23
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 17-22.11.27	140 684 000.00	151 275 140.30	11.40
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 3.12500% 18-20.11.25	10 500 000.00	11 552 129.30	0.87
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.12500% 15-03.03.25	1 000 000.00	1 055 888.00	0.08
米ドル合計		449 250 164.00	33.87
ミディアム・ターム・ノート、固定利付債合計			33.87
債券、固定利付債			
米ドル			
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 14-25.11.24	1 000 000.00	1 067 740.00	0.08
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 15-29.07.25	1 000 000.00	1 072 877.49	0.08
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.62500% 20-22.04.25	4 000 000.00	3 992 955.52	0.30
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.87500% 20-14.05.30	77 000 000.00	71 933 275.26	5.43
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.37500% 20-28.07.25	3 000 000.00	2 954 032.86	0.22
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.75000% 20-26.08.30	186 128 000.00	171 122 649.13	12.90
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 1.25000% 21-10.02.31	205 000 000.00	196 228 201.70	14.80
米ドル合計		448 371 731.96	33.81
債券、固定利付債合計			33.81
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			94.17
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
ミディアム・ターム・ノート、固定利付債			
米ドル			
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.77850% 19-13.09.29	40 000 000.00	43 684 322.00	3.29
米ドル合計		43 684 322.00	3.29
ミディアム・ターム・ノート、固定利付債合計			3.29

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
メディアム・ターム・ノート、ゼロ・クーポン			
米ドル			
USD USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.00000% 90-31.10.30	1 660 000.00	1 332 332.60	0.10
米ドル合計		1 332 332.60	0.10
メディアム・ターム・ノート、ゼロ・クーポン合計			
		1 332 332.60	0.10
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			
		45 016 654.60	3.39
投資有価証券合計			
		1 293 947 257.54	97.56
先渡為替契約			
購入通貨/購入額/売却通貨/売却額/満期日			
GBP 25 934 800.00 USD	35 760 686.55	4.5.2021	147 340.79 0.01
CHF 314 826 700.00 USD	334 412 859.91	4.5.2021	10 772 930.34 0.81
EUR 383 471 400.00 USD	450 642 704.64	4.5.2021	10 980 166.71 0.83
EUR 833 600.00 USD	978 841.46	4.5.2021	24 646.22 0.00
GBP 162 100.00 USD	223 411.25	4.5.2021	1 024.30 0.00
EUR 1 451 500.00 USD	1 710 093.43	4.5.2021	37 222.27 0.01
CHF 1 103 000.00 USD	1 173 259.97	4.5.2021	36 103.55 0.00
EUR 1 998 800.00 USD	2 351 755.90	4.5.2021	54 399.54 0.01
CHF 800 200.00 USD	849 454.61	4.5.2021	27 909.57 0.00
EUR 3 023 600.00 USD	3 600 669.18	4.5.2021	39 140.50 0.01
CHF 1 365 500.00 USD	1 474 068.06	4.5.2021	23 108.63 0.00
GBP 76 700.00 USD	105 792.00	4.5.2021	402.98 0.00
CHF 872 500.00 USD	943 992.31	4.5.2021	12 643.84 0.00
GBP 597 800.00 USD	822 538.73	4.5.2021	5 145.26 0.00
EUR 2 424 300.00 USD	2 883 993.34	4.5.2021	34 379.00 0.00
CHF 577 900.00 USD	624 882.41	4.5.2021	8 745.13 0.00
GBP 48 700.00 USD	66 911.37	4.5.2021	516.21 0.00
EUR 606 400.00 USD	722 798.48	4.5.2021	7 185.84 0.00
CHF 562 100.00 USD	610 146.60	4.5.2021	6 157.33 0.00
GBP 407 900.00 USD	560 697.71	4.5.2021	4 060.23 0.00
EUR 1 908 600.00 USD	2 279 605.31	4.5.2021	17 967.37 0.00
GBP 57 800.00 USD	79 420.90	4.5.2021	606.09 0.00
EUR 2 253 700.00 USD	2 698 677.29	4.5.2021	14 326.77 0.00
GBP 477 300.00 USD	657 860.44	4.5.2021	2 985.27 0.00
CHF 928 200.00 USD	1 006 230.13	4.5.2021	11 477.23 0.00
CHF 622 700.00 USD	676 154.11	4.5.2021	6 593.55 0.00
GBP 131 600.00 USD	181 510.22	4.5.2021	696.56 0.00
EUR 3 476 300.00 USD	4 167 207.67	4.5.2021	17 562.27 0.00
GBP 110 000.00 USD	151 725.75	4.5.2021	574.75 0.00
EUR 1 825 000.00 USD	2 195 841.83	4.5.2021	1 093.17 0.00
GBP 271 100.00 USD	379 211.86	4.5.2021	-3 860.36 0.00
CHF 1 165 800.00 USD	1 273 889.53	4.5.2021	4 329.87 0.00
EUR 1 650 300.00 USD	1 985 221.78	4.5.2021	1 409.36 0.00
CHF 687 200.00 USD	748 659.48	4.5.2021	4 807.98 0.00
GBP 92 700.00 USD	128 916.04	4.5.2021	-568.26 0.00
EUR 2 502 600.00 USD	3 015 185.03	4.5.2021	-2 555.15 0.00
CHF 927 000.00 USD	1 012 218.69	4.5.2021	4 172.96 0.00
GBP 86 900.00 USD	120 531.43	4.5.2021	-214.04 0.00
EUR 692 000.00 USD	834 603.90	4.5.2021	-1 574.30 0.00
EUR 908 000.00 USD	1 096 386.39	4.5.2021	-3 335.99 0.00
CHF 747 700.00 USD	817 580.22	4.5.2021	2 221.33 0.00
GBP 188 300.00 USD	261 498.24	4.5.2021	-787.48 0.00
EUR 2 481 000.00 USD	2 997 462.33	4.5.2021	-10 834.53 0.00
CHF 992 300.00 USD	1 085 518.94	4.5.2021	2 469.66 0.00
GBP 95 900.00 USD	133 295.82	4.5.2021	-517.48 0.00
EUR 2 625 900.00 USD	3 175 666.30	4.5.2021	-14 607.88 0.00

注記は当財務書類の一部である。

銘柄			数量/ 額面		米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
CHF	924 600.00	USD	1 012 619.97	4.5.2021	1 140.24	0.00
GBP	729 100.00	USD	1 014 312.25	4.5.2021	-4 836.85	0.00
EUR	1 651 200.00	USD	2 001 043.38	4.5.2021	-13 328.82	0.00
USD	138 508.61	GBP	99 300.00	4.5.2021	1 022.80	0.00
GBP	29 568 000.00	USD	41 144 037.58	2.6.2021	-202 585.19	-0.02
CHF	327 103 400.00	USD	359 883 931.76	2.6.2021	-944 485.87	-0.07
EUR	415 784 200.00	USD	503 242 119.66	2.6.2021	-2 407 025.99	-0.18
CHF	964 600.00	USD	1 059 649.50	2.6.2021	-1 167.72	0.00
USD	98 978.25	GBP	71 400.00	5.5.2021	120.90	0.00
GBP	71 400.00	USD	98 984.25	2.6.2021	-119.95	0.00
先渡為替契約合計					18 706 400.51	1.41
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					18 290 524.53	1.38
その他の資産および負債					-4 650 694.67	-0.35
純資産総額					1 326 293 487.91	100.00

注記は当財務書類の一部である。

[次へ](#)

5 販売及び買戻しの実績

2020年6月1日から2021年5月末日までの1年間における販売および買戻しの実績ならびに2021年5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
フォーカス・シキャブ - USコーポレート・ボンド・ サステナブル・米ドル	クラスF - acc投資証券	7,481,624.524 (0)	834,269.742 (0)	10,859,237.077 (0)
フォーカス・シキャブ - ワールドバンク・ロング・ ターム・ボンド・米ドル	クラスF - acc投資証券	3,033,139.560 (0)	436,914.895 (0)	3,722,504.997 (0)

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

(注2) フォーカス・シキャブ - USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドルは2016年11月8日に運用を開始し、クラスF - acc投資証券は2016年11月8日に運用が開始された。

(注3) フォーカス・シキャブ - ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドルは2018年2月14日に運用を開始し、クラスF - acc投資証券は2018年2月14日に運用が開始された。

[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

<訂正前>

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
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)上記販売会社の本支店において申込みの取扱いを行う。

<訂正後>

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
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)上記販売会社の本支店において申込みの取扱いを行う。

() UBS証券株式会社のウェルス・マネジメント本部の事業が会社分割され、2021年8月10日からは分割先であるUBS SUMITRUSTウェルス・マネジメント株式会社が承継した業務を開始する予定である。このため、同日以降、本書におけるUBS証券株式会社に関する記載は、UBS SUMITRUSTウェルス・マネジメント株式会社と読み替えられるものとする。また、申込取扱場所は、以下の通り変更となる予定である。以下同じ。

UBS SUMITRUSTウェルス・マネジメント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電話番号 03-5293-3100ホームページ・アドレス <https://www.ubs-sumitrust.com/>

(以下「UBS SUMITRUST」または「日本における販売会社」という。)

(注)上記日本における販売会社の本支店において申込みの取扱いを行う。

(12) 払込取扱場所

<訂正前>

UBS証券株式会社 東京都千代田区大手町一丁目2番1号
Otemachi Oneタワー
(後略)

<訂正後>

UBS証券株式会社 東京都千代田区大手町一丁目2番1号
Otemachi Oneタワー

() 2021年8月10日以降、払込取扱場所は、以下の通り変更となる予定である。以下同じ。UBS SUMITRUSTウェルス・マネジメント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

(後略)

第三部 外国投資法人の詳細情報

第4 関係法人の状況

2 その他の関係法人の概況

(1) 名称、資本金の額及び事業の内容

<訂正前>

(前略)

UBS証券株式会社(「代行協会員」「日本における販売会社」)

a. 資本金(株主資本)の額

2021年2月末日現在、321億円

b. 事業の内容

金融商品取引法に基づき、日本における金融商品取引業者としての業務を行う。

<訂正後>

(前略)

UBS証券株式会社(「代行協会員」「日本における販売会社」)

a. 資本金(株主資本)の額

2021年2月末日現在、321億円

b. 事業の内容

金融商品取引法に基づき、日本における金融商品取引業者としての業務を行う。

() UBS証券株式会社のウェルス・マネジメント本部の事業が会社分割され、2021年8月10日からは分割先であるUBS SuMi TRUSTウェルス・マネジメント株式会社が承継した業務を開始する予定である。このため、同日以降、本書におけるUBS証券株式会社に関する記載は、UBS SuMi TRUSTウェルス・マネジメント株式会社と読み替えられるものとする。分割先の商号、資本金の額および事業の内容は、以下のとおりである。

UBS SuMi TRUSTウェルス・マネジメント株式会社

a. 資本金(株主資本)の額

2021年6月末日現在、5,000万円

b. 事業の内容

金融商品取引法に基づき、日本における金融商品取引業者としての業務を行う。

交付目論見書の概要

<訂正前>

(前略)

日本における 販売会社	U B S 証券株式会社
----------------	--------------

(後略)

<訂正後>

(前略)

日本における 販売会社	U B S 証券株式会社 <u>() U B S 証券株式会社のウェルス・マネジメント本部の事業が会社分割され、2021年8月10日からは分割先であるU B S S u M i T R U S T ウェルス・マネジメント株式会社が承継した業務を開始する予定です。</u>
----------------	---

(後略)