

【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4年2月28日

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

【代表者の役職氏名】 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 Süttinger)
メンバー・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ
トーマス・ローズ (Thomas Rose)

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

【代理人の氏名又は名称】 弁護士 三 浦 健
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・サステナブル(米ドル)
- インカム・サステナブル(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 Sustainable (USD)
- Income Sustainable (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・サステナブル (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・サステナブル (米ドル)

クラス P - a c c 投資証券

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

クラス P - a c c 投資証券

システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル)

クラス P - a c c 投資証券

システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)

クラス P - a c c 投資証券

上限見込額は以下のとおりである。

ダイナミック・インカム (米ドル)

クラス P - m d i s t 投資証券

10億9,980万米ドル (約1,209億円)

クラス P - a c c 投資証券

12億5,260万米ドル (約1,377億円)

フィクスト・インカム・サステナブル (米ドル)

クラス P - a c c 投資証券

25億9,780万米ドル (約2,855億円)

クラス (日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券

1,053億9,000万円

インカム・サステナブル (米ドル)

クラス P - a c c 投資証券

12億9,810万米ドル (約1,427億円)

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

12億80万米ドル (約1,320億円)

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

12億7,900万米ドル (約1,406億円)

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

13億4,920万米ドル (約1,483億円)

- (注1) 上限見込額は、便宜上、ファンドの投資証券の2021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109.98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125.26米ドルに1,000万口、フィクスト・インカム・サステナブル(米ドル)クラスP - a c c 投資証券については259.78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10,539円に1,000万口、インカム・サステナブル(米ドル)クラスP - a c c 投資証券については129.81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120.08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127.90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134.92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) 2021年11月15日付で、UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - フィクスト・インカム(米ドル)(UBS (Lux) Strategy SICAV - Fixed Income (USD))はUBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - フィクスト・インカム・サステナブル(米ドル)(UBS (Lux) Strategy SICAV - Fixed Income Sustainable (USD))に、UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - インカム(米ドル)(UBS (Lux) Strategy SICAV - Income (USD))はUBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - インカム・サステナブル(米ドル)(UBS (Lux) Strategy SICAV - Income Sustainable (USD))にそれぞれ名称を変更した。
- (注3) 米ドルの円貨換算は、特に記載がない限り、2021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=109.90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、2021年11月30日に提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報により更新するため、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用いておりますので、訂正前の換算レートとは異なっております。

2【訂正の内容】

（１）半期報告書に係る訂正

半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正内容は、下記のとおりです。

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

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

半期報告書の記載内容は以下のとおりです。（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・サステナブル (米ドル) / インカム・サステナブル (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・サステナブル (米ドル) / インカム・サステナブル (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	2021年5月末日 に終了する 会計年度末	2021年11月末日に 終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	23,031,370.03	- 24,848,715.02	59,726,564.32	103,787,257.49	- 16,009,716.89
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	23,031,370.03	- 24,848,715.02	59,726,564.32	103,787,257.49	- 16,009,716.89
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	23,031,370.03	- 24,848,715.02	59,726,564.32	103,787,257.49	- 16,009,716.89
(d) 出資総額 ⁽²⁾	501,866,143.45	488,867,866.14	509,560,086.69	530,090,612.88	638,706,690.39
(e) 発行済投資口総数 (クラス P - m d i s t 投資証券)	1,990,112.770口	2,316,940.942口	2,292,205.461口	2,182,895.043口	2,668,103.481口
(クラス P - a c c 投資証券)	602,725.332口	626,008.150口	526,114.338口	474,026.978口	626,504.082口
(f) 純資産額	501,866,143.45	488,867,866.14	509,560,086.69	530,090,612.88	638,706,690.39
(g) 資産総額	514,490,856.98	490,373,794.28	512,062,762.45	540,863,426.63	651,377,333.60
(h) 1口当たり純資産価格 (クラス P - m d i s t 投資証券)	102.92	93.87	102.59	108.86	103.90
(クラス P - a c c 投資証券)	107.26	100.50	112.51	122.33	119.96
(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)	4.43	- 4.55	11.10	20.43	- 2.35
(クラス P - a c c 投資証券)	4.21	- 5.34	12.83	24.81	- 2.71
(j) 分配総額	9,162,256.65	20,227,465.10	9,800,706.34	20,148,602.33	14,378,384.65
(k) 1口当たり分配金額 (クラス P - m d i s t 投資証券)	2.79	5.36	2.38	4.97	2.94
(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	該当事項なし
(l) 自己資本比率	97.55%	99.69%	99.51%	98.01%	98.05%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾ (クラス P - m d i s t 投資証券)	7.15%	- 0.61%	4.49%	21.26%	6.67%
(クラス P - a c c 投資証券)	7.26%	- 0.73%	4.89%	21.72%	6.62%

(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、当該会計年度末および当該中間会計年度末の 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・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	2021年 5 月末日 に終了する 会計年度末	2021年11月末日に 終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ^(1)	2,445,729.76	4,659,313.29	5,135,953.19	2,586,561.14	- 1,529,295.67
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	2,445,729.76	4,659,313.29	5,135,953.19	2,586,561.14	- 1,529,295.67
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	2,445,729.76	4,659,313.29	5,135,953.19	2,586,561.14	- 1,529,295.67
(d) 出資総額 ^(2)	160,989,751.98	104,821,036.41	115,577,961.48	102,844,434.46	88,778,631.73
(e) 発行済投資口総数 (クラス P - a c c 投資証券)	369,527.950口	238,985.170口	264,768.036口	241,587.435口	222,369.939口
(クラス(日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券)	675,913.442口	418,030.888口	412,007.866口	370,497.929口	291,006.106口
(f) 純資産額	160,989,751.98	104,821,036.41	115,577,961.48	102,844,434.46	88,778,631.73
(g) 資産総額	164,938,100.58	104,966,265.09	115,728,454.87	103,216,926.53	88,832,101.35
(h) 1 口当たり純資産価格 (クラス P - a c c 投資証券)	244.88	250.24	259.09	257.58	256.18
(クラス(日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券)	10,102円	10,214円	10,545円	10,451円	10,383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)	5.42	12.26	8.72	7.68	- 1.20
(クラス(日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券)	0.34円	3.25円	6.38円	- 1.20円	- 4.28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	97.61%	99.86%	99.87%	99.64%	99.94%
(m) 自己資本利益率 ^(3) (クラス P - a c c 投資証券)	7.57%	4.68%	5.80%	2.93%	- 1.12%
(クラス(日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券)	4.72%	2.30%	4.39%	2.32%	- 1.54%

(注) フィクスト・インカム・サステナブル(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・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	2021年5月末日 に終了する 会計年度末	2021年11月末日に 終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	4,912,568.00	3,635,272.03	8,076,810.62	11,518,156.57	37,266.98
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	4,912,568.00	3,635,272.03	8,076,810.62	11,518,156.57	37,266.98
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	4,912,568.00	3,635,272.03	8,076,810.62	11,518,156.57	37,266.98
(d) 出資総額 ⁽²⁾	139,056,923.59	124,799,844.54	127,891,521.32	126,960,186.18	124,672,188.51
(e) 発行済投資口総数 (クラスP - a c c 投資証券)	613,977.915口	584,895.742口	581,003.760口	568,236.342口	582,564.970口
(f) 純資産額	139,056,923.59	124,799,844.54	127,891,521.32	126,960,186.18	124,672,188.51
(g) 資産総額	139,235,786.51	124,917,288.25	128,186,013.64	127,719,934.61	124,748,596.17
(h) 1口当たり純資産価格 (クラスP - a c c 投資証券)	118.76	117.41	124.95	128.27	128.08
(i) 1口当たり当期純利益金 額または当期純損失金額 (クラスP - a c c 投資証券)	4.14	5.50	7.62	11.11	- 0.23
(j) 分配総額	134,207.94	134,207.94	123,453.56	123,453.56	66,133.46
(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	99.87%	99.91%	99.77%	99.41%	99.94%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾ (クラスP - a c c 投資証券)	7.75%	2.33%	5.21%	9.25%	2.51%

(注) インカム・サステナブル(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)

	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	2021年5月末日 に終了する 会計年度末	2021年11月末日に 終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	30,547,510.91	739,156.51	89,028,421.65	140,479,015.02	- 17,261,428.76
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	30,547,510.91	739,156.51	89,028,421.65	140,479,015.02	- 17,261,428.76
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	30,547,510.91	739,156.51	89,028,421.65	140,479,015.02	- 17,261,428.76
(d) 出資総額 ⁽²⁾	1,187,843,431.51	1,089,453,896.73	1,082,302,425.23	995,743,841.16	1,027,333,236.14
(e) 発行済投資口総数 (クラスP - a c c 投資証券)	3,305,422.535口	3,251,483.088口	2,995,552.319口	2,881,176.778口	2,896,817.594口
(f) 純資産額	1,187,843,431.51	1,089,453,896.73	1,082,302,425.23	995,743,841.16	1,027,333,236.14
(g) 資産総額	1,192,659,119.25	1,093,297,414.19	1,086,164,069.06	1,002,710,507.41	1,030,577,156.59
(h) 1口当たり純資産価格 (クラスP - a c c 投資証券)	109.41	106.66	112.46	117.45	118.78
(i) 1口当たり当期純利益金額 または当期純損失金額 (クラスP - a c c 投資証券)	3.50	0.70	5.95	11.22	1.30
(j) 分配総額	4,515,771.12	8,432,873.58	3,125,195.72	5,716,856.99	2,374,193.13
(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	99.60%	99.65%	99.64%	99.31%	99.69%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾ (クラスP - a c c 投資証券)	7.74%	0.80%	2.79%	10.12%	5.62%

(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)

	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	2021年 5 月末日 に終了する 会計年度末	2021年11月末日に 終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ^(1)	90,028,031.11	- 55,697,519.57	210,322,670.84	383,528,056.56	- 2,410,627.04
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	90,028,031.11	- 55,697,519.57	210,322,670.84	383,528,056.56	- 2,410,627.04
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	90,028,031.11	- 55,697,519.57	210,322,670.84	383,528,056.56	- 2,410,627.04
(d) 出資総額 ^(2)	2,331,541,245.56	2,011,788,426.80	1,948,978,139.54	1,930,791,077.91	1,930,456,246.87
(e) 発行済投資口総数 (クラス P - a c c 投資証券)	5,898,082.209口	5,432,559.813口	4,824,142.965口	4,457,096.733口	4,444,497.809口
(f) 純資産額	2,331,541,245.56	2,011,788,426.80	1,948,978,139.54	1,930,791,077.91	1,930,456,246.87
(g) 資産総額	2,345,840,197.41	2,019,595,290.10	1,964,783,089.97	1,949,336,207.67	1,943,208,365.03
(h) 1口当たり純資産価格 (クラス P - a c c 投資証券)	112.07	105.57	114.11	123.78	126.76
(i) 1口当たり当期純利益金額 または当期純損失金額 (クラス P - a c c 投資証券)	4.74	- 2.42	9.00	19.69	2.97
(j) 分配総額	6,778,479.23	13,334,473.37	5,147,609.68	9,686,478.44	4,434,240.50
(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	99.39%	99.61%	99.20%	99.05%	99.34%
(m) 自己資本利益率 ^(3) (クラス P - a c c 投資証券)	8.19%	- 1.47%	1.82%	17.25%	11.09%

(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)

	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	2021年 5 月末日 に終了する 会計年度末	2021年11月末日に 終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ^(1)	27,354,123.21	- 23,565,442.73	59,019,376.07	113,462,550.29	4,818,732.96
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	27,354,123.21	- 23,565,442.73	59,019,376.07	113,462,550.29	4,818,732.96
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	27,354,123.21	- 23,565,442.73	59,019,376.07	113,462,550.29	4,818,732.96
(d) 出資総額 ^(2)	589,998,727.11	490,288,568.55	469,328,444.71	431,225,866.64	446,387,788.66
(e) 発行済投資口総数 (クラス P - a c c 投資証券)	1,471,146.212口	1,456,136.297口	1,179,426.030口	1,038,007.614口	1,053,265.175口
(f) 純資産額	589,998,727.11	490,288,568.55	469,328,444.71	431,225,866.64	446,387,788.66
(g) 資産総額	592,698,228.35	493,104,881.97	473,110,713.66	435,080,949.57	449,518,385.80
(h) 1口当たり純資産価格 (クラス P - a c c 投資証券)	114.54	104.88	115.22	129.19	134.10
(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)	5.80	- 5.33	11.26	27.69	4.90
(j) 分配総額	706,571.76	1,306,084.97	408,504.22	756,319.62	390,645.25
(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	99.54%	99.43%	99.20%	99.11%	99.30%
(m) 自己資本利益率 ^(3) (クラス P - a c c 投資証券)	8.59%	- 3.27%	0.59%	23.18%	16.39%

(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

2021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)	650,981,411.66	74,876	クラス P - m d i s t 投資証券	2,673,336.978
			クラス P - a c c 投資証券	614,466.789
フィクスト・インカム・サステナブル(米ドル)	87,404,215.62	10,053	クラス P - a c c 投資証券	220,746.464
			クラス(日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券	285,906.106
インカム・サステナブル(米ドル)	125,154,041.29	14,395	クラス P - a c c 投資証券	579,242.404
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)	1,019,106,941.27	117,218	クラス P - a c c 投資証券	2,883,113.167
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)	1,993,620,104.71	229,306	クラス P - a c c 投資証券	4,445,641.037
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)	483,727,324.40	55,638	クラス P - a c c 投資証券	1,049,834.553

(注) 米ドルの円貨換算は、便宜上、2021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=115.02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

(2021年12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 (チェアマン・オブ・ ザ・ボード・オブ・ ディレクターズ)	UBSアセット・マネジメント・ スイス・エイ・ジー(チューリッ ヒ)マネージング・ディレクター	該当なし
トーマス・ローズ (Thomas Rose)	取締役会役員 (メンバー・オブ・ ザ・ボード・オブ・ ディレクターズ)	UBSアセット・マネジメント・ スイス・エイ・ジー(チューリッ ヒ)マネージング・ディレクター	該当なし
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 (ドイツ)ゲーエムベーハー、 フランクフルト エグゼクティブ・ディレクター	該当なし
フランチェスカ・グア ニニ (Francesca Guagnini)	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 (UK)リミテッド、ロンドン マネージング・ディレクター	該当なし
ジョゼ・リンダ・デニス (Josée Lynda Denis)	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)	ルクセンブルグ、 インディペンデント・ディレクター	該当なし

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

(5) その他

a. 定款の変更

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

b. 事業譲渡または事業譲受

投資法人およびそのサブ・ファンドの解散、サブ・ファンドの合併

本投資法人およびそのサブ・ファンドの解散

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

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

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

同一サブ・ファンド内で各サブ・ファンドまたは投資証券クラスの純資産総額が当該サブ・ファンドまたは投資証券クラスを経済的に合理的な管理のため要求される価額またはかかる価額に達しな

かった場合、または政治、経済もしくは金融の状況が著しく変化した場合または合理化の一環として、投資主総会または本投資法人の取締役は、該当する投資証券クラスのすべての投資証券を決定が効力を生じる評価日における純資産価格にて(投資対象の実際の換金率および経費を考慮して)買い戻すことを決定することができる。

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

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

「合併」とは、以下の取引である。

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

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

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

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

資証券は、交換比率が計算される日と同日に計算した関係するサブ・ファンドの純資産価格に基づいて交換される。割当ての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))

(2021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	1,839,126.16	0.28
従来型 オプション	スイス	- 45,062.63	- 0.01
	フランス	- 56,054.67	- 0.01
	アメリカ合衆国	- 138,529.16	- 0.02
	カナダ	- 152,819.33	- 0.02
	イギリス	- 334,900.11	- 0.05
	小計	- 727,365.90	- 0.11
投資信託	ルクセンブルグ	247,282,603.31	37.85
	アイルランド	65,623,432.53	10.04
	アメリカ合衆国	261,976.58	0.04
	イギリス	111,934.25	0.02
	小計	313,279,946.67	47.95
短期金融商品	アメリカ合衆国	30,987,517.58	4.74
株式	アメリカ合衆国	168,242,084.94	25.75
	日本	22,960,958.54	3.51
	イギリス	17,341,984.42	2.65
	フランス	17,176,795.47	2.63
	ドイツ	15,049,578.38	2.30
	オーストラリア	14,132,003.09	2.16
	オランダ	8,845,119.56	1.35
	スイス	6,958,359.58	1.07
	アイルランド	4,535,676.69	0.69
	スペイン	3,548,311.87	0.54
	イタリア	3,120,717.09	0.48
	フィンランド	1,855,157.86	0.28
	カナダ	1,572,591.75	0.24
	ベルギー	1,182,232.14	0.18
	香港	765,135.13	0.12
	シンガポール	593,979.32	0.09
	スウェーデン	573,106.74	0.09
	ルクセンブルグ	419,845.63	0.06
	オーストリア	395,056.31	0.06
	ポルトガル	208,193.41	0.03
	ニュージーランド	193,446.44	0.03
	アルゼンチン	192,821.20	0.03

	ノルウェー	162,283.53	0.02
	バミューダ	87,172.29	0.01
	マン島	69,115.63	0.01
	デンマーク	45,484.96	0.01
	ジャージー	45,143.04	0.01
	イスラエル	38,999.23	0.01
	ポーランド	24,357.19	0.00
	小計	290,335,711.43	44.44
ポートフォリオ合計		635,714,935.94	97.30
現金・その他資産		17,614,860.61	2.70
資産総額		653,329,796.55	100.00
負債総額		2,348,384.89	0.36
合計(純資産総額)		650,981,411.66 (約74,876百万円)	99.64

(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・サステナブル(米ドル))

(2021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	8,984,695.93	10.27
	国際機関	7,250,417.02	8.29
	フィリピン	5,193,709.56	5.94
	イギリス	1,159,749.12	1.33
	コートジボワール	981,982.97	1.12
	小計	23,570,554.60	26.95
投資信託	ルクセンブルグ	54,826,708.57	62.68
	アイルランド	8,668,281.11	9.91
	小計	63,494,989.68	72.59
ポートフォリオ合計		87,065,544.28	99.54
現金・その他資産		400,958.22	0.46
資産総額		87,466,502.50	100.00
負債総額		62,286.88	0.07
合計(純資産総額)		87,404,215.62 (約10,053百万円)	99.93

(インカム・サステナブル(米ドル))

(2021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(%)
投資信託	ルクセンブルグ	112,562,047.28	88.86
	アイルランド	10,798,879.84	8.53
	小計	123,360,927.12	97.39
ポートフォリオ合計		123,360,927.12	97.39
現金・その他資産		3,306,185.25	2.61
資産総額		126,667,112.37	100.00
負債総額		1,513,071.08	1.19
合計(純資産総額)		125,154,041.29 (約14,395百万円)	98.81

(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))

(2021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	176,739,210.45	17.30
	カナダ	22,466,131.63	2.20
	ドイツ	15,502,501.78	1.52
	韓国	13,058,239.21	1.28
	ルクセンブルグ	10,221,521.01	1.00
	アラブ首長国連邦	10,017,677.49	0.98
	オーストラリア	8,437,890.15	0.83
	カタール	7,363,881.25	0.72
	フィリピン	7,337,674.28	0.72
	ノルウェー	5,618,857.35	0.55
	クウェート	4,787,200.00	0.47
	国際機関	4,697,311.15	0.46
	ケイマン諸島	3,237,197.05	0.32
	シンガポール	3,147,750.23	0.31
	フランス	3,004,137.65	0.29
	ジャージー	1,818,763.20	0.18
	オランダ	1,349,000.40	0.13
	イギリス	1,296,618.00	0.13
	日本	1,118,456.30	0.11
	スウェーデン	401,956.34	0.04
	英領バーズン諸島	263,807.50	0.03
	小計	301,885,782.42	29.55
投資信託	ルクセンブルグ	430,413,975.42	42.13
	アイルランド	144,247,778.26	14.12
	イギリス	86,796.23	0.01
	シンガポール	56,132.56	0.01
	カナダ	28,133.71	0.00
	小計	574,832,816.18	56.26
短期金融商品	アメリカ合衆国	999,402.08	0.10
その他の有価証券	アイルランド	42,777,504.00	4.19
株式	日本	14,062,534.66	1.38
	イギリス	7,924,662.23	0.78
	カナダ	7,291,037.90	0.71
	フランス	7,055,967.47	0.69
	スイス	6,780,662.09	0.66
	ドイツ	5,496,956.15	0.54
	オーストラリア	4,429,914.81	0.43
	オランダ	3,997,521.56	0.39
	スウェーデン	2,317,658.19	0.23

	デンマーク	1,695,492.36	0.17
	香港	1,673,428.81	0.16
	スペイン	1,413,153.97	0.14
	イタリア	1,282,043.41	0.13
	フィンランド	798,162.48	0.08
	アイルランド	690,853.34	0.07
	シンガポール	679,188.70	0.07
	ベルギー	517,963.83	0.05
	イスラエル	416,543.36	0.04
	ノルウェー	383,855.55	0.04
	ルクセンブルグ	180,248.30	0.02
	ニュージーランド	174,552.64	0.02
	オーストリア	147,652.52	0.01
	ポルトガル	96,888.78	0.01
	アメリカ合衆国	51,453.40	0.01
	マン島	47,847.53	0.00
	マカオ	21,429.65	0.00
	ポーランド	8,846.20	0.00
	中国	8,660.00	0.00
	小計	69,645,179.89	6.82
	ポートフォリオ合計	990,140,684.57	96.91
	現金・その他資産	31,553,575.36	3.09
	資産総額	1,021,694,259.93	100.00
	負債総額	2,587,318.66	0.25
	合計 (純資産総額)	1,019,106,941.27 (約117,218百万円)	99.75

(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))

(2021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	218,176,704.60	10.91
	カナダ	24,109,527.63	1.21
	ドイツ	19,613,987.27	0.98
	ルクセンブルグ	16,364,440.72	0.82
	韓国	15,498,565.04	0.78
	アラブ首長国連邦	11,895,076.50	0.59
	オーストラリア	9,619,496.84	0.48
	フィリピン	9,364,212.50	0.47
	国際機関	7,604,690.74	0.38
	クウェート	6,745,600.00	0.34
	ノルウェー	5,499,374.41	0.28
	カタール	5,313,328.12	0.27
	シンガポール	4,036,078.62	0.20
	フランス	3,960,389.83	0.20
	ケイマン諸島	3,245,280.60	0.16
	オランダ	2,285,657.20	0.11
	ジャージー	1,566,157.20	0.08
	イギリス	1,297,628.62	0.06
	スウェーデン	1,004,890.85	0.05
	日本	824,938.77	0.04
	英領バージン諸島	712,280.25	0.04
	小計	368,738,306.31	18.44
投資信託	ルクセンブルグ	675,119,975.19	33.77
	アイルランド	532,054,432.29	26.61
	イギリス	292,608.93	0.01
	シンガポール	198,215.03	0.01
	カナダ	91,933.48	0.00
	小計	1,207,757,164.92	60.41
短期金融商品	アメリカ合衆国	10,495,840.43	0.52
その他の有価証券	アイルランド	59,043,600.00	2.95
株式	日本	49,128,529.82	2.46
	イギリス	27,764,034.48	1.39
	カナダ	25,461,523.22	1.27
	フランス	24,589,755.32	1.23
	スイス	23,612,873.64	1.18
	ドイツ	19,092,618.36	0.95
	オーストラリア	15,469,971.50	0.77
	オランダ	13,942,049.48	0.70
	スウェーデン	8,135,083.54	0.41

デンマーク	5,968,731.55	0.30
香港	5,916,943.29	0.30
スペイン	4,940,186.47	0.25
イタリア	4,523,560.33	0.23
フィンランド	2,803,430.14	0.14
アイルランド	2,453,295.07	0.12
シンガポール	2,417,608.20	0.12
ベルギー	1,722,034.84	0.09
イスラエル	1,479,717.55	0.07
ノルウェー	1,397,539.46	0.07
ルクセンブルグ	644,039.67	0.03
ニュージーランド	603,411.47	0.03
オーストリア	499,479.66	0.02
ポルトガル	327,031.16	0.02
アメリカ合衆国	175,616.48	0.01
マン島	170,965.45	0.01
マカオ	78,264.82	0.00
ポーランド	32,154.85	0.00
中国	30,310.00	0.00
アラブ首長国連邦	0.04	0.00
小計	243,380,759.86	12.17
ポートフォリオ合計	1,889,415,671.52	94.50
現金・その他資産	109,984,638.77	5.50
資産総額	1,999,400,310.29	100.00
負債総額	5,780,205.58	0.29
合計(純資産総額)	1,993,620,104.71 (約229,306百万円)	99.71

(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))

(2021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	46,484,970.16	9.58
	ドイツ	9,064,507.55	1.87
	カナダ	7,236,175.83	1.49
	韓国	4,251,269.93	0.88
	ルクセンブルグ	4,012,430.81	0.83
	アラブ首長国連邦	3,605,544.00	0.74
	国際機関	3,135,537.40	0.65
	オーストラリア	2,829,914.33	0.58
	フィリピン	2,503,155.00	0.52
	カタール	2,045,620.31	0.42
	フランス	1,394,753.21	0.29
	ノルウェー	1,357,334.42	0.28
	クウェート	1,305,600.00	0.27
	ケイマン諸島	1,251,074.61	0.26
	シンガポール	1,177,456.89	0.24
	オランダ	724,139.50	0.15
	イギリス	589,188.07	0.12
	ジャージー	505,212.00	0.10
	日本	430,492.39	0.09
	英領バージン諸島	316,569.00	0.07
	スウェーデン	200,978.17	0.04
	小計	94,421,923.58	19.45
投資信託	アイルランド	185,671,339.42	38.26
	ルクセンブルグ	67,303,480.00	13.87
	イギリス	102,128.09	0.02
	シンガポール	61,625.38	0.01
	カナダ	33,316.44	0.01
	小計	253,171,889.33	52.16
短期金融商品	アメリカ合衆国	8,996,434.65	1.85
その他の有価証券	アイルランド	9,081,072.00	1.87
株式	日本	16,486,446.12	3.40
	イギリス	9,294,971.21	1.92
	カナダ	8,528,438.98	1.76
	フランス	8,252,803.30	1.70
	スイス	7,942,395.74	1.64
	ドイツ	6,446,303.56	1.33
	オーストラリア	5,212,112.00	1.07
	オランダ	4,670,489.94	0.96
	スウェーデン	2,738,795.85	0.56

デンマーク	2,001,696.00	0.41
香港	1,990,529.02	0.41
スペイン	1,653,992.80	0.34
イタリア	1,503,121.28	0.31
フィンランド	936,361.69	0.19
シンガポール	838,393.24	0.17
アイルランド	809,110.62	0.17
ベルギー	579,687.53	0.12
イスラエル	494,191.88	0.10
ノルウェー	473,362.65	0.10
ルクセンブルグ	206,061.27	0.04
ニュージーランド	205,813.46	0.04
オーストリア	161,514.23	0.03
ポルトガル	111,115.91	0.02
マン島	54,936.90	0.01
アメリカ合衆国	53,876.89	0.01
マカオ	23,293.10	0.00
ポーランド	10,388.87	0.00
中国	8,660.00	0.00
アラブ首長国連邦	0.01	0.00
小計	81,688,864.05	16.83
ポートフォリオ合計	447,360,183.61	92.17
現金・その他資産	37,989,790.42	7.83
資産総額	485,349,974.03	100.00
負債総額	1,622,649.63	0.33
合計(純資産総額)	483,727,324.40 (約55,638百万円)	99.67

(2) 運用実績

純資産等の推移

2021年12月末日までの1年間における各月末の資産総額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
2021年1月末日	501,508.78	57,684	492,575.12	56,656	104.03	11,966	115.05	13,233
2月末日	495,968.55	57,046	494,735.37	56,904	104.78	12,052	116.35	13,383
3月末日	509,249.03	58,574	503,480.63	57,910	106.28	12,224	118.49	13,629
4月末日	528,000.67	60,731	522,210.81	60,065	108.35	12,462	121.27	13,948
5月末日	540,863.43	62,210	530,090.61	60,971	108.86	12,521	122.33	14,070
6月末日	572,475.09	65,846	570,615.04	65,632	109.39	12,582	123.41	14,195
7月末日	618,947.24	71,191	617,516.29	71,027	108.66	12,498	123.17	14,167
8月末日	711,046.47	81,785	660,329.32	75,951	109.98	12,650	125.26	14,407
9月末日	651,785.55	74,968	649,530.42	74,709	106.42	12,240	121.75	14,004
10月末日	665,188.04	76,510	659,861.49	75,897	106.54	12,254	122.45	14,084
11月末日	651,377.33	74,921	638,706.69	73,464	103.90	11,951	119.96	13,798
12月末日	653,329.80	75,146	650,981.41	74,876	106.00	12,192	122.91	14,137

(フィクスト・インカム・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
2021年1月末日	111,418.38	12,815	111,376.71	12,811	259.08	29,799	10,530
2月末日	109,013.59	12,539	108,889.43	12,524	256.49	29,501	10,422
3月末日	102,642.50	11,806	102,602.53	11,801	254.79	29,306	10,345
4月末日	103,876.11	11,948	103,844.03	11,944	256.48	29,500	10,410
5月末日	103,216.93	11,872	102,844.43	11,829	257.58	29,627	10,451
6月末日	98,039.26	11,276	96,815.94	11,136	258.41	29,722	10,488
7月末日	95,250.91	10,956	94,015.58	10,814	259.91	29,895	10,546
8月末日	96,967.04	11,153	91,692.69	10,546	259.78	29,880	10,539
9月末日	89,263.83	10,267	89,200.30	10,260	258.01	29,676	10,464
10月末日	88,109.66	10,134	87,883.43	10,108	257.06	29,567	10,422
11月末日	88,832.10	10,217	88,778.63	10,211	256.18	29,466	10,383
12月末日	87,466.50	10,060	87,404.22	10,053	255.87	29,430	10,361

(インカム・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
2021年1月末日	127,071.20	14,616	124,151.08	14,280	126.10	14,504
2月末日	124,398.31	14,308	124,188.31	14,284	125.78	14,467
3月末日	124,243.63	14,291	123,809.08	14,241	125.70	14,458
4月末日	125,468.49	14,431	125,298.20	14,412	127.28	14,640
5月末日	127,719.93	14,690	126,960.19	14,603	128.27	14,754
6月末日	126,009.90	14,494	125,509.30	14,436	128.83	14,818
7月末日	146,519.56	16,853	146,444.39	16,844	129.30	14,872
8月末日	159,188.41	18,310	147,973.12	17,020	129.81	14,931
9月末日	149,026.34	17,141	147,431.89	16,958	128.77	14,811
10月末日	148,457.47	17,076	148,168.74	17,042	129.46	14,890
11月末日	124,748.60	14,349	124,672.19	14,340	128.08	14,732
12月末日	126,667.11	14,569	125,154.04	14,395	129.00	14,838

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

	資産総額		純資産総額		1口当たり純資産価格 (クラスP - a c c 投資証券)	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円
2021年1月末日	1,047,493.98	120,483	1,029,178.60	118,376	113.99	13,111
2月末日	1,022,210.96	117,575	1,012,696.34	116,480	114.34	13,151
3月末日	969,092.82	111,465	964,703.75	110,960	114.78	13,202
4月末日	998,866.54	114,890	988,603.24	113,709	116.74	13,427
5月末日	1,002,710.51	115,332	995,743.84	114,530	117.45	13,509
6月末日	996,449.55	114,612	992,860.34	114,199	118.60	13,641
7月末日	1,042,007.05	119,852	1,038,614.00	119,461	119.22	13,713
8月末日	1,140,698.24	131,203	1,062,304.64	122,186	120.08	13,812
9月末日	1,046,395.96	120,356	1,040,647.91	119,695	118.24	13,600
10月末日	1,061,041.24	122,041	1,046,916.17	120,416	119.58	13,754
11月末日	1,030,577.16	118,537	1,027,333.24	118,164	118.78	13,662
12月末日	1,021,694.26	117,515	1,019,106.94	117,218	120.09	13,813

(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
2021年1月末日	1,933,926.36	222,440	1,903,859.28	218,982	117.00	13,457
2月末日	1,903,938.49	218,991	1,869,821.20	215,067	118.09	13,583
3月末日	1,853,946.66	213,241	1,839,582.48	211,589	119.75	13,774
4月末日	1,939,436.21	223,074	1,914,619.15	220,219	122.88	14,134
5月末日	1,949,336.21	224,213	1,930,791.08	222,080	123.78	14,237
6月末日	1,931,640.46	222,177	1,925,427.29	221,463	125.46	14,430
7月末日	1,952,388.62	224,564	1,945,944.14	223,822	126.23	14,519
8月末日	2,183,001.95	251,089	1,968,955.54	226,469	127.90	14,711
9月末日	1,917,238.29	220,521	1,907,924.00	219,449	125.12	14,391
10月末日	2,006,608.78	230,800	1,964,467.25	225,953	127.92	14,713
11月末日	1,943,208.37	223,508	1,930,456.25	222,041	126.76	14,580
12月末日	1,999,400.31	229,971	1,993,620.10	229,306	129.01	14,839

(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
2021年1月末日	467,118.86	53,728	452,185.43	52,010	119.20	13,710
2月末日	435,589.55	50,102	423,665.48	48,730	121.23	13,944
3月末日	416,669.12	47,925	413,785.17	47,594	124.07	14,271
4月末日	435,815.96	50,128	429,474.95	49,398	128.16	14,741
5月末日	435,080.95	50,043	431,225.87	49,600	129.19	14,859
6月末日	438,829.57	50,474	436,869.90	50,249	131.69	15,147
7月末日	445,804.39	51,276	444,389.88	51,114	132.37	15,225
8月末日	510,433.07	58,710	448,095.21	51,540	134.92	15,518
9月末日	436,347.50	50,189	433,881.99	49,905	131.08	15,077
10月末日	461,360.01	53,066	452,549.47	52,052	135.45	15,579
11月末日	449,518.39	51,704	446,387.79	51,344	134.10	15,424
12月末日	485,349.97	55,825	483,727.32	55,638	137.32	15,795

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

2021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
2021年1月	0.42	48
2月	0.43	49
3月	0.43	49
4月	0.43	49
5月	0.43	49
6月	0.52	60
7月	0.52	60
8月	0.49	56
9月	0.49	56
10月	0.49	56
11月	0.44	51
12月	0.46	53

(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・サステナブル(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・サステナブル(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・ミディアム(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・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

2021年1月1日から2021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	6.36
	クラスP - a c c 投資証券	6.42
フィクスト・インカム・サステナブル(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	- 1.69
	クラス(日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券	- 2.09
インカム・サステナブル(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	1.87
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	5.23
システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	10.33
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	15.36

(注) 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$

a = 2021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 = 2020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、2021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

2021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、2021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 = 130.51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

2021年12月末日現在の株主資本総額は、500,000スイス・フラン (約6,288万円)

(注) スイス・フランの円貨換算は、便宜上、2021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 = 125.76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

2021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13億円)

(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

(2021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)

(2021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)

(2021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

(2021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)

(2021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
サリバ・ガイレ・フアド (Saliba Gaylee Fouad)	ヴァイス・チェアマン	2021年12月1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)

(2021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 (2020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 Achermann)	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 Eckehard Bluhm)	ディレクター/ ボード・メンバー	2016年4月25日就任	259,745株
ガブリエラ・フーパー (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。

管理会社は、本投資法人の所在地事務代行会社としても行為している。

2021年12月末日現在、管理会社は以下のとおり、412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	357	586,805,928.15 オーストラリア・ドル
			3,831,933,763.06 カナダ・ドル
			16,005,160,614.94 スイス・フラン
			23,509,686,436.51 中国元
			563,961,560.11 デンマーク・クローネ
			57,110,700,645.00 ユーロ
			1,926,172,021.91 英ポンド
			234,252,199.76 香港ドル
			647,494,719,469.26 日本円
			44,885,476.46 シンガポール・ドル
			147,856,431,143.50 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	55	506,966,292.16 オーストラリア・ドル
			215,490,778.80 スイス・フラン
			2,553,195,460.96 ユーロ
			2,448,682,973.59 英ポンド
			19,416,207,040.00 日本円
			35,174,571,540.76 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)

2021年12月末日現在、UBS アセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー (チューリッヒ) は120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	5,555,836,870
2	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	3,353,929,827
3	UBS (Lux) Money Market Fund - USD Sustainable	契約型投資信託	1988年11月29日	2,950,027,014

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	2,571,347,330
5	Focused Sicav - World Bank Long Term Bond USD	変動資本を有する投資法人	2018年 2 月13日	2,375,662,549
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	1,753,095,414
7	Focused Sicav - High Grade Long Term Bond EUR	変動資本を有する投資法人	2006年11月 2 日	1,679,264,026
8	UBS (Lux) Fund Solutions - Sustainable Development Bank Bonds UCITS ETF	変動資本を有する投資法人	2018年11月 8 日	1,607,678,909
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	1,541,612,069
10	Focused Sicav - High Grade Bond USD	変動資本を有する投資法人	2005年 8 月30日	1,455,957,963

(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)

2021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97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	6	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	42億スイス・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	4	54億スイス・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	35	375億スイス・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	41	219億スイス・フラン
アイルランド (ポートフォリオ・マネージャー)	ヘッジ・ファンド	2	10億スイス・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・サステナブル(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・サステナブル(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、2021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=115.02円)で換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

(1) 資産及び負債の状況

U B S (L u x) 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

	2021年11月30日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	577,997,749.57	66,481,301
投資有価証券、未実現評価(損)益	50,459,739.20	5,803,879
投資有価証券合計(注1)	628,457,488.77	72,285,180
現金預金、要求払預金および預託金勘定	17,759,111.15 *	2,042,653
有価証券売却未収金(注1)	2,939,577.85	338,110
発行未収金	96,199.99	11,065
有価証券に係る未収利息	6,622.32	762
配当金に係る未収金	525,207.67	60,409
その他の未収金	133,584.77	15,365
先渡為替契約に係る未実現利益(注1)	1,459,541.08	167,876
資産合計	651,377,333.60	74,921,421
負 債		
スワップに係る未実現損失(注1)	(1,126,502.71)	(129,570)
有価証券購入未払金(注1)	(1,102,000.49)	(126,752)
買戻未払金	(10,044,838.92)	(1,155,357)
定率報酬引当金(注2)	(301,661.21)	(34,697)
年次税引当金(注3)	(32,527.53)	(3,741)
その他の手数料および報酬引当金(注2)	(63,112.35)	(7,259)
引当金合計	(397,301.09)	(45,698)
負債合計	(12,670,643.21)	(1,457,377)
期末現在純資産	638,706,690.39	73,464,044

* 2021年11月30日現在、460,000.00米ドルの現金額が取引相手方であるユービーエス・エイ・ジーの担保として使用される。

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - フィクスト・インカム・サステナブル(米ドル) *

純資産計算書

	2021年11月30日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	85,899,179.84	9,880,124
投資有価証券、未実現評価(損)益	819,462.45	94,255
投資有価証券合計(注1)	86,718,642.29	9,974,378
現金預金、要求払預金および預託金勘定	1,260,515.48	144,984
その他の流動資産(マージン)	36,504.75	4,199
有価証券に係る未収利息	62,435.45	7,181
その他の未収金	22,350.51	2,571
流動資産に係る未収利息	129.92	15
金融先物に係る未実現利益(注1)	27,455.54	3,158
先渡為替契約に係る未実現利益(注1)	704,067.41	80,982
資産合計	88,832,101.35	10,217,468
負 債		
当座借越	(0.79)	(0)
当座借越に係る未払利息	(1,566.66)	(180)
定率報酬引当金(注2)	(38,716.34)	(4,453)
年次税引当金(注3)	(2,830.33)	(326)
その他の手数料および報酬引当金(注2)	(10,355.50)	(1,191)
引当金合計	(51,902.17)	(5,970)
負債合計	(53,469.62)	(6,150)
期末現在純資産	88,778,631.73	10,211,318

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

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 - インカム・サステナブル (米ドル) *

純資産計算書

	2021年11月30日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	120,860,400.58	13,901,363
投資有価証券、未実現評価(損)益	1,631,536.78	187,659
投資有価証券合計(注1)	122,491,937.36	14,089,023
現金預金、要求払預金および預託金勘定	1,692,384.04	194,658
その他の未収金	39,549.66	4,549
流動資産に係る未収利息	98.91	11
先渡為替契約に係る未実現利益(注1)	524,626.20	60,343
資産合計	124,748,596.17	14,348,584
負 債		
当座借越	(0.79)	(0)
当座借越に係る未払利息	(815.46)	(94)
定率報酬引当金(注2)	(58,538.22)	(6,733)
年次税引当金(注3)	(1,057.76)	(122)
その他の手数料および報酬引当金(注2)	(15,995.43)	(1,840)
引当金合計	(75,591.41)	(8,695)
負債合計	(76,407.66)	(8,788)
期末現在純資産	124,672,188.51	14,339,795

* 旧：U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ - インカム (米ドル)

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・ディフェンシブ(米ドル)

純資産計算書

	2021年11月30日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	885,375,853.96	101,835,931
投資有価証券、未実現評価(損)益	112,826,465.72	12,977,300
投資有価証券合計(注1)	998,202,319.68	114,813,231
現金預金、要求払預金および預託金勘定	16,150,499.72	1,857,630
その他の流動資産(マージン)	7,849,768.06	902,880
有価証券売却未収金(注1)	91,541.04	10,529
発行未収金	556,184.63	63,972
有価証券に係る未収利息	1,474,030.28	169,543
配当金に係る未収金	184,124.69	21,178
その他の未収金	170,828.88	19,649
先渡為替契約に係る未実現利益(注1)	5,897,859.61	678,372
資産合計	1,030,577,156.59	118,536,985
負 債		
金融先物に係る未実現損失(注1)	(1,496,699.67)	(172,150)
当座借越	(65,364.60)	(7,518)
有価証券購入未払金(注1)	(31,747.71)	(3,652)
買戻未払金	(957,705.47)	(110,155)
定率報酬引当金(注2)	(504,177.53)	(57,990)
年次税引当金(注3)	(48,143.58)	(5,537)
その他の手数料および報酬引当金(注2)	(140,081.89)	(16,112)
引当金合計	(692,403.00)	(79,640)
負債合計	(3,243,920.45)	(373,116)
期末現在純資産	1,027,333,236.14	118,163,869

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

	2021年11月30日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	335,980,111.46	38,644,432
投資有価証券、未実現評価(損)益	84,625,970.75	9,733,679
投資有価証券合計(注1)	420,606,082.21	48,378,112
現金預金、要求払預金および預託金勘定	14,498,106.12	1,667,572
その他の流動資産(マージン)	8,608,807.06	990,185
有価証券売却未収金(注1)	175,062.12	20,136
発行未収金	1,058,908.17	121,796
有価証券に係る未収利息	463,003.21	53,255
配当金に係る未収金	201,071.89	23,127
その他の未収金	156,576.62	18,009
先渡為替契約に係る未実現利益(注1)	3,750,768.40	431,413
資産合計	449,518,385.80	51,703,605
負 債		
金融先物に係る未実現損失(注1)	(2,278,602.43)	(262,085)
有価証券購入未払金(注1)	(50,133.57)	(5,766)
買戻未払金	(486,346.84)	(55,940)
定率報酬引当金(注2)	(256,486.04)	(29,501)
年次税引当金(注3)	(31,701.38)	(3,646)
その他の手数料および報酬引当金(注2)	(27,326.88)	(3,143)
引当金合計	(315,514.30)	(36,290)
負債合計	(3,130,597.14)	(360,081)
期末現在純資産	446,387,788.66	51,343,523

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・ミディアム(米ドル)

純資産計算書

	2021年11月30日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	1,554,491,330.89	178,797,593
投資有価証券、未実現評価(損)益	292,407,068.52	33,632,661
投資有価証券合計(注1)	1,846,898,399.41	212,430,254
現金預金、要求払預金および預託金勘定	54,134,313.34	6,226,529
その他の流動資産(マージン)	24,822,833.91	2,855,122
有価証券売却未収金(注1)	2,395,111.86	275,486
発行未収金	1,409,742.19	162,149
有価証券に係る未収利息	1,615,428.91	185,807
配当金に係る未収金	614,261.56	70,652
その他の未収金	460,358.65	52,950
先渡為替契約に係る未実現利益(注1)	10,857,915.20	1,248,877
資産合計	1,943,208,365.03	223,507,826
負 債		
金融先物に係る未実現損失(注1)	(5,775,411.01)	(664,288)
当座借越	(3,912,734.53)	(450,043)
有価証券購入未払金(注1)	(100,248.03)	(11,531)
買戻未払金	(1,438,629.98)	(165,471)
定率報酬引当金(注2)	(1,054,807.74)	(121,324)
年次税引当金(注3)	(104,847.10)	(12,060)
その他の手数料および報酬引当金(注2)	(365,439.77)	(42,033)
引当金合計	(1,525,094.61)	(175,416)
負債合計	(12,752,118.16)	(1,466,749)
期末現在純資産	1,930,456,246.87	222,041,078

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)

運用計算書

	自2021年 6 月 1 日 至2021年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	943.33	109
有価証券に係る利息	20,379.08	2,344
配当金	2,495,756.80	287,062
貸付証券に係る純収益	21,399.96	2,461
その他の収益(注4)	214,671.13	24,691
収益合計	2,753,150.30	316,667
費 用		
定率報酬(注2)	(3,516,602.88)	(404,480)
年次税(注3)	(100,332.05)	(11,540)
その他の手数料および報酬(注2)	(74,553.02)	(8,575)
現金および当座借越に係る利息	(1,602.67)	(184)
費用合計	(3,693,090.62)	(424,779)
投資純(損)益	(939,940.32)	(108,112)
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	8,379,702.87	963,833
オプションに係る実現(損)益	(1,606,915.24)	(184,827)
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	7,228.48	831
先渡為替契約に係る実現(損)益	2,921,250.39	336,002
スワップに係る実現(損)益	434,452.79	49,971
為替差(損)益	(652,148.24)	(75,010)
実現(損)益合計	9,483,571.05	1,090,800
当期実現純(損)益	8,543,630.73	982,688
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	(24,911,188.82)	(2,865,285)
オプションに係る未実現評価(損)益	620,218.62	71,338
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	(8,374.96)	(963)
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	1,450,928.26	166,886
スワップに係る未実現評価(損)益	(1,704,930.72)	(196,101)
未実現評価(損)益の変動合計	(24,553,347.62)	(2,824,126)
運用の結果による純資産の純増(減)	(16,009,716.89)	(1,841,438)

注記は当財務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・サステナブル(米ドル) *

運用計算書

	自2021年6月1日 至2021年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	129.92	15
有価証券に係る利息	475,906.15	54,739
配当金	144,638.72	16,636
貸付証券に係る純収益	5,506.12	633
その他の収益(注4)	6,800.32	782
収益合計	632,981.23	72,806
費 用		
定率報酬(注2)	(497,263.98)	(57,195)
年次税(注3)	(10,650.96)	(1,225)
その他の手数料および報酬(注2)	(10,517.26)	(1,210)
現金および当座借越に係る利息	(1,668.10)	(192)
費用合計	(520,100.30)	(59,822)
投資純(損)益	112,880.93	12,984
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	4,441,409.59	510,851
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	22,336.17	2,569
金融先物に係る実現(損)益	(3,266.07)	(376)
先渡為替契約に係る実現(損)益	(1,055,891.93)	(121,449)
為替差(損)益	(265,891.71)	(30,583)
実現(損)益合計	3,138,696.05	361,013
当期実現純(損)益	3,251,576.98	373,996
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	(5,698,117.72)	(655,398)
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	(18,586.17)	(2,138)
金融先物に係る未実現評価(損)益	27,455.54	3,158
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	908,375.70	104,481
未実現評価(損)益の変動合計	(4,780,872.65)	(549,896)
運用の結果による純資産の純増(減)	(1,529,295.67)	(175,900)

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

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 - インカム・サステナブル (米ドル) *

運用計算書

	自2021年 6 月 1 日 至2021年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	98.91	11
有価証券に係る利息	357,196.79	41,085
配当金	222,534.08	25,596
貸付証券に係る純収益	4,231.27	487
その他の収益(注4)	55,561.90	6,391
収益合計	639,622.95	73,569
費 用		
定率報酬(注2)	(770,813.71)	(88,659)
年次税(注3)	(9,323.27)	(1,072)
その他の手数料および報酬(注2)	(16,329.52)	(1,878)
現金および当座借越に係る利息	(3,326.65)	(383)
費用合計	(799,793.15)	(91,992)
投資純(損)益	(160,170.20)	(18,423)
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	14,932,393.90	1,717,524
オプションに係る実現(損)益	40,848.03	4,698
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	9,055.21	1,042
金融先物に係る実現(損)益	(531,631.57)	(61,148)
先渡為替契約に係る実現(損)益	310,972.37	35,768
為替差(損)益	(67,078.53)	(7,715)
実現(損)益合計	14,694,559.41	1,690,168
当期実現純(損)益	14,534,389.21	1,671,745
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	(15,235,665.24)	(1,752,406)
オプションに係る未実現評価(損)益	(117,513.78)	(13,516)
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	(7,534.93)	(867)
金融先物に係る未実現評価(損)益	285,969.47	32,892
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	577,622.25	66,438
未実現評価(損)益の変動合計	(14,497,122.23)	(1,667,459)
運用の結果による純資産の純増(減)	37,266.98	4,286

* 旧：U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ - インカム (米ドル)

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)

運用計算書

	自2021年6月1日 至2021年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	2.23	0
有価証券に係る利息	3,180,317.75	365,800
配当金	898,455.23	103,340
貸付証券に係る純収益	43,206.82	4,970
その他の収益(注4)	102,951.47	11,841
収益合計	4,224,933.50	485,952
費 用		
定率報酬(注2)	(6,156,128.88)	(708,078)
年次税(注3)	(146,564.53)	(16,858)
その他の手数料および報酬(注2)	(120,928.75)	(13,909)
現金および当座借越に係る利息	(18,411.61)	(2,118)
その他の費用	(184,548.96)	(21,227)
費用合計	(6,626,582.73)	(762,190)
投資純(損)益	(2,401,649.23)	(276,238)
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	5,275,356.02	606,771
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	84,429.91	9,711
金融先物に係る実現(損)益	7,392,981.41	850,341
先渡為替契約に係る実現(損)益	(23,456,661.10)	(2,697,985)
為替差(損)益	(6,897,836.46)	(793,389)
実現(損)益合計	(17,601,730.22)	(2,024,551)
当期実現純(損)益	(20,003,379.45)	(2,300,789)
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	(277,167.41)	(31,880)
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	(70,418.89)	(8,100)
金融先物に係る未実現評価(損)益	(5,865,078.14)	(674,601)
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	8,954,615.13	1,029,960
未実現評価(損)益の変動合計	2,741,950.69	315,379
運用の結果による純資産の純増(減)	(17,261,428.76)	(1,985,410)

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)

運用計算書

	自2021年6月1日 至2021年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	1.00	0
有価証券に係る利息	999,734.61	114,989
配当金	1,010,820.74	116,265
貸付証券に係る純収益	18,864.78	2,170
その他の収益(注4)	7,641.37	879
収益合計	2,037,062.50	234,303
費 用		
定率報酬(注2)	(3,078,431.57)	(354,081)
年次税(注3)	(93,901.81)	(10,801)
その他の手数料および報酬(注2)	(51,741.83)	(5,951)
現金および当座借越に係る利息	(17,492.32)	(2,012)
その他の費用	(88,360.05)	(10,163)
費用合計	(3,329,927.58)	(383,008)
投資純(損)益	(1,292,865.08)	(148,705)
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	3,095,103.03	355,999
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	32,650.18	3,755
金融先物に係る実現(損)益	6,597,013.65	758,789
先渡為替契約に係る実現(損)益	(8,658,371.10)	(995,886)
為替差(損)益	(3,209,889.01)	(369,201)
実現(損)益合計	(2,143,493.25)	(246,545)
当期実現純(損)益	(3,436,358.33)	(395,250)
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	8,986,196.03	1,033,592
利回り評価有価証券および短期金融商品に係る未実現評価(損)益	(27,873.81)	(3,206)
金融先物に係る未実現評価(損)益	(6,301,393.60)	(724,786)
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	5,598,162.67	643,901
未実現評価(損)益の変動合計	8,255,091.29	949,501
運用の結果による純資産の純増(減)	4,818,732.96	554,251

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・ミディアム(米ドル)

運用計算書

	自2021年6月1日 至2021年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	3.54	0
有価証券に係る利息	3,579,632.38	411,729
配当金	3,037,468.95	349,370
貸付証券に係る純収益	77,121.19	8,870
その他の収益(注4)	18,783.54	2,160
収益合計	6,713,009.60	772,130
費 用		
定率報酬(注2)	(12,830,922.23)	(1,475,813)
年次税(注3)	(312,369.25)	(35,929)
その他の手数料および報酬(注2)	(225,652.45)	(25,955)
現金および当座借越に係る利息	(53,065.10)	(6,104)
その他の費用	(161,166.96)	(18,537)
費用合計	(13,583,175.99)	(1,562,337)
投資純(損)益	(6,870,166.39)	(790,207)
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	8,752,231.38	1,006,682
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	118,542.81	13,635
金融先物に係る実現(損)益	20,906,322.69	2,404,645
先渡為替契約に係る実現(損)益	(38,892,109.20)	(4,473,370)
為替差(損)益	(8,328,344.39)	(957,926)
実現(損)益合計	(17,443,356.71)	(2,006,335)
当期実現純(損)益	(24,313,523.10)	(2,796,541)
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	23,486,463.80	2,701,413
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	(99,356.32)	(11,428)
金融先物に係る未実現評価(損)益	(18,836,772.74)	(2,166,606)
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	17,352,561.32	1,995,892
未実現評価(損)益の変動合計	21,902,896.06	2,519,271
運用の結果による純資産の純増(減)	(2,410,627.04)	(277,270)

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)

純資産変動計算書

	自2021年6月1日 至2021年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	530,090,612.88	60,971,022
発行額	181,677,769.01	20,896,577
買戻額	(42,673,589.96)	(4,908,316)
純発行(買戻)合計	139,004,179.05	15,988,261
支払配当金	(14,378,384.65)	(1,653,802)
投資純(損)益	(939,940.32)	(108,112)
実現(損)益合計	9,483,571.05	1,090,800
未実現評価(損)益の変動合計	(24,553,347.62)	(2,824,126)
運用の結果による純資産の純増(減)	(16,009,716.89)	(1,841,438)
期末現在純資産	638,706,690.39	73,464,044

発行済投資証券数の変動表

	自2021年6月1日 至2021年11月30日
クラスP - a c c	(口)
期首現在発行済投資証券数	474,026.9780
期中発行投資証券数	175,864.8670
期中買戻投資証券数	(23,387.7630)
期末現在発行済投資証券数	626,504.0820
クラスP - m d i s t	(口)
期首現在発行済投資証券数	2,182,895.0430
期中発行投資証券数	706,710.2660
期中買戻投資証券数	(221,501.8280)
期末現在発行済投資証券数	2,668,103.4810

注記は当財務書類と不可分のものである。

月次分配金¹UBS (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	2021年6月15日	2021年6月18日	米ドル	0.43
P - m d i s t	2021年7月15日	2021年7月20日	米ドル	0.52
P - m d i s t	2021年8月16日	2021年8月19日	米ドル	0.52
P - m d i s t	2021年9月15日	2021年9月20日	米ドル	0.49
P - m d i s t	2021年10月15日	2021年10月20日	米ドル	0.49
P - m d i s t	2021年11月15日	2021年11月18日	米ドル	0.49

¹ 注記5を参照

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)

最重要数値

	ISIN	2021年11月30日	2021年 5 月31日	2020年 5 月31日
純資産額 (米ドル)		638 706 690.39	530 090 612.88	488 867 866.14
クラス P - a c c	LU1917362490			
発行済投資証券数 (口)		626 504.0820	474 026.9780	626 008.1500
1 口当たり純資産価格 (米ドル)		119.96	122.33	100.50
1 口当たり発行・買戻価格 (米ドル) ²		119.96	122.60	99.95
クラス P - m d i s t	LU1917361179			
発行済投資証券数 (口)		2 668 103.4810	2 182 895.0430	2 316 940.9420
1 口当たり純資産価格 (米ドル)		103.90	108.86	93.87
1 口当たり発行・買戻価格 (米ドル) ²		103.90	109.10	93.35

² 注記 1 を参照

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)

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	38.61	投資信託	48.93
アメリカ合衆国	31.44	国債・中央政府債	5.45
アイルランド	10.89	インターネット・ソフトウェア・ITサービス	5.23
日本	3.50	医薬品・化粧品・医療品	4.73
イギリス	2.69	金融・持株会社	3.37
フランス	2.46	銀行・金融機関	3.21
オーストラリア	2.07	電子機器・半導体	2.56
		コンピュータハードウェア・ネットワーク装置供給業	2.22
ドイツ	2.06		
オランダ	1.32	小売り・百貨店	2.10
スイス	1.08	食品・清涼飲料	1.73
スペイン	0.53	エネルギー・水道	1.67
イタリア	0.46	通信	1.51
カナダ	0.32	自動車	1.50
フィンランド	0.28	保険	1.29
ベルギー	0.17	石油	1.03
香港	0.12	機械工学・産業機器	0.87
スウェーデン	0.09	不動産	0.84
シンガポール	0.09	たばこ・アルコール	0.82
オーストリア	0.05	その他の消費財	0.82
ポルトガル	0.03	化学	0.71
ニュージーランド	0.03	交通・運輸	0.70
アルゼンチン	0.03	建築業・資材	0.65
ノルウェー	0.02	繊維・衣服・革製品	0.65
バミューダ	0.01	バイオテクノロジー	0.65
マン島	0.01	電子部品・デバイス	0.60
デンマーク	0.01	航空宇宙産業	0.60
ジャージー	0.01	宿泊・仕出し・レジャー	0.55
パプアニューギニア	0.01	グラフィックデザイン・出版・メディア	0.52
イスラエル	0.01	その他のサービス業	0.48
合計	98.40	ヘルスケア・社会福祉	0.42
		鉱業・石炭・鉄鋼	0.38
		非鉄金属	0.29
		各種資本財	0.27
		各種貿易会社	0.26
		林業・紙・パルプ製品	0.22
		基金属・宝石	0.15
		その他の非分類会社	0.10
		ゴム・タイヤ	0.08
		環境サービス・リサイクル	0.08
		農業・漁業	0.07
		包装業	0.06
		写真・光学	0.02
		モーゲージ・資金調達機関	0.01
		合計	98.40

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ・フィクスト・インカム・サステナブル(米ドル)^{*}

純資産変動計算書

	自2021年6月1日 至2021年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	102,844,434.46	11,829,167
発行額	1,700,285.76	195,567
買戻額	(14,236,792.82)	(1,637,516)
純発行(買戻)合計	(12,536,507.06)	(1,441,949)
投資純(損)益	112,880.93	12,984
実現(損)益合計	3,138,696.05	361,013
未実現評価(損)益の変動合計	(4,780,872.65)	(549,896)
運用の結果による純資産の純増(減)	(1,529,295.67)	(175,900)
期末現在純資産	88,778,631.73	10,211,318

発行済投資証券数の変動表

	自2021年6月1日 至2021年11月30日
クラスP - a c c	(口)
期首現在発行済投資証券数	241,587.4350
期中発行投資証券数	6,624.5060
期中買戻投資証券数	(25,842.0020)
期末現在発行済投資証券数	222,369.9390
クラス(日本円・ヘッジ)P - a c c	(口)
期首現在発行済投資証券数	370,497.9290
期中発行投資証券数	0.0000
期中買戻投資証券数	(79,491.8230)
期末現在発行済投資証券数	291,006.1060

^{*} 旧: UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ・フィクスト・インカム(米ドル)

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 - フィクスト・インカム・サステナブル (米ドル) *

最重要数値

	ISIN	2021年11月30日	2021年 5 月31日	2020年 5 月31日
純資産額 (米ドル)		88 778 631.73	102 844 434.46	104 821 036.41
クラス P - a c c	LU0042745397			
発行済投資証券数 (口)		222 369.9390	241 587.4350	238 985.1700
1 口当たり純資産価格 (米ドル)		256.18	257.58	250.24
1 口当たり発行・買戻価格 (米ドル) ¹		256.18	257.58	250.24
クラス (日本円・ヘッジ) P - a c c	LU1203193534			
発行済投資証券数 (口)		291 006.1060	370 497.9290	418 030.8880
1 口当たり純資産価格 (日本円)		10 383	10 451	10 214
1 口当たり発行・買戻価格 (日本円) ¹		10 383	10 451	10 214

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 %)	業種別分布表	(純資産に対する 百分率 %)
ルクセンブルグ	61.53	投資信託	71.22
アメリカ合衆国	9.98	国際機関	25.88
アイルランド	9.68	金融・持株会社	0.58
国際機関	8.20	合計	97.68
フィリピン	5.87		
イギリス	1.31		
コートジボワール	1.11		
合計	97.68		

* 旧 : U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ - フィクスト・インカム (米ドル)

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ - インカム・サステナブル (米ドル) *

	自2021年 6 月 1 日 至2021年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	126,960,186.18	14,602,961
発行額	26,434,042.07	3,040,444
買戻額	(28,693,173.26)	(3,300,289)
純発行(買戻)合計	(2,259,131.19)	(259,845)
支払配当金	(66,133.46)	(7,607)
投資純(損)益	(160,170.20)	(18,423)
実現(損)益合計	14,694,559.41	1,690,168
未実現評価(損)益の変動合計	(14,497,122.23)	(1,667,459)
運用の結果による純資産の純増(減)	37,266.98	4,286
期末現在純資産	124,672,188.51	14,339,795

発行済投資証券数の変動表

	自2021年 6 月 1 日 至2021年11月30日
クラス P - a c c	(口)
期首現在発行済投資証券数	568,236.3420
期中発行投資証券数	51,164.0580
期中買戻投資証券数	(36,835.4300)
期末現在発行済投資証券数	582,564.9700

* 旧：U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ - インカム (米ドル)

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 - インカム・サステナブル (米ドル) *

最重要数値

	ISIN	2021年11月30日	2021年 5 月31日	2020年 5 月31日
純資産額 (米ドル)		124 672 188.51	126 960 186.18	124 799 844.54
クラス P - a c c	LU0994951548			
発行済投資証券数 (口)		582 564.9700	568 236.3420	584 895.7420
1 口当たり純資産価格 (米ドル)		128.08	128.27	117.41
1 口当たり発行・買戻価格 (米ドル) ¹		128.08	128.27	117.41

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 %)	業種別分布表	(純資産に対する 百分率 %)
ルクセンブルグ	89.76	投資信託	98.25
アイルランド	8.49	合計	98.25
合計	98.25		

* 旧 : U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ - インカム (米ドル)

U B S (L u x) 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2021年 6 月 1 日 至2021年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	995,743,841.16	114,530,457
発行額	129,940,749.69	14,945,785
買戻額	(78,715,732.82)	(9,053,884)
純発行(買戻)合計	51,225,016.87	5,891,901
支払配当金	(2,374,193.13)	(273,080)
投資純(損)益	(2,401,649.23)	(276,238)
実現(損)益合計	(17,601,730.22)	(2,024,551)
未実現評価(損)益の変動合計	2,741,950.69	315,379
運用の結果による純資産の純増(減)	(17,261,428.76)	(1,985,410)
期末現在純資産	1,027,333,236.14	118,163,869

発行済投資証券数の変動表

	自2021年 6 月 1 日 至2021年11月30日
	(口)
クラスP - a c c	
期首現在発行済投資証券数	2,881,176.7780
期中発行投資証券数	158,998.1440
期中買戻投資証券数	(143,357.3280)
期末現在発行済投資証券数	2,896,817.5940

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・ディフェンシブ(米ドル)

最重要数値

	ISIN	2021年11月30日	2021年 5 月31日	2020年 5 月31日
純資産額(米ドル)		1 027 333 236.14	995 743 841.16	1 089 453 896.73
クラス P - a c c	LU1599185649			
発行済投資証券数(口)		2 896 817.5940	2 881 176.7780	3 251 483.0880
1口当たり純資産価格(米ドル)		118.78	117.45	106.66
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) ¹		118.78	117.45	105.86

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 %)	地域別分布表	(純資産に対する 百分率 %)
ルクセンブルグ	43.56	国際機関	0.46
アイルランド	18.09	シンガポール	0.37
アメリカ合衆国	17.87	ケイマン諸島	0.32
カナダ	2.87	スウェーデン	0.24
ドイツ	2.02	ジャージー	0.18
日本	1.45	香港	0.16
韓国	1.28	デンマーク	0.16
オーストラリア	1.23	スペイン	0.13
アラブ首長国連邦	0.97	イタリア	0.12
フランス	0.94	フィンランド	0.07
イギリス	0.86	ベルギー	0.05
フィリピン	0.72	イスラエル	0.03
カタール	0.72	英領ヴァージン諸島	0.03
スイス	0.62	ニュージーランド	0.02
ノルウェー	0.58	オーストリア	0.01
オランダ	0.55	ポルトガル	0.01
クウェート	0.47	合計	97.16

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	56.34	通信	0.22
国債・中央政府債	9.56	機械工学・産業機器	0.19
金融・持株会社	7.82	不動産	0.17
銀行・金融機関	4.87	たばこ・アルコール	0.16
国際機関	3.93	建築業・資材	0.15
郡・連邦州	2.00	繊維・衣服・革製品	0.14
インターネット・ソフトウェア・ITサービス	1.77	電子部品・デバイス	0.13
石油	1.69	鉱業・石炭・鉄鋼	0.10
コンピュータハードウェア・ネットワーク装置供給業	1.54	グラフィックデザイン・出版・メディア	0.09
医薬品・化粧品・医療品	1.04	各種貿易会社	0.07
その他のサービス業	0.90	非鉄金属	0.06
食品・清涼飲料	0.56	基金属・宝石	0.06
電子機器・半導体	0.48	航空宇宙産業	0.05
交通・運輸	0.39	各種資本財	0.04
モーゲージ・資金調達機関	0.34	宿泊・仕出し・レジャー	0.04
公共・非営利機関	0.33	時計・宝飾品	0.03
小売り・百貨店	0.28	林業・紙・パルプ製品	0.03
保険	0.27	ゴム・タイヤ	0.02
バイオテクノロジー	0.27	農業・漁業	0.02
エネルギー・水道	0.25	ヘルスケア・社会福祉	0.02
自動車	0.25	その他の非分類会社	0.02
化学	0.24	写真・光学	0.01
その他の消費財	0.22	合計	97.16

U B S (L u x) 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)

純資産変動計算書

	自2021年6月1日 至2021年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	431,225,866.64	49,599,599
発行額	38,821,486.77	4,465,247
買戻額	(28,087,652.46)	(3,230,642)
純発行(買戻)合計	10,733,834.31	1,234,606
支払配当金	(390,645.25)	(44,932)
投資純(損)益	(1,292,865.08)	(148,705)
実現(損)益合計	(2,143,493.25)	(246,545)
未実現評価(損)益の変動合計	8,255,091.29	949,501
運用の結果による純資産の純増(減)	4,818,732.96	554,251
期末現在純資産	446,387,788.66	51,343,523

発行済投資証券数の変動表

	自2021年6月1日 至2021年11月30日
クラスP - a c c	(口)
期首現在発行済投資証券数	1,038,007.6140
期中発行投資証券数	78,690.4710
期中買戻投資証券数	(63,432.9100)
期末現在発行済投資証券数	1,053,265.1750

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	2021年11月30日	2021年 5 月31日	2020年 5 月31日
純資産額(米ドル)		446 387 788.66	431 225 866.64	490 288 568.55
クラス P - a c c	LU1599187934			
発行済投資証券数(口)		1 053 265.1750	1 038 007.6140	1 456 136.2970
1口当たり純資産価格(米ドル)		134.10	129.19	104.88
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) ¹		134.10	129.19	104.88

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 %)	地域別分布表	(純資産に対する 百分率 %)
アイルランド	40.72	デンマーク	0.43
ルクセンブルグ	15.29	ノルウェー	0.41
アメリカ合衆国	11.65	国際機関	0.38
日本	3.73	スペイン	0.35
カナダ	3.44	イタリア	0.32
ドイツ	3.18	クウェート	0.29
イギリス	2.10	ケイマン諸島	0.28
フランス	2.04	フィンランド	0.20
オーストラリア	1.74	ベルギー	0.12
スイス	1.66	ジャージー	0.11
オランダ	1.22	イスラエル	0.09
韓国	0.96	英領ヴァージン諸島	0.07
アラブ首長国連邦	0.81	ニュージーランド	0.05
スウェーデン	0.60	オーストリア	0.03
フィリピン	0.56	ポルトガル	0.02
カタール	0.46	マン島	0.01
シンガポール	0.45	マカオ	0.01
香港	0.44	合計	94.22

業種別分布表		業種別分布表	
(純資産に対する 百分率 %)		(純資産に対する 百分率 %)	
投資信託	52.90	繊維・衣服・革製品	0.38
銀行・金融機関	6.27	バイオテクノロジー	0.35
金融・持株会社	5.94	電子部品・デバイス	0.34
国債・中央政府債	5.57	公共・非営利機関	0.30
国際機関	3.13	鉱業・石炭・鉄鋼	0.28
医薬品・化粧品・医療品	1.92	その他の消費財	0.28
インターネット・ソフトウェア・ITサービス	1.76	モーゲージ・資金調達機関	0.26
郡・連邦州	1.50	グラフィックデザイン・出版・メディア	0.24
石油	1.35	各種貿易会社	0.19
電子機器・半導体	1.28	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		航空宇宙産業	0.14
供給業	1.09	基金属・宝石	0.12
食品・清涼飲料	0.83	宿泊・仕出し・レジャー	0.12
保険	0.75	各種資本財	0.12
交通・運輸	0.72	時計・宝飾品	0.09
その他のサービス業	0.68	林業・紙・パルプ製品	0.08
エネルギー・水道	0.67	ゴム・タイヤ	0.06
自動車	0.66	農業・漁業	0.05
化学	0.65	ヘルスケア・社会福祉	0.05
通信	0.59	その他の非分類会社	0.04
機械工学・産業機器	0.52	写真・光学	0.02
小売り・百貨店	0.46	環境サービス・リサイクル	0.01
不動産	0.46	包装業	0.01
建築業・資材	0.41	合計	94.22
たばこ・アルコール	0.41		

U B S (L u x) 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)

純資産変動計算書

	自2021年6月1日 至2021年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	1,930,791,077.91	222,079,590
発行額	145,732,756.67	16,762,182
買戻額	(139,222,720.17)	(16,013,397)
純発行(買戻)合計	6,510,036.50	748,784
支払配当金	(4,434,240.50)	(510,026)
投資純(損)益	(6,870,166.39)	(790,207)
実現(損)益合計	(17,443,356.71)	(2,006,335)
未実現評価(損)益の変動合計	21,902,896.06	2,519,271
運用の結果による純資産の純増(減)	(2,410,627.04)	(277,270)
期末現在純資産	1,930,456,246.87	222,041,078

発行済投資証券数の変動表

	自2021年6月1日 至2021年11月30日
クラスP - a c c	(口)
期首現在発行済投資証券数	4,457,096.7330
期中発行投資証券数	214,722.5990
期中買戻投資証券数	(227,321.5230)
期末現在発行済投資証券数	4,444,497.8090

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・ミディアム(米ドル)

最重要数値

	ISIN	2021年11月30日	2021年 5 月31日	2020年 5 月31日
純資産額(米ドル)		1 930 456 246.87	1 930 791 077.91	2 011 788 426.80
クラス P - a c c	LU1599186969			
発行済投資証券数(口)		4 444 497.8090	4 457 096.7330	5 432 559.8130
1口当たり純資産価格(米ドル)		126.76	123.78	105.57
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) ¹		126.76	123.78	105.57

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 %)	地域別分布表	(純資産に対する 百分率 %)
ルクセンブルグ	35.36	香港	0.30
アイルランド	29.98	国際機関	0.30
アメリカ合衆国	11.59	デンマーク	0.29
日本	2.54	カタール	0.27
カナダ	2.51	スペイン	0.24
ドイツ	1.96	イタリア	0.22
イギリス	1.43	ケイマン諸島	0.17
フランス	1.40	フィンランド	0.14
オーストラリア	1.25	ベルギー	0.09
スイス	1.14	ジャージー	0.08
オランダ	0.84	イスラエル	0.07
韓国	0.81	英領ヴァージン諸島	0.04
アラブ首長国連邦	0.62	ニュージーランド	0.03
フィリピン	0.49	オーストリア	0.02
スウェーデン	0.43	ポルトガル	0.02
ノルウェー	0.35	マン島	0.01
クウェート	0.35	合計	95.67
シンガポール	0.33		

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	61.31	バイオテクノロジー	0.28
国債・中央政府債	6.80	繊維・衣服・革製品	0.26
金融・持株会社	5.71	電子部品・デバイス	0.23
銀行・金融機関	4.02	モーゲージ・資金調達機関	0.21
国際機関	2.66	その他の消費財	0.20
医薬品・化粧品・医療品	1.38	鉱業・石炭・鉄鋼	0.19
インターネット・ソフトウェア・ITサービス	1.29	グラフィックデザイン・出版・メディア	0.17
石油	1.23	公共・非営利機関	0.16
郡・連邦州	1.22	各種貿易会社	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	0.92	非鉄金属	0.12
電子機器・半導体	0.88	航空宇宙産業	0.10
その他のサービス業	0.67	基金属・宝石	0.08
食品・清涼飲料	0.64	宿泊・仕出し・レジャー	0.08
保険	0.51	各種資本財	0.08
エネルギー・水道	0.46	時計・宝飾品	0.06
自動車	0.46	林業・紙・パルプ製品	0.06
化学	0.44	ゴム・タイヤ	0.04
交通・運輸	0.43	農業・漁業	0.04
小売り・百貨店	0.41	ヘルスケア・社会福祉	0.03
通信	0.40	その他の非分類会社	0.03
機械工学・産業機器	0.36	写真・光学	0.02
不動産	0.31	環境サービス・リサイクル	0.01
建築業・資材	0.29	包装業	0.01
たばこ・アルコール	0.28	合計	95.67

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

財務書類に対する注記

2021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出入額の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原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係る実際の費用は、入手可能な最新の価格または該当する場合は投資証券 1 口当たり純資産価格を計算するために用いられる純資産価額とは異なることがある。当該費用は、サブ・ファンドの価値にマイナスの影響を及ぼすものであり「希薄化」と称される。希薄化の影響を軽減するために、取締役会はその裁量により、投資証券 1 口当たり純資産価格に対して希薄化調整を行うことができる。

投資証券は、通常、単一の価格である純資産価格に基づいて発行され、買い戻される。しかしながら、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、以下に記載するとおり評価日に調整される。これは、サブ・ファンドが関連する評価日において正味申込ポジションにあるかまたは正味買戻ポジションにあるかに関係なく行われる。特定の評価日において、いずれかのサブ・ファンドまたはサブ・ファンドのクラスにおいて取引が行われない場合、未調整の投資証券 1 口当たり純資産価格が適用される。かかる希薄化調整が行われる状況は、取締役会の裁量により決定される。希薄化調整を実行するための要件は、通常、関連するサブ・ファンドにおける投資証券の申込みまたは買戻しの規模に左右される。取締役会は、その見解において、既存の投資主（申込みの場合）または残存する投資主（買戻しの場合）が損害を被る可能性がある場合、希薄化調整を行うことができる。希薄化調整は、以下の場合に行われることがある。

- (a) サブ・ファンドが一定の下落(すなわち買戻しによる純流出)を記録した場合。
- (b) サブ・ファンドがその規模に比べて大量の正味申込みを記録した場合。
- (c) サブ・ファンドが特定の評価日において正味申込ポジションまたは正味買戻ポジションを示した場合。または、
- (d) 投資主の利益のために希薄化の調整が必要であると取締役会が確信するその他のあらゆる場合。

評価額調整が行われる場合、サブ・ファンドが正味申込ポジションにあるかまたは正味買戻ポジションにあるかに応じて、投資証券1口当たり純資産価格に価値が加算されるかまたは投資証券1口当たり純資産価格から価値が控除される。評価額調整の範囲は、取締役会の意見において、報酬および手数料ならびに売買価格のスプレッドを十分にカバーするものとする。特に、各サブ・ファンドの純資産価額は、() 見積もり税金費用、() サブ・ファンドが負担する可能性がある取引費用および() サブ・ファンドが投資する資産の想定売買スプレッドを反映する金額分が(上方または下方に)調整される。一部の株式市場および国々では買主および売主の側に異なる手数料体系を示すことがあるため、純流入および純流出の調整は異なることがある。調整は通常、その時点の投資証券1口当たり実勢純資産価格の最大2%に制限されるものとする。取締役会は、例外的な状況(例えば、高い市場ボラティリティおよび/または流動性、例外的な市況、市場の混乱等)において、サブ・ファンドおよび/または評価日に関して、その時点の投資証券1口当たり実勢純資産価格の2%を超える希薄化調整を一時的に適用することを決定することができる。ただし、当該調整が実勢の市況を代表するものであることおよび投資主の最善の利益に資するもの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。当該希薄化調整は、取締役会が決定し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終了した時点で、通常の連絡経路を通じて通知される。

サブ・ファンドの各クラスの純資産価額は個別に計算される。ただし、希薄化調整は、各クラスの純資産価額に対してパーセンテージの点において同程度の影響を及ぼす。希薄化調整はサブ・ファンドのレベルで行われ資本活動に関連するが、各個人投資者の取引の特定の状況には関連しない。

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) 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) モーゲージ担保证券

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2021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、2021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	=	1.041630	スイス・フラン
1 ユーロ	=	1.125600	米ドル

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・サステナブル (米ドル)²

	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%

² 旧: UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - フィクスト・インカム (米ドル)

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - インカム・サステナブル(米ドル)⁵

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%
------------------	--------	--------

⁵ 旧: UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - インカム(米ドル)

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)

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)

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)

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。

2. 上限定率管理報酬は、以下の報酬および本投資法人の資産にも請求される追加費用を含まない。

- a) 資産の売買のための本投資法人の資産の管理に関する一切の追加の費用(市場、手数料、報酬等に合致する買呼値/売呼値スプレッド、仲介手数料)。かかる費用は、通常、各資産の売買時点で計算される。本書の記載にかかわらず、投資証券の発行および買戻しの決済に関する資産の売買によって生じるかかる追加の費用は、販売目論見書の「純資産価額、発行、買戻しおよび転換価格」の項に基づくスイング・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。

本投資法人の取締役を支払われる報酬、コストおよび費用(合理的な立替費用、保険料および取締役会に関連する合理的な交通費ならびに取締役の報酬を含む)。

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・ファンドの两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

2021年6月1日から2021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

2021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・サステナブル(米ドル) ²	1 338 235.12 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・ディフェンシブ(米ドル)	218 734.38 米ドル	103 655 554.84 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	91 015 234.65 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	290 244 438.22 米ドル

² 旧：UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - フィクスト・インカム(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)
- 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)	114 847 740.92 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)	114 886 346.61 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)	342 837 303.07 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)	38 697 574.46 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	25 332 648.09 米ドル

注8 - 総費用比率(TER)

この比率は、スイス・アセット・マネジメント協会(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T E R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 (T E R)
- ダイナミック・インカム (米ドル) P - a c c	1.47%
- ダイナミック・インカム (米ドル) P - m d i s t	1.47%
- フィクスト・インカム・サステナブル (米ドル) ² P - a c c	1.21%
- フィクスト・インカム・サステナブル (米ドル) ² (日本円・ヘッジ) P - a c c	1.26%
- インカム・サステナブル (米ドル) ⁶ P - a c c	1.45%
- 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	1.64%
- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ ・ダイナミック (米ドル) P - a c c	1.90%
- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ ・ミディアム (米ドル) P - a c c	1.80%

² 旧：UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - フィクスト・インカム (米ドル)

⁶ 旧：UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - インカム (米ドル)

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、T E R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T E Rは、年率換算されている。

注9 - 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10 - 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。

U B S ヨーロッパ S E ルクセンブルグ支店は貸付証券機関として行為する。

U B S (Lux) ストラテジー・シキャブ	2021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		2021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)	56 467 595.47 米ドル	60 695 489.12 米ドル	43.98	56.02	0.00
- フィクスト・インカム ・サステナブル(米ドル) ²	5 921 756.94 米ドル	6 365 136.16 米ドル	43.98	56.02	0.00
- 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)	117 760 295.63 米ドル	126 577 352.60 米ドル	43.98	56.02	0.00
- 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)	46 391 931.50 米ドル	49 865 430.79 米ドル	43.98	56.02	0.00
- 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)	172 610 726.40 米ドル	185 534 595.17 米ドル	43.98	56.02	0.00

U B S (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
・サステナブル(米ドル)²

貸付証券収益	35 666.60 米ドル	9 176.87 米ドル
貸付証券コスト	14 266.64 米ドル	3 670.75 米ドル
純貸付証券収益	21 399.96 米ドル	5 506.12 米ドル

U B S (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) - 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) - 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)

貸付証券収益	72 011.37 米ドル	31 441.30 米ドル	128 535.32 米ドル
貸付証券コスト	28 804.55 米ドル	12 576.52 米ドル	51 414.13 米ドル
純貸付証券収益	43 206.82 米ドル	18 864.78 米ドル	77 121.19 米ドル

² 旧: U B S (Lux) ストラテジー・シキャブ - フィクスト・インカム(米ドル)

[次へ](#)

(2) 投資有価証券明細表等

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)

2021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	2 250.00	173 655.21	0.03
AUD AGL ENERGY NPV	7 218.00	27 636.78	0.00
AUD APA GROUP NPV	11 675.00	78 890.85	0.01
AUD ARISTOCRAT LEISURE NPV	6 323.00	197 759.38	0.03
AUD ASX LTD NPV	3 134.00	200 950.17	0.03
AUD AURIZON HOLDINGS NPV	21 981.00	52 523.57	0.01
AUD AUSNET SERVICES NPV	12 564.00	22 627.60	0.00
AUD AUST & NZ BANK GRP NPV	29 762.00	563 443.32	0.09
AUD BLUESCOPE STEEL NPV	4 887.00	68 505.57	0.01
AUD BRAMBLES LTD NPV	14 827.00	105 235.97	0.02
AUD CMNWLTH BK OF AUST NPV	18 435.00	1 217 987.16	0.19
AUD COCHLEAR LTD NPV	623.00	96 210.57	0.02
AUD COMPUTERSHARE LTD NPV(POST REC)	8 037.00	108 786.94	0.02
AUD CROWN RESORTS LTD NPV	2 771.00	21 651.85	0.00
AUD CSL NPV	4 716.00	1 025 868.88	0.16
AUD DOMINOS PIZZA ENT NPV	524.00	48 196.45	0.01
AUD ENDEAVOUR GROUP LI NPV	11 459.00	55 656.28	0.01
AUD EVOLUTION MINING NPV	33 492.00	95 702.44	0.01
AUD FORTESCUE METALS G NPV	26 127.00	315 116.19	0.05
AUD GOODMAN GROUP (STAPLED SECURITY)	17 401.00	304 629.64	0.05
AUD GPT GROUP NPV (STAPLED SECURITIES)	22 169.00	82 838.76	0.01
AUD INSURANCE AUST GRP NPV	27 987.00	87 909.73	0.01
AUD LEND LEASE GROUP NPV	6 376.00	48 283.24	0.01
AUD MACQUARIE GP LTD NPV	3 554.00	495 777.66	0.08
AUD MAGELLAN FINANCIAL NPV	1 835.00	43 144.70	0.01
AUD MEDIBANK PRIVATE L NPV	38 988.00	95 373.32	0.01
AUD MIRVAC GROUP STAPLED SECURITIES	42 713.00	86 616.97	0.01
AUD NATL AUSTRALIA BK NPV	34 500.00	667 818.74	0.10
AUD NEWCREST MINING NPV	12 666.00	212 127.14	0.03
AUD NTHN STAR RES LTD NPV	12 765.00	85 441.66	0.01
AUD ORICA LIMITED NPV	5 027.00	50 471.82	0.01
AUD ORIGIN ENERGY NPV	15 839.00	53 907.09	0.01
AUD QANTAS AIRWAYS NPV	12 414.00	44 538.86	0.01
AUD QBE INS GROUP NPV	16 093.00	132 592.82	0.02
AUD RAMSAY HEALTH CARE NPV	2 152.00	101 959.01	0.02
AUD REA GROUP LIMITED NPV	555.00	63 904.16	0.01
AUD REECE AUSTRALIA NPV	2 591.00	43 026.02	0.01
AUD RIO TINTO LIMITED NPV	5 815.00	385 512.26	0.06
AUD SANTOS LIMITED NPV	21 533.00	97 409.67	0.02
AUD SCENTRE GROUP NPV STAPLED UNIT	55 518.00	121 637.97	0.02
AUD SEEK LIMITED NPV	3 276.00	80 835.10	0.01
AUD SONIC HEALTHCARE NPV	7 775.00	235 399.28	0.04
AUD SOUL PATTINSON(WH) NPV	3 788.00	83 477.19	0.01
AUD SOUTH32 LTD NPV	48 090.00	120 366.70	0.02
AUD STOCKLAND NPV (STAPLED)	27 857.00	86 316.27	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 (%)
AUD SUNCORP GROUP LTD NPV	13 440.00	103 110.62	0.02
AUD SYDNEY AIRPORT NPV(STAPLED SECURITY)	15 225.00	89 600.88	0.01
AUD TABCORP HLDGS LTD NPV	19 376.00	68 417.99	0.01
AUD TELSTRA CORP NPV	37 617.00	108 556.40	0.02
AUD TRANSURBAN GROUP STAPLED UNITS NPV	31 814.00	308 138.41	0.05
AUD TREASURY WINE ESTA NPV	10 833.00	92 941.78	0.01
AUD VICINITY CENTRES NPV (STAPLED SECURITY)	34 618.00	41 605.29	0.01
AUD WESFARMERS LTD NPV	17 604.00	709 733.13	0.11
AUD WESTPAC BKG CORP NPV	38 412.00	558 883.31	0.09
AUD WISETECH GLOBAL LT NPV	1 514.00	56 326.63	0.01
AUD WOODSIDE PETROLEUM NPV	9 472.00	143 926.49	0.02
AUD WOOLWORTHS GRP LTD NPV	19 803.00	573 166.57	0.09
オーストラリア合計		11 242 128.46	1.76
オーストリア			
EUR ERSTE GROUP BK AG NPV	2 474.00	107 407.21	0.02
EUR OMV AG NPV(VAR)	1 479.00	78 193.89	0.01
EUR RAIFFEISEN BK INTL NPV (REGD)	919.00	27 122.66	0.00
EUR VERBUND AG CLASS ' A ' NPV	568.00	59 139.02	0.01
EUR VOESTALPINE AG NPV	1 147.00	38 576.97	0.01
オーストリア合計		310 439.75	0.05
ベルギー			
EUR ANHEUSER-BUSCH IN NPV	5 850.00	324 332.35	0.05
EUR COLRUYT SA NPV	1 033.00	48 067.87	0.01
EUR ELIA SYS OPERATOR NPV	278.00	34 389.56	0.01
EUR GPE BRUXELLES LAM NPV	842.00	90 529.57	0.01
EUR PROXIMUS SA NPV	1 095.00	19 745.16	0.00
EUR SOFINA NPV	134.00	61 659.47	0.01
EUR SOLVAY SA NPV	569.00	63 354.94	0.01
EUR UMICORE NPV	1 301.00	62 984.08	0.01
ベルギー合計		705 063.00	0.11
カナダ			
CAD ALGONQUIN PWR&UTIL COM NPV	3 900.00	52 565.48	0.01
CAD B2GOLD CORP COM NPV	3 700.00	14 594.64	0.00
CAD HYDRO ONE INC COM NPV	2 025.00	49 298.99	0.01
CAD IGM FINANCIAL INC COM	561.00	20 191.28	0.00
CAD KEYERA CORPORATION COM NPV	1 276.00	27 911.26	0.00
CAD TELUS CORPORATION NPV	2 570.00	58 500.16	0.01
カナダ合計		223 061.81	0.03
フィンランド			
EUR KESKO OYJ EUR2 SER ' B '	3 647.00	113 874.45	0.02
EUR KONE CORPORATION NPV ORD ' B '	4 844.00	317 548.15	0.05
EUR WARTSILA OYJ ABP SER ' B ' EUR3.50	3 669.00	50 734.92	0.01
フィンランド合計		482 157.52	0.08
フランス			
EUR ACCOR EUR3	1 312.00	38 647.52	0.01
EUR ADP EUR3	330.00	38 296.29	0.01
EUR AIR LIQUIDE(L ') EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)	3 659.00	600 569.94	0.09
EUR AIRBUS EUR1	4 587.00	509 703.92	0.08
EUR ALSTOM EUR7.00	2 720.00	96 380.18	0.01
EUR AMUNDI EUR2.5 (AIW)	342.00	28 274.96	0.00

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 (%)
EUR ARKEMA EUR10	754.00	98 110.00	0.02
EUR AXA EUR2.29	15 762.00	432 010.57	0.07
EUR BIOMERIEUX NPV (POST SPLIT)	338.00	47 632.69	0.01
EUR BNP PARIBAS EUR2	8 758.00	542 978.90	0.08
EUR BOLLORE EURO.16	8 573.00	45 701.31	0.01
EUR BOUYGUES EUR1	2 794.00	94 190.55	0.01
EUR BUREAU VERITAS EURO.12	2 664.00	83 840.81	0.01
EUR CAPGEMINI EUR8	1 258.00	289 006.58	0.04
EUR CARREFOUR EUR2.50	4 164.00	68 523.92	0.01
EUR CIE DE ST-GOBAIN EUR4	3 947.00	249 593.31	0.04
EUR CNP ASSURANCES EUR1	1 223.00	29 693.45	0.00
EUR COVIVIO EUR3	400.00	32 966.57	0.00
EUR CREDIT AGRICOLE SA EUR3	8 467.00	114 994.47	0.02
EUR DANONE EURO.25	8 667.00	507 192.35	0.08
EUR EDENRED EUR2	1 964.00	87 366.01	0.01
EUR EDF EURO.5	2 797.00	39 007.48	0.01
EUR EIFFAGE EUR4	645.00	59 692.71	0.01
EUR ENGIE EUR1	13 959.00	201 273.93	0.03
EUR ESSILORLUXOTTICA EURO.18	2 249.00	448 121.60	0.07
EUR EURAZEO NPV	237.00	19 300.61	0.00
EUR FAURECIA EUR7	871.00	37 157.07	0.01
EUR GETLINK SE EURO.40	4 269.00	62 707.68	0.01
EUR HERMES INTL NPV	254.00	472 596.67	0.07
EUR IPSEN EUR1	361.00	35 002.27	0.01
EUR KERING EUR4	597.00	457 889.35	0.07
EUR KLEPIERRE EUR1.40	1 495.00	31 442.60	0.00
EUR L ' OREAL EURO.20	2 022.00	904 695.37	0.14
EUR LEGRAND SA EUR4	2 003.00	218 197.94	0.03
EUR LVMH MOET HENNESSY EURO.30	2 172.00	1 678 601.88	0.26
EUR ORANGE EUR4	15 762.00	168 723.64	0.03
EUR ORPEA EUR2.5	389.00	36 517.39	0.01
EUR PERNOD RICARD EUR1.55	1 697.00	386 804.00	0.06
EUR PUBLICIS GROUPE SA EURO.40	1 617.00	104 000.24	0.02
EUR REMY COINTREAU EUR1.60	154.00	35 881.88	0.01
EUR RENAULT SA EUR3.81	1 384.00	44 335.85	0.01
EUR SAFRAN EURO.20	2 753.00	306 097.17	0.05
EUR SANOFI EUR2	15 306.00	1 444 776.44	0.23
EUR SARTORIUS STEDIM B EURO.20 (POST SUBD)	229.00	134 397.32	0.02
EUR SCHNEIDER ELECTRIC EUR8	7 362.00	1 294 543.15	0.20
EUR SEB SA EUR1	268.00	39 487.40	0.01
EUR SOC GENERALE EUR1.25	6 080.00	188 508.28	0.03
EUR SODEXO EUR4	634.00	52 837.19	0.01
EUR SUEZ EUR4	2 648.00	58 821.92	0.01
EUR TELEPERFORMANCE EUR2.50	462.00	188 613.87	0.03
EUR THALES EUR3	883.00	72 038.22	0.01
EUR TOTALENERGIES SE EUR2.5	19 908.00	910 006.94	0.14
EUR UBISOFT ENTERTAIN EURO.31	836.00	42 636.78	0.01
EUR UNIBAIL-RODAMCO-WE NPV(1 ORD UNIBAIL-R & 1CLS)	999.00	65 444.41	0.01
EUR VALEO EUR1 (POST SUBD)	1 595.00	45 852.78	0.01
EUR VEOLIA ENVIRONNEME EUR5	5 125.00	163 831.08	0.03
EUR VINCI EUR2.50	4 225.00	397 858.52	0.06
EUR VIVENDI SA EUR5.50	5 702.00	72 204.43	0.01
EUR WENDEL EUR4	167.00	19 004.29	0.00
EUR WORLDLINE EURO.68	1 895.00	98 939.77	0.02
フランス合計		15 073 524.42	2.36

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 (%)
ドイツ			
EUR BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG EUR1	2 706.00	258 838.34	0.04
EUR BECHTLE AG NPV	624.00	44 797.44	0.01
EUR BEIERSDORF AG NPV	750.00	74 475.32	0.01
EUR CARL ZEISS MEDITEC NPV	347.00	69 113.70	0.01
EUR COMMERZBANK AG NPV	7 609.00	53 400.85	0.01
EUR CONTINENTAL AG ORD NPV	920.00	98 066.77	0.02
EUR COVESTRO AG NPV	1 709.00	95 874.74	0.01
EUR FRESENIUS MED CARE NPV	1 542.00	91 608.94	0.01
EUR FRESENIUS SE & CO. KGAA NPV	3 301.00	124 454.22	0.02
EUR GEA GROUP AG NPV	2 002.00	100 796.87	0.02
EUR HEIDELBERGCEMENT NPV	1 071.00	71 294.31	0.01
EUR HELLOFRESH SE NPV	1 217.00	122 465.05	0.02
EUR HENKEL AG & CO KGAA	1 362.00	100 492.55	0.02
EUR KION GROUP AG NPV	552.00	59 275.00	0.01
EUR KNORR BREMSE AG NPV	532.00	52 552.37	0.01
EUR LANXESS AG NPV	800.00	46 176.61	0.01
EUR MERCK KGAA NPV	1 031.00	254 032.05	0.04
EUR NEMETSCHEK SE ORD NPV	363.00	45 680.68	0.01
EUR PUMA SE NPV	755.00	90 719.14	0.01
EUR RATIONAL AG NPV	38.00	34 825.61	0.01
EUR RWE AG (NEU) NPV	8 884.00	341 494.21	0.05
EUR SAP AG ORD NPV	8 148.00	1 038 017.78	0.16
EUR SYMRISE AG NPV (BR)	1 093.00	153 169.96	0.02
EUR TEAMVIEWER AG NPV	1 136.00	15 331.39	0.00
EUR VOLKSWAGEN AG ORD NPV	253.00	70 169.00	0.01
EUR ZALANDO SE NPV	1 743.00	157 463.76	0.02
ドイツ合計		3 664 586.66	0.57
香港			
HKD BOC HONG KONG HLDG HKD5	19 500.00	58 906.35	0.01
HKD CHOW TAI FOOK JEWE HKD1	7 400.00	13 270.14	0.00
HKD CK ASSET HOLDINGS HKD1	11 000.00	62 930.92	0.01
HKD CK INFRASTRUCTURE HKD1	4 000.00	23 166.17	0.00
HKD CLP HOLDINGS HKD5	9 000.00	88 200.77	0.01
HKD HANG LUNG PROP HKD1	10 000.00	19 831.06	0.00
HKD HANG SENG BANK HKD5	4 500.00	79 657.76	0.01
HKD HENDERSON LAND DEV HKD2	8 000.00	32 735.37	0.01
HKD HKT TRUST AND HKT SHARE STAPLED UNIT	16 000.00	21 714.12	0.00
HKD HONGKONG&CHINA GAS HKD0.25	62 400.00	93 169.57	0.02
HKD POWER ASSETS HOLDINGS LTD HKD1	7 500.00	45 168.26	0.01
HKD SINO LAND CO HKD1	18 000.00	21 519.14	0.00
HKD SITC INTERNATIONAL HKD0.10	5 000.00	20 042.72	0.00
HKD SUN HUNG KAI PROP NPV	7 500.00	91 202.37	0.02
HKD SWIRE PROPERTIES LTD HKD1	7 600.00	18 054.73	0.00
HKD WHARF REAL ESTATE HKD0.1	10 000.00	50 667.98	0.01
HKD XINYI GLASS HLDGS HKD0.1	10 000.00	24 397.60	0.01
香港合計		764 635.03	0.12
アイルランド			
GBP DCC ORD EURO.25	1 052.00	77 077.66	0.01
EUR FLUTTER ENTERTAINM ORD EURO.09	1 168.00	157 435.42	0.03
EUR KERRY GROUP 'A' ORD EURO.125(DUBLIN LIST)	976.00	119 306.40	0.02
アイルランド合計		353 819.48	0.06

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 (%)
イスラエル			
USD SOLAREDGE TECHNOLO USD0.0001	139.00	45 558.64	0.01
イスラエル合計		45 558.64	0.01
イタリア			
EUR AMPLIFON EURO.02	925.00	44 895.68	0.01
EUR ASSIC GENERALI SPA EUR1	15 792.00	315 159.18	0.05
EUR DIASORIN SPA EUR1	231.00	49 077.57	0.01
EUR FINECOBANK SPA EURO.33	4 435.00	77 326.64	0.01
EUR INFRASTRUTTURE WIR NPV	1 963.00	22 393.82	0.00
EUR POSTE ITALIANE SPA NPV	4 822.00	60 463.95	0.01
EUR TELECOM ITALIA SPA EURO.55	80 786.00	41 829.05	0.01
イタリア合計		611 145.89	0.10
日本			
JPY アドバンテスト	1 000.00	87 982.74	0.01
JPY アイシン	400.00	14 690.21	0.00
JPY 朝日インテック	1 400.00	30 676.82	0.01
JPY アズビル	500.00	22 105.77	0.00
JPY バンダイナムコホールディングス	900.00	70 045.36	0.01
JPY カプコン	800.00	19 932.19	0.00
JPY 東海旅客鉄道	600.00	82 434.28	0.01
JPY 千葉銀行	4 800.00	27 943.11	0.00
JPY 中外製薬	3 100.00	100 471.18	0.02
JPY コンコルディア・フィナンシャルグループ	8 300.00	30 189.79	0.01
JPY コスモス薬品	100.00	15 509.27	0.00
JPY サイバーエージェント	1 700.00	31 336.47	0.01
JPY 第一生命ホールディングス	5 100.00	102 723.15	0.02
JPY ダイフク	400.00	32 022.55	0.01
JPY 第一三共	7 900.00	196 517.24	0.03
JPY ダイキン工業	1 100.00	224 272.32	0.04
JPY 大東建託	200.00	21 647.80	0.00
JPY 大和ハウス工業	5 900.00	172 305.25	0.03
JPY 大和ハウスリート投資法人	14.00	39 887.27	0.01
JPY ディスコ	200.00	57 422.17	0.01
JPY エーザイ	2 500.00	151 327.67	0.02
JPY ファナック	900.00	176 322.16	0.03
JPY ファーストリテイリング	300.00	178 079.18	0.03
JPY 富士電機	500.00	26 157.03	0.00
JPY G L P 投資法人	18.00	28 582.50	0.00
JPY G M O ペイメントゲートウェイ	100.00	13 413.18	0.00
JPY 阪急阪神ホールディングス	1 100.00	32 599.41	0.01
JPY ハーモニック・ドライブ・システムズ	200.00	8 252.23	0.00
JPY 光通信	200.00	28 992.91	0.01
JPY ヒロセ電機	200.00	33 554.98	0.01
JPY ホシザキ	300.00	22 775.11	0.00
JPY ヒューリック	800.00	7 581.14	0.00
JPY イビデン	500.00	31 133.03	0.01
JPY 出光興産	600.00	15 488.13	0.00
JPY いすゞ自動車	4 800.00	64 763.75	0.01
JPY 伊藤園	200.00	11 748.65	0.00
JPY 伊藤忠テクノソリューションズ	600.00	19 525.30	0.00
JPY 日本取引所グループ	2 800.00	60 638.51	0.01
JPY かんぽ生命保険	1 400.00	21 675.99	0.00
JPY ジャパンリアルエステイト投資法人	7.00	40 380.47	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 J S R	600.00	22 405.21	0.00
JPY 鹿島建設	5 900.00	65 004.18	0.01
JPY カカクコム	500.00	13 981.24	0.00
JPY 関西電力	3 200.00	28 943.59	0.01
JPY 関西ペイント	1 000.00	22 458.06	0.00
JPY 花王	4 800.00	244 639.57	0.04
JPY 京王電鉄	300.00	13 501.26	0.00
JPY 京成電鉄	800.00	21 912.02	0.00
JPY キッコーマン	600.00	45 761.59	0.01
JPY 近鉄グループホールディングス	700.00	20 097.76	0.00
JPY キリンホールディングス	8 800.00	140 821.70	0.02
JPY 小林製薬	300.00	23 567.75	0.00
JPY 神戸物産	400.00	15 077.72	0.00
JPY コーエーテックモホールディングス	390.00	16 332.29	0.00
JPY 小糸製作所	600.00	34 506.14	0.01
JPY 小松製作所	3 900.00	89 029.02	0.01
JPY コーセー	100.00	12 039.28	0.00
JPY 栗田工業	400.00	18 671.01	0.00
JPY レーザーテック	300.00	78 589.99	0.01
JPY ライオン	1 100.00	15 607.03	0.00
JPY エムスリー	2 000.00	107 781.06	0.02
JPY マキタ	900.00	39 505.04	0.01
JPY 日本マクドナルドホールディングス	200.00	8 895.15	0.00
JPY 明治ホールディングス	1 000.00	58 655.16	0.01
JPY ミネベアミツミ	1 800.00	47 558.24	0.01
JPY ミスミグループ本社	1 400.00	58 998.63	0.01
JPY 三菱瓦斯化学	1 600.00	26 618.52	0.00
JPY 三菱H C キャピタル	3 200.00	15 049.54	0.00
JPY 三井化学	1 500.00	40 226.34	0.01
JPY 三井不動産	4 200.00	86 408.03	0.01
JPY 三浦工業	500.00	17 548.11	0.00
JPY M o n o t a R O	1 200.00	23 842.53	0.00
JPY ナブテスコ	1 000.00	28 931.26	0.01
JPY 日本電産	1 900.00	217 534.90	0.03
JPY 日本M & A センター	1 300.00	38 183.10	0.01
JPY 日本ビルファンド投資法人	6.00	36 989.74	0.01
JPY 日本通運	600.00	34 189.09	0.01
JPY 日本ペイントホールディングス	2 500.00	26 267.12	0.00
JPY 日本酸素ホールディングス	400.00	8 465.37	0.00
JPY 日本新薬	100.00	7 397.95	0.00
JPY 日本製鉄	4 100.00	61 367.30	0.01
JPY 日産化学	500.00	28 799.15	0.01
JPY 日清製粉グループ本社	1 200.00	17 290.06	0.00
JPY 日清食品ホールディングス	200.00	14 690.21	0.00
JPY ニトリホールディングス	400.00	63 516.67	0.01
JPY 日東電工	1 400.00	97 406.31	0.02
JPY 野村不動産ホールディングス	1 200.00	26 051.35	0.00
JPY 大林組	8 000.00	58 901.76	0.01
JPY オービック	300.00	55 458.19	0.01
JPY 小田急電鉄	1 400.00	26 965.52	0.00
JPY 王子ホールディングス	8 400.00	38 839.23	0.01
JPY オリンパス	5 000.00	111 805.89	0.02
JPY 小野薬品工業	3 200.00	70 611.65	0.01
JPY 日本オラクル	100.00	9 828.70	0.00
JPY オリエンタルランド	900.00	141 406.49	0.02

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 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	1 900.00	32 395.97	0.01
JPY パーソルホールディングス	1 300.00	37 553.39	0.01
JPY ポーラ・オルビスホールディングス	600.00	10 684.75	0.00
JPY 楽天グループ	3 400.00	34 765.07	0.01
JPY リクルートホールディングス	6 100.00	370 743.76	0.06
JPY リンナイ	300.00	28 323.57	0.00
JPY 良品計画	1 200.00	19 393.19	0.00
JPY S B I ホールディングス	1 100.00	28 327.10	0.00
JPY S C S K	1 800.00	34 162.67	0.01
JPY セコム	1 800.00	121 495.44	0.02
JPY 積水ハウス	5 900.00	114 835.53	0.02
JPY シャープ	600.00	6 711.00	0.00
JPY シマノ	300.00	82 962.70	0.01
JPY 清水建設	5 100.00	32 204.85	0.01
JPY 信越化学工業	1 600.00	267 735.26	0.04
JPY 塩野義製薬	1 000.00	69 778.50	0.01
JPY 資生堂	1 700.00	97 363.16	0.02
JPY 静岡銀行	900.00	6 341.10	0.00
JPY S M C	300.00	191 950.33	0.03
JPY スクウェア・エニックス・ホールディングス	200.00	10 445.20	0.00
JPY スタンレー電気	600.00	15 599.10	0.00
JPY 住友金属鉱山	1 000.00	37 280.37	0.01
JPY サントリー食品インターナショナル	800.00	28 217.89	0.00
JPY スズキ	1 800.00	72 684.84	0.01
JPY シスメックス	800.00	99 766.61	0.02
JPY T & D ホールディングス	6 600.00	78 006.08	0.01
JPY 大成建設	2 200.00	64 133.16	0.01
JPY 大正製薬ホールディングス	100.00	4 914.35	0.00
JPY テルモ	2 800.00	114 125.68	0.02
JPY T I S	1 200.00	37 095.42	0.01
JPY 東武鉄道	1 400.00	31 626.23	0.01
JPY 東宝	600.00	26 685.46	0.00
JPY 東邦瓦斯	400.00	11 290.68	0.00
JPY 東北電力	1 000.00	6 922.37	0.00
JPY 東京センチュリー	200.00	9 546.88	0.00
JPY 東京瓦斯	3 500.00	59 954.20	0.01
JPY 東急	2 300.00	31 822.63	0.01
JPY 東レ	5 600.00	32 590.43	0.01
JPY 東ソー	3 100.00	44 529.48	0.01
JPY T O T O	400.00	17 719.85	0.00
JPY 東洋水産	300.00	12 153.77	0.00
JPY 豊田自動織機	800.00	65 665.60	0.01
JPY 豊田通商	1 900.00	82 914.26	0.01
JPY ツルハホールディングス	100.00	11 273.06	0.00
JPY ユー・エス・エス	2 100.00	30 812.45	0.01
JPY ウエルシアホールディングス	700.00	24 813.95	0.00
JPY ヤクルト本社	300.00	14 980.84	0.00
JPY ヤマハ	600.00	30 754.33	0.01
JPY ヤマトホールディングス	1 200.00	26 463.52	0.00
JPY Z O Z O	738.00	23 496.15	0.00
日本合計		7 794 048.22	1.22
ジャージー			
USD NOVOCURE LTD COM USD0.00	288.00	26 968.32	0.00
ジャージー合計		26 968.32	0.00

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 (%)
ルクセンブルグ			
EUR AROUNDTOWN SA EURO.01	7 236.00	43 167.66	0.01
ルクセンブルグ合計		43 167.66	0.01
オランダ			
EUR AKZO NOBEL NV EURO.50(POST REV SPLIT)	1 555.00	162 638.62	0.03
EUR ARGEN X NV EURO.10	333.00	92 581.73	0.02
EUR ASM INTL NV EURO.04	392.00	175 082.13	0.03
EUR EXOR NV EURO.01	992.00	86 759.45	0.01
EUR HEINEKEN HOLDING EUR1.6	1 062.00	87 920.73	0.01
EUR HEINEKEN NV EUR1.60	2 141.00	211 927.45	0.03
EUR ING GROEP N.V. EURO.01	30 879.00	424 318.37	0.07
EUR JUST EAT TAKEAWAY EURO.04	1 410.00	87 591.83	0.01
EUR KON KPN NV EURO.04	27 362.00	80 107.33	0.01
EUR KONINKLIJKE AHOLD EURO.01	14 231.00	474 945.96	0.07
EUR KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20	7 201.00	252 849.38	0.04
USD NXP SEMICONDUCTORS EURO.20	901.00	201 247.36	0.03
EUR QIAGEN NV EURO.01	1 962.00	108 212.93	0.02
EUR RANDSTAD N.V. EURO.10	1 607.00	100 788.52	0.02
GBP ROYAL DUTCH SHELL ' B ' SHS EURO.07 (UK LIST)	18 813.00	392 608.53	0.06
EUR STMICROELECTRONICS EUR1.04	5 528.00	268 337.41	0.04
EUR VOPAK(KON) EURO.50	605.00	22 853.96	0.00
EUR WOLTERS KLUWER EURO.12	2 141.00	239 207.63	0.04
オランダ合計		3 469 979.32	0.54
ニュージーランド			
NZD SPARK NEW ZEALAND NPV	10 107.00	31 554.26	0.01
AUD XERO LIMITED NPV	1 355.00	139 156.88	0.02
ニュージーランド合計		170 711.14	0.03
ノルウェー			
NOK GJENSIDIGE FORSIKR NOK2	1 277.00	28 787.81	0.00
NOK ORKLA ASA NOK1.25	4 875.00	44 312.59	0.01
NOK YARA INTERNATIONAL NOK1.7	997.00	48 759.32	0.01
ノルウェー合計		121 859.72	0.02
パプアニューギニア			
AUD OIL SEARCH LTD PGK0.10	17 518.00	47 324.54	0.01
パプアニューギニア合計		47 324.54	0.01
ポーランド			
EUR INPOST S.A. EURO.01	2 021.00	22 373.03	0.00
ポーランド合計		22 373.03	0.00
シンガポール			
SGD DBS GROUP HLDGS SGD1	9 800.00	213 489.41	0.03
SGD OVERSEA-CHINESE BK NPV	18 603.00	148 970.53	0.02
SGD SINGAPORE EXCHANGE SGDO.01	4 500.00	29 307.52	0.01
SGD SINGAPORE TECH ENG NPV	6 800.00	18 895.09	0.00
SGD UTD O/S BANK SGD1	6 400.00	118 884.15	0.02
SGD VENTURE CORP LTD SGDO.25	1 700.00	22 949.35	0.00
SGD WILMAR INTERNATIONAL LTD	11 200.00	33 571.82	0.01
シンガポール合計		586 067.87	0.09

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 (%)
スペイン			
EUR ACS ACTIVIDADES CO EURO.5	1 852.00	44 214.60	0.01
EUR AENA SME S.A. EUR10	631.00	91 977.84	0.01
EUR AMADEUS IT GROUP EURO.01	3 648.00	231 917.54	0.04
EUR CAIXABANK SA EUR1	31 592.00	80 863.34	0.01
EUR CELLNEX TELECOM SA EURO.25	4 024.00	235 710.73	0.04
EUR EDP RENOVAVEIS SA EUR5	2 422.00	61 666.72	0.01
EUR ENAGAS SA EUR1.50	3 685.00	83 330.03	0.01
EUR ENDESA SA EUR1.2	3 848.00	85 911.51	0.01
EUR FERROVIAL SA EURO.2	3 364.00	92 996.89	0.02
EUR GRIFOLS SA EURO.25 (CLASS A) POST SUBD	2 077.00	37 008.50	0.01
EUR IBERDROLA SA EURO.75 (POST SUBDIVISION)	79 936.00	891 121.92	0.14
EUR INDITEX EURO.03 (POST SUBD)	8 296.00	260 156.06	0.04
EUR NATURGY ENERGY GRO EUR1	1 047.00	28 637.63	0.00
EUR RED ELECTRICA CORP EURO.5	5 655.00	119 253.30	0.02
EUR REPSOL SA EUR1	11 581.00	127 631.30	0.02
EUR SIEMENS GAMESA REN EURO.17	2 163.00	57 287.85	0.01
EUR TELEFONICA SA EUR1	42 706.00	192 111.25	0.03
スペイン合計		2 721 797.01	0.43
スウェーデン			
SEK ESSITY AB SER ' B ' NPV	3 667.00	116 539.70	0.02
SEK HUSQVARNA AB SER ' B ' NPV	2 419.00	33 947.09	0.00
SEK ICA GRUPPEN AB	607.00	35 718.87	0.01
SEK LUNDIN ENERGY AB NPV	1 095.00	38 552.51	0.01
SEK SECURITAS SER ' B ' NPV	1 778.00	25 588.37	0.00
SEK VOLVO AB SER ' A ' NPV (POST SPLIT)	1 154.00	25 128.15	0.00
スウェーデン合計		275 474.69	0.04
スイス			
GBP GLENCORE XSTRATA ORD USD0.01	49 661.00	234 620.07	0.04
CHF ROCHE HLDGS AG CHF1(BR)	181.00	74 715.80	0.01
CHF SWISS RE AG CHF0.10	1 773.00	165 612.84	0.02
スイス合計		474 948.71	0.07
イギリス			
GBP 3I GROUP ORD GBPO.738636	10 588.00	194 289.91	0.03
GBP ASTRAZENECA ORD USD0.25	16 825.00	1 842 194.15	0.29
GBP AVEVA GROUP ORD GBPO.03556	699.00	29 657.60	0.00
GBP AVIVA ORD GBPO.25	20 192.00	102 848.96	0.02
GBP BAE SYSTEMS ORD GBPO.025	36 158.00	262 242.63	0.04
GBP BARRATT DEVEL ORD GBPO.10	4 976.00	45 911.57	0.01
GBP BRIT AMER TOBACCO ORD GBPO.25	23 426.00	784 112.73	0.12
GBP BRITISH LAND CO PLC REIT	6 102.00	41 075.15	0.01
GBP BT GROUP ORD GBPO.05	48 297.00	101 340.53	0.02
USD COCA-COLA EUROPACI COM EURO.01	1 427.00	70 450.99	0.01
GBP EVRAZ PLC ORD USD1	2 475.00	18 860.69	0.00
GBP HALMA ORD GBPO.10	2 098.00	83 297.38	0.01
GBP HIKMA PHARMACEUTIC ORD GBPO.10	1 128.00	33 055.42	0.00
USD IHS MARKIT LTD COM	1 259.00	160 925.38	0.02
GBP INFORMA PLC (GB) ORD GBPO.001	6 966.00	43 038.80	0.01
GBP JOHNSON MATTHEY ORD GBP1.109245	1 045.00	28 977.93	0.00
GBP KINGFISHER ORD GBPO.157142857	10 886.00	45 626.10	0.01
GBP LAND SECURITIES GP ORD GBPO.106666666	3 752.00	36 087.52	0.01
USD LIBERTY GLOBAL INC USD0.01 A	323.00	8 527.20	0.00

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 (%)
GBP LLOYDS BANKING GP ORD GBP0.1	359 871.00	222 819.17	0.03
GBP NATIONAL GRID ORD GBP0.12431289	39 435.00	525 168.44	0.08
GBP OCADO GROUP PLC ORD GBP0.02	2 194.00	52 117.30	0.01
GBP RECKITT BENCK GRP ORD GBP0.10	7 707.00	622 997.66	0.10
GBP RELX PLC GBP0.1444	20 719.00	640 600.61	0.10
GBP RENTOKIL INITIAL ORD GBP0.01	8 378.00	68 012.00	0.01
GBP ROLLS-ROYCE HLDGS ORD GBP0.20	39 818.00	64 532.04	0.01
GBP SAGE GROUP GBP0.01051948	12 007.00	122 602.45	0.02
GBP SEVERN TRENT ORD GBP0.9789	1 203.00	45 932.68	0.01
GBP SMITHS GROUP ORD GBP0.375	1 784.00	34 034.55	0.01
GBP SPIRAX-SARCO ENG ORD GBP0.269230769	356.00	73 615.42	0.01
GBP SSE PLC ORD GBP0.50	4 917.00	100 960.56	0.02
GBP ST JAMES ' S PLACE ORD GBP0.15	6 368.00	130 459.02	0.02
GBP UNITED UTILITIES G ORD GBP0.05	3 355.00	48 137.33	0.01
GBP WHITBREAD ORD GBP0.76797385	980.00	36 342.02	0.01
USD WILLIS TOWERS WATS COM USD0.000304635	414.00	93 497.76	0.01
GBP WPP PLC ORD GBP0.10	6 768.00	93 301.35	0.01
イギリス合計		6 907 651.00	1.08

アメリカ合衆国

USD 3M CO COM	5 277.00	897 301.08	0.14
USD AFLAC INC COM USD0.10	5 580.00	302 101.20	0.05
USD AKAMAI TECHNOLOGIES INC COM	555.00	62 548.50	0.01
USD ALBEMARLE CORP COM USD0.01	357.00	95 136.93	0.01
USD ALIGN TECHNOLOGY INC COM	234.00	143 098.02	0.02
USD ALLEGHANY CORP DEL COM	43.00	27 815.84	0.00
USD ALLIANT ENERGY CORP COM	2 126.00	116 483.54	0.02
USD ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC COM	432.00	79 401.60	0.01
USD ALPHABET INC CAP STK USD0.001 CL C	942.00	2 683 795.68	0.42
USD ALTICE USA INC COM USD0.01 CL A	899.00	14 240.16	0.00
USD AMC ENTMT HLDGS IN COM USD0.01 ' A '	1 641.00	55 695.54	0.01
USD AMER ELEC PWR INC COM USD6.50	4 511.00	365 616.55	0.06
USD AMERICAN WATER WOR COM STK USD0.01	627.00	105 693.39	0.02
USD ANSYS INC COM	283.00	110 788.84	0.02
USD ARISTA NETWORKS IN COM USD0.0001	652.00	80 887.12	0.01
USD ARROW ELECTRS INC COM	387.00	47 078.55	0.01
USD BAKER HUGHES COMPA COM USD0.0001 CL A	6 710.00	156 611.40	0.02
USD BERKLEY(WR)CORP COM USD0.20	384.00	29 429.76	0.00
USD BERKSHIRE HATHAWAY CLASS ' B ' COM USD0.0033	4 255.00	1 177 315.95	0.18
USD BIO RAD LABS INC CL A	71.00	53 477.20	0.01
USD BIO-TECHNE CORP COM USD0.01	118.00	55 699.54	0.01
USD BIOMARIN PHARMA COM USD0.001	624.00	53 844.96	0.01
USD BLACK KNIGHT INC COM USD0.0001 WI	614.00	43 882.58	0.01
USD BLACKROCK INC COM STK USD0.01	512.00	463 160.32	0.07
USD BOOZ ALLEN HAMILTO COM USD0.01 CLASS ' A '	503.00	42 221.82	0.01
USD BOSTON BEER INC CL A	25.00	11 279.25	0.00
USD BOSTON PPTYS INC COM USD0.01	482.00	51 978.88	0.01
USD BOSTON SCIENTIFIC COM USD0.01	4 581.00	174 398.67	0.03
USD BROADRIDGE FIN SOL COM STK USD0.01	421.00	70 967.97	0.01
USD BROWN & BROWN INC COM	865.00	55 714.65	0.01
USD BROWN FORMAN CORP CL B	986.00	69 374.96	0.01
USD CABLE ONE INC COM USD1 ' WI '	14.00	24 808.84	0.00
USD CADENCE DESIGN SYS COM USD0.01	953.00	169 119.38	0.03
USD CAMPBELL SOUP CO CAP USD0.0375	2 194.00	88 484.02	0.01
USD CARVANA CO COM USD0.001 CL A	200.00	56 084.00	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 (%)
USD CATALENT INC COM USD0.01	571.00	73 464.86	0.01
USD CDW CORP COM USD0.01	496.00	93 922.56	0.01
USD CERNER CORP COM	1 044.00	73 549.80	0.01
USD CHARLES RIV LABS INTL INC COM	170.00	62 197.90	0.01
USD CHENIERE ENERGY INC COM NEW	779.00	81 646.99	0.01
USD CINCINNATI FINL CORP COM	399.00	45 446.10	0.01
USD CINTAS CORP COM	329.00	138 900.51	0.02
USD CLOROX CO DEL COM	1 164.00	189 557.40	0.03
USD CME GROUP INC COM STK USD0.01 CLASS ' A '	3 224.00	710 956.48	0.11
USD CMS ENERGY CORP COM	2 790.00	164 191.50	0.03
USD COCA-COLA CO COM USD0.25	37 070.00	1 944 321.50	0.30
USD COGNEX CORP COM	720.00	55 620.00	0.01
USD COLGATE-PALMOLIVE COM USD1	2 524.00	189 350.48	0.03
USD CONSTELLATION BRDS CLASS ' A ' COM USD0.01	542.00	122 128.86	0.02
USD COPART INC COM	670.00	97 257.20	0.02
USD COSTAR GROUP INC COM	1 185.00	92 145.60	0.01
USD COTERRA ENERGY INC COM USD0.10	2 914.00	58 513.12	0.01
USD COUPA SOFTWARE INC COM USD0.0001	231.00	45 428.46	0.01
USD CSX CORP COM USD1	7 530.00	260 989.80	0.04
USD DEERE & CO COM USD1	990.00	342 084.60	0.05
USD DEVON ENERGY CORP NEW COM	2 067.00	86 938.02	0.01
USD DEXCOM INC COM	306.00	172 152.54	0.03
USD DIGITAL REALTY TRU COM STK USD0.01	845.00	141 740.30	0.02
USD DISCOVERY INC COM USD0.01 SER A	547.00	12 728.69	0.00
USD DISCOVERY INC COM USD0.01 SER C	833.00	18 917.43	0.00
USD DOMINION ENERGY IN COM STK NPV	7 273.00	517 837.60	0.08
USD DROPBOX INC COM USD0.00001 CL A	1 220.00	30 024.20	0.00
USD DUKE ENERGY CORP COM USD0.001 (POST REV SPLT)	6 968.00	675 965.68	0.11
USD ECOLAB INC COM	831.00	184 041.57	0.03
USD EDWARDS LIFESCIENCES CORP COM	1 972.00	211 615.32	0.03
USD ENPHASE ENERGY INC COM USD0.00001	400.00	100 000.00	0.02
USD EOG RESOURCES INC COM USD0.01	1 922.00	167 214.00	0.03
USD EPAM SYS INC COM USD0.001	169.00	102 844.95	0.02
USD EQUIFAX INC COM	396.00	110 345.40	0.02
USD EQUITY LIFESTYLE PPTYS INC	610.00	49 593.00	0.01
USD ERIE INDTY CO CL A	28.00	5 202.68	0.00
USD ESSEX PROP TRUST COM USD0.0001	214.00	72 640.16	0.01
USD ETSY INC USD0.001	404.00	110 930.32	0.02
USD EXACT SCIENCES CORP COM	522.00	44 563.14	0.01
USD EXPEDTRS INTL WASH COM USD0.01	588.00	71 512.56	0.01
USD F M C CORP COM NEW	584.00	58 510.96	0.01
USD F5 NETWORK INC COM STK NPV	148.00	33 681.84	0.01
USD FACTSET RESH SYS INC COM	89.00	41 702.73	0.01
USD FAIR ISAAC CORP COM	116.00	40 963.08	0.01
USD FASTENAL COM USD0.01	1 811.00	107 156.87	0.02
USD FIDELITY NATL FINL FNF GROUP COM USD0.0001	2 411.00	117 922.01	0.02
USD FORTINET INC COM USD0.001	463.00	153 766.93	0.02
USD FORTIVE CORP COM USD0.01	1 025.00	75 716.75	0.01
USD FRANKLIN RES INC COM	2 680.00	86 832.00	0.01
USD GALLAGHER ARTHUR J & CO COM	700.00	114 030.00	0.02
USD GARTNER INC COM	309.00	96 485.25	0.01
USD GEN DYNAMICS CORP COM USD1	2 196.00	414 978.12	0.06
USD GENERAC HLDGS INC COM USD0.01	204.00	85 932.96	0.01
USD GUIDEWIRE SOFTWARE COM USD0.0001	212.00	24 664.08	0.00
USD HEICO CORP NEW CL A	206.00	25 585.20	0.00

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 (%)
USD HEICO CORP NEW COM	201.00	27 842.52	0.00
USD HENRY JACK & ASSOC COM USD0.01	282.00	42 759.66	0.01
USD HONEYWELL INTL INC COM USD1	2 183.00	441 489.92	0.07
USD HORIZON THERAPEUTI COM USD0.0001	597.00	61 944.72	0.01
USD HUBSPOT INC COM USD0.001	135.00	108 932.85	0.02
USD HUNT J B TRANS SVCS INC COM	262.00	50 083.92	0.01
USD IDEX CORP COM	208.00	46 714.72	0.01
USD IDEXX LABORATORIES COM USD0.10	302.00	183 637.14	0.03
USD ILLINOIS TOOL WKS COM NPV	1 015.00	235 632.25	0.04
USD ILLUMINA INC COM USD0.01	493.00	180 107.69	0.03
USD INCYTE CORPORATION COM USD0.001	773.00	52 347.56	0.01
USD INSULET CORP COM STK USD0.001	248.00	71 533.12	0.01
USD INTERCONTINENTAL E COM USD0.01	1 761.00	230 197.92	0.04
USD INTERNATIONAL FLAVORS&FRAGRANC COM	2 249.00	319 740.33	0.05
USD INTERPUBLIC GROUP COM USD0.10	3 247.00	107 767.93	0.02
USD INTUITIVE SURGICAL COM USD0.001	1 140.00	369 747.60	0.06
USD INVITATION HOMES I COM USD0.01	1 967.00	79 545.48	0.01
USD IPG PHOTONICS CORP COM USD0.0001	77.00	12 642.63	0.00
USD JOHNSON & JOHNSON COM USD1	23 835.00	3 716 591.55	0.58
USD JP MORGAN CHASE & COM USD1	9 760.00	1 550 180.80	0.24
USD JUNIPER NETWORKS COM USD0.00001	2 631.00	81 903.03	0.01
USD KRAFT HEINZ CO COM USD0.01	2 193.00	73 706.73	0.01
USD LAMB WESTON HLDGS COM USD1.00 WI	514.00	26 686.88	0.00
USD LEIDOS HLDGS INC COM USD0.0001	478.00	42 020.98	0.01
USD LENNOX INTL INC COM	85.00	26 266.70	0.00
USD LIBERTY BROADBAND COM USD0.01 CL ' A '	100.00	15 158.00	0.00
USD LIBERTY BROADBAND COM USD0.01 CL ' C '	436.00	67 514.60	0.01
USD LIBERTY MEDIA CORP COM USD0.01 SER A SIRIUSXM	138.00	6 734.40	0.00
USD LIBERTY MEDIA CORP COM USD0.01 SER C SIRIUSXM	784.00	38 361.12	0.01
USD LIBERTY MEDIA CORP COM USD0.01 SER C FORMULA	534.00	32 531.28	0.00
USD LIVE NATION INC COM	614.00	65 483.10	0.01
USD LOCKHEED MARTIN CORP COM	2 227.00	742 303.64	0.12
USD LOEWS CORP COM	627.00	33 519.42	0.01
USD LYONDELLBASELL IND COM USD0.01	2 419.00	210 767.47	0.03
USD M & T BANK CORP COM USD0.50	1 214.00	177 984.54	0.03
USD MARKEL CORP COM	34.00	40 623.88	0.01
USD MARKETAXESS HLDGS INC COM	134.00	47 260.46	0.01
USD MARSH & MCLENNAN COM USD1	1 617.00	265 220.34	0.04
USD MARTIN MARIETTA M. COM USD0.01	201.00	81 105.51	0.01
USD MASIMO CORPORATION COM STK USD0.001	140.00	38 936.80	0.01
USD MEDICAL PROP TST COM USD0.001	1 636.00	34 830.44	0.01
USD METTLER TOLEDO INTERNATIONAL COM	74.00	112 045.62	0.02
USD MOLINA HEALTHCARE INC COM	196.00	55 895.28	0.01
USD MONGODB INC COM USD0.001 CL A	155.00	77 205.50	0.01
USD MONOLITHIC PWR SYS INC COM	142.00	78 591.32	0.01
USD MONSTER BEV CORP USD0.005(NEW)	1 249.00	104 641.22	0.02
USD MOODYS CORP COM USD0.01	534.00	208 601.76	0.03
USD NASDAQ INC COM STK USD0.01	308.00	62 594.84	0.01
USD NEUROCRINE BIOSCIENCES INC COM	232.00	19 314.00	0.00
USD NEWS CORP NEW COM USD0.01 CL ' A '	1 357.00	29 338.34	0.00
USD NEXTERA ENERGY INC COM USD0.01	6 228.00	540 465.84	0.08
USD NORDSON CORP COM	180.00	45 754.20	0.01
USD NORTHROP GRUMMAN COM USD1	500.00	174 400.00	0.03
USD OKTA INC COM USD0.0001 CL A	409.00	88 029.07	0.01
USD OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	1 157.00	32 326.58	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 (%)
USD PAYCOM SOFTWARE IN COM USD0.01	160.00	69 996.80	0.01
USD PEPSICO INC CAP USD0.016666	12 468.00	1 992 137.04	0.31
USD PERKINELMER INC COM USD1	362.00	65 941.92	0.01
USD PHILIP MORRIS INTL COM STK NPV 'WI'	14 131.00	1 214 418.14	0.19
USD PIONEER NATURAL RE COM STK USD0.01	738.00	131 600.16	0.02
USD PLUG POWER INC COM USD0.01	1 645.00	65 553.25	0.01
USD POOL CORPORATION COM USD0.001	131.00	72 589.72	0.01
USD PPG INDS INC COM	795.00	122 565.15	0.02
USD PROGRESSIVE CP(OH) COM USD1	5 281.00	490 816.14	0.08
USD PTC INC COM USD0.01	481.00	52 707.98	0.01
USD PUBLIC STORAGE COM USD0.10	567.00	185 624.46	0.03
USD PULTE GROUP INC COM USD0.01	1 035.00	51 781.05	0.01
USD QORVO INC COM USD 0.0001	376.00	54 982.48	0.01
USD REALTY INCOME CORP	1 743.00	118 384.56	0.02
USD RESMED INC COM USD0.004	473.00	120 544.05	0.02
USD RINGCENTRAL INC COM USD0.0001 CL 'A'	240.00	51 835.20	0.01
USD ROKU INC COM USD0.0001 CLASS A	409.00	93 092.49	0.01
USD ROLLINS INC COM	886.00	29 486.08	0.00
USD ROPER TECHNOLOGIES COM USD0.01	330.00	153 169.50	0.02
USD RPM INTERNATIONAL COM USD0.01	356.00	32 410.24	0.01
USD S&P GLOBAL INC COM USD1	765.00	348 633.45	0.05
USD SEMPRA ENERGY COM NPV	2 884.00	345 705.08	0.05
USD SHERWIN-WILLIAMS COM USD1	779.00	258 035.96	0.04
USD SMITH A O COM	583.00	46 086.15	0.01
USD SNAP INC COM USD0.00001 CL A	3 192.00	151 971.12	0.02
USD SOUTHERN CO COM	3 288.00	200 896.80	0.03
USD SPLUNK INC COM USD0.001	536.00	64 856.00	0.01
USD SS&C TECH HLDGS COM USD0.01	874.00	66 712.42	0.01
USD STRYKER CORP COM USD0.10	1 055.00	249 644.65	0.04
USD SUN COMMUNITIES COM USD0.01	343.00	64 682.94	0.01
USD SUNRUN INC COM USD0.0001	725.00	33 379.00	0.01
USD SVB FINL GROUP COM	173.00	119 773.09	0.02
USD SYNOPSYS INC COM USD0.01	499.00	170 159.00	0.03
USD TAKE TWO INTERACTI COM USD0.01	384.00	63 697.92	0.01
USD TELADOC HEALTH INC COM USD0.001	492.00	49 815.00	0.01
USD TELEDYNE TECHNOLOGIES INC COM	137.00	56 894.73	0.01
USD TERADYNE INC COM USD0.125	602.00	92 027.74	0.01
USD THE TRADE DESK INC COM USD0.000001 CL A	1 368.00	141 478.56	0.02
USD TRANSUNION COM USD0.01	634.00	70 494.46	0.01
USD TRIMBLE INC COM NPV	734.00	63 028.58	0.01
USD TWILIO INC COM USD0.001 CL A	552.00	157 954.80	0.02
USD TYLER TECHNOLOGIES INC COM	136.00	70 581.28	0.01
USD UDR INC	734.00	41 639.82	0.01
USD UNITED PARCEL SERVICE INC CL B	2 290.00	454 267.30	0.07
USD VEEVA SYSTEMS INC COM USD0.00001 CL 'A'	433.00	122 357.14	0.02
USD VERISIGN INC COM	356.00	85 407.96	0.01
USD VERISK ANALYTICS I CL A USD0.001	510.00	114 683.70	0.02
USD VERTEX PHARMACEUTI COM USD0.01	863.00	161 329.22	0.03
USD VICI PPTYS INC COM USD0.01	1 989.00	54 100.80	0.01
USD VMWARE INC COM STK USD0.01 CLASS 'A'	744.00	86 854.56	0.01
USD VORNADO REALTY TR COM USD0.04	639.00	25 649.46	0.00
USD VULCAN MATERIALS COM STK USD1	437.00	83 746.68	0.01
USD W P CAREY INC COM USD0.001	586.00	44 741.10	0.01
USD WABTEC CORP COM	485.00	43 053.45	0.01
USD WASTE CONNECTIONS COM NPV (POST REV SPLT)	758.00	100 859.48	0.02

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 (%)
USD WATERS CORP COM	198.00	64 957.86	0.01
USD WAYFAIR INC COM USD0.001 A	209.00	51 798.56	0.01
USD WEC ENERGY GROUP COM USD0.01	2 891.00	251 314.63	0.04
USD WEST PHARMACEUTICA COM USD0.25	248.00	109 779.68	0.02
USD WESTERN UN CO COM	3 945.00	62 409.90	0.01
USD XCEL ENERGY INC COM	5 015.00	319 605.95	0.05
USD ZEBRA TECHNOLOGIES CORP CL A	171.00	100 681.38	0.02
USD ZENDESK INC COM USD0.01	406.00	41 456.66	0.01
USD ZILLOW GROUP INC COM USD0.0001 CLASS A	200.00	10 822.00	0.00
USD ZILLOW GROUP INC COM USD0.0001 CLASS C WI	464.00	25 181.28	0.00
USD ZOETIS INC COM USD0.01 CL 'A'	1 512.00	335 724.48	0.05
USD ZSCALER INC COM USD0.001	300.00	104 091.00	0.02
アメリカ合衆国合計		39 862 169.14	6.24
無記名株式合計		96 000 661.03	15.03
その他の株式			
スイス			
CHF ROCHE HLDGS AG GENUSSSCHEINE NPV	4 087.00	1 588 382.92	0.25
スイス合計		1 588 382.92	0.25
アメリカ合衆国			
USD CAMDEN PROP TST SBI USD0.01	325.00	53 693.25	0.01
アメリカ合衆国合計		53 693.25	0.01
その他の株式合計		1 642 076.17	0.26
優先株式			
ドイツ			
EUR BAYERISCHE MOTORENWERKE AG EUR1	322.00	25 153.56	0.00
EUR FUCHS PETROLUB SE PRF NPV (REG)	750.00	33 430.32	0.00
EUR HENKEL AG&CO. KGAA NON-VTG PRF NPV	1 273.00	99 872.35	0.02
EUR PORSCHE AUTO HL SE NON VTG PRF NPV	2 076.00	173 339.79	0.03
EUR SARTORIUS AG NON VTG PRF NPV	191.00	130 498.69	0.02
EUR VOLKSWAGEN AG NON VTG PRF NPV	1 431.00	260 391.19	0.04
ドイツ合計		722 685.90	0.11
優先株式合計		722 685.90	0.11
記名株式			
アルゼンチン			
USD MERCADOLIBRE INC COM STK USD0.001	143.00	169 942.63	0.03
アルゼンチン合計		169 942.63	0.03
オーストラリア			
AUD AMPOL LTD NPV	2 311.00	46 979.08	0.01
AUD BHP GROUP LTD NPV	46 469.00	1 297 196.01	0.20
GBP BHP GROUP PLC ORD USD0.50	10 580.00	289 255.03	0.05
AUD COLES GROUP LTD NPV	20 655.00	263 910.61	0.04
オーストラリア合計		1 897 340.73	0.30

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 (%)
ベルギー			
EUR AGEAS NPV	1 546.00	79 404.30	0.01
EUR KBC GROUP NV NPV	2 050.00	170 799.67	0.03
EUR UCB NPV	1 053.00	113 950.59	0.02
ベルギー合計		364 154.56	0.06
バミューダ			
USD ARCH CAPITAL GROUP COM USD0.01	1 425.00	57 541.50	0.01
USD EVEREST RE GROUP COM USD0.01	87.00	22 305.06	0.00
バミューダ合計		79 846.56	0.01
カナダ			
CAD BCE INC COM NEW	431.00	21 600.40	0.00
CAD CANADIAN TIRE LTD CL A	353.00	46 461.27	0.01
CAD FORTIS INC COM NPV	2 789.00	120 143.55	0.02
CAD GREAT WEST LIFECO INC COM	1 577.00	45 584.00	0.01
CAD IA FINANCIAL CORP COM NPV	591.00	31 273.06	0.01
USD LULULEMON ATHLETIC COM STK USD0.01	398.00	180 855.18	0.03
CAD MAGNA INTL INC COM NPV	1 694.00	126 442.55	0.02
CAD MANULIFE FINL CORP COM	11 410.00	203 152.79	0.03
CAD NUTRIEN LTD NPV	3 290.00	217 178.98	0.03
CAD PEMBINA PIPELINE C COM NPV	3 243.00	95 560.80	0.01
CAD POWER CORP CDA COM	3 231.00	103 796.00	0.02
CAD ROGERS COMMS INC CLASS ' B ' COM CAD1.62478	2 073.00	92 370.35	0.01
CAD SHAW COMMUNICATIONS INC CL B CONV	2 699.00	77 847.68	0.01
CAD SUN LIFE FINL INC COM	3 379.00	178 669.76	0.03
CAD TC ENERGY CORPORAT COM NPV	5 632.00	263 072.53	0.04
カナダ合計		1 804 008.90	0.28
デンマーク			
DKK TRYG A/S DKK5	2 114.00	50 857.07	0.01
デンマーク合計		50 857.07	0.01
フィンランド			
EUR ELISA OYJ NPV	1 912.00	113 977.72	0.02
EUR FORTUM OYJ EUR3.40	6 507.00	186 109.93	0.03
EUR NESTE OIL OYJ NPV	3 166.00	148 853.64	0.02
EUR NOKIA OYJ NPV	43 421.00	240 194.60	0.04
EUR ORION CORP SER ' B ' NPV	1 641.00	67 031.61	0.01
EUR SAMPO PLC SER ' A ' NPV	3 829.00	187 007.53	0.03
EUR STORA ENSO OYJ NPV SER ' R '	4 337.00	73 103.87	0.01
EUR UPM-KYMMENE CORP NPV	7 559.00	272 694.55	0.04
フィンランド合計		1 288 973.45	0.20
フランス			
EUR DASSAULT AVIATION EURO0.80 (POST SUBDIVISION)	160.00	15 056.03	0.00
EUR DASSAULT SYSTEMES EURO0.10	5 347.00	320 128.44	0.05
EUR GECINA EUR7.50	338.00	45 426.06	0.01
EUR LA FRANCAISE DES EURO0.40 (PROMESSES)	971.00	44 701.97	0.01
EUR MICHELIN (CGDE) EUR2	1 313.00	192 867.62	0.03
フランス合計		618 180.12	0.10
ドイツ			
EUR ADIDAS AG NPV (REGD)	1 478.00	425 142.38	0.07
EUR ALLIANZ SE NPV(REGD)(VINKULIERT)	5 700.00	1 234 679.64	0.19

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 (%)
EUR BASF SE NPV	7 248.00	472 205.23	0.07
EUR BAYER AG NPV (REGD)	7 531.00	377 391.30	0.06
EUR BRENNTAG AG	1 310.00	111 622.38	0.02
EUR DAIMLER AG ORD NPV(REGD)	6 808.00	636 036.03	0.10
EUR DELIVERY HERO SE NPV	1 197.00	158 582.29	0.03
EUR DEUTSCHE BANK AG NPV(REGD)	16 845.00	202 121.40	0.03
EUR DEUTSCHE BOERSE AG NPV(REGD)	1 451.00	226 367.84	0.04
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA ORD NPV (REGD) (VINK)	4 784.00	28 868.29	0.00
EUR DEUTSCHE POST AG NPV(REGD)	13 714.00	805 321.08	0.13
EUR DEUTSCHE TELEKOM NPV(REGD)	26 721.00	468 842.73	0.07
EUR E.ON SE NPV	17 889.00	219 360.05	0.03
EUR EVONIK INDUSTRIES NPV	3 087.00	92 462.49	0.01
EUR HANNOVER RUECKVERS ORD NPV(REGD)	506.00	88 081.46	0.01
EUR INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)	9 814.00	441 092.27	0.07
EUR LEG IMMOBILIEN SE NPV	623.00	86 604.23	0.01
EUR MTU AERO ENGINES H NPV (REGD)	478.00	88 749.17	0.01
EUR MUENCHENER RUECKVE NPV(REGD)	1 124.00	301 554.32	0.05
EUR SCOUT24 AG NPV	762.00	50 261.64	0.01
EUR SIEMENS AG NPV(REGD)	10 397.00	1 653 380.51	0.26
EUR SIEMENS ENERGY AG NPV	3 589.00	94 692.41	0.02
EUR SIEMENS HEALTHINEE NPV	2 225.00	161 086.87	0.03
EUR TELEFONICA DEUTSCH NPV	9 574.00	25 410.97	0.00
EUR UNIPER SE NPV	712.00	30 790.83	0.00
EUR UNITED INTERNET AG NPV(REGD)	909.00	33 918.10	0.01
EUR VONOVIA SE NPV	4 078.00	224 919.64	0.04
ドイツ合計		8 739 545.55	1.37

アイルランド

USD ACCENTURE PLC SHS CL A 'NEW'	2 038.00	728 381.20	0.11
USD ALLEGION PLC CIM USD0.01	302.00	37 339.28	0.01
USD APTIV PLC COM USD0.01	887.00	142 230.45	0.02
EUR CRH ORD EURO.32	10 015.00	483 832.18	0.08
USD EATON CORP PLC COM USD0.01	3 617.00	586 171.02	0.09
GBP EXPERIAN ORD USD0.10	4 838.00	216 342.78	0.03
USD JAZZ PHARMA PLC COM USD0.0001	133.00	15 942.71	0.00
EUR KINGSPAN GROUP ORD EURO.13(DUBLIN LISTING)	1 046.00	120 327.99	0.02
USD MEDTRONIC PLC USD0.0001	4 225.00	450 807.50	0.07
USD PENTAIR PLC COM USD0.01	675.00	49 740.75	0.01
EUR SMURFIT KAPPA GRP ORD EURO.001	1 316.00	66 687.66	0.01
USD STERIS PLC ORD USD0.001	297.00	64 903.41	0.01
USD TRANE TECHNOLOGIES COM USD1	797.00	148 760.05	0.02
アイルランド合計		3 111 466.98	0.48

マン島

GBP ENTAIN PLC ORD EURO.01	3 032.00	66 949.20	0.01
マン島合計		66 949.20	0.01

イタリア

EUR ATLANTIA SPA EUR1	3 654.00	66 341.76	0.01
EUR DAVIDE CAMPARI MIL EURO.01	4 392.00	63 624.59	0.01
EUR ENEL EUR1	64 162.00	484 384.55	0.08
EUR ENI SPA EUR1	19 284.00	252 702.07	0.04
EUR FERRARI NV EURO.01(NEW)	992.00	258 715.11	0.04
EUR INTESA SANPAOLO NPV	128 291.00	305 487.40	0.05
EUR MEDIABANCA SPA EURO.5	4 571.00	50 267.80	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 (%)
EUR MONCLER SPA NPV	1 750.00	126 224.78	0.02
EUR NEXI SPA NPV	3 407.00	51 982.33	0.01
EUR PRYSMIAN SPA EURO.10	1 785.00	65 881.54	0.01
EUR RECORDATI EURO.125	1 386.00	86 490.92	0.01
EUR SNAM EUR1	25 638.00	143 540.35	0.02
EUR TERNA SPA ORD EURO.22	20 627.00	152 679.93	0.02
EUR UNICREDIT SPA NPV (POST REV SPLIT)	16 457.00	198 021.55	0.03
イタリア合計		2 306 344.68	0.36
日本			
JPY イオン	3 600.00	83 845.17	0.01
JPY A G C	2 100.00	102 646.53	0.02
JPY 味の素	1 800.00	54 010.30	0.01
JPY アサヒグループホールディングス	4 600.00	169 909.73	0.03
JPY 旭化成	13 800.00	130 227.66	0.02
JPY アステラス製薬	17 800.00	278 965.17	0.04
JPY ブリヂストン	6 000.00	243 339.65	0.04
JPY ブラザー工業	2 300.00	39 580.78	0.01
JPY キヤノン	4 300.00	94 676.12	0.02
JPY カシオ計算機	500.00	6 490.82	0.00
JPY 中部電力	3 100.00	31 288.04	0.01
JPY 大日本印刷	2 400.00	56 287.82	0.01
JPY 大和証券グループ本社	5 000.00	27 781.94	0.00
JPY デンソー	1 900.00	139 406.40	0.02
JPY 電通グループ	1 000.00	31 793.56	0.01
JPY 東日本旅客鉄道	1 400.00	86 136.77	0.01
JPY E N E O S ホールディングス	13 400.00	49 967.50	0.01
JPY 富士フイルムホールディングス	1 700.00	133 715.27	0.02
JPY 富士通	900.00	148 976.18	0.02
JPY 博報堂 D Y ホールディングス	900.00	13 419.35	0.00
JPY 浜松ホトニクス	400.00	24 589.37	0.00
JPY 日野自動車	1 100.00	9 145.27	0.00
JPY 日立建機	400.00	11 625.35	0.00
JPY 日立金属	500.00	9 256.24	0.00
JPY 日立製作所	4 200.00	247 387.38	0.04
JPY 本田技研工業	16 300.00	445 165.35	0.07
JPY H O Y A	1 600.00	253 925.76	0.04
JPY 飯田グループホールディングス	1 700.00	35 154.34	0.01
JPY I N P E X	3 500.00	28 882.82	0.00
JPY 伊藤忠商事	11 700.00	335 919.68	0.05
JPY 日本航空	300.00	5 432.21	0.00
JPY 日本都市ファンド投資法人	32.00	27 562.64	0.00
JPY ゆうちょ銀行	2 400.00	19 615.13	0.00
JPY 日本郵政	12 000.00	90 466.34	0.01
JPY 日本たばこ産業	5 300.00	106 121.36	0.02
JPY ジェイ エフ イー ホールディングス	2 000.00	23 180.24	0.00
JPY K D D I	16 000.00	465 013.87	0.07
JPY キーエンス	900.00	557 461.80	0.09
JPY コナミホールディングス	600.00	30 701.48	0.01
JPY クボタ	4 700.00	98 060.68	0.02
JPY 京セラ	3 100.00	183 769.43	0.03
JPY 協和キリン	1 100.00	30 710.29	0.01
JPY ローソン	100.00	4 879.12	0.00
JPY L I X I L	1 300.00	31 931.83	0.01
JPY 丸紅	7 700.00	69 001.28	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 マツダ	2 000.00	16 169.80	0.00
JPY メディカルホールディングス	300.00	5 389.93	0.00
JPY メルカリ	300.00	18 204.24	0.00
JPY 三菱ケミカルホールディングス	7 500.00	58 932.58	0.01
JPY 三菱商事	6 200.00	185 161.83	0.03
JPY 三菱電機	19 200.00	240 877.19	0.04
JPY 三菱地所	5 800.00	79 941.87	0.01
JPY 三菱重工業	1 300.00	29 321.41	0.00
JPY 三菱U F J フィナンシャル・グループ	54 800.00	290 252.50	0.05
JPY 三井物産	14 800.00	333 291.65	0.05
JPY みずほフィナンシャルグループ	10 830.00	133 723.72	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	4 700.00	137 260.12	0.02
JPY 村田製作所	2 500.00	184 508.34	0.03
JPY 日本電気	900.00	40 583.03	0.01
JPY ネクソン	1 800.00	35 732.09	0.01
JPY 日本碍子	800.00	12 661.06	0.00
JPY 任天堂	1 100.00	485 358.23	0.08
JPY 日本プロロジスリート投資法人	10.00	32 542.16	0.01
JPY 日本電信電話	13 200.00	363 292.09	0.06
JPY 日本郵船	700.00	45 620.68	0.01
JPY 日産自動車	9 100.00	45 113.30	0.01
JPY 野村ホールディングス	15 500.00	65 169.76	0.01
JPY 野村不動産マスターファンド投資法人	22.00	31 272.18	0.01
JPY 野村総合研究所	1 200.00	51 574.27	0.01
JPY エヌ・ティ・ティ・データ	2 500.00	52 710.38	0.01
JPY オムロン	800.00	77 255.71	0.01
JPY オリックス	6 100.00	120 608.57	0.02
JPY オリックス不動産投資法人	8.00	12 717.42	0.00
JPY 大阪瓦斯	4 400.00	70 798.36	0.01
JPY 大塚商会	1 100.00	50 279.62	0.01
JPY 大塚ホールディングス	4 100.00	149 708.05	0.02
JPY パナソニック	9 600.00	105 050.86	0.02
JPY ルネサスエレクトロニクス	5 000.00	63 499.05	0.01
JPY リソナホールディングス	8 300.00	30 379.85	0.00
JPY リコー	4 100.00	36 217.36	0.01
JPY ローム	400.00	37 447.71	0.01
JPY 参天製薬	2 700.00	35 763.79	0.01
JPY セイコーエプソン	1 800.00	29 010.52	0.00
JPY 積水化学工業	3 500.00	56 871.72	0.01
JPY セブン&アイ・ホールディングス	7 600.00	304 816.59	0.05
JPY S Gホールディングス	1 200.00	26 526.93	0.00
JPY 島津製作所	1 100.00	46 598.27	0.01
JPY ソフトバンク	28 800.00	396 318.64	0.06
JPY ソフトバンクグループ	5 200.00	276 154.83	0.04
JPY 総合警備保障	200.00	8 525.25	0.00
JPY S O M P Oホールディングス	3 400.00	139 958.61	0.02
JPY ソニーグループ	5 500.00	669 668.41	0.10
JPY S U B A R U	3 400.00	64 155.18	0.01
JPY S U M C O	1 200.00	26 294.42	0.00
JPY 住友化学	4 500.00	20 767.10	0.00
JPY 住友商事	5 700.00	77 609.76	0.01
JPY 住友電気工業	3 100.00	40 666.26	0.01
JPY 三井住友フィナンシャルグループ	5 700.00	185 891.94	0.03
JPY 三井住友トラスト・ホールディングス	2 000.00	62 706.42	0.01
JPY 住友不動産	1 400.00	43 635.56	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 - 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 武田薬品工業	7 400.00	197 537.54	0.03
JPY T D K	1 500.00	59 447.80	0.01
JPY 東京海上ホールディングス	6 100.00	306 651.99	0.05
JPY 東京電力ホールディングス	6 800.00	18 146.11	0.00
JPY 東京エレクトロン	700.00	368 911.00	0.06
JPY 凸版印刷	2 500.00	37 936.50	0.01
JPY 東芝	2 100.00	83 726.28	0.01
JPY トヨタ自動車	104 500.00	1 841 600.25	0.29
JPY トレンドマイクロ	1 400.00	80 760.93	0.01
JPY ユニ・チャーム	1 700.00	73 183.32	0.01
JPY 西日本旅客鉄道	700.00	30 195.96	0.00
JPY ヤマダホールディングス	5 600.00	19 530.58	0.00
JPY ヤマハ発動機	900.00	22 661.50	0.00
JPY 安川電機	900.00	40 345.24	0.01
JPY 横河電機	1 100.00	20 683.43	0.00
JPY Zホールディングス	13 700.00	90 734.07	0.01
日本合計		14 600 043.69	2.29
ジャージー			
USD CLARIVATE PLC COM NPV	1 000.00	23 340.00	0.00
ジャージー合計		23 340.00	0.00
ルクセンブルグ			
EUR ARCELORMITTAL NPV(POST STOCK SPLIT)	5 984.00	161 182.68	0.02
EUR EUROFINS SCIENTIFI EURO.01	1 109.00	140 981.92	0.02
EUR TENARIS S.A. USD1	4 379.00	42 695.02	0.01
ルクセンブルグ合計		344 859.62	0.05
オランダ			
EUR ADYEN NV EURO.01	157.00	432 520.24	0.07
EUR AEGON NV EURO.12	14 122.00	62 168.17	0.01
EUR ASML HOLDING NV EURO.09	3 277.00	2 580 538.40	0.39
EUR CNH INDUSTRIAL NV COM EURO.01	8 215.00	135 511.92	0.02
EUR JDE PEETS N.V. EURO.01	540.00	14 648.56	0.00
EUR KONINKLIJKE DSM NV EUR1.5	1 387.00	296 863.55	0.05
EUR NN GROUP N.V. EURO.12	3 858.00	190 812.30	0.03
EUR PROSUS N.V. EURO.05	7 356.00	587 211.47	0.09
GBP ROYAL DUTCH SHELL PLC 'A' SHS EURO.07	20 229.00	422 051.99	0.07
EUR UNIVERSAL MUSIC GR EUR10.00	5 689.00	162 073.56	0.03
オランダ合計		4 884 400.16	0.76
ポルトガル			
EUR EDP ENERGIAS PORTU EUR1(REGD)	19 983.00	108 730.51	0.02
EUR GALP ENERGIA EUR1-B	3 992.00	37 151.40	0.00
EUR JERONIMO MARTINS EUR5	2 126.00	45 981.99	0.01
ポルトガル合計		191 863.90	0.03
スペイン			
EUR BANCO SANTANDER SA EURO.50(REGD)	139 570.00	432 024.98	0.07
EUR BBVA(BILB-VIZ-ARG) EURO.49	50 913.00	269 489.33	0.04
スペイン合計		701 514.31	0.11
スウェーデン			
SEK BOLIDEN AB NPV (POST SPLIT)	1 681.00	57 720.87	0.01
SEK ELECTROLUX AB SER 'B' NPV (POST SPLIT)	1 457.00	32 512.65	0.00

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 (%)
SEK TELE2 AB SHS	3 083.00	43 859.89	0.01
SEK VOLVO AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	8 359.00	180 007.69	0.03
スウェーデン合計		314 101.10	0.05
スイス			
CHF ADECCO GROUP AG CHF0.1 (REGD)	943.00	43 614.00	0.01
CHF BALOISE-HLDGS CHF0.1(REGD)	263.00	39 106.12	0.01
USD CHUBB LIMITED ORD CHF24.15	1 461.00	262 205.67	0.04
GBP COCA-COLA HBC AG ORD CHF6.70	2 189.00	67 246.21	0.01
CHF EMS-CHEMIE HLDG AG CHF0.01(REGD)(POST RECON)	38.00	36 012.54	0.00
USD GARMIN LTD COM CHF10.00	510.00	68 105.40	0.01
CHF HOLCIM LTD CHF2 (REGD)	3 064.00	147 173.98	0.02
CHF NESTLE SA CHF0.10(REGD)	16 775.00	2 139 020.96	0.33
CHF NOVARTIS AG CHF0.50(REGD)	12 944.00	1 027 239.42	0.16
CHF PARTNERS GROUP HLG CHF0.01 (REGD)	133.00	228 517.40	0.03
CHF SGS LTD CHF1(REGD)	35.00	105 030.26	0.02
CHF SWISS LIFE HLDG CHF5.1(REGD)	194.00	111 066.78	0.02
CHF SWISSCOM AG CHF1(REGD)	148.00	81 628.70	0.01
USD TE CONNECTIVITY LT COM CHF0.57	1 081.00	166 398.33	0.03
CHF ZURICH INSURANCE GRP CHF0.10	885.00	362 549.71	0.06
スイス合計		4 884 915.48	0.76
アラブ首長国連邦			
GBP NMC HEALTH PLC ORD GBP0.1	225.00	0.00	0.00
アラブ首長国連邦合計		0.00	0.00
イギリス			
GBP ABRDN PLC ORD GBP0.1396825396	12 621.00	38 955.46	0.01
GBP ADMIRAL GROUP ORD GBP0.001	2 048.00	80 120.03	0.01
USD AMCOR PLC ORD USD0.01	14 356.00	162 509.92	0.02
GBP ANGLO AMERICAN USD0.54945	13 950.00	511 596.16	0.08
GBP ANTOFAGASTA ORD GBP0.05	4 364.00	79 675.29	0.01
GBP ASHTEAD GROUP ORD GBP0.10	2 085.00	166 721.02	0.03
GBP ASSOCD BRIT FOODS ORD GBP0.0568	1 711.00	43 530.05	0.01
GBP AUTO TRADER GROUP ORD GBP0.01	5 054.00	48 984.87	0.01
GBP BARCLAYS ORD GBP0.25	88 470.00	215 621.79	0.03
GBP BP ORD USD0.25	101 366.00	436 451.94	0.07
GBP BUNZL ORD GBP0.32142857	3 603.00	136 710.93	0.02
GBP BURBERRY GROUP ORD GBP0.0005	2 002.00	46 549.95	0.01
GBP COMPASS GROUP ORD GBP0.1105	8 522.00	164 891.11	0.03
GBP CRODA INTL ORD GBP0.10609756	758.00	101 436.66	0.02
GBP DIAGEO ORD GBP0.28 101/108	11 467.00	576 416.11	0.09
GBP DIRECT LINE INSURA ORD GBP 0.109090909	4 324.00	15 480.08	0.00
GBP FERGUSON PLC (NEW) ORD GBP0.10	2 436.00	369 497.23	0.06
GBP GLAXOSMITHKLINE ORD GBP0.25	54 106.00	1 091 629.13	0.17
GBP HARGREAVES LANSDOW ORD GBP0.004 (WI)	3 694.00	65 341.36	0.01
GBP HSBC HLDGS ORD USD0.50(UK REG)	102 775.00	570 195.75	0.09
GBP IMPERIAL BRANDS PL GBP0.10	9 721.00	198 314.82	0.03
GBP INTERCONTL HOTELS ORD GBP0.208521303	867.00	51 031.85	0.01
GBP INTERTEK GROUP ORD GBP0.01	946.00	66 833.20	0.01
GBP JD SPORTS FASHION ORD GBP0.0005	19 015.00	56 074.61	0.01
GBP LEGAL & GENERAL GP ORD GBP0.025	29 968.00	111 766.76	0.02
USD LIBERTY GLOBAL INC USD0.01 C	810.00	21 578.40	0.00
USD LINDE PLC COM EURO.001	1 656.00	526 839.84	0.08
GBP LONDON STOCK EXCH ORD GBP0.06918604	1 720.00	147 956.91	0.02

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 (%)
GBP M&G PLC ORD GBP0.05	25 772.00	63 726.09	0.01
GBP MELROSE INDUST PLC ORD GBP0.076190476	21 689.00	41 607.09	0.01
GBP MONDI ORD EURO.20	5 400.00	122 844.52	0.02
GBP NATWEST GROUP PLC ORD GBP1	31 601.00	88 884.07	0.01
GBP NEXT ORD GBP0.10	679.00	70 625.68	0.01
GBP PEARSON ORD GBP0.25	3 732.00	29 288.87	0.00
GBP PERSIMMON ORD GBP0.10	3 516.00	127 316.15	0.02
GBP PHOENIX GP HLDGS ORD GBP0.10	3 366.00	28 509.50	0.00
GBP PRUDENTIAL ORD GBP0.05	12 828.00	216 555.63	0.03
GBP RIO TINTO ORD GBP0.10	12 345.00	753 251.90	0.12
GBP SAINSBURY(J) ORD GBP0.28571428	9 456.00	34 603.46	0.01
GBP SCHROEDERS VTG SHS GBP1	1 376.00	62 550.59	0.01
GBP SMITH & NEPHEW ORD USD0.20	4 355.00	70 148.28	0.01
GBP STANDARD CHARTERED ORD USD0.50	13 587.00	74 814.45	0.01
EUR STELLANTIS N V COM EURO.01	15 784.00	268 984.36	0.04
GBP TAYLOR WIMPEY ORD GBP0.01	18 561.00	38 774.25	0.01
GBP TESCO ORD GBP0.0633333	84 562.00	309 615.52	0.05
GBP UNILEVER PLC ORD GBP0.031111	24 943.00	1 273 454.14	0.20
EUR UNILEVER PLC ORD GBP0.031111	3 346.00	171 044.59	0.03
GBP VODAFONE GROUP ORD USD0.2095238(POST CONS)	142 038.00	205 467.66	0.03
イギリス合計		10 154 778.03	1.59

アメリカ合衆国

USD 10X GENOMICS INC COM USD0.00001 CLASS A	200.00	30 562.00	0.00
USD ABBOTT LABS COM	5 693.00	716 008.61	0.11
USD ABBVIE INC COM USD0.01	15 954.00	1 839 177.12	0.29
USD ABIOMED INC COM	179.00	56 345.62	0.01
USD ACTIVISION BLIZZAR COM STK USD0.000001	2 678.00	156 930.80	0.02
USD ADOBE INC COM USD0.0001	1 546.00	1 035 588.10	0.16
USD ADVANCE AUTO PARTS COM USD0.0001	262.00	57 828.64	0.01
USD ADVANCED MICRO DEV COM USD0.01	3 959.00	626 986.83	0.10
USD AES CORP COM	2 451.00	57 304.38	0.01
USD AGILENT TECHNOLOGIES INC COM	1 035.00	156 181.50	0.02
USD AGNC INV CORP COM USD0.01	1 208.00	18 470.32	0.00
USD AIR PRODS & CHEMS COM USD1	703.00	202 070.32	0.03
USD AIRBNB INC USD0.0001 A	400.00	69 016.00	0.01
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQ INC COM	422.00	84 429.54	0.01
USD ALLSTATE CORP COM	2 802.00	304 633.44	0.05
USD ALLY FINANCIAL INC COM USD0.01	1 082.00	49 588.06	0.01
USD ALPHABET INC CAP STK USD0.001 CL A	972.00	2 758 487.40	0.43
USD ALTRIA GROUP INC COM USD0.333333	17 092.00	728 802.88	0.11
USD AMAZON COM INC COM USD0.01	1 470.00	5 155 392.90	0.81
USD AMER EXPRESS CO COM USD0.20	2 146.00	326 835.80	0.05
USD AMER FINL GP OHIO COM NPV	601.00	80 299.61	0.01
USD AMER INTL GRP COM USD2.50	2 799.00	147 227.40	0.02
USD AMER TOWER CORP COM NEW USD0.01	1 476.00	387 420.48	0.06
USD AMEREN CORP COM	2 331.00	190 186.29	0.03
USD AMERIPRISE FINL INC COM	416.00	120 473.60	0.02
USD AMERISOURCEBERGEN COM STK USD0.01	549.00	63 546.75	0.01
USD AMETEK INC COM USD0.01	657.00	89 680.50	0.01
USD AMGEN INC COM USD0.0001	5 191.00	1 032 386.08	0.16
USD AMPHENOL CORP NEW CL A	1 741.00	140 289.78	0.02
USD ANALOG DEVICES INC COM	1 737.00	313 094.25	0.05
USD ANNALY CAPITAL MAN COM USD0.01	4 888.00	39 592.80	0.01
USD ANTHEM INC COM USD0.01	810.00	329 046.30	0.05

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 (%)
USD AON PLC COM USD0.01 CL A	747.00	220 940.19	0.03
USD APOLLO GLOBAL MANA COM USD0.00001 CLASS A	610.00	43 175.80	0.01
USD APPLE INC COM NPV	54 007.00	8 927 357.10	1.40
USD APPLIED MATLS INC COM	2 974.00	437 743.06	0.07
USD ARAMARK COM USD0.01	612.00	20 440.80	0.00
USD ARCHER DANIELS MIDLAND CO COM	5 095.00	316 959.95	0.05
USD ASSURANT INC COM	175.00	26 617.50	0.00
USD AT&T INC COM USD1	64 614.00	1 475 137.62	0.23
USD ATHENE HOLDING LTD COM USD0.001 CL A	414.00	33 914.88	0.01
USD ATMOS ENERGY CORP COM	1 200.00	108 384.00	0.02
USD AUTO DATA PROCESS COM USD0.10	1 410.00	325 554.90	0.05
USD AUTODESK INC COM USD0.01	699.00	177 678.81	0.03
USD AUTOZONE INC COM USD0.01	74.00	134 463.18	0.02
USD AVALARA INC COM USD0.0001	300.00	41 904.00	0.01
USD AVALONBAY COMMUNI COM USD0.01	448.00	107 013.76	0.02
USD AVANTOR INC COM USD0.01	1 872.00	73 906.56	0.01
USD AVERY DENNISON CORP COM	288.00	59 060.16	0.01
USD BALL CORP COM NPV	1 142.00	106 719.90	0.02
USD BATH & BODY WORKS COM USD0.5	729.00	54 769.77	0.01
USD BAXTER INTL INC COM USD1	1 672.00	124 681.04	0.02
USD BECTON DICKINSON COM USD1	930.00	220 540.20	0.03
USD BENTLEY SYSTEMS IN COM USD0.01 CLASS B	600.00	28 794.00	0.00
USD BEST BUY CO INC COM USD0.10	2 018.00	215 643.48	0.03
USD BIOGEN INC COM STK USD0.0005	485.00	114 333.90	0.02
USD BK OF AMERICA CORP COM USD0.01	24 876.00	1 106 235.72	0.17
USD BK OF NY MELLON CP COM STK USD0.01	7 557.00	414 048.03	0.06
USD BLACKSTONE INC COM USD0.00001	2 148.00	303 834.60	0.05
USD BOEING CO COM USD5	1 832.00	362 461.20	0.06
USD BOOKING HLDGS INC COM USD0.008	141.00	296 360.85	0.05
USD BORG WARNER INC COM	1 018.00	44 059.04	0.01
USD BRISTOL-MYRS SQUIB COM STK USD0.10	20 355.00	1 091 638.65	0.17
USD BROADCOM CORP COM USD1.00	1 357.00	751 343.76	0.12
USD BUNGE LIMITED COM USD0.01	410.00	35 493.70	0.01
USD BURLINGTON STORES COM USD0.0001	223.00	65 367.99	0.01
USD CAESARS ENT INC COM USD0.00001	700.00	63 049.00	0.01
USD CAPITAL ONE FINL COM USD0.01	1 576.00	221 475.28	0.03
USD CARDINAL HEALTH INC COM	984.00	45 490.32	0.01
USD CARLYLE GROUP INC COM USD0.01	742.00	40 579.98	0.01
USD CARMAX INC COM USD0.50	513.00	72 461.25	0.01
USD CARNIVAL CORP COM USD0.01(PAIRE STOCK)	3 143.00	55 379.66	0.01
USD CARRIER GLOBAL COR COM USD0.01	2 711.00	146 719.32	0.02
USD CATERPILLAR INC DEL COM	1 780.00	344 163.00	0.05
USD CBOE GLOBAL MARKET COM USD0.01	371.00	47 836.74	0.01
USD CBRE GROUP INC CLASS 'A' USD0.01	1 093.00	104 458.01	0.02
USD CELANESE CORP COM SERIES 'A' USD0.0001	385.00	58 273.60	0.01
USD CENTENE CORP DEL COM	1 888.00	134 822.08	0.02
USD CENTERPOINT ENERGY INC COM	1 418.00	36 740.38	0.01
USD CERIDIAN HCM HLDG COM USD0.01	500.00	54 700.00	0.01
USD CF INDS HLDGS INC COM	530.00	32 112.70	0.01
USD CH ROBINSON WORLDW COM USD0.1	294.00	27 956.46	0.00
USD CHARTER COMMUN INC COM USD0.001 CLASS 'A'	409.00	264 328.52	0.04
USD CHEVRON CORP COM USD0.75	6 361.00	717 966.07	0.11
USD CHEWY INC COM USD0.01 CL A	200.00	13 652.00	0.00
USD CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC CL A	97.00	159 410.77	0.02
USD CHURCH & DWIGHT INC COM	845.00	75 526.10	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 (%)
USD CIGNA CORP COM USD0.25	1 065.00	204 373.50	0.03
USD CISCO SYSTEMS COM USD0.001	38 070.00	2 087 758.80	0.33
USD CITIGROUP INC COM USD0.01	6 549.00	417 171.30	0.07
USD CITIZENS FINL GP COM USD0.01	3 626.00	171 401.02	0.03
USD CITRIX SYSTEMS INC COM USD0.001	391.00	31 448.13	0.00
USD CLOUDFLARE INC COM USD0.001 CL A	800.00	150 592.00	0.02
USD COGNIZANT TECHNOLO COM CL ' A ' USD0.01	1 786.00	139 272.28	0.02
USD COMCAST CORP COM CLS ' A ' USD0.01	15 197.00	759 546.06	0.12
USD CONAGRA BRANDS IN COM USD5	4 365.00	133 350.75	0.02
USD CONOCOPHILLIPS COM USD0.01	4 306.00	301 979.78	0.05
USD CONSOLIDATED EDISON INC COM	3 125.00	242 625.00	0.04
USD COOPER COS INC COM USD0.10	168.00	63 246.96	0.01
USD CORNING INC COM USD0.50	2 286.00	84 787.74	0.01
USD CORTEVA INC COM USD0.01	2 578.00	116 010.00	0.02
USD COSTCO WHSL CORP NEW COM	1 425.00	768 616.50	0.12
USD CROWDSTRIKE HOLDIN COM USD0.0005 CL A	564.00	122 466.96	0.02
USD CROWN CASTLE INTL COM USD0.01	1 434.00	260 486.10	0.04
USD CROWN HOLDINGS INC COM USD5	373.00	39 463.40	0.01
USD CUMMINS INC COM	1 349.00	282 952.75	0.04
USD CVS HEALTH CORP COM STK USD0.01	11 787.00	1 049 750.22	0.16
USD D R HORTON INC COM	988.00	96 527.60	0.02
USD DANAHER CORP COM USD0.01	2 062.00	663 221.68	0.10
USD DARDEN RESTAURANTS INC COM	435.00	60 008.25	0.01
USD DATADOG INC COM USD0.00001 CL A	600.00	106 974.00	0.02
USD DAVITA INC COM USD0.001	204.00	19 278.00	0.00
USD DELL TECHNOLOGIES COM USD0.01 CL C	1 029.00	58 107.63	0.01
USD DELTA AIRLINES INC COM USD0.0001	793.00	28 706.60	0.00
USD DENTSPLY SIRONA IN COM NPV	787.00	38 358.38	0.01
USD DISCOVER FINL SVCS COM STK USD0.01	977.00	105 369.45	0.02
USD DISH NETWORK CORPO CLASS ' A ' COM USD0.01	653.00	20 406.25	0.00
USD DOCUSIGN INC COM USD0.0001	639.00	157 424.04	0.02
USD DOLLAR GENERAL CP COM USD0.875	808.00	178 810.40	0.03
USD DOLLAR TREE INC	680.00	91 004.40	0.01
USD DOMINOS PIZZA INC COM USD0.01	132.00	69 186.48	0.01
USD DOORDASH INC COM USD0.00001 CLASS A	300.00	53 631.00	0.01
USD DOVER CORP COM	508.00	83 235.80	0.01
USD DOW INC COM USD0.01	6 861.00	376 874.73	0.06
USD DRAFTKINGS INC COM USD0.0001 CL A	1 200.00	41 460.00	0.01
USD DTE ENERGY CO COM	1 773.00	192 086.82	0.03
USD DUPONT DE NEMOURS COM USD0.01	1 651.00	122 107.96	0.02
USD DYNATRACE INC COM USD0.001	350.00	21 997.50	0.00
USD EASTMAN CHEM CO COM	1 255.00	130 883.95	0.02
USD EBAY INC COM USD0.001	2 261.00	152 527.06	0.02
USD EDISON INTL COM	3 413.00	222 800.64	0.03
USD ELANCO ANIMAL HEAL COM NPV	1 588.00	45 639.12	0.01
USD ELECTRONIC ARTS INC COM	937.00	116 394.14	0.02
USD ELI LILLY AND CO COM NPV	2 617.00	649 120.68	0.10
USD EMERSON ELEC CO COM	5 384.00	472 930.56	0.07
USD ENTERGY CORP NEW COM	675.00	67 729.50	0.01
USD EQUINIX INC COM USD0.001 NEW	282.00	229 040.40	0.04
USD EQUITABLE HOLDINGS COM USD0.01	1 428.00	44 924.88	0.01
USD ESSENTIAL UTILS IN COM USD0.50	584.00	27 605.68	0.00
USD ESTEE LAUDER COS CLASS ' A ' COM USD0.01	762.00	253 037.34	0.04
USD EVERGY INC COM NPV	2 046.00	129 511.80	0.02
USD EVERSOURCE ENERGY COM USD5	3 100.00	255 037.00	0.04

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 (%)
USD EXELON CORP COM NPV	3 132.00	165 150.36	0.03
USD EXPEDIA GROUP INC COM USD0.001	488.00	78 611.92	0.01
USD EXTRA SPACE STORAG COM USD0.01	457.00	91 400.00	0.01
USD EXXON MOBIL CORP COM NPV	13 628.00	815 499.52	0.13
USD FEDEX CORP COM USD0.10	795.00	183 144.15	0.03
USD FIDELITY NATL INF COM STK USD0.01	2 171.00	226 869.50	0.04
USD FIFTH THIRD BANCORP COM	6 188.00	260 824.20	0.04
USD FIRST REPUBLIC BAN COM USD0.01	569.00	119 296.54	0.02
USD FIRSTENERGY CORP COM USD0.10	1 877.00	70 687.82	0.01
USD FISERV INC COM USD0.01	2 022.00	195 163.44	0.03
USD FLEETCOR TECHNOLOG COM STK USD0.001	275.00	56 960.75	0.01
USD FORD MOTOR CO COM STK USD0.01	12 344.00	236 881.36	0.04
USD FORTUNE BRANDS HOME USD0.01 WI	564.00	56 698.92	0.01
USD FOX CORP COM USD0.01 CL A	922.00	32 924.62	0.01
USD FOX CORP COM USD0.01 CL B	663.00	22 276.80	0.00
USD FREEPORT-MCMORAN COM STK USD0.10	4 740.00	175 759.20	0.03
USD GEN ELEC CO COM USD0.01(POST REV SPLIT)	3 610.00	342 913.90	0.05
USD GENERAL MLS INC COM	5 466.00	337 634.82	0.05
USD GENERAL MOTORS CO COM USD0.01	4 101.00	237 324.87	0.04
USD GENUINE PARTS CO COM STK USD1	1 256.00	160 441.44	0.03
USD GILEAD SCIENCES COM USD0.001	3 973.00	273 858.89	0.04
USD GLOBAL PAYMENTS COM NPV	986.00	117 373.44	0.02
USD GLOBE LIFE INC COM USD1.00	253.00	21 894.62	0.00
USD GODADDY INC COM CL A USD0.001	663.00	46 522.71	0.01
USD GOLDMAN SACHS GRP COM USD0.01	1 111.00	423 279.89	0.07
USD GRAINGER W W INC COM	145.00	69 804.45	0.01
USD HALLIBURTON COM STK USD2.50	2 819.00	60 862.21	0.01
USD HARTFORD FINL SVCS COM USD0.01	3 167.00	209 338.70	0.03
USD HASBRO INC COM	1 203.00	116 582.73	0.02
USD HCA HEALTHCARE INC COM USD0.01	845.00	190 623.55	0.03
USD HEALTHPEAK PTYS I COM USD1	1 530.00	50 275.80	0.01
USD HERSHEY COMPANY COM USD1.00	486.00	86 260.14	0.01
USD HESS CORPORATION COM USD1	754.00	56 188.08	0.01
USD HEWLETT PACKARD EN COM USD0.01	5 006.00	71 836.10	0.01
USD HILTON WORLDWIDE H COM USD0.01	845.00	114 134.15	0.02
USD HOLOGIC INC COM USD0.01	801.00	59 858.73	0.01
USD HOME DEPOT INC COM USD0.05	3 435.00	1 376 095.35	0.22
USD HORMEL FOODS CORP COM USD0.0586	1 085.00	44 919.00	0.01
USD HOST HOTELS & RESO COM STK USD0.01	2 658.00	41 730.60	0.01
USD HOWMET AEROSPACE I COM USD1.00	1 491.00	41 941.83	0.01
USD HP INC COM USD0.01	11 266.00	397 464.48	0.06
USD HUMANA INC COM USD0.166	419.00	175 858.49	0.03
USD HUNTINGTON BANCSHARES INC COM	13 137.00	194 953.08	0.03
USD HUNTINGTON INGALLS COM USD0.01	297.00	52 720.47	0.01
USD IAC/INTERACTIVECOR COM USD0.0001	293.00	39 159.45	0.01
USD INGERSOLL RAND INC COM USD1.00	1 295.00	75 550.30	0.01
USD INTEL CORP COM USD0.001	36 423.00	1 792 011.60	0.28
USD INTL BUSINESS MCHN COM USD0.20	8 139.00	953 076.90	0.15
USD INTL PAPER CO COM USD1.00	3 462.00	157 590.24	0.02
USD INTUIT INC COM USD0.01	878.00	572 719.40	0.09
USD INVESCO LTD COM STK USD0.20	1 093.00	24 406.69	0.00
USD IQVIA HOLDINGS INC COM USD0.01	636.00	164 806.68	0.03
USD IRON MTN INC NEW COM NPV	734.00	33 352.96	0.01
USD JACOBS ENG GROUP COM USD1	466.00	66 432.96	0.01
USD JOHNSON CTLS INTL COM USD0.01	2 203.00	164 696.28	0.03

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 (%)
USD KANSAS CITY STHN I COM USD0.01	283.00	82 310.55	0.01
USD KELLOGG CO COM USD0.25	2 397.00	146 648.46	0.02
USD KEURIG DR PEPPER COM USD0.01	2 571.00	87 388.29	0.01
USD KEYCORP NEW COM	9 046.00	202 992.24	0.03
USD KEYSIGHT TECHNOLOG COM USD0.01 'WD'	650.00	126 412.00	0.02
USD KIMBERLY-CLARK CP COM USD1.25	3 051.00	397 575.81	0.06
USD KINDER MORGAN INC USD0.01	6 519.00	100 783.74	0.02
USD KKR & CO INC COM NPV CLASS A	1 807.00	134 531.15	0.02
USD KLA CORPORATION COM USD0.001	507.00	206 921.91	0.03
USD KNIGHT SWIFT TRANS CL A COM STK USD0.01	652.00	37 327.00	0.01
USD KROGER CO COM USD1	2 581.00	107 188.93	0.02
USD L3HARRIS TECHNOLOG COM USD1.00	676.00	141 338.08	0.02
USD LAB CORP AMER HLDG COM USD0.1	327.00	93 302.91	0.01
USD LAM RESEARCH CORP COM USD0.001	467.00	317 489.95	0.05
USD LAS VEGAS SANDS CORP COM	1 129.00	40 214.98	0.01
USD LEAR CORP COM USD0.01	161.00	27 014.19	0.00
USD LENNAR CORP COM CL 'A' USD0.10	1 007.00	105 785.35	0.02
USD LINCOLN NATL CORP COM NPV	1 553.00	103 010.49	0.02
USD LKQ CORP COM	1 008.00	56 347.20	0.01
USD LOWE 'S COS INC COM USD0.50	2 259.00	552 528.81	0.09
USD LUMEN TECHNOLOGIES COM USD1.00	3 356.00	41 413.04	0.01
USD LYFT INC COM USD0.00001 CLASS A	900.00	36 549.00	0.01
USD MARATHON PETROLEUM COM USD0.01	5 896.00	358 771.60	0.06
USD MARRIOTT INTL INC COM USD0.01 CLASS 'A'	925.00	136 493.00	0.02
USD MARVELL TECHNOLOGY COM USD0.002	2 574.00	183 191.58	0.03
USD MASCO CORP COM	895.00	58 980.50	0.01
USD MASTERCARD INC COM USD0.0001 CLASS 'A'	2 858.00	900 041.36	0.14
USD MATCH GRP INC NEW COM NPV	816.00	106 071.84	0.02
USD MCCORMICK & CO INC COM N/VTGP NPV	824.00	70 715.68	0.01
USD MCDONALD 'S CORP COM USD0.01	6 801.00	1 663 524.60	0.26
USD MCKESSON CORP COM USD0.01	522.00	113 148.72	0.02
USD MERCK & CO INC COM USD0.50	22 807.00	1 708 472.37	0.27
USD META PLATFORMS INC	7 748.00	2 513 916.08	0.39
USD METLIFE INC COM USD0.01	2 411.00	141 429.26	0.02
USD MGM RESORTS INTL COM STK USD0.01	1 108.00	43 854.64	0.01
USD MICROCHIP TECHN LGY COM USD0.001	1 934.00	161 353.62	0.03
USD MICRON TECHNOLOGY COM USD0.10	3 706.00	311 304.00	0.05
USD MICROSOFT CORP COM USD0.0000125	23 137.00	7 648 860.83	1.20
USD MID-AMER APARTMENT COM STK USD0.01	390.00	80 437.50	0.01
USD MODERNA INC COM USD0.0001	1 100.00	387 673.00	0.06
USD MOHAWK INDS COM USD0.01	233.00	39 113.71	0.01
USD MOLSON COORS BEVER COM USD0.01 CLASS B	463.00	20 575.72	0.00
USD MONDELEZ INTL INC COM USD0.01	4 524.00	266 644.56	0.04
USD MORGAN STANLEY COM STK USD0.01	4 432.00	420 242.24	0.07
USD MOSAIC CO COM USD0.01	984.00	33 672.48	0.01
USD MOTOROLA SOLUTIONS COM USD0.01	562.00	142 287.16	0.02
USD MSCI INC COM STK USS0.01	264.00	166 174.80	0.03
USD NETAPP INC COM USD0.001	2 032.00	180 604.16	0.03
USD NETFLIX INC COM USD0.001	1 437.00	922 410.30	0.14
USD NEWELL BRANDS INC COM USD1	1 127.00	24 196.69	0.00
USD NEWMONT CORPORATIO COM USD1.60	2 233.00	122 636.36	0.02
USD NIKE INC CLASS 'B' COM NPV	4 110.00	695 576.40	0.11
USD NISOURCE INC COM NPV	1 972.00	48 333.72	0.01
USD NORFOLK STHN CORP COM USD1	827.00	219 378.29	0.03
USD NORTHERN TRUST CP COM USD1.666	1 831.00	211 846.70	0.03

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 (%)
USD NORTONLIFELOCK INC COM USD0.01	1 976.00	49 103.60	0.01
USD NOVAVAX INC COM USD0.01(POST REV SPLIT)	200.00	41 726.00	0.01
USD NRG ENERGY INC COM USD0.01	709.00	25 538.18	0.00
USD NUCOR CORP COM	893.00	94 890.18	0.01
USD NVIDIA CORP COM USD0.001	8 069.00	2 636 626.44	0.41
USD NVR INC COM STK USD0.01	10.00	52 253.40	0.01
USD OAK STREET HEALTH COM USD0.001	300.00	9 285.00	0.00
USD OCCIDENTAL PETRLM COM USD0.20	2 963.00	87 852.95	0.01
USD OLD DOMINION FGHT LINES INC COM	328.00	116 495.76	0.02
USD OMNICOM GROUP INC COM USD0.15	1 963.00	132 129.53	0.02
USD ON SEMICONDUCTOR COM USD0.01	1 207.00	74 146.01	0.01
USD ONEOK INC	1 488.00	89 041.92	0.01
USD ORACLE CORP COM USD0.01	5 962.00	540 991.88	0.08
USD OREILLY AUTO NEW COM USD0.01	243.00	155 072.88	0.02
USD OTIS WORLDWIDE COR COM USD0.01	1 279.00	102 831.60	0.02
USD OWENS CORNING COM STK USD0.01	447.00	37 923.48	0.01
USD PACCAR INC COM STK USD1	3 208.00	267 611.36	0.04
USD PACKAGING CORP AMER COM	937.00	122 362.83	0.02
USD PALANTIR TECH INC COM USD0.001 CLASS A	5 000.00	103 250.00	0.02
USD PALO ALTO NETWORKS COM USD0.0001	314.00	171 739.16	0.03
USD PARKER-HANNIFIN COM STK USD0.50	415.00	125 354.90	0.02
USD PAYCHEX INC COM	2 819.00	336 024.80	0.05
USD PAYPAL HOLDINGS IN COM USD0.0001	3 584.00	662 645.76	0.10
USD PELOTON INTERACTIV COM USD0.000025 CL A	900.00	39 600.00	0.01
USD PFIZER INC COM USD0.05	50 656.00	2 721 746.88	0.43
USD PG&E CORP COM	5 049.00	59 982.12	0.01
USD PHILLIPS 66 COM USD0.01	1 402.00	96 976.34	0.02
USD PINNACLE WEST CAP CORP COM	949.00	61 732.45	0.01
USD PINTEREST INC COM USD0.00001 CL A	1 800.00	72 108.00	0.01
USD PNC FINANCIAL SVCS COM USD5	3 907.00	769 679.00	0.12
USD PPD INC COM USD0.01	400.00	18 840.00	0.00
USD PPL CORP COM USD0.01	7 117.00	198 066.11	0.03
USD PRINCIPAL FINL GP COM USD0.01	2 529.00	173 438.82	0.03
USD PROCTER & GAMBLE COM NPV	22 166.00	3 204 760.28	0.50
USD PROLOGIS INC COM USD0.01	2 349.00	354 111.75	0.06
USD PRUDENTIAL FINL COM USD0.01	1 285.00	131 404.10	0.02
USD PUBLIC SVC ENTERPRISE GROUP COM	4 607.00	287 891.43	0.05
USD QUALCOMM INC COM USD0.0001	3 606.00	651 099.36	0.10
USD QUEST DIAGNOSTICS INC COM	428.00	63 635.04	0.01
USD RAYMOND JAMES FINANCIAL INC COM	649.00	63 790.21	0.01
USD RAYTHEON TECHNOLOG COM USD1.00	4 652.00	376 439.84	0.06
USD REGENCY CENTERS COM USD0.01	546.00	37 859.64	0.01
USD REGENERON PHARMACE COM USD0.001	361.00	229 787.33	0.04
USD REGIONS FINANCIAL CORP NEW COM	9 330.00	212 257.50	0.03
USD REPUBLIC SERVICES COM USD0.01	638.00	84 381.88	0.01
USD ROBERT HALF INTL COM USD0.001	358.00	39 798.86	0.01
USD ROCKWELL AUTOMATIO COM USD1	376.00	126 411.20	0.02
USD ROSS STORES INC COM USD0.01	1 146.00	125 017.14	0.02
USD ROYAL CARIBBEAN GR COM USD0.01	857.00	59 835.74	0.01
USD ROYALTY PHARMA PLC COM USD0.0001 CLASS A	500.00	19 885.00	0.00
USD SALESFORCE.COM INC COM USD0.001	3 141.00	895 059.36	0.14
USD SBA COMMUNICATIONS COM USD0.01 CL A	353.00	121 361.40	0.02
USD SCHEIN HENRY INC COM	332.00	23 591.92	0.00
USD SCHLUMBERGER COM USD0.01	4 583.00	131 440.44	0.02
USD SCHWAB(CHARLES)CP COM USD0.01	4 705.00	364 119.95	0.06

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 (%)
USD SEAGATE TECHNOLOGY COM USD0.00001	1 982.00	203 491.94	0.03
USD SEAGEN INC COM USD0.001	521.00	83 360.00	0.01
USD SEALED AIR CORP NEW COM	586.00	36 402.32	0.01
USD SEI INVESTMENT COM USD0.01	353.00	21 049.39	0.00
USD SENSATA TECHNO PLC COM EURO.01	730.00	40 661.00	0.01
USD SERVICENOW INC COM USD0.001	624.00	404 164.80	0.06
USD SIMON PROP GROUP COM USD0.0001	1 024.00	156 508.16	0.02
USD SIRIUS XM HLDGS IN COM USD0.001	2 160.00	13 176.00	0.00
USD SKYWORKS SOLUTIONS INC COM	575.00	87 204.50	0.01
USD SMUCKER(JM)CO COM NPV	1 056.00	133 552.32	0.02
USD SNAP-ON INC COM USD1	507.00	104 396.37	0.02
USD SNOWFLAKE INC COM USD0.0001 CLASS A	600.00	204 090.00	0.03
USD SOUTHWEST AIRLINES COM USD1	453.00	20 113.20	0.00
USD SQUARE INC COM USD0.0000001 CL A	1 272.00	264 995.76	0.04
USD STANLEY BLACK & DE COM USD2.50	531.00	92 797.56	0.01
USD STARBUCKS CORP COM USD0.001	3 766.00	412 904.24	0.06
USD STATE STREET CORP COM STK USD1	3 308.00	294 312.76	0.05
USD STEEL DYNAMICS INC COM	840.00	50 232.00	0.01
USD SYNCHRONY FINANCIA COM USD0.001	5 194.00	232 639.26	0.04
USD SYSCO CORP COM USD1	4 849.00	339 623.96	0.05
USD T ROWE PRICE GROUP COM USD0.20	2 018.00	403 499.10	0.06
USD T-MOBILE US INC COM USD0.0001	1 985.00	215 987.85	0.03
USD TARGET CORP COM STK USD0.0833	1 643.00	400 629.12	0.06
USD TELEFLEX INC COM	157.00	46 694.94	0.01
USD TESLA INC COM USD0.001	2 653.00	3 037 048.28	0.48
USD TEXAS INSTRUMENTS COM USD1	8 417.00	1 619 178.29	0.25
USD THERMO FISHER SCIE COM USD1	1 273.00	805 592.59	0.13
USD TJX COS INC COM USD1	3 816.00	264 830.40	0.04
USD TRACTOR SUPPLY CO COM USD0.008	407.00	91 709.31	0.01
USD TRADEWEB MARKETS I COM USD0.00001 CL A	400.00	38 400.00	0.01
USD TRANSDIGM GROUP INC COM	161.00	93 066.05	0.01
USD TRAVELERS CO INC COM NPV	2 302.00	338 278.90	0.05
USD TRUIST FINL CORP COM USD5	12 289.00	728 860.59	0.11
USD TWITTER INC COM USD0.000005	2 534.00	111 343.96	0.02
USD TYSON FOODS INC CL A	2 723.00	215 008.08	0.03
USD UBER TECHNOLOGIES COM USD0.00001	4 016.00	152 608.00	0.02
USD UGI CORP NEW COM	862.00	35 557.50	0.01
USD ULTA BEAUTY INC COM STK USD0.01	176.00	67 575.20	0.01
USD UNION PACIFIC CORP COM USD2.50	2 100.00	494 844.00	0.08
USD UNITED RENTALS INC COM	240.00	81 297.60	0.01
USD UNITEDHEALTH GRP COM USD0.01	3 031.00	1 346 430.82	0.21
USD UNITY SOFTWARE INC COM USD0.000005	200.00	34 478.00	0.01
USD UNIVERSAL HEALTH S CLASS ' B ' COM USD0.01	268.00	31 819.64	0.00
USD US BANCORP COM USD0.01	12 797.00	708 185.98	0.11
USD VAIL RESORTS INC COM	98.00	32 507.58	0.01
USD VALERO ENERGY CORP NEW COM	1 321.00	88 427.74	0.01
USD VERIZON COMMUN COM USD0.10	37 796.00	1 900 004.92	0.30
USD VF CORP COM NPV	1 096.00	78 616.08	0.01
USD VIACOMCBS INC COM USD0.001 CL B	5 785.00	179 045.75	0.03
USD VIATRIS INC COM USD0.01	4 045.00	49 793.95	0.01
USD VISA INC COM STK USD0.0001	5 453.00	1 056 627.81	0.17
USD VISTRA CORP COM USD0.01	1 104.00	21 947.52	0.00
USD VONTIER CORP COM USD0.0001	0.80	25.21	0.00
USD WALGREENS BOOTS AL COM USD0.01	2 419.00	108 371.20	0.02
USD WALMART INC COM USD0.10	4 949.00	695 977.87	0.11

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 (%)
USD WALT DISNEY CO. DISNEY COM USD0.01	5 882.00	852 301.80	0.13
USD WASTE MGMT INC DEL COM	1 293.00	207 746.31	0.03
USD WELLS FARGO & CO COM USD1 2/3	13 311.00	635 999.58	0.10
USD WELLTOWER INC COM USD1	1 335.00	106 292.70	0.02
USD WESTERN DIGITAL CORP COM	810.00	46 850.40	0.01
USD WESTROCK CO COM USD0.01	1 035.00	44 908.65	0.01
USD WEYERHAEUSER CO COM USD1.25	2 613.00	98 274.93	0.02
USD WHIRLPOOL CORP COM	520.00	113 224.80	0.02
USD WILLIAMS COS INC COM USD1	4 214.00	112 893.06	0.02
USD WORKDAY INC COM USD0.001 CL A	595.00	163 166.85	0.03
USD WYNN RESORTS LTD COM	288.00	23 330.88	0.00
USD XILINX INC COM USD0.01	793.00	181 160.85	0.03
USD XYLEM INC COM USD0.01 WI	522.00	63 219.42	0.01
USD YUM BRANDS INC COM	985.00	120 997.40	0.02
USD ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC COM USD0.01	693.00	82 882.80	0.01
USD ZOOM VIDEO COMMUNI COM USD0.001 CL A	702.00	148 409.82	0.02
アメリカ合衆国合計		125 831 087.37	19.71
記名株式合計		182 428 514.09	28.56
預託証券			
アイルランド			
AUD JAMES HARDIE ID PLC CUFS EURO0.5	4 653.00	183 667.00	0.03
アイルランド合計		183 667.00	0.03
オランダ			
EUR ABN AMRO BANK N.V. DR EACH REP SHS	4 035.00	57 226.63	0.01
オランダ合計		57 226.63	0.01
預託証券合計		240 893.63	0.04
投資信託、クローズド・エンド型			
イギリス			
GBP SEGRO PLC REIT	5 753.00	107 242.08	0.02
イギリス合計		107 242.08	0.02
アメリカ合衆国			
USD DUKE REALTY CORP REIT	1 379.00	80 437.07	0.01
USD EQUITY RESIDENTIAL SBI USD0.01	1 219.00	103 992.89	0.02
USD VENTAS INC REIT	1 196.00	56 116.32	0.01
アメリカ合衆国合計		240 546.28	0.04
投資信託、クローズド・エンド型合計		347 788.36	0.06
新株引受権			
ドイツ			
EUR VONOVIA SE RIGHTS 07.12.21	4 461.00	15 616.25	0.00
ドイツ合計		15 616.25	0.00
新株引受権合計		15 616.25	0.00

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 (%)
財務省証券 (T-note)、固定利付債			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.50000% 09-15.02.39	110 000.00	140 009.37	0.02
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.12500% 12-15.02.42	120 000.00	146 381.25	0.02
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.00000% 18-30.09.25	230 000.00	247 115.23	0.04
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.12500% 18-15.11.28	200 000.00	223 570.31	0.04
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.00000% 16-15.11.26	385 000.00	400 926.37	0.06
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 17-15.02.27	380 000.00	400 380.46	0.06
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.37500% 17-15.05.27	140 000.00	148 635.15	0.03
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.87500% 20-15.11.30	150 000.00	143 408.20	0.02
米ドル合計		1 850 426.34	0.29
財務省証券 (T-note)、固定利付債合計		1 850 426.34	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		283 248 661.77	44.35
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% 21-21.04.22	11 000 000.00	10 996 876.44	1.72
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 21-19.05.22	11 000 000.00	10 995 438.52	1.72
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 17.06.21-16.06.22	11 000 000.00	10 994 206.30	1.72
米ドル合計		32 986 521.26	5.16
財務省証券 (T-bill)、ゼロ・クーポン合計		32 986 521.26	5.16
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		32 986 521.26	5.16
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			
無記名株式			
オーストラリア			
AUD DEXUS NPV (STAPLED)	10 405.00	82 408.52	0.01
オーストラリア合計		82 408.52	0.01
無記名株式合計		82 408.52	0.01
記名株式			
イギリス			
GBP BERKELEY GP HLDGS ORD GBPO.053943	638.00	36 160.13	0.01
イギリス合計		36 160.13	0.01
記名株式合計		36 160.13	0.01
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		118 568.65	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 (%)
----	------------	--	------------------

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	1 934 763.00	26 235 386.28	4.11
USD PIMCO GIS DIVERSIFIED INCOME FUND-INSTITUTIONAL CLASS-USD-ACC	1 427 357.00	39 680 524.60	6.21
アイルランド合計		65 915 910.88	10.32

ルクセンブルグ

USD UBS (LUX) BD SICAV-ASIAN INVEST GR BDS SUSTAIN (USD) U-X-ACC	584.00	7 526 089.76	1.18
USD UBS (LUX) BD SICAV-USD INVES GRA CORPOR SUSTAI (USD) U-X-ACC	156.00	1 907 023.56	0.30
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD U-X-ACC	2 050.00	44 834 996.50	7.02
USD UBS (LUX) BOND SICAV - ASIAN HIGH YIELD U-X-ACC	6 906.00	72 485 583.18	11.35
USD UBS (LUX) BOND SICAV-SHORT DURATION H Y SUST (USD) I-X-ACC	257 089.00	33 712 080.57	5.28
USD UBS (LUX) EMERGING ECONOMIES FUND-GLOBAL BONDS (USD)-U-X-ACC	1 551.00	22 178 338.38	3.47
USD UBS (LUX) INSTITUTIONAL SICAV - E MARKETS EQUITY PASS FA USD	2 622.71	41 044 929.27	6.42
USD UBS LUX BOND SICAV-EMERGING ECONOMIES CORP USD-I-X-ACC	172 553.00	22 554 402.63	3.53
ルクセンブルグ合計		246 243 443.85	38.55

投資信託、オープン・エンド型合計		312 159 354.73	48.87
-------------------------	--	-----------------------	--------------

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

312 159 354.73 48.87

公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引されていない派生商品

指数に係るオプション、従来型

豪ドル			
AUD MORGAN STANLEY/S&P/ASX 200 INDEX CALL 7557.45210 01.12.21	-1 070.00	0.00	0.00
AUD BNP/S&P/ASX 200 INDEX CALL 7561.21600 15.12.21	-1 170.00	-2 987.41	0.00
豪ドル合計		-2 987.41	0.00

ユーロ			
EUR MORGAN STANLEY/EURO STOXX 50 CALL 4408.73100 01.12.21	-4 580.00	0.00	0.00
EUR GS/EURO STOXX 50 INDEX CALL 4506.42940 15.12.21	-4 680.00	-285.88	0.00
ユーロ合計		-285.88	0.00

英ポンド			
GBP SOCIETE GENERALE/FTSE 100 INDEX CALL 7415.61450 01.12.21	-620.00	0.00	0.00
GBP CIBC/FTSE 100 INDEX CALL 7458.89760 15.12.21	-630.00	-2 242.30	0.00
英ポンド合計		-2 242.30	0.00

日本円			
JPY BNP/TOPIX INDEX (TOKYO) CALL 2122.36570 01.12.21	-513 980.00	0.00	0.00
JPY HSBC/TOPIX INDEX (TOKYO) CALL 2103.00060 15.12.21	-514 850.00	-2 685.00	0.00
日本円合計		-2 685.00	0.00

米ドル			
USD BOA/S&P 500 INDEX CALL 4772.42370 01.12.21	-6 400.00	-0.26	0.00
USD HSBC/MSCI EM INDEX CALL 1308.25800 01.12.21	-17 080.00	0.00	0.00
USD BOA/S&P 500 INDEX CALL 4758.23100 08.12.21	-7 560.00	-5 463.39	0.00
USD MORGAN STANLEY/MSCI EM INDEX CALL 1332.72010 15.12.21	-16 980.00	-4 930.65	0.00

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 (%)
USD UBS/S&P 500 INDEX CALL 4801.19810 15.12.21	-7 520.00	-12 254.82	0.00
USD MORGAN STANLEY/S&P 500 INDEX CALL 4816.64580 22.12.21	-7 500.00	-24 767.93	0.00
米ドル合計		-47 417.05	0.00
指数に係るオプション、従来型合計		-55 617.64	0.00
公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引されていない 派生商品合計		-55 617.64	0.00
投資有価証券合計		628 457 488.77	98.40

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 DVLDP TR EQS REC PERF 21-02.12.21	-26 459 150.80	-1 126 502.71	-0.18
USD UBS/FTSE EEPRA NAREIT DVLDP TR EQS PAYER 3ML 21-02.12.21			
指数に係るスワップおよび先渡スワップ合計		-1 126 502.71	-0.18
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		-1 126 502.71	-0.18
派生商品合計		-1 126 502.71	-0.18

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 （％）		
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	7 460 513.75	AUD 10 250 000.00	10.12.2021	192 440.69	0.03
USD	70 256.07	DKK 450 000.00	10.12.2021	2 135.71	0.00
USD	3 611 632.43	GBP 2 650 438.85	10.12.2021	104 945.90	0.02
USD	305 679.26	SGD 415 000.00	10.12.2021	3 025.98	0.00
USD	135 731.04	NZD 195 000.00	10.12.2021	3 394.88	0.00
USD	3 237 957.04	JPY 359 913 172.00	10.12.2021	67 986.36	0.01
USD	3 078 616.49	CHF 2 849 500.00	10.12.2021	-1 303.44	0.00
USD	982 201.40	CAD 1 237 500.00	10.12.2021	17 505.62	0.00
USD	1 011 487.17	HKD 7 872 500.00	10.12.2021	1 654.45	0.00
USD	26 519 787.39	EUR 22 842 843.41	10.12.2021	803 129.41	0.13
USD	312 498.04	SEK 2 730 000.00	10.12.2021	11 627.43	0.00
USD	128 419.96	NOK 1 100 000.00	10.12.2021	7 698.05	0.00
USD	3 112 441.93	CHF 2 859 500.00	7.1.2022	17 283.37	0.00
USD	7 718 152.54	AUD 10 289 561.22	7.1.2022	418 669.92	0.07
USD	26 684 129.02	EUR 22 929 136.66	7.1.2022	834 729.67	0.13
USD	139 802.40	NZD 195 000.00	7.1.2022	7 512.65	0.00
USD	1 009 261.75	CAD 1 247 500.00	7.1.2022	36 323.70	0.01
USD	3 775 999.44	GBP 2 730 438.00	7.1.2022	160 631.67	0.03
USD	1 012 588.33	HKD 7 872 500.00	7.1.2022	2 742.79	0.00
USD	3 160 849.06	JPY 359 915 072.00	7.1.2022	-11 493.99	0.00
USD	323 058.25	SGD 435 000.00	7.1.2022	5 857.48	0.00
USD	131 695.92	NOK 1 100 000.00	7.1.2022	10 994.91	0.00
USD	70 410.69	DKK 450 000.00	7.1.2022	2 203.07	0.00
USD	317 587.15	SEK 2 730 000.00	7.1.2022	16 262.83	0.00
HKD	1 700 000.00	USD 218 612.11	7.1.2022	-544.48	0.00
HKD	1 700 000.00	USD 218 598.57	10.12.2021	-533.71	0.00
SGD	100 406 300.00	USD 74 482 429.67	12.1.2022	-1 267 916.76	-0.20
USD	340 595.71	SGD 462 000.00	12.1.2022	3 713.41	0.00
USD	75 516.29	CHF 70 000.00	7.1.2022	-252.59	0.00
USD	75 419.55	CHF 70 000.00	10.12.2021	-240.88	0.00
USD	174 456.92	CAD 220 000.00	7.1.2022	2 876.66	0.00
USD	174 393.36	CAD 220 000.00	10.12.2021	2 891.89	0.00
USD	383 220.50	SGD 521 400.00	12.1.2022	3 024.76	0.00
USD	40 392.47	SGD 55 000.00	10.12.2021	281.79	0.00
USD	40 387.72	SGD 55 000.00	7.1.2022	281.88	0.00
先渡為替契約合計				1 459 541.08	0.23
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				17 759 111.15*	2.78
その他の資産および負債				-7 842 947.90	-1.23
純資産総額				638 706 690.39	100.00

* 2021年11月30日現在、460,000.00米ドルの現金額が取引相手方であるユービーエス・エイ・ジーの担保として使用される。

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・フィクスト・インカム・サステナブル(米ドル)*

2021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	AFRICAN DEVELOPMENT BANK 3.00000% 18-20.09.23	350 000.00	365 134.92	0.41
USD	AFRICAN DEVELOPMENT BANK 0.87500% 21-23.03.26	350 000.00	345 940.00	0.39
USD	ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.62500% 19-30.01.24	600 000.00	624 816.01	0.70
USD	ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.62500% 20-24.01.23	425 000.00	430 856.95	0.49
USD	EUROPEAN BANK FOR RECONSTR & DEVT 0.50000% 20-19.05.25	650 000.00	638 301.88	0.72
USD	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.50000% 18-18.01.23	725 000.00	742 371.00	0.84
USD	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.62500% 19-16.01.24	575 000.00	598 034.69	0.67
USD	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.00000% 19-23.07.26	300 000.00	310 881.00	0.35
USD	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.50000% 20-24.05.23	650 000.00	650 099.76	0.73
USD	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.25000% 20-15.11.23	500 000.00	496 537.87	0.56
USD	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.50000% 21-23.09.24	475 000.00	469 686.33	0.53
USD	INTERNATIONAL BK FOR RECONSTR & DEVE 0.12500% 21-20.04.23	400 000.00	398 390.91	0.45
USD	INTERNATIONAL BK FOR RECONST & DEV 0.87500% 21-15.07.26	525 000.00	518 055.79	0.58
USD	INTERNATIONAL DEVELOPMENT ASSOC-REG-S 0.37500% 20-23.09.25	150 000.00	145 850.21	0.16
USD	INTERNATIONAL DEVELOPMENT ASSOC-REG-S 0.87500% 21-28.04.26	175 000.00	172 661.16	0.19
USD	INTL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVT 0.25000% 20-24.11.23	425 000.00	422 244.74	0.48
USD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 1.50000% 19-28.08.24	350 000.00	356 431.91	0.40
USD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 3.00000% 18-27.09.23	300 000.00	313 214.03	0.35
USD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 19-19.03.24	775 000.00	806 453.53	0.91
USD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 1.87500% 19-19.06.23	500 000.00	510 817.49	0.58
USD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.50000% 20-28.10.25	850 000.00	830 700.74	0.94
米ドル合計			10 147 480.92	11.43

ノート、固定利付債合計

10 147 480.92 11.43

中期債券、固定利付債

米ドル

USD	AFRICAN DEVELOPMENT BANK 0.87500% 21-22.07.26	375 000.00	369 052.96	0.42
USD	ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.00000% 15-22.01.25	300 000.00	309 658.40	0.35
USD	ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.50000% 19-18.10.24	250 000.00	254 420.97	0.29
USD	ASIAN DEVELOPMENT BANK 0.25000% 20-14.07.23	750 000.00	746 932.78	0.84
USD	ASIAN DEVELOPMENT BANK 0.37500% 20-03.09.25	250 000.00	243 691.85	0.27
USD	ASIAN DEVELOPMENT BANK 0.25000% 20-06.10.23	350 000.00	347 915.47	0.39
USD	ASIAN DEVELOPMENT BANK 0.50000% 21-04.02.26	600 000.00	585 163.61	0.66
USD	ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.00000% 21-14.04.26	725 000.00	720 984.15	0.81
USD	ASIAN DEVELOPMENT BANK 0.37500% 21-11.06.24	475 000.00	469 591.17	0.53
USD	ASIAN DEVELOPMENT BANK 0.62500% 21-08.10.24	400 000.00	396 864.02	0.45
USD	EUROPEAN BANK FOR RECONSTR & DEVT 0.50000% 20-25.11.25	225 000.00	219 319.56	0.25
USD	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 1.75000% 20-14.03.25	400 000.00	410 104.68	0.46
USD	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.87500% 20-03.04.25	700 000.00	697 704.88	0.79
USD	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.87500% 21-20.04.26	200 000.00	197 247.96	0.22
USD	INTERNATIONAL DEVELOPMENT ASSOC-REG-S 2.75000% 18-24.04.23	500 000.00	515 630.00	0.58
USD	INTERNATIONAL FINANCE CORP 0.37500% 20-16.07.25	275 000.00	268 471.50	0.30
USD	INTERNATIONAL FINANCE CORP 0.75000% 21-08.10.26	600 000.00	586 132.78	0.66
米ドル合計			7 338 886.74	8.27

中期債券、固定利付債合計

7 338 886.74 8.27

* 旧：U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ・フィクスト・インカム(米ドル)

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・フィクスト・インカム・サステナブル(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 (%)
債券、固定利付債			
米ドル			
USD AFRICAN DEVELOPMENT BANK 0.75000% 20-03.04.23	250 000.00	251 008.05	0.28
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 0.62500% 20-29.04.25	650 000.00	641 991.42	0.72
USD EUROPEAN BANK FOR RECONSTR & DEVT 1.62500% 19-27.09.24	300 000.00	306 351.38	0.35
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 3.00000% 13-04.10.23	225 000.00	234 949.27	0.26
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.62500% 20-15.07.25	950 000.00	935 923.24	1.05
USD INTERNATIONAL FINANCE CORP 0.50000% 20-20.03.23	350 000.00	350 322.00	0.39
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 14-25.11.24	700 000.00	733 307.52	0.83
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 15-29.07.25	250 000.00	262 951.28	0.30
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.75000% 20-11.03.25	400 000.00	397 337.20	0.45
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.62500% 20-22.04.25	1 275 000.00	1 259 617.34	1.42
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.37500% 20-28.07.25	650 000.00	634 331.50	0.71
米ドル合計		6 008 090.20	6.76
債券、固定利付債合計		6 008 090.20	6.76
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		23 494 457.86	26.46
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 FEDERATED HERMES SDG ENGAGEMENT HIGH-M- USD	1 226 381.00	2 618 323.44	2.95
USD RECORD UCITS ICAV-RECORD EM SUSTAINABLE FINANCE FUND-A-USD	26 334.00	2 570 909.42	2.90
EUR XTRACKERS (IE) PLC - XTRACKERS USD CORPORATE GRE EN-1C-EUR	51 669.00	1 700 732.72	1.92
EUR XTRACKERS USD CORPORATE GREEN BOND-ACCUM SHS-1C-HEDGED EUR	57 269.00	1 705 212.93	1.92
アイルランド合計		8 595 178.51	9.69
ルクセンブルグ			
USD FOCUSED FUND - CORPORATE BOND SUSTAINABLE USD U-X-ACC	1 601.00	15 982 062.55	18.00
USD FOCUSED SICAV - US CORPORATE BOND SUSTAINABLE USD U-X-ACC	358.00	3 550 164.28	4.00
USD UBS (LUX) BD SICAV-USD INVES GRA CORPOR SUSTAI (USD) U-X-ACC	1 306.00	15 965 210.06	17.98
EUR UBS (LUX) BOND SICAV - GREEN SOC SUSTAINABLE BD(EUR)U-X-ACC	1 410.00	15 907 367.98	17.92
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD SUSTAINABLE U-X-ACC	287.00	3 224 201.05	3.63
ルクセンブルグ合計		54 629 005.92	61.53
投資信託、オープン・エンド型合計		63 224 184.43	71.22
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		63 224 184.43	71.22
投資有価証券合計		86 718 642.29	97.68
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-BUXL FUTURE 08.12.21	3.00	17 424.29	0.02
USD US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 22.03.22	3.00	10 031.25	0.01
債券に係る金融先物合計		27 455.54	0.03
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		27 455.54	0.03
派生商品合計		27 455.54	0.03

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

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・フィクスト・インカム・サステナブル(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)			
GBP	271 007.36 USD	369 289.40 10.12.2021	-10 730.72 -0.01
USD	455 931.27 CHF	422 000.00 10.12.2021	-193.04 0.00
USD	3 968.49 CAD	5 000.00 10.12.2021	70.73 0.00
SGD	1 230 000.00 USD	905 989.12 10.12.2021	-8 968.54 -0.01
USD	3 636.15 AUD	5 000.00 10.12.2021	90.75 0.00
USD	1 861 859.37 EUR	1 603 670.78 10.12.2021	56 433.83 0.06
NZD	660 000.00 USD	459 397.36 10.12.2021	-11 490.37 -0.01
USD	583.73 NOK	5 000.00 10.12.2021	34.99 0.00
USD	902 299.86 JPY	100 294 599.00 10.12.2021	18 945.31 0.02
USD	437 318.88 NZD	612 500.00 10.12.2021	21 647.62 0.02
JPY	89 945 669.00 SGD	1 066 000.00 10.12.2021	14 788.12 0.02
USD	114 813.54 SGD	155 000.00 10.12.2021	1 774.36 0.00
JPY	9 000 000.00 USD	79 242.92 10.12.2021	25.47 0.00
EUR	390 000.00 USD	453 935.82 10.12.2021	-14 870.66 -0.02
USD	862 604.07 CHF	790 000.00 10.12.2021	8 722.08 0.01
USD	1 319 209.52 CHF	1 212 000.00 7.1.2022	7 325.56 0.01
USD	1 460 685.50 EUR	1 255 496.02 7.1.2022	45 289.08 0.05
NZD	47 500.00 USD	34 054.43 7.1.2022	-1 830.00 0.00
USD	742.66 SGD	1 000.00 7.1.2022	13.46 0.00
GBP	320 000.00 USD	442 536.99 7.1.2022	-18 825.60 -0.02
USD	25 548.70 JPY	2 909 143.00 7.1.2022	-92.90 0.00
USD	1 761 430.72 EUR	1 520 000.00 10.12.2021	50 202.42 0.06
USD	1 763 269.92 EUR	1 520 000.00 7.1.2022	49 682.20 0.06
USD	1 294 391.74 EUR	1 120 500.00 7.1.2022	31 184.48 0.03
USD	1 293 012.96 EUR	1 120 500.00 10.12.2021	31 544.99 0.04
USD	3 488 884.29 EUR	3 004 500.00 7.1.2022	101 730.14 0.11
USD	3 485 004.28 EUR	3 004 500.00 10.12.2021	102 513.86 0.12
USD	1 741 553.32 EUR	1 511 500.00 10.12.2021	39 894.39 0.04
USD	1 743 522.81 EUR	1 511 500.00 7.1.2022	39 517.65 0.04
JPY	3 035 538 000.00 USD	26 606 938.61 14.1.2022	150 278.96 0.17
EUR	42 000.00 USD	47 426.57 7.1.2022	-77.44 0.00
EUR	43 000.00 USD	48 491.99 10.12.2021	-82.24 0.00
USD	333 568.90 EUR	296 500.00 10.12.2021	-233.20 0.00
USD	334 014.01 EUR	296 500.00 7.1.2022	-248.33 0.00
先渡為替契約合計			704 067.41 0.79
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		1 297 020.23	1.46
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		31 447.05	0.04
純資産総額		88 778 631.73	100.00

* 旧: U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ - フィクスト・インカム(米ドル)

注記は当財務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・サステナブル (米ドル) *

2021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 (%)
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 FEDERATED HERMES SDG ENGAGEMENT HIGH-M- USD	1 773 371.00	3 786 147.09	3.04
USD RECORD UCITS ICAV-RECORD EM SUSTAINABLE FINANCE FUND-A-USD	37 994.00	3 709 240.24	2.97
CHF UBS IRL ETF PIC-MSCI ACWI ESG UNIVERSAL UCITS ETF A-DIST	195 535.00	3 087 061.11	2.48
アイルランド合計		10 582 448.44	8.49
ルクセンブルグ			
USD FOCUSED FUND - CORPORATE BOND SUSTAINABLE USD U-X-ACC	885.00	8 834 556.75	7.09
USD FOCUSED SICAV - WORLD BANK LONG TERM BOND USD U-X-ACC	2 058.00	20 588 026.20	16.51
USD FOCUSED SICAV - WORLD BANK BOND USD U-X-ACC	1 372.00	13 688 855.60	10.98
USD UBS (LUX) BD SICAV-USD INVES GRA CORPOR SUSTAI (USD) U-X-ACC	1 858.00	22 713 139.58	18.22
EUR UBS (LUX) BOND SICAV - GREEN SOC SUSTAINABLE BD(EUR)U-X-ACC	1 304.00	14 711 494.93	11.80
USD UBS (LUX) EQUITY FUND - GLOBAL SUSTAINABLE (USD) U-X-ACC	64.00	1 012 478.08	0.81
USD UBS (LUX) EQUITY FUND-GLBAL SUSTAINABLE IMPRO (USD) U-X-ACC	461.00	4 570 801.17	3.67
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - GLOBAL OPPORTUNITY (USD) U-X-ACC	317.00	4 153 622.47	3.33
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - ACTIVE CLIMATE AWARE (USD) I-X-ACC	16 191.00	2 536 805.88	2.03
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - LONG TERM THEMES (USD) U-X-ACC	250.00	2 519 185.00	2.02
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - GLOBAL IMPACT (USD) U-X-ACC	769.00	7 464 329.26	5.99
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD SUSTAINABLE U-X-ACC	260.00	2 920 879.00	2.34
USD UBS ETF - SUSTAINABLE DEVELOPMENT BANK BONDS UCITS-ETF-A-ACC	320 612.00	3 805 023.22	3.05
JPY UBS ETF SICAV-MSCI JAPAN SOCIALLY RESP UCITS ETF-JPY-A-DIST	93 912.00	2 390 291.78	1.92
ルクセンブルグ合計		111 909 488.92	89.76
投資信託、オープン・エンド型合計		122 491 937.36	98.25
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		122 491 937.36	98.25
投資有価証券合計		122 491 937.36	98.25

* 旧：UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ - インカム (米ドル)

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 - インカム・サステナブル (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)			
GBP	1 338 432.41 USD	1 823 820.95 10.12.2021	-52 996.13 -0.04
USD	116 312.83 DKK	745 000.00 10.12.2021	3 535.79 0.00
NZD	1 055 000.00 USD	734 339.71 10.12.2021	-18 367.17 -0.01
USD	634 655.11 CAD	799 617.78 10.12.2021	11 311.36 0.01
USD	3 723 331.77 EUR	3 207 008.25 10.12.2021	112 855.93 0.09
USD	1 044 779.93 CHF	967 025.42 10.12.2021	-442.34 0.00
SGD	1 980 000.00 USD	1 458 421.51 10.12.2021	-14 437.16 -0.01
USD	631 903.03 JPY	70 238 802.00 10.12.2021	13 267.87 0.01
USD	158 677.25 HKD	1 235 000.00 10.12.2021	259.54 0.00
USD	758 107.90 AUD	1 042 460.47 10.12.2021	18 919.72 0.02
USD	54 230.71 NOK	464 521.10 10.12.2021	3 250.83 0.00
USD	126 223.79 SEK	1 102 697.98 10.12.2021	4 696.53 0.00
USD	92 756.24 EUR	80 000.00 10.12.2021	2 691.59 0.00
USD	746 119.55 NZD	1 045 000.00 10.12.2021	36 933.48 0.03
JPY	151 034 472.00 SGD	1 790 000.00 10.12.2021	24 831.83 0.02
USD	75 599.14 GBP	55 000.00 10.12.2021	2 830.90 0.00
USD	170 368.48 SGD	230 000.00 10.12.2021	2 632.92 0.00
JPY	19 500 000.00 USD	171 692.99 10.12.2021	55.18 0.00
EUR	590 000.00 USD	686 723.42 10.12.2021	-22 496.65 -0.02
USD	1 495 908.33 CHF	1 370 000.00 10.12.2021	15 125.63 0.01
USD	2 471 853.71 CHF	2 270 971.10 7.1.2022	13 726.19 0.01
USD	3 039 020.22 EUR	2 612 114.51 7.1.2022	94 225.91 0.08
AUD	664 876.66 USD	498 932.82 7.1.2022	-27 264.93 -0.02
NZD	15 000.00 USD	10 754.03 7.1.2022	-577.90 0.00
JPY	99 602 396.00 USD	874 728.97 7.1.2022	3 180.83 0.00
USD	160 136.23 HKD	1 245 000.00 7.1.2022	433.76 0.00
GBP	1 675 941.42 USD	2 317 706.48 7.1.2022	-98 595.63 -0.08
CAD	246 118.20 USD	199 116.38 7.1.2022	-7 166.27 -0.01
USD	29 706.51 SGD	40 000.00 7.1.2022	538.62 0.00
USD	54 232.59 NOK	452 981.75 7.1.2022	4 527.72 0.00
USD	101 704.33 DKK	650 000.00 7.1.2022	3 182.22 0.00
USD	127 662.64 SEK	1 097 396.45 7.1.2022	6 537.28 0.01
USD	330 584.33 EUR	285 000.00 10.12.2021	9 729.02 0.01
USD	330 939.15 EUR	285 000.00 7.1.2022	9 641.45 0.01
JPY	11 500 000.00 USD	101 128.81 7.1.2022	233.84 0.00
CHF	320 000.00 USD	350 779.38 7.1.2022	-4 407.38 0.00
GBP	100 000.00 USD	136 123.77 10.12.2021	-3 817.89 0.00
CHF	320 000.00 USD	350 392.56 10.12.2021	-4 516.31 0.00
GBP	95 000.00 USD	129 357.84 7.1.2022	-3 568.52 0.00
JPY	11 500 000.00 USD	101 059.77 10.12.2021	227.61 0.00
USD	1 970 021.20 EUR	1 700 000.00 10.12.2021	56 147.44 0.05
USD	1 972 078.20 EUR	1 700 000.00 7.1.2022	55 565.62 0.05
USD	657 757.60 EUR	570 000.00 10.12.2021	16 046.99 0.01
USD	658 458.98 EUR	570 000.00 7.1.2022	15 863.59 0.01
USD	3 407 540.87 EUR	2 935 000.00 7.1.2022	98 738.27 0.08
USD	3 403 751.79 EUR	2 935 000.00 10.12.2021	99 505.04 0.08
AUD	100 000.00 USD	73 037.48 10.12.2021	-2 129.45 0.00
USD	2 918 464.34 JPY	332 500 000.00 10.12.2021	-10 062.13 -0.01
USD	2 920 601.79 JPY	332 500 000.00 7.1.2022	-10 100.88 -0.01
AUD	90 000.00 USD	65 754.12 7.1.2022	-1 907.53 0.00

* 旧 : U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ - インカム (米ドル)

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 - インカム・サステナブル (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)			
USD	2 261 941.12	GBP 1 690 000.00 10.12.2021	25 971.70 0.02
USD	98 360.56	NZD 140 000.00 7.1.2022	3 383.31 0.00
USD	2 263 031.85	GBP 1 690 000.00 7.1.2022	25 306.06 0.02
SEK	600 000.00	USD 68 562.56 10.12.2021	-2 437.15 0.00
HKD	510 000.00	USD 65 451.93 10.12.2021	-32.47 0.00
USD	98 403.26	NZD 140 000.00 10.12.2021	3 392.69 0.00
SEK	600 000.00	USD 68 635.07 7.1.2022	-2 409.94 0.00
USD	114 951.96	NOK 1 000 000.00 7.1.2022	5 223.77 0.00
HKD	500 000.00	USD 64 172.20 7.1.2022	-34.66 0.00
USD	108 805.81	EUR 95 000.00 7.1.2022	1 706.58 0.00
USD	75 839.47	CHF 70 000.00 10.12.2021	179.04 0.00
USD	108 683.34	EUR 95 000.00 10.12.2021	1 731.57 0.00
USD	75 931.88	CHF 70 000.00 7.1.2022	163.00 0.00
USD	114 986.58	NOK 1 000 000.00 10.12.2021	5 239.39 0.00
EUR	280 000.00	USD 320 545.68 10.12.2021	-5 319.41 0.00
EUR	280 000.00	USD 320 907.16 7.1.2022	-5 246.26 0.00
JPY	8 500 000.00	USD 74 708.39 7.1.2022	211.83 0.00
JPY	8 500 000.00	USD 74 652.25 10.12.2021	212.34 0.00
GBP	51 000.00	USD 68 471.34 7.1.2022	-942.34 0.00
GBP	60 000.00	USD 80 515.69 10.12.2021	-1 132.16 0.00
USD	96 715.51	GBP 72 000.00 10.12.2021	1 455.27 0.00
USD	96 767.99	GBP 72 000.00 7.1.2022	1 432.93 0.00
USD	140 366.18	JPY 16 000 000.00 7.1.2022	-660.11 0.00
USD	140 249.49	JPY 16 000 000.00 10.12.2021	-672.08 0.00
USD	247 477.46	GBP 184 000.00 7.1.2022	3 843.41 0.00
USD	247 314.01	GBP 184 000.00 10.12.2021	3 871.19 0.00
USD	439 977.88	EUR 390 000.00 10.12.2021	912.72 0.00
USD	440 550.28	EUR 390 000.00 7.1.2022	879.75 0.00
先渡為替契約合計			524 626.20 0.42
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			1 692 384.04 1.36
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			-36 758.30 -0.03
純資産総額			124 672 188.51 100.00

* 旧：U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ - インカム (米ドル)

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・ディフェンシブ(米ドル)

2021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	785.00	60 586.37	0.01
AUD APA GROUP NPV	4 051.00	27 373.60	0.00
AUD ARISTOCRAT LEISURE NPV	2 229.00	69 714.64	0.01
AUD ASX LTD NPV	708.00	45 396.53	0.01
AUD AURIZON HOLDINGS NPV	6 372.00	15 225.88	0.00
AUD AUSNET SERVICES NPV	4 666.00	8 403.41	0.00
AUD AUST & NZ BANK GRP NPV	10 407.00	197 021.53	0.02
AUD BLUESCOPE STEEL NPV	1 899.00	26 620.03	0.00
AUD BRAMBLES LTD NPV	5 258.00	37 319.13	0.01
AUD CMNWLT BK OF AUST NPV	6 492.00	428 921.76	0.04
AUD COCHLEAR LTD NPV	246.00	37 990.05	0.00
AUD COMPUTERSHARE LTD NPV(POST REC)	1 912.00	25 880.38	0.00
AUD CROWN RESORTS LTD NPV	1 259.00	9 837.49	0.00
AUD CSL NPV	1 659.00	360 881.36	0.04
AUD DOMINOS PIZZA ENT NPV	199.00	18 303.62	0.00
AUD ENDEAVOUR GROUP LI NPV	4 565.00	22 172.17	0.00
AUD EVOLUTION MINING NPV	5 356.00	15 304.62	0.00
AUD FORTESCUE METALS G NPV	6 174.00	74 464.25	0.01
AUD GOODMAN GROUP (STAPLED SECURITY)	5 952.00	104 198.36	0.01
AUD GPT GROUP NPV (STAPLED SECURITIES)	7 291.00	27 244.23	0.00
AUD IDP EDUCATION LTD NPV	652.00	16 171.27	0.00
AUD INSURANCE AUST GRP NPV	8 484.00	26 649.02	0.00
AUD LEND LEASE GROUP NPV	2 566.00	19 431.43	0.00
AUD MACQUARIE GP LTD NPV	1 280.00	178 558.08	0.02
AUD MAGELLAN FINANCIAL NPV	488.00	11 473.90	0.00
AUD MEDIBANK PRIVATE L NPV	8 235.00	20 144.64	0.00
AUD MIRVAC GROUP STAPLED SECURITIES	13 667.00	27 715.08	0.00
AUD NATL AUSTRALIA BK NPV	12 162.00	235 420.62	0.02
AUD NEWCREST MINING NPV	2 955.00	49 489.63	0.01
AUD NTHN STAR RES LTD NPV	3 911.00	26 178.01	0.00
AUD ORICA LIMITED NPV	1 386.00	13 915.65	0.00
AUD ORIGIN ENERGY NPV	6 441.00	21 921.56	0.00
AUD QANTAS AIRWAYS NPV	3 186.00	11 430.71	0.00
AUD QBE INS GROUP NPV	5 398.00	44 474.99	0.01
AUD RAMSAY HEALTH CARE NPV	702.00	33 259.86	0.00
AUD REA GROUP LIMITED NPV	192.00	22 107.38	0.00
AUD REECE AUSTRALIA NPV	934.00	15 509.96	0.00
AUD RIO TINTO LIMITED NPV	1 351.00	89 566.13	0.01
AUD SANTOS LIMITED NPV	6 443.00	29 146.45	0.00
AUD SCENTRE GROUP NPV STAPLED UNIT	18 835.00	41 266.82	0.01
AUD SEEK LIMITED NPV	1 264.00	31 189.12	0.00
AUD SONIC HEALTHCARE NPV	1 691.00	51 197.45	0.01
AUD SOUL PATTINSON(WH) NPV	371.00	8 175.83	0.00
AUD SOUTH32 LTD NPV	16 027.00	40 114.72	0.01
AUD STOCKLAND NPV (STAPLED)	8 975.00	27 809.47	0.00
AUD SUNCORP GROUP LTD NPV	4 726.00	36 257.50	0.00

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・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 (%)
AUD SYDNEY AIRPORT NPV(STAPLED SECURITY)	4 603.00	27 089.18	0.00
AUD TABCORP HLDGS LTD NPV	7 033.00	24 834.01	0.00
AUD TELSTRA CORP NPV	13 377.00	38 603.79	0.01
AUD TRANSURBAN GROUP STAPLED UNITS NPV	11 094.00	107 452.30	0.01
AUD TREASURY WINE ESTA NPV	2 637.00	22 624.15	0.00
AUD VICINITY CENTRES NPV (STAPLED SECURITY)	14 175.00	17 036.08	0.00
AUD WESFARMERS LTD NPV	4 112.00	165 781.79	0.02
AUD WESTPAC BKG CORP NPV	13 270.00	193 074.60	0.02
AUD WISETECH GLOBAL LT NPV	542.00	20 164.49	0.00
AUD WOODSIDE PETROLEUM NPV	3 677.00	55 871.80	0.01
AUD WOOLWORTHS GRP LTD NPV	4 565.00	132 126.72	0.02
オーストラリア合計		3 546 093.60	0.35
オーストリア			
EUR ERSTE GROUP BK AG NPV	1 093.00	47 451.93	0.01
EUR OMV AG NPV(VAR)	554.00	29 289.67	0.00
EUR RAIFFEISEN BK INTL NPV (REGD)	660.00	19 478.73	0.00
EUR VERBUND AG CLASS ' A ' NPV	260.00	27 070.68	0.00
EUR VOESTALPINE AG NPV	443.00	14 899.39	0.00
オーストリア合計		138 190.40	0.01
ベルギー			
EUR ANHEUSER-BUSCH IN NPV	2 786.00	154 459.82	0.03
EUR COLRUYT SA NPV	233.00	10 842.03	0.00
EUR ELIA SYS OPERATOR NPV	126.00	15 586.63	0.00
EUR GPE BRUXELLES LAM NPV	465.00	49 995.55	0.00
EUR PROXIMUS SA NPV	687.00	12 388.06	0.00
EUR SOFINA NPV	75.00	34 510.90	0.00
EUR SOLVAY SA NPV	263.00	29 283.56	0.00
EUR UMICORE NPV	733.00	35 486.04	0.00
ベルギー合計		342 552.59	0.03
カナダ			
CAD AIR CANADA VAR VTG SHS NPV	572.00	9 274.71	0.00
CAD ALGONQUIN PWR&UTIL COM NPV	2 200.00	29 652.32	0.01
CAD ALTAGAS LTD COM NPV	1 030.00	19 511.23	0.00
CAD ATCO LTD CL 1 NON VTG	91.00	2 953.17	0.00
CAD B2GOLD CORP COM NPV	1 600.00	6 311.19	0.00
CAD BALLARD POWER SYS COM NPV	800.00	12 129.72	0.00
CAD CAE INC COM NPV	1 027.00	24 578.19	0.00
CAD CAMECO CORP COM	1 436.00	33 347.71	0.00
CAD CANADIAN UTILS LTD CL A	446.00	11 925.32	0.00
CAD CANOPY GROWTH CORP COM NPV	741.00	7 925.26	0.00
CAD EMERA INC COM	955.00	43 692.66	0.01
CAD EMPIRE LTD CL A	613.00	17 504.05	0.00
CAD HYDRO ONE INC COM NPV	1 246.00	30 334.10	0.01
CAD IGM FINANCIAL INC COM	375.00	13 496.84	0.00
CAD IVANHOE MINES LTD COM NPV CL ' A '	1 900.00	15 018.71	0.00
CAD KEYERA CORPORATION COM NPV	809.00	17 696.09	0.00
CAD KINROSS GOLD CORP COM NPV	4 682.00	27 665.70	0.00
CAD KIRKLAND LAKE GOLD COM NPV	946.00	37 248.57	0.01
CAD LUNDIN MINING CORP COM	2 594.00	20 282.05	0.00
CAD NORTHLAND POWER IN COM NPV	716.00	21 343.81	0.00
CAD NUVEI CORPORATION SUB VOTING SHARES (CAD)	200.00	19 611.79	0.00

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・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 ONEX CORP SUB VTG	318.00	23 009.64	0.00
CAD PAN AMER SILVER COM NPV	751.00	19 102.85	0.00
CAD QUEBECOR INC CL B	682.00	15 114.80	0.00
CAD RITCHIE BROS AUCTIONEERS COM	428.00	28 930.37	0.01
CAD TELUS CORPORATION NPV	1 534.00	34 917.99	0.01
CAD TFI INTERNATIONAL COM NPV	63.00	6 229.28	0.00
CAD TMX GROUP LTD COM NPV	157.00	15 172.51	0.00
CAD TOROMONT INDS LTD COM	300.00	25 093.55	0.00
CAD TOURMALINE OIL CP COM NPV	195.00	6 462.00	0.00
CAD WEST FRASER TIMBER COM NPV	286.00	23 418.65	0.00
CAD WSP GLOBAL INC COM NPV	432.00	59 839.48	0.01
CAD YAMANA GOLD INC COM	1 984.00	7 887.75	0.00
カナダ合計		686 682.06	0.07
デンマーク			
DKK A.P. MOELLER-MAERSK SER ' B ' DKK1000	22.00	65 845.33	0.01
DKK A.P. MOLLER-MAERSK ' A ' DKK1000	11.00	31 249.48	0.00
DKK AMBU A/S SER ' B ' DKK0.5	600.00	16 872.63	0.00
DKK CHR. HANSEN HLDG DKK10	372.00	27 470.06	0.00
DKK DANSKE BANK A/S DKK10	2 438.00	39 962.07	0.00
DKK DSV PANALPINA A/S DKK1	738.00	159 503.57	0.02
DKK GENMAB AS DKK1 (BEARER)	236.00	90 654.52	0.01
DKK GN STORE NORD DKK4	455.00	25 962.03	0.00
DKK NOVOZYMES A/S SER ' B ' DKK2 (POST CONS)	733.00	55 148.48	0.01
DKK ORSTED A/S DKK10	678.00	86 690.09	0.01
DKK PANDORA A/S DKK1	361.00	44 475.15	0.00
DKK ROCKWOOL INTL SER ' B ' DKK10	26.00	10 750.78	0.00
デンマーク合計		654 584.19	0.06
フィンランド			
EUR KESKO OYJ EUR2 SER ' B '	1 041.00	32 504.33	0.00
EUR KONE CORPORATION NPV ORD ' B '	1 281.00	83 975.88	0.01
EUR WARTSILA OYJ ABP SER ' B ' EUR3.50	1 912.00	26 439.13	0.00
フィンランド合計		142 919.34	0.01
フランス			
EUR ACCOR EUR3	652.00	19 205.93	0.00
EUR ADP EUR3	101.00	11 720.99	0.00
EUR AIR LIQUIDE(L ') EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)	1 737.00	285 102.48	0.03
EUR AIRBUS EUR1	2 144.00	238 239.63	0.03
EUR ALSTOM EUR7.00	948.00	33 591.33	0.00
EUR AMUNDI EUR2.5 (AIW)	229.00	18 932.65	0.00
EUR ARKEMA EUR10	250.00	32 529.84	0.01
EUR AXA EUR2.29	7 003.00	191 940.75	0.02
EUR BIOMERIEUX NPV (POST SPLIT)	171.00	24 098.20	0.00
EUR BNP PARIBAS EUR2	4 100.00	254 192.00	0.03
EUR BOLLORE EURO.16	3 199.00	17 053.36	0.00
EUR BOUYGUES EUR1	768.00	25 890.60	0.00
EUR BUREAU VERITAS EURO.12	1 151.00	36 224.01	0.01
EUR CAPGEMINI EUR8	591.00	135 773.36	0.01
EUR CARREFOUR EUR2.50	2 273.00	37 405.11	0.00
EUR CIE DE ST-GOBAIN EUR4	1 901.00	120 212.03	0.01
EUR CNP ASSURANCES EUR1	684.00	16 606.97	0.00
EUR COVIVIO EUR3	196.00	16 153.62	0.00

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・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 CREDIT AGRICOLE SA EUR3	4 391.00	59 636.33	0.01
EUR DANONE EURO.25	2 289.00	133 952.15	0.01
EUR EDENRED EUR2	910.00	40 480.18	0.01
EUR EDF EURO.5	1 877.00	26 176.99	0.00
EUR EIFFAGE EUR4	301.00	27 856.60	0.00
EUR ENGIE EUR1	6 635.00	95 669.64	0.01
EUR ESSILORLUXOTTICA EURO.18	1 044.00	208 020.88	0.02
EUR EURAZEO NPV	169.00	13 762.88	0.00
EUR FAURECIA EUR7	416.00	17 746.66	0.00
EUR GETLINK SE EURO.40	1 727.00	25 368.04	0.00
EUR HERMES INTL NPV	116.00	215 831.55	0.02
EUR IPSEN EUR1	141.00	13 671.24	0.00
EUR KERING EUR4	275.00	210 920.56	0.02
EUR KLEPIERRE EUR1.40	658.00	13 838.95	0.00
EUR L ' OREAL EURO.20	922.00	412 526.77	0.04
EUR LEGRAND SA EUR4	977.00	106 430.05	0.01
EUR LVMH MOET HENNESSY EURO.30	1 006.00	777 473.98	0.08
EUR ORANGE EUR4	7 262.00	77 735.76	0.01
EUR ORPEA EUR2.5	181.00	16 991.38	0.00
EUR PERNOD RICARD EUR1.55	776.00	176 876.78	0.02
EUR PUBLICIS GROUPE SA EURO.40	818.00	52 611.13	0.01
EUR REMY COINTREAU EUR1.60	87.00	20 270.93	0.00
EUR RENAULT SA EUR3.81	694.00	22 232.00	0.00
EUR SAFRAN EURO.20	1 220.00	135 647.86	0.01
EUR SANOFI EUR2	4 109.00	387 860.08	0.04
EUR SARTORIUS STEDIM B EURO.20 (POST SUBD)	107.00	62 797.00	0.01
EUR SCHNEIDER ELECTRIC EUR8	1 939.00	340 956.15	0.03
EUR SEB SA EUR1	98.00	14 439.42	0.00
EUR SOC GENERALE EUR1.25	2 987.00	92 610.90	0.01
EUR SODEXO EUR4	313.00	26 085.24	0.00
EUR SUEZ EUR4	1 214.00	26 967.45	0.00
EUR TELEPERFORMANCE EUR2.50	220.00	89 816.13	0.01
EUR THALES EUR3	379.00	30 920.14	0.00
EUR TOTALENERGIES SE EUR2.5	9 086.00	415 326.66	0.04
EUR UBISOFT ENTERTAIN EURO.31	350.00	17 850.33	0.00
EUR UNIBAIL-RODAMCO-WE NPV(1 ORD UNIBAIL-R & 1CLS)	502.00	32 885.98	0.00
EUR VALEO EUR1 (POST SUBD)	799.00	22 969.51	0.00
EUR VEOLIA ENVIRONNEME EUR5	2 333.00	74 579.10	0.01
EUR VINCI EUR2.50	1 867.00	175 811.09	0.02
EUR VIVENDI SA EUR5.50	2 780.00	35 203.14	0.01
EUR WENDEL EUR4	95.00	10 810.83	0.00
EUR WORLDLINE EURO.68	872.00	45 527.95	0.01
フランス合計		6 320 019.25	0.62
ドイツ			
EUR BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG EUR1	1 203.00	115 071.15	0.01
EUR BECHTLE AG NPV	297.00	21 321.86	0.00
EUR BEIERSDORF AG NPV	376.00	37 336.96	0.00
EUR CARL ZEISS MEDITEC NPV	157.00	31 270.46	0.00
EUR COMMERZBANK AG NPV	3 553.00	24 935.37	0.00
EUR CONTINENTAL AG ORD NPV	400.00	42 637.73	0.01
EUR COVESTRO AG NPV	672.00	37 699.14	0.00
EUR FRESENIUS MED CARE NPV	811.00	48 180.84	0.01
EUR FRESENIUS SE & CO. KGAA NPV	1 517.00	57 193.90	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・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 GEA GROUP AG NPV	554.00	27 892.84	0.00
EUR HEIDELBERGCEMENT NPV	527.00	35 081.33	0.00
EUR HELLOFRESH SE NPV	619.00	62 289.13	0.01
EUR HENKEL AG & CO KGAA	399.00	29 439.45	0.00
EUR KION GROUP AG NPV	269.00	28 885.82	0.00
EUR KNORR BREMSE AG NPV	280.00	27 659.14	0.00
EUR LANXESS AG NPV	308.00	17 778.00	0.00
EUR MERCK KGAA NPV	445.00	109 645.26	0.01
EUR NEMETSCHEK SE ORD NPV	217.00	27 307.73	0.00
EUR PUMA SE NPV	360.00	43 256.81	0.01
EUR RATIONAL AG NPV	18.00	16 496.34	0.00
EUR RWE AG (NEU) NPV	2 339.00	89 909.38	0.01
EUR SAP AG ORD NPV	3 768.00	480 025.90	0.05
EUR SYMRISE AG NPV (BR)	485.00	67 966.54	0.01
EUR TEAMVIEWER AG NPV	553.00	7 463.26	0.00
EUR VOLKSWAGEN AG ORD NPV	117.00	32 449.70	0.00
EUR ZALANDO SE NPV	714.00	64 503.23	0.01
ドイツ合計		1 583 697.27	0.15
香港			
HKD AIA GROUP LTD NPV	44 200.00	465 197.51	0.05
HKD BOC HONG KONG HLDG HKD5	13 500.00	40 781.31	0.00
HKD CHOW TAI FOOK JEWE HKD1	3 400.00	6 097.09	0.00
HKD CK ASSET HOLDINGS HKD1	8 500.00	48 628.44	0.01
HKD CK HUTCHISON HLDGS HKD1.0	10 000.00	62 661.54	0.01
HKD CK INFRASTRUCTURE HKD1	2 500.00	14 478.86	0.00
HKD CLP HOLDINGS HKD5	5 500.00	53 900.47	0.01
HKD GALAXY ENTERTAINME HKD0.10	8 000.00	43 766.88	0.00
HKD HANG LUNG PROP HKD1	7 000.00	13 881.74	0.00
HKD HANG SENG BANK HKD5	2 800.00	49 564.83	0.01
HKD HENDERSON LAND DEV HKD2	5 000.00	20 459.60	0.00
HKD HKT TRUST AND HKT SHARE STAPLED UNIT	9 000.00	12 214.19	0.00
HKD HONG KONG EXCHANGE HKD1	4 400.00	242 693.23	0.02
USD HONGKONG LAND HLD ORD USDO.10(SINGAPORE REG)	3 800.00	20 520.00	0.00
HKD HONGKONG&CHINA GAS HKD0.25	36 750.00	54 871.50	0.01
USD JARDINE MATHESON COM USDO.25(BERMUDA REG)	800.00	45 272.00	0.01
HKD MTR CORP HKD1	5 500.00	29 348.95	0.00
HKD POWER ASSETS HOLDINGS LTD HKD1	4 500.00	27 100.96	0.00
HKD SINO LAND CO HKD1	10 000.00	11 955.08	0.00
HKD SITC INTERNATIONAL HKD0.10	4 000.00	16 034.17	0.00
HKD SUN HUNG KAI PROP NPV	5 000.00	60 801.58	0.01
HKD SWIRE PACIFIC 'A' HKD0.60	2 000.00	11 069.99	0.00
HKD SWIRE PROPERTIES LTD HKD1	3 800.00	9 027.37	0.00
HKD TECHTRONIC INDUSTRY HKD0.1	5 000.00	103 195.93	0.01
HKD THE LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7 900.00	68 503.11	0.01
HKD WH GROUP LTD USDO.0001	33 858.00	21 237.66	0.00
HKD WHARF REAL ESTATE HKD0.1	6 000.00	30 400.79	0.00
HKD XINYI GLASS HLDGS HKD0.1	6 000.00	14 638.56	0.00
香港合計		1 598 303.34	0.16
アイルランド			
GBP DCC ORD EURO.25	361.00	26 449.65	0.00
EUR FLUTTER ENTERTAINM ORD EURO.09	599.00	80 739.57	0.01
EUR KERRY GROUP 'A' ORD EURO.125(DUBLIN LIST	621.00	75 911.14	0.01
アイルランド合計		183 100.36	0.02

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・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 (%)
イスラエル			
ILS AZRIELI GROUP ILS0.01	109.00	9 960.20	0.00
ILS BANK HAPOLIM B.M. ILS1	3 713.00	36 309.18	0.00
ILS BK LEUMI LE ISRAEL ILS1	4 891.00	47 347.53	0.01
USD CHECK POINT SFTWRE ORD ILS0.01	377.00	41 963.87	0.01
USD CYBER-ARK SOFTWARE COM ILS0.01	200.00	34 570.00	0.00
ILS ICL GROUP LTD ILS1	2 405.00	21 083.30	0.00
ILS ISRAEL DISCOUNT BK ILS0.10 SER ' A '	3 506.00	21 554.67	0.00
ILS NICE SYSTEMS ILS1	215.00	61 347.66	0.01
USD WIX.COM LTD COM ILS0.01	200.00	30 560.00	0.00
イスラエル合計		304 696.41	0.03
イタリア			
EUR AMPLIFON EURO.02	452.00	21 938.21	0.00
EUR ASSIC GENERALI SPA EUR1	4 253.00	84 876.64	0.01
EUR DIASORIN SPA EUR1	99.00	21 033.24	0.00
EUR FINECOBANK SPA EURO.33	2 210.00	38 532.55	0.01
EUR INFRASTRUTTURE WIR NPV	1 307.00	14 910.20	0.00
EUR POSTE ITALIANE SPA NPV	1 602.00	20 087.77	0.00
EUR TELECOM ITALIA SPA EURO.55	27 984.00	14 489.44	0.00
イタリア合計		215 868.05	0.02
日本			
JPY アドバンテスト	700.00	61 587.92	0.01
JPY アイシン	600.00	22 035.32	0.00
JPY 朝日インテック	700.00	15 338.41	0.00
JPY アズビル	400.00	17 684.62	0.00
JPY バンダイナムコホールディングス	700.00	54 479.72	0.01
JPY ベネフィット・ワン	100.00	4 685.37	0.00
JPY カブコン	600.00	14 949.14	0.00
JPY 東海旅客鉄道	500.00	68 695.23	0.01
JPY 千葉銀行	1 900.00	11 060.81	0.00
JPY 中外製薬	2 400.00	77 784.14	0.01
JPY コンコルディア・フィナンシャルグループ	3 400.00	12 366.90	0.00
JPY コスモス薬品	100.00	15 509.27	0.00
JPY サイバーエージェント	1 600.00	29 493.15	0.00
JPY 第一生命ホールディングス	3 700.00	74 524.64	0.01
JPY ダイフク	400.00	32 022.55	0.01
JPY 第一三共	6 200.00	154 228.72	0.03
JPY ダイキン工業	900.00	183 495.53	0.02
JPY 大東建託	200.00	21 647.80	0.00
JPY 大和ハウス工業	2 100.00	61 328.99	0.01
JPY 大和ハウスリート投資法人	8.00	22 792.73	0.00
JPY ディスコ	100.00	28 711.08	0.00
JPY エーザイ	900.00	54 477.96	0.01
JPY ファナック	700.00	137 139.46	0.02
JPY ファーストリテイリング	200.00	118 719.45	0.01
JPY 富士電機	500.00	26 157.03	0.00
JPY G L P 投資法人	15.00	23 818.75	0.00
JPY G M O ペイメントゲートウェイ	100.00	13 413.18	0.00
JPY 阪急阪神ホールディングス	800.00	23 708.66	0.00
JPY 光通信	100.00	14 496.46	0.00
JPY ヒロセ電機	100.00	16 777.49	0.00
JPY ホシザキ	200.00	15 183.41	0.00

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・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 (%)
JPY ヒューリック	1 100.00	10 424.06	0.00
JPY イビデン	400.00	24 906.42	0.00
JPY 出光興産	700.00	18 069.49	0.00
JPY いすゞ自動車	2 000.00	26 984.90	0.00
JPY 伊藤園	200.00	11 748.65	0.00
JPY 伊藤忠テクノソリューションズ	300.00	9 762.65	0.00
JPY 日本取引所グループ	1 900.00	41 147.56	0.01
JPY かんぽ生命保険	800.00	12 386.28	0.00
JPY ジャパンリアルエステイト投資法人	5.00	28 843.19	0.00
JPY J S R	700.00	26 139.42	0.00
JPY 鹿島建設	1 700.00	18 730.02	0.00
JPY カカクコム	500.00	13 981.24	0.00
JPY 関西電力	2 700.00	24 421.15	0.00
JPY 関西ペイント	600.00	13 474.83	0.00
JPY 花王	1 800.00	91 739.84	0.01
JPY 京王電鉄	400.00	18 001.67	0.00
JPY 京成電鉄	400.00	10 956.01	0.00
JPY キッコーマン	500.00	38 134.66	0.01
JPY 近鉄グループホールディングス	600.00	17 226.65	0.00
JPY キリンホールディングス	3 000.00	48 007.40	0.01
JPY 小林製薬	200.00	15 711.83	0.00
JPY 神戸物産	400.00	15 077.72	0.00
JPY コーエーテックモホールディングス	260.00	10 888.19	0.00
JPY 小糸製作所	400.00	23 004.10	0.00
JPY 小松製作所	3 200.00	73 049.45	0.01
JPY コーセー	100.00	12 039.28	0.00
JPY 栗田工業	400.00	18 671.01	0.00
JPY レーザーテック	300.00	78 589.99	0.01
JPY ライオン	800.00	11 350.57	0.00
JPY エムスリー	1 600.00	86 224.84	0.01
JPY マキタ	800.00	35 115.59	0.01
JPY 日本マクドナルドホールディングス	200.00	8 895.15	0.00
JPY 明治ホールディングス	400.00	23 462.06	0.00
JPY ミネベアミツミ	1 400.00	36 989.74	0.01
JPY ミスミグループ本社	1 000.00	42 141.88	0.01
JPY 三菱瓦斯化学	600.00	9 981.95	0.00
JPY 三菱H Cキャピタル	1 400.00	6 584.17	0.00
JPY 三井化学	700.00	18 772.29	0.00
JPY 三井不動産	3 400.00	69 949.36	0.01
JPY 三浦工業	300.00	10 528.87	0.00
JPY M o n o t a R O	1 000.00	19 868.77	0.00
JPY 日本電産	1 600.00	183 187.28	0.02
JPY 日本M & Aセンター	1 000.00	29 371.61	0.00
JPY 日本ビルファンド投資法人	5.00	30 824.78	0.00
JPY 日本通運	200.00	11 396.36	0.00
JPY 日本ペイントホールディングス	2 500.00	26 267.12	0.00
JPY 日本酸素ホールディングス	500.00	10 581.71	0.00
JPY 日本新薬	200.00	14 795.90	0.00
JPY 日本製鉄	3 000.00	44 902.90	0.01
JPY 日産化学	400.00	23 039.32	0.00
JPY 日清製粉グループ本社	700.00	10 085.87	0.00
JPY 日清食品ホールディングス	200.00	14 690.21	0.00
JPY ニトリホールディングス	300.00	47 637.50	0.01
JPY 日東電工	600.00	41 745.56	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・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 (%)
JPY 野村不動産ホールディングス	400.00	8 683.78	0.00
JPY 大林組	2 300.00	16 934.26	0.00
JPY オービック	300.00	55 458.19	0.01
JPY 小田急電鉄	1 100.00	21 187.19	0.00
JPY 王子ホールディングス	3 100.00	14 333.52	0.00
JPY オリンパス	4 200.00	93 916.95	0.01
JPY 小野薬品工業	1 400.00	30 892.60	0.01
JPY オープンハウス	200.00	11 343.52	0.00
JPY 日本オラクル	100.00	9 828.70	0.00
JPY オリエンタルランド	700.00	109 982.83	0.01
JPY パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	1 500.00	25 575.76	0.00
JPY パーソルホールディングス	700.00	20 221.06	0.00
JPY ポーラ・オルビスホールディングス	300.00	5 342.38	0.00
JPY 楽天グループ	3 200.00	32 720.07	0.01
JPY リクルートホールディングス	5 000.00	303 888.33	0.03
JPY リンナイ	100.00	9 441.19	0.00
JPY 良品計画	900.00	14 544.89	0.00
JPY S B I ホールディングス	900.00	23 176.71	0.00
JPY S C S K	600.00	11 387.56	0.00
JPY セコム	800.00	53 997.97	0.01
JPY 積水ハウス	2 200.00	42 820.03	0.01
JPY シャープ	800.00	8 947.99	0.00
JPY シマノ	300.00	82 962.70	0.01
JPY 清水建設	2 000.00	12 629.35	0.00
JPY 信越化学工業	1 300.00	217 534.90	0.02
JPY 塩野義製薬	1 000.00	69 778.50	0.01
JPY 資生堂	1 400.00	80 181.43	0.01
JPY 静岡銀行	1 500.00	10 568.50	0.00
JPY S M C	200.00	127 966.89	0.01
JPY スクウェア・エニックス・ホールディングス	300.00	15 667.80	0.00
JPY スタンレー電気	500.00	12 999.25	0.00
JPY 住友金属鉱山	900.00	33 552.34	0.00
JPY サントリー食品インターナショナル	400.00	14 108.94	0.00
JPY スズキ	1 300.00	52 494.61	0.01
JPY シスメックス	600.00	74 824.96	0.01
JPY T & D ホールディングス	2 000.00	23 638.21	0.00
JPY 大成建設	700.00	20 406.01	0.00
JPY 大正製薬ホールディングス	100.00	4 914.35	0.00
JPY テルモ	2 300.00	93 746.09	0.01
JPY T I S	800.00	24 730.28	0.00
JPY 東武鉄道	700.00	15 813.11	0.00
JPY 東宝	400.00	17 790.30	0.00
JPY 東京センチュリー	200.00	9 546.88	0.00
JPY 東京瓦斯	1 400.00	23 981.68	0.00
JPY 東急	1 900.00	26 288.26	0.00
JPY 東レ	5 000.00	29 098.60	0.00
JPY 東ソー	900.00	12 927.91	0.00
JPY T O T O	500.00	22 149.81	0.00
JPY 東洋水産	300.00	12 153.77	0.00
JPY 豊田自動織機	500.00	41 041.00	0.01
JPY 豊田通商	800.00	34 911.27	0.00
JPY ツルハホールディングス	100.00	11 273.06	0.00
JPY ユー・エス・エス	800.00	11 738.08	0.00
JPY ウエルシアホールディングス	300.00	10 634.55	0.00

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・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 (%)
JPY ヤクルト本社	500.00	24 968.07	0.00
JPY ヤマハ	500.00	25 628.61	0.00
JPY ヤマトホールディングス	1 100.00	24 258.22	0.00
JPY Z O Z O	400.00	12 735.04	0.00
日本合計		5 313 091.72	0.52
ルクセンブルグ			
EUR AROUNDTOWN SA EURO.01	4 155.00	24 787.40	0.00
ルクセンブルグ合計		24 787.40	0.00
マカオ			
HKD SANDS CHINA LTD USD0.01 REG ' S '	9 200.00	21 147.66	0.00
マカオ合計		21 147.66	0.00
オランダ			
EUR AKZO NOBEL NV EURO.50(POST REV SPLIT)	728.00	76 142.07	0.01
EUR ARGEN X NV EURO.10	170.00	47 263.94	0.01
EUR ASM INTL NV EURO.04	156.00	69 675.54	0.01
EUR EURONEXT EUR1.60	130.00	12 708.59	0.00
EUR EXOR NV EURO.01	417.00	36 470.45	0.00
EUR HEINEKEN HOLDING EUR1.6	484.00	40 069.33	0.01
EUR HEINEKEN NV EUR1.60	958.00	94 827.88	0.01
EUR ING GROEP N.V. EURO.01	14 146.00	194 384.78	0.02
EUR JUST EAT TAKEAWAY EURO.04	621.00	38 577.68	0.00
EUR KON KPN NV EURO.04	13 261.00	38 824.04	0.00
EUR KONINKLIJKE AHOLD EURO.01	3 869.00	129 124.16	0.01
EUR KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20	3 376.00	118 541.80	0.01
EUR QIAGEN NV EURO.01	869.00	47 929.17	0.01
EUR RANDSTAD N.V. EURO.10	452.00	28 348.73	0.00
GBP ROYAL DUTCH SHELL ' B ' SHS EURO.07 (UK LIST)	13 511.00	281 961.08	0.03
EUR STMICROELECTRONICS EUR1.04	2 338.00	113 490.03	0.01
EUR VOPAK(KON) EURO.50	377.00	14 241.23	0.00
EUR WOLTERS KLUWER EURO.12	978.00	109 269.06	0.01
オランダ合計		1 491 849.56	0.15
ニュージーランド			
NZD AUCKLAND INTL NPV	4 224.00	22 647.95	0.00
NZD FISHER & PAYKEL HE NPV	2 059.00	46 576.79	0.01
NZD MERCURY NZ LTD NPV	2 033.00	8 306.38	0.00
NZD MERIDIAN ENERGY LT NPV	4 284.00	13 810.87	0.00
NZD RYMAN HEALTHCARE G NPV	1 579.00	13 181.51	0.00
NZD SPARK NEW ZEALAND NPV	5 677.00	17 723.71	0.00
AUD XERO LIMITED NPV	511.00	52 479.09	0.01
ニュージーランド合計		174 726.30	0.02
ノルウェー			
NOK GJENSIDIGE FORSIKR NOK2	548.00	12 353.73	0.00
NOK ORKLA ASA NOK1.25	2 104.00	19 124.86	0.00
NOK SCHIBSTED ASA SER ' A ' NOK0.50	233.00	10 338.96	0.00
NOK SCHIBSTED ASA SER ' B ' NOK0.5	314.00	12 041.20	0.00
NOK YARA INTERNATIONAL NOK1.7	592.00	28 952.37	0.01
ノルウェー合計		82 811.12	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・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 (%)
パプアニューギニア			
AUD OIL SEARCH LTD PGK0.10	7 356.00	19 872.09	0.00
パプアニューギニア合計		19 872.09	0.00
ポーランド			
EUR INPOST S.A. EURO.01	734.00	8 125.58	0.00
ポーランド合計		8 125.58	0.00
シンガポール			
SGD CITY DEVELOPMENTS SGD0.50	2 000.00	10 239.58	0.00
SGD DBS GROUP HLDGS SGD1	6 600.00	143 778.58	0.02
SGD KEPPEL CORP NPV	4 900.00	18 225.58	0.00
SGD MAPLETREE LOGISTICS TRUST-UNITS REIT	6 800.00	9 224.37	0.00
SGD OVERSEA-CHINESE BK NPV	12 261.00	98 184.57	0.01
SGD SINGAPORE AIRLINES NPV	4 900.00	17 403.64	0.00
SGD SINGAPORE EXCHANGE SGD0.01	2 800.00	18 235.79	0.00
SGD SINGAPORE TECH ENG NPV	5 400.00	15 004.92	0.00
SGD UOL GROUP LIMITED SGD1	1 500.00	7 526.53	0.00
SGD UTD O/S BANK SGD1	4 500.00	83 590.42	0.01
SGD VENTURE CORP LTD SGD0.25	1 100.00	14 849.58	0.00
SGD WILMAR INTERNATIONAL LTD	6 800.00	20 382.89	0.00
シンガポール合計		456 646.45	0.04
スペイン			
EUR ACS ACTIVIDADES CO EURO.5	1 069.00	25 521.28	0.00
EUR AENA SME S.A. EUR10	247.00	36 004.00	0.00
EUR AMADEUS IT GROUP EURO.01	1 656.00	105 278.36	0.01
EUR CAIXABANK SA EUR1	12 994.00	33 259.63	0.00
EUR CELLNEX TELECOM SA EURO.25	1 767.00	103 504.19	0.01
EUR EDP RENOVAVEIS SA EUR5	840.00	21 387.30	0.00
EUR ENAGAS SA EUR1.50	898.00	20 306.75	0.00
EUR ENDESA SA EUR1.2	1 214.00	27 104.10	0.00
EUR FERROVIAL SA EURO.2	1 871.00	51 723.30	0.02
EUR GRIFOLS SA EURO.25 (CLASS A) POST SUBD	1 136.00	20 241.53	0.00
EUR IBERDROLA SA EURO.75 (POST SUBDIVISION)	21 470.00	239 346.32	0.02
EUR INDITEX EURO.03 (POST SUBD)	3 967.00	124 402.01	0.01
EUR RED ELECTRICA CORP EURO.5	1 697.00	35 786.54	0.01
EUR REPSOL SA EUR1	5 224.00	57 572.39	0.01
EUR SIEMENS GAMESA REN EURO.17	886.00	23 466.04	0.00
EUR TELEFONICA SA EUR1	19 387.00	87 211.66	0.01
スペイン合計		1 012 115.40	0.10
スウェーデン			
SEK ASSA ABLQY SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	3 611.00	100 991.97	0.01
SEK ESSITY AB SER ' B ' NPV	2 200.00	69 917.46	0.01
SEK FASTIGHETS AB BALD SER ' B ' NPV	350.00	26 111.06	0.00
SEK HUSQVARNA AB SER ' B ' NPV	1 458.00	20 460.87	0.00
SEK ICA GRUPPEN AB	353.00	20 772.26	0.00
SEK INDUSTRIVARDEN AB SER ' C ' NPV	547.00	16 088.06	0.00
SEK INDUSTRIVARDEN AB SER ' A ' NPV	421.00	12 470.36	0.00
SEK LATOUR INVESTMENT SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	502.00	18 874.72	0.00
SEK LUNDBERGFORETAGEN SER ' B ' NPV	254.00	13 885.79	0.00
SEK LUNDIN ENERGY AB NPV	660.00	23 237.13	0.00
SEK SECURITAS SER ' B ' NPV	1 153.00	16 593.58	0.00

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・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 (%)
SEK SINCH AB NPV (POST SPLIT)	1 720.00	22 962.52	0.00
SEK SKANSKA AB SER ' B ' NPV	1 206.00	27 709.02	0.00
SEK SVENSKA CELLULOSA SER ' B ' NPV	2 139.00	34 755.48	0.01
SEK SVENSKA HANDELSBKN SER ' A ' NPV (P/S)	5 620.00	59 354.12	0.01
SEK TELIA COMPANY AB NPV	9 096.00	34 991.94	0.01
SEK VOLVO AB SER ' A ' NPV (POST SPLIT)	517.00	11 257.58	0.00
スウェーデン合計		530 433.92	0.05
スイス			
GBP GLENCORE XSTRATA ORD USD0.01	36 519.00	172 531.57	0.02
CHF ROCHE HLDGS AG CHF1(BR)	37.00	15 273.40	0.00
CHF SWATCH GROUP CHF2.25(BR)	102.00	29 914.42	0.00
CHF SWISS RE AG CHF0.10	1 058.00	98 825.93	0.01
CHF VIFOR PHARMA AG CHF0.01	170.00	18 958.29	0.00
スイス合計		335 503.61	0.03
イギリス			
GBP 3I GROUP ORD GBPO.738636	3 453.00	63 362.58	0.01
GBP ASTRAZENECA ORD USD0.25	5 646.00	618 188.90	0.06
GBP AVEVA GROUP ORD GBPO.03556	416.00	17 650.30	0.00
GBP AVIVA ORD GBPO.25	14 097.00	71 803.77	0.01
GBP BAE SYSTEMS ORD GBPO.025	11 693.00	84 805.66	0.01
GBP BARRATT DEVEL ORD GBPO.10	3 645.00	33 630.96	0.00
GBP BRIT AMER TOBACCO ORD GBPO.25	8 104.00	271 256.28	0.03
GBP BRITISH LAND CO PLC REIT	3 245.00	21 843.47	0.00
GBP BT GROUP ORD GBPO.05	32 435.00	68 057.65	0.01
USD COCA-COLA EUROPACI COM EURO.01	792.00	39 101.04	0.00
GBP EVRAZ PLC ORD USD1	1 871.00	14 257.92	0.00
GBP HALMA ORD GBPO.10	1 376.00	54 631.64	0.01
GBP HIKMA PHARMACEUTIC ORD GBPO.10	630.00	18 461.80	0.00
GBP INFORMA PLC (GB) ORD GBPO.001	5 368.00	33 165.70	0.00
GBP JOHNSON MATTHEY ORD GBP1.109245	704.00	19 521.98	0.00
GBP KINGFISHER ORD GBPO.157142857	7 674.00	32 163.76	0.00
GBP LAND SECURITIES GP ORD GBPO.106666666	2 621.00	25 209.33	0.00
GBP LLOYDS BANKING GP ORD GBPO.1	256 553.00	158 848.38	0.02
GBP NATIONAL GRID ORD GBPO.12431289	12 876.00	171 473.79	0.02
GBP OCADO GROUP PLC ORD GBPO.02	1 781.00	42 306.71	0.01
GBP RECKITT BENCK GRP ORD GBPO.10	2 588.00	209 201.76	0.02
GBP RELX PLC GBPO.1444	7 010.00	216 738.76	0.02
GBP RENTOKIL INITIAL ORD GBPO.01	6 709.00	54 463.17	0.01
GBP ROLLS-ROYCE HLDGS ORD GBPO.20	30 440.00	49 333.35	0.00
GBP SAGE GROUP GBPO.01051948	4 025.00	41 098.93	0.00
GBP SEVERN TRENT ORD GBPO.9789	876.00	33 447.24	0.00
GBP SMITHS GROUP ORD GBPO.375	1 409.00	26 880.42	0.00
GBP SPIRAX-SARCO ENG ORD GBPO.269230769	269.00	55 625.14	0.01
GBP SSE PLC ORD GBPO.50	3 892.00	79 914.28	0.01
GBP ST JAMES ' S PLACE ORD GBPO.15	1 924.00	39 416.32	0.00
GBP UNITED UTILITIES G ORD GBPO.05	2 535.00	36 372.02	0.00
GBP WHITBREAD ORD GBPO.76797385	702.00	26 032.75	0.00
GBP WPP PLC ORD GBPO.10	4 392.00	60 546.62	0.01
イギリス合計		2 788 812.38	0.27
無記名株式合計		27 976 630.05	2.72

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・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 (%)
参加証券			
スイス			
CHF LINDT & SPRUENGLI PTG CERT CHF10	8.00	97 773.94	0.01
CHF SCHINDLER-HLDG AG PTG CERT CHF0.10(POST-SUBD)	150.00	38 415.82	0.00
スイス合計		136 189.76	0.01
参加証券合計			
		136 189.76	0.01
その他の株式			
スイス			
CHF ROCHE HLDGS AG GENUSSSCHEINE NPV	2 643.00	1 027 182.79	0.10
スイス合計		1 027 182.79	0.10
その他の株式合計			
		1 027 182.79	0.10
優先株式			
ドイツ			
EUR BAYERISCHE MOTORENWERKE AG EUR1	237.00	18 513.64	0.00
EUR FUCHS PETROLUB SE PRF NPV (REG)	256.00	11 410.88	0.00
EUR HENKEL AG&CO. KGAA NON-VTG PRF NPV	653.00	51 230.67	0.01
EUR PORSCHE AUTO HL SE NON VTG PRF NPV	558.00	46 591.33	0.00
EUR SARTORIUS AG NON VTG PRF NPV	106.00	72 423.36	0.01
EUR VOLKSWAGEN AG NON VTG PRF NPV	670.00	121 916.21	0.01
ドイツ合計		322 086.09	0.03
優先株式合計			
		322 086.09	0.03
記名株式			
オーストラリア			
AUD AMPOL LTD NPV	847.00	17 218.21	0.00
AUD BHP GROUP LTD NPV	10 760.00	300 368.61	0.03
GBP BHP GROUP PLC ORD USD0.50	7 713.00	210 871.85	0.02
AUD COLES GROUP LTD NPV	4 701.00	60 065.06	0.01
オーストラリア合計		588 523.73	0.06
ベルギー			
EUR AGEAS NPV	684.00	35 131.01	0.00
EUR KBC GROUP NV NPV	894.00	74 485.32	0.01
EUR UCB NPV	484.00	52 376.15	0.01
ベルギー合計		161 992.48	0.02
カナダ			
CAD 1ST QUANTUM MINLS COM NPV	2 181.00	46 296.09	0.01
CAD AGNICO EAGLE MINES LTD COM	889.00	44 131.21	0.00
CAD ALIMENTATION COUCHE TARD INC SUB VTG SH	3 129.00	114 154.35	0.01
CAD BANK NOVA SCOTIA HALIFAX COM	4 378.00	272 276.93	0.03
CAD BANK OF MONTREAL COM NPV	2 323.00	240 919.80	0.02
CAD BARRICK GOLD CORP COM NPV	6 485.00	122 743.84	0.01
CAD BCE INC COM NEW	309.00	15 486.13	0.00

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・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 BLACKBERRY LTD NPV	2 065.00	19 590.78	0.00
CAD BROOKFIELD ASSET M LTD VTG SHS NPV CL ' A '	4 587.50	255 123.36	0.02
CAD BROOKFIELD ASST MG CL A EXCHANGEABLE LTD VTG S	1.00	57.15	0.00
CAD CAN PACIFIC RYS COM NPV	2 475.00	172 485.97	0.02
CAD CANADIAN NAT RES LTD COM	4 315.00	175 721.55	0.02
CAD CANADIAN NATL RY CO COM	2 593.00	327 177.25	0.03
CAD CANADIAN TIRE LTD CL A	226.00	29 745.74	0.00
CAD CCL INDUSTRIES INC ' B ' NON-VTG COM NPV	568.00	27 757.97	0.00
CAD CDN IMPERIAL BK OF COMMERCE COM	1 606.00	178 340.12	0.02
CAD CENOVUS ENERGY INC COM NPV	4 927.00	58 226.79	0.01
CAD CGI INC COM NPV SUB VOTING SHARES C	852.00	70 880.45	0.01
CAD CONSTELLATION SOFT COM STK NPV	73.00	123 697.67	0.01
CAD DOLLARAMA INC COM NPV	1 100.00	47 316.81	0.00
CAD ENBRIDGE INC COM NPV	7 264.00	271 409.04	0.03
CAD FAIRFAX FINL HLDGS SUB-VTG COM NPV	103.00	45 522.18	0.00
CAD FIRSTSERVICE CORP COM NPV	100.00	19 140.94	0.00
CAD FORTIS INC COM NPV	1 733.00	74 653.55	0.01
CAD FRANCO NEVADA CORP COM NPV	698.00	95 319.33	0.01
CAD GFL ENVIRON INC COM NPV SUB VTG SHS	700.00	26 863.89	0.00
CAD GILDAN ACTIVEWEAR INC COM	718.00	28 965.15	0.00
CAD GREAT WEST LIFE CO INC COM	1 063.00	30 726.57	0.00
CAD IA FINANCIAL CORP COM NPV	419.00	22 171.59	0.00
CAD IMPERIAL OIL LTD COM NEW	952.00	31 340.01	0.00
CAD INTACT FINL CORP COM NPV	588.00	72 661.18	0.01
CAD LIGHTSPEED COMMERC COM NPV SUB VTG SHS	300.00	15 112.25	0.00
CAD LOBLAW COS LTD COM	624.00	46 843.78	0.01
CAD MAGNA INTL INC COM NPV	1 051.00	78 448.12	0.01
CAD MANULIFE FINL CORP COM	7 180.00	127 838.48	0.01
CAD METRO INC CL A SUB	925.00	43 956.97	0.00
CAD NATL BK OF CANADA COM NPV	1 191.00	92 166.02	0.01
CAD NUTRIEN LTD NPV	2 109.00	139 218.99	0.01
CAD OPEN TEXT CO COM NPV	1 001.00	47 256.44	0.00
CAD PARKLAND CORP. COM NPV	600.00	15 425.63	0.00
CAD PEMBINA PIPELINE C COM NPV	1 991.00	58 668.38	0.01
CAD POWER CORP CDA COM	2 041.00	65 567.20	0.01
CAD RESTAURANT BRANDS COM NPV	1 051.00	58 555.48	0.01
CAD ROGERS COMMS INC CLASS ' B ' COM CAD1.62478	1 323.00	58 951.26	0.01
CAD ROYAL BK OF CANADA COM NPV	5 184.00	510 398.50	0.05
CAD SAPUTO INC COM	927.00	20 436.20	0.00
CAD SHAW COMMUNICATIONS INC CL B CONV	1 738.00	50 129.40	0.01
CAD SHOPIFY INC COM NPV CL A	408.00	617 352.85	0.06
CAD SUN LIFE FINL INC COM	2 121.00	112 151.10	0.01
CAD SUNCOR ENERGY INC COM NPV ' NEW '	5 620.00	136 338.01	0.01
CAD TC ENERGY CORPORAT COM NPV	3 475.00	162 318.37	0.02
CAD TECK RESOURCES LTD CLASS ' B ' SUB-VTG COM NPV	1 751.00	46 245.62	0.00
CAD THOMSON-REUTERS CP COM NPV(POST REV SPLIT)	630.00	75 066.65	0.01
CAD TORONTO-DOMINION COM NPV	6 536.00	459 323.67	0.05
CAD WESTON GEORGE LTD COM	278.00	29 217.31	0.00
CAD WHEATON PRECIOUS M COM NPV	1 638.00	68 211.69	0.01
カナダ合計		6 196 101.76	0.60
デンマーク			
DKK CARLSBERG SER ' B ' DKK20	374.00	57 737.45	0.01
DKK COLOPLAST DKK1 B	426.00	69 182.33	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・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 (%)
DKK DEMANT A/S DKK0.20	373.00	17 709.62	0.00
DKK NOVO-NORDISK AS DKK0.2 SER ' B '	6 171.00	658 181.47	0.06
DKK TRYG A/S DKK5	1 105.00	26 583.28	0.00
DKK VESTAS WIND SYSTEM DKK0.20 (POST SPLIT)	3 734.00	124 331.97	0.01
デンマーク合計		953 726.12	0.09
フィンランド			
EUR ELISA OYJ NPV	527.00	31 415.41	0.00
EUR FORTUM OYJ EUR3.40	1 667.00	47 678.69	0.01
EUR NESTE OIL OYJ NPV	1 541.00	72 452.14	0.01
EUR NOKIA OYJ NPV	19 727.00	109 125.05	0.01
SEK NORDEA HOLDING ABP NPV	11 572.00	136 598.75	0.01
EUR ORION CORP SER ' B ' NPV	429.00	17 523.80	0.00
EUR SAMPO PLC SER ' A ' NPV	1 732.00	84 590.51	0.01
EUR STORA ENSO OYJ NPV SER ' R '	2 137.00	36 020.98	0.00
EUR UPM-KYMMENE CORP NPV	1 972.00	71 140.85	0.01
フィンランド合計		606 546.18	0.06
フランス			
EUR DASSAULT AVIATION EURO0.80 (POST SUBDIVISION)	90.00	8 469.01	0.00
EUR DASSAULT SYSTEMES EURO0.10	2 455.00	146 982.48	0.02
EUR GECINA EUR7.50	190.00	25 535.36	0.00
EUR LA FRANCAISE DES EURO0.40 (PROMESSES)	323.00	14 869.96	0.00
EUR MICHELIN (CGDE) EUR2	632.00	92 834.99	0.01
フランス合計		288 691.80	0.03
ドイツ			
EUR ADIDAS AG NPV (REGD)	693.00	199 339.43	0.02
EUR ALLIANZ SE NPV(REGD)(VINKULIERT)	1 490.00	322 749.59	0.03
EUR BASF SE NPV	3 325.00	216 622.85	0.02
EUR BAYER AG NPV (REGD)	3 516.00	176 192.78	0.02
EUR BRENNTAG AG	575.00	48 994.55	0.01
EUR DAIMLER AG ORD NPV(REGD)	3 106.00	290 177.43	0.03
EUR DELIVERY HERO SE NPV	557.00	73 793.10	0.01
EUR DEUTSCHE BANK AG NPV(REGD)	7 147.00	85 756.11	0.01
EUR DEUTSCHE BOERSE AG NPV(REGD)	694.00	108 269.66	0.01
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA ORD NPV (REGD)(VINK)	2 244.00	13 541.06	0.00
EUR DEUTSCHE POST AG NPV(REGD)	3 616.00	212 340.75	0.02
EUR DEUTSCHE TELEKOM NPV(REGD)	12 141.00	213 024.20	0.02
EUR E.ON SE NPV	8 386.00	102 831.53	0.01
EUR EVONIK INDUSTRIES NPV	734.00	21 984.93	0.00
EUR HANNOVER RUECKVERS ORD NPV(REGD)	217.00	37 774.07	0.01
EUR INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)	4 776.00	214 658.31	0.02
EUR LEG IMMOBILIEN SE NPV	273.00	37 950.17	0.00
EUR MTU AERO ENGINES H NPV (REGD)	198.00	36 762.21	0.00
EUR MUENCHENER RUECKVE NPV(REGD)	514.00	137 899.39	0.01
EUR SCOUT24 AG NPV	362.00	23 877.58	0.00
EUR SIEMENS AG NPV(REGD)	2 785.00	442 883.98	0.04
EUR SIEMENS ENERGY AG NPV	1 473.00	38 863.73	0.01
EUR SIEMENS HEALTHINEE NPV	971.00	70 299.03	0.01
EUR TELEFONICA DEUTSCH NPV	3 864.00	10 255.69	0.00
EUR UNIPER SE NPV	528.00	22 833.65	0.00
EUR UNITED INTERNET AG NPV(REGD)	397.00	14 813.52	0.00
EUR VITESCO TECHNOLOGI NPV	80.00	3 529.88	0.00
EUR VONOVIA SE NPV	2 010.00	110 860.34	0.01
ドイツ合計		3 288 879.52	0.32

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・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 (%)
香港			
HKD BUDWEISER BREWING USD0.00001	6 100.00	15 492.86	0.00
HKD ESR CAYMAN LIMITED USD0.001	5 800.00	19 194.83	0.00
HKD NEW WORLD DEVEL CO NPV POST CON	6 000.00	23 704.92	0.01
香港合計		58 392.61	0.01
アイルランド			
EUR CRH ORD EURO.32	2 899.00	140 052.87	0.01
GBP EXPERIAN ORD USD0.10	3 324.00	148 640.64	0.01
EUR KINGSPAN GROUP ORD EURO.13(DUBLIN LISTING)	578.00	66 490.99	0.01
EUR SMURFIT KAPPA GRP ORD EURO.001	908.00	46 012.46	0.01
アイルランド合計		401 196.96	0.04
マン島			
GBP ENTAIN PLC ORD EURO.01	2 099.00	46 347.75	0.00
マン島合計		46 347.75	0.00
イスラエル			
USD FIVERR INTERNATION COM NPV	39.00	5 523.18	0.00
ILS MIZRAHI TEFAHOT BK ILS0.01	396.00	14 642.69	0.00
イスラエル合計		20 165.87	0.00
イタリア			
EUR ATLANTIA SPA EUR1	1 782.00	32 353.86	0.00
EUR DAVIDE CAMPARI MIL EURO.01	2 148.00	31 116.94	0.00
EUR ENEL EUR1	29 619.00	223 605.65	0.02
EUR ENI SPA EUR1	8 842.00	115 867.64	0.01
EUR FERRARI NV EURO.01(NEW)	468.00	122 055.11	0.01
EUR INTESA SANPAOLO NPV	59 290.00	141 181.76	0.02
EUR MEDIOBANCA SPA EURO.5	2 195.00	24 138.66	0.00
EUR MONCLER SPA NPV	727.00	52 437.38	0.01
EUR NEXI SPA NPV	1 618.00	24 686.65	0.00
EUR PRYSMIAN SPA EURO.10	879.00	32 442.50	0.00
EUR RECORDATI EURO.125	403.00	25 148.52	0.00
EUR SNAM EUR1	7 104.00	39 773.41	0.01
EUR TERNA SPA ORD EURO.22	5 324.00	39 407.95	0.01
EUR UNICREDIT SPA NPV (POST REV SPLIT)	7 541.00	90 738.32	0.01
イタリア合計		994 954.35	0.10
日本			
JPY イオン	2 400.00	55 896.78	0.01
JPY A G C	700.00	34 215.51	0.00
JPY 味の素	1 700.00	51 009.73	0.01
JPY A N A ホールディングス	600.00	11 834.07	0.00
JPY アサヒグループホールディングス	1 700.00	62 792.73	0.01
JPY 旭化成	4 600.00	43 409.22	0.01
JPY アステラス製薬	6 800.00	106 570.96	0.01
JPY ブリヂストン	2 000.00	81 113.22	0.01
JPY ブラザー工業	900.00	15 488.13	0.00
JPY キヤノン	3 700.00	81 465.50	0.01
JPY 中部電力	2 400.00	24 223.00	0.00
JPY 大日本印刷	900.00	21 107.93	0.00
JPY 大和証券グループ本社	5 500.00	30 560.13	0.00
JPY デンソー	1 600.00	117 394.87	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・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 (%)
JPY 電通グループ	800.00	25 434.85	0.00
JPY 東日本旅客鉄道	1 100.00	67 678.89	0.01
JPY E N E O Sホールディングス	11 100.00	41 390.99	0.00
JPY 富士フイルムホールディングス	1 300.00	102 252.85	0.01
JPY 富士通	700.00	115 870.36	0.01
JPY 博報堂D Yホールディングス	800.00	11 928.31	0.00
JPY 浜松ホトニクス	500.00	30 736.71	0.00
JPY 日野自動車	1 000.00	8 313.88	0.00
JPY 日立建機	400.00	11 625.35	0.00
JPY 日立金属	800.00	14 809.99	0.00
JPY 日立製作所	3 500.00	206 156.15	0.02
JPY 本田技研工業	5 900.00	161 133.47	0.02
JPY H O Y A	1 400.00	222 185.04	0.02
JPY 飯田グループホールディングス	600.00	12 407.42	0.00
JPY I N P E X	3 600.00	29 708.05	0.00
JPY 伊藤忠商事	4 300.00	123 457.66	0.01
JPY 日本航空	600.00	10 864.41	0.00
JPY 日本都市ファンド投資法人	20.00	17 226.65	0.00
JPY ゆうちょ銀行	1 400.00	11 442.16	0.00
JPY 日本郵政	7 900.00	59 557.00	0.01
JPY 日本たばこ産業	4 400.00	88 100.75	0.01
JPY ジェイ エフ イー ホールディングス	1 900.00	22 021.23	0.00
JPY K D D I	5 800.00	168 567.53	0.02
JPY キーエンス	700.00	433 581.40	0.04
JPY コナミホールディングス	300.00	15 350.74	0.00
JPY クボタ	3 800.00	79 283.10	0.01
JPY 京セラ	1 200.00	71 136.55	0.01
JPY 協和キリン	1 000.00	27 918.45	0.00
JPY ローソン	100.00	4 879.12	0.00
JPY L I X I L	1 000.00	24 562.95	0.00
JPY 丸紅	6 100.00	54 663.35	0.01
JPY マツダ	2 200.00	17 786.78	0.00
JPY メディカルホールディングス	700.00	12 576.51	0.00
JPY メルカリ	300.00	18 204.24	0.00
JPY 三菱ケミカルホールディングス	4 700.00	36 931.08	0.00
JPY 三菱商事	4 700.00	140 364.61	0.01
JPY 三菱電機	6 700.00	84 056.10	0.01
JPY 三菱地所	4 300.00	59 267.25	0.01
JPY 三菱重工業	1 200.00	27 065.92	0.00
JPY 三菱U F Jフィナンシャル・グループ	44 400.00	235 168.08	0.02
JPY 三井物産	5 900.00	132 866.26	0.01
JPY みずほフィナンシャルグループ	8 800.00	108 658.24	0.01
JPY M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	1 600.00	46 726.85	0.01
JPY 村田製作所	2 100.00	154 987.01	0.02
JPY 日本電気	900.00	40 583.03	0.00
JPY ネクソン	1 800.00	35 732.09	0.00
JPY 日本碍子	1 000.00	15 826.32	0.00
JPY 任天堂	400.00	176 493.90	0.02
JPY 日本プロロジスリート投資法人	7.00	22 779.51	0.00
JPY 日本電信電話	4 600.00	126 601.79	0.01
JPY 日本郵船	600.00	39 103.44	0.00
JPY 日産自動車	8 600.00	42 634.55	0.01
JPY 野村ホールディングス	11 600.00	48 772.20	0.01
JPY 野村不動産マスターファンド投資法人	16.00	22 743.41	0.00

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・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 (%)
JPY 野村総合研究所	1 200.00	51 574.27	0.02
JPY エヌ・ティ・ティ・データ	2 300.00	48 493.55	0.01
JPY オムロン	700.00	67 598.75	0.01
JPY オリックス	4 500.00	88 973.53	0.01
JPY オリックス不動産投資法人	10.00	15 896.78	0.00
JPY 大阪瓦斯	1 400.00	22 526.75	0.00
JPY 大塚商会	400.00	18 283.50	0.00
JPY 大塚ホールディングス	1 400.00	51 119.82	0.01
JPY パナソニック	8 000.00	87 542.38	0.01
JPY ルネサスエレクトロニクス	4 200.00	53 339.20	0.01
JPY リソナホールディングス	7 900.00	28 915.76	0.00
JPY リコー	2 500.00	22 083.76	0.00
JPY ローム	300.00	28 085.78	0.00
JPY 参天製薬	1 400.00	18 544.19	0.00
JPY セイコーエプソン	1 100.00	17 728.65	0.00
JPY 積水化学工業	1 300.00	21 123.78	0.00
JPY セブン&アイ・ホールディングス	2 700.00	108 290.11	0.01
JPY S Gホールディングス	1 200.00	26 526.93	0.00
JPY 島津製作所	800.00	33 889.65	0.00
JPY ソフトバンク	10 400.00	143 115.06	0.01
JPY ソフトバンクグループ	4 400.00	233 669.47	0.02
JPY 総合警備保障	200.00	8 525.25	0.00
JPY S O M P Oホールディングス	1 200.00	49 397.16	0.01
JPY ソニーグループ	4 600.00	560 086.31	0.05
JPY S U B A R U	2 300.00	43 399.09	0.01
JPY S U M C O	1 000.00	21 912.02	0.00
JPY 住友化学	4 900.00	22 613.06	0.00
JPY 住友商事	4 400.00	59 909.29	0.01
JPY 大日本住友製薬	700.00	8 519.97	0.00
JPY 住友電気工業	2 900.00	38 042.63	0.00
JPY 三井住友フィナンシャルグループ	4 700.00	153 279.32	0.02
JPY 三井住友トラスト・ホールディングス	1 200.00	37 623.85	0.00
JPY 住友不動産	1 100.00	34 285.09	0.00
JPY 武田薬品工業	5 700.00	152 157.29	0.02
JPY T D K	1 500.00	59 447.80	0.01
JPY 東京海上ホールディングス	2 300.00	115 622.88	0.01
JPY 東京電力ホールディングス	4 200.00	11 207.89	0.00
JPY 東京エレクトロン	500.00	263 507.86	0.03
JPY 凸版印刷	1 000.00	15 174.60	0.00
JPY 東芝	1 400.00	55 817.52	0.01
JPY トヨタ自動車	38 500.00	678 484.30	0.07
JPY トrendマイクロ	500.00	28 843.19	0.00
JPY ユニ・チャーム	1 400.00	60 268.62	0.01
JPY 西日本旅客鉄道	600.00	25 882.25	0.00
JPY ヤマハ発動機	1 100.00	27 697.39	0.00
JPY 安川電機	900.00	40 345.24	0.00
JPY 横河電機	800.00	15 042.49	0.00
JPY Zホールディングス	9 600.00	63 580.08	0.01
日本合計		8 495 250.42	0.83
ルクセンブルグ			
EUR ARCELORMITTAL NPV(POST STOCK SPLIT)	2 599.00	70 005.65	0.01
EUR EUROFINS SCIENTIFI EURO.01	495.00	62 927.01	0.00
EUR TENARIS S.A. USD1	1 741.00	16 974.66	0.00
ルクセンブルグ合計		149 907.32	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・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 (%)
オランダ			
EUR ADYEN NV EURO.01	71.00	195 598.33	0.02
EUR AEGON NV EURO.12	6 472.00	28 491.18	0.00
EUR ASML HOLDING NV EURO.09	1 536.00	1 209 553.55	0.12
EUR CNH INDUSTRIAL NV COM EURO.01	3 841.00	63 359.87	0.01
EUR JDE PEETS N.V. EURO.01	335.00	9 087.53	0.00
EUR KONINKLIJKE DSM NV EUR1.5	646.00	138 265.21	0.01
EUR NN GROUP N.V. EURO.12	994.00	49 162.11	0.00
EUR PROSUS N.V. EURO.05	3 371.00	269 098.68	0.03
GBP ROYAL DUTCH SHELL PLC 'A' SHS EURO.07	14 826.00	309 325.36	0.03
EUR UNIVERSAL MUSIC GR EUR10.00	2 780.00	79 199.24	0.01
オランダ合計		2 351 141.06	0.23
ノルウェー			
NOK ADEVINTA ASA SER 'B' NOK0.2	808.00	11 493.01	0.00
NOK AKER BP ASA NOK1	211.00	6 632.43	0.00
NOK DNB BANK ASA NOK12.50	3 549.00	77 201.71	0.01
NOK EQUINOR ASA NOK2.50	3 373.00	84 664.19	0.01
NOK MOWI ASA NOK7.50	1 546.00	34 987.70	0.01
NOK NORSK HYDRO ASA NOK3.6666	4 803.00	31 048.82	0.00
NOK TELENOR ASA ORD NOK6	2 342.00	34 405.08	0.00
ノルウェー合計		280 432.94	0.03
ポルトガル			
EUR EDP ENERGIAS PORTU EUR1(REGD)	10 480.00	57 023.26	0.01
EUR GALP ENERGIA EUR1-B	1 893.00	17 617.13	0.00
EUR JERONIMO MARTINS EUR5	917.00	19 833.25	0.00
ポルトガル合計		94 473.64	0.01
シンガポール			
SGD CAPITALAND INVESTM NPV	8 700.00	21 319.33	0.00
SGD GENTING SINGAPORE LTD	16 100.00	9 041.32	0.00
SGD SINGAPORE TELECOMM NPV	27 800.00	47 848.89	0.01
シンガポール合計		78 209.54	0.01
スペイン			
EUR BANCO SANTANDER SA EURO.50(REGD)	63 811.00	197 520.57	0.02
EUR BBVA(BILB-VIZ-ARG) EURO.49	24 633.00	130 385.77	0.01
スペイン合計		327 906.34	0.03
スウェーデン			
SEK ALFA LAVAL AB NPV	1 133.00	43 710.90	0.00
SEK ATLAS COPCO AB SER 'A' NPV (POST SPLIT)	2 433.00	148 799.96	0.01
SEK ATLAS COPCO AB SER 'B' NPV (POST SPLIT)	1 397.00	72 507.85	0.01
SEK BOLIDEN AB NPV (POST SPLIT)	1 025.00	35 195.65	0.00
SEK ELECTROLUX AB SER 'B' NPV (POST SPLIT)	800.00	17 851.83	0.00
SEK EMBRACER GROUP AB SER 'B' NPV (POST SPLIT)	1 964.00	21 129.66	0.00
SEK EPIROC AB SER 'A' NPV (POST SPLIT)	2 364.00	57 154.68	0.01
SEK EPIROC AB SER 'B' NPV	1 365.00	27 391.15	0.00
SEK EQT AB NPV	863.00	50 783.17	0.00
SEK ERICSSON SER 'B' NPV	10 604.00	106 522.60	0.01
SEK EVOLUTION AB NPV	627.00	65 693.81	0.01
SEK GETINGE AB SER 'B' NPV	231.00	9 645.05	0.00
SEK HENNES & MAURITZ SER 'B' NPV	2 914.00	51 378.01	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 (%)
SEK HEXAGON AB SER 'B' NPV (POST SPLIT)	7 133.00	103 756.16	0.01
SEK INVESTOR AB SER 'A' NPV (POST SPLIT)	583.00	13 992.46	0.00
SEK INVESTOR AB SER 'B' NPV (POST SPLIT)	6 420.00	148 531.52	0.02
SEK KINNEVIK AB SER 'B' NPV (POST SPLIT)	853.00	30 328.32	0.00
SEK LIFCO AB SER 'B' NPV (POST SPLIT)	352.00	9 514.98	0.00
SEK NIBE INDUSTRIER AB SER 'B' NPV (POST SPLIT)	4 292.00	61 012.26	0.01
SEK SANDVIK AB NPV (POST SPLIT)	4 078.00	100 841.15	0.01
SEK SKAND ENSKILDA BKN SER 'A' NPV	5 761.00	83 608.68	0.01
SEK SKF AB SER 'B' NPV	1 366.00	31 204.54	0.00
SEK SWEDBANK AB SER 'A' NPV	3 249.00	65 282.89	0.01
SEK SWEDISH MATCH NPV (POST SPLIT)	5 920.00	42 964.64	0.00
SEK TELE2 AB SHS	1 876.00	26 688.66	0.00
SEK VOLVO AB SER 'B' NPV (POST SPLIT)	5 150.00	110 903.17	0.01
スウェーデン合計		1 536 393.75	0.15

スイス

CHF ABB LTD CHF0.12 (REGD)	6 485.00	223 478.12	0.02
CHF ADECCO GROUP AG CHF0.1 (REGD)	561.00	25 946.40	0.00
CHF ALCON AG CHF0.04	1 823.00	143 255.41	0.01
CHF BACHEM HOLDING AG CHF0.05(REGD)CLS 'B'	9.00	6 457.75	0.00
CHF BALOISE-HLDGS CHF0.1(REGD)	181.00	26 913.33	0.00
CHF BARRY CALLEBAUT AG CHF0.02 (REGD)	11.00	25 913.12	0.00
CHF BQE CANT VAUDOISE CHF1	168.00	13 561.27	0.00
CHF CLARIANT CHF4.00(REGD)	749.00	14 609.30	0.00
GBP COCA-COLA HBC AG ORD CHF6.70	712.00	21 872.68	0.00
CHF CREDIT SUISSE GRP CHF0.04(REGD)	9 088.00	87 521.35	0.01
CHF EMS-CHEMIE HLDG AG CHF0.01(REGD)(POST RECON)	30.00	28 430.95	0.00
CHF GEBERIT CHF0.10(REGD)	135.00	102 672.36	0.01
CHF GIVAUDAN AG CHF10	34.00	165 333.91	0.02
CHF HOLCIM LTD CHF2 (REGD)	1 902.00	91 359.30	0.01
CHF JULIUS BAER GRUPPE CHF0.02 (REGD)	803.00	49 669.03	0.01
CHF KUEHNE&NAGEL INTL CHF1(REGD)(POST-SUBD)	201.00	57 276.53	0.01
CHF LOGITECH INTL CHF0.25(REGD) (POST-SUBD)	604.00	47 555.05	0.01
CHF LONZA GROUP AG CHF1(REGD)	273.00	219 190.62	0.02
CHF NESTLE SA CHF0.10(REGD)	10 517.00	1 341 048.20	0.13
CHF NOVARTIS AG CHF0.50(REGD)	8 066.00	640 119.99	0.06
CHF PARTNERS GROUP HLG CHF0.01 (REGD)	78.00	134 017.72	0.01
CHF RICHEMONT(CIE FIN) CHF1.00 (REG) SER 'A'	1 916.00	283 031.34	0.03
CHF SCHINDLER-HLDG AG CHF0.1(REGD)(POST-SUBD)	77.00	19 037.82	0.00
CHF SGS LTD CHF1(REGD)	22.00	66 019.02	0.01
CHF SIKA AG CHF0.01 (REG)	512.00	199 566.03	0.02
CHF SONOVA HOLDING AG CHF0.05 (REGD)	204.00	76 384.27	0.01
CHF STRAUMANN HLDG CHF0.1(REGD)	39.00	82 475.69	0.01
CHF SWATCH GROUP CHF0.45(REGD)	163.00	9 256.16	0.00
CHF SWISS LIFE HLDG CHF5.1(REGD)	113.00	64 693.54	0.01
CHF SWISS PRIME SITE CHF15.3 (REGD)	310.00	29 211.15	0.00
CHF SWISSCOM AG CHF1(REGD)	93.00	51 293.71	0.01
CHF TEMENOS AG CHF5 (REGD)	248.00	31 582.88	0.00
CHF UBS GROUP CHF0.10 (REGD)	13 359.00	230 108.56	0.02
CHF ZURICH INSURANCE GRP CHF0.10	547.00	224 084.40	0.02
スイス合計		4 832 946.96	0.47

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・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 (%)
イギリス			
GBP ABRDN PLC ORD GBP0.1396825396	8 055.00	24 862.24	0.00
GBP ADMIRAL GROUP ORD GBP0.001	701.00	27 423.90	0.00
GBP ANGLO AMERICAN USD0.54945	4 781.00	175 336.29	0.02
GBP ANTOFAGASTA ORD GBP0.05	1 490.00	27 203.53	0.00
GBP ASHTEAD GROUP ORD GBP0.10	1 619.00	129 458.67	0.01
GBP ASSOCD BRIT FOODS ORD GBP0.0568	1 294.00	32 921.03	0.00
GBP AUTO TRADER GROUP ORD GBP0.01	3 459.00	33 525.65	0.00
GBP BARCLAYS ORD GBP0.25	61 982.00	151 064.43	0.02
GBP BP ORD USD0.25	74 117.00	319 125.83	0.03
GBP BUNZL ORD GBP0.32142857	1 230.00	46 670.68	0.01
GBP BURBERRY GROUP ORD GBP0.0005	1 460.00	33 947.52	0.00
GBP COMPASS GROUP ORD GBP0.1105	6 437.00	124 548.71	0.01
GBP CRODA INTL ORD GBP0.10609756	515.00	68 918.05	0.01
GBP DIAGEO ORD GBP0.28 101/108	8 506.00	427 574.38	0.04
GBP FERGUSON PLC (NEW) ORD GBP0.10	811.00	123 014.06	0.01
GBP GLAXOSMITHKLINE ORD GBP0.25	18 341.00	370 043.43	0.04
GBP HARGREAVES LANSDOW ORD GBP0.004 (WI)	1 223.00	21 633.05	0.00
GBP HSBC HLDGS ORD USD0.50(UK REG)	74 243.00	411 900.20	0.04
GBP IMPERIAL BRANDS PL GBP0.10	3 473.00	70 851.49	0.01
GBP INTERCONTL HOTELS ORD GBP0.208521303	610.00	35 904.76	0.00
GBP INTERTEK GROUP ORD GBP0.01	588.00	41 541.14	0.00
GBP JD SPORTS FASHION ORD GBP0.0005	7 670.00	22 618.58	0.00
GBP LEGAL & GENERAL GP ORD GBP0.025	21 485.00	80 129.11	0.01
GBP LONDON STOCK EXCH ORD GBP0.06918604	1 146.00	98 580.59	0.01
GBP M&G PLC ORD GBP0.05	9 474.00	23 426.24	0.00
GBP MELROSE INDUST PLC ORD GBP0.076190476	15 838.00	30 382.83	0.00
GBP MONDI ORD EURO.20	1 727.00	39 287.50	0.00
GBP NATWEST GROUP PLC ORD GBP1	17 155.00	48 251.83	0.01
GBP NEXT ORD GBP0.10	477.00	49 614.80	0.01
GBP PEARSON ORD GBP0.25	2 760.00	21 660.58	0.00
GBP PERSIMMON ORD GBP0.10	1 141.00	41 316.19	0.01
GBP PHOENIX GP HLDGS ORD GBP0.10	1 976.00	16 736.41	0.00
GBP PRUDENTIAL ORD GBP0.05	9 429.00	159 175.47	0.02
GBP RIO TINTO ORD GBP0.10	4 099.00	250 107.70	0.03
GBP SAINSBURY(J) ORD GBP0.28571428	6 362.00	23 281.21	0.00
GBP SCHROEDERS VTG SHS GBP1	442.00	20 092.56	0.00
GBP SMITH & NEPHEW ORD USD0.20	3 153.00	50 787.03	0.01
GBP STANDARD CHARTERED ORD USD0.50	9 615.00	52 943.32	0.00
EUR STELLANTIS N V COM EURO.01	7 715.00	131 475.82	0.01
GBP TAYLOR WIMPEY ORD GBP0.01	12 866.00	26 877.29	0.00
GBP TESCO ORD GBP0.0633333	27 889.00	102 112.86	0.01
GBP UNILEVER PLC ORD GBP0.031111	9 586.00	489 409.11	0.05
GBP VODAFONE GROUP ORD USD0.2095238(POST CONS)	97 966.00	141 714.49	0.01
イギリス合計		4 617 450.56	0.44
アメリカ合衆国			
CAD BAUSCH HEALTH COMP COM NPV	1 194.00	28 221.14	0.00
CAD BROOKFIELD RENEWA. CLASS A SUB VOTING SHARES	500.00	18 514.19	0.00
アメリカ合衆国合計		46 735.33	0.00
記名株式合計		36 416 366.99	3.54

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・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 (%)
預託証券			
中国			
USD FUTU HOLDINGS LIM1 SPON ADS EA REP 8 ORD SHS	200.00	9 498.00	0.00
中国合計		9 498.00	0.00
香港			
USD MELCO RESORTS UNSP ARD EACH REP 3 ORD SHS	800.00	7 808.00	0.00
香港合計		7 808.00	0.00
アイルランド			
AUD JAMES HARDIE ID PLC CUFS EURO.5	1 621.00	63 985.43	0.01
アイルランド合計		63 985.43	0.01
イスラエル			
USD TEVA PHARMA IND ADR(CNV 1 ORD ILS0.10)	3 800.00	31 350.00	0.00
イスラエル合計		31 350.00	0.00
オランダ			
EUR ABN AMRO BANK N.V. DR EACH REP SHS	1 503.00	21 316.39	0.00
オランダ合計		21 316.39	0.00
シンガポール			
USD SEA LTD ADS EACH REP ONE CL A SHS	200.00	57 614.00	0.01
シンガポール合計		57 614.00	0.01
預託証券合計		191 571.82	0.02
投資信託証券			
アイルランド			
USD STAR COMPASS PLC/UBS DYNMC DIVERSIFIED LTD NOTE DUE 30.06.23	25 720 000.00	42 582 032.00	4.14
アイルランド合計		42 582 032.00	4.14
投資信託証券合計		42 582 032.00	4.14
投資信託、クローズド・エンド型			
カナダ			
CAD CANADIAN APARTMENT PROP. REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	300.00	13 297.47	0.00
CAD RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	765.00	12 672.47	0.00
カナダ合計		25 969.94	0.00
シンガポール			
SGD ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	10 800.00	22 999.67	0.00
SGD CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST REAL ESTATE INV TRUST	15 945.64	24 538.02	0.01
SGD MAPLETREE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5 700.00	8 480.47	0.00
シンガポール合計		56 018.16	0.01
イギリス			
GBP SEGRO PLC REIT	4 461.00	83 157.81	0.01
イギリス合計		83 157.81	0.01
投資信託、クローズド・エンド型合計		165 145.91	0.02

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・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 (%)
新株引受権			
ドイツ			
EUR VONOVIA SE RIGHTS 07.12.21	2 010.00	7 036.24	0.00
ドイツ合計		7 036.24	0.00
新株引受権合計			
		7 036.24	0.00
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD 3M CO 2.25000% 16-19.09.26	1 150 000.00	1 190 392.10	0.12
USD ABU DHABI, GOVERNMENT OF-REG-S 3.12500% 17-11.10.27	2 475 000.00	2 648 250.00	0.26
USD ALBERTA, PROVINCE OF 3.30000% 18-15.03.28	2 800 000.00	3 079 121.28	0.30
USD ALPHABET INC 1.10000% 20-15.08.30	3 700 000.00	3 476 675.03	0.34
USD ALPHABET INC 1.99800% 16-15.08.26	2 150 000.00	2 213 464.45	0.22
USD AMERICAN EXPRESS CO 3.40000% 18-27.02.23	1 000 000.00	1 032 351.47	0.10
USD APPLE INC 1.65000% 20-11.05.30	1 789 000.00	1 741 070.60	0.17
USD APPLE INC 2.20000% 19-11.09.29	3 400 000.00	3 464 477.91	0.34
USD APPLE INC 2.40000% 13-03.05.23	1 975 000.00	2 022 500.25	0.20
USD APPLE INC 2.45000% 16-04.08.26	1 575 000.00	1 640 685.19	0.16
USD APPLE INC 2.85000% 16-23.02.23	750 000.00	768 237.41	0.07
USD APPLE INC 3.20000% 17-11.05.27	4 850 000.00	5 216 820.88	0.51
USD BANK OF NOVA SCOTIA 2.00000% 19-15.11.22	1 410 000.00	1 430 304.31	0.14
USD BAYER US FINANCE II LLC-REG-S 3.87500% 18-15.12.23	1 000 000.00	1 050 259.31	0.10
USD BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 1.75000% 19-27.09.24	500 000.00	511 790.64	0.05
USD BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 1.30000% 21-29.01.31	2 125 000.00	2 068 347.50	0.20
USD CHEVRON CORP 2.23600% 20-11.05.30	2 571 000.00	2 597 781.31	0.25
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 3.90000% 18-16.03.28	1 000 000.00	1 133 449.90	0.11
USD CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 4.37500% 12-15.06.22	1 150 000.00	1 173 314.20	0.11
USD CPPIB CAPITAL INC-REG-S 1.25000% 21-28.01.31	450 000.00	434 735.10	0.04
USD EQUINOR ASA 2.37500% 20-22.05.30	1 000 000.00	1 019 311.92	0.10
USD EQUINOR ASA 3.62500% 18-10.09.28	3 500 000.00	3 866 466.59	0.38
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.37500% 17-24.05.27	1 500 000.00	1 585 365.45	0.15
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.87500% 20-17.05.30	4 800 000.00	4 644 272.92	0.45
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.25000% 21-14.02.31	5 200 000.00	5 101 145.97	0.50
USD EXPORT DEVELOPMENT CANADA 2.00000% 17-17.05.22	200 000.00	201 677.74	0.02
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 3.25000% 15-10.11.25	1 200 000.00	1 294 350.00	0.13
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 2.75000% 17-25.01.22	1 375 000.00	1 379 984.38	0.13
USD EXXON MOBIL CORP 3.04300% 16-01.03.26	3 050 000.00	3 235 423.34	0.31
USD EXXON MOBIL CORP 3.48200% 20-19.03.30	1 500 000.00	1 645 949.40	0.16
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.37500% 17-07.07.27	900 000.00	950 497.03	0.09
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.25000% 19-18.06.29	2 450 000.00	2 586 269.00	0.25
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.00000% 19-23.07.26	1 500 000.00	1 554 405.00	0.15
USD INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 2.85000% 19-13.05.22	700 000.00	707 807.73	0.07
USD INTERNATIONAL DVPT ASSOCIATION-REG-S 1.00000% 20-03.12.30	825 000.00	788 224.80	0.08
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.12500% 17-13.12.21	900 000.00	900 568.05	0.09
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 1.75000% 19-23.10.29	1 900 000.00	1 937 074.11	0.19
USD JOHNSON & JOHNSON 1.30000% 20-01.09.30	2 500 000.00	2 381 024.05	0.23
USD JOHNSON & JOHNSON 2.90000% 17-15.01.28	1 000 000.00	1 066 036.05	0.10
USD JOHNSON & JOHNSON 3.37500% 13-05.12.23	775 000.00	815 847.50	0.08
USD KOREA DEVELOPMENT BANK 2.75000% 17-19.03.23	850 000.00	872 787.31	0.08
USD KOREA HYDRO&NUCLEAR POWER CO LTD-REG-S 3.00000% 12-19.09.22	1 150 000.00	1 171 059.38	0.11
USD KOREA HYDRO&NUCLEAR POWER CO LTD-REG-S 3.12500% 17-25.07.27	2 575 000.00	2 766 998.44	0.27

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・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 KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.12500% 13-17.01.23	625 000.00	637 454.90	0.06
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.00000% 15-02.05.25	1 075 000.00	1 111 003.59	0.11
USD KUWAIT INTERNATIONAL GOVT BOND-REG-S 3.50000% 17-20.03.27	4 400 000.00	4 788 575.00	0.47
USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 2.00000% 15-13.01.25	3 200 000.00	3 302 583.90	0.32
USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 0.87500% 20-03.09.30	3 000 000.00	2 845 700.85	0.28
USD MANITOBA, PROVINCE OF 2.12500% 17-04.05.22	1 300 000.00	1 310 634.00	0.13
USD MICROSOFT CORP 2.65000% 15-03.11.22	2 950 000.00	3 002 530.76	0.29
USD MICROSOFT CORP 2.87500% 17-06.02.24	1 575 000.00	1 639 488.09	0.16
USD MICROSOFT CORP 3.30000% 17-06.02.27	4 175 000.00	4 526 372.22	0.44
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD/NY 2.50000% 16-12.07.26	2 300 000.00	2 412 963.81	0.23
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 1.25000% 20-15.09.30	2 062 000.00	1 954 272.36	0.19
USD NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 3.00000% 18-10.01.28	1 900 000.00	2 042 866.89	0.20
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 2.40000% 12-21.09.22	1 700 000.00	1 727 230.46	0.17
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 3.10000% 17-17.05.27	2 600 000.00	2 785 803.43	0.27
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 2.20000% 20-14.08.30	1 500 000.00	1 529 464.78	0.15
USD QATAR, STATE OF-REG-S 3.37500% 19-14.03.24	2 200 000.00	2 308 900.00	0.22
USD QATAR, STATE OF-REG-S 4.00000% 19-14.03.29	3 300 000.00	3 702 600.00	0.36
USD QATAR, STATE OF-REG-S 3.75000% 20-16.04.30	1 200 000.00	1 334 400.00	0.13
USD QUEBEC, PROVINCE OF 2.50000% 16-20.04.26	3 125 000.00	3 292 670.12	0.32
USD ROCHE HOLDINGS INC-REG-S 3.62500% 18-17.09.28	2 000 000.00	2 225 366.42	0.22
USD SINOPEC GROUP OVERSEAS DEV 2013-REG-S 4.37500% 13-17.10.23	250 000.00	265 490.00	0.03
USD STATE STREET CORP 2.40000% 20-24.01.30	872 000.00	896 865.32	0.09
USD TEMASEK FINANCIAL I LTD-REG-S 2.37500% 12-23.01.23	850 000.00	866 546.36	0.08
USD TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.70000% 13-15.01.24	650 000.00	686 163.22	0.07
USD TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.45500% 19-19.02.29	1 000 000.00	1 089 395.29	0.11
USD VISA INC 2.05000% 20-15.04.30	1 900 000.00	1 917 335.89	0.19
USD VISA INC 3.15000% 15-14.12.25	1 375 000.00	1 471 218.82	0.14
USD WAL-MART STORES INC 1.80000% 21-22.09.31	1 500 000.00	1 483 632.80	0.14
USD WESTPAC BANKING CORP 2.85000% 16-13.05.26	2 500 000.00	2 652 377.25	0.26
USD WESTPAC BANKING CORP 3.35000% 17-08.03.27	1 000 000.00	1 081 672.60	0.11
米ドル合計		142 258 154.13	13.85

ノート、固定利付債合計	142 258 154.13	13.85
-------------	----------------	-------

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	2 000 000.00	2 152 500.00	0.21
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.00000% 17-16.02.22	200 000.00	200 870.00	0.02
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.50000% 17-02.11.27	2 900 000.00	3 089 051.00	0.30
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.75000% 19-19.09.29	4 000 000.00	4 080 477.64	0.40
USD BANK OF NEW YORK CO INC 0.75000% 21-28.01.26	1 500 000.00	1 461 671.54	0.14
USD CAISSE D ' AMOR DE LA DETTE SOCIALE-REG-S 3.37500% 14-20.03.24	650 000.00	688 378.15	0.07
USD CLIFFORD CAPITAL PTE LTD-REG-S 1.73300% 19-10.09.24	1 200 000.00	1 224 319.32	0.12
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 3.15000% 17-19.09.27	625 000.00	675 524.07	0.07
USD CPPIB CAPITAL INC-REG-S 2.75000% 17-02.11.27	3 125 000.00	3 347 319.50	0.33
USD IDB TRUST SERVICES LTD-REG-S 2.26100% 17-26.09.22	1 800 000.00	1 823 040.00	0.18
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 1.12500% 21-13.01.31	3 000 000.00	2 905 606.80	0.28
USD INTERNATIONAL FINANCE CORP 2.12500% 16-07.04.26	1 000 000.00	1 041 895.54	0.10
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 17-22.11.27	3 195 000.00	3 394 083.10	0.33
USD KOREA DEVELOPMENT BANK 1.75000% 20-18.02.25	375 000.00	382 541.25	0.04
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 3.00000% 17-19.04.24	1 000 000.00	1 046 250.00	0.10
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 2.87500% 19-07.11.29	2 500 000.00	2 600 000.00	0.25
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 2.87500% 20-21.05.30	1 500 000.00	1 558 125.00	0.15

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・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 MORGAN STANLEY 3.12500% 16-27.07.26	800 000.00	847 628.80	0.08
USD MTR CORP CI LTD-REG-S 2.50000% 16-02.11.26	2 000 000.00	2 094 479.60	0.20
USD NEDERLANDSE WATERSCHAPSBK NV-REG-S 3.00000% 18-21.12.21	425 000.00	425 635.80	0.04
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 2.37500% 17-18.01.22	650 000.00	651 391.00	0.06
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 3.12500% 18-22.03.23	1 330 000.00	1 372 604.96	0.13
USD NORDRHEIN-WESTFALEN, STATE OF-REG-S 2.25000% 15-16.04.25	700 000.00	727 137.60	0.07
USD SP POWERASSETS LTD-REG-S 3.25000% 15-24.11.25	1 000 000.00	1 073 172.90	0.11
USD SUMITOMO MITSUI BANKING CORP-REG-S 2.44000% 19-18.06.24	1 086 000.00	1 123 787.70	0.11
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 2.60000% 17-11.01.22	1 225 000.00	1 227 897.63	0.12
米ドル合計		41 215 388.90	4.01

中期債券、固定利付債合計	41 215 388.90	4.01
--------------	---------------	------

債券、固定利付債

米ドル

USD BNG BANK NV-REG-S 2.37500% 16-16.03.26	1 000 000.00	1 048 702.00	0.10
USD CAISSE D ' AMORTIS DE LA DETTE SOC-REG-S 1.87500% 15-12.02.22	550 000.00	551 815.00	0.05
USD CANADIAN IMPERIAL BANK OF COM/CAN-REG-S 2.35000% 17-27.07.22	875 000.00	886 503.56	0.09
USD DNB BOLIGKREDITT AS-REG-S 2.50000% 17-28.03.22	750 000.00	755 208.00	0.07
USD FAB SUKUK CO LTD-REG-S 3.87500% 19-22.01.24	1 100 000.00	1 163 250.00	0.11
USD FMS WERTMANAGEMENT 2.00000% 17-01.08.22	475 000.00	480 619.25	0.05
USD ING BANK NV-REG-S 2.62500% 12-05.12.22	300 000.00	306 495.60	0.03
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 14-25.11.24	625 000.00	654 738.87	0.06
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 15-29.07.25	2 000 000.00	2 103 610.22	0.20
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.87500% 20-14.05.30	1 800 000.00	1 720 638.00	0.17
USD KOREA GAS CORP-REG-S 2.87500% 19-16.07.29	1 600 000.00	1 708 300.00	0.17
USD KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 3.25000% 14-10.07.24	1 550 000.00	1 640 679.18	0.16
USD KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 1.62500% 20-05.10.30	800 000.00	764 638.08	0.08
USD KOREA, REPUBLIC OF 3.87500% 13-11.09.23	1 100 000.00	1 162 081.25	0.11
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.50000% 14-20.11.24	1 250 000.00	1 308 757.88	0.13
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 0.75000% 20-30.09.30	5 500 000.00	5 181 363.17	0.50
USD NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S 1.70000% 20-13.02.23	1 283 000.00	1 299 945.02	0.13
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 3.40000% 14-06.05.24	450 000.00	476 303.59	0.05
USD ONTARIO, PROVINCE OF 1.12500% 20-07.10.30	2 800 000.00	2 664 282.57	0.26
USD ONTARIO, PROVINCE OF 3.20000% 14-16.05.24	2 000 000.00	2 114 320.00	0.21
USD SWEDBANK AB-REG-S 2.80000% 17-14.03.22	400 000.00	402 878.90	0.04
米ドル合計		28 395 130.14	2.77

債券、固定利付債合計	28 395 130.14	2.77
------------	---------------	------

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	7 528 000.00	8 177 584.03	0.80
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 15-31.01.22	4 005 000.00	4 014 596.94	0.39
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 17-15.02.27	6 605 000.00	6 959 244.71	0.68
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 13-15.05.23	11 000.00	11 216.56	0.00
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.62500% 20-15.05.30	8 501 000.00	7 979 317.52	0.78
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.12500% 21-15.02.31	15 200 000.00	14 838 406.29	1.44
米ドル合計		41 980 366.05	4.09

財務省証券(T-note)、固定利付債合計	41 980 366.05	4.09
-----------------------	---------------	------

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・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 (%)
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	2 322 000.00	5 434 086.69	0.53
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.375%/CPI LINKED 04-15.01.25	3 025 000.00	5 053 595.08	0.49
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.625%/CPI LINKED 16-15.01.26	2 358 000.00	3 006 960.03	0.29
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI LINKED 17-15.01.27	3 381 000.00	4 244 407.26	0.41
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI INDEX 13-15.07.23	3 354 000.00	4 193 952.74	0.41
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI LINKED 15-15.07.25	4 636 000.00	5 857 488.70	0.57
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.750%/CPI LINKED 18-15.07.28	3 709 000.00	4 672 099.10	0.46
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 20-15.01.30	5 145 000.00	6 105 542.84	0.60
米ドル合計		38 568 132.44	3.76
財務省証券(T-note)、変動利付債合計		38 568 132.44	3.76
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		401 241 413.31	39.06
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% 17.06.21-16.06.22	1 000 000.00	999 473.30	0.10
米ドル合計		999 473.30	0.10
財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン合計		999 473.30	0.10
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD FANNIE MAE 0.25000% 20-27.11.23	1 400 000.00	1 391 071.23	0.14
USD FANNIE MAE 2.12500% 16-24.04.26	2 000 000.00	2 081 698.16	0.20
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD NEW YORK 2.87500% 18-12.04.23	500 000.00	515 651.05	0.05
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-144A 3.50000% 17-10.01.27	2 000 000.00	2 178 661.00	0.21
USD NESTLE HOLDINGS INC-144A 1.00000% 20-15.09.27	1 200 000.00	1 154 529.65	0.11
USD PROCTER & GAMBLE CO 2.30000% 12-06.02.22	625 000.00	627 087.97	0.06
米ドル合計		7 948 699.06	0.77
ノート、固定利付債合計		7 948 699.06	0.77
中期債券、固定利付債			
米ドル			
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 3.85000% 14-08.07.24	1 000 000.00	1 060 914.13	0.10
米ドル合計		1 060 914.13	0.10
中期債券、固定利付債合計		1 060 914.13	0.10
債券、固定利付債			
米ドル			
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 1.62500% 19-17.10.22	750 000.00	755 974.95	0.07
USD HSBC BANK CANADA-REG-S 1.65000% 19-10.09.22	600 000.00	606 030.22	0.06
米ドル合計		1 362 005.17	0.13
債券、固定利付債合計		1 362 005.17	0.13

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・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 (%)
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	2 736 000.00	3 374 012.04	0.33
米ドル合計		3 374 012.04	0.33
財務省証券(T-note)、変動利付債合計		3 374 012.04	0.33
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		14 745 103.70	1.43
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			
無記名株式			
オーストラリア			
AUD DEXUS NPV (STAPLED)	4 149.00	32 860.45	0.01
オーストラリア合計		32 860.45	0.01
無記名株式合計		32 860.45	0.01
記名株式			
イギリス			
GBP BERKELEY GP HLDGS ORD GBPO.053943	414.00	23 464.41	0.00
イギリス合計		23 464.41	0.00
記名株式合計		23 464.41	0.00
新株引受権			
シンガポール			
SGD MAPLETREE LOGISTICS TRUST RIGHTS 14.12.21	251.60	3.67	0.00
シンガポール合計		3.67	0.00
新株引受権合計		3.67	0.00
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 2.95000% 18-11.01.25	1 100 000.00	1 158 272.32	0.11
USD US BANK NA/CINCINNATI OH 2.65000% 19-23.05.22	900 000.00	907 823.05	0.09
米ドル合計		2 066 095.37	0.20
ノート、固定利付債合計		2 066 095.37	0.20
中期債券、変動利付債			
米ドル			
USD NATIONAL BANK OF CANADA 0.550%/VAR 20-15.11.24	636 000.00	629 966.52	0.06
米ドル合計		629 966.52	0.06
中期債券、変動利付債合計		629 966.52	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 (%)
債券、固定利付債			
米ドル			
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 2.75000% 17-22.06.24	800 000.00	835 583.96	0.08
米ドル合計		835 583.96	0.08
債券、固定利付債合計			
		835 583.96	0.08
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			
		3 587 974.38	0.35
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 MAN FUNDS VI PLC-MAN AHL TARGETRISK-INU-USD-CAP	118 355.13	18 350 962.13	1.79
USD UBS(IRELAND)FUND SOLUTION PLC-MSCI USA SF UCITS SHS-A-ETF-ACC	954 261.00	124 225 696.98	12.09
アイルランド合計		142 576 659.11	13.88
ルクセンブルグ			
EUR ALMA PLATINUM IV UBS MULTI-STRATEGY ALTERNATIVES-IOC-E-CAP	3 678.22	40 414 387.57	3.93
USD AQR UCITS FUNDS - GLOBAL RISK PARITY UCITS FUND-A2-CAP	97 200.65	13 728 619.81	1.34
USD INVESCO FUNDS SICAV BAL RISK ALLOCATION-PI1-USD HDG-CAP	688 743.22	9 787 041.13	0.95
USD UBS (LUX) BD SICAV-USD INVES GRA CORPOR SUSTAI (USD) F-ACC	1 603.08	186 630 652.97	18.17
USD UBS (LUX) BOND FUND-EURO HIGH YIELD (EUR)(USD HEDGED) F-ACC	197 124.00	24 750 889.44	2.41
USD UBS (LUX) BOND SICAV-SHT TERM USD CORP SUSTAIN (USD) F-ACC	210 481.00	24 238 991.96	2.36
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD CORPORATES (USD) F-ACC	758 736.00	17 579 913.12	1.71
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD (USD) F-ACC	104 638.00	37 061 733.22	3.61
USD UBS (LUX) BOND SICAV - EMERG ECON CORPORATES (USD) F-ACC	266 652.00	33 112 845.36	3.22
USD UBS (LUX) EMERGING ECONOMIES FUND - GLOBAL BONDS (USD) F-ACC	23 325.00	48 644 987.25	4.73
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD SUSTAINABLE U-X-ACC	9.00	101 107.35	0.01
ルクセンブルグ合計		436 051 169.18	42.44
投資信託、オープン・エンド型合計			
		578 627 828.29	56.32
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			
		578 627 828.29	56.32
投資有価証券合計			
		998 202 319.68	97.16

派生商品

公認の証券取引所に上場されている派生商品

債券に係る金融先物

USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 22.03.22	-217.00	-166 140.63	-0.02
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 22.03.22	-246.00	-303 937.50	-0.03
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.22	-305.00	-107 226.71	-0.01
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.22	1.00	31.25	0.00
USD US LONG BOND FUTURE 22.03.22	-13.00	-21 023.43	0.00
債券に係る金融先物合計		-598 297.02	-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 (%)
指数に係る金融先物			
EUR EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 17.12.21	102.00	-53 578.56	-0.01
CHF SWISS MARKET INDEX FUTURE 17.12.21	13.00	20 791.01	0.00
GBP FTSE 100 INDEX FUTURE 17.12.21	23.00	17 662.05	0.00
SEK OMX 30 INDEX FUTURE 17.12.21	28.00	-41 422.86	0.00
AUD SPI 200 INDEX FUTURES 16.12.21	8.00	-22 973.22	0.00
USD S&P500 EMINI FUTURE 17.12.21	283.00	1 634 580.00	0.16
USD MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 17.12.21	568.00	-2 181 760.00	-0.21
JPY TOPIX INDEX FUTURE 09.12.21	20.00	-279 096.39	-0.03
CAD S&P/TSX 60 INDEX FUTURE 16.12.21	9.00	30 215.15	0.00
HKD HANG SENG INDEX FUTURE 30.12.21	3.00	-22 819.83	0.00
指数に係る金融先物合計		-898 402.65	-0.09
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		-1 496 699.67	-0.15
派生商品合計		-1 496 699.67	-0.15

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・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	8 507 027.86 JPY	945 500 000.00 10.12.2021	179 443.55 0.02
USD	733 785.61 DKK	4 700 000.00 10.12.2021	22 306.32 0.00
USD	3 645 100.79 GBP	2 675 000.00 10.12.2021	105 918.42 0.01
USD	405 117.09 SGD	550 000.00 10.12.2021	4 010.33 0.00
USD	4 174 852.01 CAD	5 260 000.00 10.12.2021	74 407.73 0.01
USD	366 178.27 HKD	2 850 000.00 10.12.2021	598.94 0.00
USD	2 414 707.09 CHF	2 235 000.00 10.12.2021	-1 022.35 0.00
USD	139 211.32 NZD	200 000.00 10.12.2021	3 481.93 0.00
USD	2 545 302.90 AUD	3 500 000.00 10.12.2021	63 521.86 0.01
USD	139 305.61 ILS	450 000.00 10.12.2021	-3 544.15 0.00
USD	27 235 124.85 EUR	23 459 000.00 10.12.2021	824 792.79 0.08
USD	215 979.02 NOK	1 850 000.00 10.12.2021	12 946.72 0.00
USD	1 282 043.23 SEK	11 200 000.00 10.12.2021	47 702.28 0.00
USD	7 411 750.55 GBP	5 372 000.00 7.1.2022	298 695.56 0.03
USD	8 435 153.82 JPY	960 500 000.00 7.1.2022	-30 830.89 0.00
USD	4 781 590.28 CHF	4 393 000.00 7.1.2022	26 552.14 0.00
USD	40 502 516.78 EUR	34 803 000.00 7.1.2022	1 266 994.79 0.12
USD	2 716 499.04 AUD	3 620 000.00 7.1.2022	148 447.15 0.02
USD	143 387.08 NZD	200 000.00 7.1.2022	7 705.29 0.00
USD	4 466 640.56 CAD	5 521 000.00 7.1.2022	160 756.01 0.01
USD	408 464.45 SGD	550 000.00 7.1.2022	7 406.01 0.00
USD	140 596.89 ILS	450 000.00 7.1.2022	-2 486.03 0.00
USD	735 400.50 DKK	4 700 000.00 7.1.2022	23 009.84 0.00
USD	1 665 674.04 HKD	12 950 000.00 7.1.2022	4 511.80 0.00
USD	221 488.59 NOK	1 850 000.00 7.1.2022	18 491.44 0.00
USD	1 302 921.65 SEK	11 200 000.00 7.1.2022	66 719.31 0.01
CHF	153 072 600.00 USD	163 865 608.29 12.1.2022	1 843 731.86 0.18
EUR	216 589 700.00 USD	243 183 666.31 12.1.2022	1 016 308.37 0.10
GBP	17 163 800.00 USD	22 948 635.66 12.1.2022	-222 279.51 -0.02
SGD	24 027 000.00 USD	17 568 733.55 12.1.2022	-48 666.57 0.00
USD	893 864.83 EUR	797 300.00 12.1.2022	-5 072.84 0.00
GBP	700 000.00 USD	932 466.85 10.12.2021	-6 325.67 0.00
CAD	900 000.00 USD	711 328.68 10.12.2021	-9 731.75 0.00
CAD	850 000.00 USD	672 092.64 7.1.2022	-9 168.92 0.00
GBP	550 000.00 USD	733 182.95 7.1.2022	-4 929.00 0.00
EUR	1 500 000.00 USD	1 684 290.00 7.1.2022	6 750.51 0.00
EUR	1 500 000.00 USD	1 682 005.80 10.12.2021	6 706.34 0.00
先渡為替契約合計			5 897 859.61 0.58
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			24 000 267.78 2.34
当座借越およびその他の短期負債			-65 364.60 -0.01
その他の資産および負債			794 853.34 0.08
純資産総額			1 027 333 236.14 100.00

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)

2021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	925.00	71 391.59	0.02
AUD APA GROUP NPV	4 852.00	32 786.16	0.01
AUD ARISTOCRAT LEISURE NPV	2 475.00	77 408.58	0.02
AUD ASX LTD NPV	773.00	49 564.29	0.01
AUD AURIZON HOLDINGS NPV	10 241.00	24 470.85	0.01
AUD AUSNET SERVICES NPV	11 781.00	21 217.43	0.00
AUD AUST & NZ BANK GRP NPV	12 071.00	228 523.77	0.05
AUD BLUESCOPE STEEL NPV	1 967.00	27 573.25	0.01
AUD BRAMBLES LTD NPV	6 421.00	45 573.63	0.01
AUD CMNWLT BK OF AUST NPV	7 538.00	498 030.23	0.11
AUD COCHLEAR LTD NPV	264.00	40 769.81	0.01
AUD COMPUTERSHARE LTD NPV(POST REC)	1 888.00	25 555.52	0.01
AUD CROWN RESORTS LTD NPV	1 658.00	12 955.17	0.00
AUD CSL NPV	1 935.00	420 919.48	0.09
AUD DOMINOS PIZZA ENT NPV	240.00	22 074.71	0.00
AUD ENDEAVOUR GROUP LI NPV	5 329.00	25 882.91	0.01
AUD EVOLUTION MINING NPV	8 053.00	23 011.22	0.01
AUD FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD NPV	1.00	12.59	0.00
AUD FORTESCUE METALS G NPV	7 112.00	85 777.41	0.02
AUD GOODMAN GROUP (STAPLED SECURITY)	6 724.00	117 713.33	0.03
AUD GPT GROUP NPV (STAPLED SECURITIES)	10 037.00	37 505.19	0.01
AUD IDP EDUCATION LTD NPV	760.00	18 849.95	0.00
AUD INSURANCE AUST GRP NPV	10 088.00	31 687.33	0.01
AUD LEND LEASE GROUP NPV	2 465.00	18 666.59	0.00
AUD MACQUARIE GP LTD NPV	1 441.00	201 017.33	0.05
AUD MAGELLAN FINANCIAL NPV	597.00	14 036.72	0.00
AUD MEDIBANK PRIVATE L NPV	12 345.00	30 198.62	0.01
AUD MIRVAC GROUP STAPLED SECURITIES	21 346.00	43 287.19	0.01
AUD NATL AUSTRALIA BK NPV	13 957.00	270 166.56	0.06
AUD NEWCREST MINING NPV	3 455.00	57 863.51	0.01
AUD NTHN STAR RES LTD NPV	4 496.00	30 093.67	0.01
AUD ORICA LIMITED NPV	1 996.00	20 040.14	0.00
AUD ORIGIN ENERGY NPV	8 872.00	30 195.32	0.01
AUD QANTAS AIRWAYS NPV	4 915.00	17 634.00	0.00
AUD QBE INS GROUP NPV	6 072.00	50 028.19	0.01
AUD RAMSAY HEALTH CARE NPV	705.00	33 402.00	0.01
AUD REA GROUP LIMITED NPV	186.00	21 416.53	0.00
AUD REECE AUSTRALIA NPV	1 160.00	19 262.90	0.00
AUD RIO TINTO LIMITED NPV	1 568.00	103 952.40	0.02
AUD SANTOS LIMITED NPV	8 636.00	39 067.01	0.01
AUD SCENTRE GROUP NPV STAPLED UNIT	22 336.00	48 937.38	0.01
AUD SEEK LIMITED NPV	1 593.00	39 307.18	0.01
AUD SONIC HEALTHCARE NPV	1 845.00	55 860.02	0.01
AUD SOUL PATTINSON(WH) NPV	694.00	15 293.87	0.00
AUD SOUTH32 LTD NPV	22 711.00	56 844.42	0.01
AUD STOCKLAND NPV (STAPLED)	9 530.00	29 529.17	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 (%)
AUD SUNCORP GROUP LTD NPV	5 260.00	40 354.30	0.01
AUD SYDNEY AIRPORT NPV(STAPLED SECURITY)	6 551.00	38 553.39	0.01
AUD TABCORP HLDGS LTD NPV	9 353.00	33 026.09	0.01
AUD TELSTRA CORP NPV	19 872.00	57 347.28	0.01
AUD TRANSURBAN GROUP STAPLED UNITS NPV	12 569.00	121 738.60	0.03
AUD TREASURY WINE ESTA NPV	3 507.00	30 088.32	0.01
AUD VICINITY CENTRES NPV (STAPLED SECURITY)	19 897.00	23 913.01	0.01
AUD WESFARMERS LTD NPV	4 791.00	193 156.75	0.04
AUD WESTPAC BKG CORP NPV	15 351.00	223 352.54	0.05
AUD WISETECH GLOBAL LT NPV	689.00	25 633.46	0.01
AUD WOODSIDE PETROLEUM NPV	4 076.00	61 934.58	0.01
AUD WOOLWORTHS GRP LTD NPV	5 329.00	154 239.49	0.03
オーストラリア合計		4 188 692.93	0.94
オーストリア			
EUR ERSTE GROUP BK AG NPV	1 176.00	51 055.32	0.01
EUR OMV AG NPV(VAR)	579.00	30 611.40	0.01
EUR RAIFFEISEN BK INTL NPV (REGD)	503.00	14 845.16	0.00
EUR VERBUND AG CLASS ' A ' NPV	333.00	34 671.29	0.01
EUR VOESTALPINE AG NPV	579.00	19 473.47	0.00
オーストリア合計		150 656.64	0.03
ベルギー			
EUR ANHEUSER-BUSCH IN NPV	3 230.00	179 075.81	0.04
EUR COLRUYT SA NPV	156.00	7 259.04	0.00
EUR ELIA SYS OPERATOR NPV	159.00	19 668.85	0.00
EUR GPE BRUXELLES LAM NPV	500.00	53 758.66	0.01
EUR PROXIMUS SA NPV	437.00	7 880.03	0.00
EUR SOFINA NPV	63.00	28 989.15	0.01
EUR SOLVAY SA NPV	339.00	37 745.74	0.01
EUR UMICORE NPV	800.00	38 729.64	0.01
ベルギー合計		373 106.92	0.08
カナダ			
CAD AIR CANADA VAR VTG SHS NPV	592.00	9 599.00	0.00
CAD ALGONQUIN PWR&UTIL COM NPV	2 700.00	36 391.49	0.01
CAD ALTAGAS LTD COM NPV	1 302.00	24 663.70	0.01
CAD B2GOLD CORP COM NPV	2 400.00	9 466.79	0.00
CAD BALLARD POWER SYS COM NPV	1 000.00	15 162.15	0.00
CAD CAE INC COM NPV	1 328.00	31 781.73	0.01
CAD CAMECO CORP COM	1 469.00	34 114.06	0.01
CAD CANADIAN UTILS LTD CL A	555.00	14 839.80	0.00
CAD CANOPY GROWTH CORP COM NPV	1 082.00	11 572.37	0.00
CAD EMERA INC COM	996.00	45 568.48	0.01
CAD EMPIRE LTD CL A	831.00	23 728.98	0.01
CAD HYDRO ONE INC COM NPV	1 308.00	31 843.50	0.01
CAD IGM FINANCIAL INC COM	362.00	13 028.95	0.00
CAD IVANHOE MINES LTD COM NPV CL ' A '	2 500.00	19 761.46	0.00
CAD KEYERA CORPORATION COM NPV	1 035.00	22 639.62	0.01
CAD KINROSS GOLD CORP COM NPV	5 974.00	35 300.06	0.01
CAD KIRKLAND LAKE GOLD COM NPV	1 050.00	41 343.55	0.01
CAD LUNDIN MINING CORP COM	2 587.00	20 227.32	0.00
CAD NORTHLAND POWER IN COM NPV	820.00	24 444.03	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 (%)
CAD NUVEI CORPORATION SUB VOTING SHARES (CAD)	200.00	19 611.79	0.00
CAD ONEX CORP SUB VTG	273.00	19 753.55	0.00
CAD PAN AMER SILVER COM NPV	896.00	22 791.14	0.01
CAD QUEBECOR INC CL B	860.00	19 059.71	0.00
CAD RITCHIE BROS AUCTIONEERS COM	452.00	30 552.63	0.01
CAD TELUS CORPORATION NPV	1 713.00	38 992.52	0.01
CAD TFI INTERNATIONAL COM NPV	75.00	7 415.81	0.00
CAD TMX GROUP LTD COM NPV	267.00	25 802.92	0.01
CAD TOROMONT INDS LTD COM	400.00	33 458.06	0.01
CAD TOURMALINE OIL CP COM NPV	232.00	7 688.12	0.00
CAD WEST FRASER TIMBER COM NPV	365.00	29 887.43	0.01
CAD WSP GLOBAL INC COM NPV	476.00	65 934.24	0.01
CAD YAMANA GOLD INC COM	2 364.00	9 398.50	0.00
カナダ合計		795 823.46	0.18
デンマーク			
DKK A.P. MOELLER-MAERSK SER ' B ' DKK1000	26.00	77 817.21	0.02
DKK A.P. MOLLER-MAERSK ' A ' DKK1000	14.00	39 772.07	0.01
DKK AMBU A/S SER ' B ' DKK0.5	792.00	22 271.87	0.01
DKK CHR. HANSEN HLDG DKK10	400.00	29 537.70	0.01
DKK DANSKE BANK A/S DKK10	2 822.00	46 256.34	0.01
DKK DSV PANALPINA A/S DKK1	885.00	191 274.60	0.04
DKK GENMAB AS DKK1 (BEARER)	265.00	101 794.27	0.02
DKK GN STORE NORD DKK4	505.00	28 815.00	0.01
DKK NOVOZYMES A/S SER ' B ' DKK2 (POST CONS)	867.00	65 230.20	0.01
DKK ORSTED A/S DKK10	780.00	99 731.96	0.02
DKK PANDORA A/S DKK1	411.00	50 635.15	0.01
DKK ROCKWOOL INTL SER ' B ' DKK10	34.00	14 058.71	0.00
デンマーク合計		767 195.08	0.17
フィンランド			
EUR KESKO OYJ EUR2 SER ' B '	1 155.00	36 063.89	0.01
EUR KONE CORPORATION NPV ORD ' B '	1 529.00	100 233.51	0.02
EUR WARTSILA OYJ ABP SER ' B ' EUR3.50	1 691.00	23 383.15	0.01
フィンランド合計		159 680.55	0.04
フランス			
EUR ACCOR EUR3	860.00	25 332.98	0.01
EUR ADP EUR3	143.00	16 595.06	0.00
EUR AIR LIQUIDE(L ') EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)	2 019.00	331 388.55	0.07
EUR AIRBUS EUR1	2 487.00	276 353.53	0.06
EUR ALSTOM EUR7.00	1 089.00	38 587.50	0.01
EUR AMUNDI EUR2.5 (AIW)	296.00	24 471.89	0.01
EUR ARKEMA EUR10	327.00	42 549.03	0.01
EUR AXA EUR2.29	8 159.00	223 624.81	0.05
EUR BIOMERIEUX NPV (POST SPLIT)	153.00	21 561.54	0.00
EUR BNP PARIBAS EUR2	4 782.00	296 474.67	0.07
EUR BOLLORE EURO.16	4 344.00	23 157.17	0.00
EUR BOUYGUES EUR1	1 035.00	34 891.63	0.01
EUR BUREAU VERITAS EURO.12	1 216.00	38 269.68	0.01
EUR CAPGEMINI EUR8	710.00	163 111.82	0.04
EUR CARREFOUR EUR2.50	2 540.00	41 798.93	0.01
EUR CIE DE ST-GOBAIN EUR4	2 120.00	134 060.76	0.03

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 (%)
EUR CNP ASSURANCES EUR1	836.00	20 297.40	0.00
EUR COVIVIO EUR3	252.00	20 768.94	0.00
EUR CREDIT AGRICOLE SA EUR3	5 358.00	72 769.62	0.02
EUR DANONE EURO.25	2 617.00	153 146.69	0.03
EUR EDENRED EUR2	1 065.00	47 375.15	0.01
EUR EDF EURO.5	1 879.00	26 204.88	0.01
EUR EIFFAGE EUR4	320.00	29 614.99	0.01
EUR ENGIE EUR1	7 609.00	109 713.68	0.02
EUR ESSILORLUXOTTICA EURO.18	1 223.00	243 687.29	0.05
EUR EURAZEO NPV	214.00	17 427.55	0.00
EUR FAURECIA EUR7	542.00	23 121.85	0.00
EUR GETLINK SE EURO.40	1 723.00	25 309.28	0.01
EUR HERMES INTL NPV	135.00	251 183.27	0.06
EUR IPSEN EUR1	176.00	17 064.82	0.00
EUR KERING EUR4	322.00	246 968.80	0.06
EUR KLEPIERRE EUR1.40	905.00	19 033.82	0.00
EUR L ' OREAL EURO.20	1 072.00	479 640.67	0.11
EUR LEGRAND SA EUR4	1 121.00	122 116.77	0.03
EUR LVMH MOET HENNESSY EURO.30	1 182.00	913 493.29	0.20
EUR ORANGE EUR4	8 215.00	87 937.11	0.02
EUR ORPEA EUR2.5	244.00	22 905.51	0.00
EUR PERNOD RICARD EUR1.55	890.00	202 861.26	0.05
EUR PUBLICIS GROUPE SA EURO.40	945.00	60 779.36	0.01
EUR REMY COINTREAU EUR1.60	113.00	26 328.91	0.01
EUR RENAULT SA EUR3.81	735.00	23 545.41	0.01
EUR SAFRAN EURO.20	1 430.00	158 997.08	0.04
EUR SANOFI EUR2	4 824.00	455 350.94	0.10
EUR SARTORIUS STEDIM B EURO.20 (POST SUBD)	118.00	69 252.77	0.02
EUR SCHNEIDER ELECTRIC EUR8	2 295.00	403 555.63	0.09
EUR SEB SA EUR1	130.00	19 154.34	0.00
EUR SOC GENERALE EUR1.25	3 569.00	110 655.61	0.02
EUR SODEXO EUR4	327.00	27 251.99	0.01
EUR SUEZ EUR4	1 281.00	28 455.78	0.01
EUR TELEPERFORMANCE EUR2.50	258.00	105 329.82	0.02
EUR THALES EUR3	427.00	34 836.15	0.01
EUR TOTALENERGIES SE EUR2.5	10 694.00	488 829.33	0.11
EUR UBISOFT ENTERTAIN EURO.31	344.00	17 544.32	0.00
EUR UNIBAIL-RODAMCO-WE NPV(1 ORD UNIBAIL-R & 1CLS)	565.00	37 013.10	0.01
EUR VALEO EUR1 (POST SUBD)	844.00	24 263.16	0.01
EUR VEOLIA ENVIRONNEME EUR5	2 738.00	87 525.76	0.02
EUR VINCI EUR2.50	2 201.00	207 263.10	0.05
EUR VIVENDI SA EUR5.50	3 154.00	39 939.10	0.01
EUR WENDEL EUR4	130.00	14 793.76	0.00
EUR WORLDLINE EURO.68	1 043.80	54 497.79	0.01
フランス合計		7 380 035.40	1.65
ドイツ			
EUR BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG EUR1	1 389.00	132 862.69	0.03
EUR BECHTLE AG NPV	387.00	27 783.03	0.01
EUR BEIERSDORF AG NPV	408.00	40 514.58	0.01
EUR CARL ZEISS MEDITEC NPV	152.00	30 274.59	0.01
EUR COMMERZBANK AG NPV	4 823.00	33 848.38	0.01
EUR CONTINENTAL AG ORD NPV	473.00	50 419.11	0.01
EUR COVESTRO AG NPV	776.00	43 533.53	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 (%)
EUR FRESENIUS MED CARE NPV	942.00	55 963.44	0.01
EUR FRESENIUS SE & CO. KGAA NPV	1 828.00	68 919.20	0.01
EUR GEA GROUP AG NPV	564.00	28 396.32	0.01
EUR HEIDELBERGCEMENT NPV	619.00	41 205.58	0.01
EUR HELLOFRESH SE NPV	689.00	69 333.13	0.01
EUR HENKEL AG & CO KGAA	435.00	32 095.64	0.01
EUR KION GROUP AG NPV	347.00	37 261.64	0.01
EUR KNORR BREMSE AG NPV	299.00	29 536.01	0.01
EUR LANXESS AG NPV	360.00	20 779.48	0.00
EUR MERCK KGAA NPV	577.00	142 169.25	0.03
EUR NEMETSCHEK SE ORD NPV	274.00	34 480.73	0.01
EUR PUMA SE NPV	391.00	46 981.70	0.01
EUR RATIONAL AG NPV	24.00	21 995.12	0.00
EUR RWE AG (NEU) NPV	2 654.00	102 017.74	0.02
EUR SAP AG ORD NPV	4 435.00	564 998.63	0.13
EUR SYMRISE AG NPV (BR)	556.00	77 916.28	0.02
EUR TEAMVIEWER AG NPV	726.00	9 798.06	0.00
EUR VOLKSWAGEN AG ORD NPV	149.00	41 324.83	0.01
EUR ZALANDO SE NPV	873.00	78 867.39	0.02
ドイツ合計		1 863 276.08	0.42
香港			
HKD AIA GROUP LTD NPV	51 600.00	543 081.26	0.12
HKD BOC HONG KONG HLDG HKD5	18 000.00	54 375.08	0.01
HKD CHOW TAI FOOK JEWELRY HKD1	4 000.00	7 173.05	0.00
HKD CK ASSET HOLDINGS HKD1	10 000.00	57 209.93	0.01
HKD CK HUTCHISON HLDGS HKD1.0	12 000.00	75 193.85	0.02
HKD CK INFRASTRUCTURE HKD1	3 000.00	17 374.63	0.00
HKD CLP HOLDINGS HKD5	7 000.00	68 600.60	0.02
HKD GALAXY ENTERTAINMENT HKD0.10	9 000.00	49 237.74	0.01
HKD HANG LUNG PROP HKD1	9 000.00	17 847.96	0.00
HKD HANG SENG BANK HKD5	3 400.00	60 185.87	0.01
HKD HENDERSON LAND DEV HKD2	6 000.00	24 551.53	0.01
HKD HKT TRUST AND HKT SHARE STAPLED UNIT	12 000.00	16 285.59	0.00
HKD HONG KONG EXCHANGE HKD1	5 100.00	281 303.51	0.06
USD HONGKONG LAND HLD ORD USD0.10(SINGAPORE REG)	4 900.00	26 460.00	0.01
HKD HONGKONG&CHINA GAS HKD0.25	49 350.00	73 684.59	0.02
USD JARDINE MATHESON COM USD0.25(BERMUDA REG)	900.00	50 931.00	0.01
HKD MTR CORP HKD1	7 000.00	37 353.21	0.01
HKD POWER ASSETS HOLDINGS LTD HKD1	6 000.00	36 134.61	0.01
HKD SINO LAND CO HKD1	12 000.00	14 346.09	0.00
HKD SITC INTERNATIONAL HKD0.10	4 000.00	16 034.17	0.00
HKD SUN HUNG KAI PROP NPV	5 500.00	66 881.74	0.02
HKD SWIRE PACIFIC 'A' HKD0.60	2 000.00	11 069.99	0.00
HKD SWIRE PROPERTIES LTD HKD1	5 000.00	11 878.11	0.00
HKD TECHTRONIC INDUSTRIES HKD0.1	6 000.00	123 835.12	0.03
HKD THE LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9 100.00	78 908.65	0.02
HKD WH GROUP LTD USD0.0001	32 826.00	20 590.33	0.01
HKD WHARF REAL ESTATE HKD0.1	7 000.00	35 467.59	0.01
HKD XINYI GLASS HLDGS HKD0.1	8 000.00	19 518.08	0.00
香港合計		1 895 513.88	0.42

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 (%)
アイルランド			
GBP DCC ORD EURO.25	384.00	28 134.81	0.01
EUR FLUTTER ENTERTAINM ORD EURO.09	688.00	92 735.93	0.02
EUR KERRY GROUP 'A' ORD EURO.125(DUBLIN LIST)	661.00	80 800.75	0.02
アイルランド合計		201 671.49	0.05
イスラエル			
ILS AZRIELI GROUP ILS0.01	119.00	10 873.98	0.00
ILS BANK HAPOLIM B.M. ILS1	3 872.00	37 864.03	0.01
ILS BK LEUMI LE ISRAEL ILS1	5 589.00	54 104.55	0.01
USD CHECK POINT SFTWRE ORD ILS0.01	493.00	54 875.83	0.01
USD CYBER-ARK SOFTWARE COM ILS0.01	200.00	34 570.00	0.01
ILS ICL GROUP LTD ILS1	2 657.00	23 292.44	0.00
ILS ISRAEL DISCOUNT BK ILS0.10 SER 'A'	4 129.00	25 384.83	0.01
ILS NICE SYSTEMS ILS1	255.00	72 761.18	0.02
USD WIX.COM LTD COM ILS0.01	300.00	45 840.00	0.01
イスラエル合計		359 566.84	0.08
イタリア			
EUR AMPLIFON EURO.02	593.00	28 781.77	0.01
EUR ASSIC GENERALI SPA EUR1	4 893.00	97 649.05	0.02
EUR DIASORIN SPA EUR1	81.00	17 209.02	0.00
EUR FINECOBANK SPA EURO.33	2 970.00	51 783.57	0.01
EUR INFRASTRUTTURE WIR NPV	1 680.00	19 165.37	0.00
EUR POSTE ITALIANE SPA NPV	2 343.00	29 379.31	0.01
EUR TELECOM ITALIA SPA EURO.55	38 492.00	19 930.23	0.01
イタリア合計		263 898.32	0.06
日本			
JPY アドバンテスト	900.00	79 184.46	0.02
JPY アイシン	700.00	25 707.87	0.01
JPY 朝日インテック	700.00	15 338.41	0.00
JPY アズビル	600.00	26 526.93	0.01
JPY バンダイナムコホールディングス	900.00	70 045.36	0.02
JPY ベネフィット・ワン	200.00	9 370.73	0.00
JPY カブコン	800.00	19 932.19	0.00
JPY 東海旅客鉄道	600.00	82 434.28	0.02
JPY 千葉銀行	3 000.00	17 464.44	0.00
JPY 中外製薬	2 800.00	90 748.16	0.02
JPY コンコルディア・フィナンシャルグループ	4 700.00	17 095.42	0.00
JPY コスモス薬品	100.00	15 509.27	0.00
JPY サイバーエージェント	1 600.00	29 493.15	0.01
JPY 第一生命ホールディングス	4 500.00	90 638.07	0.02
JPY ダイフク	400.00	32 022.55	0.01
JPY 第一三共	7 200.00	179 104.32	0.04
JPY ダイキン工業	1 100.00	224 272.32	0.05
JPY 大東建託	300.00	32 471.71	0.01
JPY 大和ハウス工業	2 400.00	70 090.27	0.02
JPY 大和ハウスリート投資法人	7.00	19 943.63	0.00
JPY ディスコ	100.00	28 711.08	0.01
JPY エーザイ	1 000.00	60 531.07	0.01
JPY ファナック	800.00	156 730.81	0.04
JPY ファーストリテイリング	300.00	178 079.18	0.04
JPY 富士電機	600.00	31 388.44	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 G L P 投資法人	15.00	23 818.75	0.01
JPY G M O ペイメントゲートウェイ	200.00	26 826.37	0.01
JPY 阪急阪神ホールディングス	1 100.00	32 599.41	0.01
JPY 光通信	100.00	14 496.46	0.00
JPY ヒロセ電機	110.00	18 455.24	0.00
JPY ホシザキ	200.00	15 183.41	0.00
JPY ヒューリック	1 300.00	12 319.35	0.00
JPY イビデン	500.00	31 133.03	0.01
JPY 出光興産	892.00	23 025.69	0.01
JPY いすゞ自動車	1 900.00	25 635.65	0.01
JPY 伊藤園	300.00	17 622.97	0.00
JPY 伊藤忠テクノソリューションズ	400.00	13 016.87	0.00
JPY 日本取引所グループ	2 100.00	45 478.89	0.01
JPY かんぽ生命保険	900.00	13 934.56	0.00
JPY ジャパンリアルエステイト投資法人	6.00	34 611.83	0.01
JPY J S R	1 000.00	37 342.02	0.01
JPY 鹿島建設	2 100.00	23 137.08	0.01
JPY カカクコム	400.00	11 184.99	0.00
JPY 関西電力	3 100.00	28 039.10	0.01
JPY 関西ペイント	600.00	13 474.83	0.00
JPY 花王	2 000.00	101 933.15	0.02
JPY 京王電鉄	500.00	22 502.09	0.01
JPY 京成電鉄	700.00	19 173.02	0.00
JPY キッコーマン	700.00	53 388.52	0.01
JPY 近鉄グループホールディングス	800.00	22 968.87	0.01
JPY キリンホールディングス	3 500.00	56 008.63	0.01
JPY 小林製薬	200.00	15 711.83	0.00
JPY 神戸物産	600.00	22 616.58	0.01
JPY コーエーテックモホールディングス	260.00	10 888.19	0.00
JPY 小糸製作所	500.00	28 755.12	0.01
JPY 小松製作所	3 800.00	86 746.22	0.02
JPY コーセー	100.00	12 039.28	0.00
JPY 栗田工業	500.00	23 338.76	0.01
JPY レーザーテック	300.00	78 589.99	0.02
JPY ライオン	1 100.00	15 607.03	0.00
JPY エムスリー	1 900.00	102 392.00	0.02
JPY マキタ	900.00	39 505.04	0.01
JPY 日本マクドナルドホールディングス	200.00	8 895.15	0.00
JPY 明治ホールディングス	500.00	29 327.58	0.01
JPY ミネベアミツミ	1 600.00	42 273.99	0.01
JPY ミスミグループ本社	1 300.00	54 784.45	0.01
JPY 三菱瓦斯化学	600.00	9 981.95	0.00
JPY 三菱H C キャピタル	2 000.00	9 405.96	0.00
JPY 三井化学	800.00	21 454.05	0.01
JPY 三井不動産	3 700.00	76 121.36	0.02
JPY 三浦工業	500.00	17 548.11	0.00
JPY M o n o t a R O	1 200.00	23 842.53	0.01
JPY 日本電産	1 900.00	217 534.90	0.05
JPY 日本M & A センター	1 400.00	41 120.26	0.01
JPY 日本ビルファンド投資法人	7.00	43 154.70	0.01
JPY 日本通運	300.00	17 094.54	0.00
JPY 日本ペイントホールディングス	3 000.00	31 520.54	0.01
JPY 日本酸素ホールディングス	700.00	14 814.39	0.00
JPY 日本新薬	200.00	14 795.90	0.00

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 日本製鉄	3 400.00	50 889.96	0.01
JPY 日産化学	600.00	34 558.99	0.01
JPY 日清製粉グループ本社	1 000.00	14 408.38	0.00
JPY 日清食品ホールディングス	300.00	22 035.32	0.01
JPY ニトリホールディングス	300.00	47 637.50	0.01
JPY 日東電工	700.00	48 703.16	0.01
JPY 野村不動産ホールディングス	400.00	8 683.78	0.00
JPY 大林組	2 700.00	19 879.34	0.00
JPY オービック	300.00	55 458.19	0.01
JPY 小田急電鉄	1 100.00	21 187.19	0.00
JPY 王子ホールディングス	4 100.00	18 957.24	0.00
JPY オリンパス	4 800.00	107 333.66	0.02
JPY 小野薬品工業	1 400.00	30 892.60	0.01
JPY オープンハウス	200.00	11 343.52	0.00
JPY 日本オラクル	100.00	9 828.70	0.00
JPY オリエンタルランド	800.00	125 694.66	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	1 600.00	27 280.81	0.01
JPY パーソルホールディングス	800.00	23 109.78	0.01
JPY ポーラ・オルビスホールディングス	400.00	7 123.17	0.00
JPY 楽天グループ	3 400.00	34 765.07	0.01
JPY リクルートホールディングス	5 800.00	352 510.46	0.08
JPY リンナイ	100.00	9 441.19	0.00
JPY 良品計画	1 000.00	16 160.99	0.00
JPY S B I ホールディングス	900.00	23 176.71	0.01
JPY S C S K	600.00	11 387.56	0.00
JPY セコム	900.00	60 747.72	0.01
JPY 積水ハウス	2 500.00	48 659.12	0.01
JPY シャープ	1 000.00	11 184.99	0.00
JPY シマノ	300.00	82 962.70	0.02
JPY 清水建設	2 800.00	17 681.10	0.00
JPY 信越化学工業	1 500.00	251 001.81	0.06
JPY 塩野義製薬	1 200.00	83 734.20	0.02
JPY 資生堂	1 700.00	97 363.16	0.02
JPY 静岡銀行	1 700.00	11 977.63	0.00
JPY S M C	200.00	127 966.89	0.03
JPY スクウェア・エニックス・ホールディングス	400.00	20 890.40	0.00
JPY スタンレー電気	700.00	18 198.95	0.00
JPY 住友金属鉱山	900.00	33 552.34	0.01
JPY サントリー食品インターナショナル	700.00	24 690.65	0.01
JPY スズキ	1 600.00	64 608.75	0.01
JPY シスメックス	700.00	87 295.79	0.02
JPY T & D ホールディングス	2 500.00	29 547.76	0.01
JPY 大成建設	900.00	26 236.29	0.01
JPY 大正製薬ホールディングス	200.00	9 828.70	0.00
JPY テルモ	2 700.00	110 049.76	0.02
JPY T I S	1 100.00	34 004.14	0.01
JPY 東武鉄道	900.00	20 331.15	0.00
JPY 東宝	500.00	22 237.88	0.01
JPY 東京センチュリー	200.00	9 546.88	0.00
JPY 東京瓦斯	1 400.00	23 981.68	0.01
JPY 東急	2 100.00	29 055.44	0.01
JPY 東レ	5 200.00	30 262.54	0.01
JPY 東ソー	1 100.00	15 800.78	0.00

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 T O T O	500.00	22 149.81	0.01
JPY 東洋水産	400.00	16 205.03	0.00
JPY 豊田自動織機	600.00	49 249.20	0.01
JPY 豊田通商	1 000.00	43 639.09	0.01
JPY ツルハホールディングス	200.00	22 546.13	0.01
JPY ユー・エス・エス	1 000.00	14 672.60	0.00
JPY ウエルシアホールディングス	400.00	14 179.40	0.00
JPY ヤクルト本社	600.00	29 961.69	0.01
JPY ヤマハ	700.00	35 880.05	0.01
JPY ヤマトホールディングス	1 400.00	30 874.10	0.01
JPY Z O Z O	540.00	17 192.30	0.00
日本合計		6 282 401.83	1.41
ルクセンブルグ			
EUR AROUNDTOWN SA EURO.01	3 989.00	23 797.10	0.01
ルクセンブルグ合計		23 797.10	0.01
マカオ			
HKD SANDS CHINA LTD USD0.01 REG ' S '	10 000.00	22 986.59	0.00
マカオ合計		22 986.59	0.00
オランダ			
EUR AKZO NOBEL NV EURO.50(POST REV SPLIT)	788.00	82 417.51	0.02
EUR ARGEN X NV EURO.10	188.00	52 268.37	0.01
EUR ASM INTL NV EURO.04	207.00	92 454.08	0.02
EUR EURONEXT EUR1.60	153.00	14 957.03	0.00
EUR EXOR NV EURO.01	435.00	38 044.72	0.01
EUR HEINEKEN HOLDING EUR1.6	510.00	42 221.82	0.01
EUR HEINEKEN NV EUR1.60	1 082.00	107 102.06	0.03
EUR ING GROEP N.V. EURO.01	16 607.00	228 202.19	0.05
EUR JUST EAT TAKEAWAY EURO.04	757.00	47 026.25	0.01
EUR KON KPN NV EURO.04	15 489.00	45 346.92	0.01
EUR KONINKLIJKE AHOLD EURO.01	4 322.00	144 242.60	0.03
EUR KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20	3 978.00	139 679.88	0.03
EUR QIAGEN NV EURO.01	959.00	52 893.07	0.01
EUR RANDSTAD N.V. EURO.10	475.00	29 791.26	0.01
GBP ROYAL DUTCH SHELL ' B ' SHS EURO.07 (UK LIST)	15 709.00	327 831.16	0.07
EUR STMICROELECTRONICS EUR1.04	2 831.00	137 420.99	0.03
EUR VOPAK(KON) EURO.50	373.00	14 090.13	0.00
EUR WOLTERS KLUWER EURO.12	1 098.00	122 676.31	0.03
オランダ合計		1 718 666.35	0.38
ニュージーランド			
NZD AUCKLAND INTL NPV	5 032.00	26 980.23	0.01
NZD FISHER & PAYKEL HE NPV	2 627.00	59 425.55	0.01
NZD MERCURY NZ LTD NPV	1 827.00	7 464.71	0.00
NZD MERIDIAN ENERGY LT NPV	5 143.00	16 580.13	0.01
NZD RYMAN HEALTHCARE G NPV	1 857.00	15 502.25	0.00
NZD SPARK NEW ZEALAND NPV	6 397.00	19 971.56	0.01
AUD XERO LIMITED NPV	586.00	60 181.50	0.01
ニュージーランド合計		206 105.93	0.05

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 (%)
ノルウェー			
NOK GJENSIDIGE FORSIKR NOK2	693.00	15 622.51	0.00
NOK ORKLA ASA NOK1.25	3 082.00	28 014.65	0.01
NOK SCHIBSTED ASA SER ' A ' NOK0.50	295.00	13 090.10	0.00
NOK SCHIBSTED ASA SER ' B ' NOK0.5	385.00	14 763.89	0.00
NOK YARA INTERNATIONAL NOK1.7	782.00	38 244.52	0.01
ノルウェー合計		109 735.67	0.02
パプアニューギニア			
AUD OIL SEARCH LTD PGK0.10	7 530.00	20 342.15	0.00
パプアニューギニア合計		20 342.15	0.00
ポーランド			
EUR INPOST S.A. EURO.01	862.00	9 542.58	0.00
ポーランド合計		9 542.58	0.00
シンガポール			
SGD CITY DEVELOPMENTS SGD0.50	2 700.00	13 823.43	0.00
SGD DBS GROUP HLDGS SGD1	7 700.00	167 741.68	0.04
SGD KEPPEL CORP NPV	6 400.00	23 804.84	0.01
SGD MAPLETREE LOGISTICS TRUST-UNITS REIT	8 300.00	11 259.16	0.00
SGD OVERSEA-CHINESE BK NPV	15 414.00	123 433.41	0.03
SGD SINGAPORE AIRLINES NPV	7 100.00	25 217.52	0.01
SGD SINGAPORE EXCHANGE SGD0.01	3 800.00	24 748.57	0.01
SGD SINGAPORE TECH ENG NPV	7 500.00	20 840.17	0.00
SGD UOL GROUP LIMITED SGD1	1 900.00	9 533.60	0.00
SGD UTD O/S BANK SGD1	5 000.00	92 878.24	0.02
SGD VENTURE CORP LTD SGD0.25	1 400.00	18 899.46	0.00
SGD WILMAR INTERNATIONAL LTD	9 100.00	27 277.10	0.01
シンガポール合計		559 457.18	0.13
スペイン			
EUR ACS ACTIVIDADES CO EURO.5	1 088.00	25 974.89	0.01
EUR AENA SME S.A. EUR10	276.00	40 231.20	0.01
EUR AMADEUS IT GROUP EURO.01	1 894.00	120 408.94	0.03
EUR CAIXABANK SA EUR1	16 920.00	43 308.68	0.01
EUR CELLNEX TELECOM SA EURO.25	2 060.00	120 667.02	0.03
EUR EDP RENOVAVEIS SA EUR5	1 087.00	27 676.19	0.01
EUR ENAGAS SA EUR1.50	1 203.00	27 203.80	0.01
EUR ENDESA SA EUR1.2	1 558.00	34 784.34	0.01
EUR FERROVIAL SA EURO.2	2 115.00	58 468.62	0.01
EUR GRIFOLS SA EURO.25 (CLASS A) POST SUBD	1 202.00	21 417.54	0.00
EUR IBERDROLA SA EURO.75 (POST SUBDIVISION)	25 861.00	288 296.93	0.06
EUR INDITEX EURO.03 (POST SUBD)	4 692.00	147 137.44	0.03
EUR RED ELECTRICA CORP EURO.5	1 703.00	35 913.07	0.01
EUR REPSOL SA EUR1	5 937.00	65 430.19	0.01
EUR SIEMENS GAMESA REN EURO.17	906.00	23 995.74	0.00
EUR TELEFONICA SA EUR1	21 852.00	98 300.36	0.02
スペイン合計		1 179 214.95	0.26
スウェーデン			
SEK ASSA ABLOY SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	4 175.00	116 765.84	0.03
SEK ESSITY AB SER ' B ' NPV	2 641.00	83 932.74	0.02
SEK FASTIGHETS AB BALD SER ' B ' NPV	467.00	34 839.61	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 (%)
SEK HUSQVARNA AB SER ' B ' NPV	1 827.00	25 639.24	0.01
SEK ICA GRUPPEN AB	472.00	27 774.80	0.01
SEK INDUSTRIVARDEN AB SER ' C ' NPV	722.00	21 235.06	0.00
SEK INDUSTRIVARDEN AB SER ' A ' NPV	541.00	16 024.86	0.00
SEK LATOUR INVESTMENT SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	671.00	25 228.96	0.00
SEK LUNDBERGFÖRETAGEN SER ' B ' NPV	330.00	18 040.60	0.00
SEK LUNDIN ENERGY AB NPV	890.00	31 334.92	0.01
SEK SECURITAS SER ' B ' NPV	1 369.00	19 702.18	0.00
SEK SINCH AB NPV (POST SPLIT)	2 250.00	30 038.18	0.01
SEK SKANSKA AB SER ' B ' NPV	1 533.00	35 222.16	0.01
SEK SVENSKA CELLULOSA SER ' B ' NPV	2 379.00	38 655.11	0.01
SEK SVENSKA HANDELSBKN SER ' A ' NPV (P/S)	6 695.00	70 707.44	0.02
SEK TELIA COMPANY AB NPV	10 388.00	39 962.21	0.01
SEK VOLVO AB SER ' A ' NPV (POST SPLIT)	741.00	16 135.14	0.00
スウェーデン合計		651 239.05	0.15
スイス			
GBP GLENCORE XSTRATA ORD USD0.01	42 622.00	201 364.78	0.04
CHF SWATCH GROUP CHF2.25(BR)	138.00	40 472.44	0.01
CHF SWISS RE AG CHF0.10	1 254.00	117 133.95	0.03
CHF VIFOR PHARMA AG CHF0.01	214.00	23 865.14	0.01
スイス合計		382 836.31	0.09
イギリス			
GBP 3I GROUP ORD GBP0.738636	4 117.00	75 546.99	0.02
GBP ASTRAZENECA ORD USD0.25	6 528.00	714 760.38	0.16
GBP AVEVA GROUP ORD GBP0.03556	551.00	23 378.16	0.01
GBP AVIVA ORD GBP0.25	16 964.00	86 406.98	0.02
GBP BAE SYSTEMS ORD GBP0.025	14 301.00	103 720.66	0.02
GBP BARRATT DEVEL ORD GBP0.10	4 072.00	37 570.73	0.01
GBP BRIT AMER TOBACCO ORD GBP0.25	9 509.00	318 284.30	0.07
GBP BRITISH LAND CO PLC REIT	3 221.00	21 681.92	0.00
GBP BT GROUP ORD GBP0.05	39 106.00	82 055.26	0.02
USD COCA-COLA EUROPACI COM EURO.01	867.00	42 803.79	0.01
GBP EVRAZ PLC ORD USD1	2 556.00	19 477.95	0.00
GBP HALMA ORD GBP0.10	1 602.00	63 604.57	0.01
GBP HIKMA PHARMACEUTIC ORD GBP0.10	580.00	16 996.58	0.00
GBP INFORMA PLC (GB) ORD GBP0.001	6 136.00	37 910.72	0.01
GBP JOHNSON MATTHEY ORD GBP1.109245	742.00	20 575.72	0.00
GBP KINGFISHER ORD GBP0.157142857	8 627.00	36 158.04	0.01
GBP LAND SECURITIES GP ORD GBP0.106666666	2 636.00	25 353.60	0.01
GBP LLOYDS BANKING GP ORD GBP0.1	301 071.00	186 412.33	0.04
GBP NATIONAL GRID ORD GBP0.12431289	15 042.00	200 319.09	0.05
GBP OCADO GROUP PLC ORD GBP0.02	2 106.00	50 026.90	0.01
GBP RECKITT BENCK GRP ORD GBP0.10	3 047.00	246 305.16	0.06
GBP RELX PLC GBP0.1444	8 262.00	255 448.73	0.06
GBP RENTOKIL INITIAL ORD GBP0.01	7 854.00	63 758.20	0.01
GBP ROLLS-ROYCE HLDGS ORD GBP0.20	35 423.00	57 409.18	0.01
GBP SAGE GROUP GBP0.01051948	4 338.00	44 294.94	0.01
GBP SEVERN TRENT ORD GBP0.9789	924.00	35 279.96	0.01
GBP SMITHS GROUP ORD GBP0.375	1 843.00	35 160.13	0.01
GBP SPIRAX-SARCO ENG ORD GBP0.269230769	314.00	64 930.46	0.01
GBP SSE PLC ORD GBP0.50	4 754.00	97 613.69	0.02

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 (%)
GBP ST JAMES ' S PLACE ORD GBP0.15	2 538.00	51 995.13	0.01
GBP UNITED UTILITIES G ORD GBP0.05	2 694.00	38 653.34	0.01
GBP WHITBREAD ORD GBP0.76797385	961.00	35 637.43	0.01
GBP WPP PLC ORD GBP0.10	5 298.00	73 036.43	0.02
イギリス合計		3 262 567.45	0.73
無記名株式合計		32 828 010.73	7.35
参加証券			
スイス			
CHF LINDT & SPRUENGLI PTG CERT CHF10	9.00	109 995.68	0.03
CHF SCHINDLER-HLDG AG PTG CERT CHF0.10(POST-SUBD)	202.00	51 733.30	0.01
スイス合計		161 728.98	0.04
参加証券合計		161 728.98	0.04
その他の株式			
スイス			
CHF ROCHE HLDGS AG GENUSSSCHEINE NPV	3 140.00	1 220 338.23	0.27
スイス合計		1 220 338.23	0.27
その他の株式合計		1 220 338.23	0.27
優先株式			
ドイツ			
EUR BAYERISCHE MOTORENWERKE AG EUR1	207.00	16 170.14	0.01
EUR FUCHS PETROLUB SE PRF NPV (REG)	327.00	14 575.62	0.00
EUR HENKEL AG&CO. KGAA NON-VTG PRF NPV	798.00	62 606.55	0.02
EUR PORSCHE AUTO HL SE NON VTG PRF NPV	654.00	54 607.04	0.01
EUR SARTORIUS AG NON VTG PRF NPV	128.00	87 454.62	0.02
EUR VOLKSWAGEN AG NON VTG PRF NPV	788.00	143 388.02	0.03
ドイツ合計		378 801.99	0.09
優先株式合計		378 801.99	0.09
記名株式			
オーストラリア			
AUD AMPOL LTD NPV	800.00	16 262.77	0.00
AUD BHP GROUP LTD NPV	12 512.00	349 276.21	0.08
GBP BHP GROUP PLC ORD USD0.50	9 040.00	247 151.75	0.05
AUD COLES GROUP LTD NPV	5 621.00	71 819.97	0.02
オーストラリア合計		684 510.70	0.15
ベルギー			
EUR AGEAS NPV	737.00	37 853.15	0.01
EUR KBC GROUP NV NPV	1 067.00	88 899.15	0.02
EUR UCB NPV	525.00	56 812.97	0.01
ベルギー合計		183 565.27	0.04

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 (%)
カナダ			
CAD 1ST QUANTUM MINLS COM NPV	2 453.00	52 069.84	0.01
CAD AGNICO EAGLE MINES LTD COM	1 026.00	50 932.09	0.01
CAD ALIMENTATION COUCHE TARD INC SUB VTG SH	3 588.00	130 899.91	0.03
CAD BANK NOVA SCOTIA HALIFAX COM	5 165.00	321 222.09	0.07
CAD BANK OF MONTREAL COM NPV	2 863.00	296 923.55	0.07
CAD BARRICK GOLD CORP COM NPV	7 574.00	143 355.72	0.03
CAD BCE INC COM NEW	574.00	28 767.12	0.01
CAD BLACKBERRY LTD NPV	2 631.00	24 960.45	0.01
CAD BROOKFIELD ASSET M LTD VTG SHS NPV CL ' A '	5 450.50	303 117.14	0.07
CAD CAN PACIFIC RYS COM NPV	2 850.00	198 620.21	0.04
CAD CANADIAN NAT RES LTD COM	5 004.00	203 779.98	0.05
CAD CANADIAN NATL RY CO COM	3 001.00	378 657.51	0.08
CAD CANADIAN TIRE LTD CL A	230.00	30 272.22	0.01
CAD CCL INDUSTRIES INC ' B ' NON-VTG COM NPV	611.00	29 859.36	0.01
CAD CDN IMPERIAL BK OF COMMERCE COM	1 902.00	211 209.78	0.05
CAD CENOVUS ENERGY INC COM NPV	6 360.00	75 161.83	0.02
CAD CGI INC COM NPV SUB VOTING SHARES C	1 002.00	83 359.40	0.02
CAD CONSTELLATION SOFT COM STK NPV	94.00	159 281.93	0.04
CAD DOLLARAMA INC COM NPV	1 239.00	53 295.93	0.01
CAD ENBRIDGE INC COM NPV	8 613.00	321 812.51	0.07
CAD FAIRFAX FINL HLDGS SUB-VTG COM NPV	116.00	51 267.70	0.01
CAD FIRSTSERVICE CORP COM NPV	200.00	38 281.88	0.01
CAD FORTIS INC COM NPV	1 986.00	85 552.19	0.02
CAD FRANCO NEVADA CORP COM NPV	799.00	109 111.96	0.02
CAD GFL ENVIRON INC COM NPV SUB VTG SHS	700.00	26 863.89	0.01
CAD GILDAN ACTIVEWEAR INC COM	719.00	29 005.50	0.01
CAD GREAT WEST LIFECO INC COM	1 026.00	29 657.06	0.01
CAD IA FINANCIAL CORP COM NPV	383.00	20 266.64	0.00
CAD IMPERIAL OIL LTD COM NEW	952.00	31 340.01	0.01
CAD INTACT FINL CORP COM NPV	633.00	78 221.98	0.02
CAD LIGHTSPEED COMMERC COM NPV SUB VTG SHS	400.00	20 149.67	0.00
CAD LOBLAW COS LTD COM	668.00	50 146.87	0.01
CAD MAGNA INTL INC COM NPV	1 261.00	94 122.82	0.02
CAD MANULIFE FINL CORP COM	8 210.00	146 177.42	0.03
CAD METRO INC CL A SUB	1 008.00	47 901.22	0.01
CAD NATL BK OF CANADA COM NPV	1 483.00	114 762.56	0.03
CAD NUTRIEN LTD NPV	2 395.00	158 098.38	0.03
CAD OPEN TEXT CO COM NPV	1 148.00	54 196.20	0.01
CAD PARKLAND CORP. COM NPV	700.00	17 996.57	0.00
CAD PEMBINA PIPELINE C COM NPV	2 334.00	68 775.49	0.01
CAD POWER CORP CDA COM	2 360.00	75 815.09	0.02
CAD RESTAURANT BRANDS COM NPV	1 248.00	69 531.15	0.02
CAD ROGERS COMMS INC CLASS ' B ' COM CAD1.62478	1 550.00	69 066.11	0.02
CAD ROYAL BK OF CANADA COM NPV	6 063.00	596 941.77	0.13
CAD SAPUTO INC COM	966.00	21 295.98	0.00
CAD SHAW COMMUNICATIONS INC CL B CONV	1 952.00	56 301.84	0.01
CAD SHOPIFY INC COM NPV CL A	482.00	729 323.71	0.16
CAD SUN LIFE FINL INC COM	2 565.00	135 628.27	0.03
CAD SUNCOR ENERGY INC COM NPV ' NEW '	6 793.00	164 794.32	0.04
CAD TC ENERGY CORPORAT COM NPV	3 994.00	186 561.02	0.04
CAD TECK RESOURCES LTD CLASS ' B ' SUB-VTG COM NPV	1 954.00	51 607.05	0.01
CAD THOMSON-REUTERS CP COM NPV(POST REV SPLIT)	731.00	87 101.15	0.02
CAD TORONTO-DOMINION COM NPV	7 734.00	543 514.27	0.12

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 (%)
CAD WESTON GEORGE LTD COM	288.00	30 268.29	0.01
CAD WHEATON PRECIOUS M COM NPV	1 934.00	80 538.10	0.02
カナダ合計		7 267 742.70	1.63
デンマーク			
DKK CARLSBERG SER ' B ' DKK20	449.00	69 315.82	0.02
DKK COLOPLAST DKK1 B	514.00	83 473.51	0.02
DKK DEMANT A/S DKK0.20	491.00	23 312.12	0.00
DKK NOVO-NORDISK AS DKK0.2 SER ' B '	7 252.00	773 477.88	0.17
DKK TRYG A/S DKK5	1 484.00	35 700.99	0.01
DKK VESTAS WIND SYSTEM DKK0.20 (POST SPLIT)	4 379.00	145 808.71	0.03
デンマーク合計		1 131 089.03	0.25
フィンランド			
EUR ELISA OYJ NPV	587.00	34 992.11	0.01
EUR FORTUM OYJ EUR3.40	1 874.00	53 599.20	0.01
EUR NESTE OIL OYJ NPV	1 756.00	82 560.64	0.02
EUR NOKIA OYJ NPV	23 718.00	131 202.31	0.03
SEK NORDEA HOLDING ABP NPV	13 874.00	163 772.12	0.04
EUR ORION CORP SER ' B ' NPV	527.00	21 526.91	0.00
EUR SAMPO PLC SER ' A ' NPV	2 116.00	103 344.98	0.02
EUR STORA ENSO OYJ NPV SER ' R '	2 452.00	41 330.57	0.01
EUR UPM-KYMMENE CORP NPV	2 408.00	86 869.76	0.02
フィンランド合計		719 198.60	0.16
フランス			
EUR DASSAULT AVIATION EURO0.80 (POST SUBDIVISION)	120.00	11 292.02	0.00
EUR DASSAULT SYSTEMES EURO0.10	2 720.00	162 848.21	0.04
EUR GECINA EUR7.50	188.00	25 266.57	0.01
EUR LA FRANCAISE DES EURO0.40 (PROMESSES)	423.00	19 473.67	0.00
EUR MICHELIN (CGDE) EUR2	762.00	111 930.79	0.02
フランス合計		330 811.26	0.07
ドイツ			
EUR ADIDAS AG NPV (REGD)	810.00	232 994.13	0.05
EUR ALLIANZ SE NPV(REGD)(VINKULIERT)	1 746.00	378 201.87	0.08
EUR BASF SE NPV	3 903.00	254 279.39	0.06
EUR BAYER AG NPV (REGD)	4 176.00	209 266.51	0.05
EUR BRENNTAG AG	669.00	57 004.10	0.01
EUR DAIMLER AG ORD NPV(REGD)	3 635.00	339 599.15	0.08
EUR DELIVERY HERO SE NPV	663.00	87 836.31	0.02
EUR DEUTSCHE BANK AG NPV(REGD)	8 784.00	105 398.30	0.02
EUR DEUTSCHE BOERSE AG NPV(REGD)	810.00	126 366.61	0.03
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA ORD NPV (REGD)(VINK)	3 000.00	18 103.02	0.00
EUR DEUTSCHE POST AG NPV(REGD)	4 206.00	246 987.05	0.05
EUR DEUTSCHE TELEKOM NPV(REGD)	14 167.00	248 572.10	0.06
EUR E.ON SE NPV	9 398.00	115 240.97	0.03
EUR EVONIK INDUSTRIES NPV	938.00	28 095.18	0.01
EUR HANNOVER RUECKVERS ORD NPV(REGD)	292.00	50 829.62	0.01
EUR INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)	5 547.00	249 311.07	0.06
EUR LEG IMMOBILIEN SE NPV	292.00	40 591.39	0.01
EUR MTU AERO ENGINES H NPV (REGD)	223.00	41 403.90	0.01
EUR MUENCHENER RUECKVE NPV(REGD)	590.00	158 289.19	0.03
EUR SCOUT24 AG NPV	390.00	25 724.46	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 (%)
EUR SIEMENS AG NPV(REGD)	3 253.00	517 307.57	0.12
EUR SIEMENS ENERGY AG NPV	1 724.00	45 486.13	0.01
EUR SIEMENS HEALTHINEE NPV	1 146.00	82 968.79	0.02
EUR TELEFONICA DEUTSCH NPV	5 416.00	14 374.96	0.00
EUR UNIPER SE NPV	500.00	21 622.78	0.00
EUR UNITED INTERNET AG NPV(REGD)	509.00	18 992.64	0.00
EUR VITESCO TECHNOLOGI NPV	95.00	4 191.73	0.00
EUR VONOVIA SE NPV	2 376.00	131 046.85	0.03
ドイツ合計		3 850 085.77	0.86
香港			
HKD BUDWEISER BREWING USD0.00001	7 900.00	20 064.52	0.00
HKD ESR CAYMAN LIMITED USD0.001	7 600.00	25 151.84	0.01
HKD NEW WORLD DEVEL CO NPV POST CON	7 000.00	27 655.74	0.01
香港合計		72 872.10	0.02
アイルランド			
EUR CRH ORD EURO.32	3 355.00	162 082.57	0.03
GBP EXPERIAN ORD USD0.10	3 840.00	171 714.82	0.04
EUR KINGSPAN GROUP ORD EURO.13(DUBLIN LISTING)	697.00	80 180.32	0.02
EUR SMURFIT KAPPA GRP ORD EURO.001	1 055.00	53 461.61	0.01
アイルランド合計		467 439.32	0.10
マン島			
GBP ENTAIN PLC ORD EURO.01	2 410.00	53 214.90	0.01
マン島合計		53 214.90	0.01
イスラエル			
USD FIVERR INTERNATIONAL COM NPV	46.00	6 514.52	0.00
ILS MIZRAHI TEFAHOT BK ILS0.01	449.00	16 602.45	0.01
イスラエル合計		23 116.97	0.01
イタリア			
EUR ATLANTIA SPA EUR1	1 963.00	35 640.09	0.01
EUR DAVIDE CAMPARI MIL EURO.01	2 156.00	31 232.83	0.01
EUR ENEL EUR1	34 701.00	261 971.71	0.06
EUR ENI SPA EUR1	10 544.00	138 171.06	0.03
EUR FERRARI NV EURO.01(NEW)	523.00	136 399.19	0.03
EUR INTESA SANPAOLO NPV	70 718.00	168 394.18	0.04
EUR MEDIOBANCA SPA EURO.5	2 868.00	31 539.72	0.01
EUR MONCLER SPA NPV	824.00	59 433.84	0.01
EUR NEXI SPA NPV	1 678.00	25 602.09	0.00
EUR PRYSMIAN SPA EURO.10	928.00	34 251.02	0.01
EUR RECORDATI EURO.125	498.00	31 076.83	0.01
EUR SNAM EUR1	8 173.00	45 758.45	0.01
EUR TERNA SPA ORD EURO.22	5 594.00	41 406.48	0.01
EUR UNICREDIT SPA NPV (POST REV SPLIT)	9 320.00	112 144.43	0.02
イタリア合計		1 153 021.92	0.26
日本			
JPY イオン	2 800.00	65 212.91	0.01
JPY A G C	900.00	43 991.37	0.01
JPY 味の素	1 800.00	54 010.30	0.01
JPY A N Aホールディングス	600.00	11 834.07	0.00

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 アサヒグループホールディングス	2 000.00	73 873.79	0.02
JPY 旭化成	5 200.00	49 071.29	0.01
JPY アステラス製薬	7 800.00	122 243.16	0.03
JPY ブリヂストン	2 200.00	89 224.54	0.02
JPY ブラザー工業	1 100.00	18 929.94	0.00
JPY キヤノン	4 400.00	96 877.89	0.02
JPY 中部電力	3 000.00	30 278.74	0.01
JPY 大日本印刷	1 200.00	28 143.91	0.01
JPY 大和証券グループ本社	6 600.00	36 672.16	0.01
JPY デンソー	1 900.00	139 406.40	0.03
JPY 電通グループ	900.00	28 614.21	0.01
JPY 東日本旅客鉄道	1 300.00	79 984.15	0.02
JPY E N E O S ホールディングス	13 000.00	48 475.93	0.01
JPY 富士フイルムホールディングス	1 600.00	125 849.66	0.03
JPY 富士通	800.00	132 423.27	0.03
JPY 博報堂D Y ホールディングス	900.00	13 419.35	0.00
JPY 浜松ホトニクス	700.00	43 031.40	0.01
JPY 日野自動車	1 100.00	9 145.27	0.00
JPY 日立建機	600.00	17 438.02	0.00
JPY 日立金属	1 000.00	18 512.48	0.00
JPY 日立製作所	4 100.00	241 497.20	0.05
JPY 本田技研工業	6 900.00	188 444.23	0.04
JPY H O Y A	1 600.00	253 925.76	0.06
JPY 飯田グループホールディングス	600.00	12 407.42	0.00
JPY I N P E X	4 200.00	34 659.39	0.01
JPY 伊藤忠商事	5 000.00	143 555.42	0.03
JPY 日本航空	200.00	3 621.47	0.00
JPY 日本都市ファンド投資法人	26.00	22 394.65	0.01
JPY ゆうちょ銀行	1 400.00	11 442.16	0.00
JPY 日本郵政	9 300.00	70 111.41	0.02
JPY 日本たばこ産業	4 900.00	98 112.20	0.02
JPY ジェイ エフ イー ホールディングス	2 000.00	23 180.24	0.01
JPY K D D I	6 900.00	200 537.23	0.04
JPY キーエンス	800.00	495 521.60	0.11
JPY コナミホールディングス	400.00	20 467.66	0.00
JPY クボタ	4 500.00	93 887.89	0.02
JPY 京セラ	1 400.00	82 992.65	0.02
JPY 協和キリン	1 300.00	36 293.98	0.01
JPY ローソン	200.00	9 758.25	0.00
JPY L I X I L	1 200.00	29 475.54	0.01
JPY 丸紅	6 800.00	60 936.19	0.01
JPY マツダ	1 900.00	15 361.31	0.00
JPY メディカルホールディングス	700.00	12 576.51	0.00
JPY メルカリ	400.00	24 272.31	0.01
JPY 三菱ケミカルホールディングス	5 800.00	45 574.53	0.01
JPY 三菱商事	5 600.00	167 242.94	0.04
JPY 三菱電機	7 500.00	94 092.65	0.02
JPY 三菱地所	5 100.00	70 293.72	0.02
JPY 三菱重工業	1 200.00	27 065.92	0.01
JPY 三菱U F J フィナンシャル・グループ	51 800.00	274 362.76	0.06
JPY 三井物産	6 400.00	144 126.12	0.03
JPY みずほフィナンシャルグループ	9 940.00	122 734.42	0.03
JPY M S & A D インシュアランスグループホールディングス	1 800.00	52 567.70	0.01
JPY 村田製作所	2 400.00	177 128.01	0.04

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 日本電気	1 100.00	49 601.48	0.01
JPY ネクソン	2 100.00	41 687.44	0.01
JPY 日本碍子	1 000.00	15 826.32	0.00
JPY 任天堂	500.00	220 617.38	0.05
JPY 日本プロロジスリート投資法人	10.00	32 542.16	0.01
JPY 日本電信電話	5 400.00	148 619.49	0.03
JPY 日本郵船	600.00	39 103.44	0.01
JPY 日産自動車	9 700.00	48 087.81	0.01
JPY 野村ホールディングス	13 200.00	55 499.41	0.01
JPY 野村不動産マスターファンド投資法人	20.00	28 429.26	0.01
JPY 野村総合研究所	1 500.00	64 467.83	0.01
JPY エヌ・ティ・ティ・データ	2 500.00	52 710.38	0.01
JPY オムロン	800.00	77 255.71	0.02
JPY オリックス	5 300.00	104 791.05	0.02
JPY オリックス不動産投資法人	13.00	20 665.82	0.00
JPY 大阪瓦斯	1 800.00	28 962.97	0.01
JPY 大塚商会	500.00	22 854.37	0.01
JPY 大塚ホールディングス	1 600.00	58 422.65	0.01
JPY パナソニック	9 800.00	107 239.42	0.02
JPY ルネサスエレクトロニクス	4 800.00	60 959.09	0.01
JPY リソナホールディングス	8 600.00	31 477.92	0.01
JPY リコー	2 800.00	24 733.81	0.01
JPY ローム	400.00	37 447.71	0.01
JPY 参天製薬	1 600.00	21 193.36	0.00
JPY セイコーエプソン	1 300.00	20 952.05	0.00
JPY 積水化学工業	1 400.00	22 748.69	0.01
JPY セブン&アイ・ホールディングス	3 100.00	124 333.08	0.03
JPY S Gホールディングス	1 500.00	33 158.66	0.01
JPY 島津製作所	900.00	38 125.85	0.01
JPY ソフトバンク	12 800.00	176 141.62	0.04
JPY ソフトバンクグループ	5 100.00	270 844.16	0.06
JPY 総合警備保障	200.00	8 525.25	0.00
JPY S O M P Oホールディングス	1 400.00	57 630.01	0.01
JPY ソニーグループ	5 400.00	657 492.62	0.15
JPY S U B A R U	2 500.00	47 172.93	0.01
JPY S U M C O	1 100.00	24 103.22	0.01
JPY 住友化学	6 600.00	30 458.41	0.01
JPY 住友商事	5 000.00	68 078.74	0.02
JPY 大日本住友製薬	700.00	8 519.97	0.00
JPY 住友電気工業	3 000.00	39 354.44	0.01
JPY 三井住友フィナンシャルグループ	5 500.00	179 369.41	0.04
JPY 三井住友トラスト・ホールディングス	1 400.00	43 894.49	0.01
JPY 住友不動産	1 400.00	43 635.56	0.01
JPY 武田薬品工業	6 709.00	179 091.81	0.04
JPY T D K	1 500.00	59 447.80	0.01
JPY 東京海上ホールディングス	2 600.00	130 704.13	0.03
JPY 東京電力ホールディングス	8 300.00	22 148.93	0.00
JPY 東京エレクトロン	600.00	316 209.43	0.07
JPY 凸版印刷	1 200.00	18 209.52	0.00
JPY 東芝	1 700.00	67 778.41	0.02
JPY トヨタ自動車	45 000.00	793 033.60	0.18
JPY トレンドマイクロ	500.00	28 843.19	0.01
JPY ユニ・チャーム	1 800.00	77 488.22	0.02

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 西日本旅客鉄道	700.00	30 195.96	0.01
JPY ヤマハ発動機	1 300.00	32 733.28	0.01
JPY 安川電機	1 000.00	44 828.04	0.01
JPY 横河電機	1 000.00	18 803.12	0.00
JPY Zホールディングス	11 000.00	72 852.17	0.02
日本合計		9 917 388.70	2.22
ルクセンブルグ			
EUR ARCELORMITTAL NPV(POST STOCK SPLIT)	3 099.00	83 473.45	0.02
EUR EUROFINS SCIENTIFI EURO.01	556.00	70 681.65	0.02
EUR TENARIS S.A. USD1	2 157.00	21 030.63	0.00
ルクセンブルグ合計		175 185.73	0.04
オランダ			
EUR ADYEN NV EURO.01	83.00	228 657.20	0.05
EUR AEGON NV EURO.12	8 648.00	38 070.41	0.01
EUR ASML HOLDING NV EURO.09	1 803.00	1 419 807.98	0.32
EUR CNH INDUSTRIAL NV COM EURO.01	4 476.00	73 834.61	0.02
EUR JDE PEETS N.V. EURO.01	367.00	9 955.59	0.00
EUR KONINKLIJKE DSM NV EUR1.5	734.00	157 100.10	0.04
EUR NN GROUP N.V. EURO.12	1 295.00	64 049.23	0.01
EUR PROSUS N.V. EURO.05	3 877.00	309 491.42	0.07
GBP ROYAL DUTCH SHELL PLC 'A' SHS EURO.07	17 389.00	362 799.05	0.08
EUR UNIVERSAL MUSIC GR EUR10.00	3 154.00	89 854.10	0.02
オランダ合計		2 753 619.69	0.62
ノルウェー			
NOK ADEVINTA ASA SER 'B' NOK0.2	1 050.00	14 935.22	0.01
NOK AKER BP ASA NOK1	248.00	7 795.46	0.00
NOK DNB BANK ASA NOK12.50	3 932.00	85 533.14	0.02
NOK EQUINOR ASA NOK2.50	4 012.00	100 703.45	0.02
NOK MOWI ASA NOK7.50	2 013.00	45 556.43	0.01
NOK NORSK HYDRO ASA NOK3.6666	5 955.00	38 495.89	0.01
NOK TELENOR ASA ORD NOK6	3 071.00	45 114.43	0.01
ノルウェー合計		338 134.02	0.08
ポルトガル			
EUR EDP ENERGIAS PORTU EUR1(REGD)	12 113.00	65 908.65	0.01
EUR GALP ENERGIA EUR1-B	1 803.00	16 779.54	0.00
EUR JERONIMO MARTINS EUR5	1 185.00	25 629.66	0.01
ポルトガル合計		108 317.85	0.02
シンガポール			
SGD CAPITALAND INVESTM NPV	11 800.00	28 915.87	0.01
SGD GENTING SINGAPORE LTD	21 800.00	12 242.28	0.00
SGD SINGAPORE TELECOMM NPV	37 600.00	64 716.48	0.01
シンガポール合計		105 874.63	0.02
スペイン			
EUR BANCO SANTANDER SA EURO.50(REGD)	74 196.00	229 666.30	0.05
EUR BBVA(BILB-VIZ-ARG) EURO.49	28 338.00	149 996.84	0.04
スペイン合計		379 663.14	0.09

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 (%)
スウェーデン			
SEK ALFA LAVAL AB NPV	1 262.00	48 687.69	0.01
SEK ATLAS COPCO AB SER ' A ' NPV (POST SPLIT)	2 868.00	175 404.15	0.04
SEK ATLAS COPCO AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	1 696.00	88 026.71	0.02
SEK BOLIDEN AB NPV (POST SPLIT)	1 141.00	39 178.77	0.01
SEK ELECTROLUX AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	1 002.00	22 359.42	0.01
SEK EMBRACER GROUP AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	2 054.00	22 097.92	0.00
SEK EPIROC AB SER ' A ' NPV (POST SPLIT)	2 764.00	66 825.53	0.01
SEK EPIROC AB SER ' B ' NPV	1 789.00	35 899.47	0.01
SEK EQT AB NPV	1 110.00	65 317.86	0.01
SEK ERICSSON SER ' B ' NPV	12 470.00	125 267.52	0.03
SEK EVOLUTION AB NPV	722.00	75 647.42	0.02
SEK GETINGE AB SER ' B ' NPV	271.00	11 315.18	0.00
SEK HENNES & MAURITZ SER ' B ' NPV	3 531.00	62 256.60	0.01
SEK HEXAGON AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	8 162.00	118 723.92	0.03
SEK INVESTOR AB SER ' A ' NPV (POST SPLIT)	685.00	16 440.54	0.00
SEK INVESTOR AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	7 736.00	178 978.17	0.04
SEK KINNEVIK AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	966.00	34 346.03	0.01
SEK LIFCO AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	413.00	11 163.88	0.00
SEK NIBE INDUSTRIER AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	5 628.00	80 003.97	0.02
SEK SANDVIK AB NPV (POST SPLIT)	4 718.00	116 667.13	0.03
SEK SKAND ENSKILDA BKN SER ' A ' NPV	7 024.00	101 938.44	0.02
SEK SKF AB SER ' B ' NPV	1 508.00	34 448.35	0.01
SEK SWEDBANK AB SER ' A ' NPV	3 945.00	79 267.78	0.02
SEK SWEDISH MATCH NPV (POST SPLIT)	6 740.00	48 915.82	0.01
SEK TELE2 AB SHS	1 861.00	26 475.27	0.01
SEK VOLVO AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	6 320.00	136 098.65	0.03
スウェーデン合計		1 821 752.19	0.41
スイス			
CHF ABB LTD CHF0.12 (REGD)	7 813.00	269 242.03	0.06
CHF ADECCO GROUP AG CHF0.1 (REGD)	633.00	29 276.42	0.01
CHF ALCON AG CHF0.04	2 070.00	162 665.23	0.04
CHF BACHEM HOLDING AG CHF0.05(REGD)CLS ' B '	11.00	7 892.80	0.00
CHF BALOISE-HLDGS CHF0.1(REGD)	229.00	34 050.57	0.01
CHF BARRY CALLEBAUT AG CHF0.02 (REGD)	15.00	35 336.07	0.01
CHF BQE CANT VAUDOISE CHF1	119.00	9 605.90	0.00
CHF CLARIANT CHF4.00(REGD)	968.00	18 880.92	0.00
GBP COCA-COLA HBC AG ORD CHF6.70	942.00	28 938.30	0.01
CHF CREDIT SUISSE GRP CHF0.04(REGD)	10 825.00	104 249.41	0.02
CHF EMS-CHEMIE HLDG AG CHF0.01(REGD)(POST RECON)	40.00	37 907.93	0.01
CHF GEBERIT CHF0.10(REGD)	164.00	124 727.90	0.03
CHF GIVAUDAN AG CHF10	39.00	189 647.72	0.04
CHF HOLCIM LTD CHF2 (REGD)	2 179.00	104 664.52	0.02
CHF JULIUS BAER GRUPPE CHF0.02 (REGD)	948.00	58 637.91	0.01
CHF KUEHNE&NAGEL INTL CHF1(REGD)(POST-SUBD)	238.00	67 819.97	0.01
CHF LOGITECH INTL CHF0.25(REGD) (POST-SUBD)	720.00	56 688.13	0.01
CHF LONZA GROUP AG CHF1(REGD)	319.00	256 123.84	0.06
CHF NESTLE SA CHF0.10(REGD)	12 249.00	1 561 899.72	0.35
CHF NOVARTIS AG CHF0.50(REGD)	9 437.00	748 922.93	0.17
CHF PARTNERS GROUP HLG CHF0.01 (REGD)	93.00	159 790.36	0.04
CHF RICHEMONT(CIE FIN) CHF1.00 (REG) SER ' A '	2 227.00	328 972.23	0.07
CHF SCHINDLER-HLDG AG CHF0.1(REGD)(POST-SUBD)	106.00	26 207.91	0.01
CHF SGS LTD CHF1(REGD)	26.00	78 022.48	0.02

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 (%)
CHF SIKA AG CHF0.01 (REG)	604.00	235 425.55	0.05
CHF SONOVA HOLDING AG CHF0.05 (REGD)	235.00	87 991.68	0.02
CHF STRAUMANN HLDG CHF0.1(REGD)	45.00	95 164.25	0.02
CHF SWATCH GROUP CHF0.45(REGD)	228.00	12 947.27	0.00
CHF SWISS LIFE HLDG CHF5.1(REGD)	128.00	73 281.18	0.02
CHF SWISS PRIME SITE CHF15.3 (REGD)	315.00	29 682.30	0.01
CHF SWISSCOM AG CHF1(REGD)	111.00	61 221.53	0.01
CHF TEMENOS AG CHF5 (REGD)	271.00	34 511.94	0.01
CHF UBS GROUP CHF0.10 (REGD)	15 528.00	267 469.55	0.06
CHF ZURICH INSURANCE GRP CHF0.10	635.00	260 134.54	0.06
スイス合計		5 658 000.99	1.27

アラブ首長国連邦

GBP NMC HEALTH PLC ORD GBP0.1	997.00	0.01	0.00
-------------------------------	--------	------	------

アラブ首長国連邦合計

0.01 0.00

イギリス

GBP ABRDN PLC ORD GBP0.1396825396	8 526.00	26 316.00	0.01
GBP ADMIRAL GROUP ORD GBP0.001	759.00	29 692.92	0.01
GBP ANGLO AMERICAN USD0.54945	5 478.00	200 897.76	0.04
GBP ANTOFAGASTA ORD GBP0.05	1 638.00	29 905.62	0.01
GBP ASHTEAD GROUP ORD GBP0.10	1 984.00	158 644.85	0.04
GBP ASSOCD BRIT FOODS ORD GBP0.0568	1 486.00	37 805.76	0.01
GBP AUTO TRADER GROUP ORD GBP0.01	3 767.00	36 510.88	0.01
GBP BARCLAYS ORD GBP0.25	73 276.00	178 590.51	0.04
GBP BP ORD USD0.25	86 195.00	371 130.12	0.08
GBP BUNZL ORD GBP0.32142857	1 392.00	52 817.55	0.01
GBP BURBERRY GROUP ORD GBP0.0005	1 931.00	44 899.09	0.01
GBP COMPASS GROUP ORD GBP0.1105	7 577.00	146 606.43	0.03
GBP CRODA INTL ORD GBP0.10609756	600.00	80 292.87	0.02
GBP DIAGEO ORD GBP0.28 101/108	9 980.00	501 668.50	0.11
GBP FERGUSON PLC (NEW) ORD GBP0.10	933.00	141 519.26	0.03
GBP GLAXOSMITHKLINE ORD GBP0.25	21 486.00	433 496.16	0.10
GBP HARGREAVES LANSDOW ORD GBP0.004 (WI)	1 293.00	22 871.24	0.00
GBP HSBC HLDGS ORD USD0.50(UK REG)	86 805.00	481 594.19	0.11
GBP IMPERIAL BRANDS PL GBP0.10	4 181.00	85 295.16	0.02
GBP INTERCONTL HOTELS ORD GBP0.208521303	698.00	41 084.47	0.01
GBP INTERTEK GROUP ORD GBP0.01	680.00	48 040.78	0.01
GBP JD SPORTS FASHION ORD GBP0.0005	10 120.00	29 843.55	0.01
GBP LEGAL & GENERAL GP ORD GBP0.025	26 176.00	97 624.36	0.02
GBP LONDON STOCK EXCH ORD GBP0.06918604	1 325.00	113 978.43	0.03
GBP M&G PLC ORD GBP0.05	9 776.00	24 172.98	0.01
GBP MELROSE INDUST PLC ORD GBP0.076190476	18 155.00	34 827.64	0.01
GBP MONDI ORD EURO.20	1 990.00	45 270.48	0.01
GBP NATWEST GROUP PLC ORD GBP1	20 452.00	57 525.30	0.01
GBP NEXT ORD GBP0.10	571.00	59 392.14	0.01
GBP PEARSON ORD GBP0.25	2 972.00	23 324.36	0.00
GBP PERSIMMON ORD GBP0.10	1 332.00	48 232.40	0.01
GBP PHOENIX GP HLDGS ORD GBP0.10	2 682.00	22 716.12	0.00
GBP PRUDENTIAL ORD GBP0.05	11 237.00	189 697.19	0.04
GBP RIO TINTO ORD GBP0.10	4 803.00	293 063.50	0.07
GBP SAINSBURY(J) ORD GBP0.28571428	8 643.00	31 628.35	0.01
GBP SCHROEDERS VTG SHS GBP1	618.00	28 093.22	0.01
GBP SMITH & NEPHEW ORD USD0.20	3 768.00	60 693.15	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 (%)
GBP STANDARD CHARTERED ORD USD0.50	11 756.00	64 732.37	0.01
EUR STELLANTIS N V COM EURO.01	8 731.00	148 790.07	0.03
GBP TAYLOR WIMPEY ORD GBP0.01	14 355.00	29 987.85	0.01
GBP TESCO ORD GBPO.0633333	31 852.00	116 622.99	0.03
EUR UNILEVER PLC ORD GBPO.031111	10 936.00	559 038.74	0.12
GBP VODAFONE GROUP ORD USD0.2095238(POST CONS)	114 624.00	165 811.43	0.04
イギリス合計		5 394 746.74	1.21
アメリカ合衆国			
CAD BAUSCH HEALTH COMP COM NPV	1 215.00	28 717.49	0.01
CAD BROOKFIELD RENEWA. CLASS A SUB VOTING SHARES	550.00	20 365.61	0.00
アメリカ合衆国合計		49 083.10	0.01
記名株式合計		42 638 435.33	9.55
預託証券			
中国			
USD FUTU HOLDINGS LIM1 SPON ADS EA REP 8 ORD SHS	200.00	9 498.00	0.00
中国合計		9 498.00	0.00
香港			
USD MELCO RESORTS UNSP ARD EACH REP 3 ORD SHS	1 000.00	9 760.00	0.00
香港合計		9 760.00	0.00
アイルランド			
AUD JAMES HARDIE ID PLC CUFS EURO.5	1 891.00	74 643.09	0.02
アイルランド合計		74 643.09	0.02
イスラエル			
USD TEVA PHARMA IND ADR(CNV 1 ORD ILS0.10)	4 900.00	40 425.00	0.01
イスラエル合計		40 425.00	0.01
オランダ			
EUR ABN AMRO BANK N.V. DR EACH REP SHS	1 984.00	28 138.20	0.01
オランダ合計		28 138.20	0.01
シンガポール			
USD SEA LTD ADS EACH REP ONE CL A SHS	300.00	86 421.00	0.02
シンガポール合計		86 421.00	0.02
預託証券合計		248 885.29	0.06
投資信託証券			
アイルランド			
USD STAR COMPASS PLC/UBS DYNMC DIVERSIFIED LTD NOTE DUE 30.06.23	5 460 000.00	9 039 576.00	2.03
アイルランド合計		9 039 576.00	2.03
投資信託証券合計		9 039 576.00	2.03

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 (%)
投資信託、クローズド・エンド型			
カナダ			
CAD CANADIAN APARTMENT PROP. REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	400.00	17 729.97	0.01
CAD RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	789.00	13 070.04	0.00
カナダ合計		30 800.01	0.01
シンガポール			
SGD ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	13 900.00	29 601.43	0.00
SGD CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST REAL ESTATE INV TRUST	20 625.13	31 739.06	0.01
シンガポール合計		61 340.49	0.01
イギリス			
GBP SEGRO PLC REIT	5 249.00	97 846.98	0.02
イギリス合計		97 846.98	0.02
投資信託、クローズド・エンド型合計		189 987.48	0.04
新株引受権			
ドイツ			
EUR VONOVIA SE RIGHTS 07.12.21	2 376.00	8 317.46	0.00
ドイツ合計		8 317.46	0.00
新株引受権合計		8 317.46	0.00
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD 3M CO 2.25000% 16-19.09.26	350 000.00	362 293.24	0.08
USD ABU DHABI ,GOVERNMENT OF-REG-S 3.12500% 17-11.10.27	1 000 000.00	1 070 000.00	0.24
USD ALBERTA, PROVINCE OF 3.30000% 18-15.03.28	900 000.00	989 717.55	0.22
USD ALPHABET INC 1.10000% 20-15.08.30	830 000.00	779 902.77	0.17
USD ALPHABET INC 1.99800% 16-15.08.26	525 000.00	540 497.13	0.12
USD AMERICAN EXPRESS CO 3.40000% 18-27.02.23	700 000.00	722 646.03	0.16
USD APPLE INC 1.65000% 20-11.05.30	950 000.00	924 548.39	0.21
USD APPLE INC 2.20000% 19-11.09.29	600 000.00	611 378.45	0.14
USD APPLE INC 2.40000% 13-03.05.23	250 000.00	256 012.69	0.06
USD APPLE INC 2.45000% 16-04.08.26	1 000 000.00	1 041 704.88	0.23
USD APPLE INC 2.85000% 16-23.02.23	475 000.00	486 550.37	0.11
USD APPLE INC 3.20000% 17-11.05.27	775 000.00	833 615.71	0.19
USD BANK OF NOVA SCOTIA 2.00000% 19-15.11.22	330 000.00	334 752.07	0.08
USD BAYER US FINANCE II LLC-REG-S 3.87500% 18-15.12.23	500 000.00	525 129.65	0.12
USD BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 1.75000% 19-27.09.24	250 000.00	255 895.31	0.06
USD BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 1.30000% 21-29.01.31	875 000.00	851 672.50	0.19
USD CHEVRON CORP 2.23600% 20-11.05.30	821 000.00	829 552.10	0.19
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 3.90000% 18-16.03.28	450 000.00	510 052.46	0.11
USD CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 4.37500% 12-15.06.22	625 000.00	637 670.76	0.14
USD CPPIB CAPITAL INC-REG-S 1.25000% 21-28.01.31	250 000.00	241 519.50	0.05
USD EQUINOR ASA 2.37500% 20-22.05.30	300 000.00	305 793.58	0.07
USD EQUINOR ASA 3.62500% 18-10.09.28	500 000.00	552 352.37	0.12
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.37500% 17-24.05.27	300 000.00	317 073.09	0.07
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.87500% 20-17.05.30	2 110 000.00	2 041 544.98	0.46

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 (%)
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.25000% 21-14.02.31	1 740 000.00	1 706 921.92	0.38
USD EXPORT DEVELOPMENT CANADA 2.00000% 17-17.05.22	200 000.00	201 677.74	0.05
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 3.25000% 15-10.11.25	700 000.00	755 037.50	0.17
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 2.75000% 17-25.01.22	200 000.00	200 725.00	0.05
USD EXXON MOBIL CORP 3.04300% 16-01.03.26	525 000.00	556 917.13	0.13
USD EXXON MOBIL CORP 3.48200% 20-19.03.30	90 000.00	98 756.96	0.02
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.37500% 17-07.07.27	400 000.00	422 443.13	0.09
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.25000% 19-18.06.29	800 000.00	844 496.00	0.19
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.00000% 19-23.07.26	450 000.00	466 321.50	0.10
USD INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 2.85000% 19-13.05.22	400 000.00	404 461.56	0.09
USD INTERNATIONAL DVPT ASSOCIATION-REG-S 1.00000% 20-03.12.30	500 000.00	477 712.00	0.11
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 1.75000% 19-23.10.29	500 000.00	509 756.34	0.11
USD JOHNSON & JOHNSON 1.30000% 20-01.09.30	500 000.00	476 204.81	0.11
USD JOHNSON & JOHNSON 2.90000% 17-15.01.28	250 000.00	266 509.01	0.06
USD JOHNSON & JOHNSON 3.37500% 13-05.12.23	300 000.00	315 811.93	0.07
USD KOREA DEVELOPMENT BANK 2.75000% 17-19.03.23	400 000.00	410 723.44	0.09
USD KOREA HYDRO&NUCLEAR POWER CO LTD-REG-S 3.00000% 12-19.09.22	200 000.00	203 662.50	0.05
USD KOREA HYDRO&NUCLEAR POWER CO LTD-REG-S 3.12500% 17-25.07.27	800 000.00	859 650.00	0.19
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.12500% 13-17.01.23	1 650 000.00	1 682 880.92	0.38
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.00000% 15-02.05.25	750 000.00	775 118.78	0.17
USD KUWAIT INTERNATIONAL GOVT BOND-REG-S 3.50000% 17-20.03.27	1 200 000.00	1 305 975.00	0.29
USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 2.00000% 15-13.01.25	775 000.00	799 844.54	0.18
USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 0.87500% 20-03.09.30	1 800 000.00	1 707 420.51	0.38
USD MICROSOFT CORP 2.65000% 15-03.11.22	250 000.00	254 451.76	0.06
USD MICROSOFT CORP 2.87500% 17-06.02.24	725 000.00	754 685.00	0.17
USD MICROSOFT CORP 3.30000% 17-06.02.27	1 500 000.00	1 626 241.52	0.36
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD/NY 2.50000% 16-12.07.26	800 000.00	839 291.76	0.19
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 1.25000% 20-15.09.30	250 000.00	236 938.94	0.05
USD NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 3.00000% 18-10.01.28	425 000.00	456 957.07	0.10
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 2.40000% 12-21.09.22	850 000.00	863 615.23	0.19
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 3.10000% 17-17.05.27	850 000.00	910 743.43	0.20
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 2.20000% 20-14.08.30	600 000.00	611 785.91	0.14
USD QATAR, STATE OF-REG-S 3.37500% 19-14.03.24	800 000.00	839 600.00	0.19
USD QATAR, STATE OF-REG-S 4.00000% 19-14.03.29	575 000.00	645 150.00	0.14
USD QATAR, STATE OF-REG-S 3.75000% 20-16.04.30	500 000.00	556 000.00	0.12
USD QUEBEC, PROVINCE OF 2.50000% 16-20.04.26	850 000.00	895 606.28	0.20
USD ROCHE HOLDINGS INC-REG-S 3.62500% 18-17.09.28	800 000.00	890 146.56	0.20
USD SINOPEC GROUP OVERSEAS DEV 2013-REG-S 4.37500% 13-17.10.23	300 000.00	318 588.00	0.07
USD STATE STREET CORP 2.40000% 20-24.01.30	208 000.00	213 931.18	0.05
USD TEMASEK FINANCIAL I LTD-REG-S 2.37500% 12-23.01.23	300 000.00	305 839.89	0.07
USD TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.70000% 13-15.01.24	350 000.00	369 472.51	0.08
USD TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.45500% 19-19.02.29	350 000.00	381 288.35	0.09
USD VISA INC 2.05000% 20-15.04.30	350 000.00	353 193.45	0.08
USD VISA INC 3.15000% 15-14.12.25	400 000.00	427 990.93	0.10
USD WAL-MART STORES INC 1.80000% 21-22.09.31	400 000.00	395 635.41	0.09
USD WESTPAC BANKING CORP 2.85000% 16-13.05.26	991 000.00	1 051 402.34	0.24
USD WESTPAC BANKING CORP 3.35000% 17-08.03.27	300 000.00	324 501.78	0.07
米ドル合計		45 993 961.10	10.30
ノート、固定利付債合計		45 993 961.10	10.30

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 (%)
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	968 625.00	0.22
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.00000% 17-16.02.22	550 000.00	552 392.50	0.12
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.50000% 17-02.11.27	500 000.00	532 595.00	0.12
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.75000% 19-19.09.29	1 400 000.00	1 428 167.18	0.32
USD BANK OF NEW YORK CO INC 0.75000% 21-28.01.26	700 000.00	682 113.38	0.15
USD CAISSE D ' AMOR DE LA DETTE SOCIALE-REG-S 3.37500% 14-20.03.24	400 000.00	423 617.33	0.10
USD CLIFFORD CAPITAL PTE LTD-REG-S 1.73300% 19-10.09.24	650 000.00	663 172.96	0.15
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 3.15000% 17-19.09.27	150 000.00	162 125.77	0.04
USD CPPIB CAPITAL INC-REG-S 2.75000% 17-02.11.27	1 000 000.00	1 071 142.24	0.24
USD IDB TRUST SERVICES LTD-REG-S 2.26100% 17-26.09.22	500 000.00	506 400.00	0.11
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 1.12500% 21-13.01.31	800 000.00	774 828.48	0.17
USD INTERNATIONAL FINANCE CORP 2.12500% 16-07.04.26	350 000.00	364 663.43	0.08
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 17-22.11.27	1 305 000.00	1 386 315.63	0.31
USD KOREA DEVELOPMENT BANK 1.75000% 20-18.02.25	225 000.00	229 524.75	0.05
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 3.00000% 17-19.04.24	600 000.00	627 750.00	0.14
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 2.87500% 19-07.11.29	300 000.00	312 000.00	0.07
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 2.87500% 20-21.05.30	600 000.00	623 250.00	0.14
USD MORGAN STANLEY 3.12500% 16-27.07.26	300 000.00	317 860.80	0.07
USD MTR CORP CI LTD-REG-S 2.50000% 16-02.11.26	900 000.00	942 515.82	0.21
USD NEDERLANDSE WATERSCHAPS BK NV-REG-S 3.00000% 18-21.12.21	200 000.00	200 299.20	0.04
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 2.37500% 17-18.01.22	325 000.00	325 695.50	0.07
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 3.12500% 18-22.03.23	415 000.00	428 294.02	0.10
USD NORDRHEIN-WESTFALEN, STATE OF-REG-S 2.25000% 15-16.04.25	200 000.00	207 753.60	0.05
USD SP POWERASSETS LTD-REG-S 3.25000% 15-24.11.25	200 000.00	214 634.58	0.05
USD SUMITOMO MITSUI BANKING CORP-REG-S 2.44000% 19-18.06.24	418 000.00	432 544.44	0.10
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 2.60000% 17-11.01.22	350 000.00	350 827.89	0.08
米ドル合計		14 729 109.50	3.30
中期債券、固定利付債合計		14 729 109.50	3.30
債券、固定利付債			
米ドル			
USD BNG BANK NV-REG-S 2.37500% 16-16.03.26	450 000.00	471 915.90	0.11
USD CAISSE D ' AMORTIS DE LA DETTE SOC-REG-S 1.87500% 15-12.02.22	225 000.00	225 742.50	0.05
USD CANADIAN IMPERIAL BANK OF COM/CAN-REG-S 2.35000% 17-27.07.22	350 000.00	354 601.42	0.08
USD DNB BOLIGKREDITT AS-REG-S 2.50000% 17-28.03.22	500 000.00	503 472.00	0.11
USD FAB SUKUK CO LTD-REG-S 3.87500% 19-22.01.24	300 000.00	317 250.00	0.07
USD FEDERAL HOME LOAN BANK SYSTEM 2.00000% 12-09.09.22	600 000.00	608 682.94	0.14
USD FMS WERTMANAGEMENT 2.00000% 17-01.08.22	375 000.00	379 436.25	0.08
USD ING BANK NV-REG-S 2.62500% 12-05.12.22	250 000.00	255 413.00	0.06
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 14-25.11.24	675 000.00	707 117.97	0.16
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 15-29.07.25	550 000.00	578 492.81	0.13
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.87500% 20-14.05.30	250 000.00	238 977.50	0.05
USD KOREA GAS CORP-REG-S 2.87500% 19-16.07.29	300 000.00	320 306.25	0.07
USD KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 3.25000% 14-10.07.24	450 000.00	476 326.22	0.11
USD KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 1.62500% 20-05.10.30	200 000.00	191 159.52	0.04
USD KOREA, REPUBLIC OF 3.87500% 13-11.09.23	600 000.00	633 862.50	0.14
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.50000% 14-20.11.24	625 000.00	654 378.94	0.15
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 0.75000% 20-30.09.30	2 000 000.00	1 884 132.06	0.42

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 (%)
USD NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S 1.70000% 20-13.02.23	583 000.00	590 699.88	0.13
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 3.40000% 14-06.05.24	200 000.00	211 690.49	0.05
USD ONTARIO, PROVINCE OF 1.12500% 20-07.10.30	700 000.00	666 070.64	0.15
USD ONTARIO, PROVINCE OF 3.20000% 14-16.05.24	750 000.00	792 870.00	0.18
USD SWEDBANK AB-REG-S 2.80000% 17-14.03.22	200 000.00	201 439.45	0.04
米ドル合計		11 264 038.24	2.52

債券、固定利付債合計	11 264 038.24	2.52
------------	---------------	------

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	602 000.00	653 946.02	0.15
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 15-31.01.22	1 205 000.00	1 207 887.46	0.27
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 17-15.02.27	3 805 000.00	4 009 072.84	0.90
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 13-15.05.23	910 000.00	927 915.62	0.21
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.62500% 20-15.05.30	2 581 000.00	2 422 611.28	0.54
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.12500% 21-15.02.31	2 750 000.00	2 684 580.09	0.60
米ドル合計		11 906 013.31	2.67

財務省証券(T-note)、固定利付債合計	11 906 013.31	2.67
-----------------------	---------------	------

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	170 607 203.64	38.22
-------------------------------------	----------------	-------

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

財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン

米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 21-21.04.22	3 000 000.00	2 999 148.12	0.67
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 21-19.05.22	3 000 000.00	2 998 755.96	0.67
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 17.06.21-16.06.22	3 000 000.00	2 998 419.90	0.67
米ドル合計		8 996 323.98	2.01

財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン合計	8 996 323.98	2.01
-------------------------	--------------	------

ノート、固定利付債

米ドル			
USD FANNIE MAE 0.25000% 20-27.11.23	400 000.00	397 448.93	0.09
USD FANNIE MAE 2.12500% 16-24.04.26	700 000.00	728 594.36	0.16
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD NEW YORK 2.87500% 18-12.04.23	250 000.00	257 825.53	0.06
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-144A 3.50000% 17-10.01.27	500 000.00	544 665.25	0.12
USD NESTLE HOLDINGS INC-144A 1.00000% 20-15.09.27	450 000.00	432 948.62	0.10
USD PROCTER & GAMBLE CO 2.30000% 12-06.02.22	350 000.00	351 169.26	0.08
米ドル合計		2 712 651.95	0.61

ノート、固定利付債合計	2 712 651.95	0.61
-------------	--------------	------

注記は当財務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 (%)
中期債券、固定利付債			
米ドル			
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 3.85000% 14-08.07.24	350 000.00	371 319.94	0.08
米ドル合計		371 319.94	0.08
中期債券、固定利付債合計		371 319.94	0.08
債券、固定利付債			
米ドル			
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 1.62500% 19-17.10.22	250 000.00	251 991.65	0.06
USD HSBC BANK CANADA-REG-S 1.65000% 19-10.09.22	300 000.00	303 015.11	0.07
米ドル合計		555 006.76	0.13
債券、固定利付債合計		555 006.76	0.13
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		12 635 302.63	2.83
公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引されていない 譲渡性のある証券および短期金融商品			
無記名株式			
オーストラリア			
AUD DEXUS NPV (STAPLED)	4 388.00	34 753.35	0.01
オーストラリア合計		34 753.35	0.01
無記名株式合計		34 753.35	0.01
記名株式			
イギリス			
GBP BERKELEY GP HLDGS ORD GBPO.053943	438.00	24 824.67	0.00
イギリス合計		24 824.67	0.00
記名株式合計		24 824.67	0.00
新株引受権			
シンガポール			
SGD MAPLETREE LOGISTICS TRUST RIGHTS 14.12.21	307.10	4.48	0.00
シンガポール合計		4.48	0.00
新株引受権合計		4.48	0.00
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 2.95000% 18-11.01.25	350 000.00	368 541.19	0.08
USD US BANK NA/CINCINNATI OH 2.65000% 19-23.05.22	400 000.00	403 476.91	0.09
米ドル合計		772 018.10	0.17
ノート、固定利付債合計		772 018.10	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 (%)
中期債券、変動利付債			
米ドル			
USD NATIONAL BANK OF CANADA 0.550%/VAR 20-15.11.24	318 000.00	314 983.25	0.07
米ドル合計		314 983.25	0.07
中期債券、変動利付債合計		314 983.25	0.07
債券、固定利付債			
米ドル			
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 2.75000% 17-22.06.24	250 000.00	261 119.99	0.06
米ドル合計		261 119.99	0.06
債券、固定利付債合計		261 119.99	0.06
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		1 407 703.84	0.31
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 MAN FUNDS VI PLC-MAN AHL TARGETRISK-INU-USD-CAP	49 431.45	7 664 346.48	1.72
USD UBS (IRL) ETF PLC-MSCI USA UCITS-ACC-A-USD-ETF	1 840 635.00	48 197 027.48	10.80
USD UBS IRL FND SOLUTIONS PLC-MSCI USA SF INDEX-SHS-A-USD-ACC	219 326.00	29 761 529.30	6.67
USD UBS(IRL)FUND SOLUTION PLC-MSCI USA SF UCITS SHS-A-ETF-ACC	663 367.00	86 357 116.06	19.34
アイルランド合計		171 980 019.32	38.53
ルクセンブルグ			
EUR ALMA PLATINUM IV UBS MULTI-STRATEGY ALTERNATIVES-IOC-E-CAP	791.37	8 695 190.45	1.95
USD AQR UCITS FUNDS - GLOBAL RISK PARITY UCITS FUND-A2-CAP	42 846.48	6 051 636.84	1.35
USD INVESCO FUNDS SICAV BAL RISK ALLOCATION-PI1-USD HDG-CAP	294 283.52	4 181 768.85	0.94
USD UBS (LUX) BOND FUND-EURO HIGH YIELD (EUR)(USD HEDGED) F-ACC	57 954.00	7 276 704.24	1.63
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD (USD) F-ACC	30 699.00	10 873 278.81	2.44
USD UBS (LUX) BOND SICAV - EMERG ECON CORPORATES (USD) F-ACC	87 326.00	10 844 142.68	2.43
USD UBS (LUX) EMERGING ECONOMIES FUND - GLOBAL BONDS (USD) F-ACC	7 692.00	16 041 896.76	3.59
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD SUSTAINABLE U-X-ACC	1.00	11 234.15	0.00
ルクセンブルグ合計		63 975 852.78	14.33
投資信託、オープン・エンド型合計		235 955 872.10	52.86
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		235 955 872.10	52.86
投資有価証券合計		420 606 082.21	94.22

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 (%)
----	------------	--	------------------

派生商品

公認の証券取引所に上場されている派生商品

債券に係る金融先物

USD	US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 22.03.22	-95.00	-72 734.38	-0.02
USD	US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 22.03.22	-108.00	-133 437.50	-0.03
USD	US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.22	-242.00	-85 078.25	-0.02
USD	US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.22	-148.00	-4 562.65	0.00
USD	US LONG BOND FUTURE 22.03.22	-6.00	-9 703.12	0.00
債券に係る金融先物合計			-305 515.90	-0.07

指数に係る金融先物

EUR	EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 17.12.21	136.00	-145 517.57	-0.03
CHF	SWISS MARKET INDEX FUTURE 17.12.21	13.00	20 791.01	0.00
GBP	FTSE 100 INDEX FUTURE 17.12.21	27.00	20 916.63	0.00
SEK	OMX 30 INDEX FUTURE 17.12.21	24.00	-35 505.31	-0.01
AUD	SPI 200 INDEX FUTURES 16.12.21	9.00	-23 274.57	0.00
USD	S&P500 EMINI FUTURE 17.12.21	241.00	1 123 337.50	0.25
USD	MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 17.12.21	677.00	-2 613 375.00	-0.59
JPY	TOPIX INDEX FUTURE 09.12.21	24.00	-333 436.08	-0.07
CAD	S&P/TSX 60 INDEX FUTURE 16.12.21	11.00	35 796.69	0.01
HKD	HANG SENG INDEX FUTURE 30.12.21	3.00	-22 819.83	0.00
指数に係る金融先物合計			-1 973 086.53	-0.44

公認の証券取引所に上場されている派生商品合計			-2 278 602.43	-0.51
------------------------	--	--	---------------	-------

派生商品合計			-2 278 602.43	-0.51
--------	--	--	---------------	-------

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 （％）
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	4 277 372.48	GBP	3 139 000.00	10.12.2021	124 290.81	0.03
USD	9 111 922.08	JPY	1 012 730 000.00	10.12.2021	192 202.93	0.04
USD	445 628.79	SGD	605 000.00	10.12.2021	4 411.35	0.00
USD	3 270 388.53	CHF	3 027 000.00	10.12.2021	-1 384.63	0.00
USD	123 827.21	ILS	400 000.00	10.12.2021	-3 150.36	0.00
USD	3 374 344.42	AUD	4 640 000.00	10.12.2021	84 211.84	0.02
USD	4 861 400.87	CAD	6 125 000.00	10.12.2021	86 643.99	0.02
USD	233 490.83	NOK	2 000 000.00	10.12.2021	13 996.45	0.00
USD	121 809.91	NZD	175 000.00	10.12.2021	3 046.69	0.00
USD	12 515 224.26	EUR	10 780 000.00	10.12.2021	379 013.02	0.09
USD	1 069 453.49	DKK	6 850 000.00	10.12.2021	32 510.27	0.01
USD	1 374 774.55	HKD	10 700 000.00	10.12.2021	2 248.66	0.00
USD	1 556 766.77	SEK	13 600 000.00	10.12.2021	57 924.19	0.01
USD	11 119 210.11	JPY	1 266 130 000.00	7.1.2022	-40 641.24	-0.01
USD	8 859 056.27	GBP	6 421 000.00	7.1.2022	357 022.37	0.08
USD	4 580 225.79	CHF	4 208 000.00	7.1.2022	25 433.96	0.01
USD	21 595 988.96	EUR	18 557 000.00	7.1.2022	675 563.09	0.15
USD	3 271 805.48	AUD	4 360 000.00	7.1.2022	178 792.71	0.04
USD	1 376 271.21	HKD	10 700 000.00	7.1.2022	3 727.89	0.00
USD	1 071 807.12	DKK	6 850 000.00	7.1.2022	33 535.63	0.01
USD	124 975.01	ILS	400 000.00	7.1.2022	-2 209.81	0.00
USD	4 974 709.80	CAD	6 149 000.00	7.1.2022	179 041.61	0.04
USD	125 463.70	NZD	175 000.00	7.1.2022	6 742.13	0.00
USD	1 582 119.15	SEK	13 600 000.00	7.1.2022	81 016.31	0.02
USD	449 310.90	SGD	605 000.00	7.1.2022	8 146.61	0.00
USD	239 447.13	NOK	2 000 000.00	7.1.2022	19 990.75	0.00
USD	504 377.06	EUR	435 000.00	7.1.2022	13 975.31	0.00
USD	503 850.19	EUR	435 000.00	10.12.2021	14 123.67	0.00
USD	531 304.73	EUR	470 000.00	7.1.2022	1 445.37	0.00
USD	530 658.62	EUR	470 000.00	10.12.2021	1 528.82	0.00
CHF	73 543 500.00	USD	78 728 984.57	12.1.2022	885 818.19	0.20
EUR	91 202 300.00	USD	102 400 574.41	12.1.2022	427 950.45	0.10
SGD	10 223 500.00	USD	7 475 504.53	12.1.2022	-20 707.64	0.00
GBP	5 423 700.00	USD	7 251 687.58	12.1.2022	-70 239.54	-0.02
USD	443 288.79	EUR	395 400.00	12.1.2022	-2 515.74	0.00
USD	23 871.03	GBP	17 900.00	12.1.2022	169.88	0.00
EUR	398 400.00	USD	450 836.21	12.1.2022	-1 649.25	0.00
GBP	199 500.00	USD	265 413.60	12.1.2022	-1 258.34	0.00
先渡為替契約合計					3 750 768.40	0.84
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					23 106 913.18	5.18
その他の資産および負債					1 202 627.30	0.27
純資産総額					446 387 788.66	100.00

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・ミディアム(米ドル)

2021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	2 745.00	211 859.35	0.01
AUD APA GROUP NPV	14 866.00	100 453.23	0.01
AUD ARISTOCRAT LEISURE NPV	7 371.00	230 536.84	0.01
AUD ASX LTD NPV	2 544.00	163 119.73	0.01
AUD AURIZON HOLDINGS NPV	23 639.00	56 485.36	0.00
AUD AUST & NZ BANK GRP NPV	35 968.00	680 933.05	0.04
AUD BLUESCOPE STEEL NPV	5 490.00	76 958.37	0.00
AUD BRAMBLES LTD NPV	19 231.00	136 493.76	0.01
AUD CMNWLTH BK OF AUST NPV	22 471.00	1 484 642.77	0.08
AUD COCHLEAR LTD NPV	886.00	136 825.95	0.01
AUD COMPUTERSHARE LTD NPV(POST REC)	7 091.00	95 982.11	0.00
AUD CROWN RESORTS LTD NPV	4 610.00	36 021.30	0.00
AUD CSL NPV	5 764.00	1 253 839.75	0.06
AUD DOMINOS PIZZA ENT NPV	749.00	68 891.50	0.00
AUD ENDEAVOUR GROUP LI NPV	16 568.00	80 470.65	0.00
AUD EVOLUTION MINING NPV	19 245.00	54 992.04	0.00
AUD FORTESCUE METALS G NPV	20 509.00	247 357.83	0.01
AUD GOODMAN GROUP (STAPLED SECURITY)	21 392.00	374 497.86	0.02
AUD GPT GROUP NPV (STAPLED SECURITIES)	25 958.00	96 997.09	0.01
AUD IDP EDUCATION LTD NPV	2 072.00	51 390.92	0.00
AUD INSURANCE AUST GRP NPV	31 017.00	97 427.24	0.01
AUD LEND LEASE GROUP NPV	9 301.00	70 433.25	0.00
AUD MACQUARIE GP LTD NPV	4 344.00	605 981.47	0.03
AUD MAGELLAN FINANCIAL NPV	1 742.00	40 958.07	0.00
AUD MEDIBANK PRIVATE L NPV	31 415.00	76 848.08	0.00
AUD MIRVAC GROUP STAPLED SECURITIES	48 348.00	98 044.09	0.01
AUD NATL AUSTRALIA BK NPV	41 781.00	808 757.53	0.04
AUD NEWCREST MINING NPV	10 728.00	179 669.98	0.01
AUD NTHN STAR RES LTD NPV	15 035.00	100 635.75	0.01
AUD ORICA LIMITED NPV	5 001.00	50 210.78	0.00
AUD ORIGIN ENERGY NPV	23 392.00	79 613.27	0.00
AUD QANTAS AIRWAYS NPV	11 865.00	42 569.16	0.00
AUD QBE INS GROUP NPV	19 631.00	161 742.97	0.01
AUD RAMSAY HEALTH CARE NPV	2 046.00	96 936.86	0.00
AUD REA GROUP LIMITED NPV	718.00	82 672.41	0.00
AUD REECE AUSTRALIA NPV	3 380.00	56 128.11	0.00
AUD RIO TINTO LIMITED NPV	4 570.00	302 973.52	0.02
AUD SANTOS LIMITED NPV	23 729.00	107 343.80	0.01
AUD SCENTRE GROUP NPV STAPLED UNIT	66 925.00	146 630.30	0.01
AUD SEEK LIMITED NPV	4 593.00	113 332.00	0.01
AUD SONIC HEALTHCARE NPV	6 153.00	186 290.90	0.01
AUD SOUL PATTINSON(WH) NPV	1 363.00	30 036.80	0.00
AUD SOUTH32 LTD NPV	57 803.00	144 677.82	0.01
AUD STOCKLAND NPV (STAPLED)	32 246.00	99 915.79	0.01
AUD SUNCORP GROUP LTD NPV	17 393.00	133 437.72	0.01
AUD SYDNEY AIRPORT NPV(STAPLED SECURITY)	16 605.00	97 722.33	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・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 (%)
AUD TABCORP HLDGS LTD NPV	31 302.00	110 529.52	0.01
AUD TELSTRA CORP NPV	48 788.00	140 794.04	0.01
AUD TRANSURBAN GROUP STAPLED UNITS NPV	39 777.00	385 265.03	0.02
AUD TREASURY WINE ESTA NPV	9 428.00	80 887.57	0.00
AUD VICINITY CENTRES NPV (STAPLED SECURITY)	49 834.00	59 892.48	0.00
AUD WESFARMERS LTD NPV	14 309.00	576 889.99	0.03
AUD WESTPAC BKG CORP NPV	46 651.00	678 758.33	0.04
AUD WISETECH GLOBAL LT NPV	1 922.00	71 505.81	0.00
AUD WOODSIDE PETROLEUM NPV	11 894.00	180 728.63	0.01
AUD WOOLWORTHS GRP LTD NPV	15 767.00	456 350.92	0.02
オーストラリア合計		12 391 341.78	0.64
オーストリア			
EUR ERSTE GROUP BK AG NPV	3 379.00	146 697.23	0.01
EUR OMV AG NPV(VAR)	1 975.00	104 417.13	0.01
EUR RAIFFEISEN BK INTL NPV (REGD)	2 288.00	67 526.27	0.00
EUR VERBUND AG CLASS ' A ' NPV	905.00	94 226.79	0.00
EUR VOESTALPINE AG NPV	1 629.00	54 788.04	0.00
オーストリア合計		467 655.46	0.02
ベルギー			
EUR ANHEUSER-BUSCH IN NPV	9 531.00	528 412.26	0.03
EUR COLRUYT SA NPV	317.00	14 750.74	0.00
EUR ELIA SYS OPERATOR NPV	452.00	55 913.95	0.00
EUR GPE BRUXELLES LAM NPV	1 383.00	148 696.44	0.01
EUR PROXIMUS SA NPV	2 452.00	44 214.74	0.00
EUR SOFINA NPV	203.00	93 409.49	0.00
EUR SOLVAY SA NPV	921.00	102 548.15	0.01
EUR UMICORE NPV	2 664.00	128 969.72	0.01
ベルギー合計		1 116 915.49	0.06
カナダ			
CAD AIR CANADA VAR VTG SHS NPV	1 930.00	31 294.04	0.00
CAD ALGONQUIN PWR&UTIL COM NPV	7 200.00	97 043.97	0.01
CAD ALTAGAS LTD COM NPV	3 351.00	63 477.78	0.00
CAD ATCO LTD CL 1 NON VTG	239.00	7 756.14	0.00
CAD B2GOLD CORP COM NPV	6 600.00	26 033.68	0.00
CAD BALLARD POWER SYS COM NPV	2 700.00	40 937.80	0.00
CAD CAE INC COM NPV	3 680.00	88 069.85	0.01
CAD CAMECO CORP COM	5 194.00	120 618.38	0.01
CAD CANADIAN UTILS LTD CL A	1 583.00	42 326.86	0.00
CAD CANOPY GROWTH CORP COM NPV	2 249.00	24 053.85	0.00
CAD EMERA INC COM	3 221.00	147 365.52	0.01
CAD EMPIRE LTD CL A	2 146.00	61 278.44	0.00
CAD HYDRO ONE INC COM NPV	4 260.00	103 710.48	0.01
CAD IGM FINANCIAL INC COM	1 223.00	44 017.70	0.00
CAD IVANHOE MINES LTD COM NPV CL ' A '	8 200.00	64 817.59	0.00
CAD KEYERA CORPORATION COM NPV	2 799.00	61 225.39	0.00
CAD KINROSS GOLD CORP COM NPV	17 136.00	101 255.75	0.01
CAD KIRKLAND LAKE GOLD COM NPV	3 394.00	133 638.09	0.01
CAD LUNDIN MINING CORP COM	9 350.00	73 106.10	0.00
CAD NORTHLAND POWER IN COM NPV	2 465.00	73 481.14	0.00
CAD NUVEI CORPORATION SUB VOTING SHARES (CAD)	700.00	68 641.25	0.00
CAD ONEX CORP SUB VTG	1 136.00	82 197.94	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・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 PAN AMER SILVER COM NPV	2 726.00	69 340.02	0.00
CAD QUEBECOR INC CL B	2 416.00	53 544.50	0.00
CAD RITCHIE BROS AUCTIONEERS COM	1 423.00	96 186.72	0.00
CAD TELUS CORPORATION NPV	5 645.00	128 495.48	0.01
CAD TFI INTERNATIONAL COM NPV	223.00	22 049.67	0.00
CAD TMX GROUP LTD COM NPV	788.00	76 152.45	0.01
CAD TOROMONT INDS LTD COM	1 100.00	92 009.67	0.01
CAD TOURMALINE OIL CP COM NPV	687.00	22 766.11	0.00
CAD WEST FRASER TIMBER COM NPV	1 113.00	91 136.20	0.01
CAD WSP GLOBAL INC COM NPV	1 545.00	214 009.24	0.01
CAD YAMANA GOLD INC COM	7 485.00	29 757.95	0.00
カナダ合計		2 451 795.75	0.13
デンマーク			
DKK A.P. MOELLER-MAERSK SER ' B ' DKK1000	78.00	233 451.64	0.01
DKK A.P. MOLLER-MAERSK ' A ' DKK1000	39.00	110 793.61	0.01
DKK AMBU A/S SER ' B ' DKK0.5	2 171.00	61 050.80	0.00
DKK CHR. HANSEN HLDG DKK10	1 383.00	102 126.59	0.00
DKK DANSKE BANK A/S DKK10	9 108.00	149 292.27	0.01
DKK DSV PANALPINA A/S DKK1	2 551.00	551 346.34	0.03
DKK GENMAB AS DKK1 (BEARER)	840.00	322 668.62	0.02
DKK GN STORE NORD DKK4	1 639.00	93 520.35	0.00
DKK NOVOZYMES A/S SER ' B ' DKK2 (POST CONS)	2 747.00	206 675.15	0.01
DKK ORSTED A/S DKK10	2 448.00	313 004.91	0.02
DKK PANDORA A/S DKK1	1 306.00	160 899.03	0.01
DKK ROCKWOOL INTL SER ' B ' DKK10	92.00	38 041.21	0.00
デンマーク合計		2 342 870.52	0.12
フィンランド			
EUR KESKO OYJ EUR2 SER ' B '	3 904.00	121 899.06	0.01
EUR KONE CORPORATION NPV ORD ' B '	4 067.00	266 611.96	0.01
EUR WARTSILA OYJ ABP SER ' B ' EUR3.50	6 771.00	93 629.37	0.01
フィンランド合計		482 140.39	0.03
フランス			
EUR ACCOR EUR3	2 302.00	67 809.90	0.00
EUR ADP EUR3	352.00	40 849.37	0.00
EUR AIR LIQUIDE(L ') EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)	5 977.00	981 034.85	0.05
EUR AIRBUS EUR1	7 500.00	833 394.24	0.04
EUR ALSTOM EUR7.00	3 390.00	120 120.88	0.01
EUR AMUNDI EUR2.5 (AIW)	855.00	70 687.40	0.00
EUR ARKEMA EUR10	742.00	96 548.57	0.01
EUR AXA EUR2.29	25 229.00	691 485.51	0.04
EUR BIOMERIEUX NPV (POST SPLIT)	616.00	86 809.87	0.00
EUR BNP PARIBAS EUR2	14 303.00	886 758.08	0.05
EUR BOLLORE EURO.16	12 352.00	65 846.55	0.00
EUR BOUYGUES EUR1	2 694.00	90 819.37	0.01
EUR BUREAU VERITAS EURO.12	3 459.00	108 860.87	0.01
EUR CAPGEMINI EUR8	2 040.00	468 659.32	0.02
EUR CARREFOUR EUR2.50	8 293.00	136 471.86	0.01
EUR CIE DE ST-GOBAIN EUR4	6 441.00	407 304.42	0.02
EUR CNP ASSURANCES EUR1	2 273.00	55 186.60	0.00
EUR COVIVIO EUR3	700.00	57 691.50	0.00
EUR CREDIT AGRICOLE SA EUR3	14 413.00	195 750.01	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・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 DANONE EURO.25	8 290.00	485 130.34	0.03
EUR EDENRED EUR2	2 916.00	129 714.50	0.01
EUR EDF EURO.5	5 093.00	71 027.92	0.00
EUR EIFFAGE EUR4	1 031.00	95 415.78	0.01
EUR ENGIE EUR1	24 046.00	346 717.74	0.02
EUR ESSILORLUXOTTICA EURO.18	3 617.00	720 700.68	0.04
EUR EURAZEO NPV	594.00	48 373.67	0.00
EUR FAURECIA EUR7	1 462.00	62 369.27	0.00
EUR GETLINK SE EURO.40	6 268.00	92 071.15	0.01
EUR HERMES INTL NPV	403.00	749 828.57	0.04
EUR IPSEN EUR1	463.00	44 892.10	0.00
EUR KERING EUR4	951.00	729 401.63	0.04
EUR KLEPIERRE EUR1.40	2 350.00	49 424.81	0.00
EUR L ' OREAL EURO.20	3 203.00	1 433 105.48	0.07
EUR LEGRAND SA EUR4	3 329.00	362 646.51	0.02
EUR LVMH MOET HENNESSY EURO.30	3 525.00	2 724 250.28	0.14
EUR ORANGE EUR4	24 991.00	267 515.06	0.01
EUR ORPEA EUR2.5	646.00	60 643.28	0.00
EUR PERNOD RICARD EUR1.55	2 653.00	604 708.90	0.03
EUR PUBLICIS GROUPE SA EURO.40	2 939.00	189 027.03	0.01
EUR REMY COINTREAU EUR1.60	320.00	74 559.74	0.00
EUR RENAULT SA EUR3.81	2 435.00	78 004.19	0.00
EUR SAFRAN EURO.20	4 227.00	469 986.47	0.02
EUR SANOFI EUR2	14 363.00	1 355 764.02	0.07
EUR SARTORIUS STEDIM B EURO.20 (POST SUBD)	337.00	197 781.20	0.01
EUR SCHNEIDER ELECTRIC EUR8	6 832.00	1 201 347.30	0.06
EUR SEB SA EUR1	367.00	54 074.16	0.00
EUR SOC GENERALE EUR1.25	10 518.00	326 106.93	0.02
EUR SODEXO EUR4	1 099.00	91 590.03	0.01
EUR SUEZ EUR4	4 451.00	98 873.26	0.01
EUR TELEPERFORMANCE EUR2.50	735.00	300 067.51	0.02
EUR THALES EUR3	1 378.00	112 422.05	0.01
EUR TOTALENERGIES SE EUR2.5	31 724.00	1 450 123.58	0.08
EUR UBISOFT ENTERTAIN EURO.31	1 266.00	64 567.18	0.00
EUR UNIBAIL-RODAMCO-WE NPV(1 ORD UNIBAIL-R & 1CLS)	1 459.00	95 578.97	0.01
EUR VALEO EUR1 (POST SUBD)	2 868.00	82 448.76	0.00
EUR VEOLIA ENVIRONNEME EUR5	8 477.00	270 984.60	0.01
EUR VINCI EUR2.50	6 810.00	641 282.01	0.03
EUR VIVENDI SA EUR5.50	8 257.00	104 558.39	0.01
EUR WENDEL EUR4	375.00	42 674.31	0.00
EUR WORLDLINE EURO.68	2 831.20	147 819.66	0.01
フランス合計		21 989 668.19	1.14

ドイツ

EUR BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG EUR1	4 134.00	395 431.52	0.02
EUR BECHTLE AG NPV	1 065.00	76 457.17	0.00
EUR BEIERSDORF AG NPV	1 334.00	132 466.78	0.01
EUR CARL ZEISS MEDITEC NPV	542.00	107 952.81	0.01
EUR COMMERZBANK AG NPV	13 090.00	91 867.14	0.00
EUR CONTINENTAL AG ORD NPV	1 425.00	151 896.91	0.01
EUR COVESTRO AG NPV	2 362.00	132 507.97	0.01
EUR FRESENIUS MED CARE NPV	2 616.00	155 414.38	0.01
EUR FRESENIUS SE & CO. KGAA NPV	5 453.00	205 588.86	0.01
EUR GEA GROUP AG NPV	1 971.00	99 236.08	0.00

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・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 HEIDELBERGCEMENT NPV	1 817.00	120 954.03	0.01
EUR HELLOFRESH SE NPV	2 199.00	221 282.38	0.01
EUR HENKEL AG & CO KGAA	1 482.00	109 346.52	0.01
EUR KION GROUP AG NPV	953.00	102 335.27	0.01
EUR KNORR BREMSE AG NPV	798.00	78 828.56	0.00
EUR LANXESS AG NPV	1 089.00	62 857.92	0.00
EUR MERCK KGAA NPV	1 620.00	399 158.02	0.02
EUR NEMETSCHEK SE ORD NPV	768.00	96 646.72	0.00
EUR PUMA SE NPV	1 281.00	153 922.14	0.01
EUR RATIONAL AG NPV	57.00	52 238.42	0.00
EUR RWE AG (NEU) NPV	7 858.00	302 055.55	0.02
EUR SAP AG ORD NPV	13 277.00	1 691 428.83	0.09
EUR SYMRISE AG NPV (BR)	1 576.00	220 856.23	0.01
EUR TEAMVIEWER AG NPV	2 013.00	27 167.34	0.00
EUR VOLKSWAGEN AG ORD NPV	394.00	109 275.05	0.01
EUR ZALANDO SE NPV	2 593.00	234 253.32	0.01
ドイツ合計		5 531 425.92	0.29
香港			
HKD AIA GROUP LTD NPV	151 200.00	1 591 354.38	0.08
HKD BOC HONG KONG HLDG HKD5	49 500.00	149 531.48	0.01
HKD CHOW TAI FOOK JEWE HKD1	12 400.00	22 236.45	0.00
HKD CK ASSET HOLDINGS HKD1	26 500.00	151 606.30	0.01
HKD CK HUTCHISON HLDGS HKD1.0	36 500.00	228 714.64	0.01
HKD CK INFRASTRUCTURE HKD1	9 500.00	55 019.66	0.00
HKD CLP HOLDINGS HKD5	20 000.00	196 001.72	0.01
HKD GALAXY ENTERTAINME HKD0.10	29 000.00	158 654.93	0.01
HKD HANG LUNG PROP HKD1	26 000.00	51 560.77	0.00
HKD HANG SENG BANK HKD5	10 500.00	185 868.12	0.01
HKD HENDERSON LAND DEV HKD2	19 000.00	77 746.49	0.01
HKD HKT TRUST AND HKT SHARE STAPLED UNIT	37 000.00	50 213.90	0.00
HKD HONG KONG EXCHANGE HKD1	15 300.00	843 910.54	0.04
USD HONGKONG LAND HLD ORD USD0.10(SINGAPORE REG)	14 300.00	77 220.00	0.01
HKD HONGKONG&CHINA GAS HKD0.25	132 300.00	197 537.41	0.01
USD JARDINE MATHESON COM USD0.25(BERMUDA REG)	2 500.00	141 475.00	0.01
HKD MTR CORP HKD1	20 500.00	109 391.54	0.01
HKD POWER ASSETS HOLDINGS LTD HKD1	17 500.00	105 392.61	0.01
HKD SINO LAND CO HKD1	38 000.00	45 429.30	0.00
HKD SITC INTERNATIONAL HKD0.10	15 000.00	60 128.15	0.00
HKD SUN HUNG KAI PROP NPV	17 500.00	212 805.53	0.01
HKD SWIRE PACIFIC 'A' HKD0.60	7 500.00	41 512.47	0.00
HKD SWIRE PROPERTIES LTD HKD1	15 000.00	35 634.34	0.00
HKD TECHTRONIC INDUSTR HKD0.1	17 500.00	361 185.76	0.02
HKD THE LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	28 200.00	244 530.10	0.01
HKD WH GROUP LTD USD0.0001	121 603.00	76 276.31	0.00
HKD WHARF REAL ESTATE HKD0.1	23 000.00	116 536.36	0.01
HKD XINYI GLASS HLDGS HKD0.1	22 000.00	53 674.71	0.00
香港合計		5 641 148.97	0.29
アイルランド			
GBP DCC ORD EURO.25	1 309.00	95 907.47	0.00
EUR FLUTTER ENTERTAINM ORD EURO.09	2 061.00	277 803.43	0.01
EUR KERRY GROUP 'A' ORD EURO.125(DUBLIN LIST)	2 071.00	253 159.37	0.01
アイルランド合計		626 870.27	0.02

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・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 （％）
イスラエル			
ILS AZRIELI GROUP ILS0.01	352.00	32 165.05	0.00
ILS BANK HAPOLIM B.M. ILS1	13 536.00	132 367.66	0.01
ILS BK LEUMI LE ISRAEL ILS1	17 529.00	169 690.22	0.01
USD CHECK POINT SFTWRE ORD ILS0.01	1 399.00	155 722.69	0.01
USD CYBER-ARK SOFTWARE COM ILS0.01	500.00	86 425.00	0.00
ILS ICL GROUP LTD ILS1	8 479.00	74 330.69	0.00
ILS ISRAEL DISCOUNT BK ILS0.10 SER ' A '	14 763.00	90 762.00	0.01
ILS NICE SYSTEMS ILS1	829.00	236 545.16	0.01
USD WIX.COM LTD COM ILS0.01	700.00	106 960.00	0.01
イスラエル合計		1 084 968.47	0.06
イタリア			
EUR AMPLIFON EURO.02	1 560.00	75 715.96	0.00
EUR ASSIC GENERALI SPA EUR1	14 056.00	280 514.02	0.02
EUR DIASORIN SPA EUR1	359.00	76 272.06	0.01
EUR FINECOBANK SPA EURO.33	7 999.00	139 466.92	0.01
EUR INFRASTRUTTURE WIR NPV	4 622.00	52 727.57	0.00
EUR POSTE ITALIANE SPA NPV	5 433.00	68 125.39	0.00
EUR TELECOM ITALIA SPA EURO.55	101 335.00	52 468.83	0.00
イタリア合計		745 290.75	0.04
日本			
JPY アドバンテスト	2 600.00	228 755.12	0.01
JPY アイシン	2 000.00	73 451.05	0.00
JPY 朝日インテック	2 600.00	56 971.24	0.00
JPY アズビル	1 700.00	75 159.63	0.00
JPY バンダイナムコホールディングス	2 600.00	202 353.25	0.01
JPY ベネフィット・ワン	500.00	23 426.84	0.00
JPY カブコン	2 200.00	54 813.51	0.00
JPY 東海旅客鉄道	1 700.00	233 563.79	0.01
JPY 千葉銀行	5 300.00	30 853.85	0.00
JPY 中外製薬	8 800.00	285 208.51	0.02
JPY コンコルディア・フィナンシャルグループ	14 500.00	52 741.20	0.00
JPY コスモス薬品	300.00	46 527.81	0.00
JPY サイバーエージェント	5 100.00	94 009.42	0.01
JPY 第一生命ホールディングス	12 800.00	257 814.96	0.01
JPY ダイフク	1 300.00	104 073.27	0.01
JPY 第一三共	22 300.00	554 725.88	0.03
JPY ダイキン工業	3 200.00	652 428.55	0.03
JPY 大東建託	900.00	97 415.12	0.01
JPY 大和ハウス工業	7 400.00	216 111.67	0.01
JPY 大和ハウスリート投資法人	27.00	76 925.45	0.00
JPY ディスコ	300.00	86 133.25	0.01
JPY エーザイ	3 000.00	181 593.20	0.01
JPY ファナック	2 400.00	470 192.44	0.03
JPY ファーストリテイリング	700.00	415 518.08	0.02
JPY 富士電機	2 000.00	104 628.12	0.01
JPY G L P 投資法人	52.00	82 571.67	0.01
JPY G M O ペイメントゲートウェイ	600.00	80 479.11	0.01
JPY 阪急阪神ホールディングス	3 000.00	88 907.48	0.01
JPY 光通信	300.00	43 489.37	0.00
JPY ヒロセ電機	220.00	36 910.48	0.00
JPY ホシザキ	600.00	45 550.22	0.00

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・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 ヒューリック	3 300.00	31 272.18	0.00
JPY イビデン	1 300.00	80 945.88	0.01
JPY 出光興産	2 058.00	53 124.29	0.00
JPY いすゞ自動車	6 200.00	83 653.18	0.01
JPY 伊藤園	500.00	29 371.61	0.00
JPY 伊藤忠テクノソリューションズ	900.00	29 287.95	0.00
JPY 日本取引所グループ	6 400.00	138 602.32	0.01
JPY かんぽ生命保険	2 400.00	37 158.84	0.00
JPY ジャパンリアルエステイト投資法人	16.00	92 298.21	0.01
JPY J S R	2 700.00	100 823.46	0.01
JPY 鹿島建設	5 100.00	56 190.06	0.00
JPY カカクコム	1 800.00	50 332.47	0.00
JPY 関西電力	7 800.00	70 550.00	0.00
JPY 関西ペイント	1 900.00	42 670.31	0.00
JPY 花王	5 900.00	300 702.81	0.02
JPY 京王電鉄	1 400.00	63 005.86	0.00
JPY 京成電鉄	1 700.00	46 563.04	0.00
JPY キッコーマン	1 900.00	144 911.71	0.01
JPY 近鉄グループホールディングス	2 500.00	71 777.70	0.00
JPY キリンホールディングス	10 800.00	172 826.63	0.01
JPY 小林製薬	800.00	62 847.33	0.00
JPY 神戸物産	1 600.00	60 310.89	0.00
JPY コーエーテックモホールディングス	520.00	21 776.39	0.00
JPY 小糸製作所	1 300.00	74 763.31	0.00
JPY 小松製作所	10 400.00	237 410.72	0.01
JPY コーセー	400.00	48 157.12	0.00
JPY 栗田工業	1 800.00	84 019.55	0.01
JPY レーザーテック	1 000.00	261 966.62	0.01
JPY ライオン	2 700.00	38 308.16	0.00
JPY エムスリー	5 800.00	312 565.06	0.02
JPY マキタ	2 800.00	122 904.58	0.01
JPY 日本マクドナルドホールディングス	700.00	31 133.03	0.00
JPY 明治ホールディングス	1 500.00	87 982.74	0.01
JPY ミネベアミツミ	4 800.00	126 821.96	0.01
JPY ミスミグループ本社	3 800.00	160 139.15	0.01
JPY 三菱瓦斯化学	1 900.00	31 609.49	0.00
JPY 三菱H Cキャピタル	5 200.00	24 455.50	0.00
JPY 三井化学	2 800.00	75 089.17	0.00
JPY 三井不動産	12 000.00	246 880.09	0.01
JPY 三浦工業	1 100.00	38 605.84	0.00
JPY M o n o t a R O	2 900.00	57 619.45	0.00
JPY 日本電産	5 700.00	652 604.69	0.03
JPY 日本M & Aセンター	4 400.00	129 235.11	0.01
JPY 日本ビルファンド投資法人	22.00	135 629.05	0.01
JPY 日本通運	1 100.00	62 679.99	0.00
JPY 日本ペイントホールディングス	9 500.00	99 815.05	0.01
JPY 日本酸素ホールディングス	1 900.00	40 210.49	0.00
JPY 日本新薬	600.00	44 387.69	0.00
JPY 日本製鉄	10 600.00	158 656.92	0.01
JPY 日産化学	1 600.00	92 157.29	0.01
JPY 日清製粉グループ本社	2 200.00	31 698.45	0.00
JPY 日清食品ホールディングス	700.00	51 415.74	0.00
JPY ニトリホールディングス	1 100.00	174 670.84	0.01
JPY 日東電工	1 800.00	125 236.69	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・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 野村不動産ホールディングス	1 400.00	30 393.24	0.00
JPY 大林組	7 600.00	55 956.67	0.00
JPY オービック	900.00	166 374.57	0.01
JPY 小田急電鉄	4 000.00	77 044.34	0.00
JPY 王子ホールディングス	13 200.00	61 033.07	0.00
JPY オリンパス	14 200.00	317 528.73	0.02
JPY 小野薬品工業	4 600.00	101 504.25	0.01
JPY オープンハウス	600.00	34 030.56	0.00
JPY 日本オラクル	500.00	49 143.51	0.00
JPY オリエンタルランド	2 600.00	408 507.64	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	4 800.00	81 842.44	0.01
JPY パーソルホールディングス	1 300.00	37 553.39	0.00
JPY ポーラ・オルビスホールディングス	500.00	8 903.96	0.00
JPY 楽天グループ	10 600.00	108 385.22	0.01
JPY リクルートホールディングス	17 200.00	1 045 375.84	0.06
JPY リンナイ	500.00	47 205.95	0.00
JPY 良品計画	2 300.00	37 170.28	0.00
JPY S B I ホールディングス	2 600.00	66 954.95	0.00
JPY S C S K	1 500.00	28 468.89	0.00
JPY セコム	2 600.00	175 493.42	0.01
JPY 積水ハウス	7 400.00	144 031.00	0.01
JPY シャープ	2 500.00	27 962.48	0.00
JPY シマノ	1 000.00	276 542.34	0.02
JPY 清水建設	9 400.00	59 357.96	0.00
JPY 信越化学工業	4 500.00	753 005.42	0.04
JPY 塩野義製薬	3 400.00	237 246.91	0.01
JPY 資生堂	5 200.00	297 816.72	0.02
JPY 静岡銀行	8 000.00	56 365.32	0.00
JPY S M C	700.00	447 884.10	0.02
JPY スクウェア・エニックス・ホールディングス	1 000.00	52 225.99	0.00
JPY スタンレー電気	1 700.00	44 197.45	0.00
JPY 住友金属鉱山	3 000.00	111 841.12	0.01
JPY サントリー食品インターナショナル	2 000.00	70 544.72	0.00
JPY スズキ	4 600.00	185 750.14	0.01
JPY シスメックス	2 200.00	274 358.18	0.02
JPY T & D ホールディングス	6 500.00	76 824.17	0.00
JPY 大成建設	2 300.00	67 048.31	0.00
JPY 大正製薬ホールディングス	400.00	19 657.40	0.00
JPY テルモ	8 400.00	342 377.03	0.02
JPY T I S	2 400.00	74 190.85	0.00
JPY 東武鉄道	2 500.00	56 475.40	0.00
JPY 東宝	1 900.00	84 503.94	0.01
JPY 東京センチュリー	400.00	19 093.75	0.00
JPY 東京瓦斯	5 000.00	85 648.86	0.01
JPY 東急	6 700.00	92 700.69	0.01
JPY 東レ	17 600.00	102 427.06	0.01
JPY 東ソー	3 100.00	44 529.48	0.00
JPY T O T O	1 800.00	79 739.31	0.00
JPY 東洋水産	1 000.00	40 512.57	0.00
JPY 豊田自動織機	2 000.00	164 163.99	0.01
JPY 豊田通商	2 800.00	122 189.44	0.01
JPY ツルハホールディングス	500.00	56 365.32	0.00
JPY ユー・エス・エス	2 500.00	36 681.49	0.00
JPY ウエルシアホールディングス	1 100.00	38 993.35	0.00

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・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 ヤクルト本社	1 500.00	74 904.22	0.00
JPY ヤマハ	1 400.00	71 760.10	0.00
JPY ヤマトホールディングス	4 100.00	90 417.02	0.01
JPY Z O Z O	920.00	29 290.59	0.00
日本合計		18 601 631.31	0.96
ルクセンブルグ			
EUR AROUNDTOWN SA EURO.01	13 795.00	82 296.56	0.01
ルクセンブルグ合計		82 296.56	0.01
マカオ			
HKD SANDS CHINA LTD USD0.01 REG ' S '	33 600.00	77 234.94	0.00
マカオ合計		77 234.94	0.00
オランダ			
EUR AKZO NOBEL NV EURO.50(POST REV SPLIT)	2 376.00	248 507.63	0.01
EUR ARGEN X NV EURO.10	594.00	165 145.78	0.01
EUR ASM INTL NV EURO.04	568.00	253 690.43	0.01
EUR EURONEXT EUR1.60	456.00	44 577.81	0.00
EUR EXOR NV EURO.01	1 486.00	129 964.25	0.01
EUR HEINEKEN HOLDING EUR1.6	1 498.00	124 016.24	0.01
EUR HEINEKEN NV EUR1.60	3 254.00	322 098.05	0.02
EUR ING GROEP N.V. EURO.01	49 402.00	678 848.93	0.03
EUR JUST EAT TAKEAWAY EURO.04	2 234.00	138 780.24	0.01
EUR KON KPN NV EURO.04	42 139.00	123 369.74	0.01
EUR KONINKLIJKE AHOLD EURO.01	12 937.00	431 759.96	0.02
EUR KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20	11 318.00	397 409.98	0.02
EUR QIAGEN NV EURO.01	3 110.00	171 530.18	0.01
EUR RANDSTAD N.V. EURO.10	1 611.00	101 039.39	0.01
GBP ROYAL DUTCH SHELL ' B ' SHS EURO.07 (UK LIST)	47 156.00	984 098.65	0.05
EUR STMICROELECTRONICS EUR1.04	8 354.00	405 515.69	0.02
EUR VOPAK(KON) EURO.50	1 121.00	42 345.93	0.00
EUR WOLTERS KLUWER EURO.12	3 382.00	377 860.90	0.02
オランダ合計		5 140 559.78	0.27
ニュージーランド			
NZD AUCKLAND INTL NPV	15 331.00	82 200.68	0.01
NZD FISHER & PAYKEL HE NPV	7 488.00	169 386.58	0.01
NZD MERCURY NZ LTD NPV	5 403.00	22 075.44	0.00
NZD MERIDIAN ENERGY LT NPV	15 948.00	51 413.56	0.00
NZD RYMAN HEALTHCARE G NPV	5 971.00	49 845.97	0.00
NZD SPARK NEW ZEALAND NPV	21 585.00	67 388.80	0.00
AUD XERO LIMITED NPV	1 577.00	161 956.01	0.01
ニュージーランド合計		604 267.04	0.03
ノルウェー			
NOK GJENSIDIGE FORSIKR NOK2	1 887.00	42 539.23	0.00
NOK ORKLA ASA NOK1.25	8 480.00	77 081.18	0.01
NOK SCHIBSTED ASA SER ' A ' NOK0.50	824.00	36 563.54	0.00
NOK SCHIBSTED ASA SER ' B ' NOK0.5	1 068.00	40 955.42	0.00
NOK YARA INTERNATIONAL NOK1.7	2 107.00	103 045.02	0.01
ノルウェー合計		300 184.39	0.02

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・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 (%)
パプアニューギニア			
AUD OIL SEARCH LTD PGK0.10	26 863.00	72 569.87	0.00
パプアニューギニア合計		72 569.87	0.00
ポーランド			
EUR INPOST S.A. EURO.01	2 668.00	29 535.50	0.00
ポーランド合計		29 535.50	0.00
シンガポール			
SGD CITY DEVELOPMENTS SGD0.50	7 200.00	36 862.49	0.00
SGD DBS GROUP HLDGS SGD1	24 100.00	525 009.66	0.03
SGD KEPPEL CORP NPV	17 700.00	65 835.25	0.00
SGD MAPLETREE LOGISTICS TRUST-UNITS REIT	22 900.00	31 064.43	0.00
SGD OVERSEA-CHINESE BK NPV	44 687.00	357 847.98	0.02
SGD SINGAPORE AIRLINES NPV	17 500.00	62 155.85	0.00
SGD SINGAPORE EXCHANGE SGDO.01	10 400.00	67 732.92	0.01
SGD SINGAPORE TECH ENG NPV	21 600.00	60 019.69	0.00
SGD UOL GROUP LIMITED SGD1	5 300.00	26 593.74	0.00
SGD UTD O/S BANK SGD1	15 300.00	284 207.42	0.02
SGD VENTURE CORP LTD SGDO.25	3 700.00	49 948.58	0.00
SGD WILMAR INTERNATIONAL LTD	24 600.00	73 738.10	0.01
シンガポール合計		1 641 016.11	0.09
スペイン			
EUR ACS ACTIVIDADES CO EURO.5	2 850.00	68 040.83	0.00
EUR AENA SME S.A. EUR10	870.00	126 815.72	0.01
EUR AMADEUS IT GROUP EURO.01	5 676.00	360 845.39	0.02
EUR CAIXABANK SA EUR1	46 518.00	119 068.14	0.01
EUR CELLNEX TELECOM SA EURO.25	6 368.00	373 013.39	0.02
EUR EDP RENOVAVEIS SA EUR5	2 760.00	70 272.56	0.00
EUR ENAGAS SA EUR1.50	3 282.00	74 216.86	0.00
EUR ENDESA SA EUR1.2	4 307.00	96 159.28	0.01
EUR FERROVIAL SA EURO.2	6 616.00	182 897.57	0.01
EUR GRIFOLS SA EURO.25 (CLASS A) POST SUBD	3 978.00	70 880.99	0.00
EUR IBERDROLA SA EURO.75 (POST SUBDIVISION)	75 305.00	839 495.80	0.04
EUR INDITEX EURO.03 (POST SUBD)	13 878.00	435 203.20	0.02
EUR RED ELECTRICA CORP EURO.5	6 088.00	128 384.45	0.01
EUR REPSOL SA EUR1	18 473.00	203 586.30	0.01
EUR SIEMENS GAMESA REN EURO.17	3 099.00	82 078.16	0.00
EUR TELEFONICA SA EUR1	64 538.00	290 321.64	0.02
スペイン合計		3 521 280.28	0.18
スウェーデン			
SEK ASSA ABLQY SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	13 189.00	368 868.19	0.02
SEK ESSITY AB SER ' B ' NPV	7 354.00	233 715.01	0.01
SEK FASTIGHETS AB BALD SER ' B ' NPV	1 201.00	89 598.22	0.01
SEK HUSQVARNA AB SER ' B ' NPV	5 199.00	72 960.28	0.00
SEK ICA GRUPPEN AB	1 313.00	77 263.38	0.00
SEK INDUSTRIVARDEN AB SER ' C ' NPV	1 891.00	55 617.03	0.00
SEK INDUSTRIVARDEN AB SER ' A ' NPV	1 437.00	42 565.11	0.00
SEK LATOUR INVESTMENT SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	1 718.00	64 595.15	0.00
SEK LUNDBERGFORETAGEN SER ' B ' NPV	898.00	49 092.29	0.00
SEK LUNDIN ENERGY AB NPV	2 396.00	84 357.83	0.01
SEK SECURITAS SER ' B ' NPV	4 119.00	59 279.25	0.00

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・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 (%)
SEK SINCH AB NPV (POST SPLIT)	6 310.00	84 240.42	0.01
SEK SKANSKA AB SER ' B ' NPV	4 159.00	95 557.04	0.01
SEK SVENSKA CELLULOSA SER ' B ' NPV	7 794.00	126 640.58	0.01
SEK SVENSKA HANDELSBKN SER ' A ' NPV (P/S)	18 652.00	196 988.07	0.01
SEK TELIA COMPANY AB NPV	34 174.00	131 465.98	0.01
SEK VOLVO AB SER ' A ' NPV (POST SPLIT)	2 416.00	52 607.98	0.00
スウェーデン合計		1 885 411.81	0.10
スイス			
GBP GLENCORE XSTRATA ORD USD0.01	125 887.00	594 744.70	0.03
CHF ROCHE HLDGS AG CHF1(BR)	133.00	54 901.66	0.00
CHF SWATCH GROUP CHF2.25(BR)	367.00	107 633.24	0.01
CHF SWISS RE AG CHF0.10	3 773.00	352 429.35	0.02
CHF VIFOR PHARMA AG CHF0.01	574.00	64 012.10	0.00
スイス合計		1 173 721.05	0.06
イギリス			
GBP 3I GROUP ORD GBPO.738636	12 495.00	229 283.37	0.01
GBP ASTRAZENECA ORD USD0.25	19 644.00	2 150 850.63	0.11
GBP AVEVA GROUP ORD GBPO.03556	1 481.00	62 836.77	0.00
GBP AVIVA ORD GBPO.25	47 483.00	241 857.03	0.01
GBP BAE SYSTEMS ORD GBPO.025	40 503.00	293 755.55	0.02
GBP BARRATT DEVEL ORD GBPO.10	13 096.00	120 831.57	0.01
GBP BRIT AMER TOBACCO ORD GBPO.25	27 522.00	921 213.63	0.05
GBP BRITISH LAND CO PLC REIT	11 673.00	78 575.91	0.00
GBP BT GROUP ORD GBPO.05	119 093.00	249 890.22	0.01
USD COCA-COLA EUROPACI COM EURO.01	2 832.00	139 815.84	0.01
GBP EVRAZ PLC ORD USD1	7 119.00	54 250.20	0.00
GBP HALMA ORD GBPO.10	4 438.00	176 202.93	0.01
GBP HIKMA PHARMACEUTIC ORD GBPO.10	2 258.00	66 169.45	0.00
GBP INFORMA PLC (GB) ORD GBPO.001	19 042.00	117 649.28	0.01
GBP JOHNSON MATTHEY ORD GBP1.109245	2 512.00	69 657.96	0.00
GBP KINGFISHER ORD GBPO.157142857	26 726.00	112 015.72	0.01
GBP LAND SECURITIES GP ORD GBPO.106666666	9 398.00	90 391.94	0.00
GBP LLOYDS BANKING GP ORD GBPO.1	893 354.00	553 132.63	0.03
GBP NATIONAL GRID ORD GBPO.12431289	44 798.00	596 589.21	0.03
GBP OCADO GROUP PLC ORD GBPO.02	6 609.00	156 993.27	0.01
GBP RECKITT BENCK GRP ORD GBPO.10	8 980.00	725 900.99	0.04
GBP RELX PLC GBPO.1444	24 451.00	755 988.49	0.04
GBP RENTOKIL INITIAL ORD GBPO.01	25 026.00	203 159.27	0.01
GBP ROLLS-ROYCE HLDGS ORD GBPO.20	110 972.00	179 849.55	0.01
GBP SAGE GROUP GBPO.01051948	12 896.00	131 679.95	0.01
GBP SEVERN TRENT ORD GBPO.9789	3 396.00	129 665.32	0.01
GBP SMITHS GROUP ORD GBPO.375	5 007.00	95 521.84	0.01
GBP SPIRAX-SARCO ENG ORD GBPO.269230769	1 006.00	208 025.61	0.01
GBP SSE PLC ORD GBPO.50	13 290.00	272 883.04	0.01
GBP ST JAMES ' S PLACE ORD GBPO.15	6 928.00	141 931.55	0.01
GBP UNITED UTILITIES G ORD GBPO.05	9 287.00	133 249.28	0.01
GBP WHITBREAD ORD GBPO.76797385	2 574.00	95 453.42	0.00
GBP WPP PLC ORD GBPO.10	16 007.00	220 667.06	0.01
イギリス合計		9 775 938.48	0.51
無記名株式合計		97 777 739.08	5.07

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・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 (%)
参加証券			
スイス			
CHF LINDT & SPRUENGLI PTG CERT CHF10	11.00	134 439.16	0.01
CHF SCHINDLER-HLDG AG PTG CERT CHF0.10(POST-SUBD)	463.00	118 576.83	0.00
スイス合計		253 015.99	0.01
参加証券合計		253 015.99	0.01
その他の株式			
スイス			
CHF ROCHE HLDGS AG GENUSSSCHEINE NPV	9 221.00	3 583 674.79	0.19
スイス合計		3 583 674.79	0.19
その他の株式合計		3 583 674.79	0.19
優先株式			
ドイツ			
EUR BAYERISCHE MOTORENWERKE AG EUR1	834.00	65 149.28	0.01
EUR FUCHS PETROLUB SE PRF NPV (REG)	891.00	39 715.22	0.00
EUR HENKEL AG&CO. KGAA NON-VTG PRF NPV	2 085.00	163 577.26	0.01
EUR PORSCHE AUTO HL SE NON VTG PRF NPV	1 970.00	164 489.11	0.01
EUR SARTORIUS AG NON VTG PRF NPV	336.00	229 568.37	0.01
EUR VOLKSWAGEN AG NON VTG PRF NPV	2 395.00	435 804.97	0.02
ドイツ合計		1 098 304.21	0.06
優先株式合計		1 098 304.21	0.06
記名株式			
オーストラリア			
AUD AMPOL LTD NPV	3 138.00	63 790.72	0.00
AUD BHP GROUP LTD NPV	37 130.00	1 036 495.03	0.06
GBP BHP GROUP PLC ORD USD0.50	26 540.00	725 598.16	0.04
AUD COLES GROUP LTD NPV	17 285.00	220 851.85	0.01
オーストラリア合計		2 046 735.76	0.11
ベルギー			
EUR AGEAS NPV	2 439.00	125 269.79	0.01
EUR KBC GROUP NV NPV	3 281.00	273 362.79	0.01
EUR UCB NPV	1 499.00	162 214.56	0.01
ベルギー合計		560 847.14	0.03
カナダ			
CAD 1ST QUANTUM MINLS COM NPV	7 863.00	166 907.93	0.01
CAD AGNICO EAGLE MINES LTD COM	2 824.00	140 187.34	0.01
CAD ALIMENTATION COUCHE TARD INC SUB VTG SH	10 501.00	383 104.77	0.02
CAD BANK NOVA SCOTIA HALIFAX COM	15 229.00	947 123.18	0.05
CAD BANK OF MONTREAL COM NPV	8 166.00	846 901.03	0.04
CAD BARRICK GOLD CORP COM NPV	22 148.00	419 202.87	0.02
CAD BCE INC COM NEW	695.00	34 831.27	0.00

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・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 BLACKBERRY LTD NPV	7 298.00	69 236.56	0.00
CAD BROOKFIELD ASSET M LTD VTG SHS NPV CL 'A'	16 265.00	904 540.93	0.05
CAD BROOKFIELD ASST MG CL A EXCHANGEABLE LTD VTG S	1.00	57.15	0.00
CAD CAN PACIFIC RYS COM NPV	8 338.00	581 086.06	0.03
CAD CANADIAN NAT RES LTD COM	15 024.00	611 828.62	0.03
CAD CANADIAN NATL RY CO COM	8 976.00	1 132 565.76	0.06
CAD CANADIAN TIRE LTD CL A	786.00	103 452.01	0.01
CAD CCL INDUSTRIES INC 'B' NON-VTG COM NPV	1 969.00	96 224.36	0.01
CAD CDN IMPERIAL BK OF COMMERCE COM	5 753.00	638 848.50	0.03
CAD CENOVUS ENERGY INC COM NPV	17 469.00	206 446.87	0.01
CAD CGI INC COM NPV SUB VOTING SHARES C	2 767.00	230 195.07	0.01
CAD CONSTELLATION SOFT COM STK NPV	268.00	454 122.95	0.02
CAD DOLLARAMA INC COM NPV	3 442.00	148 058.59	0.01
CAD ENBRIDGE INC COM NPV	25 699.00	960 206.63	0.05
CAD FAIRFAX FINL HLDGS SUB-VTG COM NPV	369.00	163 084.31	0.01
CAD FIRSTSERVICE CORP COM NPV	500.00	95 704.71	0.01
CAD FORTIS INC COM NPV	5 974.00	257 345.84	0.01
CAD FRANCO NEVADA CORP COM NPV	2 388.00	326 106.83	0.02
CAD GFL ENVIRON INC COM NPV SUB VTG SHS	1 900.00	72 916.28	0.00
CAD GILDAN ACTIVEWEAR INC COM	2 624.00	105 855.94	0.01
CAD GREAT WEST LIFECO INC COM	3 592.00	103 828.62	0.01
CAD IA FINANCIAL CORP COM NPV	1 412.00	74 716.68	0.00
CAD IMPERIAL OIL LTD COM NEW	3 269.00	107 616.05	0.01
CAD INTACT FINL CORP COM NPV	1 978.00	244 428.25	0.01
CAD LIGHTSPEED COMMERC COM NPV SUB VTG SHS	1 400.00	70 523.85	0.00
CAD LOBLAW COS LTD COM	2 275.00	170 784.61	0.01
CAD MAGNA INTL INC COM NPV	3 756.00	280 353.13	0.02
CAD MANULIFE FINL CORP COM	24 511.00	436 413.50	0.02
CAD METRO INC CL A SUB	3 239.00	153 920.67	0.01
CAD NATL BK OF CANADA COM NPV	4 294.00	332 292.94	0.02
CAD NUTRIEN LTD NPV	7 204.00	475 549.36	0.03
CAD OPEN TEXT CO COM NPV	3 146.00	148 520.24	0.01
CAD PARKLAND CORP. COM NPV	2 000.00	51 418.77	0.00
CAD PEMBINA PIPELINE C COM NPV	7 142.00	210 451.82	0.01
CAD POWER CORP CDA COM	7 289.00	234 159.41	0.01
CAD RESTAURANT BRANDS COM NPV	3 387.00	188 703.53	0.01
CAD ROGERS COMMS INC CLASS 'B' COM CAD1.62478	4 835.00	215 441.69	0.01
CAD ROYAL BK OF CANADA COM NPV	18 010.00	1 773 201.59	0.09
CAD SAPUTO INC COM	3 225.00	71 096.82	0.00
CAD SHAW COMMUNICATIONS INC CL B CONV	5 304.00	152 984.10	0.01
CAD SHOPIFY INC COM NPV CL A	1 432.00	2 166 787.47	0.11
CAD SUN LIFE FINL INC COM	7 103.00	375 581.92	0.02
CAD SUNCOR ENERGY INC COM NPV 'NEW'	18 939.00	459 449.39	0.02
CAD TC ENERGY CORPORAT COM NPV	12 494.00	583 598.75	0.03
CAD TECK RESOURCES LTD CLASS 'B' SUB-VTG COM NPV	6 323.00	166 996.60	0.01
CAD THOMSON-REUTERS CP COM NPV(POST REV SPLIT)	2 260.00	269 286.72	0.01
CAD TORONTO-DOMINION COM NPV	22 942.00	1 612 271.05	0.08
CAD WESTON GEORGE LTD COM	1 056.00	110 983.72	0.01
CAD WHEATON PRECIOUS M COM NPV	5 991.00	249 484.89	0.01
カナダ合計		21 586 988.50	1.12
デンマーク			
DKK CARLSBERG SER 'B' DKK20	1 240.00	191 428.98	0.01
DKK COLOPLAST DKK1 B	1 574.00	255 617.32	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・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 (%)
DKK DEMANT A/S DKK0.20	1 351.00	64 143.95	0.00
DKK NOVO-NORDISK AS DKK0.2 SER ' B '	21 388.00	2 281 183.81	0.12
DKK TRYG A/S DKK5	4 246.00	102 147.17	0.01
DKK VESTAS WIND SYSTEM DKK0.20 (POST SPLIT)	12 711.00	423 241.49	0.02
デンマーク合計		3 317 762.72	0.17
フィンランド			
EUR ELISA OYJ NPV	2 089.00	124 529.00	0.01
EUR FORTUM OYJ EUR3.40	6 012.00	171 952.19	0.01
EUR NESTE OIL OYJ NPV	5 218.00	245 331.12	0.01
EUR NOKIA OYJ NPV	67 826.00	375 197.24	0.02
SEK NORDEA HOLDING ABP NPV	42 444.00	501 019.46	0.03
EUR ORION CORP SER ' B ' NPV	1 483.00	60 577.62	0.00
EUR SAMPO PLC SER ' A ' NPV	6 257.00	305 590.53	0.01
EUR STORA ENSO OYJ NPV SER ' R '	7 746.00	130 565.49	0.01
EUR UPM-KYMMENE CORP NPV	6 592.00	237 809.56	0.01
フィンランド合計		2 152 572.21	0.11
フランス			
EUR DASSAULT AVIATION EURO0.80 (POST SUBDIVISION)	290.00	27 289.05	0.00
EUR DASSAULT SYSTEMES EURO0.10	8 401.00	502 973.45	0.03
EUR GECINA EUR7.50	676.00	90 852.13	0.00
EUR LA FRANCAISE DES EURO0.40 (PROMESSES)	1 199.00	55 198.41	0.00
EUR MICHELIN (CGDE) EUR2	2 108.00	309 645.81	0.02
フランス合計		985 958.85	0.05
ドイツ			
EUR ADIDAS AG NPV (REGD)	2 412.00	693 804.76	0.04
EUR ALLIANZ SE NPV(REGD)(VINKULIERT)	5 234.00	1 133 739.17	0.06
EUR BASF SE NPV	11 650.00	758 994.33	0.04
EUR BAYER AG NPV (REGD)	12 420.00	622 387.46	0.03
EUR BRENNTAG AG	1 844.00	157 123.40	0.01
EUR DAIMLER AG ORD NPV(REGD)	10 824.00	1 011 230.04	0.05
EUR DELIVERY HERO SE NPV	2 008.00	266 026.10	0.01
EUR DEUTSCHE BANK AG NPV(REGD)	25 484.00	305 779.87	0.02
EUR DEUTSCHE BOERSE AG NPV(REGD)	2 394.00	373 483.54	0.02
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA ORD NPV (REGD)(VINK)	7 890.00	47 610.96	0.00
EUR DEUTSCHE POST AG NPV(REGD)	12 658.00	743 310.06	0.04
EUR DEUTSCHE TELEKOM NPV(REGD)	42 166.00	739 838.43	0.04
EUR E.ON SE NPV	28 482.00	349 254.44	0.02
EUR EVONIK INDUSTRIES NPV	2 596.00	77 755.95	0.00
EUR HANNOVER RUECKVERS ORD NPV(REGD)	784.00	136 474.05	0.01
EUR INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)	16 571.00	744 787.04	0.04
EUR LEG IMMOBILIEN SE NPV	826.00	114 823.58	0.01
EUR MTU AERO ENGINES H NPV (REGD)	700.00	129 967.40	0.01
EUR MUENCHENER RUECKVE NPV(REGD)	1 785.00	478 891.87	0.02
EUR SCOUT24 AG NPV	986.00	65 036.72	0.00
EUR SIEMENS AG NPV(REGD)	9 707.00	1 543 653.42	0.08
EUR SIEMENS ENERGY AG NPV	5 283.00	139 387.01	0.01
EUR SIEMENS HEALTHINEE NPV	3 491.00	252 743.48	0.01
EUR TELEFONICA DEUTSCH NPV	14 200.00	37 689.14	0.00
EUR UNIPER SE NPV	1 156.00	49 991.86	0.00
EUR UNITED INTERNET AG NPV(REGD)	1 429.00	53 321.19	0.00
EUR VONOVIA SE NPV	6 848.00	377 697.33	0.02
ドイツ合計		11 404 802.60	0.59

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・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 (%)
香港			
HKD BUDWEISER BREWING USD0.00001	21 800.00	55 367.92	0.00
HKD ESR CAYMAN LIMITED USD0.001	20 400.00	67 512.84	0.00
HKD NEW WORLD DEVEL CO NPV POST CON	23 000.00	90 868.86	0.01
香港合計		213 749.62	0.01
アイルランド			
EUR CRH ORD EURO.32	9 944.00	480 402.12	0.02
GBP EXPERIAN ORD USD0.10	11 589.00	518 229.95	0.03
EUR KINGSPAN GROUP ORD EURO.13(DUBLIN LISTING)	1 924.00	221 329.88	0.01
EUR SMURFIT KAPPA GRP ORD EURO.001	3 458.00	175 232.46	0.01
アイルランド合計		1 395 194.41	0.07
マン島			
GBP ENTAIN PLC ORD EURO.01	7 500.00	165 606.53	0.01
マン島合計		165 606.53	0.01
イスラエル			
USD FIVERR INTERNATION COM NPV	136.00	19 260.32	0.00
ILS MIZRAHI TEFAHOT BK ILS0.01	1 568.00	57 979.15	0.00
イスラエル合計		77 239.47	0.00
イタリア			
EUR ATLANTIA SPA EUR1	6 487.00	117 777.50	0.01
EUR DAVIDE CAMPARI MIL EURO.01	7 515.00	108 865.84	0.01
EUR ENEL EUR1	102 863.00	776 553.85	0.04
EUR ENI SPA EUR1	32 145.00	421 235.64	0.02
EUR FERRARI NV EURO.01(NEW)	1 588.00	414 152.81	0.02
EUR INTESA SANPAOLO NPV	206 199.00	491 002.46	0.02
EUR MEDIABANCA SPA EURO.5	7 762.00	85 359.58	0.00
EUR MONCLER SPA NPV	2 629.00	189 625.69	0.01
EUR NEXI SPA NPV	5 875.00	89 637.87	0.00
EUR PRYSMIAN SPA EURO.10	3 159.00	116 593.71	0.01
EUR RECORDATI EURO.125	1 379.00	86 054.10	0.00
EUR SNAM EUR1	26 819.00	150 152.46	0.01
EUR TERNA SPA ORD EURO.22	19 897.00	147 276.51	0.01
EUR UNICREDIT SPA NPV (POST REV SPLIT)	27 372.00	329 358.08	0.02
イタリア合計		3 523 646.10	0.18
日本			
JPY イオン	8 600.00	200 296.80	0.01
JPY A G C	2 700.00	131 974.11	0.01
JPY 味の素	6 000.00	180 034.35	0.01
JPY A N A ホールディングス	1 100.00	21 695.80	0.00
JPY アサヒグループホールディングス	5 900.00	217 927.69	0.01
JPY 旭化成	16 300.00	153 819.63	0.01
JPY アステラス製薬	24 400.00	382 401.69	0.02
JPY ブリヂストン	7 100.00	287 951.91	0.02
JPY ブラザー工業	3 600.00	61 952.53	0.00
JPY キヤノン	12 300.00	270 817.74	0.01
JPY 中部電力	8 800.00	88 817.65	0.01
JPY 大日本印刷	2 600.00	60 978.47	0.00
JPY 大和証券グループ本社	20 000.00	111 127.75	0.01
JPY デンソー	5 700.00	418 219.21	0.02

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・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 電通グループ	2 600.00	82 663.26	0.00
JPY 東日本旅客鉄道	4 000.00	246 105.07	0.01
JPY E N E O Sホールディングス	40 300.00	150 275.40	0.01
JPY 富士フイルムホールディングス	4 500.00	353 952.18	0.02
JPY 富士通	2 500.00	413 822.71	0.02
JPY 博報堂D Yホールディングス	2 400.00	35 784.93	0.00
JPY 浜松ホトニクス	1 900.00	116 799.51	0.01
JPY 日野自動車	4 800.00	39 906.64	0.00
JPY 日立建機	1 700.00	49 407.72	0.00
JPY 日立金属	2 500.00	46 281.21	0.00
JPY 日立製作所	12 300.00	724 491.61	0.04
JPY 本田技研工業	20 400.00	557 139.46	0.03
JPY H O Y A	4 700.00	745 906.91	0.04
JPY 飯田グループホールディングス	1 500.00	31 018.54	0.00
JPY I N P E X	13 500.00	111 405.17	0.01
JPY 伊藤忠商事	15 000.00	430 666.26	0.02
JPY 日本航空	2 100.00	38 025.45	0.00
JPY 日本都市ファンド投資法人	92.00	79 242.59	0.00
JPY ゆうちょ銀行	2 200.00	17 980.54	0.00
JPY 日本郵政	27 700.00	208 826.46	0.01
JPY 日本たばこ産業	14 900.00	298 341.19	0.02
JPY ジェイ エフ イー ホールディングス	6 600.00	76 494.78	0.00
JPY K D D I	20 400.00	592 892.69	0.03
JPY キーエンス	2 500.00	1 548 505.00	0.08
JPY コナミホールディングス	1 100.00	56 286.05	0.00
JPY クボタ	13 700.00	285 836.45	0.02
JPY 京セラ	3 800.00	225 265.75	0.01
JPY 協和キリン	3 400.00	94 922.72	0.01
JPY ローソン	500.00	24 395.61	0.00
JPY L I X I L	3 200.00	78 601.44	0.00
JPY 丸紅	19 600.00	175 639.61	0.01
JPY マツダ	8 800.00	71 147.12	0.00
JPY メディカルホールディングス	1 600.00	28 746.31	0.00
JPY メルカリ	1 300.00	78 885.02	0.00
JPY 三菱ケミカルホールディングス	15 000.00	117 865.16	0.01
JPY 三菱商事	16 100.00	480 823.46	0.03
JPY 三菱電機	22 300.00	279 768.81	0.01
JPY 三菱地所	15 300.00	210 881.15	0.01
JPY 三菱重工業	3 800.00	85 708.75	0.00
JPY 三菱U F Jフィナンシャル・グループ	154 500.00	818 321.37	0.04
JPY 三井物産	19 200.00	432 378.35	0.02
JPY みずほフィナンシャルグループ	30 030.00	370 796.25	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	5 700.00	166 464.40	0.01
JPY 村田製作所	7 300.00	538 764.37	0.03
JPY 日本電気	3 300.00	148 804.44	0.01
JPY ネクソン	6 500.00	129 032.54	0.01
JPY 日本碍子	2 700.00	42 731.08	0.00
JPY 任天堂	1 400.00	617 728.65	0.03
JPY 日本プロロジスリート投資法人	26.00	84 609.63	0.00
JPY 日本電信電話	16 200.00	445 858.47	0.02
JPY 日本郵船	2 000.00	130 344.80	0.01
JPY 日産自動車	27 900.00	138 314.41	0.01
JPY 野村ホールディングス	38 600.00	162 293.72	0.01
JPY 野村不動産マスターファンド投資法人	62.00	88 130.70	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・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	4 100.00	176 212.07	0.01
JPY エヌ・ティ・ティ・データ	7 800.00	164 456.38	0.01
JPY オムロン	2 400.00	231 767.14	0.01
JPY オリックス	15 400.00	304 487.21	0.02
JPY オリックス不動産投資法人	29.00	46 100.66	0.00
JPY 大阪瓦斯	5 200.00	83 670.79	0.00
JPY 大塚商会	1 500.00	68 563.12	0.00
JPY 大塚ホールディングス	5 000.00	182 570.79	0.01
JPY パナソニック	29 000.00	317 341.14	0.02
JPY ルネサスエレクトロニクス	16 100.00	204 466.95	0.01
JPY リそなホールディングス	24 200.00	88 577.39	0.01
JPY リコー	8 200.00	72 434.72	0.00
JPY ローム	1 200.00	112 343.12	0.01
JPY 参天製薬	4 300.00	56 957.15	0.00
JPY セイコーエプソン	2 800.00	45 127.48	0.00
JPY 積水化学工業	4 200.00	68 246.07	0.00
JPY セブン&アイ・ホールディングス	9 400.00	377 010.00	0.02
JPY S Gホールディングス	4 300.00	95 054.82	0.01
JPY 島津製作所	3 000.00	127 086.18	0.01
JPY ソフトバンク	36 800.00	506 407.15	0.03
JPY ソフトバンクグループ	15 300.00	812 532.48	0.04
JPY 総合警備保障	1 100.00	46 888.90	0.00
JPY S O M P Oホールディングス	4 000.00	164 657.18	0.01
JPY ソニーグループ	16 000.00	1 948 126.30	0.10
JPY S U B A R U	6 900.00	130 197.28	0.01
JPY S U M C O	3 400.00	74 500.86	0.00
JPY 住友化学	23 000.00	106 142.94	0.01
JPY 住友商事	14 100.00	191 982.03	0.01
JPY 大日本住友製薬	2 700.00	32 862.74	0.00
JPY 住友電気工業	9 700.00	127 246.03	0.01
JPY 三井住友フィナンシャルグループ	16 400.00	534 846.98	0.03
JPY 三井住友トラスト・ホールディングス	4 400.00	137 954.12	0.01
JPY 住友不動産	3 500.00	109 088.91	0.01
JPY 武田薬品工業	19 949.00	532 523.84	0.03
JPY T D K	4 700.00	186 269.76	0.01
JPY 東京海上ホールディングス	7 900.00	397 139.46	0.02
JPY 東京電力ホールディングス	21 200.00	56 573.16	0.00
JPY 東京エレクトロン	1 900.00	1 001 329.87	0.05
JPY 凸版印刷	2 600.00	39 453.96	0.00
JPY 東芝	5 200.00	207 322.21	0.01
JPY トヨタ自動車	134 400.00	2 368 527.02	0.12
JPY トrendマイクロ	2 000.00	115 372.76	0.01
JPY ユニ・チャーム	5 300.00	228 159.76	0.01
JPY 西日本旅客鉄道	2 100.00	90 587.87	0.01
JPY ヤマハ発動機	3 300.00	83 092.17	0.00
JPY 安川電機	3 100.00	138 966.93	0.01
JPY 横河電機	2 500.00	47 007.79	0.00
JPY Zホールディングス	35 000.00	231 802.37	0.01
日本合計		29 663 333.21	1.54
ルクセンブルグ			
EUR ARCELORMITTAL NPV(POST STOCK SPLIT)	9 342.00	251 632.45	0.01
EUR EUROFINS SCIENTIFI EURO.01	1 788.00	227 299.97	0.01
EUR TENARIS S.A. USD1	6 107.00	59 542.92	0.01
ルクセンブルグ合計		538 475.34	0.03

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・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 (%)
オランダ			
EUR ADYEN NV EURO.01	254.00	699 746.12	0.04
EUR AEGON NV EURO.12	22 707.00	99 961.25	0.00
EUR ASML HOLDING NV EURO.09	5 325.00	4 193 276.47	0.22
EUR CNH INDUSTRIAL NV COM EURO.01	12 619.00	208 158.84	0.01
EUR JDE PEETS N.V. EURO.01	1 311.00	35 563.44	0.00
EUR KONINKLIJKE DSM NV EUR1.5	2 217.00	474 510.81	0.02
EUR NN GROUP N.V. EURO.12	3 479.00	172 067.39	0.01
EUR PROSUS N.V. EURO.05	11 819.00	943 481.84	0.05
GBP ROYAL DUTCH SHELL PLC 'A' SHS EURO.07	52 190.00	1 088 877.02	0.06
EUR UNIVERSAL MUSIC GR EUR10.00	9 273.00	264 177.90	0.01
オランダ合計		8 179 821.08	0.42
ノルウェー			
NOK ADEVINTA ASA SER 'B' NOK0.2	4 192.00	59 627.08	0.00
NOK AKER BP ASA NOK1	738.00	23 197.79	0.00
NOK DNB BANK ASA NOK12.50	12 786.00	278 134.99	0.01
NOK EQUINOR ASA NOK2.50	12 024.00	301 809.15	0.01
NOK MOWI ASA NOK7.50	5 549.00	125 580.05	0.01
NOK NORSE HYDRO ASA NOK3.6666	16 864.00	109 016.73	0.01
NOK TELENOR ASA ORD NOK6	8 614.00	126 543.70	0.01
ノルウェー合計		1 023 909.49	0.05
ポルトガル			
EUR EDP ENERGIAS PORTU EUR1(REGD)	33 451.00	182 011.92	0.01
EUR GALP ENERGIA EUR1-B	6 612.00	61 534.32	0.00
EUR JERONIMO MARTINS EUR5	3 463.00	74 899.17	0.01
ポルトガル合計		318 445.41	0.02
シンガポール			
SGD CAPITALAND INVESTM NPV	33 200.00	81 356.53	0.01
SGD GENTING SINGAPORE LTD	61 800.00	34 705.17	0.00
SGD SINGAPORE TELECOMM NPV	94 900.00	163 340.26	0.01
シンガポール合計		279 401.96	0.02
スペイン			
EUR BANCO SANTANDER SA EURO.50(REGD)	219 910.00	680 709.41	0.04
EUR BBVA(BILB-VIZ-ARG) EURO.49	84 871.00	449 233.58	0.02
スペイン合計		1 129 942.99	0.06
スウェーデン			
SEK ALFA LAVAL AB NPV	4 034.00	155 630.86	0.01
SEK ATLAS COPCO AB SER 'A' NPV (POST SPLIT)	8 512.00	520 585.80	0.03
SEK ATLAS COPCO AB SER 'B' NPV (POST SPLIT)	4 968.00	257 851.83	0.01
SEK BOLIDEN AB NPV (POST SPLIT)	3 698.00	126 979.05	0.01
SEK ELECTROLUX AB SER 'B' NPV (POST SPLIT)	2 875.00	64 155.01	0.00
SEK EMBRACER GROUP AB SER 'B' NPV (POST SPLIT)	6 966.00	74 943.59	0.00
SEK EPIROC AB SER 'A' NPV (POST SPLIT)	8 406.00	203 232.77	0.01
SEK EPIROC AB SER 'B' NPV	5 116.00	102 661.64	0.00
SEK EQT AB NPV	3 021.00	177 770.50	0.01
SEK ERICSSON SER 'B' NPV	36 687.00	368 539.67	0.02
SEK EVOLUTION AB NPV	2 123.00	222 436.93	0.01
SEK GETINGE AB SER 'B' NPV	807.00	33 695.03	0.00
SEK HENNES & MAURITZ SER 'B' NPV	9 348.00	164 818.67	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・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 (%)
SEK HEXAGON AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	25 599.00	372 361.40	0.02
SEK INVESTOR AB SER ' A ' NPV (POST SPLIT)	2 040.00	48 961.62	0.00
SEK INVESTOR AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	23 756.00	549 612.90	0.03
SEK KINNEVIK AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	3 035.00	107 909.10	0.01
SEK LIFCO AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	1 231.00	33 275.40	0.00
SEK NIBE INDUSTRIER AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	15 248.00	216 755.59	0.01
SEK SANDVIK AB NPV (POST SPLIT)	13 844.00	342 335.68	0.02
SEK SKAND ENSKILDA BKN SER ' A ' NPV	20 857.00	302 695.06	0.02
SEK SKF AB SER ' B ' NPV	4 994.00	114 081.59	0.01
SEK SWEDBANK AB SER ' A ' NPV	12 023.00	241 580.86	0.01
SEK SWEDISH MATCH NPV (POST SPLIT)	21 770.00	157 996.65	0.01
SEK TELE2 AB SHS	6 729.00	95 729.21	0.00
SEK VOLVO AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	18 616.00	400 888.04	0.02
スウェーデン合計		5 457 484.45	0.28
スイス			
CHF ABB LTD CHF0.12 (REGD)	22 016.00	758 688.39	0.04
CHF ADECCO GROUP AG CHF0.1 (REGD)	2 032.00	93 980.55	0.00
CHF ALCON AG CHF0.04	6 304.00	495 382.41	0.03
CHF BACHEM HOLDING AG CHF0.05(REGD)CLS ' B '	32.00	22 960.88	0.00
CHF BALOISE-HLDGS CHF0.1(REGD)	635.00	94 419.71	0.00
CHF BARRY CALLEBAUT AG CHF0.02 (REGD)	40.00	94 229.52	0.00
CHF BQE CANT VAUDOISE CHF1	572.00	46 172.90	0.00
CHF CLARIANT CHF4.00(REGD)	2 610.00	50 908.26	0.00
GBP COCA-COLA HBC AG ORD CHF6.70	2 511.00	77 138.07	0.00
CHF CREDIT SUISSE GRP CHF0.04(REGD)	32 829.00	316 157.39	0.02
CHF EMS-CHEMIE HLDG AG CHF0.01(REGD)(POST RECON)	113.00	107 089.91	0.01
CHF GEBERIT CHF0.10(REGD)	495.00	376 465.31	0.02
CHF GIVAUDAN AG CHF10	122.00	593 256.97	0.03
CHF HOLCIM LTD CHF2 (REGD)	6 365.00	305 731.85	0.02
CHF JULIUS BAER GRUPPE CHF0.02 (REGD)	2 914.00	180 243.53	0.01
CHF KUEHNE&NAGEL INTL CHF1(REGD)(POST-SUBD)	744.00	212 008.64	0.01
CHF LINDT & SPRUENGLI CHF100(REGD)	1.00	122 541.60	0.01
CHF LOGITECH INTL CHF0.25(REGD) (POST-SUBD)	2 174.00	171 166.67	0.01
CHF LONZA GROUP AG CHF1(REGD)	942.00	756 328.07	0.04
CHF NESTLE SA CHF0.10(REGD)	36 483.00	4 652 035.88	0.24
CHF NOVARTIS AG CHF0.50(REGD)	28 102.00	2 230 182.49	0.12
CHF PARTNERS GROUP HLG CHF0.01 (REGD)	283.00	486 243.79	0.03
CHF RICHEMONT(CIE FIN) CHF1.00 (REG) SER ' A '	6 608.00	976 133.13	0.05
CHF SCHINDLER-HLDG AG CHF0.1(REGD)(POST-SUBD)	316.00	78 129.24	0.00
CHF SGS LTD CHF1(REGD)	82.00	246 070.89	0.01
CHF SIKA AG CHF0.01 (REG)	1 787.00	696 532.20	0.04
CHF SONOVA HOLDING AG CHF0.05 (REGD)	669.00	250 495.46	0.01
CHF STRAUMANN HLDG CHF0.1(REGD)	136.00	287 607.52	0.01
CHF SWATCH GROUP CHF0.45(REGD)	612.00	34 753.19	0.00
CHF SWISS LIFE HLDG CHF5.1(REGD)	397.00	227 286.15	0.01
CHF SWISS PRIME SITE CHF15.3 (REGD)	1 132.00	106 667.82	0.01
CHF SWISSCOM AG CHF1(REGD)	317.00	174 839.85	0.01
CHF TEMENOS AG CHF5 (REGD)	896.00	114 105.90	0.01
CHF UBS GROUP CHF0.10 (REGD)	46 425.00	799 669.87	0.04
CHF ZURICH INSURANCE GRP CHF0.10	1 913.00	783 680.89	0.04
スイス合計		17 019 304.90	0.88

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・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 (%)
アラブ首長国連邦			
GBP NMC HEALTH PLC ORD GBP0.1	3 082.00	0.04	0.00
アラブ首長国連邦合計		0.04	0.00
イギリス			
GBP ABRDN PLC ORD GBP0.1396825396	27 263.00	84 148.86	0.00
GBP ADMIRAL GROUP ORD GBP0.001	2 684.00	105 001.06	0.01
GBP ANGLO AMERICAN USD0.54945	16 169.00	592 974.79	0.03
GBP ANTOFAGASTA ORD GBP0.05	4 509.00	82 322.62	0.00
GBP ASHTEAD GROUP ORD GBP0.10	5 565.00	444 989.20	0.02
GBP ASSOCD BRIT FOODS ORD GBP0.0568	4 701.00	119 599.50	0.01
GBP AUTO TRADER GROUP ORD GBP0.01	13 002.00	126 019.26	0.01
GBP BARCLAYS ORD GBP0.25	214 751.00	523 397.71	0.03
GBP BP ORD USD0.25	256 669.00	1 105 140.61	0.06
GBP BUNZL ORD GBP0.32142857	4 499.00	170 708.44	0.01
GBP BURBERRY GROUP ORD GBP0.0005	5 309.00	123 443.41	0.01
GBP COMPASS GROUP ORD GBP0.1105	22 232.00	430 164.19	0.02
GBP CRODA INTL ORD GBP0.10609756	1 701.00	227 630.29	0.01
GBP DIAGEO ORD GBP0.28 101/108	29 554.00	1 485 602.30	0.08
GBP FERGUSON PLC (NEW) ORD GBP0.10	2 822.00	428 046.46	0.02
GBP GLAXOSMITHKLINE ORD GBP0.25	63 499.00	1 281 139.95	0.07
GBP HARGREAVES LANSDOW ORD GBP0.004 (WI)	4 386.00	77 581.80	0.00
GBP HSBC HLDGS ORD USD0.50(UK REG)	258 564.00	1 434 513.20	0.07
GBP IMPERIAL BRANDS PL GBP0.10	11 612.00	236 892.46	0.01
GBP INTERCONTL HOTELS ORD GBP0.208521303	2 216.00	130 434.36	0.01
GBP INTERTEK GROUP ORD GBP0.01	2 125.00	150 127.43	0.01
GBP JD SPORTS FASHION ORD GBP0.0005	34 520.00	101 798.34	0.01
GBP LEGAL & GENERAL GP ORD GBP0.025	77 632.00	289 531.42	0.01
GBP LONDON STOCK EXCH ORD GBP0.06918604	4 190.00	360 429.92	0.02
GBP M&G PLC ORD GBP0.05	31 617.00	78 178.94	0.00
GBP MELROSE INDUST PLC ORD GBP0.076190476	56 640.00	108 655.34	0.01
GBP MONDI ORD EURO.20	6 192.00	140 861.72	0.01
GBP NATWEST GROUP PLC ORD GBP1	62 815.00	176 679.62	0.01
GBP NEXT ORD GBP0.10	1 749.00	181 920.94	0.01
GBP PEARSON ORD GBP0.25	10 185.00	79 932.25	0.00
GBP PERSIMMON ORD GBP0.10	4 156.00	150 490.88	0.01
GBP PHOENIX GP HLDGS ORD GBP0.10	7 190.00	60 898.19	0.00
GBP PRUDENTIAL ORD GBP0.05	32 875.00	554 978.66	0.03
GBP RIO TINTO ORD GBP0.10	14 104.00	860 580.38	0.04
GBP SAINSBURY(J) ORD GBP0.28571428	24 465.00	89 527.66	0.00
GBP SCHROEDERS VTG SHS GBP1	1 662.00	75 551.66	0.00
GBP SMITH & NEPHEW ORD USD0.20	11 317.00	182 288.87	0.01
GBP STANDARD CHARTERED ORD USD0.50	35 787.00	197 054.88	0.01
EUR STELLANTIS N V COM EURO.01	25 569.00	435 736.26	0.02
GBP TAYLOR WIMPEY ORD GBP0.01	47 239.00	98 683.07	0.01
GBP TESCO ORD GBP0.0633333	97 508.00	357 016.03	0.02
GBP UNILEVER PLC ORD GBP0.031111	4 058.00	207 179.45	0.01
EUR UNILEVER PLC ORD GBP0.031111	28 387.00	1 451 118.58	0.08
GBP VODAFONE GROUP ORD USD0.2095238(POST CONS)	357 428.00	517 043.98	0.03
イギリス合計		16 116 014.94	0.84

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・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 (%)
アメリカ合衆国			
CAD BAUSCH HEALTH COMP COM NPV	4 084.00	96 528.59	0.01
CAD BROOKFIELD RENEWA. CLASS A SUB VOTING SHARES	1 700.00	62 948.24	0.00
アメリカ合衆国合計		159 476.83	0.01
記名株式合計		127 316 714.55	6.60
預託証券			
中国			
USD FUTU HOLDINGS LIM1 SPON ADS EA REP 8 ORD SHS	700.00	33 243.00	0.00
中国合計		33 243.00	0.00
香港			
USD MELCO RESORTS UNSP ARD EACH REP 3 ORD SHS	2 900.00	28 304.00	0.00
香港合計		28 304.00	0.00
アイルランド			
AUD JAMES HARDIE ID PLC CUFS EURO.5	5 898.00	232 810.65	0.01
アイルランド合計		232 810.65	0.01
イスラエル			
USD TEVA PHARMA IND ADR(CNV 1 ORD ILS0.10)	13 500.00	111 375.00	0.01
イスラエル合計		111 375.00	0.01
オランダ			
EUR ABN AMRO BANK N.V. DR EACH REP SHS	5 311.00	75 323.58	0.01
オランダ合計		75 323.58	0.01
シンガポール			
USD SEA LTD ADS EACH REP ONE CL A SHS	900.00	259 263.00	0.01
シンガポール合計		259 263.00	0.01
預託証券合計		740 319.23	0.04
投資信託証券			
アイルランド			
USD STAR COMPASS PLC/UBS DYNMC DIVERSIFIED LTD NOTE DUE 30.06.23	35 500 000.00	58 773 800.00	3.04
アイルランド合計		58 773 800.00	3.04
投資信託証券合計		58 773 800.00	3.04
投資信託、クローズド・エンド型			
カナダ			
CAD CANADIAN APARTMENT PROP. REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1 100.00	48 757.41	0.00
CAD RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2 187.00	36 228.37	0.00
カナダ合計		84 985.78	0.00
シンガポール			
SGD ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	38 600.00	82 202.53	0.00
SGD CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST REAL ESTATE INV TRUST	56 635.10	87 153.16	0.01
SGD MAPLETREE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	19 100.00	28 417.02	0.00
シンガポール合計		197 772.71	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・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 (%)
イギリス			
GBP SEGRO PLC REIT	15 039.00	280 343.05	0.02
イギリス合計		280 343.05	0.02
投資信託、クローズド・エンド型合計		563 101.54	0.03
新株引受権			
ドイツ			
EUR VONOVIA SE RIGHTS 07.12.21	6 848.00	23 972.22	0.00
ドイツ合計		23 972.22	0.00
新株引受権合計		23 972.22	0.00
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD 3M CO 2.25000% 16-19.09.26	1 500 000.00	1 552 685.36	0.08
USD ABU DHABI, GOVERNMENT OF-REG-S 3.12500% 17-11.10.27	2 675 000.00	2 862 250.00	0.15
USD ALBERTA, PROVINCE OF 3.30000% 18-15.03.28	3 725 000.00	4 096 330.98	0.21
USD ALPHABET INC 1.10000% 20-15.08.30	3 550 000.00	3 335 728.75	0.17
USD ALPHABET INC 1.99800% 16-15.08.26	2 075 000.00	2 136 250.58	0.11
USD AMERICAN EXPRESS CO 3.40000% 18-27.02.23	1 127 000.00	1 163 460.11	0.06
USD APPLE INC 1.65000% 20-11.05.30	3 501 000.00	3 407 204.11	0.18
USD APPLE INC 2.20000% 19-11.09.29	3 800 000.00	3 872 063.54	0.20
USD APPLE INC 2.40000% 13-03.05.23	1 048 000.00	1 073 205.20	0.06
USD APPLE INC 2.45000% 16-04.08.26	1 306 000.00	1 360 466.57	0.07
USD APPLE INC 2.85000% 16-23.02.23	167 000.00	171 060.86	0.01
USD APPLE INC 3.20000% 17-11.05.27	5 448 000.00	5 860 049.51	0.30
USD APPLE INC 3.25000% 16-23.02.26	133 000.00	142 252.81	0.01
USD BANK OF NOVA SCOTIA 2.00000% 19-15.11.22	1 310 000.00	1 328 864.28	0.07
USD BAYER US FINANCE II LLC-REG-S 3.87500% 18-15.12.23	1 200 000.00	1 260 311.17	0.07
USD BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 1.75000% 19-27.09.24	700 000.00	716 506.89	0.04
USD BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 1.30000% 21-29.01.31	2 500 000.00	2 433 350.00	0.13
USD CHEVRON CORP 2.23600% 20-11.05.30	2 147 000.00	2 169 364.63	0.11
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 3.90000% 18-16.03.28	1 650 000.00	1 870 192.34	0.10
USD CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 4.37500% 12-15.06.22	1 000 000.00	1 020 273.22	0.05
USD CPPIB CAPITAL INC-REG-S 1.25000% 21-28.01.31	500 000.00	483 039.00	0.03
USD EQUINOR ASA 2.37500% 20-22.05.30	1 335 000.00	1 360 781.42	0.07
USD EQUINOR ASA 3.62500% 18-10.09.28	3 310 000.00	3 656 572.69	0.19
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.37500% 17-24.05.27	1 000 000.00	1 056 910.30	0.05
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.87500% 20-17.05.30	8 490 000.00	8 214 557.75	0.43
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.25000% 21-14.02.31	7 450 000.00	7 308 372.59	0.38
USD EXPORT DEVELOPMENT CANADA 2.00000% 17-17.05.22	295 000.00	297 474.66	0.02
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 3.25000% 15-10.11.25	3 600 000.00	3 883 050.00	0.20
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 2.75000% 17-25.01.22	575 000.00	577 084.38	0.03
USD EXXON MOBIL CORP 3.04300% 16-01.03.26	2 476 000.00	2 626 527.28	0.14
USD EXXON MOBIL CORP 3.48200% 20-19.03.30	1 590 000.00	1 744 706.37	0.09
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.37500% 17-07.07.27	900 000.00	950 497.03	0.05
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.25000% 19-18.06.29	3 375 000.00	3 562 717.50	0.18
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.00000% 19-23.07.26	1 000 000.00	1 036 270.00	0.05
USD INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 2.85000% 19-13.05.22	1 000 000.00	1 011 153.89	0.05
USD INTERNATIONAL DVPT ASSOCIATION-REG-S 1.00000% 20-03.12.30	1 060 000.00	1 012 749.44	0.05
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 1.75000% 19-23.10.29	1 600 000.00	1 631 220.30	0.08

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・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 JOHNSON & JOHNSON 1.30000% 20-01.09.30	2 030 000.00	1 933 391.53	0.10
USD JOHNSON & JOHNSON 2.90000% 17-15.01.28	1 025 000.00	1 092 686.95	0.06
USD JOHNSON & JOHNSON 3.37500% 13-05.12.23	1 025 000.00	1 079 024.11	0.06
USD KOREA DEVELOPMENT BANK 2.75000% 17-19.03.23	1 050 000.00	1 078 149.03	0.06
USD KOREA HYDRO&NUCLEAR POWER CO LTD-REG-S 3.00000% 12-19.09.22	800 000.00	814 650.00	0.04
USD KOREA HYDRO&NUCLEAR POWER CO LTD-REG-S 3.12500% 17-25.07.27	2 950 000.00	3 169 959.37	0.16
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.12500% 13-17.01.23	775 000.00	790 444.07	0.04
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.00000% 15-02.05.25	1 150 000.00	1 188 515.47	0.06
USD KUWAIT INTERNATIONAL GOVT BOND-REG-S 3.50000% 17-20.03.27	6 200 000.00	6 747 537.50	0.35
USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 2.00000% 15-13.01.25	3 875 000.00	3 999 222.69	0.21
USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 0.87500% 20-03.09.30	5 863 000.00	5 561 448.03	0.29
USD MANITOBA, PROVINCE OF 2.12500% 17-04.05.22	44 000.00	44 359.92	0.00
USD MICROSOFT CORP 2.65000% 15-03.11.22	1 571 000.00	1 598 974.86	0.08
USD MICROSOFT CORP 2.87500% 17-06.02.24	824 000.00	857 738.54	0.04
USD MICROSOFT CORP 3.30000% 17-06.02.27	4 890 000.00	5 301 547.34	0.27
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD/NY 2.50000% 16-12.07.26	3 200 000.00	3 357 167.05	0.17
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 1.25000% 20-15.09.30	1 938 000.00	1 836 750.64	0.09
USD NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 3.00000% 18-10.01.28	1 754 000.00	1 885 888.71	0.10
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 2.40000% 12-21.09.22	750 000.00	762 013.44	0.04
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 3.10000% 17-17.05.27	2 310 000.00	2 475 079.20	0.13
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 2.20000% 20-14.08.30	1 900 000.00	1 937 322.06	0.10
USD QATAR, STATE OF-REG-S 3.37500% 19-14.03.24	1 800 000.00	1 889 100.00	0.10
USD QATAR, STATE OF-REG-S 4.00000% 19-14.03.29	1 950 000.00	2 187 900.00	0.11
USD QATAR, STATE OF-REG-S 3.75000% 20-16.04.30	1 100 000.00	1 223 200.00	0.06
USD QUEBEC, PROVINCE OF 2.50000% 16-20.04.26	4 530 000.00	4 773 054.62	0.25
USD ROCHE HOLDINGS INC-REG-S 3.62500% 18-17.09.28	3 000 000.00	3 338 049.63	0.17
USD SINOPEC GROUP OVERSEAS DEV 2013-REG-S 4.37500% 13-17.10.23	675 000.00	716 823.00	0.04
USD STATE STREET CORP 2.40000% 20-24.01.30	811 000.00	834 125.89	0.04
USD TEMASEK FINANCIAL I LTD-REG-S 2.37500% 12-23.01.23	900 000.00	917 519.67	0.05
USD TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.70000% 13-15.01.24	940 000.00	992 297.59	0.05
USD TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.45500% 19-19.02.29	1 360 000.00	1 481 577.60	0.08
USD VISA INC 2.05000% 20-15.04.30	2 850 000.00	2 876 003.82	0.15
USD VISA INC 3.15000% 15-14.12.25	1 404 000.00	1 502 248.17	0.08
USD WAL-MART STORES INC 1.80000% 21-22.09.31	3 000 000.00	2 967 265.59	0.15
USD WESTPAC BANKING CORP 2.85000% 16-13.05.26	2 855 000.00	3 029 014.82	0.16
USD WESTPAC BANKING CORP 3.35000% 17-08.03.27	1 200 000.00	1 298 007.12	0.07
USD WESTPAC BANKING CORP 2.00000% 20-13.01.23	45 000.00	45 733.28	0.00
米ドル合計		159 829 346.82	8.28

ノート、固定利付債合計	159 829 346.82	8.28
-------------	----------------	------

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	3 200 000.00	3 444 000.00	0.18
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.00000% 17-16.02.22	500 000.00	502 175.00	0.03
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.50000% 17-02.11.27	2 000 000.00	2 130 380.00	0.11
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.75000% 19-19.09.29	6 640 000.00	6 773 592.87	0.35
USD BANK OF NEW YORK CO INC 0.75000% 21-28.01.26	1 500 000.00	1 461 671.54	0.07
USD CAISSE D'AMOR DE LA DETTE SOCIALE-REG-S 3.37500% 14-20.03.24	850 000.00	900 186.82	0.05
USD CLIFFORD CAPITAL PTE LTD-REG-S 1.73300% 19-10.09.24	1 500 000.00	1 530 399.15	0.08
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 3.15000% 17-19.09.27	725 000.00	783 607.92	0.04
USD CPPIB CAPITAL INC-REG-S 2.75000% 17-02.11.27	3 025 000.00	3 240 205.27	0.17
USD IDB TRUST SERVICES LTD-REG-S 2.26100% 17-26.09.22	1 550 000.00	1 569 840.00	0.08

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・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 INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 1.12500% 21-13.01.31	4 500 000.00	4 358 410.20	0.23
USD INTERNATIONAL FINANCE CORP 2.12500% 16-07.04.26	1 700 000.00	1 771 222.42	0.09
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 17-22.11.27	5 200 000.00	5 524 016.31	0.29
USD KOREA DEVELOPMENT BANK 1.75000% 20-18.02.25	300 000.00	306 033.00	0.02
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 3.00000% 17-19.04.24	1 100 000.00	1 150 875.00	0.06
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 2.87500% 19-07.11.29	2 450 000.00	2 548 000.00	0.13
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 2.87500% 20-21.05.30	1 800 000.00	1 869 750.00	0.10
USD MORGAN STANLEY 3.12500% 16-27.07.26	1 040 000.00	1 101 917.45	0.06
USD MTR CORP CI LTD-REG-S 2.50000% 16-02.11.26	1 500 000.00	1 570 859.70	0.08
USD NEDERLANDSE WATERSCHAPS BK NV-REG-S 3.00000% 18-21.12.21	425 000.00	425 635.80	0.02
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 2.37500% 17-18.01.22	875 000.00	876 872.50	0.04
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 3.12500% 18-22.03.23	1 370 000.00	1 413 886.30	0.07
USD NORDRHEIN-WESTFALEN, STATE OF-REG-S 2.25000% 15-16.04.25	900 000.00	934 891.20	0.05
USD SP POWERASSETS LTD-REG-S 3.25000% 15-24.11.25	1 500 000.00	1 609 759.35	0.08
USD SUMITOMO MITSUI BANKING CORP-REG-S 2.44000% 19-18.06.24	801 000.00	828 871.04	0.04
米ドル合計		48 627 058.84	2.52

中期債券、固定利付債合計	48 627 058.84	2.52
--------------	---------------	------

債券、固定利付債

米ドル

USD BNG BANK NV-REG-S 2.37500% 16-16.03.26	1 800 000.00	1 887 663.60	0.10
USD CAISSE D ' AMORTIS DE LA DETTE SOC-REG-S 1.87500% 15-12.02.22	600 000.00	601 980.00	0.03
USD CANADIAN IMPERIAL BANK OF COM/CAN-REG-S 2.35000% 17-27.07.22	1 075 000.00	1 089 132.94	0.06
USD DNB BOLIGKREDITT AS-REG-S 2.50000% 17-28.03.22	500 000.00	503 472.00	0.02
USD FAB SUKUK CO LTD-REG-S 3.87500% 19-22.01.24	1 600 000.00	1 692 000.00	0.09
USD FMS WERTMANAGEMENT 2.00000% 17-01.08.22	550 000.00	556 506.50	0.03
USD ING BANK NV-REG-S 2.62500% 12-05.12.22	400 000.00	408 660.80	0.02
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 14-25.11.24	800 000.00	838 065.74	0.04
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 15-29.07.25	1 650 000.00	1 735 478.43	0.09
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.87500% 20-14.05.30	2 026 000.00	1 936 673.66	0.10
USD KOREA GAS CORP-REG-S 2.87500% 19-16.07.29	1 000 000.00	1 067 687.50	0.05
USD KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 3.25000% 14-10.07.24	2 200 000.00	2 328 705.94	0.12
USD KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 1.62500% 20-05.10.30	950 000.00	908 007.71	0.05
USD KOREA, REPUBLIC OF 3.87500% 13-11.09.23	1 400 000.00	1 479 012.50	0.08
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.50000% 14-20.11.24	1 225 000.00	1 282 582.72	0.07
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 0.75000% 20-30.09.30	5 750 000.00	5 416 879.67	0.28
USD NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S 1.70000% 20-13.02.23	1 284 000.00	1 300 958.22	0.07
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 3.40000% 14-06.05.24	1 000 000.00	1 058 452.42	0.05
USD ONTARIO, PROVINCE OF 1.12500% 20-07.10.30	2 570 000.00	2 445 430.79	0.13
USD ONTARIO, PROVINCE OF 3.20000% 14-16.05.24	1 645 000.00	1 739 028.20	0.09
USD SWEDBANK AB-REG-S 2.80000% 17-14.03.22	1 000 000.00	1 007 197.24	0.05
米ドル合計		31 283 576.58	1.62

債券、固定利付債合計	31 283 576.58	1.62
------------	---------------	------

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	3 162 000.00	3 434 846.01	0.18
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 15-31.01.22	5 000.00	5 011.99	0.00
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 17-15.02.27	5 005 000.00	5 273 432.21	0.27
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 13-15.05.23	505 000.00	514 942.19	0.03

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・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 AMERICA, UNITED STATES OF 0.62500% 20-15.05.30	6 221 000.00	5 839 234.71	0.30
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.12500% 21-15.02.31	13 850 000.00	13 520 521.52	0.70
米ドル合計		28 587 988.63	1.48
財務省証券(T-note)、固定利付債合計		28 587 988.63	1.48
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	3 666 000.00	8 579 397.83	0.44
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.375%/CPI LINKED 04-15.01.25	5 671 000.00	9 474 028.99	0.49
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.625%/CPI LINKED 16-15.01.26	7 583 000.00	9 669 965.19	0.50
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI LINKED 17-15.01.27	6 351 000.00	7 972 857.29	0.41
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI INDEX 13-15.07.23	6 346 000.00	7 935 248.68	0.41
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI LINKED 15-15.07.25	7 198 000.00	9 094 521.93	0.47
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.750%/CPI LINKED 18-15.07.28	7 058 000.00	8 890 718.64	0.46
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 20-15.01.30	10 252 000.00	12 165 991.30	0.63
米ドル合計		73 782 729.85	3.81
財務省証券(T-note)、変動利付債合計		73 782 729.85	3.81
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		632 241 342.33	32.75
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% 21-21.04.22	3 500 000.00	3 499 006.14	0.18
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 21-19.05.22	3 500 000.00	3 498 548.62	0.18
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 17.06.21-16.06.22	3 500 000.00	3 498 156.55	0.18
米ドル合計		10 495 711.31	0.54
財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン合計		10 495 711.31	0.54
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD FANNIE MAE 0.25000% 20-27.11.23	1 400 000.00	1 391 071.23	0.07
USD FANNIE MAE 2.12500% 16-24.04.26	2 500 000.00	2 602 122.70	0.13
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD NEW YORK 2.87500% 18-12.04.23	500 000.00	515 651.05	0.03
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-144A 3.50000% 17-10.01.27	1 500 000.00	1 633 995.75	0.09
USD NESTLE HOLDINGS INC-144A 1.00000% 20-15.09.27	1 600 000.00	1 539 372.87	0.08
USD PROCTER & GAMBLE CO 2.30000% 12-06.02.22	725 000.00	727 422.03	0.04
米ドル合計		8 409 635.63	0.44
ノート、固定利付債合計		8 409 635.63	0.44
中期債券、固定利付債			
米ドル			
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 3.85000% 14-08.07.24	1 022 000.00	1 084 254.24	0.06
米ドル合計		1 084 254.24	0.06
中期債券、固定利付債合計		1 084 254.24	0.06

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・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 (%)
債券、固定利付債			
米ドル			
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 1.62500% 19-17.10.22	1 000 000.00	1 007 966.60	0.05
USD HSBC BANK CANADA-REG-S 1.65000% 19-10.09.22	750 000.00	757 537.77	0.04
米ドル合計		1 765 504.37	0.09
債券、固定利付債合計		1 765 504.37	0.09
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	3 905 000.00	4 815 612.95	0.25
米ドル合計		4 815 612.95	0.25
財務省証券(T-note)、変動利付債合計		4 815 612.95	0.25
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		26 570 718.50	1.38
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			
無記名株式			
オーストラリア			
AUD DEXUS NPV (STAPLED)	14 854.00	117 644.99	0.01
オーストラリア合計		117 644.99	0.01
無記名株式合計		117 644.99	0.01
記名株式			
イギリス			
GBP BERKELEY GP HLDGS ORD GBPO.053943	1 513.00	85 752.79	0.00
イギリス合計		85 752.79	0.00
記名株式合計		85 752.79	0.00
新株引受権			
シンガポール			
SGD MAPLETREE LOGISTICS TRUST RIGHTS 14.12.21	847.30	12.36	0.00
シンガポール合計		12.36	0.00
新株引受権合計		12.36	0.00
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 2.95000% 18-11.01.25	1 550 000.00	1 632 111.00	0.09
USD US BANK NA/CINCINNATI OH 2.65000% 19-23.05.22	1 400 000.00	1 412 169.19	0.07
米ドル合計		3 044 280.19	0.16
ノート、固定利付債合計		3 044 280.19	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・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 (%)
中期債券、変動利付債			
米ドル			
USD NATIONAL BANK OF CANADA 0.550%/VAR 20-15.11.24	796 000.00	788 448.66	0.04
米ドル合計		788 448.66	0.04
中期債券、変動利付債合計		788 448.66	0.04
債券、固定利付債			
米ドル			
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 2.75000% 17-22.06.24	950 000.00	992 255.95	0.05
米ドル合計		992 255.95	0.05
債券、固定利付債合計		992 255.95	0.05
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		5 028 394.94	0.26
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 MAN FUNDS VI PLC-MAN AHL TARGETRISK-INU-USD-CAP	215 120.63	33 354 453.84	1.73
USD SOURCE MARKETS PLC - MSCI USA SOURCE ETF-A	620 719.00	80 187 584.02	4.15
USD UBS (IRL) ETF PLC-MSCI USA UCITS-ACC-A-USD-ETF	3 240 001.00	84 839 426.19	4.40
USD UBS IRL FND SOLUTIONS PLC-MSCI USA SF INDEX-SHS-A-USD-ACC	1 158 622.00	157 219 675.74	8.14
USD UBS(IRL)FUND SOLUTION PLC-MSCI USA SF UCITS SHS-A-ETF-ACC	1 244 737.00	162 039 862.66	8.39
アイルランド合計		517 641 002.45	26.81
ルクセンブルグ			
EUR ALMA PLATINUM IV UBS MULTI-STRATEGY ALTERNATIVES-IOC-E-CAP	5 076.98	55 783 257.44	2.89
USD AQR UCITS FUNDS - GLOBAL RISK PARITY UCITS FUND-A2-CAP	188 245.70	26 587 822.67	1.38
USD INVESCO FUNDS SICAV BAL RISK ALLOCATION-PI1-USD HDG-CAP	1 303 463.33	18 522 213.95	0.96
USD UBS (LUX) BD SICAV-USD INVES GRA CORPOR SUSTAI (USD) F-ACC	2 521.69	293 575 541.49	15.21
USD UBS (LUX) BOND FUND-EURO HIGH YIELD (EUR)(USD HEDGED) F-ACC	373 411.00	46 885 485.16	2.43
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD (USD) F-ACC	197 803.00	70 059 844.57	3.63
USD UBS (LUX) BOND SICAV - EMERG ECON CORPORATES (USD) F-ACC	500 139.00	62 107 261.02	3.21
USD UBS (LUX) EMERGING ECONOMIES FUND - GLOBAL BONDS (USD) F-ACC	44 058.00	91 884 280.74	4.76
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD SUSTAINABLE U-X-ACC	1.00	11 234.15	0.00
ルクセンブルグ合計		665 416 941.19	34.47
投資信託、オープン・エンド型合計		1 183 057 943.64	61.28
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合計		1 183 057 943.64	61.28
投資有価証券合計		1 846 898 399.41	95.67

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・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 (%)
----	------------	--	------------------

派生商品

公認の証券取引所に上場されている派生商品

債券に係る金融先物

USD	US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 22.03.22	-396.00	-303 187.50	-0.02
USD	US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 22.03.22	-452.00	-558 437.50	-0.03
USD	US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.22	-814.00	-286 172.28	-0.01
USD	US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.22	-317.00	-9 765.94	0.00
USD	US LONG BOND FUTURE 22.03.22	-24.00	-38 812.49	0.00
債券に係る金融先物合計			-1 196 375.71	-0.06

指数に係る金融先物

EUR	EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 17.12.21	331.00	-180 512.47	-0.01
CHF	SWISS MARKET INDEX FUTURE 17.12.21	42.00	95 655.93	0.00
GBP	FTSE 100 INDEX FUTURE 17.12.21	74.00	41 118.84	0.00
SEK	OMX 30 INDEX FUTURE 17.12.21	82.00	-121 309.80	-0.01
AUD	SPI 200 INDEX FUTURES 16.12.21	24.00	-61 120.11	0.00
USD	S&P500 EMINI FUTURE 17.12.21	742.00	4 153 740.00	0.22
USD	MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 17.12.21	2 009.00	-7 690 145.00	-0.40
JPY	TOPIX INDEX FUTURE 09.12.21	66.00	-820 423.62	-0.04
CAD	S&P/TSX 60 INDEX FUTURE 16.12.21	32.00	87 620.83	0.00
HKD	HANG SENG INDEX FUTURE 30.12.21	11.00	-83 659.90	0.00
指数に係る金融先物合計			-4 579 035.30	-0.24

公認の証券取引所に上場されている派生商品合計			-5 775 411.01	-0.30
------------------------	--	--	---------------	-------

派生商品合計			-5 775 411.01	-0.30
--------	--	--	---------------	-------

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・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 （％）
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	8 588 689.00	AUD 11 800 000.00 10.12.2021	221 541.48 0.01
USD	14 368 963.55	CAD 18 100 000.00 10.12.2021	259 069.75 0.01
USD	11 330 626.83	GBP 8 315 000.00 10.12.2021	329 392.65 0.02
USD	27 095 626.01	JPY 3 011 500 000.00 10.12.2021	571 543.37 0.03
USD	2 966 367.36	DKK 19 000 000.00 10.12.2021	90 174.50 0.01
USD	382 831.13	NZD 550 000.00 10.12.2021	9 575.31 0.00
USD	1 252 180.08	SGD 1 700 000.00 10.12.2021	12 395.54 0.00
USD	417 916.82	ILS 1 350 000.00 10.12.2021	-10 632.46 0.00
USD	700 472.49	NOK 6 000 000.00 10.12.2021	41 989.36 0.00
USD	50 403 382.31	EUR 43 415 000.00 10.12.2021	1 526 423.95 0.08
USD	9 705 581.17	CHF 8 985 000.00 10.12.2021	-5 975.43 0.00
USD	4 407 023.59	SEK 38 500 000.00 10.12.2021	163 976.58 0.01
USD	3 276 331.88	HKD 25 500 000.00 10.12.2021	5 358.97 0.00
USD	16 713 601.13	CHF 15 360 000.00 7.1.2022	87 745.02 0.00
USD	25 055 359.26	GBP 18 160 000.00 7.1.2022	1 009 737.77 0.05
USD	14 792 409.15	CAD 18 300 000.00 7.1.2022	520 051.38 0.03
USD	9 068 653.39	AUD 12 090 000.00 7.1.2022	491 927.62 0.03
USD	88 528 148.79	EUR 76 070 461.98 7.1.2022	2 769 326.75 0.14
USD	35 650 709.98	JPY 4 059 500 000.00 7.1.2022	-130 305.05 -0.01
USD	3 923 016.07	HKD 30 500 000.00 7.1.2022	10 626.24 0.00
USD	394 314.47	NZD 550 000.00 7.1.2022	21 189.55 0.00
USD	1 262 526.49	SGD 1 700 000.00 7.1.2022	22 891.30 0.00
USD	718 341.38	NOK 6 000 000.00 7.1.2022	59 972.25 0.00
USD	4 478 793.18	SEK 38 500 000.00 7.1.2022	229 347.65 0.01
USD	421 790.66	ILS 1 350 000.00 7.1.2022	-7 458.10 0.00
USD	2 972 895.66	DKK 19 000 000.00 7.1.2022	93 018.53 0.01
USD	1 391 385.00	EUR 1 200 000.00 7.1.2022	38 552.59 0.00
USD	1 389 931.56	EUR 1 200 000.00 10.12.2021	38 961.85 0.00
AUD	74 042 100.00	USD 53 525 633.83 12.1.2022	-998 963.88 -0.05
CAD	47 209 100.00	USD 37 283 074.28 12.1.2022	-464 423.37 -0.02
SEK	78 764 300.00	USD 8 698 477.63 12.1.2022	-4 499.33 0.00
CHF	273 711 600.00	USD 293 010 753.26 12.1.2022	3 296 806.86 0.17
EUR	269 484 400.00	USD 302 573 042.05 12.1.2022	1 264 507.27 0.07
GBP	42 418 400.00	USD 56 714 970.28 12.1.2022	-549 338.79 -0.03
SGD	73 919 300.00	USD 54 050 380.23 12.1.2022	-149 723.16 -0.01
USD	902 758.77	CHF 842 900.00 12.1.2022	-9 725.91 0.00
USD	125 318.01	CAD 158 800.00 12.1.2022	1 468.97 0.00
USD	845 996.17	CHF 780 200.00 12.1.2022	1 387.62 0.00
先渡為替契約合計			10 857 915.20 0.56
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			78 957 147.25 4.09
当座借越およびその他の短期負債			-3 912 734.53 -0.20
その他の資産および負債			3 430 930.55 0.18
純資産総額			1 930 456 246.87 100.00

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

2021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2021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	994,807.257 (571,653.806)	523,044.921 (175,389.633)	2,673,336.978 (923,014.358)
	クラスP - a c c 投資証券	218,585.433 (91,913.898)	129,173.444 (9,349.289)	614,466.789 (183,877.862)
フィクスト・インカム・サステナブル(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	11,673.514 (8,409.458)	55,265.653 (37,873.085)	220,746.464 (148,716.163)
	クラス(日本円・ヘッジ)P - a c c 投資証券	2,490.000 (0.000)	128,681.807 (121,965.608)	285,906.106 (280,538.190)
インカム・サステナブル(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	73,412.725 (0.000)	87,986.966 (1,306.837)	579,242.404 (10,750.000)
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	289,049.406 (0.000)	359,792.068 (63,089.317)	2,883,113.167 (145,296.918)
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	435,474.703 (10,244.225)	747,913.251 (67,950.781)	4,445,641.037 (378,318.672)
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	118,632.965 (3,813.591)	219,480.987 (45,425.183)	1,049,834.553 (39,630.953)

(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。