

【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6月30日

【発行者名】 UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ
(UBS (Lux) Key Selection 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・シュティンガー (Robert Süttinger)
メンバー・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ
イオアナ・ナウム (Ioana Naum)

【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) キー・セレクション・シキャブ
- グローバル・アロケーション(米ドル)
- グローバル・アロケーション(ユーロ)
- ダイナミック・アルファ(米ドル)
(UBS (Lux) Key Selection SICAV
- Global Allocation (USD)
- Global Allocation (EUR)
- Dynamic Alpha (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
グローバル・アロケーション(米ドル)
クラスP - a c c 投資証券
円建クラスP - a c c 投資証券
グローバル・アロケーション(ユーロ)
クラスP - a c c 投資証券
ダイナミック・アルファ(米ドル)
クラスP - a c c 投資証券
ユーロ・ヘッジクラスP - a c c 投資証券

上限見込額は以下のとおりである。

グローバル・アロケーション(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

19億3,700万米ドル(約2,228億円)

円建クラスP - a c c 投資証券

1,681億3,000万円

グローバル・アロケーション(ユーロ)

クラスP - a c c 投資証券

17億5,100万ユーロ(約2,285億円)

ダイナミック・アルファ(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

13億630万米ドル(約1,503億円)

ユーロ・ヘッジクラスP - a c c 投資証券

10億960万ユーロ(約1,318万円)

(注1) 上限見込額は、便宜上、各サブ・ファンドの投資証券の2021年12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。(グローバル・アロケーション(米ドル)クラスP - a c c 投資証券については19.37米ドルに1億口、グローバル・アロケーション(米ドル)円建クラスP - a c c 投資証券については16,813円に1,000万口、グローバル・アロケーション(ユーロ)クラスP - a c c 投資証券については17.51ユーロに1億口、ダイナミック・アルファ(米ドル)クラスP - a c c 投資証券については130.63米ドルに1,000万口およびダイナミック・アルファ(米ドル)ユーロ・ヘッジクラスP - a c c 投資証券については100.96ユーロに1,000万口をそれぞれ乗じて算出した金額である。)

(注2) 米ドルおよび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米ドル=115.02円および1ユーロ=130.51円)による。

(注3) ファンドは、ルクセンブルグ法に基づいて設立されているが、投資証券は米ドル建て、ユーロ建てまたは円建てのため、以下の金額表示は別段の記載がない限り米ドルまたはユーロまたは円貨をもって行う。

【縦覧に供する場所】

該当事項なし

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2022年3月31日に提出した有価証券届出書(以下「原届出書」といいます。)について、本日、半期報告書を提出しましたので、これに関する記載を訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

なお、下線または傍線部は訂正部分を示します。本訂正届出書の記載事項のうち外貨数字の円換算については、直近の為替レートを用いておりますので、訂正前の換算レートとは異なっております。

2【訂正の内容】

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(ただし、UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ-グローバル・エクイティーズ(米ドル)に関する情報は除きます。)

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

* 半期報告書の記載内容は、以下のとおりです。

[次へ](#)

1 外国投資法人の概況

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション (米ドル)、UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション (ユーロ)、UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - ダイナミック・アルファ (米ドル) および UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・エクイティーズ (米ドル) (以下 UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブを「本投資法人」、UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション (米ドル)、UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション (ユーロ)、UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - ダイナミック・アルファ (米ドル) および UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・エクイティーズ (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) 上記の他、各ファンドにはクラス P - a c c 投資証券、円建クラス P - a c c 投資証券およびユーロ・ヘッジクラス P - a c c 投資証券以外の投資証券も存在するが、その他の投資証券は日本で販売されていないため、以下、各ファンドについて「投資証券」というときは、上記の各クラス P - a c c 投資証券、円建クラス P - a c c 投資証券および/またはユーロ・ヘッジクラス 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

(グローバル・アロケーション (米ドル))

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	2020年3月末日に 終了する 中間会計年度末	2020年9月末日に 終了する 会計年度末	2021年3月末日に 終了する 中間会計年度末	2021年9月末日に 終了する 会計年度末	2022年3月末日に 終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	- 38,395,634.39	13,409,415.73	40,590,539.10	48,904,898.19	- 21,073,727.05
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	- 38,395,634.39	13,409,415.73	40,590,539.10	48,904,898.19	- 21,073,727.05
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	- 38,395,634.39	13,409,415.73	40,590,539.10	48,904,898.19	- 21,073,727.05
(d) 出資総額 ⁽²⁾	348,815,237.89	350,935,668.05	346,606,260.80	339,421,733.18	307,756,565.34
(e) 発行済投資口総数	(クラス P - a c c 投資証券) 18,648,119.413口 (円建クラス P - a c c 投資証券) 6,421.050口	(クラス P - a c c 投資証券) 17,146,791.111口 (円建クラス P - a c c 投資証券) 1,283.694口	(クラス P - a c c 投資証券) 16,190,143.954口 (円建クラス P - a c c 投資証券) 1,283.694口	(クラス P - a c c 投資証券) 15,485,088.907口 (円建クラス P - a c c 投資証券) 1,283.694口	(クラス P - a c c 投資証券) 15,088,115.826口 (円建クラス P - a c c 投資証券) 1,283.694口
(f) 純資産額	348,815,237.89	350,935,668.05	346,606,260.80	339,421,733.18	307,756,565.34
(g) 資産総額	350,168,864.63	351,836,364.14	352,857,370.39	342,633,714.76	308,936,154.59
(h) 1口当たり純資産価格	(クラス P - a c c 投資証券) 14.46 (円建クラス P - a c c 投資証券) 11,779円	(クラス P - a c c 投資証券) 16.68 (円建クラス P - a c c 投資証券) 13,269円	(クラス P - a c c 投資証券) 18.74 (円建クラス P - a c c 投資証券) 15,613円	(クラス P - a c c 投資証券) 19.18 (円建クラス P - a c c 投資証券) 16,132円	(クラス P - a c c 投資証券) 17.96 (円建クラス P - a c c 投資証券) 16,435円
(i) 1口当たり当期純利益金 額または当期純損失金額	(クラス P - a c c 投資証券) - 1.61 (円建クラス P - a c c 投資証券) - 11.88	(クラス P - a c c 投資証券) 0.61 (円建クラス P - a c c 投資証券) 23.51	(クラス P - a c c 投資証券) 2.14 (円建クラス P - a c c 投資証券) 15.56	(クラス P - a c c 投資証券) 2.70 (円建クラス P - a c c 投資証券) 18.85	(クラス P - a c c 投資証券) - 1.23 (円建クラス P - a c c 投資証券) - 9.18
(j) 分配総額	なし	なし	なし	なし	なし
(k) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	99.61%	99.74%	98.23%	99.06%	99.62%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾	(クラス P - a c c 投資証券) - 7.49% (円建クラス P - a c c 投資証券) - 9.64%	(クラス P - a c c 投資証券) 3.99% (円建クラス P - a c c 投資証券) 1.48%	(クラス P - a c c 投資証券) 29.60% (円建クラス P - a c c 投資証券) 32.55%	(クラス P - a c c 投資証券) 14.99% (円建クラス P - a c c 投資証券) 21.58%	(クラス P - a c c 投資証券) - 4.16% (円建クラス P - a c c 投資証券) 5.26%

(1) 営業収益には投資収益ならびに実現および未実現利益 (損失) を含めている。以下各サブ・ファンドについて同様とする。

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

- (3) 自己資本利益率は、当該会計年度の1口当たり純資産価格の前年度に対する増減の比率であるが、当該会計年度に初めて当該投資証券が発行された場合には、当初募集価格に対する増減の比率で表すものとする。以下各サブ・ファンドについて同様とする。
- (注1) 2008年4月以降の各取引日に使用された1口当たり純資産価格は、純資産価格の調整の結果、上記および財務書類に記載の1口当たり純資産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) グローバル・アロケーション(米ドル)は2004年9月24日に運用を開始し、円建クラスP - a c c 投資証券は2013年8月5日に募集が開始された。
- (注3) 2009年5月31日付でクラスB投資証券はクラスP - a c c 投資証券に名称が変更された。以下各サブ・ファンドについて同じ。
- (注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。

(グローバル・アロケーション(ユーロ))

(別段の記載がない限り金額はユーロ表示)

	2020年3月末日に 終了する 中間会計年度末	2020年9月末日に 終了する 会計年度末	2021年3月末日に 終了する 中間会計年度末	2021年9月末日に 終了する 会計年度末	2022年3月末日に 終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益	- 36,019,430.25	2,668,977.84	39,963,208.54	53,870,716.39	- 17,372,595.48
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	- 36,019,430.25	2,668,977.84	39,963,208.54	53,870,716.39	- 17,372,595.48
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	- 36,019,430.25	2,668,977.84	39,963,208.54	53,870,716.39	- 17,372,595.48
(d) 出資総額	276,591,220.15	299,205,464.13	349,434,041.35	353,908,219.11	326,077,476.21
(e) 発行済投資口総数	(クラスP - a c c 投資証券) 15,013,005.217口	(クラスP - a c c 投資証券) 14,046,893.386口	(クラスP - a c c 投資証券) 14,684,325.211口	(クラスP - a c c 投資証券) 14,173,706.335口	(クラスP - a c c 投資証券) 13,559,853.194口
(f) 純資産額	276,591,220.15	299,205,464.13	349,434,041.35	353,908,219.11	326,077,476.21
(g) 資産総額	278,177,514.27	301,678,099.82	357,872,301.79	358,251,863.46	339,650,347.29
(h) 1口当たり純資産価格	(クラスP - a c c 投資証券) 12.92	(クラスP - a c c 投資証券) 14.76	(クラスP - a c c 投資証券) 16.55	(クラスP - a c c 投資証券) 17.18	(クラスP - a c c 投資証券) 16.19
(i) 1口当たり当期純利益金 額または当期純損失金額	(クラスP - a c c 投資証券) - 1.59	(クラスP - a c c 投資証券) 0.24	(クラスP - a c c 投資証券) 1.67	(クラスP - a c c 投資証券) 2.39	(クラスP - a c c 投資証券) - 1.01
(j) 分配総額	583,390.75	808,076.75	549,711.83	839,829.90	658,434.48
(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	99.43%	99.18%	97.64%	98.79%	96.00%
(m) 自己資本利益率	(クラスP - a c c 投資証券) - 9.40%	(クラスP - a c c 投資証券) 1.93%	(クラスP - a c c 投資証券) 28.10%	(クラスP - a c c 投資証券) 16.40%	(クラスP - a c c 投資証券) - 2.18%

(注) グローバル・アロケーション(ユーロ)は2004年9月24日に運用を開始した。

(ダイナミック・アルファ (米ドル))

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	2020年3月末日に 終了する 中間会計年度末	2020年9月末日に 終了する 会計年度末	2021年3月末日に 終了する 中間会計年度末	2021年9月末日に 終了する 会計年度末	2022年3月末日に 終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益	- 2,052,103.57	2,516,151.41	3,171,909.79	4,633,581.73	133,095.62
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	- 2,052,103.57	2,516,151.41	3,171,909.79	4,633,581.73	133,095.62
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	- 2,052,103.57	2,516,151.41	3,171,909.79	4,633,581.73	133,095.62
(d) 出資総額	37,561,054.27	43,140,160.78	45,113,865.47	49,030,139.47	48,774,840.34
(e) 発行済投資口総数	(クラスP - a c c 投資証券) 48,770.695口	(クラスP - a c c 投資証券) 43,866.273口	(クラスP - a c c 投資証券) 33,321.284口	(クラスP - a c c 投資証券) 29,414.659口	(クラスP - a c c 投資証券) 29,635.566口
	(ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) 10,325.421口	(ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) 7,333.213口	(ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) 6,411.373口	(ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) 5,009.118口	(ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) 4,590.903口
(f) 純資産額	37,561,054.27	43,140,160.78	45,113,865.47	49,030,139.47	48,774,840.34
(g) 資産総額	39,600,877.17	44,745,629.66	46,311,174.82	50,174,476.94	49,794,736.40
(h) 1口当たり純資産価格	(クラスP - a c c 投資証券) 108.99	(クラスP - a c c 投資証券) 118.53	(クラスP - a c c 投資証券) 128.04	(クラスP - a c c 投資証券) 130.94	(クラスP - a c c 投資証券) 129.75
	(ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) 85.84ユーロ	(ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) 92.75ユーロ	(ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) 99.62ユーロ	(ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) 101.47ユーロ	(ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) 100.02ユーロ
(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) - 8.55	(クラスP - a c c 投資証券) 0.81	(クラスP - a c c 投資証券) 11.55	(クラスP - a c c 投資証券) 16.30	(クラスP - a c c 投資証券) - 1.18
	(ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) - 8.32	(ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) 8.28	(ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) 10.19	(ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) 14.57	(ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) - 6.35
(j) 分配総額	15,068.39	28,341.66	13,353.71	26,768.32	12,708.63
(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	94.85%	96.41%	97.41%	97.72%	97.95%
(m) 自己資本利益率	(クラスP - a c c 投資証券) - 6.50%	(クラスP - a c c 投資証券) 0.43%	(クラスP - a c c 投資証券) 17.48%	(クラスP - a c c 投資証券) 10.47%	(クラスP - a c c 投資証券) 1.34%
	(ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) - 9.11%	(ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) - 1.61%	(ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) 16.05%	(ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) 9.40%	(ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) 0.40%

(注) ダイナミック・アルファ (米ドル) は2005年6月24日に運用を開始した。

(グローバル・エクイティーズ(米ドル))

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	2020年3月末日に 終了する 中間会計年度末	2020年9月末日に 終了する 会計年度末	2021年3月末日に 終了する 中間会計年度末	2021年9月末日に 終了する 会計年度末	2022年3月末日に 終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益	- 8,510,362.86	8,247,970.39	46,111,346.48	54,356,009.07	- 4,911,017.31
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	- 8,510,362.86	8,247,970.39	46,111,346.48	54,356,009.07	- 4,911,017.31
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	- 8,510,362.86	8,247,970.39	46,111,346.48	54,356,009.07	- 4,911,017.31
(d) 出資総額	43,116,952.79	177,851,948.52	210,053,909.19	185,067,420.08	163,161,877.84
(e) 発行済投資口総数	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) 1,024,425.066口	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) 793,268.885口	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) 712,486.218口	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) 670,508.641口	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) 650,199.725口
(f) 純資産額	43,116,952.79	177,851,948.52	210,053,909.19	185,067,420.08	163,161,877.84
(g) 資産総額	43,465,412.35	181,832,429.41	211,427,993.51	186,010,581.82	163,944,844.23
(h) 1口当たり純資産価格	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) 20.05ユーロ	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) 24.69ユーロ	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) 30.96ユーロ	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) 32.26ユーロ	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) 32.33ユーロ
(i) 1口当たり当期純利益金 額または当期純損失金額	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) - 4.55	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) 2.45	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) 7.83	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) 9.42	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) - 1.41
(j) 分配総額	なし	なし	なし	なし	なし
(k) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	99.20%	97.81%	99.35%	99.49%	99.52%
(m) 自己資本利益率	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) - 12.98%	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) 1.77%	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) 54.41%	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) 30.66%	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) 4.43%

(注) グローバル・エクイティーズ(米ドル)は2003年4月30日に運用を開始した。

(2) 外国投資法人の出資総額

2022年4月末日現在の出資総額および発行済投資証券総数は以下のとおりである。

なお、発行可能投資口総口数には原則として制限がない。

	出資総額	発行済投資証券総数(口)	
グローバル・アロケーション (米ドル)	288,245,673.52米ドル (約37,143百万円)	クラス P - a c c 投資証券	14,938,772.865
		円建クラス P - a c c 投資証券	1,283.694
グローバル・アロケーション (ユーロ)	307,735,537.67ユーロ (約41,800百万円)	クラス P - a c c 投資証券	13,431,668.217
ダイナミック・アルファ (米ドル)	47,078,259.89米ドル (約6,067百万円)	クラス P - a c c 投資証券	30,652.824
		ユーロ・ヘッジクラス P - a c c 投資証券	4,634.348
グローバル・エクイティーズ (米ドル)	123,459,525.72米ドル (約15,909百万円)	ユーロ建クラス P - a c c 投資証券	647,587.360

(注) 米ドルおよびユーロの円貨換算は、便宜上、2022年4月28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=128.86円および1ユーロ=135.83円)による。以下、別段の記載がない限り、米ドルおよびユーロ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) 役員状況

(2022年4月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有株式
ロバート・シュティンガー (Robert Süttinger)	チェアマン	UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー、チューリッヒ マネージング・ディレクター	該当なし
フランチェスカ・ガニーニ (Francesca Guagnini)	メンバー・オブ・ザ・ボード	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)	メンバー・オブ・ザ・ボード	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
ラファエル・シュミット・リヒター (Raphael Schmidt - Richter)	メンバー・オブ・ザ・ボード	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
イオアナ・ナウム (Ioana Naum)	メンバー・オブ・ザ・ボード	UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー、チューリッヒ、 エグゼクティブ・ディレクター	該当なし

(注) 本投資法人に従業員はいない。本投資法人の独立監査人は、アーンスト・アンド・ヤング・エス・エイである。

(5) その他

a. 定款の変更

本投資法人の定款は、本投資法人の投資主総会により適用を拡大するかまたはその他の方法で変更することができる。変更は、1915年8月10日の商事会社に関する法律(改正済)(以下「1915年8月10日法」という。)に規定される定足数および過半数の要件に従わなければならない。

b. 事業譲渡または事業譲受

合併

集合投資事業に関する2010年12月17日法律(以下「2010年法」という。)によれば、ルクセンブルグで設立されたUCITSは、吸収される側のUCITSとしてもまたは吸収する側のUCITSとしても、UCITSまたはUCITSのその他のコンパートメントとの、国境を越える合併または国内合併の対象となる可能性がある。

合併には3種類ある。

- UCITS(またはそのうちの一または複数のコンパートメント)(以下「吸収される側のUCITS」という。)が、清算することなく、資産および負債の全部を別の既存のUCITS(以下「吸収する側のUCITS」という。)に移転する場合
- 2つ以上のUCITS(またはその/それらの一または複数のコンパートメント)が、清算することなく、資産および負債の全部を、設立した新たなUCITSに移転する場合
- 負債が消滅するまで存続する一または複数のUCITS(またはコンパートメント)が、自らが設立した同一のUCITSの別のコンパートメントまたは別のUCITS(またはコンパートメント)に資産を移転する場合

吸収される側のUCITS(一部または全部が吸収される)がルクセンブルグで設立された場合、合併はルクセンブルグ金融監督委員会(以下「CSSF」という。)から事前の承認を受ける。

吸収する側のUCITSがルクセンブルグで設立された場合、CSSFの役割は、吸収される側のUCITSの所在国規制機関と緊密に共同して、当該UCITSの投資家の利益を保護することである。

吸収される側のUCITSおよび吸収する側のUCITS双方の預託機関(複数の場合もある。)は、合併の条件のドラフト(特に、合併の種類、合併日付、および移転される資産を記載しているもの)がUCITS文書だけでなく2010年法を遵守していることを、声明書において個別に確認しなければならない。

吸収される側のUCITSがルクセンブルグにある場合、2010年法第67条は、CSSFは以下の一連の情報を提供されていなければならないと定めている。

- a) 吸収される側のUCITSおよび吸収する側のUCITSにより正式に承認された、合併案の共通の条件のドラフト
- b) 目論見書および吸収する側のUCITSが別の加盟国で設立された場合、指令2009/65/EC第78条において言及されている、目論見書および重要投資家情報の最新情報
- c) 2010年法第70条に従い、2010年法第69条第1項a)、f)およびg)に記載されている詳細が2010年法および約款またはそれぞれのUCITSの設立証書の要件を遵守していることを立証したという、吸収される側のUCITSおよび吸収する側のUCITSの各預託機関による声明書。吸収する側のUCITSが別の加盟国で設立された場合、吸収する側のUCITSの預託機関により発行されたこの声明書は、指令2009/65/EC第41条に従い、2010年法第40条第1項a)、f)およびg)に記載された詳細が、指令2009/65/ECおよびUCITSの約款または設立証書の要件を遵守していることが立証されていることを確認するものである。

d) 吸収される側のUCITSおよび吸収する側のUCITSがそれぞれの受益者に提供することを予定している、合併案に関する情報

ファイルの記入が完了すると、CSSFは吸収する側のUCITSの規制機関と連絡を取り、20就業日以内に承認される。

吸収される側のUCITSおよび吸収する側のUCITSがルクセンブルグにある場合、それらの受益者は、自己の投資対象に関する影響可能性に対し説明を受けた上で決定し、ならびに2010年法第66条第4項および第73条に基づく自己の権利を行使することを可能にする等の、合併案に関する適切かつ正確な情報を提供されるものとする。

2010年法第73条(1)によれば、吸収される側のUCITSおよび/または吸収する側のUCITSがルクセンブルグで設立された場合、受益者は、投資回収費用に応じるためにUCITSにより留保されるものを除き、手数料なしに、自己の受益証券の買戻しまたは償還を請求する権利、または可能な場合には、類似する投資方針を有し、かつ同じ管理会社により管理されている別のUCITSの受益証券、または当該管理会社が共通の経営陣もしくは支配権により関連しもしくは実質的に直接もしくは間接保有により関連しているその他の会社により管理されている別のUCITSの受益証券に転換することを請求する権利を有する。この権利は、吸収される側のUCITSの受益者および吸収する側のUCITSの受益者が2010年法第72条に従い合併案につき情報を提供された時点から有効となるものとし、2010年法第75条第1項で言及されている交換率を計算する日付の5就業日前に消滅するものとする。

以下の項を損なうことなく、ルクセンブルグで法人形態で設立されたUCITSの設立文書は、受益者総会または取締役会または重役会(該当する場合)のうちの誰が、別のUCITSとの合併の発効日を決定する資格を有するかを予定しておかなければならない。ルクセンブルグで設立された契約型投資信託(「fonds commun de placement」あるいは「FCP」)の法的形態を有するUCITSについては、これらのUCITSの管理会社は、約款で別途規定されていない限り、別のUCITSとの合併の発効日を決定する資格を有する。約款または設立証書が受益者総会による承認を規定している場合、これらの文書は、適用される定足数要件および多数要件を規定しなければならない。ただし、受益者による合併の共通の条件のドラフトの承認については、かかる承認は、総会に出席または代理出席している受益者による投票総数の75%を超えることまでは必要としないが、少なくとも単純過半数により採用されなければならない。

約款または設立証書に特定の規定がない場合、合併は、コモン・ファンドの法的形態を有する吸収される側のUCITSの管理会社により、および法人形態の吸収される側のUCITSの総会に出席または代理出席している受益者の投票総数の単純過半数により決定する受益者総会により、承認されなければならない。

吸収される側のUCITSが消滅する投資法人である場合の合併については、合併の発効日は、定款(本項の規定が適用されることが了解されている。)に規定されている定足数要件および多数要件に従い決定を行う吸収される側のUCITSの受益者総会により決定されなければならない。

消滅する吸収される側の投資法人については、合併の発効日は、公正証書により記録されなければならない。

吸収される側のUCITSが消滅するFCPである場合の合併については、合併の発効日は、約款で別途規定されていない限り、当該UCITSの管理会社により決定されなければならない。吸収される側の消滅するコモン・ファンドについては、合併の発効日についての決定は、1915年8月10日法の規定に従って、商業および法人登録所に預託されなければならない、かつ商業および法人登録所への当該決定の預託通知として、会社公告集(Recueil Electronique des Sociétés et Associations)(以下「RESA」という。)に公告されなければならない。

合併が上記規定により受益者の承認を要求する限りにおいて、当該UCITSの約款または設立証書が別途規定していない限り、合併に係るコンパートメントの受益者の承認のみが必要であるものとする。

資産の譲渡

SICAVの投資主またはFCPの管理会社の決定に基づき、UCITSは、その資産のすべてを別のUCITSに譲渡することができ、その後、空のUCITSが清算される。

UCITSは、特別な状況において、またCSSFおよび適用法により要求される手続に従い(例えば、サブ・ファンドの合併によるかまたは分離により)、その資産の一部を相手方のUCITSに譲渡することができる。

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

(グローバル・アロケーション(米ドル))

(2022年4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	219,136,832.79	75.12
	アイルランド	24,686,242.10	8.46
	小計	243,823,074.89	83.59
その他の証券	アイルランド	15,226,710.97	5.22
	小計	15,226,710.97	5.22
短期金融商品	アメリカ合衆国	8,993,975.97	3.08
	小計	8,993,975.97	3.08
オプション(標準型)	アメリカ合衆国	462.00	0.00
	小計	462.00	0.00
ポートフォリオ合計		268,044,223.83	91.89
現金・その他資産		23,655,948.31	8.11
資産総額		291,700,172.14	100.00
負債総額		3,454,498.62	1.18
合計(純資産総額)		288,245,673.52 (約37,143百万円)	98.82

(注) 投資比率とは、ファンドの資産総額に対する当該資産の時価の比率をいう。以下各サブ・ファンドについて同様とする。

(グローバル・アロケーション(ユーロ))

(2022年4月末日現在)

資産の種類	国・地域名	時価合計(ユーロ)	投資比率(%)
株式	アメリカ合衆国	97,365,902.04	30.97
	イギリス	12,422,700.25	3.95
	フランス	12,152,178.81	3.87
	オランダ	6,215,681.26	1.98
	スイス	5,746,810.31	1.83
	ドイツ	3,248,490.90	1.03
	スペイン	2,511,894.27	0.80
	アイルランド	2,480,135.99	0.79
	日本	2,383,078.09	0.76
	デンマーク	2,216,284.15	0.70
	フィンランド	2,138,346.30	0.68
	カナダ	1,156,378.81	0.37
	スウェーデン	871,164.62	0.28
	ルクセンブルグ	766,720.00	0.24
	香港	693,215.52	0.22
	オーストリア	667,972.86	0.21
	ノルウェー	605,661.84	0.19
	イタリア	557,612.80	0.18
	ベルギー	216,936.00	0.07
	ジョージア	68,697.41	0.02
	小計	154,485,862.23	49.14
債券	アメリカ合衆国	55,702,624.19	17.72
	オーストラリア	12,943,084.79	4.12
	カナダ	8,424,195.31	2.68
	小計	77,069,904.29	24.51
投資信託	ルクセンブルグ	25,690,664.69	8.17
	小計	25,690,664.69	8.17
短期金融商品	アメリカ合衆国	24,050,008.83	7.65
	小計	24,050,008.83	7.65
その他の証券	アイルランド	4,205,659.90	1.34
	小計	4,205,659.90	1.34
オプション(標準型)	アメリカ合衆国	504.29	0.00
	小計	504.29	0.00
ポートフォリオ合計		285,502,604.23	90.81
現金・その他資産		28,903,639.68	9.19
資産総額		314,406,243.91	100.00
負債総額		6,670,706.24	2.12
合計(純資産総額)		307,735,537.67 (約41,800百万円)	97.88

(ダイナミック・アルファ(米ドル))

(2022年4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	7,752,570.28	16.07
	イギリス	2,461,723.06	5.10
	日本	2,166,264.43	4.49
	カナダ	1,824,527.91	3.78
	オーストラリア	1,481,124.41	3.07
	ドイツ	1,477,317.25	3.06
	フランス	1,348,504.02	2.79
	ニュージーランド	1,111,305.57	2.30
	アイルランド	1,088,464.97	2.26
	オランダ	770,140.43	1.60
	スペイン	721,367.51	1.50
	ルクセンブルグ	384,138.16	0.80
	メキシコ	304,674.19	0.63
	ルーマニア	251,178.31	0.52
	中国	249,053.53	0.52
	ケイマン諸島	228,029.53	0.47
	ポーランド	206,629.52	0.43
	インドネシア	199,980.00	0.41
	ガーンジー	125,615.29	0.26
	フィンランド	106,159.72	0.22
	デンマーク	105,588.89	0.22
	ベルギー	103,177.07	0.21
	マレーシア	100,143.75	0.21
	ジャージー	72,118.73	0.15
	コロンビア	52,900.00	0.11
	国際機関	45,646.42	0.09
ベネズエラ	32,013.47	0.07	
	小計	24,770,356.42	51.34
短期金融商品	アメリカ合衆国	12,878,363.69	26.69
	小計	12,878,363.69	26.69
投資信託	アイルランド	3,355,538.88	6.95
	小計	3,355,538.88	6.95
ポートフォリオ合計		41,004,258.99	84.98
現金・その他資産		7,247,477.89	15.02
資産総額		48,251,736.88	100.00
負債総額		1,173,476.99	2.43
合計(純資産総額)		47,078,259.89 (約6,067百万円)	97.57

(グローバル・エクイティーズ(米ドル))

(2022年4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(%)
株式	アメリカ合衆国	66,157,612.42	53.33
	イギリス	20,073,721.98	16.18
	日本	11,274,720.57	9.09
	オランダ	6,859,701.78	5.53
	アイルランド	4,248,885.26	3.43
	スイス	3,545,961.98	2.86
	インド	3,437,604.48	2.77
	デンマーク	2,818,937.64	2.27
	ドイツ	1,836,411.05	1.48
	フランス	1,705,411.02	1.37
	小計	121,958,968.18	98.31
投資信託	ルクセンブルグ	736,461.00	0.59
	小計	736,461.00	0.59
ポートフォリオ合計		122,695,429.18	98.91
現金・その他資産		1,354,775.26	1.09
資産総額		124,050,204.44	100.00
負債総額		590,678.72	0.48
合計(純資産総額)		123,459,525.72 (約15,909百万円)	99.52

(2) 運用実績

純資産等の推移

2022年4月末日までの1年間における各月末の総資産および純資産の推移は以下のとおりである。

(グローバル・アロケーション(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 (円建クラス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	円
2021年5月末日	356,038	45,879	349,269	45,007	19.43	2,504	16,021
6月末日	350,297	45,139	347,495	44,778	19.33	2,491	16,175
7月末日	347,018	44,717	344,471	44,389	19.38	2,497	16,032
8月末日	352,504	45,424	349,377	45,021	19.73	2,542	16,344
9月末日	342,634	44,152	339,422	43,738	19.18	2,472	16,132
10月末日	344,735	44,423	343,062	44,207	19.42	2,502	16,698
11月末日	333,918	43,029	332,053	42,788	18.86	2,430	16,141
12月末日	350,621	45,181	338,080	43,565	19.37	2,496	16,813
2022年1月末日	323,429	41,677	320,959	41,359	18.43	2,375	16,012
2月末日	315,109	40,605	312,335	40,247	18.00	2,319	15,625
3月末日	308,936	39,809	307,757	39,658	17.96	2,314	16,435
4月末日	291,700	37,588	288,246	37,143	16.98	2,188	16,588

(グローバル・アロケーション(ユーロ))

	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)	
	千ユーロ	百万円	千ユーロ	百万円	ユーロ	円
2021年5月末日	366,311	49,756	358,007	48,628	17.04	2,315
6月末日	364,626	49,527	361,466	49,098	17.16	2,331
7月末日	364,902	49,565	359,192	48,789	17.21	2,338
8月末日	366,445	49,774	363,559	49,382	17.58	2,388
9月末日	358,252	48,661	353,908	48,071	17.18	2,334
10月末日	365,366	49,628	362,923	49,296	17.55	2,384
11月末日	355,593	48,300	354,331	48,129	17.17	2,332
12月末日	366,835	49,827	360,461	48,961	17.51	2,378
2022年1月末日	347,625	47,218	342,948	46,583	16.68	2,266
2月末日	337,755	45,877	330,920	44,949	16.29	2,213
3月末日	339,650	46,135	326,077	44,291	16.19	2,199
4月末日	314,406	42,706	307,736	41,800	15.36	2,086

(ダイナミック・アルファ(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 (ユーロ・ヘッジクラス 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	ユーロ	円
2021年5月末日	52,840	6,809	47,217	6,084	130.17	16,774	101.10	13,732
6月末日	47,387	6,106	46,201	5,953	131.02	16,883	101.73	13,818
7月末日	47,449	6,114	46,262	5,961	130.14	16,770	100.97	13,715
8月末日	48,287	6,222	46,975	6,053	131.50	16,945	101.95	13,848
9月末日	50,174	6,465	49,030	6,318	130.94	16,873	101.47	13,783
10月末日	50,762	6,541	49,238	6,345	129.73	16,717	100.46	13,645
11月末日	50,158	6,463	48,657	6,270	128.75	16,591	99.66	13,537
12月末日	51,491	6,635	49,402	6,366	130.63	16,833	100.96	13,713
2022年1月末日	48,409	6,238	46,887	6,042	131.40	16,932	101.48	13,784
2月末日	48,338	6,229	46,857	6,038	130.10	16,765	100.40	13,637
3月末日	49,795	6,417	48,775	6,285	129.75	16,720	100.02	13,586
4月末日	48,252	6,218	47,078	6,066	126.82	16,342	97.60	13,257

(グローバル・エクイティーズ(米ドル))

	資産総額		純資産総額		1口当たり純資産価格 (ユーロ建クラス P - a c c投資証券)	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	ユーロ	円
2021年5月末日	224,867	28,976	224,499	28,929	31.61	4,294
6月末日	224,132	28,882	223,544	28,806	32.06	4,355
7月末日	219,711	28,312	218,004	28,092	32.11	4,362
8月末日	189,026	24,358	188,171	24,248	32.72	4,444
9月末日	186,011	23,969	185,067	23,848	32.26	4,382
10月末日	194,277	25,035	193,335	24,913	32.97	4,478
11月末日	178,351	22,982	178,040	22,942	33.19	4,508
12月末日	185,099	23,852	184,904	23,827	33.92	4,607
2022年1月末日	173,083	22,304	165,670	21,348	32.86	4,463
2月末日	166,502	21,455	166,191	21,415	31.91	4,334
3月末日	163,945	21,126	163,162	21,025	32.33	4,391
4月末日	124,050	15,985	123,460	15,909	31.10	4,224

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

(グローバル・アロケーション(米ドル))

クラスP - a c c 投資証券 / 円建クラスP - a c c 投資証券

該当事項なし。

(グローバル・アロケーション(ユーロ))

クラスP - a c c 投資証券

該当事項なし。

(ダイナミック・アルファ(米ドル))

クラスP - a c c 投資証券 / ユーロ・ヘッジクラスP - a c c 投資証券

該当事項なし。

(グローバル・エクイティーズ(米ドル))

ユーロ建クラス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5月1日から2022年4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)	
	グローバル・アロケーション(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券
	円建クラスP - a c c 投資証券	4.87
グローバル・アロケーション(ユーロ)	クラスP - a c c 投資証券	- 9.17
ダイナミック・アルファ(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	- 1.76
	ユーロ・ヘッジクラスP - a c c 投資証券	- 2.75
グローバル・エクイティーズ(米ドル)	ユーロ建クラスP - a c c 投資証券	- 1.68

(注) 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$

a = 2022年4月末日現在の1口当たり純資産価格(当該期間の分配金の合計金額を加えた額)

b = 2021年4月末日現在の1口当たり純資産価格(分配落の額)

(3) 投資リスク

当中間計算期間において、2022年3月31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

2022年4月末日現在の株主資本総額は、13,000,000ユーロ (約18億円)

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

資本金 (株主資本) の額

2021年9月末日現在の資本金額は、179,589,267米ドル (約231億円)

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

資本金 (株主資本) の額

2022年4月末日現在、500,000スイスフラン (約6,645万円)

(注) スイスフランの円貨換算は、便宜上、2022年4月28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 = 132.90円) による。

UBS アセット・マネジメント (UK) リミテッド (ロンドン) (投資運用会社)

資本金 (株主資本) の額

2022年4月末日現在の株主資本総額は、140,000,000英ポンド (約226億円)

(注) 英ポンドの円貨換算は、便宜上、2022年4月28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英ポンド = 161.54円) による。

(2) 大株主の状況

UBSファンド・マネジメント(ルクセンブルグ)エス・エイ

(2022年4月末日現在)

名称	住所	所有株式数(株)	比率(%)
ユービーエス・アセット・マネジメント・エイ・ジー (UBS Asset Management AG)	バーンホフ・シュトラッセ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(アメリカス)インク(シカゴ)

(2022年4月末日現在)

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

UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)

(2022年4月末日現在)

名称	住所	所有株式数(株)	比率(%)
ユービーエス・アセット・マネジメント・エイ・ジー (UBS Asset Management AG)	バーンホフ・シュトラッセ45、CH-8001 チューリッヒ、スイス	5,000,000	100

UBSアセット・マネジメント(UK)リミテッド(ロンドン)

(2022年4月末日現在)

名称	住所	所有株式数(株)	比率(%)
ユービーエス・アセット・マネジメント・ホールディング・リミテッド (UBS Asset Management Holding Ltd)	ブロードゲート 5、ロンドン、英国	139,999,999	99.999
フィルドリユー・ノミニーズ・リミテッド (Phildrew Nominees Ltd)	ブロードゲート 5、ロンドン、英国	1	0.001

(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

(2022年4月末日現在)

氏名	役職名	就任	略歴	所有株式
マイケル・ケール (Michael Kehl)	チェアマン	2022年1月1日	UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー、チューリッヒ、スイス、ヘッド・オブ・プロダクト	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	2019年12月5日	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
アンドレ・ヴァレンテ (André Valente)	ディレクター/ ボード・メンバー	2020年2月17日	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
アン - シャルロット・ローヤー (Ann-Charlotte Lawyer)	インディペンデント・ディレクター/ ボード・メンバー	2022年1月1日	ルクセンブルグ大公国、インディペンデント・ディレクター	該当なし
ミリアム・ウエベル (Miriam Uebel)	インディペンデント・ディレクター/ ボード・メンバー	2022年3月8日	ルクセンブルグ大公国、インディペンデント・ディレクター	該当なし

UBSアセット・マネジメント(アメリカス)インク(シカゴ)

(2022年4月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有株式
ニコラス・バグラ (Nicholas Vagra)	ディレクター	2021年6月14日就任	非公開
ジョン・クリーグ (John Krieg)	ディレクター	2021年6月14日就任	非公開
ジェームス・ポージャー (James Poucher)	ディレクター	2022年1月1日就任	非公開

UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)

(2022年4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

UBSアセット・マネジメント(UK)リミテッド(ロンドン)

(2022年4月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有株式
イアン・アシュメント (Ian Ashment)	ディレクター/ ボード・メンバー	2019年10月30日就任	非公開
プリシラ・ディヴィス (Priscilla Davies)	チェアマン	2017年9月20日就任	非公開
エリック・チャールズ・ス プレイグ・バーン (Eric Charles Sprague Byrne)	ディレクター/ ボード・メンバー	2017年2月15日就任	非公開
ルース・ビーチイ (Ruth Beechey)	ディレクター/ ボード・メンバー	2018年3月26日就任	非公開
キース・マーティン・ ジェックス (Keith Martin Jecks)	ノン・エグゼクティ ブ・ ディレクター	2018年10月1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。

2022年4月末日現在、管理会社は以下のとおり、419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	364	537,368,737.78オーストラリア・ドル
			3,091,726,752.89カナダ・ドル
			14,289,913,778.81スイス・フラン
			17,486,218,077.22中国元
			520,370,132.57デンマーク・クローネ
			53,469,850,363.98ユーロ
			1,910,340,562.38英ポンド
			297,231,496.53香港ドル
			421,108,045,148.78日本円
			54,070,829.20シンガポール・ドル
			127,761,823,049.52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	1,118,987,035.65オーストラリア・ドル
			184,810,972.50スイス・フラン
			2,561,092,361.69ユーロ
			2,730,835,288.91英ポンド
			17,546,762,171.00日本円
			33,503,018,629.23米ドル

UBSアセット・マネジメント(アメリカス)インク(シカゴ)

2022年4月末日現在、UBSアセット・マネジメント(アメリカス)インク(シカゴ)は46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 (米ドル)
1	UBS (Lux) Real Estate Funds Selection - Global	変動資本を有する投資法人	2008年6月30日	9,053,693,652
2	UBS (Irl) Fund plc - UBS (Irl) Select Money Market Fund - USD Sustainable	公開有限責任会社	2002年5月31日	5,642,032,422
3	UBS (Lux) Equity Sicav - Long Term Themes (USD)	変動資本を有する投資法人	2016年1月28日	5,282,712,353
4	Focused Fund - Corporate Bond Sustainable USD	契約型投資信託	2003年9月12日	2,245,094,687
5	UBS (Lux) Bond Sicav - USD Investment Grade Corporates Sustainable (USD)	変動資本を有する投資法人	2017年1月30日	1,887,086,761
6	Focused Sicav - US Corporate Bond Sustainable (USD)	変動資本を有する投資法人	2016年11月7日	1,653,392,525
7	UBS (Irl) Fund plc - UBS (Irl) Select Money Market Fund - US Treasury	公開有限責任会社	2018年11月14日	1,484,854,120
8	UBS (Lux) Equity Sicav - USA Growth (USD)	変動資本を有する投資法人	2004年10月13日	1,441,570,222
9	UBS (Lux) Equity Sicav - Global Impact (USD)	変動資本を有する投資法人	2017年10月13日	987,438,746
10	UBS (Lux) Fund Solutions - J.P. Morgan USD EM Diversified Bond 1-5 UCITS ETF	変動資本を有する投資法人	2017年10月31日	809,812,659

(注1) 一単位当たり純資産価格は開示していない。

(注2) 上記は管理会社から提供された情報に基づく。

UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)

2022年4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117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 (米ドル)
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	5,017,000,703
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26日	3,718,475,443
3	UBS (Lux) Money Market Fund - USD Sustainable	契約型投資信託	1988年11月29日	2,803,419,706
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	2,509,896,002
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14日	2,452,508,305
6	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	1,793,896,945
7	Focused Sicav - High Grade Bond USD	変動資本を有する 投資法人	2005年8月30日	1,757,025,005
8	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	1,678,120,278
9	UBS (Lux) Strategy Sicav - Systematic Allocation Portfolio Medium (USD)	変動資本を有する 投資法人	2017年6月1日	1,643,246,668
10	UBS (Lux) Money Market Fund - EUR Sustainable	契約型投資信託	1989年10月11日	1,577,986,042

(注1) 一単位当たり純資産価格は開示していない。

(注2) 上記は管理会社から提供された情報に基づく。

UBSアセット・マネジメント(UK)リミテッド(ロンドン)

2022年4月末日現在、UBSアセット・マネジメント(UK)リミテッド(ロンドン)は122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 (年/月/日)	純資産総額 (ユーロ)
1	UBS(Lux)Fund Solutions - MSCI World Socially Responsible UCITS ETF	変動資本を有する投資法人	2011年8月19日	4,272,414,089
2	UBS(Irl)ETF plc - MSCI ACWI Socially Responsible UCITS ETF	公開有限責任会社	2017年12月20日	3,981,696,680
3	UBS(Irl)ETF plc - MSCI ACWI ESG Universal Low Carbon Select UCITS ETF	公開有限責任会社	2017年12月19日	3,280,732,509
4	UBS(Lux)Fund Solutions - MSCI Emerging Markets UCITS ETF	変動資本を有する投資法人	2010年11月12日	3,087,099,008
5	UBS(Lux)Fund Solutions - MSCI EMU UCITS ETF	変動資本を有する投資法人	2002年9月19日	2,834,482,152
6	UBS(Irl)ETF plc - S&P 500 ESG UCITS ETF	公開有限責任会社	2019年3月25日	2,749,157,565
7	UBS(Lux)Fund Solutions - MSCI Canada UCITS ETF	変動資本を有する投資法人	2009年9月30日	2,419,096,867
8	UBS(Lux)Fund Solutions - MSCI EMU Socially Responsible UCITS ETF	変動資本を有する投資法人	2011年8月18日	2,393,125,959
9	UBS(Lux)Fund Solutions - MSCI Japan UCITS ETF	変動資本を有する投資法人	2001年10月30日	2,290,814,707
10	UBS(Lux)Fund Solutions - MSCI USA Socially Responsible UCITS ETF	変動資本を有する投資法人	2011年8月18日	2,290,287,703

(注1) 一単位当たり純資産価格は開示していない。

(注2) 上記は管理会社から提供された情報に基づく。

[次へ](#)

4 外国投資法人の経理状況

- a . ファンドの日本語の中間財務書類は、ルクセンブルグにおける諸法令および一般に認められた会計原則に準拠して作成された原文の中間財務書類を翻訳したものである。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。
- b . 原文の中間財務書類は、UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブおよびすべてのサブ・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。ただし、各サブ・ファンドには以下に記載した投資証券以外の投資証券も存在するが、以下に記載した投資証券に関連する部分を抜粋して日本語に記載している。
- グローバル・アロケーション(米ドル)クラスP - a c c 投資証券
 - グローバル・アロケーション(米ドル)円建クラスP - a c c 投資証券
 - グローバル・アロケーション(ユーロ)クラスP - a c c 投資証券
 - ダイナミック・アルファ(米ドル)クラスP - a c c 投資証券
 - ダイナミック・アルファ(米ドル)ユーロ・ヘッジクラスP - a c c 投資証券
 - グローバル・エクイティーズ(米ドル)ユーロ建クラスP - a c c 投資証券
- c . ファンドの中間財務書類は、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 . 原文の中間財務書類は、ユーロおよび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、2022年4月28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ユーロ=135.83円、1米ドル=128.86円)で換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

(1) 資産及び負債の状況

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション (米ドル)
純資産計算書

	2022年3月31日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	268,367,770.19	34,581,871
投資有価証券、未実現評価(損)益	5,724,742.62	737,690
投資有価証券合計(注1)	274,092,512.81	35,319,561
現金預金、要求払預金および預託金勘定	28,708,304.46	3,699,352
その他の流動資産(マージン)	4,395,773.95	566,439
有価証券売却未収金(注1)	190,839.33	24,592
発行未収金	14.44	2
流動資産に係る未収利息	5,683.31	732
スワップに係る未収利息	135,475.00	17,457
その他の未収金	52,994.63	6,829
金融先物に係る未実現利益(注1)	576,962.92	74,347
スワップに係る未実現利益(注1)	777,593.74	100,201
資産合計	308,936,154.59	39,809,513
負 債		
先渡為替契約に係る未実現損失(注1)	(405,150.93)	(52,208)
当座借越に係る未払利息	(1,317.98)	(170)
有価証券購入未払金(注1)	(208,574.05)	(26,877)
買戻未払金	(38,919.90)	(5,015)
定率報酬引当金(注2)	(489,533.49)	(63,081)
年次税引当金(注3)	(9,054.89)	(1,167)
その他の手数料および報酬に係る引当金(注2)	(27,038.01)	(3,484)
引当金合計	(525,626.39)	(67,732)
負債合計	(1,179,589.25)	(152,002)
期末現在純資産	307,756,565.34	39,657,511

注記は当財務書類の一部である。

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション (米ドル)
運用計算書

自2021年10月1日 至2022年3月31日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	9,469.74	1,220
有価証券に係る利息	356,052.74	45,881
スワップに係る受取利息(注1)	202,824.49	26,136
証券貸付に係る純収益	2,255.68	291
その他の収益(注4)	6,687.03	862
収益合計	<u>577,289.68</u>	<u>74,390</u>
費 用		
スワップに係る支払利息(注1)	(260,331.43)	(33,546)
定率報酬(注2)	(3,110,651.06)	(400,838)
年次税(注3)	(14,409.16)	(1,857)
その他の手数料および報酬(注2)	(32,057.71)	(4,131)
現金および当座借越に係る利息	(11,446.36)	(1,475)
費用合計	<u>(3,428,895.72)</u>	<u>(441,848)</u>
投資純(損)益	<u>(2,851,606.04)</u>	<u>(367,458)</u>
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	6,234,108.25	803,327
オプションに係る実現(損)益	165,851.25	21,372
利回り評価証券および短期金融商品に係る 実現(損)益	(1,151.10)	(148)
金融先物に係る実現(損)益	(3,982,176.23)	(513,143)
先渡為替契約に係る実現(損)益	1,570,596.58	202,387
スワップに係る実現(損)益	(3,018,328.46)	(388,942)
為替差(損)益	(306,054.93)	(39,438)
実現(損)益合計	<u>662,845.36</u>	<u>85,414</u>
当期実現純(損)益	<u>(2,188,760.68)</u>	<u>(282,044)</u>
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	(21,731,089.15)	(2,800,268)
利回り評価証券および短期金融商品に係る 未実現評価(損)益	73.93	10
金融先物に係る未実現評価(損)益	442,495.63	57,020
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	(538,557.43)	(69,399)
スワップに係る未実現評価(損)益	2,942,110.65	379,120
未実現評価(損)益の変動合計	<u>(18,884,966.37)</u>	<u>(2,433,517)</u>
運用の結果による純資産の純増(減)	<u>(21,073,727.05)</u>	<u>(2,715,560)</u>

注記は当財務書類の一部である。

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション(米ドル)
純資産の変動

	自2021年10月1日 至2022年3月31日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	339,421,733.18	43,737,885
発行額	2,430,876.12	313,243
買戻額	(13,022,316.91)	(1,678,056)
純発行(買戻)合計	(10,591,440.79)	(1,364,813)
投資純(損)益	(2,851,606.04)	(367,458)
実現(損)益合計	662,845.36	85,414
未実現評価(損)益の変動合計	(18,884,966.37)	(2,433,517)
運用の結果による純資産の純増(減)	(21,073,727.05)	(2,715,560)
期末現在純資産	307,756,565.34	39,657,511

発行済投資証券数の変動表

	自2021年10月1日 至2022年3月31日	
	(口)	
クラスP-acc	(口)	
期首現在発行済投資証券数	15,485,088.9070	
期中発行投資証券数	53,500.3040	
期中買戻投資証券数	(450,473.3850)	
期末現在発行済投資証券数	15,088,115.8260	
円建クラスP-acc	(口)	
期首現在発行済投資証券数	1,283.6940	
期中発行投資証券数	0.0000	
期中買戻投資証券数	0.0000	
期末現在発行済投資証券数	1,283.6940	

注記は当財務書類の一部である。

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション(米ドル)

最重要数値

	ISIN	2022年3月31日	2021年9月30日	2020年9月30日
純資産額(米ドル)		307,756,565.34	339,421,733.18	350,935,668.05
クラスP-acc	LU0197216392			
発行済投資証券数(口)		15,088,115.8260	15,485,088.9070	17,146,791.1110
1口当たり純資産価格(米ドル)		17.96	19.18	16.68
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) ¹		17.96	19.18	16.68
円建クラスP-acc	LU0953722104			
発行済投資証券数(口)		1,283.6940	1,283.6940	1,283.6940
1口当たり純資産価格(日本円)		16,435	16,132	13,269
1口当たり発行・買戻価格(日本円) ¹		16,435	16,132	13,269

¹ 注記1を参照

組入証券の構造

2022年3月31日現在

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	76.16 %	投資信託	83.30 %
アイルランド	12.90	抵当および資金貸出機関	5.76
合計	89.06	合計	89.06

注記は当財務書類の一部である。

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション (ユーロ)
純資産計算書

2022年3月31日現在

	(ユーロ)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	256,751,023.39	34,874,492
投資有価証券、未実現評価(損)益	28,529,947.56	3,875,223
投資有価証券合計(注1)	285,280,970.95	38,749,714
現金預金、要求払預金および預託金勘定	37,686,904.61 *	5,119,012
その他の流動資産(マージン)	10,079,211.68	1,369,059
有価証券売却未収金(注1)	4,359,794.52	592,191
発行未収金	88,278.96	11,991
有価証券に係る未収利息	557,249.86	75,691
流動資産に係る未収利息	15,034.71	2,042
未収配当金	131,037.06	17,799
前払費用	59,416.16	8,070
その他の未収金	226,607.89	30,780
金融先物に係る未実現利益(注1)	409,633.06	55,640
スワップに係る未実現利益(注1)	756,207.83	102,716
資産合計	339,650,347.29	46,134,707
負 債		
先渡為替契約に係る未実現損失(注1)	(8,121,020.14)	(1,103,078)
当座借越に係る未払利息	(291.28)	(40)
有価証券購入未払金(注1)	(4,508,779.24)	(612,427)
買戻未払金	(382,170.83)	(51,910)
定率報酬引当金(注2)	(496,714.82)	(67,469)
年次税引当金(注3)	(35,722.60)	(4,852)
その他の手数料および報酬に係る引当金(注2)	(28,172.17)	(3,827)
引当金合計	(560,609.59)	(76,148)
負債合計	(13,572,871.08)	(1,843,603)
期末現在純資産	326,077,476.21	44,291,104

* 2022年3月31日現在、当該現金額は取引の相手方のために担保に供されており、J.P. モルガンについては646.21ユーロである。

注記は当財務書類の一部である。

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション (ユーロ)
運用計算書

自2021年10月1日 至2022年3月31日

	(ユーロ)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	35,220.14	4,784
有価証券に係る利息	1,397,938.11	189,882
配当金(注1)	1,080,171.71	146,720
スワップに係る受取利息(注1)	560,248.38	76,099
証券貸付に係る純収益	37,221.60	5,056
その他の収益(注4)	3,146.19	427
収益合計	<u>3,113,946.13</u>	<u>422,967</u>
費 用		
スワップに係る支払利息(注1)	(34,919.19)	(4,743)
定率報酬(注2)	(3,172,362.24)	(430,902)
年次税(注3)	(75,241.59)	(10,220)
その他の手数料および報酬(注2)	(48,181.98)	(6,545)
現金および当座借越に係る利息	(49,210.98)	(6,684)
費用合計	<u>(3,379,915.98)</u>	<u>(459,094)</u>
投資純(損)益	<u>(265,969.85)</u>	<u>(36,127)</u>
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	27,890,184.77	3,788,324
オプションに係る実現(損)益	(21,986.17)	(2,986)
利回り評価証券および短期金融商品に係る 実現(損)益	78,624.05	10,680
金融先物に係る実現(損)益	(7,788,975.76)	(1,057,977)
先渡為替契約に係る実現(損)益	(4,772,239.31)	(648,213)
スワップに係る実現(損)益	(3,020,496.22)	(410,274)
為替差(損)益	2,207,508.54	299,846
実現(損)益合計	<u>14,572,619.90</u>	<u>1,979,399</u>
当期実現純(損)益	<u>14,306,650.05</u>	<u>1,943,272</u>
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	(27,196,914.64)	(3,694,157)
利回り評価証券および短期金融商品に係る 未実現評価(損)益	461,229.54	62,649
金融先物に係る未実現評価(損)益	(174,395.27)	(23,688)
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	(6,439,954.52)	(874,739)
スワップに係る未実現評価(損)益	1,670,789.36	226,943
未実現評価(損)益の変動合計	<u>(31,679,245.53)</u>	<u>(4,302,992)</u>
運用の結果による純資産の純増(減)	<u>(17,372,595.48)</u>	<u>(2,359,720)</u>

注記は当財務書類の一部である。

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション (ユーロ)

純資産の変動

	自2021年10月1日 至2022年3月31日	
	(ユーロ)	(千円)
期首現在純資産	353,908,219.11	48,071,353
発行額	13,338,099.07	1,811,714
買戻額	(23,137,812.01)	(3,142,809)
純発行(買戻)合計	(9,799,712.94)	(1,331,095)
支払配当金	(658,434.48)	(89,435)
投資純(損)益	(265,969.85)	(36,127)
実現(損)益合計	14,572,619.90	1,979,399
未実現評価(損)益の変動合計	(31,679,245.53)	(4,302,992)
運用の結果による純資産の純増(減)	(17,372,595.48)	(2,359,720)
期末現在純資産	326,077,476.21	44,291,104

発行済投資証券数の変動表

クラスP-acc	自2021年10月1日 至2022年3月31日	
	(口)	
期首現在発行済投資証券数	14,173,706.3350	
期中発行投資証券数	192,557.6550	
期中買戻投資証券数	(806,410.7960)	
期末現在発行済投資証券数	13,559,853.1940	

最重要数値

	ISIN	2022年3月31日	2021年9月30日	2020年9月30日
純資産額(ユーロ)		326,077,476.21	353,908,219.11	299,205,464.13
クラスP-acc	LU0197216558			
発行済投資証券数(口)		13,559,853.1940	14,173,706.3350	14,046,893.3860
1口当たり純資産価格(ユーロ)		16.19	17.18	14.76
1口当たり発行・買戻価格(ユーロ) ¹		16.19	17.18	14.76

¹ 注記1を参照

注記は当財務書類の一部である。

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション (ユーロ)

組入証券の構造

2022年3月31日現在

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)
アメリカ合衆国	54.88 %	国および中央政府	29.26 %
ルクセンブルグ	7.88	インターネット、ソフトウェア・ITサービス	8.64
オーストラリア	4.05	投資信託	7.67
フランス	3.89	金融および持株会社	6.24
イギリス	3.59	医薬品・化粧品・医療品	5.89
カナダ	2.99	銀行および金融機関	3.13
アイルランド	2.02	電子工学・半導体	2.69
オランダ	1.89	小売り・百貨店	2.37
スイス	1.72	食品・清涼飲料	2.33
ドイツ	1.01	保険	2.18
日本	0.75	エネルギー・水道	1.33
フィンランド	0.61	自動車	1.28
デンマーク	0.60	機械工学・産業機器	1.26
スペイン	0.44	抵当および資金貸出機関	1.25
スウェーデン	0.27	コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置	1.24
イタリア	0.26	たばこ・アルコール	1.17
香港	0.22	グラフィックデザイン・出版・メディア	1.15
オーストリア	0.19	宿泊・仕出し・レジャー	0.74
ノルウェー	0.17	化学	0.73
ベルギー	0.06	バイオテクノロジー	0.73
合計	87.49	繊維・衣服・革製品	0.66
		通信	0.65
		石油	0.63
		ヘルスケア、社会事業	0.62
		交通・運輸	0.61
		航空宇宙産業	0.54
		不動産	0.52
		電気装置・部品	0.49
		建築業・資材	0.48
		各種非分類会社	0.30
		農業・漁業	0.17
		環境保護・リサイクル	0.16
		非鉄金属	0.15
		各種サービス	0.12
		カントン(州)、連邦国家	0.11
		合計	87.49

注記は当財務書類の一部である。

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - ダイナミック・アルファ (米ドル)
純資産計算書

2022年3月31日現在

	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	41,276,582.65	5,318,900
投資有価証券、未実現評価(損)益	(62,107.74)	(8,003)
投資有価証券合計(注1)	41,214,474.91	5,310,897
現金預金、要求払預金および預託金勘定	7,317,574.46	942,943
その他の流動資産(マージン)	269,835.94	34,771
有価証券に係る未収利息	152,346.89	19,631
流動資産に係る未収利息	398.43	51
その他の未収金	49,238.21	6,345
金融先物に係る未実現利益(注1)	463,996.67	59,791
先渡為替契約に係る未実現利益(注1)	198,285.35	25,551
スワップに係る未実現利益(注1)	128,585.54	16,570
資産合計	49,794,736.40	6,416,550
負 債		
当座借越	(874,064.52)	(112,632)
当座借越に係る未払利息	(133.45)	(17)
有価証券購入未払金(注1)	(82,300.46)	(10,605)
買戻未払金	(47,000.13)	(6,056)
定率報酬引当金(注2)	(10,738.27)	(1,384)
年次税引当金(注3)	(1,805.99)	(233)
その他の手数料および報酬に係る引当金(注2)	(3,853.24)	(497)
引当金合計	(16,397.50)	(2,113)
負債合計	(1,019,896.06)	(131,424)
期末現在純資産	48,774,840.34	6,285,126

注記は当財務書類の一部である。

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - ダイナミック・アルファ (米ドル)
運用計算書

自2021年10月1日 至2022年3月31日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	486.32	63
有価証券に係る利息	221,792.67	28,580
スワップに係る受取利息(注1)	54,521.89	7,026
証券貸付に係る純収益	9,212.51	1,187
その他の収益(注4)	3,124.59	403
収益合計	<u>289,137.98</u>	<u>37,258</u>
費 用		
スワップに係る支払利息(注1)	(1,575.36)	(203)
定率報酬(注2)	(62,783.36)	(8,090)
年次税(注3)	(3,644.31)	(470)
その他の手数料および報酬(注2)	(10,209.18)	(1,316)
現金および当座借越に係る利息	(5,898.43)	(760)
費用合計	<u>(84,110.64)</u>	<u>(10,838)</u>
投資純(損)益	<u>205,027.34</u>	<u>26,420</u>
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	(3,845.40)	(496)
利回り評価証券および短期金融商品に係る 実現(損)益	993.65	128
金融先物に係る実現(損)益	(190,720.18)	(24,576)
先渡為替契約に係る実現(損)益	792,053.61	102,064
スワップに係る実現(損)益	11,800.90	1,521
為替差(損)益	(29,387.88)	(3,787)
実現(損)益合計	<u>580,894.70</u>	<u>74,854</u>
当期実現純(損)益	<u>785,922.04</u>	<u>101,274</u>
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	(1,210,084.34)	(155,931)
利回り評価証券および短期金融商品に係る 未実現評価(損)益	(4,596.09)	(592)
金融先物に係る未実現評価(損)益	373,768.17	48,164
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	271,900.09	35,037
スワップに係る未実現評価(損)益	(83,814.25)	(10,800)
未実現評価(損)益の変動合計	<u>(652,826.42)</u>	<u>(84,123)</u>
運用の結果による純資産の純増(減)	<u>133,095.62</u>	<u>17,151</u>

注記は当財務書類の一部である。

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - ダイナミック・アルファ (米ドル)
純資産の変動

	自2021年10月1日 至2022年3月31日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	49,030,139.47	6,318,024
発行額	3,113,638.53	401,223
買戻額	(3,489,324.65)	(449,634)
純発行(買戻)合計	(375,686.12)	(48,411)
支払配当金	(12,708.63)	(1,638)
投資純(損)益	205,027.34	26,420
実現(損)益合計	580,894.70	74,854
未実現評価(損)益の変動合計	(652,826.42)	(84,123)
運用の結果による純資産の純増(減)	133,095.62	17,151
期末現在純資産	48,774,840.34	6,285,126

発行済投資証券数の変動表

	自2021年10月1日 至2022年3月31日	
	(口)	
クラスP-acc	(口)	
期首現在発行済投資証券数	29,414.6590	
期中発行投資証券数	2,845.7980	
期中買戻投資証券数	(2,624.8910)	
期末現在発行済投資証券数	29,635.5660	
ユーロ・ヘッジクラスP-acc	(口)	
期首現在発行済投資証券数	5,009.1180	
期中発行投資証券数	69.2470	
期中買戻投資証券数	(487.4620)	
期末現在発行済投資証券数	4,590.9030	

注記は当財務書類の一部である。

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - ダイナミック・アルファ (米ドル)

最重要数値

	ISIN	2022年3月31日	2021年9月30日	2020年9月30日
純資産額 (米ドル)		48,774,840.34	49,030,139.47	43,140,160.78
クラスP-acc	LU0218832805			
発行済投資証券数 (口)		29,635.5660	29,414.6590	43,866.2730
1口当たり純資産価格 (米ドル)		129.75	130.94	118.53
1口当たり発行・買戻価格 (米ドル) ¹		129.75	130.94	118.53
ユーロ・ヘッジクラスP-acc	LU0849401350			
発行済投資証券数 (口)		4,590.9030	5,009.1180	7,333.2130
1口当たり純資産価格 (ユーロ)		100.02	101.47	92.75
1口当たり発行・買戻価格 (ユーロ) ¹		100.02	101.47	92.75

¹ 注記1を参照

組入証券の構造

2022年3月31日現在

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)
アメリカ合衆国	42.71 %	国および中央政府	54.77 %
アイルランド	9.22	投資信託	7.10
日本	4.67	銀行および金融機関	6.67
イギリス	4.48	金融および持株会社	5.33
カナダ	3.61	エネルギー・水道	1.48
オーストラリア	3.23	保険	1.30
ドイツ	3.23	石油	1.27
フランス	2.94	交通・運輸	0.85
ニュージーランド	2.47	国際機関	0.82
スペイン	1.45	不動産	0.65
オランダ	1.42	化学	0.60
ルクセンブルグ	0.85	各種サービス	0.57
メキシコ	0.67	通信	0.48
ルーマニア	0.55	医薬品・化粧品・医療品	0.38
中国	0.54	公共、非営利機関	0.35
ケイマン諸島	0.47	抵当および資金貸出機関	0.30
ポーランド	0.46	電子工学・半導体	0.24
イタリア	0.41	電気装置・部品	0.23
フィンランド	0.23	コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置	0.17
デンマーク	0.23	航空宇宙産業	0.14
ベルギー	0.23	機械工学・産業機器	0.14
ジャージー	0.15	グラフィックデザイン・出版・メディア	0.13
コロンビア	0.11	たばこ・アルコール	0.12
国際機関	0.10	鉱業・石炭・鋼鉄	0.11
ベネズエラ	0.07	小売り・百貨店	0.07
合計	84.50	各種非分類会社	0.06
		バイオテクノロジー	0.06
		インターネット、ソフトウェア・ITサービス	0.05
		各種消費財	0.04
		繊維・衣服・革製品	0.02
		合計	84.50

注記は当財務書類の一部である。

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・エクイティーズ(米ドル)
純資産計算書

	2022年3月31日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	143,408,635.97	18,479,637
投資有価証券、未実現評価(損)益	16,853,883.63	2,171,791
投資有価証券合計(注1)	160,262,519.60	20,651,428
現金預金、要求払預金および預託金勘定	3,419,387.17	440,622
有価証券売却未収金(注1)	302.95	39
発行未収金	4,337.27	559
流動資産に係る未収利息	378.60	49
未収配当金	165,804.52	21,366
前払費用	44,505.80	5,735
その他の未収金	47,608.32	6,135
資産合計	163,944,844.23	21,125,933
負 債		
当座借越に係る未払利息	(20.81)	(3)
有価証券購入未払金(注1)	(548,357.96)	(70,661)
買戻未払金	(45,461.98)	(5,858)
その他の負債	(98,171.77)	(12,650)
定率報酬引当金(注2)	(68,505.28)	(8,828)
年次税引当金(注3)	(8,053.44)	(1,038)
その他の手数料および報酬に係る引当金(注2)	(14,395.15)	(1,855)
引当金合計	(90,953.87)	(11,720)
負債合計	(782,966.39)	(100,893)
期末現在純資産	163,161,877.84	21,025,040

注記は当財務書類の一部である。

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・エクイティーズ(米ドル)
運用計算書

自2021年10月1日 至2022年3月31日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	387.12	50
配当金(注1)	1,460,158.38	188,156
貸付証券に係る純収益	24,483.54	3,155
その他の収益(注4)	41,264.50	5,317
収益合計	1,526,293.54	196,678
費 用		
定率報酬(注2)	(436,391.25)	(56,233)
年次税(注3)	(17,099.57)	(2,203)
その他の手数料および報酬(注2)	(42,668.32)	(5,498)
現金および当座借越に係る利息	(311.56)	(40)
費用合計	(496,470.70)	(63,975)
投資純(損)益	1,029,822.84	132,703
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	15,337,346.93	1,976,371
為替差(損)益	(115,622.02)	(14,899)
実現(損)益合計	15,221,724.91	1,961,471
当期実現純(損)益	16,251,547.75	2,094,174
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	(21,162,565.06)	(2,727,008)
未実現評価(損)益の変動合計	(21,162,565.06)	(2,727,008)
運用の結果による純資産の純増(減)	(4,911,017.31)	(632,834)

注記は当財務書類の一部である。

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・エクイティーズ(米ドル)
純資産の変動

	自2021年10月1日 至2022年3月31日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	185,067,420.08	23,847,788
発行額	24,889,162.24	3,207,217
買戻額	(41,883,687.17)	(5,397,132)
純発行(買戻)合計	(16,994,524.93)	(2,189,914)
投資純(損)益	1,029,822.84	132,703
実現(損)益合計	15,221,724.91	1,961,471
未実現評価(損)益の変動合計	(21,162,565.06)	(2,727,008)
運用の結果による純資産の純増(減)	(4,911,017.31)	(632,834)
期末現在純資産	163,161,877.84	21,025,040

発行済投資証券数の変動表

	自2021年10月1日 至2022年3月31日	
	(口)	
ユーロ建クラスP-acc		
期首現在発行済投資証券数	670,508.6410	
期中発行投資証券数	7,781.9970	
期中買戻投資証券数	(28,090.9130)	
期末現在発行済投資証券数	650,199.7250	

最重要数値

	ISIN	2022年3月31日	2021年9月30日	2020年9月30日
純資産額(米ドル)		163,161,877.84	185,067,420.08	177,851,948.52
ユーロ建クラスP-acc	LU0161942635			
発行済投資証券数(口)		650,199.7250	670,508.6410	793,268.8850
1口当たり純資産価格(ユーロ)		32.33	32.26	24.69
1口当たり発行・買戻価格(ユーロ) ¹		32.33	32.26	24.69

¹ 注記1を参照

注記は当財務書類の一部である。

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・エクイティーズ (米ドル)

組入証券の構造

2022年3月31日現在

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)
アメリカ合衆国	54.15 %	インターネット、ソフトウェア・ITサービス	15.88 %
イギリス	14.96	電子工学・半導体	15.46
日本	9.77	金融および持株会社	14.15
オランダ	5.06	銀行および金融機関	6.61
アイルランド	3.32	食品・清涼飲料	5.79
スイス	2.90	グラフィックデザイン・出版・メディア	5.63
インド	2.70	バイオテクノロジー	5.28
デンマーク	2.06	小売り・百貨店	4.43
ドイツ	1.45	石油	4.12
フランス	1.36	機械工学・産業機器	3.70
ルクセンブルグ	0.49	各種非分類会社	3.53
合計	98.22	たばこ・アルコール	2.47
		ヘルスケア、社会事業	2.24
		航空宇宙産業	2.05
		医薬品・化粧品・医療品	1.91
		自動車	1.60
		ゴム・タイヤ	1.37
		宿泊・仕出し・レジャー	1.09
		投資信託	0.49
		不動産	0.42
		合計	98.22

注記は当財務書類の一部である。

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ

財務書類に対する注記

2022年3月31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、以下のとおり要約される。

a) 純資産価額の計算

各サブ・ファンドまたは投資証券クラスの投資証券1口当たりの純資産価格、発行価格および買戻価格は、当該サブ・ファンドまたは投資証券クラスの計算通貨で表示され、各投資証券クラスに帰するサブ・ファンドの純資産総額を当該サブ・ファンドの特定投資証券クラスの発行済投資証券数で除することにより営業日毎に計算される。ただし、投資証券の純資産価格は、以下の項に記載される通り、投資証券の発行または買戻しを行わない日にも算出されることがある。この場合、純資産価格は公表されることがあるが、運用実績、統計または報酬を算出する目的のためだけに利用することができる。いかなる状況においても申込みまたは買戻しの注文のための根拠として利用してはならない。

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日）を指し、12月24日および31日、ルクセンブルグの個々の法定外休日ならびにサブ・ファンドが投資する主要各国の取引所の休業日またはサブ・ファンドの投資対象の50%以上を適切に評価することができない日等を含まない。

さらに、サブ・ファンドであるUBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - チャイナ・アロケーション・オポチュニティー（米ドル）に関して、中華人民共和国における通常の銀行営業日でない日は本サブ・ファンドの営業日とはみなされない。

サブ・ファンドであるUBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - マルチ・ストラテジー・オルタナティブズ（ユーロ）に関して、以下の日は営業日（「MSA営業日」）とはみなされない。

a) 英国およびアメリカ合衆国において通常の銀行営業日とみなされない日。

b) マスターファンド（DB PLATINUM IV UBS Multi - Strategy Alternatives）が投資証券の発行および買戻しを行わない日。

サブ・ファンドの各投資証券クラスに帰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、当該投資証券クラスに課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、小切手、約束手形、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）いずれも額面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、その真正価値に達する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証券、派生商品およびその他の資産は、直近の入手可能な市場価格で評価される。当該証券、派生商品またはその他の資産が複数の証券取引所に上場されている場合には、当該資産の主要市場である証券取引所における直近の入手可能な価格が適用される。

証券取引所において通常取引されない証券、派生商品およびその他の資産について、標準的な市場に基づく値付けによる流通市場が証券トレーダー間で存在する場合、本投資法人はこれらの価格に基づいて当該証券、派生商品およびその他の投資対象を評価することができる。証券取引所に上場されていないが、公認され、公開の他の定期的にかかれる規制ある市場で取引されている証券、派生商品およびその他の投資対象は、当該市場における直近の入手可能な価格により評価される。

- 証券取引所に上場されておらずまたは他の規制ある市場で取引されておらず、適正価格を入手することができない証券およびその他の投資対象は、予想販売価格に基づき誠意をもって本投資法人が選ぶ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、独立の価格提供業者に基づいて評価される。派生商品について、利用できる独立の価格提供業者がただ1社の場合、得られた評価の妥当性は、派生商品の原資産の時価に基づき本投資法人および本投資法人の監査人が認めた計算モデルを使用して検証される。
- その他の譲渡性証券集合投資事業(UCITS)および/または集合投資事業(UCIS)の受益証券は、その最終資産価額で評価される。
サブ・ファンドであるUBS(Lux)キー・セレクション・シキャブ-マルチ・ストラテジー・オルタナティブズ(ユーロ)に関して、純資産価額の計算は、マスターファンドの純資産価額を適時に受領することに依拠する。
- 証券取引所または一般に公開されている他の規制市場で取引されていない短期金融商品は、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から計算される。このプロセスには次の原則が適用される。残余期間が最も近い金利が、各短期金融商品について補間される。このように計算された金利は、裏付けとなる借り手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、借り手の信用格付けに重大な変更がある場合には調整される。
- 関連するサブ・ファンドの会計通貨以外の通貨で表示され、為替取引によるヘッジを行わない証券、短期金融商品、派生商品およびその他の資産は、ルクセンブルグの平均為替レート(買呼値と売呼値の仲値)または入手不可能な場合、当該通貨を最も代表する市場におけるレートをを用いて評価される。
- 定期預金および信託預金は、額面価額に累積利息を付して評価される。
- スワップの価値は、外部のサービス提供会社が計算し、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。かかる計算はすべての現金流入出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評価を利用することができる。評価方法は、当該証券に依拠し、適用されるUBS評価方針に従い選択される。

上述した規則による評価が実行不可能または不正確になった場合、本投資法人は、純資産の適切な評価を遂行するために、誠意をもって他の一般に認められておりかつ検証可能な評価基準を用いる権限を付与されている。

本投資法人のサブ・ファンドの一部が、資産の評価時に終了している市場に投資される可能性があるため、本投資法人は、上記の規定に従うことなく、評価時のこれらのサブ・ファンドの資産の適正価格をより正確に反映する目的で1口当たりの純資産価格が調整されることを認めることができる。実際に、サブ・ファンドが投資される証券は、概して、上記の1口当たりの純資産価格を計算する時に入手可能な最新の価格に基づいて評価される。ただし、サブ・ファンドが投資する市場の終了時と評価時に実質的な時差がある可能性がある。

結果として、かかる証券の価格に影響を与える可能性があり、市場の終了時と評価時の間に生じる変化は、通常、関連するサブ・ファンドの1口当たりの純資産価格には考慮されない。この結果、本投資法人が、サブ・ファンドのポートフォリオの証券の入手可能な最新価格がその適正価格を反映していないとみなした場合、本投資法人は、評価時のポートフォリオの想定適正価格を反映する目的で1口当たりの純資産価格が調整されることを認めることができる。かかる調整は、本投資法人が定める投資方針および数々の慣行に基づく。上記のとおり価格を調整する場合、当該価格は、同一のサブ・ファンドのすべての投資証券クラスに常に適用される。

本投資法人は、適切とみなす場合にはいつでも、上記の措置を本投資法人の関連するサブ・ファンドに適用する権利を留保する。

適正価格での資産の評価は、容易に入手可能な市場評価が参照可能な資産の評価よりも評価の信頼性を高める。また、適正価格での評価は、価格報告者が適正価格を定めるために使用するクオンツ・モデルに基づく。本投資法人が1口当たりの純資産価格を自ら定める頃に資産を売却しようとする場合、本投資法人が資産の適正評価を正確に定めることができるという保証はない。結果として、1つ以上の参加権を適正価格で評価する場合に本投資法人が純資産価格で受益証券を売却または償還する場合、現投資主の経済的参加権を希薄化するまたは増大させる可能性がある。

さらに、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。かかる新評価が投資証券の事後の発行、買戻しおよび転換について有効となる。再評価は、当該日の唯一の純資産価格が公表される前のみ行われる。発行、買戻しおよび転換は、唯一の純資産価格に基づいてのみ処理される。

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(「スイング・プライシング」)。

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、各個人投資家の取引の特定の状況には関連しない。

c) 証券売買実現純(損)益

証券売買実現損益は、売却証券の平均原価に基づいて計算される。

d) 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、評価日に適用される先渡為替レートに基づいて評価される。

e) 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。

f) 外貨換算

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

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

g) 組入証券取引の会計処理

組入証券取引は、取引日の翌銀行営業日に会計処理される。

h) 連結財務書類

本投資法人の連結財務書類は、ユーロ（EUR）で表示される。本投資法人の2022年3月31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、以下の為替レートでユーロに換算された各サブ・ファンドの財務書類の対応する科目の合計に等しい。

以下の為替レートが、2022年3月31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 = 1.023916 スイスフラン（CHF）

1ユーロ = 1.112650 米ドル（USD）

償還または統合したサブ・ファンドに関して、連結財務書類の換算に使用された為替レートは、償還日または統合日のものである。

i) 収益の認識

源泉税控除後の配当金は、「配当落ち」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。

j) 有価証券売却未収金、有価証券購入未払金

「有価証券売却未収金」の勘定科目には、外貨取引による未収金が含まれる。また「有価証券購入未払金」の勘定科目には、外貨取引による未払金が含まれる。

外国為替取引による未収金および未払金は相殺される。

k) サブ・ファンド間投資

2022年3月31日現在、UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション（ユーロ）およびUBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション（米ドル）は、UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブの他のサブ・ファンドに以下の投資を行った。

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション（ユーロ）	金額（ユーロ）
UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - ユーロ・エクイティ・バリュー・オポチュニティ（ユーロ） クラスI - B - ACC 投資証券	8,033,736.60
合計	8,033,736.60

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション（米ドル）	金額（米ドル）
UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - ユーロ・エクイティ・バリュー・オポチュニティ（ユーロ） クラスU - X - ACC 投資証券	20,425,396.29
UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・エクイティーズ（米ドル） クラスU - X - ACC 投資証券	33,621,593.27
合計	54,046,989.56

サブ・ファンド間投資の総額は、104,848,003.65ユーロである。したがって、報告期間末現在の調整済み連結純資産は、6,450,407,255.84ユーロである。

l) スワップ

本投資法人は、金利スワップ契約、金利スワップシヨンの金利先渡し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。ただし、当該契約は、この種の取引を専門とする第一級の金融機関との間で執行される場合に限る。

シンセティック・エクイティ・スワップは、投資先の株式価格を基に評価される。スワップと株式が同じ通貨建てでない場合、株式価格が換算される。

スワップ取引の価値は、外部のサービス提供会社が計算し、また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。かかる計算は、インフローとアウトフロー双方のすべてのキャッシュフローの正味現在価値に基づいている。

特定の場合に、ブルームバーグより入手可能なモデルと市場データに基づいた当社内部での算出額および/またはブローカーの報告評価を利用することができる。

評価方法は、それぞれの証券に依拠し、UBS評価方針に従って決定される。

当該評価方法は、取締役会によって認可されている。

未実現損益の変動は、「スワップに係る未実現評価(損)益」の変動の下で運用計算書に計上される。

終了もしくは満期の時点で生じたスワップの損益は、運用計算書に「スワップに係る実現(損)益」として記帳される。

注2 - 定率報酬

本投資法人は、サブ・ファンドの平均純資産額に基づき計算された月次上限定率報酬を投資証券クラス「P」「N」「K-1」「F」「G」「Q」「I-A1」「I-A2」および「I-A3」のために支払う。

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - ダイナミック・アルファ (米ドル)

	定率報酬	上限定率報酬 名称に「ヘッジ」を含む クラス受益証券の料率
名称に「P」が付く投資証券クラス	1.920%	年率1.970%

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション (ユーロ)

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション (米ドル)

上限定率報酬

	定率報酬	名称に「ヘッジ」を含む クラス受益証券の料率
名称に「P」が付く投資証券クラス	2.040%	年率2.090%

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・エクイティーズ (米ドル)

上限定率報酬

	定率報酬	名称に「ヘッジ」を含む クラス受益証券の料率
名称に「P」が付く投資証券クラス	2.040%	年率2.090%

上記の定率報酬から、以下の報酬が支払われる。

1. 本投資法人の運用、管理事務、ポートフォリオ管理、投資助言および販売に関して（該当する場合）、また保管受託銀行のすべての職務（本投資法人の資産の保管および監督、決済取引の取扱いならびに販売目論見書の「保管受託銀行および主たる支払代理人」の項に記載されるその他一切の職務等）に関して、次の規定に従い本投資法人の資産から本投資法人の純資産価額に基づく上限定率報酬が支払われる。当該報酬は、純資産価額の計算毎に比例按分ベースで本投資法人の資産に対し請求され、毎月支払われる（上限定率報酬）。名称に「ヘッジ」を含むクラス投資証券の上限定率報酬には、為替リスクをヘッジするための報酬が含まれる。関連する上限定率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。上限定率報酬の概要は、販売目論見書の「サブ・ファンドおよび特別な投資方針」に記載されている。
本報酬は、「定率報酬」として運用計算書に計上されている。
2. 上限定率報酬は、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の費用を含まない。
 - a) 資産の売買のための本投資法人の資産の管理に関する一切の追加の費用（市場、手数料、報酬等に合致する買呼値および売呼値のスプレッド、仲介手数料）。かかる費用は、通常、各資産の売買時点で計算される。本書の記載にかかわらず、受益証券の発行および買戻しの決済に関する資産の売買によって生じるかかる追加の費用は、販売目論見書の「純資産価額、発行、買戻しおよび転換価格」の項に基づくスイング・プライシングの原理の適用によりカバーされる。
 - b) 本投資法人の設立、変更、清算および合併に関する監督官庁への費用ならびに監督官庁およびサブ・ファンドが上場されている証券取引所に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管理事務に関して監査人が提供するサービスに関して監査法人に支払われるか、または法律によって許可される一切のその他の報酬。アドホック・レポートの作成に関してマスターファンドから請求される費用。ただし、当該費用は、UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - マルチ・ストラテジー・オルタナティブズ (ユーロ) の年次報告書または中間報告書の作成に関連して生じるものとする。
 - 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 s、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の使用により発生した費用(外部顧問報酬を含む)。
- i) 本投資法人の名義で登録された知的財産または本投資法人の使用権に関するコストおよび手数料。
- j) 管理会社、ポートフォリオ・マネジャーまたは保管受託銀行が投資者の利益の保護のために講じた特別措置に関して生じた一切の費用。
- k) 管理会社が投資者の利益につき集団訴訟に関与する場合、管理会社は、第三者に関して生じた費用(例えば、法律コストおよび保管受託銀行に関するコスト)を本投資法人の資産に対して請求することができる。さらに、管理会社は、すべての管理事務コストを請求することができる。ただし、かかるすべての管理事務コストは、証明可能かつ公表されており、および/または本投資法人の総費用率(T E R)の開示において考慮される。
当該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計上されている。
- l) 本投資法人の取締役を支払われる手数料、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)。

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

本投資法人の収益および資産に対し課せられるすべての税金、特に年次税("taxe d'abonnement")も本投資法人が負担する。

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

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

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

投資証券クラス「K - B」の資産運用を目的と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・ジーまたは公認の販売パートナーの1つ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、それらのサブ・ファンドに請求される。

個々の投資証券クラスに帰属する費用は、それらの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、これらの費用は当該サブ・ファンド/投資証券クラスに対してその純資産額に比例して請求される。その投資方針がその他の現存する投資信託(U C I sまたはU C I T S)に投資することを容認するサブ・ファンドに関しては、当該対象ファンドおよびサブ・ファンドの両段階で支払が生じる。サブ・ファンドの資産が投資される対象ファンドの管理報酬は、販売報酬を考慮して最大で3.00%となる場合がある。

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に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、直接的または委託によって運営

されるファンドの受益証券への投資を行う場合、対象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課されることはない。

本投資法人の現行の手数料の詳細は、K I I D s に記載されている。

注3 - 年次税

ルクセンブルグの現行法規に準拠して、本投資法人は、四半期毎に支払われ各四半期末日の各サブ・ファンドの純資産額に基づいて計算される年率0.05%の年次税を課されているが、機関筋の投資証券クラスに関しては年率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る収益で構成される。

注5 - 収益の分配

各サブ・ファンドの投資主総会は、管理会社の取締役会の提案によりサブ・ファンドの年次決算の終了後に、各サブ・ファンドおよび/または投資証券クラスから分配を行うか、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資産額を下回る場合には、分配の支払は行われない。分配が行われる場合、分配金は年度末後4ヵ月以内に支払われる。

分配の詳細については、未監査である。

取締役会は、中間配当金を支払い、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10月1日から2022年3月31日までの期間中に、UBS (Lux) キー・セレクション・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の契約

2022年3月31日現在の個々のサブ・ファンドおよび各通貨の金融先物、オプションおよびスワップに係る契約は、以下のように要約できる。

a) 金融先物

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ	指数関連金融先物 (購入)	指数関連金融先物 (売却)
- ダイナミック・アルファ (米ドル)	12,084,739.16 米ドル	4,721,563.65 米ドル
- グローバル・アロケーション (ユーロ)	66,629,991.07 ユーロ	47,063,475.54 ユーロ
- グローバル・アロケーション (米ドル)	55,182,461.90 米ドル	23,614,653.51 米ドル
UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ	債券関連金融先物 (購入)	債券関連金融先物 (売却)
- ダイナミック・アルファ (米ドル)	3,844,269.82 米ドル	2,695,513.04 米ドル
- グローバル・アロケーション (ユーロ)	55,857,455.51 ユーロ	- ユーロ
- グローバル・アロケーション (米ドル)	76,423,148.53 米ドル	- 米ドル
UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ	金利関連金融先物 (購入)	金利関連金融先物 (売却)
	該当なし	

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

b) オプション

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ	指数に係るオプション、従来型 (売却)
	該当なし

c) スワップ

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ	クレジット・デフォルト・スワップ (購入)	クレジット・デフォルト・スワップ (売却)
- ダイナミック・アルファ (米ドル)	- 米ドル	2,208,602.74 米ドル
- グローバル・アロケーション (ユーロ)	- ユーロ	63,512,602.35 ユーロ
- グローバル・アロケーション (米ドル)	- 米ドル	14,479,309.28 米ドル
UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ	指数スワップおよび 指数先渡スワップ (購入)	指数スワップおよび 指数先渡スワップ (売却)
	該当なし	
UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ	金利スワップおよび 金利先渡スワップ (購入)	金利スワップおよび 金利先渡スワップ (売却)
	該当なし	
UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ	シンセティック・エクイティ・スワップ (購入)	シンセティック・エクイティ・スワップ (売却)
	該当なし	

注8 - 総費用比率 (TER)

この比率は、アセット・マネジメント・アソシエーション・スイス (AMAS) / スイス・ファンズ・アンド・アセット・マネジメント・アソシエーション (SFAMA) の「TERの計算および公表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カ月のTERは、以下のとおりである。

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ	総費用比率 (TER)
- ダイナミック・アルファ (米ドル) クラスP - acc投資証券	2.00%
- ダイナミック・アルファ (米ドル) ユーロ・ヘッジクラスP - acc投資証券	2.05%
- グローバル・アロケーション (ユーロ) クラスP - acc投資証券	2.11%
- グローバル・アロケーション (米ドル) クラスP - acc投資証券	2.11%
- グローバル・アロケーション (米ドル) 円建クラスP - acc投資証券	2.11%
- グローバル・エクイティーズ (米ドル) ユーロ建クラスP - acc投資証券	2.12%

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

取引コスト、利息費用、証券貸付費用および為替ヘッジに関連して生じたその他コストは、TERに含まれていない。

注9 - マスター・フィーダー・ストラクチャー

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - マルチ・ストラテジー・オルタナティブズ (ユーロ) について、記述されている。

注10 - 名称の変更

以下の名称の変更が生じた。

旧名称	新名称	日付
該当なし		

注11 - 償還

サブ・ファンドであるUBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - チャイナAエクイティ・クオンティタティブ (米ドル) が、2022年3月22日に償還した。

注12 - 事象

ウクライナにおける戦争は、ロシアやウクライナの証券をはじめとして、世界的に広範な市場に重大な影響を及ぼしたが、依然として重大な影響を及ぼしている。状況は依然として非常に不安定であり、投資主の利益を保護するために適切な措置を迅速にとるために、本投資法人の経営陣によって綿密に監視されている。

適用される法規制、特に、EU、スイス、英国、米国および国連 (UN) で最近施行された制裁 (これらに限定されない。) を常に遵守するために必要な措置が講じられた。制裁を受けたロシアの証券の範囲を越えた厳しい取引制限が実施されているため、(入手可能であれば) 価格が現在の市場価値を反映していないと考えられるすべての関連証券に対して公正価値評価が適用されている。

また、本報告書作成日現在、本投資法人およびそのサブ・ファンドのパフォーマンス、継続企業または運用のいずれも、本投資法人の経営陣による評価に大きな影響を与えていない。

注13 - 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、管理会社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、他の国の投資家の賠償請求に関する件については、管理会社および/または保管受託銀行は、ファンドの投資証券が売買された国の裁判管轄権に自らおよびファンドを服せしめ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家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14 - 証券貸付

本投資法人は、第三者に本投資法人の組入証券の一部を貸付けることができる。一般的に、貸付はクリアストリーム・インターナショナルもしくはユーロクリアのような公認の決済機関、または同種の業務を専門とする第一級の金融機関の仲介により、それらの機関が設定した方法に従ってのみ行われる。担保は、貸付証券に関連して受領される。担保は、一般的に借入れられた証券の少なくとも時価に相当する金額の高格付け証券から構成される。

UBSヨーロッパSE ルクセンブルグ支店は、証券貸付代理店として従事している。

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ	2022年3月31日現在の貸付証券による 相手方エクスポージャー*		2022年3月31日 現在の担保内訳 (比重%)		
	貸付証券の時価	担保(ユービーエス・スイス・エイ・ジー)	株式	債券	現金
- ダイナミック・アルファ(米ドル)	6,583,169.88 米ドル	6,985,149.40 米ドル	49.13	50.87	0.00
- グローバル・アロケーション(ユーロ)	51,486,526.54 ユーロ	54,630,381.18 ユーロ	49.13	50.87	0.00
- グローバル・エクイティーズ(米ドル)	8,350,221.96 米ドル	8,860,100.68 米ドル	49.13	50.87	0.00

* 相手方エクスポージャーの価格および為替レート情報は、2022年3月31日に証券貸付代理人から直接入手されるため、2022年3月31日現在の財務書類の作成に使用された終値および為替レートとは異なる可能性がある。

	UBS (Lux) キー・ セレクション・シキャブ - ダイナミック・アルファ (米ドル)	UBS (Lux) キー・ セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション (ユーロ)	UBS (Lux) キー・ セレクション・シキャブ - グローバル・エクイティーズ (米ドル)
貸付証券収益	15,354.18 米ドル	62,036.00 ユーロ	40,805.90 米ドル
貸付証券費用	6,141.67 米ドル	24,814.40 ユーロ	16,322.36 米ドル
貸付証券純収益	9,212.51 米ドル	37,221.60 ユーロ	24,483.54 米ドル

[次へ](#)

(2) 投資有価証券明細表等

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション (米ドル)

2022年3月31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			
商品証券			
アイルランド			
USD ISHARES PHYSICAL GOLD ETC 11-PRP	468 007.00	17 736 295.28	5.76
アイルランド合計		17 736 295.28	5.76
商品証券合計		17 736 295.28	5.76
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			
		17 736 295.28	5.76
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 ETFX DJ-UBS ALL COMMODITIES FORWARD 3 MONTH FUND USD	627 083.00	15 310 231.45	4.97
USD X-TRACKERS S&P 500 EQUAL WEIGHT UCITS ETF-1C-USD-ACC	79 670.00	6 677 939.40	2.17
アイルランド合計		21 988 170.85	7.14
ルクセンブルグ			
USD UBS (LUX) BOND SICAV - GLOBAL CORPORATES U-X-DIST	995.00	11 777 824.95	3.83
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD U-X-ACC	631.00	13 528 886.09	4.40
USD UBS (LUX) BOND SICAV - ASIAN HIGH YIELD U-X-ACC	1 285.00	11 254 364.10	3.66
USD UBS (LUX) BOND SICAV - CHINA FIXED INCOME (RMB) (USD) U-X-AC	1 705.00	18 449 378.75	5.99
USD UBS (LUX) EMERGING ECONOMIES FUND-GLOBAL BONDS (USD)-U-X-ACC	1 105.00	14 422 471.05	4.69
EUR UBS (LUX) EQUITY FUND - EUROPEAN OPP SUST (EUR) U-X-ACC	236.00	9 170 655.92	2.98
USD UBS (LUX) EQUITY FUND - MID CAPS USA U-X-ACC	60.00	605 263.20	0.20
USD UBS (LUX) EQUITY FUND - SMALL CAPS USA (USD) U-X-ACC	60.00	597 003.00	0.19
USD UBS (LUX) EQUITY FUND - CHINA OPPORTUNITY (USD) U-X-ACC	666.00	4 928 246.82	1.60
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - GLB EM OPP(USD)-U-X-ACC	674.00	20 844 366.64	6.77
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - GLOB OPPORT UNCONST USD-U-X-ACC	914.00	17 812 644.38	5.79
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV GLOBAL DEFENSIVE (USD) U-X-ACC	578.00	56 907 487.08	18.49
EUR UBS (LUX) KEY SELE SICAV - EURO EQU VALUE OPP (EUR) U-X-ACC	1 596.88	20 425 396.29	6.64
USD UBS (LUX) KEY SELECTION SICAV - GLOBAL EQUITIES (USD) U-X-AC	2 551.00	33 621 593.27	10.92
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD SUSTAINABLE U-X-ACC	2.00	22 465.14	0.01
ルクセンブルグ合計		234 368 046.68	76.16
投資信託、オープン・エンド型合計		256 356 217.53	83.30
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		256 356 217.53	83.30
投資有価証券合計		274 092 512.81	89.06

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
金融派生商品			
公認の証券取引所に上場されている金融派生商品			
債券関連金融先物			
GBP	LONG GILT FUTURE 28.06.22	67.00	-18 749.10 -0.01
USD	US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.06.22	298.00	-662 179.75 -0.21
CAD	CAN 10YR BOND FUTURE 21.06.22	87.00	-396 325.21 -0.13
USD	US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.06.22	65.00	-174 179.72 -0.06
AUD	AUSTRALIA 10YR BOND FUTURE 15.06.22	132.00	-492 553.12 -0.16
債券関連金融先物合計			-1 743 986.90 -0.57
指数関連金融先物			
EUR	EURO STOXX BANKS PRICE INDEX FUTURE 17.06.22	1 284.00	166 417.39 0.05
CHF	SWISS MARKET INDEX FUTURE 17.06.22	-13.00	-80 662.86 -0.03
USD	MSCI WORLD FINANCE FUTURE 17.06.22	183.00	258 030.00 0.08
USD	MSCI WORLD HEALTH 17.06.22	66.00	187 440.00 0.06
EUR	EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 17.06.22	-428.00	-782 181.82 -0.25
GBP	FTSE 100 INDEX FUTURE 17.06.22	-4.00	-20 408.08 -0.01
SEK	OMX 30 INDEX FUTURE 13.04.22	-40.00	-10 607.44 0.00
USD	MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 17.06.22	-43.00	-198 015.00 -0.05
USD	S&P500 EMINI FUTURE 17.06.22	97.00	1 778 980.00 0.58
CAD	S&P/TSX 60 IX FUTURE 16.06.22	8.00	33 958.61 0.01
USD	XAE ENERGY TECH FUTURE 17.06.22	59.00	185 740.00 0.06
USD	RUSSELL 2000 E-MINI INDEX FUTURE 17.06.22	67.00	433 155.00 0.14
JPY	TOPIX INDX FUTURE 09.06.22	35.00	369 104.02 0.12
指数関連金融先物合計			2 320 949.82 0.76
公認の証券取引所に上場されている金融派生商品合計			576 962.92 0.19
公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引されていない金融派生商品			
クレジット・デフォルト・スワップ*			
USD	ICE/CDX.NA.IG S38 V1 CDI REC 5.00000% 22-20.06.27	13 700 000.00	777 593.74 0.25
クレジット・デフォルト・スワップ合計			777 593.74 0.25
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金融派生商品合計			777 593.74 0.25
金融派生商品合計			1 354 556.66 0.44

* 額面が正：サブ・ファンドは「受取側」、額面が負：サブ・ファンドは「支払側」

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 / 先物 / 先渡為替契約 / 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 / 購入金額 / 売却通貨 / 売却金額 / 満期日			
AUD	3 612 255.42	USD 2 575 632.03	7.4.2022 137 128.44 0.04
CAD	5 607 582.17	USD 4 416 907.91	7.4.2022 72 538.68 0.02
USD	5 655 162.21	CHF 5 211 511.34	7.4.2022 -8 809.87 0.00
USD	12 979 980.35	NZD 19 568 232.40	7.4.2022 -630 064.45 -0.19
USD	9 949 349.52	GBP 7 350 892.74	7.4.2022 271 198.44 0.09
ILS	1 100 000.00	USD 342 850.45	7.4.2022 1 861.87 0.00
DKK	4 100 000.00	USD 629 378.88	7.4.2022 -16 022.25 -0.01
SEK	4 338 526.92	USD 474 877.35	7.4.2022 -9 306.46 0.00
NOK	76 327 514.75	USD 8 654 784.01	7.4.2022 73 875.72 0.02
HKD	3 200 000.00	USD 410 541.73	7.4.2022 -1 913.89 0.00
SGD	890 000.00	USD 661 569.75	7.4.2022 -3 961.82 0.00
USD	9 014 933.95	ZAR 140 501 026.97	7.4.2022 -594 583.31 -0.19
EUR	3 037 826.92	USD 3 470 879.48	7.4.2022 -90 407.99 -0.03
JPY	608 796 996.00	USD 5 285 320.57	7.4.2022 -269 113.49 -0.09
USD	13 664 650.92	CNH 87 380 000.00	7.4.2022 -96 185.59 -0.03
PLN	26 080 000.00	USD 6 542 087.72	7.4.2022 -286 186.83 -0.09
NZD	4 880 000.00	USD 3 237 134.82	7.4.2022 156 989.76 0.05
EUR	5 650 000.00	USD 6 458 397.48	7.4.2022 -171 118.97 -0.06
USD	6 470 440.95	AUD 9 070 000.00	7.4.2022 -341 020.20 -0.11
USD	429 903.60	AUD 600 000.00	7.4.2022 -20 689.20 -0.01
USD	2 745 553.20	EUR 2 400 000.00	7.4.2022 74 850.82 0.02
USD	285 401.98	EUR 250 000.00	7.4.2022 7 203.82 0.00
JPY	100 000 000.00	USD 864 254.79	7.4.2022 -40 300.81 -0.01
USD	256 459.58	HKD 2 000 000.00	7.4.2022 1 067.18 0.00
GBP	200 000.00	USD 270 009.24	7.4.2022 -6 690.17 0.00
EUR	220 000.00	USD 250 087.71	7.4.2022 -5 273.33 0.00
USD	216 249.81	JPY 25 000 000.00	7.4.2022 10 261.31 0.00
USD	157 342.89	CAD 200 000.00	7.4.2022 -2 777.69 0.00
USD	287 555.24	AUD 400 000.00	7.4.2022 -12 839.96 0.00
USD	272 469.80	GBP 200 000.00	7.4.2022 9 150.73 0.00
USD	115 270.66	HKD 900 000.00	6.4.2022 345.23 0.00
USD	335 053.28	GBP 250 000.00	6.4.2022 5 901.03 0.00
USD	260 325.98	JPY 30 000 000.00	6.4.2022 13 144.37 0.00
USD	224 085.04	EUR 200 000.00	6.4.2022 1 533.64 0.00
USD	320 174.30	HKD 2 500 000.00	6.4.2022 937.00 0.00
USD	180 141.25	EUR 160 000.00	6.4.2022 2 100.13 0.00
USD	7 847 403.12	EUR 6 970 000.00	6.4.2022 91 486.90 0.03
USD	6 359 942.73	PLN 26 260 000.00	6.4.2022 60 254.87 0.02
USD	2 020 844.70	EUR 1 800 000.00	6.4.2022 17 882.12 0.01
GBP	420 000.00	USD 562 861.66	6.4.2022 -9 885.88 0.00
USD	490 770.25	CHF 450 000.00	6.4.2022 1 719.29 0.00
JPY	20 000 000.00	USD 173 001.88	7.4.2022 -8 211.08 0.00
GBP	180 000.00	USD 240 536.59	7.4.2022 -3 549.43 0.00
AUD	700 000.00	USD 513 583.00	7.4.2022 12 108.60 0.00
USD	360 488.64	AUD 490 000.00	6.4.2022 -7 490.82 0.00
USD	1 556 989.13	JPY 179 610 000.00	6.4.2022 77 112.82 0.03
AUD	8 490 000.00	EUR 5 699 229.70	6.4.2022 33 946.49 0.01
USD	204 792.76	HKD 1 600 000.00	7.4.2022 478.84 0.00
EUR	800 000.00	USD 871 715.04	7.4.2022 18 519.09 0.01
USD	130 488.71	JPY 15 000 000.00	7.4.2022 6 895.61 0.00
USD	9 221 799.87	EUR 8 480 000.00	7.4.2022 -214 681.86 -0.07
NZD	13 550 000.00	GBP 7 090 098.51	7.4.2022 89 472.97 0.03
USD	153 440.30	HKD 1 200 000.00	7.4.2022 204.86 0.00

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ 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/購入金額/売却通貨/売却金額/満期日					
USD	260 091.80	JPY 30 000 000.00	7.4.2022	12 905.61	0.00
ZAR	140 501 026.97	USD 9 263 952.20	7.4.2022	345 565.06	0.11
USD	212 493.73	HKD 1 661 331.70	7.4.2022	347.99	0.00
USD	442 975.09	EUR 400 343.33	7.4.2022	-2 524.03	0.00
USD	447 298.88	HKD 3 500 000.00	7.4.2022	362.18	0.00
USD	478 965.16	HKD 3 745 835.00	7.4.2022	636.27	0.00
USD	137 912.06	CAD 174 565.20	7.4.2022	-1 845.35	0.00
USD	922 028.61	EUR 832 837.99	7.4.2022	-4 747.39	0.00
USD	15 339 333.08	PHP 809 610 000.00	20.5.2022	-231 582.11	-0.08
USD	14 171 012.95	TWD 399 410 000.00	20.5.2022	187 056.34	0.06
USD	9 846 872.20	KRW 11 967 790 000.00	20.5.2022	-11 153.30	0.00
CLP	8 104 940 000.00	USD 9 974 696.94	20.5.2022	238 458.68	0.08
BRL	54 590 000.00	USD 10 611 229.36	20.5.2022	719 876.75	0.23
CHF	4 057 942.17	USD 4 350 285.25	7.4.2022	59 965.38	0.02
USD	3 565 544.53	CHF 3 303 660.99	7.4.2022	-24 938.61	-0.01
USD	657 381.90	CAD 820 881.00	7.4.2022	182.18	0.00
USD	16 742 986.64	CNY 107 130 000.00	20.5.2022	-92 801.86	-0.03
先渡為替契約合計				-405 150.93	-0.13
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				33 104 078.41	10.76
その他の資産および負債				-389 431.61	-0.13
純資産総額				307 756 565.34	100.00

注記は当財務書類の一部である。

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション (ユーロ)

2022年3月31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	ユーロ建評価額 先物 / 先渡為替契約 / 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			
株式			
オーストリア			
EUR ERSTE GROUP BK AG NPV	18 534.00	613 290.06	0.19
オーストリア合計		613 290.06	0.19
ベルギー			
EUR AZELIS GROUP NV NPV	8 400.00	184 800.00	0.06
ベルギー合計		184 800.00	0.06
カナダ			
CAD CAN PACIFIC RYS COM NPV	7 307.00	542 495.62	0.17
USD LULULEMON ATHLETIC COM STK USD0.01	2 005.00	658 146.00	0.20
カナダ合計		1 200 641.62	0.37
デンマーク			
DKK CARLSBERG SER ' B ' DKK20	5 077.00	566 503.42	0.17
DKK GENMAB AS DKK1 (BEARER)	2 340.00	775 443.32	0.24
DKK NOVO-NORDISK AS DKK0.2 SER ' B '	6 231.00	627 334.05	0.19
デンマーク合計		1 969 280.79	0.60
フィンランド			
EUR METSO OUTOTEC OYJ NPV	65 004.00	499 490.74	0.15
SEK NORDEA HOLDING ABP NPV	49 764.00	466 962.06	0.14
EUR SAMPO PLC SER ' A ' NPV	23 059.00	1 023 358.42	0.32
フィンランド合計		1 989 811.22	0.61
フランス			
EUR AIR LIQUIDE(L ') EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)	6 046.00	960 830.32	0.29
EUR ANTIN INFRA PARTN EURO.01 (PROMESSES)	5 487.00	159 123.00	0.05
EUR AXA EUR2.29	68 738.00	1 826 024.97	0.56
EUR CAPGEMINI EUR8	2 856.00	578 340.00	0.18
EUR DANONE EURO.25	12 316.00	616 169.48	0.19
EUR EIFFAGE EUR4	3 320.00	309 556.80	0.09
EUR ESSILORLUXOTTICA EURO.18	4 290.00	713 427.00	0.22
EUR KERING EUR4	942.00	542 309.40	0.17
EUR L ' OREAL EURO.20	1 921.00	698 955.85	0.21
EUR LEGRAND SA EUR4	3 111.00	268 728.18	0.08
EUR LVMH MOET HENNESSY EURO.30	1 878.00	1 219 573.20	0.37
EUR PERNOD RICARD EUR1.55	5 570.00	1 110 101.00	0.34
EUR SANOFI EUR2	13 016.00	1 204 110.16	0.37
EUR SCHNEIDER ELECTRIC EUR8	5 496.00	836 271.36	0.26
EUR SOC GENERALE EUR1.25	27 343.00	668 809.78	0.21
EUR TELEPERFORMANCE EUR2.50	2 852.00	987 647.60	0.30
フランス合計		12 699 978.10	3.89
ドイツ			
EUR ALLIANZ SE NPV(REGD)(VINKULIERT)	2 503.00	542 024.65	0.17
USD BIONTECH SE SPON ADS EACH REP 1 ORD SHS	1 100.00	168 620.86	0.05
EUR DERMAPHARM HLDG SE NPV	2 802.00	161 675.40	0.05
EUR EXASOL AG ORD NPV	8 917.00	54 126.19	0.02

銘柄	数量 / 額面	ユーロ建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)	12 853.00	398 250.21	0.12
EUR KNORR BREMSE AG NPV	4 796.00	333 993.44	0.10
EUR MUENCHENER RUECKVE NPV(REGD)	1 668.00	405 324.00	0.13
EUR NAGARRO SE NPV	877.00	126 288.00	0.04
EUR SAP AG ORD NPV	11 098.00	1 122 229.76	0.34
ドイツ合計		3 312 532.51	1.02
香港			
HKD AIA GROUP LTD NPV	74 400.00	703 988.58	0.22
香港合計		703 988.58	0.22
アイルランド			
EUR AIB GROUP PLC ORD EURO.625	154 492.00	309 447.48	0.09
USD APTIV PLC COM USDO.01	9 114.00	980 575.15	0.30
EUR BANK OF IRELAND GR EUR1	57 285.00	332 711.28	0.10
EUR CRH ORD EURO.32	6 986.00	253 941.10	0.08
EUR KINGSPAN GROUP ORD EURO.13(DUBLIN LISTING)	7 283.00	648 478.32	0.20
アイルランド合計		2 525 153.33	0.77
イタリア			
EUR ENEL EUR1	54 769.00	332 338.29	0.10
EUR INTERCOS SPA NPV	18 500.00	231 990.00	0.07
EUR MONCLER SPA NPV	5 631.00	285 716.94	0.09
イタリア合計		850 045.23	0.26
日本			
JPY ファナック	3 100.00	496 857.07	0.15
JPY 日本電気	5 300.00	202 113.48	0.06
JPY 日本電信電話	24 200.00	635 248.71	0.20
JPY ソフトバンクグループ	12 500.00	514 539.68	0.16
JPY ソニーグループ	6 200.00	584 429.71	0.18
日本合計		2 433 188.65	0.75
ルクセンブルグ			
EUR MAJOREL GRP SA(LUX EURO.01)	23 500.00	697 480.00	0.21
ルクセンブルグ合計		697 480.00	0.21
オランダ			
EUR ADYEN NV EURO.01	292.00	528 228.00	0.16
EUR ASML HOLDING NV EURO.09	2 876.00	1 754 360.00	0.54
EUR KONINKLIJKE AHOLD EURO.01	16 123.00	469 421.15	0.14
EUR KONINKLIJKE DSM NV EUR1.5	2 892.00	469 950.00	0.14
EUR KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20	32 779.00	908 961.67	0.28
EUR OCI N.V. EURO.02	25 100.00	805 208.00	0.25
EUR SHELL PLC ORD EURO.07	30 300.00	756 136.50	0.23
EUR WOLTERS KLUWER EURO.12	4 871.00	470 441.18	0.15
オランダ合計		6 162 706.50	1.89
ノルウェー			
NOK MOWI ASA NOK7.50	22 482.00	549 975.29	0.17
ノルウェー合計		549 975.29	0.17
スペイン			
EUR AMADEUS IT GROUP EURO.01	8 959.00	530 193.62	0.16
EUR EDP RENOVAVEIS SA EUR5	22 200.00	518 148.00	0.16
EUR GREENERGY RENOVABLE EURO.35	11 271.00	384 341.10	0.12
スペイン合計		1 432 682.72	0.44

銘柄	数量 / 額面	ユーロ建評価額 先物 / 先渡為替契約 / 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 CINT GROUP AB	14 658.00	130 249.60	0.04
SEK FORTNOX AB NPV (POST SPLIT)	14 686.00	73 577.08	0.02
SEK HEXAGON AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	25 703.00	329 057.52	0.10
SEK KARNOV GROUP AB NPV	36 552.00	210 797.67	0.06
SEK LIFCO AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	3 858.00	89 629.81	0.03
SEK NORDNET AB NPV	3 461.00	56 741.92	0.02
スウェーデン合計		890 053.60	0.27
スイス			
CHF ALCON AG CHF0.04	8 555.00	615 776.49	0.19
CHF LONZA GROUP AG CHF1(REGD)	440.00	288 859.59	0.09
CHF NESTLE SA CHF0.10(REGD)	15 129.00	1 776 029.98	0.54
CHF NOVARTIS AG CHF0.50(REGD)	8 672.00	688 142.28	0.21
CHF ROCHE HLDGS AG GENUSSSCHEINE NPV	3 251.00	1 163 502.44	0.36
CHF STRAUMANN HLDG CHF0.1(REGD)	234.00	339 716.29	0.10
CHF SWISS LIFE HLDG CHF5.1(REGD)	943.00	547 242.66	0.17
GBP WIZZ AIR HLDGS PLC ORD GBPO.0001	5 506.00	188 428.36	0.06
スイス合計		5 607 698.09	1.72
イギリス			
GBP 3I GROUP ORD GBPO.738636	21 604.00	354 970.14	0.11
GBP ASHTEAD GROUP ORD GBPO.10	14 655.00	838 135.80	0.26
GBP ASTRAZENECA ORD USDO.25	21 739.00	2 606 432.70	0.80
GBP BRIT AMER TOBACCO ORD GBPO.25	12 210.00	461 562.30	0.14
GBP CVS GROUP PLC ORD GBPO.002	8 775.00	186 078.80	0.06
GBP DIAGEO ORD GBPO.28 101/108	26 477.00	1 210 490.72	0.37
GBP DIPLOMA ORD GBPO.05	12 762.00	397 783.06	0.12
USD FARFETCH LTD COM USDO.04 CLASS A	7 687.00	104 460.02	0.03
GBP HSBC HLDGS ORD USDO.50(UK REG)	170 237.00	1 058 414.54	0.32
USD LIVANOVA PLC ORD GBP1.00 (DI)	6 300.00	463 334.38	0.14
GBP LONDON STOCK EXCH ORD GBPO.06918604	14 183.00	1 336 965.43	0.41
EUR RELX PLC GBPO.1444	24 886.00	702 780.64	0.22
GBP SAGE GROUP GBPO.01051948	66 879.00	554 936.71	0.17
GBP SPECTRIS ORD GBPO.05	19 168.00	589 514.99	0.18
EUR STELLANTIS N V COM EURO.01	18 827.00	278 639.60	0.09
EUR UNILEVER PLC ORD GBPO.031111	5 400.00	222 264.00	0.07
EUR UNILEVER PLC ORD GBPO.031111	8 182.00	335 011.99	0.10
イギリス合計		11 701 775.82	3.59
アメリカ合衆国			
USD 10X GENOMICS INC COM USDO.00001 CLASS A	2 395.00	163 742.11	0.05
USD ABBVIE INC COM USDO.01	29 583.00	4 310 160.55	1.32
USD ADVANCED MICRO DEV COM USDO.01	11 918.00	1 171 180.62	0.36
USD AGCO CORP COM USDO.01	10 288.00	1 350 250.88	0.41
USD AKAMAI TECHNOLOGIES INC COM	22 878.00	2 454 863.99	0.75
USD ALLSTATE CORP COM	6 458.00	803 934.37	0.25
USD ALPHABET INC CAP STK USDO.001 CL A	1 166.00	2 914 711.81	0.89
USD AMAZON COM INC COM USDO.01	1 499.00	4 391 915.74	1.35
USD AMERIPRISE FINL INC COM	9 332.00	2 519 174.51	0.77
USD APA CORPORATION COM USDO.625	57 735.00	2 144 598.53	0.66
USD APPLE INC COM NPV	19 393.00	3 043 375.48	0.93
USD APPLIED MATLS INC COM	6 761.00	800 880.60	0.25
USD AVANTOR INC COM USDO.01	16 066.00	488 340.56	0.15
USD BANK OZK COM USDO.01	20 602.00	790 639.82	0.24
USD BIO RAD LABS INC CL A	2 968.00	1 502 419.13	0.46
USD BOOKING HLDGS INC COM USDO.008	271.00	571 994.74	0.18
USD BUNGE LIMITED COM USDO.01	24 762.00	2 466 073.99	0.76
USD CADENCE DESIGN SYS COM USDO.01	5 013.00	740 967.94	0.23
USD CARVANA CO COM USDO.001 CL A	2 528.00	271 033.23	0.08
USD CF INDS HLDGS INC COM	17 282.00	1 600 757.58	0.49

銘柄	数量 / 額面	ユーロ建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD CHEGG INC COM USDO.001	17 646.00	575 380.29	0.18
USD COMCAST CORP COM CLS ' A ' USDO.01	40 678.00	1 711 718.83	0.53
USD CONSTELLATION BRDS CLASS ' A ' COM USDO.01	2 270.00	469 892.96	0.14
USD COOPER COS INC COM USDO.10	907.00	340 407.25	0.10
USD DEXCOM INC COM	1 299.00	597 284.32	0.18
USD DOLLAR TREE INC	20 998.00	3 022 360.76	0.93
USD DROPBOX INC COM USDO.00001 CL A	13 943.00	291 353.75	0.09
USD EDWARDS LIFESCIENCES CORP COM	7 202.00	761 982.15	0.23
USD ELI LILLY AND CO COM NPV	4 840.00	1 245 702.42	0.38
USD ESTEE LAUDER COS CLASS ' A ' COM USDO.01	1 366.00	334 327.16	0.10
USD F5 NETWORK INC COM STK NPV	2 644.00	496 529.73	0.15
USD FIDELITY NATL INF COM STK USDO.01	8 463.00	763 811.14	0.23
USD FORD MOTOR CO COM STK USDO.01	118 290.00	1 797 765.60	0.55
USD HESS CORPORATION COM USD1	10 049.00	966 741.53	0.30
USD HUBSPOT INC COM USDO.001	1 138.00	485 760.77	0.15
USD INGERSOLL RAND INC COM USD1.00	51 415.00	2 326 648.32	0.71
USD IQVIA HOLDINGS INC COM USDO.01	2 357.00	489 787.42	0.15
USD LAB CORP AMER HLDG COM USDO.1	4 572.00	1 083 407.65	0.33
USD LAS VEGAS SANDS CORP COM	36 816.00	1 286 152.81	0.39
USD LOWE ' S COS INC COM USDO.50	4 530.00	823 188.51	0.25
USD LYFT INC COM USDO.00001 CLASS A	11 035.00	380 842.13	0.12
USD MADISON SQUARE GRD COM USDO.01 CLASS A	2 775.00	447 332.05	0.14
USD MARAVAI LIFESCIENC USDO.01 A	11 953.00	378 899.30	0.12
USD MARSH & MCLENNAN COM USD1	8 198.00	1 255 653.76	0.39
USD MARTIN MARIETTA M. COM USDO.01	1 042.00	360 450.62	0.11
USD MARVELL TECHNOLOGY COM USDO.002	7 392.00	476 412.46	0.15
USD MASTERCARD INC COM USDO.0001 CLASS ' A '	1 486.00	477 298.95	0.15
USD MATCH GRP INC NEW COM NPV	5 087.00	497 155.78	0.15
USD MCDONALD ' S CORP COM USDO.01	2 260.00	502 271.87	0.15
USD META PLATFORMS INC	2 354.00	470 440.34	0.14
USD MICRON TECHNOLOGY COM USDO.10	21 505.00	1 505 436.97	0.46
USD MICROSOFT CORP COM USDO.0000125	17 454.00	4 836 420.02	1.48
USD MONDELEZ INTL INC COM USDO.01	38 412.00	2 167 353.04	0.67
USD MSA SAFETY INC COM NPV	3 241.00	386 537.28	0.12
USD MSCI INC COM STK USSO.01	881.00	398 182.07	0.12
USD NETFLIX INC COM USDO.001	846.00	284 818.35	0.09
USD NEXTERA ENERGY INC COM USDO.01	18 280.00	1 391 721.39	0.43
USD NVIDIA CORP COM USDO.001	5 402.00	1 324 755.96	0.41
USD ON SEMICONDUCTOR COM USDO.01	6 949.00	391 027.63	0.12
USD ORACLE CORP COM USDO.01	7 939.00	590 296.56	0.18
USD PIONEER NATURAL RE COM STK USDO.01	1 480.00	332 579.34	0.10
USD PROLOGIS INC COM USDO.01	10 100.00	1 465 823.04	0.45
USD REGAL BELOIT CORP. COM USDO.01	9 298.00	1 243 298.83	0.38
USD SALESFORCE.COM INC COM USDO.001	8 632.00	1 647 190.26	0.51
USD SCHWAB(CHARLES)CP COM USDO.01	6 134.00	464 798.04	0.14
USD SERVICENOW INC COM USDO.001	1 313.00	657 166.74	0.20
USD SLM CORP COM USDO.20	35 791.00	590 592.51	0.18
USD SNAP INC COM USDO.00001 CL A	12 524.00	405 103.82	0.12
USD SPIRIT AEROSYSTEMS COM STK USDO.01 CLASS ' A '	40 115.00	1 762 658.83	0.54
USD SPLUNK INC COM USDO.001	7 597.00	1 014 685.81	0.31
USD SQUARE INC COM USDO.0000001 CL A	2 343.00	285 544.24	0.09
USD SYNCHRONY FINANCIA COM USDO.001	18 982.00	593 864.58	0.18
USD TAKE TWO INTERACTI COM USDO.01	14 417.00	1 992 063.61	0.61
USD TESLA INC COM USDO.001	871.00	843 562.31	0.26
USD THE TRADE DESK INC COM USDO.000001 CL A	7 228.00	449 862.04	0.14
USD TJX COS INC COM USD1	13 829.00	752 941.91	0.23
USD TRANSDIGM GROUP INC COM	1 342.00	785 841.62	0.24
USD UNION PACIFIC CORP COM USD2.50	3 544.00	870 225.35	0.27
USD UNITED RENTALS INC COM	2 024.00	646 155.61	0.20
USD UNITEDHEALTH GRP COM USDO.01	3 364.00	1 541 849.71	0.47
USD UNIVERSAL DISPLAY COM USDO.01	1 742.00	261 382.19	0.08

銘柄	数量 / 額面	ユーロ建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD VERTEX PHARMACEUTI COM USDO.01	5 444.00	1 276 880.13	0.39
USD VISA INC COM STK USDO.0001	7 122.00	1 419 535.29	0.44
USD VMWARE INC COM STK USDO.01 CLASS 'A'	13 477.00	1 379 253.13	0.42
USD VOYA FINL INC COM USDO.01	22 165.00	1 321 752.35	0.41
USD WAYFAIR INC COM USDO.001 A	2 353.00	234 274.34	0.07
USD WELLS FARGO & CO COM USD1 2/3	56 783.00	2 473 108.51	0.76
USD WESTERN DIGITAL CORP COM	18 050.00	805 448.70	0.25
USD WILLIAMS COS INC COM USD1	87 296.00	2 621 272.96	0.80
USD WORKDAY INC COM USDO.001 CL A	2 998.00	645 217.35	0.20
USD WORLD WRESTLING ENTMT INC CL A	11 394.00	639 411.64	0.20
USD ZSCALER INC COM USDO.001	2 793.00	605 666.69	0.19
アメリカ合衆国合計		104 923 537.56	32.18
株式合計		160 448 619.67	49.21
商品証券			
アイルランド			
USD ISHARES PHYSICAL GOLD ETC 11-PRP	119 356.00	4 065 334.12	1.25
アイルランド合計		4 065 334.12	1.25
商品証券合計		4 065 334.12	1.25
ノート、固定利付債			
豪ドル			
AUD AUSTRALIA 5.50000% 11-21.04.23	1 045 000.00	738 249.93	0.22
豪ドル合計		738 249.93	0.22
ノート、固定利付債合計		738 249.93	0.22
ボンド、固定利付債			
豪ドル			
AUD AUSTRALIA 2.75000% 12-21.04.24	4 585 000.00	3 152 469.44	0.97
AUD AUSTRALIA-REG-S 1.00000% 20-21.12.30	3 955 000.00	2 296 353.60	0.70
AUD AUSTRALIA-REG-S 1.75000% 20-21.06.51	415 000.00	200 932.32	0.06
AUD AUSTRALIA-REG-S 2.25000% 16-21.05.28	1 755 000.00	1 154 091.12	0.35
AUD AUSTRALIA-REG-S 2.75000% 14-21.06.35	1 980 000.00	1 304 831.12	0.40
AUD AUSTRALIA-REG-S 2.75000% 16-21.11.27	2 560 000.00	1 735 259.88	0.53
AUD AUSTRALIA-REG-S 3.00000% 16-21.03.47	800 000.00	516 713.53	0.16
AUD AUSTRALIA-REG-S 3.25000% 13-21.04.25	2 530 000.00	1 752 968.97	0.54
AUD QUEENSLAND TREASURY CORP-REG-S 4.25000% 12-21.07.23	493 000.00	344 630.97	0.11
豪ドル合計		12 458 250.95	3.82
カナダドル			
CAD CANADA, GOVERNMENT 2.75000% 14-01.12.64	1 100 000.00	857 889.76	0.26
CAD CANADA, GOVERNMENT 2.75000% 14-01.12.48	1 095 000.00	841 935.26	0.26
CAD CANADA, GOVERNMENT 2.25000% 14-01.06.25	4 975 000.00	3 571 962.52	1.10
CAD CANADA, GOVERNMENT 3.50000% 11-01.12.45	1 230 000.00	1 054 950.40	0.32
CAD CANADA, GOVERNMENT 5.75000% 01-01.06.33	2 325 000.00	2 210 175.85	0.68
カナダドル合計		8 536 913.79	2.62
ボンド、固定利付債合計		20 995 164.74	6.44
財務省証券 (T-note)、固定利付債			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 5.00000% 07-15.05.37	4 790 000.00	5 759 669.32	1.77
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.62500% 14-15.02.44	6 315 000.00	6 600 591.06	2.02

銘柄	数量 / 額面	ユーロ建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.37500% 20-15.08.50	5 055 000.00	3 496 850.15	1.07
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.87500% 17-30.09.22	9 645 000.00	8 703 371.30	2.67
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.37500% 14-15.08.24	11 730 000.00	10 518 101.83	3.23
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.00000% 15-15.02.25	10 230 000.00	9 064 971.58	2.78
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.50000% 14-15.05.24	11 330 000.00	10 203 978.45	3.13
米ドル合計		54 347 533.69	16.67
財務省証券(T-note)、固定利付債合計		54 347 533.69	16.67
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		240 594 902.15	73.79
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	5 500 000.00	4 942 817.30	1.51
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 21-19.05.22	8 200 000.00	7 367 344.45	2.26
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 17.06.21-16.06.22	8 200 000.00	7 363 336.09	2.26
米ドル合計		19 673 497.84	6.03
財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン合計		19 673 497.84	6.03
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		19 673 497.84	6.03
ルクセンブルグ2010年12月17日法(改訂済)の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs			
投資信託、オープン・エンド型			
ルクセンブルグ			
USD UBS (LUX) BOND SICAV - ASIAN HIGH YIELD U-X-ACC	1 360.00	10 705 283.42	3.28
USD UBS (LUX) BOND SICAV - CHINA FIXED INCOME (RMB) (USD) U-X-AC	643.00	6 253 307.20	1.92
EUR UBS (LUX) KEY SELE SICAV-EURO EQUITY VALUE OPP (EUR) I-B-ACC	63 684.00	8 033 736.60	2.46
EUR UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - EUR SUSTAINABLE U-X-ACC	2.00	20 243.74	0.01
ルクセンブルグ合計		25 012 570.96	7.67
投資信託、オープン・エンド型合計		25 012 570.96	7.67
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		25 012 570.96	7.67
投資有価証券合計		285 280 970.95	87.49
金融派生商品			
公認の証券取引所に上場されている金融派生商品			
債券関連金融先物			
EUR EURO-BUND FUTURE 08.06.22	40.00	-34 680.00	-0.01
GBP LONG GILT FUTURE 28.06.22	78.00	-19 596.21	-0.01
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.06.22	193.00	-588 467.06	-0.18
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.06.22	165.00	-397 383.29	-0.12
債券関連金融先物合計		-1 040 126.56	-0.32

銘柄	数量 / 額面	ユーロ建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
指数関連金融先物			
EUR	EURO STOXX BANKS PRICE INDEX FUTURE 17.06.22	1 505.00	175 759.50 0.05
CHF	SWISS MARKET INDEX FUTURE 17.06.22	-29.00	-161 722.22 -0.05
USD	MSCI WORLD FINANCE FUTURE 17.06.22	222.00	281 328.36 0.09
USD	MSCI WORLD HEALTH 17.06.22	81.00	206 749.65 0.06
EUR	EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 17.06.22	-556.00	-913 230.00 -0.28
GBP	FTSE 100 INDEX FUTURE 17.06.22	-30.00	-137 563.98 -0.04
SEK	OMX 30 INDEX FUTURE 13.04.22	-111.00	-26 448.44 -0.01
USD	MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 17.06.22	468.00	1 092 783.00 0.34
USD	S&P500 EMINI FUTURE 17.06.22	-86.00	-556 787.85 -0.17
CAD	S&P/TSX 60 IX FUTURE 16.06.22	15.00	53 871.35 0.02
USD	XAE ENERGY TECH FUTURE 17.06.22	69.00	296 481.37 0.09
USD	RUSSELL 2000 E-MINI INDEX FUTURE 17.06.22	93.00	540 372.08 0.17
JPY	TOPIX INDX FUTURE 09.06.22	66.00	531 552.17 0.16
AUD	SPI 200 INDEX FUTURES 16.06.22	13.00	66 614.63 0.02
指数関連金融先物合計			1 449 759.62 0.45

公認の証券取引所に上場されている金融派生商品合計 409 633.06 0.13

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

クレジット・デフォルト・スワップ*

USD	ICE/MARKIT CDX.EM.37 CDI REC 1.00000% 22-20.06.27	21 700 000.00	-1 134 911.39 -0.35
USD	ICE/CDX.NA.IG.S38 CDI REC 1.00000% 22-20.06.27	14 100 000.00	207 718.33 0.06
USD	ICE/CDX.NA.IG.S38 V1 CDI REC 5.00000% 22-20.06.27	33 000 000.00	1 683 400.89 0.52
クレジット・デフォルト・スワップ合計			756 207.83 0.23

公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引されていない金融派生商品合計 756 207.83 0.23

金融派生商品合計 1 165 840.89 0.36

先渡為替契約

購入通貨 / 購入金額 / 売却通貨 / 売却金額 / 満期日

EUR	15 059 843.60	CHF	15 858 476.14	7.4.2022	-428 487.33	-0.13
EUR	18 175 987.50	GBP	15 347 140.42	7.4.2022	18 091.60	0.01
EUR	14 664 227.00	CAD	21 273 907.35	7.4.2022	-641 366.37	-0.20
EUR	13 794 427.15	AUD	22 112 259.80	7.4.2022	-1 128 426.22	-0.35
EUR	4 448 933.65	JPY	585 689 525.00	7.4.2022	112 265.81	0.03
NOK	82 187 874.27	EUR	8 155 671.82	7.4.2022	290 500.42	0.09
EUR	2 935 452.44	HKD	26 149 999.57	7.4.2022	-65 336.16	-0.02
EUR	2 878 962.91	DKK	21 428 000.00	7.4.2022	-1 727.56	0.00
EUR	3 700 526.90	SEK	38 624 097.80	7.4.2022	-24 141.50	-0.01
EUR	192 955 073.01	USD	220 460 124.03	7.4.2022	-5 159 212.45	-1.58
EUR	14 309 163.38	NZD	24 651 454.64	7.4.2022	-1 098 481.22	-0.34
PLN	30 110 000.00	EUR	6 610 649.95	7.4.2022	-120 140.86	-0.04
EUR	10 804 113.12	ZAR	192 461 456.85	7.4.2022	-1 024 983.26	-0.31
EUR	7 217 771.65	CNH	52 750 000.00	7.4.2022	-247 420.59	-0.08
NZD	5 920 000.00	USD	3 927 016.02	7.4.2022	171 164.87	0.05
EUR	6 860 096.90	USD	7 840 000.00	7.4.2022	-185 240.69	-0.06
USD	7 854 416.19	AUD	11 010 000.00	7.4.2022	-372 031.39	-0.11

* 額面が正：サブ・ファンドは「受取側」、額面が負：サブ・ファンドは「支払側」

銘柄	数量 / 額面	ユーロ建評価額 先物 / 先渡為替契約 / 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 / 購入金額 / 売却通貨 / 売却金額 / 満期日			
EUR	125 236.93	AUD 200 000.00 7.4.2022	-9 736.64 0.00
EUR	158 108.00	AUD 250 000.00 7.4.2022	-10 608.96 0.00
USD	9 167 771.05	EUR 8 140 000.00 6.4.2022	98 789.83 0.03
USD	7 425 584.31	PLN 30 660 000.00 6.4.2022	63 246.59 0.02
EUR	9 720.70	CHF 10 000.00 6.4.2022	-45.85 0.00
USD	1 570 000.00	EUR 1 398 935.26 6.4.2022	11 974.76 0.00
EUR	47 792.56	GBP 40 000.00 6.4.2022	464.74 0.00
CAD	580 000.00	EUR 413 679.73 7.4.2022	3 603.47 0.00
CAD	390 000.00	EUR 278 640.93 6.4.2022	1 955.53 0.00
USD	1 799 800.03	JPY 207 620 000.00 6.4.2022	80 109.23 0.03
AUD	9 820 000.00	EUR 6 592 041.89 6.4.2022	35 289.04 0.01
USD	16 240 000.00	EUR 14 855 760.99 6.4.2022	-261 379.65 -0.08
CAD	2 000 000.00	EUR 1 445 964.31 7.4.2022	-7 056.72 0.00
EUR	234 974.93	HKD 2 000 000.00 7.4.2022	5 469.11 0.00
USD	10 418 023.91	EUR 9 580 000.00 7.4.2022	-217 947.01 -0.07
NZD	15 320 000.00	GBP 8 016 258.98 7.4.2022	90 918.59 0.03
EUR	235 065.69	HKD 2 000 000.00 7.4.2022	5 559.87 0.00
EUR	916 144.47	USD 1 000 000.00 7.4.2022	17 504.47 0.01
GBP	1 080 399.90	EUR 1 288 814.17 7.4.2022	-10 544.19 0.00
EUR	142 982.93	HKD 1 233 835.14 7.4.2022	1 396.75 0.00
CHF	1 000 000.00	EUR 977 940.50 7.4.2022	-1 281.03 0.00
EUR	1 044 847.51	USD 1 153 007.83 7.4.2022	8 708.56 0.00
CAD	3 072 632.49	EUR 2 170 724.32 7.4.2022	39 892.79 0.01
EUR	268 786.35	HKD 2 325 549.16 7.4.2022	1 922.81 0.00
EUR	2 364 398.57	USD 2 610 000.00 7.4.2022	18 948.17 0.01
ZAR	192 461 456.85	EUR 11 549 010.70 7.4.2022	280 085.68 0.09
EUR	7 268 225.60	USD 8 000 000.00 7.4.2022	79 105.61 0.02
EUR	615 372.60	HKD 5 300 000.00 7.4.2022	7 182.17 0.00
GBP	23 430 900.00	EUR 27 731 087.66 20.4.2022	-22 151.55 -0.01
CAD	42 553 100.00	EUR 30 029 208.42 20.4.2022	571 469.91 0.18
EUR	379 335.79	CHF 391 138.67 7.4.2022	-2 673.50 0.00
EUR	644 407.42	HKD 5 529 011.38 7.4.2022	9 937.26 0.00
USD	6 840 000.00	EUR 6 214 710.06 7.4.2022	-68 012.47 -0.02
USD	8 760 000.00	EUR 7 899 513.86 7.4.2022	-27 427.48 -0.01
EUR	517 944.09	CHF 536 342.40 7.4.2022	-5 879.80 0.00
USD	1 363 113.75	EUR 1 231 190.02 7.4.2022	-6 241.48 0.00
USD	15 846 372.18	TWD 446 630 000.00 20.5.2022	187 406.35 0.06
USD	18 204 812.43	PHP 960 850 000.00 20.5.2022	-248 210.13 -0.08
USD	11 444 663.85	KRW 13 909 730 000.00 20.5.2022	-11 669.53 0.00
CLP	9 847 700 000.00	USD 12 119 500.34 20.5.2022	260 644.36 0.08
BRL	62 740 000.00	USD 12 195 430.12 20.5.2022	744 394.72 0.23
CAD	2 011 000.00	EUR 1 446 331.71 20.4.2022	-186.44 0.00
GBP	501 000.00	EUR 601 073.51 20.4.2022	-8 600.45 0.00
EUR	93 532.31	GBP 78 000.00 20.4.2022	1 291.00 0.00
EUR	6 562 293.49	USD 7 217 195.29 7.4.2022	76 633.13 0.02
EUR	84 125.53	CAD 117 400.00 20.4.2022	-298.86 0.00
先渡為替契約合計			-8 121 020.14 -2.49
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			47 766 116.29 ** 14.65
その他の資産および負債			-14 431.78 -0.01
純資産総額			326 077 476.21 100.00

** 2022年3月31日現在、当該現金額は取引相手のために担保金に供されており、J.P.モルガンについては646.21ユーロである。

注記は当財務書類の一部である。

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - ダイナミック・アルファ (米ドル)

2022年3月31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			
ユーロ			
EUR GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 3.37500% 20-27.03.25	45 000.00	53 063.60	0.11
ユーロ合計		53 063.60	0.11
米ドル			
USD 3M CO 2.65000% 20-15.04.25	20 000.00	19 857.74	0.04
USD AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP 1.65000% 21-29.10.24	300 000.00	283 322.74	0.58
USD AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC 2.05000% 20-15.05.30	20 000.00	18 435.41	0.04
USD ALBEMARLE CORPORATION 5.45000% 14-01.12.44	50 000.00	55 531.89	0.11
USD ALTRIA GROUP INC 4.40000% 19-14.02.26	19 000.00	19 653.22	0.04
USD AMBER CIRCLE FUNDING LTD-REG-S 3.25000% 12-04.12.22	200 000.00	200 786.00	0.41
USD APACHE CORP 4.25000% 12-15.01.44	80 000.00	70 016.00	0.14
USD APPLE INC 1.80000% 19-11.09.24	40 000.00	39 441.11	0.08
USD APT PIPELINES LTD-REG-S 4.20000% 15-23.03.25	20 000.00	20 320.32	0.04
USD APTIV PLC 2.39600% 22-18.02.25	75 000.00	73 058.95	0.15
USD ASTRAZENECA PLC 3.50000% 18-17.08.23	50 000.00	50 765.31	0.11
USD AT&T INC 4.35000% 19-01.03.29	80 000.00	84 657.49	0.17
USD BANK OF ENGLAND-REG-S 0.50000% 20-28.04.23	60 000.00	59 079.48	0.12
USD BAT CAPITAL CORP 3.55700% 18-15.08.27	40 000.00	38 929.99	0.08
USD BAXTER INTERNATIONAL INC 2.60000% 16-15.08.26	40 000.00	38 775.32	0.08
USD BOEING CO/THE 2.19600% 21-04.02.26	30 000.00	28 362.49	0.06
USD BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 2.60000% 20-16.05.22	50 000.00	50 046.94	0.10
USD CANADIAN PACIFIC RAILWAY 1.35000% 21-02.12.24	90 000.00	86 291.72	0.18
USD CITIGROUP INC-SUB 4.60000% 16-09.03.26	30 000.00	31 107.92	0.06
USD CNOOC PETROLEUM NORTH AMERICA ULC 6.40000% 07-15.05.37	45 000.00	52 650.00	0.11
USD COMCAST CORP 3.95000% 18-15.10.25	50 000.00	51 635.62	0.11
USD COSTCO WHOLESALE CORP 1.60000% 20-20.04.30	15 000.00	13 440.34	0.03
USD CVS HEALTH CORP 2.62500% 19-15.08.24	45 000.00	44 851.56	0.09
USD ENLINK MIDSTREAM PARTNERS LP 4.40000% 14-01.04.24	15 000.00	15 195.85	0.03
USD EQT CORP 3.90000% 17-01.10.27	30 000.00	29 913.15	0.06
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.00000% 17-15.12.22	150 000.00	150 512.95	0.31
USD EVERSOURCE ENERGY 2.90000% 22-01.03.27	100 000.00	97 988.33	0.20
USD EXELON CORP 3.40000% 16-15.04.26	25 000.00	25 085.08	0.05
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO 4.35000% 18-09.04.25	105 000.00	106 789.48	0.22
USD GEORGIA POWER CO 2.10000% 20-30.07.23	35 000.00	34 794.89	0.07
USD GILEAD SCIENCES INC 2.50000% 16-01.09.23	30 000.00	30 054.64	0.06
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.50000% 20-01.04.25	130 000.00	130 969.54	0.27
USD ILLINOIS TOOL WORKS INC 2.65000% 16-15.11.26	70 000.00	69 221.45	0.14
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.20000% 13-25.01.23	330 000.00	333 465.32	0.68
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 3.62500% 16-01.12.27	75 000.00	75 183.72	0.16
USD LINCOLN NATIONAL CORP 3.80000% 18-01.03.28	80 000.00	80 900.91	0.17
USD MASTERCARD INC 2.00000% 19-03.03.25	30 000.00	29 519.69	0.06
USD NIKE INC 2.40000% 20-27.03.25	10 000.00	9 932.70	0.02
USD ORACLE CORP 2.50000% 20-01.04.25	25 000.00	24 417.69	0.05
USD QUANTA SERVICES INC 0.95000% 21-01.10.24	85 000.00	80 587.15	0.17
USD SOUTHERN CO 3.25000% 16-01.07.26	50 000.00	50 004.69	0.10
USD TARGET CORP 1.95000% 22-15.01.27	20 000.00	19 314.67	0.04
USD THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 1.21500% 21-18.10.24	35 000.00	33 657.31	0.07
USD UNITED TECHNOLOGIES CORP 3.95000% 18-16.08.25	40 000.00	41 261.21	0.09
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.37600% 18-15.02.25	36 000.00	36 452.71	0.08

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD VIACOMCBS INC 4.75000% 20-15.05.25	95 000.00	98 696.49	0.20
USD VIRGINIA ELECTRIC & POWER CO 3.80000% 18-01.04.28	20 000.00	20 471.93	0.04
USD VISA INC 1.90000% 20-15.04.27	35 000.00	33 634.65	0.07
USD WESTPAC BANKING CORP 2.00000% 20-13.01.23	35 000.00	35 027.21	0.07
USD WILLIAMS COS INC/THE 4.30000% 14-04.03.24	35 000.00	35 777.18	0.07
USD WPP FINANCE 2010 3.75000% 14-19.09.24	30 000.00	30 308.43	0.06
USD XLIT LTD 5.25000% 13-15.12.43	25 000.00	30 187.50	0.06
米ドル合計		3 220 344.08	6.60
ノート、固定利付債合計		3 273 407.68	6.71
ノート、変動利付債			
英ポンド			
GBP AVIVA PLC-SUB 6.125%/VAR 03-PRP	60 000.00	79 788.99	0.16
英ポンド合計		79 788.99	0.16
米ドル			
USD BK OF AMERICA CORP 3.004%/VAR 18-20.12.23	120 000.00	120 302.98	0.25
USD ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 5.625%/VAR 14-PRP	185 000.00	185 185.00	0.38
USD NATWEST GROUP PLC 4.519%/VAR 18-25.06.24	200 000.00	203 011.94	0.42
米ドル合計		508 499.92	1.05
ノート、変動利付債合計		588 288.91	1.21
ミディアム・ターム・ノート、固定利付債			
豪ドル			
AUD AURIZON NETWORK PTY LTD-REG-S 4.00000% 17-21.06.24	30 000.00	22 836.24	0.05
AUD AUSGRID FINANCE PTY LTD-REG-S 3.75000% 17-30.10.24	50 000.00	37 995.06	0.08
AUD BANCO SANTANDER SA 4.00000% 17-19.01.23	200 000.00	152 692.17	0.31
AUD CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 4.50000% 15-05.06.25	45 000.00	34 285.11	0.07
豪ドル合計		247 808.58	0.51
ユーロ			
EUR BANCO SANTANDER SA-REG-S-SUB 3.25000% 16-04.04.26	100 000.00	117 785.13	0.24
EUR BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC-REG-S 0.87500% 15-13.10.23	100 000.00	111 454.82	0.23
EUR CANAL DE ISABEL II GESTION SA-REG-S 1.68000% 15-26.02.25	100 000.00	112 316.45	0.23
EUR CREDIT AGRICOLE SA LONDON 1.25000% 16-14.04.26	100 000.00	111 525.36	0.23
EUR CTP NV-REG-S 0.87500% 22-20.01.26	100 000.00	104 755.33	0.22
EUR DANSKE BANK AS-REG-S 1.37500% 19-24.05.22	100 000.00	111 514.23	0.23
EUR EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FAC-REG-S 0.50000% 17-11.07.25	150 000.00	166 507.29	0.34
EUR EUROPEAN UNION-REG-S 3.00000% 11-04.09.26	40 000.00	48 995.59	0.10
EUR FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.02100% 19-06.03.24	100 000.00	112 369.64	0.23
EUR GLOBALWORTH REAL ESTATE INVEST-REG-S 3.00000% 18-29.03.25	100 000.00	112 641.91	0.23
EUR GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 1.62500% 16-27.07.26	50 000.00	55 754.33	0.12
EUR PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 3.75000% 17-21.02.24	100 000.00	111 209.37	0.23
EUR REDEXIS GAS FINANCE BV-REG-S 1.87500% 15-27.04.27	100 000.00	109 195.48	0.22
EUR ROMANIA-REG-S 2.75000% 20-26.02.26	140 000.00	158 185.46	0.32
ユーロ合計		1 544 210.39	3.17
英ポンド			
GBP ANGLIAN WATER SERVICES FINANCING-REG-S 4.50000% 13-22.02.26	100 000.00	141 568.17	0.29
GBP CHINA DEVELOPMENT BANK-REG-S 1.25000% 20-21.01.23	200 000.00	261 552.54	0.54
GBP LLOYDS BANKING GROUP PLC 2.25000% 17-16.10.24	100 000.00	129 480.16	0.27
GBP PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC-REG-S-SUB 4.12500% 17-20.07.22	200 000.00	264 931.57	0.54
英ポンド合計		797 532.44	1.64

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
米ドル			
USD BANK OF AMERICA CORP 3.87500% 15-01.08.25	120 000.00	123 371.34	0.25
USD GENERAL ELECTRIC CO 6.75000% 02-15.03.32	6 000.00	7 558.47	0.02
USD JOHN DEERE CAPITAL 2.12500% 22-07.03.25	30 000.00	29 515.01	0.06
USD MEXICO, UNITED STATES OF 8.00000% 02-24.09.22	40 000.00	40 782.50	0.08
USD MORGAN STANLEY 4.00000% 15-23.07.25	130 000.00	133 059.71	0.27
USD MORGAN STANLEY-SUB 4.35000% 14-08.09.26	30 000.00	30 899.27	0.06
USD WALT DISNEY CO/THE 1.85000% 16-30.07.26	10 000.00	9 551.14	0.02
米ドル合計		374 737.44	0.76
ミディアム・ターム・ノート、固定利付債合計		2 964 288.85	6.08
ミディアム・ターム・ノート、ゼロ・クーポン			
ユーロ			
EUR POLAND, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 20-10.02.25	110 000.00	119 309.68	0.24
ユーロ合計		119 309.68	0.24
ミディアム・ターム・ノート、ゼロ・クーポン合計		119 309.68	0.24
ミディアム・ターム・ノート、変動利付債			
ユーロ			
EUR AXA SA-REG-S-SUB 3.250%/VAR 18-28.05.49	100 000.00	115 176.84	0.24
EUR COMMONWEALTH BK OF AUSTRALIA-REG-S-SUB 1.936%/VAR 17-03.10.29	100 000.00	111 345.12	0.23
EUR IBERDROLA INTERNATIONAL BV-REG-S-SUB 2.625%/VAR 18-PRP	100 000.00	113 073.06	0.23
EUR TOTAL SE-REG-S-SUB 2.625%/VAR 15-PRP	100 000.00	111 653.98	0.23
ユーロ合計		451 249.00	0.93
英ポンド			
GBP BARCLAYS PLC-REG-S 2.375%/VAR 17-06.10.23	100 000.00	131 751.64	0.27
GBP CYBG PLC-REG-S 3.375%/VAR 18-24.04.26	100 000.00	131 074.52	0.27
GBP YORKSHIRE WATER SERVICES FIN-REG-S 3.750%/VAR 10-22.03.46	110 000.00	145 874.14	0.30
英ポンド合計		408 700.30	0.84
ミディアム・ターム・ノート、変動利付債合計		859 949.30	1.77
ポンド、固定利付債			
豪ドル			
AUD AUSTRALIA 5.75000% 10-15.07.22	840 000.00	641 004.32	1.31
AUD AUSTRALIA-REG-S 2.25000% 16-21.05.28	650 000.00	475 592.41	0.98
AUD AUSTRALIA-REG-S 2.75000% 16-21.11.27	310 000.00	233 800.17	0.48
豪ドル合計		1 350 396.90	2.77
カナダドル			
CAD CANADA HOUSING TRUST-144A 2.35000% 13-15.09.23	180 000.00	144 340.10	0.30
CAD CANADA, GOVERNMENT 1.00000% 17-01.09.22	780 000.00	624 081.18	1.28
CAD CANADA, GOVERNMENT 1.50000% 19-01.09.24	1 070 000.00	840 982.90	1.72
カナダドル合計		1 609 404.18	3.30
ユーロ			
EUR ADO PROPERTIES SA-REG-S 1.50000% 17-26.07.24	100 000.00	97 730.73	0.20
EUR CAISSE D' AMORTIS DE LA DETTE SOC-REG-S 1.37500% 14-25.11.24	150 000.00	170 573.91	0.35
EUR IRELAND, REPUBLIC OF-REG-S 1.00000% 16-15.05.26	760 000.00	863 711.83	1.77
EUR RESA SA/BELGIUM-REG-S 1.00000% 16-22.07.26	100 000.00	110 165.71	0.23
EUR SPAIN, KINGDOM OF-REG-S 1.60000% 15-30.04.25	280 000.00	322 782.44	0.66
EUR TAURON POLSKA ENERGIA SA-REG-S 2.37500% 17-05.07.27	100 000.00	104 401.34	0.22
EUR TRANSPORT ET INFRASTRUCTURES GAZ-REG-S 2.20000% 15-05.08.25	100 000.00	113 964.07	0.23
EUR VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FIN NV-REG-S 1.12500% 17-02.10.23	100 000.00	111 975.54	0.23
EUR VVO-YHTYMA OYJ-REG-S 1.62500% 16-17.10.23	100 000.00	112 500.98	0.23
ユーロ合計		2 007 806.55	4.12

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
英ポンド			
GBP UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 0.50000% 16-22.07.22	450 000.00	592 368.55	1.21
英ポンド合計		592 368.55	1.21
日本円			
JPY JAPAN 0.10000% 20-01.05.22	59 700 000.00	491 928.01	1.01
JPY JAPAN 0.40000% 15-20.03.25	98 850 000.00	824 655.37	1.69
日本円合計		1 316 583.38	2.70
ニュージーランド・ドル			
NZD NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 0.50000% 21-15.05.20	770 000.00	481 989.37	0.99
ニュージーランド・ドル合計		481 989.37	0.99
米ドル			
USD AMERICAN AIRLINES PASS THROUGH TRUST 4.37500% 14-01.10.22	150 000.00	58 041.44	0.12
USD CITIGROUP INC 3.87500% 13-25.10.23	190 000.00	194 116.93	0.40
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 8.12500% 04-21.05.24	50 000.00	54 290.62	0.11
USD ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC 3.90000% 14-15.02.24	30 000.00	30 550.12	0.06
USD JAPAN BANK FOR INTL COOPERATION 0.62500% 20-22.05.23	400 000.00	393 695.40	0.81
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-REG-S 5.50000% 17-31.07.47	200 000.00	176 750.00	0.36
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 2.66500% 17-25.07.22	40 000.00	40 047.76	0.08
USD NATL RURAL UTIL COOPERATIVE FIN CORP 3.70000% 19-15.03.29	25 000.00	25 571.30	0.05
USD REYNOLDS AMERICAN INC 4.45000% 15-12.06.25	40 000.00	40 842.41	0.09
USD SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 3.70000% 18-01.08.25	25 000.00	25 415.29	0.05
米ドル合計		1 039 321.27	2.13
債券、固定利付債合計		8 397 870.20	17.22
債券、ゼロ・クーポン債			
ユーロ			
EUR FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.00000% 19-25.03.25	400 000.00	441 268.09	0.90
EUR GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 20-11.04.25	1 420 000.00	1 573 327.15	3.23
ユーロ合計		2 014 595.24	4.13
債券、ゼロ・クーポン債合計		2 014 595.24	4.13
債券、変動利付債			
ユーロ			
EUR SWISS LIFE AG VIA DEMETER INV BV-SUB 4.375%/VAR 15-PRP	100 000.00	117 856.34	0.24
EUR UNIBAIL-RODAMCO SE-REG-S-SUB 2.875%/VAR 18-PRP	100 000.00	107 114.40	0.22
EUR VOLKSWAGEN INTL FINANCE NV-REG-S-SUB 3.375%/VAR 18-PRP	100 000.00	112 740.37	0.23
ユーロ合計		337 711.11	0.69
日本円			
JPY JAPAN 0.100%/CPI LINKED 16-10.03.26	60 000 000.00	528 506.53	1.08
日本円合計		528 506.53	1.08
米ドル			
USD SCOR SE-REG-S-SUB 5.250%/VAR 18-PRP	200 000.00	187 608.00	0.39
USD WESTPAC BANKING CORP-SUB 5.000%/VAR 17-PRP	90 000.00	88 069.82	0.18
米ドル合計		275 677.82	0.57
債券、変動利付債合計		1 141 895.46	2.34

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / 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 1.50000% 16-28.02.23	320 000.00	319 575.00	0.66
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.37500% 16-30.09.23	490 000.00	484 583.20	0.99
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.75000% 13-15.11.23	250 000.00	252 089.85	0.52
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.37500% 30.04.20-30.04.25	780 000.00	730 366.40	1.50
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.25000% 20-31.05.25	1 590 000.00	1 479 817.96	3.03
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.12500% 20-30.06.22	620 000.00	619 297.66	1.27
米ドル合計		3 885 730.07	7.97
財務省証券(T-note)、固定利付債合計		3 885 730.07	7.97
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		23 245 335.39	47.67
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	2 600 000.00	2 599 823.04	5.33
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 21-19.05.22	2 600 000.00	2 599 136.23	5.33
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 15.07.21-14.07.22	2 200 000.00	2 196 139.00	4.50
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 21-11.08.22	2 600 000.00	2 592 087.34	5.32
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 02.12.21-02.06.22	2 900 000.00	2 898 369.30	5.94
米ドル合計		12 885 554.91	26.42
財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン合計		12 885 554.91	26.42
ノート、固定利付債			
カナダドル			
CAD TELUS CORP 3.75000% 14-17.01.25	15 000.00	12 110.00	0.02
カナダドル合計		12 110.00	0.02
米ドル			
USD BROADCOM INC 3.15000% 20-15.11.25	45 000.00	44 635.17	0.09
USD CHEVRON PHILLIPS CHEMICAL CO LLC-144A 3.30000% 18-01.05.23	185 000.00	186 460.13	0.38
USD CHEVRON PHILLIPS CHEMICAL CO LLC-144A 5.12500% 20-01.04.25	30 000.00	31 621.72	0.07
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 5.30000% 21-01.10.29	85 000.00	92 586.23	0.19
USD GLENCORE FUNDING LLC-144A 4.87500% 19-12.03.29	50 000.00	52 615.36	0.11
USD KINDER MORGAN INC-144A 5.62500% 13-15.11.23	50 000.00	51 613.97	0.11
USD LIBERTY MUTUAL GROUP INC-144A 4.56900% 19-01.02.29	50 000.00	52 998.25	0.11
USD MPLX LP 4.25000% 20-01.12.27	50 000.00	51 638.28	0.11
USD NXP BV / NXP FDNG LLC / NXP USA-144A 3.15000% 20-01.05.27	20 000.00	19 404.03	0.04
USD NXP BV / NXP FDNG LLC / NXP USA-144A 2.70000% 20-01.05.25	5 000.00	4 846.25	0.01
USD ONCOR ELECTRIC DELIVERY CO 3.70000% 19-15.11.28	20 000.00	20 570.87	0.04
USD SWISS RE TREASURY (US) CORP-144A 4.25000% 12-06.12.42	40 000.00	44 533.93	0.09
USD UNICREDIT SPA-REG-S 3.75000% 17-12.04.22	200 000.00	200 044.97	0.41
USD UNITD AIRLNS 2016-1 CL B PAS THROUGH TRT 3.65000% 17-07.01.26	50 000.00	31 015.72	0.06
USD XCEL ENERGY INC 4.80000% 11-15.09.41	120 000.00	128 512.44	0.26
米ドル合計		1 013 097.32	2.08
ノート、固定利付債合計		1 025 207.32	2.10

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
ボンド、変動利付債			
ニュージーランド・ドル			
NZD NEW ZEALAND 3.000%/CPI LINKED 13-20.09.30	680 000.00	635 781.11	1.30
ニュージーランド・ドル合計		635 781.11	1.30
ボンド、変動利付債合計		635 781.11	1.30
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			
		14 546 543.34	29.82
最近発行された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 MAGALLANES INC-144A 3.75500% 22-15.03.27	75 000.00	74 863.48	0.15
米ドル合計		74 863.48	0.15
ノート、固定利付債合計		74 863.48	0.15
最近発行された譲渡性のある証券および短期金融商品合計		74 863.48	0.15
ルクセンブルグ2010年12月17日法(改訂済)の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs			
投資信託、オープン・エンド型			
アイルランド			
USD ISHARES EDGE MSCI WORLD VALUE FACTOR-ETF-ACCUM	89 154.00	3 347 732.70	6.86
アイルランド合計		3 347 732.70	6.86
投資信託、オープン・エンド型合計		3 347 732.70	6.86
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			
		3 347 732.70	6.86
投資有価証券合計		41 214 474.91	84.50
金融派生商品			
公認の証券取引所に上場されている金融派生商品			
債券関連金融先物			
EUR EURO-BUND FUTURE 08.06.22	-6.00	51 738.22	0.11
EUR EURO-BOBL FUTURE 08.06.22	-1.00	4 361.59	0.01
GBP LONG GILT FUTURE 28.06.22	-4.00	5 108.60	0.01
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.06.22	11.00	1 031.25	0.00
CAD CAN 10YR BOND FUTURE 21.06.22	3.00	-13 642.37	-0.03
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.06.22	19.00	-57 148.45	-0.12
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 21.06.22	-5.00	22 500.00	0.05
USD US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 21.06.22	-1.00	6 750.00	0.01
債券関連金融先物合計		20 698.84	0.04

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
指数関連金融先物			
EUR	EURO STOXX BANKS PRICE INDEX FUTURE 17.06.22	309.00	79 935.56 0.16
EUR	STOXX 600 BASIC RESOURCES FUTURE 17.06.22	26.00	76 950.87 0.16
EUR	STOXX EUROPE 600 INDEX FUTURE 17.06.22	53.00	41 751.08 0.09
CHF	SWISS MARKET INDEX FUTURE 17.06.22	3.00	13 300.73 0.03
EUR	STOXX 600 OIL & GAS FUTURE 17.06.22	58.00	51 983.01 0.11
EUR	EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 17.06.22	-111.00	-274 487.97 -0.56
GBP	FTSE 100 INDEX FUTURE 17.06.22	14.00	70 137.95 0.14
EUR	FTSE/MIB IDX FUTURE 17.06.22	8.00	41 435.09 0.08
USD	MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 17.06.22	28.00	143 630.00 0.29
CAD	S&P/TSX 60 IX FUTURE 16.06.22	2.00	12 406.23 0.03
JPY	TOPIX INDX FUTURE 09.06.22	13.00	170 710.61 0.35
AUD	SPI 200 INDEX FUTURES 16.06.22	2.00	15 544.67 0.03
指数関連金融先物合計			443 297.83 0.91
公認の証券取引所に上場されている金融派生商品合計			463 996.67 0.95
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金融派生商品			
クレジット・デフォルト・スワップ*			
EUR	ICE/ITRX.XOVER.37-V1 CDI REC 5.00000% 22-20.06.27	520 000.00	43 447.54 0.09
USD	ICE/CDX.NA.IG S38 V1 CDI REC 5.00000% 22-20.06.27	1 500 000.00	85 138.00 0.17
クレジット・デフォルト・スワップ合計			128 585.54 0.26
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金融派生商品合計			128 585.54 0.26
金融派生商品合計			592 582.21 1.21
先渡為替契約			
購入通貨 / 購入金額 / 売却通貨 / 売却金額 / 満期日			
USD	665 389.08	KRW	809 000 000.00 13.4.2022 -1 243.51 0.00
MYR	2 951 000.00	USD	707 368.52 13.4.2022 -6 916.81 -0.01
USD	2 061 307.77	PHP	108 600 000.00 13.4.2022 -33 949.34 -0.07
USD	1 359 292.04	TWD	38 400 000.00 13.4.2022 17 585.19 0.04
BRL	14 690 000.00	USD	2 875 880.97 13.4.2022 205 534.81 0.42
CLP	1 240 600 000.00	USD	1 523 797.83 13.4.2022 49 756.68 0.10
COP	11 208 491 000.00	USD	2 922 988.32 13.4.2022 58 481.68 0.12
USD	8 233 935.68	EUR	7 455 000.00 13.4.2022 -63 468.37 -0.13
CHF	21 191 600.00	USD	22 877 067.98 13.4.2022 159 249.25 0.33
NOK	36 740 000.00	USD	4 099 191.74 13.4.2022 101 976.87 0.21
EUR	1 578 200.00	USD	1 744 823.83 13.4.2022 11 710.45 0.02
USD	3 196 767.26	AUD	4 360 000.00 13.4.2022 -77 782.46 -0.16
USD	4 249 477.41	CHF	3 930 000.00 13.4.2022 -22 626.95 -0.05
USD	4 085 999.34	NZD	5 970 000.00 13.4.2022 -65 861.21 -0.15
SEK	13 350 000.00	USD	1 374 639.09 13.4.2022 58 120.16 0.12
USD	4 815 059.60	CAD	6 175 000.00 13.4.2022 -128 525.06 -0.26
MXN	16 750 000.00	USD	791 882.23 13.4.2022 46 466.50 0.10
JPY	284 700 000.00	USD	2 456 947.54 13.4.2022 -110 871.77 -0.23
USD	3 698 612.76	GBP	2 810 000.00 13.4.2022 -863.17 0.00
USD	357 567.28	EUR	325 000.00 13.4.2022 -4 157.24 -0.01
JPY	38 900 000.00	USD	327 663.35 13.4.2022 -7 107.16 -0.01

* 額面が正：サブ・ファンドは「受取側」、額面が負：サブ・ファンドは「支払側」

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / 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 / 購入金額 / 売却通貨 / 売却金額 / 満期日					
USD	286 873.34	EUR 260 000.00	13.4.2022	-2 506.28	-0.01
USD	316 804.58	CHF 295 000.00	13.4.2022	-3 875.01	-0.01
USD	8 943.66	EUR 8 100.00	13.4.2022	-71.63	0.00
JPY	175 686 594.00	USD 1 455 000.00	13.4.2022	-7 251.27	-0.01
EUR	1 330 000.00	NOK 12 660 363.10	13.4.2022	32 597.46	0.07
USD	1 460 000.00	BRL 6 985 224.00	13.4.2022	-5 240.26	-0.01
AUD	1 945 000.00	USD 1 461 655.83	13.4.2022	-876.20	0.00
先渡為替契約合計				198 285.35	0.41
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産				7 587 410.40	15.56
当座借越およびその他の短期負債				-874 064.52	-1.79
その他の資産および負債				56 151.99	0.11
純資産総額				48 774 840.34	100.00

注記は当財務書類の一部である。

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・エクイティーズ (米ドル)

2022年3月31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			
株式			
デンマーク			
DKK GENMAB AS DKK1 (BEARER)	9 100.00	3 355 321.71	2.06
デンマーク合計		3 355 321.71	2.06
フランス			
EUR MICHELIN (CGDE) EUR2	16 287.00	2 228 066.77	1.36
フランス合計		2 228 066.77	1.36
ドイツ			
EUR KNORR BREMSE AG NPV	30 549.00	2 367 087.62	1.45
ドイツ合計		2 367 087.62	1.45
インド			
INR HDFC BANK INR1	227 413.00	4 412 757.57	2.70
インド合計		4 412 757.57	2.70
アイルランド			
EUR AIB GROUP PLC ORD EURO.625	1 263 609.00	2 816 126.97	1.72
USD APTIV PLC COM USD0.01	21 798.00	2 609 438.58	1.60
アイルランド合計		5 425 565.55	3.32
日本			
JPY J T O W E R	51 500.00	3 071 967.07	1.88
JPY キーエンス	8 700.00	4 103 604.56	2.51
JPY ソフトバンクグループ	68 600.00	3 141 894.15	1.93
JPY ソニーグループ	53 600.00	5 621 651.95	3.45
日本合計		15 939 117.73	9.77
オランダ			
EUR KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20	80 700.00	2 489 900.41	1.53
EUR OCI N.V. EURO.02	161 392.00	5 760 695.71	3.53
オランダ合計		8 250 596.12	5.06
スイス			
CHF ALCON AG CHF0.04	59 044.00	4 728 652.87	2.90
スイス合計		4 728 652.87	2.90
イギリス			
GBP ARIX BIOSCIENCE ORD GBPO.00001	342 529.00	527 659.25	0.32
GBP ASHTEAD GROUP ORD GBPO.10	57 680.00	3 670 391.50	2.25
GBP BRIT AMER TOBACCO ORD GBPO.25	95 853.00	4 031 614.02	2.47
USD LIVANOVA PLC ORD GBP1.00 (DI)	44 600.00	3 649 618.00	2.24
GBP LONDON STOCK EXCH ORD GBPO.06918604	38 844.00	4 074 127.26	2.50
GBP SPECTRIS ORD GBPO.05	116 512.00	3 987 009.59	2.44
EUR UNILEVER PLC ORD GBPO.031111	5 600.00	256 461.37	0.16
EUR UNILEVER PLC ORD GBPO.031111	92 323.00	4 206 000.85	2.58
イギリス合計		24 402 881.84	14.96

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ 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			
USD ADOBE INC COM USDO.0001	9 308.00	4 240 910.96	2.60
USD AKAMAI TECHNOLOGIES INC COM	30 065.00	3 589 460.35	2.20
USD AMAZON COM INC COM USDO.01	2 219.00	7 233 829.05	4.43
USD AMERIPRISE FINL INC COM	19 115.00	5 741 381.40	3.52
USD COMCAST CORP COM CLS 'A' USDO.01	99 957.00	4 679 986.74	2.87
USD FIDELITY NATL INF COM STK USDO.01	42 866.00	4 304 603.72	2.64
USD HESS CORPORATION COM USD1	62 768.00	6 718 686.72	4.12
USD INGERSOLL RAND INC COM USD1.00	113 686.00	5 724 090.10	3.51
USD LAB CORP AMER HLDG COM USDO.1	11 800.00	3 111 188.00	1.91
USD LAS VEGAS SANDS CORP COM	45 704.00	1 776 514.48	1.09
USD MADISON SQUARE GRD COM USDO.01 CLASS A	14 473.00	2 595 877.28	1.59
USD MICRON TECHNOLOGY COM USDO.10	63 713.00	4 962 605.57	3.04
USD MONDELEZ INTL INC COM USDO.01	79 462.00	4 988 624.36	3.06
USD ON SEMICONDUCTOR COM USDO.01	64 923.00	4 064 829.03	2.49
USD SNAP INC COM USDO.00001 CL A	53 206.00	1 914 883.94	1.17
USD SPIRIT AEROSYSTEMS COM STK USDO.01 CLASS 'A'	68 244.00	3 336 449.16	2.04
USD TAKE TWO INTERACTI COM USDO.01	24 598.00	3 781 696.52	2.32
USD VERTEX PHARMACEUTI COM USDO.01	18 147.00	4 735 822.59	2.90
USD VMWARE INC COM STK USDO.01 CLASS 'A'	33 253.00	3 786 519.11	2.32
USD WAYFAIR INC COM USDO.001 A	6 253.00	692 707.34	0.42
USD WELLS FARGO & CO COM USD1 2/3	131 490.00	6 372 005.40	3.91
アメリカ合衆国合計		88 352 671.82	54.15
株式合計		159 462 719.60	97.73
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		159 462 719.60	97.73
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			
ルクセンブルグ			
USD UBS-ETF MSCI WORLD-A	2 580.00	799 800.00	0.49
ルクセンブルグ合計		799 800.00	0.49
投資信託、オープン・エンド型合計		799 800.00	0.49
ルクセンブルグ2010年12月17日法(改訂済)の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs合計		799 800.00	0.49
投資有価証券合計		160 262 519.60	98.22
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産		3 419 387.17	2.10
その他の資産および負債		-520 028.93	-0.32
純資産総額		163 161 877.84	100.00

注記は当財務書類の一部である。

[次へ](#)

5 販売及び買戻しの実績

2021年5月1日から2022年4月末日までの1年間における販売および買戻しの実績ならびに2022年4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
グローバル・ アロケーション(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	351,341.551 (0)	1,335,364.870 (24,405.000)	14,938,772.865 (666,220.000)
	円建クラス P - a c c 投資証券	0 (0)	0 (0)	1,283.694 (1,133.000)
グローバル・ アロケーション(ユーロ)	クラスP - a c c 投資証券	302,977.116 (0)	1,501,027.518 (4,810.000)	13,431,668.217 (0)
ダイナミック・アルファ (米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	4,094.379 (0)	6,317.516 (0)	30,652.824 (0)
	ユーロ・ヘッジクラス P - a c c 投資証券	121.914 (0)	1,720.674 (0)	4,634.348 (0)
グローバル・ エクイティーズ(米ドル)	ユーロ建クラス P - a c c 投資証券	13,157.495 (0)	75,522.794 (0)	647,587.360 (6,931.468)

(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。