

## 【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  
- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・エクイティ  
(米ドル)  
(UBS (Lux) Key Selection SICAV  
- Systematic Allocation Portfolio Equity (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  
システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・エクイティ  
(米ドル)  
クラス F - a c c 投資証券  
クラス F - a c c (円ヘッジ) 投資証券  
上限見込額は以下のとおりである。  
システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・エクイティ  
(米ドル)  
クラス F - a c c 投資証券 13億7,380万米ドル  
(約1,580億円)  
クラス F - a c c (円ヘッジ) 投資証券 1,337億円

- (注1) 上限見込額は、便宜上、各クラスの投資証券の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。  
( システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・エクイティ (米ドル) クラス F - a c c 投資証券については137.38米ドルに1,000万口を、システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・エクイティ (米ドル) クラス F - a c c (円ヘッジ) 投資証券については13,370円に1,000万口を、それぞれ乗じて算出した金額である。 )
- (注2) 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円貨をもって行う。
- (注3) 米ドルの円貨換算は、便宜上、2021年12月30日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値 ( 1 米ドル = 115.02円 ) による。

【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。

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

\* 半期報告書の記載内容は、以下のとおりです。

[次へ](#)

## 1 外国投資法人の概況

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・エクイティ (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」、システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・エクイティ (米ドル) を「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、ファンドにはクラスF - a c c 投資証券およびクラスF - a c c (円ヘッジ) 投資証券以外の投資証券も存在するが、その他の投資証券は日本で販売されていないため、以下、ファンドについて「投資証券」というときは、上記の各クラスF - a c c 投資証券および/またはクラスF - a c c (円ヘッジ) 投資証券を指すものとする。

## (1) 主要な経営指標等の推移

(システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・エクイティ (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 <sup>(1)</sup>	- 47,623,680.88	- 22,665,592.62	103,549,287.53	142,573,137.78	- 48,599,430.82
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	- 47,623,680.88	- 22,665,592.62	103,549,287.53	142,573,137.78	- 48,599,430.82
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	- 47,623,680.88	- 22,665,592.62	103,549,287.53	142,573,137.78	- 48,599,430.82
(d) 出資総額 <sup>(2)</sup>	344,633,790.83	402,103,730.02	459,680,598.62	516,228,396.34	542,012,361.69
(e) 発行済投資口総数	(クラスF - a c c 投資証券) 1,825,991.797口 (クラスF - a c c (円ヘッジ) 投資証券) 342,371.000口	(クラスF - a c c 投資証券) 2,069,478.911口 (クラスF - a c c (円ヘッジ) 投資証券) 405,860.000口	(クラスF - a c c 投資証券) 1,839,130.000口 (クラスF - a c c (円ヘッジ) 投資証券) 310,626.000口	(クラスF - a c c 投資証券) 1,793,833.073口 (クラスF - a c c (円ヘッジ) 投資証券) 359,456.000口	(クラスF - a c c 投資証券) 2,043,621.628口 (クラスF - a c c (円ヘッジ) 投資証券) 419,089.000口
(f) 純資産額	344,633,790.83	402,103,730.02	459,680,598.62	516,228,396.34	542,012,361.69
(g) 資産総額	349,040,541.22	406,093,456.48	461,658,841.99	525,666,244.29	586,686,578.34
(h) 1口当たり 純資産価格	(クラスF - a c c 投資証券) 86.26 (クラスF - a c c (円ヘッジ) 投資証券) 8,458円	(クラスF - a c c 投資証券) 89.61 (クラスF - a c c (円ヘッジ) 投資証券) 8,756円	(クラスF - a c c 投資証券) 115.33 (クラスF - a c c (円ヘッジ) 投資証券) 11,235円	(クラスF - a c c 投資証券) 126.06 (クラスF - a c c (円ヘッジ) 投資証券) 12,266円	(クラスF - a c c 投資証券) 117.17 (クラスF - a c c (円ヘッジ) 投資証券) 11,387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F - a c c 投資証券) - 11.28 (クラスF - a c c (円ヘッジ) 投資証券) - 11.70	(クラスF - a c c 投資証券) - 6.52 (クラスF - a c c (円ヘッジ) 投資証券) - 5.18	(クラスF - a c c 投資証券) 26.39 (クラスF - a c c (円ヘッジ) 投資証券) 22.72	(クラスF - a c c 投資証券) 37.76 (クラスF - a c c (円ヘッジ) 投資証券) 26.88	(クラスF - a c c 投資証券) - 8.52 (クラスF - a c c (円ヘッジ) 投資証券) - 13.07
(j) 分配総額	なし	33,993.86	152,294.31	152,294.31	102,467.19
(k) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	98.74%	99.02%	99.57%	98.20%	92.39%
(m) 自己資本利益率 <sup>(3)</sup>	(クラスF - a c c 投資証券) - 16.02% (クラスF - a c c (円ヘッジ) 投資証券) - 15.42%	(クラスF - a c c 投資証券) - 8.50% (クラスF - a c c (円ヘッジ) 投資証券) - 9.38%	(クラスF - a c c 投資証券) 33.70% (クラスF - a c c (円ヘッジ) 投資証券) 32.83%	(クラスF - a c c 投資証券) 40.68% (クラスF - a c c (円ヘッジ) 投資証券) 40.09%	(クラスF - a c c 投資証券) 1.60% (クラスF - a c c (円ヘッジ) 投資証券) 1.35%

- ( 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。
- ( 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。
- ( 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。
- ( 注 1 ) 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 ) システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・エクイティ(米ドル)およびファンドのクラスF - a c c 投資証券は2018年4月30日に運用を開始した。最初の評価日は2018年5月2日である。クラスF - a c c (円ヘッジ)投資証券は、2019年4月1日に募集を開始した。最初の評価日は2019年5月24日である。
- ( 注 3 ) 「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。

## ( 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)	
	米ドル	百万円		
システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・エクイティ(米ドル)	492,187,189.20	63,423	クラスF - a c c 投資証券	2,071,148.089
			クラスF - a c c (円ヘッジ)投資証券	435,585.000

( 注 ) 米ドルの円貨換算は、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)による。以下、別段の記載がない限り、米ドルの円換算表示はすべてこれによるものとする。

## ( 3 ) 主要な投資主の状況

1993年4月5日付ルクセンブルグ法第41条により課されるルクセンブルグ銀行機密規定(改訂済)により、当該サブ・ファンドの主要な投資主に関する情報は公開できない。

## ( 4 ) 役員の状況

( 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、CS SF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、合併に関係す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

S I C A Vの投資主またはF C Pの管理会社の決定に基づき、U C I T Sは、その資産のすべてを別のU C I T Sに譲渡することができ、その後、空のU C I T Sが清算される。

U C I T Sは、特別な状況において、またC S S F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U C I T S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

(システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・エクイティ(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	アイルランド	285,521,156.30	57.70
	ルクセンブルグ	25,916,382.73	5.24
	イギリス	152,150.88	0.03
	シンガポール	99,219.12	0.02
	カナダ	54,132.47	0.01
	小計	311,743,041.50	63.00
株式	日本	26,441,888.91	5.34
	イギリス	16,478,277.71	3.33
	カナダ	15,638,001.83	3.16
	スイス	13,279,471.14	2.68
	フランス	13,197,071.13	2.67
	オーストラリア	9,780,952.83	1.98
	ドイツ	9,697,150.62	1.96
	オランダ	7,344,042.12	1.48
	スウェーデン	4,005,729.28	0.81
	香港	3,420,381.17	0.69
	デンマーク	3,379,185.41	0.68
	スペイン	2,862,850.64	0.58
	イタリア	2,347,902.70	0.47
	シンガポール	1,618,611.02	0.33
	フィンランド	1,453,129.28	0.29
	ベルギー	1,071,800.00	0.22
	アイルランド	1,068,566.52	0.22
	ノルウェー	951,506.20	0.19
	イスラエル	829,733.50	0.17
	ルクセンブルグ	380,199.65	0.08
	ニュージーランド	321,692.97	0.07
	オーストリア	251,424.19	0.05
	ポルトガル	215,228.19	0.04
	マン島	93,302.97	0.02
	アメリカ合衆国	80,948.82	0.02
	マカオ	57,554.85	0.01
	中国	12,796.00	0.00
	ポーランド	8,919.45	0.00
	アラブ首長国連邦	0.01	0.00
	小計	136,288,319.11	27.54

短期金融商品	アメリカ合衆国	9,187,242.83	1.86
	小計	9,187,242.83	1.86
ポートフォリオ合計		457,218,603.44	92.40
現金・その他資産		37,589,868.89	7.60
資産総額		494,808,472.33	100.00
負債総額		2,621,283.13	0.53
合計(純資産総額)		492,187,189.20 (約63,423百万円)	99.47

(注) 投資比率とは、ファンドの資産総額に対する当該資産の時価の比率をいう。以下同じ。

## (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。

(システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・エクイティ(米ドル))

	資産総額		純資産総額		1口当たり純資産価格 (クラスF - a c c 投資証券)		1口当たり純資産価格 (クラスF - a c c (円ヘッジ)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	501,222.97	64,588	484,851.29	62,478	122.88	15,834	11,954
6月末日	517,936.59	66,741	511,866.84	65,959	126.43	16,292	12,302
7月末日	521,601.12	67,214	520,498.60	67,071	126.62	16,316	12,320
8月末日	620,271.46	79,928	540,414.89	69,638	131.37	16,928	12,781
9月末日	525,666.24	67,737	516,228.40	66,521	126.06	16,244	12,266
10月末日	582,119.89	75,012	561,513.89	72,357	134.32	17,308	13,075
11月末日	540,492.61	69,648	538,618.10	69,406	131.54	16,950	12,808
12月末日	573,145.68	73,856	571,585.99	73,655	137.38	17,703	13,370
2022年1月末日	547,262.81	70,520	545,961.28	70,353	127.52	16,432	12,405
2月末日	555,224.98	71,546	550,507.92	70,938	124.79	16,080	12,138
3月末日	586,686.58	75,600	542,012.36	69,844	117.17	15,099	11,387
4月末日	494,808.47	63,761	492,187.19	63,423	107.99	13,916	10,482

ファンドのクラスF - a c c 投資証券およびクラスF - a c c (円ヘッジ) 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

クラスF - a c c 投資証券 / クラスF - a c c (円ヘッジ) 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。

システムティック・アロケーション・ ポートフォリオ・エクイティ(米ドル)	収益率(%) (注)	
	クラスF - a c c 投資証券	- 11.05
	クラスF - a c c (円ヘッジ) 投資証券	- 11.28

(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)

(注)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ユーロ = 135.83円)による。

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。

## (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・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

## (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)	ディレクターノ 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)	ディレクターノ 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 ターノ 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 ターノ 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・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
ケッテラー・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

## (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・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。

[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、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。
- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・エクイティ(米ドル)
- クラスF - a c c 投資証券
- クラスF - a c c (円ヘッジ) 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、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

U B S ( L u x ) キー・セクション・シキャブ  
- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・エクイティ ( 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	370,551,984.15	47,749,329
投資有価証券、未実現評価 ( 損 ) 益	116,945,605.47	15,069,611
投資有価証券合計 ( 注 1 )	487,497,589.62	62,818,939
現金預金、要求払預金および預託金勘定	9,516,646.26	1,226,315
その他の流動資産 ( マージン )	82,198,134.48	10,592,052
有価証券売却未収金 ( 注 1 )	519.66	67
発行未収金	2,113,497.44	272,345
未収配当金	603,170.87	77,725
その他の未収金	90,738.13	11,693
前払費用	9,066.53	1,168
先渡為替契約に係る未実現利益 ( 注 1 )	4,657,215.35	600,129
資産合計	586,686,578.34	75,600,432
負 債		
金融先物に係る未実現損失 ( 注 1 )	(43,659,232.85)	(5,625,929)
当座借越	(331.43)	(43)
買戻未払金	(679,737.88)	(87,591)
定率報酬引当金 ( 注 2 )	(279,685.93)	(36,040)
年次税引当金 ( 注 3 )	(12,854.94)	(1,656)
その他の手数料および報酬に係る引当金 ( 注 2 )	(42,373.62)	(5,460)
引当金合計	(334,914.49)	(43,157)
負債合計	(44,674,216.65)	(5,756,720)
期末現在純資産	542,012,361.69	69,843,713

注記は当財務書類の一部である。

U B S ( L u x ) キー・セクション・シキャブ  
- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・エクイティ (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	4,955.43	639
配当金(注1)	1,552,124.73	200,007
証券貸付に係る純収益	28,046.84	3,614
その他の収益(注4)	126,235.16	16,267
収益合計	1,711,362.16	220,526
費 用		
定率報酬(注2)	(1,713,644.81)	(220,820)
年次税(注3)	(26,640.19)	(3,433)
その他の手数料および報酬(注2)	(36,568.16)	(4,712)
現金および当座借越に係る利息	(50,156.94)	(6,463)
費用合計	(1,827,010.10)	(235,429)
投資純(損)益	(115,647.94)	(14,902)
実現(損)益(注1)		
無オプション市場価格証券に係る実現(損)益	5,039,555.06	649,397
利回り評価証券および短期金融商品に係る実現(損)益	(2,109.20)	(272)
金融先物に係る実現(損)益	(18,291,834.23)	(2,357,086)
先渡為替契約に係る実現(損)益	(1,201,372.71)	(154,809)
為替差(損)益	(7,863,701.06)	(1,013,317)
実現(損)益合計	(22,319,462.14)	(2,876,086)
当期実現純(損)益	(22,435,110.08)	(2,890,988)
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	4,261,396.70	549,124
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	1,049.40	135
金融先物に係る未実現評価(損)益	(35,553,799.20)	(4,581,463)
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	5,127,032.36	660,669
未実現評価(損)益の変動合計	(26,164,320.74)	(3,371,534)
運用の結果による純資産の純増(減)	(48,599,430.82)	(6,262,523)

注記は当財務書類の一部である。

U B S ( L u x ) キー・セレクション・シキャブ  
 - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・エクイティ (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	516,228,396.34	66,521,191
発行額	127,302,513.71	16,404,202
買戻額	(52,816,650.35)	(6,805,954)
純発行(買戻)合計	74,485,863.36	9,598,248
支払配当金	(102,467.19)	(13,204)
投資純(損)益	(115,647.94)	(14,902)
実現(損)益合計	(22,319,462.14)	(2,876,086)
未実現評価(損)益の変動合計	(26,164,320.74)	(3,371,534)
運用の結果による純資産の純増(減)	(48,599,430.82)	(6,262,523)
期末現在純資産	542,012,361.69	69,843,713

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F-acc	(口)	
期首現在発行済投資証券数	1,793,833.0730	
期中発行投資証券数	393,205.2350	
期中買戻投資証券数	(143,416.6800)	
期末現在発行済投資証券数	2,043,621.6280	
クラスF-acc(円ヘッジ)	(口)	
期首現在発行済投資証券数	359,456.0000	
期中発行投資証券数	90,825.0000	
期中買戻投資証券数	(31,192.0000)	
期末現在発行済投資証券数	419,089.0000	

注記は当財務書類の一部である。

U B S (Lux) キー・セレクション・シキャブ  
- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・エクイティ (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)		542,012,361.69	516,228,396.34	402,103,730.02
クラスF-acc	LU1735538461			
発行済投資証券数 (口)		2,043,621.6280	1,793,833.0730	2,069,478.9110
1口当たり純資産価格 (米ドル)		117.17	126.06	89.61
1口当たり発行・買戻価格 (米ドル) <sup>1</sup>		117.17	126.06	89.61
クラスF-acc (円ヘッジ)	LU1735539352			
発行済投資証券数 (口)		419,089.0000	359,456.0000	405,860.0000
1口当たり純資産価格 (日本円)		11,387	12,266	8,756
1口当たり発行・買戻価格 (日本円) <sup>1</sup>		11,387	12,266	8,756

<sup>1</sup> 注記1を参照

注記は当財務書類の一部である。

U B S (Lux) キー・セレクション・シキャブ  
- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・エクイティ (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)
アイルランド	57.65 %	投資信託	62.62 %
日本	5.23	銀行および金融機関	2.93
ルクセンブルグ	5.20	医薬品・化粧品・医療品	2.60
イギリス	3.14	金融および持株会社	1.96
カナダ	3.05	電子工学・半導体	1.68
フランス	2.55	石油	1.29
スイス	2.54	保険	1.20
ドイツ	1.91	エネルギー・水道	1.06
オーストラリア	1.87	インターネット、ソフトウェア・ITサービス	1.05
オランダ	1.44	食品・清涼飲料	0.98
アメリカ合衆国	0.97	国および中央政府	0.96
スウェーデン	0.78	自動車	0.95
香港	0.65	化学	0.93
デンマーク	0.63	通信	0.91
スペイン	0.54	交通・運輸	0.80
イタリア	0.46	不動産	0.71
シンガポール	0.34	機械工学・産業機器	0.71
フィンランド	0.28	たばこ・アルコール	0.64
ベルギー	0.20	建築業・資材	0.59
ノルウェー	0.18	鉱業・石炭・鋼鉄	0.55
イスラエル	0.16	小売り・百貨店	0.53
ニュージーランド	0.06	繊維・衣服・革製品	0.50
オーストリア	0.04	電気装置・部品	0.47
ポルトガル	0.04	貿易会社	0.36
マン島	0.02	グラフィックデザイン・出版・メディア	0.34
マカオ	0.01	非鉄金属	0.33
合計	89.94	各種サービス	0.30
		航空宇宙産業	0.25
		貴金属・宝石	0.24
		バイオテクノロジー	0.23
		宿泊・仕出し・レジャー	0.20
		各種消費財	0.16
		各種資本財	0.16
		林業、紙・パルプ製品	0.13
		時計および宝飾品	0.12
		農業・漁業	0.12
		コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置	0.10
		ゴム・タイヤ	0.08
		各種非分類会社	0.07
		ヘルスケア、社会事業	0.07
		写真・光学	0.03
		環境保護・リサイクル	0.02
		梱包業	0.01
		合計	89.94

注記は当財務書類の一部である。

U B S (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のみ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関わ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にのみ行われる。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

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、金利スワップショ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 - システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・エクイティ(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「F」が付く投資証券クラス	0.610%	年率0.640%

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(UCIsまたはUCITS)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

ルクセンブルク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

U B S (Lux) キー・セレクション・シキャブ - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ エクイティ(米ドル)	指数関連金融先物(購入)  56,275.00 米ドル	指数関連金融先物(売却)  472,903,854.39 米ドル
U B S (Lux) キー・セレクション・シキャブ - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ エクイティ(米ドル)	債券関連金融先物(購入)  380,443,422.60 米ドル	債券関連金融先物(売却)  285,531.25 米ドル
U B S (Lux) キー・セレクション・シキャブ - システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ エクイティ(米ドル)	金利関連金融先物(購入)  103,147,325.00 米ドル	金利関連金融先物(売却)  - 米ドル

債券または指数に係る金融先物契約(もしあれば)は、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

U B S (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

U B S (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)
該当なし		
U B S (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		
U B S (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		
U B S (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)
- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・エクイティ (米ドル) クラス F - a c c 投資証券	0.70%
- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・エクイティ (米ドル) クラス F - a c c (円ヘッジ) 投資証券	0.73%

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・クオンティティティブ (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。

U B S ヨーロッパ S E 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。

U B S (Lux) キー・セレクション・シキャブ - システマティック・アロケーション・ ポートフォリオ・エクイティ(米ドル)	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
	24,394,157.90 米ドル	25,883,706.55 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。

U B S (Lux) キー・セレクション・シキャブ - システマティック・アロケーション・ ポートフォリオ・エクイティ(米ドル)	
貸付証券収益	46,744.73 米ドル
貸付証券費用	18,697.89 米ドル
貸付証券純収益	28,046.84 米ドル

[次へ](#)



## ( 2 ) 投資有価証券明細表等

## U B S (Lux)キー・セレクション・シキャブ

- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・エクイティ(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			
オーストラリア			
AUD AMPOL LTD NPV	1 882.00	43 303.14	0.01
AUD APA GROUP NPV	10 240.00	82 049.40	0.01
AUD ARISTOCRAT LEISURE NPV	4 860.00	133 940.94	0.02
AUD ASX LTD NPV	1 659.00	101 908.57	0.02
AUD AURIZON HOLDINGS NPV	14 597.00	40 448.37	0.01
AUD AUST & NZ BANK GRP NPV	21 960.00	455 147.79	0.08
AUD BHP GROUP LTD NPV	27 867.00	1 082 957.95	0.20
GBP BHP GROUP LTD NPV	12 123.00	471 190.80	0.09
AUD BLUESCOPE STEEL NPV	3 432.00	53 761.65	0.01
AUD BRAMBLES LTD NPV	10 777.00	80 201.51	0.01
AUD CMNWLT BK OF AUST NPV	13 414.00	1 065 446.94	0.20
AUD COCHLEAR LTD NPV	495.00	83 759.72	0.01
AUD COLES GROUP LTD NPV	10 579.00	142 282.41	0.03
AUD COMPUTERSHARE LTD NPV(POST REC)	4 786.00	88 772.95	0.02
AUD CROWN RESORTS LTD NPV	3 638.00	34 859.76	0.01
AUD CSL NPV	3 797.00	764 591.42	0.14
AUD DOMINOS PIZZA ENT NPV	370.00	24 409.25	0.00
AUD ENDEAVOUR GROUP LI NPV	8 917.00	48 815.45	0.01
AUD EVOLUTION MINING NPV	11 789.00	38 952.98	0.01
AUD FORTECUE METALS G NPV	13 488.00	209 261.29	0.04
AUD GOODMAN GROUP (STAPLED SECURITY)	12 670.00	217 787.74	0.04
AUD GPT GROUP NPV (STAPLED SECURITIES)	15 032.00	58 473.29	0.01
AUD IDP EDUCATION LTD NPV	1 492.00	35 382.78	0.01
AUD INSURANCE AUST GRP NPV	19 986.00	65 737.17	0.01
AUD LEND LEASE GROUP NPV	4 711.00	39 622.53	0.01
AUD MACQUARIE GP LTD NPV	2 756.00	420 691.29	0.08
AUD MEDIBANK PRIVATE L NPV	20 870.00	48 270.77	0.01
AUD MINERAL RESS LTD NPV	980.00	38 790.92	0.01
AUD MIRVAC GROUP STAPLED SECURITIES	25 687.00	48 031.24	0.01
AUD NATL AUSTRALIA BK NPV	25 612.00	622 198.27	0.11
AUD NEWCREST MINING NPV	6 746.00	135 462.40	0.01
AUD NTHN STAR RES LTD NPV	7 550.00	60 892.28	0.01
AUD ORICA LIMITED NPV	3 320.00	39 765.81	0.01
AUD ORIGIN ENERGY NPV	11 554.00	54 054.45	0.01
AUD QANTAS AIRWAYS NPV	7 944.00	31 080.50	0.01
AUD QBE INS GROUP NPV	10 687.00	92 292.13	0.02
AUD RAMSAY HEALTH CARE NPV	1 405.00	68 738.77	0.01
AUD REA GROUP LIMITED NPV	411.00	41 811.52	0.01
AUD REECE AUSTRALIA NPV	1 815.00	25 978.29	0.00
AUD RIO TINTO LIMITED NPV	2 796.00	250 090.05	0.05
AUD SANTOS LIMITED NPV	24 464.97	142 199.01	0.03
AUD SCENTRE GROUP NPV STAPLED UNIT	41 617.00	95 319.47	0.02
AUD SEEK LIMITED NPV	2 378.00	53 251.34	0.01
AUD SONIC HEALTHCARE NPV	3 750.00	99 913.90	0.02
AUD SOUL PATTINSON(WH) NPV	1 749.00	37 589.84	0.01
AUD SOUTH32 LTD NPV	36 900.00	139 104.48	0.02
AUD STOCKLAND NPV (STAPLED)	18 487.00	59 279.61	0.01

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
AUD SUNCORP GROUP LTD NPV	11 200.00	93 526.32	0.02
AUD TABCORP HLDGS LTD NPV	17 857.00	71 607.87	0.01
AUD TELSTRA CORP NPV	29 800.00	88 618.11	0.02
AUD TRANSURBAN GROUP STAPLED UNITS NPV	24 349.00	247 760.15	0.04
AUD TREASURY WINE ESTA NPV	5 345.00	46 480.13	0.01
AUD VICINITY CENTRES NPV (STAPLED SECURITY)	28 696.00	40 189.37	0.01
AUD WESFARMERS LTD NPV	9 123.00	345 354.72	0.06
AUD WESTPAC BKG CORP NPV	29 104.00	529 780.93	0.10
AUD WISETECH GLOBAL LT NPV	1 339.00	51 362.07	0.01
AUD WOODSIDE PETROLEUM NPV	7 836.00	188 890.66	0.03
AUD WOOLWORTHS GRP LTD NPV	9 527.00	266 569.24	0.05
オーストラリア合計		10 038 011.71	1.85
オーストリア			
EUR ERSTE GROUP BK AG NPV	2 131.00	78 458.28	0.01
EUR OMV AG NPV(VAR)	1 264.00	61 023.24	0.01
EUR RAIFFEISEN BK INTL NPV (REGD)	1 425.00	20 532.56	0.00
EUR VERBUND AG CLASS 'A' NPV	532.00	56 529.30	0.01
EUR VOESTALPINE AG NPV	1 056.00	31 747.38	0.01
オーストリア合計		248 290.76	0.04
ベルギー			
EUR AGEAS NPV	1 244.00	63 448.82	0.01
EUR ANHEUSER-BUSCH IN NPV	6 576.00	397 008.83	0.07
EUR COLRUYT SA NPV	386.00	16 105.61	0.00
EUR ELIA SYS OPERATOR NPV	177.00	27 216.98	0.01
EUR GPE BRUXELLES LAM NPV	1 016.00	106 398.18	0.02
EUR KBC GROUP NV NPV	2 031.00	147 745.21	0.03
EUR PROXIMUS SA NPV	1 474.00	27 634.78	0.01
EUR SOFINA NPV	134.00	49 231.20	0.01
EUR SOLVAY SA NPV	530.00	52 754.96	0.01
EUR UCB NPV	1 045.00	126 096.90	0.02
EUR UMICORE NPV	1 440.00	63 063.22	0.01
ベルギー合計		1 076 704.69	0.20
カナダ			
CAD 1ST QUANTUM MINLS COM NPV	4 369.00	151 387.31	0.03
CAD AGNICO EAGLE MINES LTD COM	3 879.98	237 635.56	0.04
CAD AIR CANADA VAR VTG SHS NPV	1 576.00	30 597.65	0.01
CAD ALGONQUIN PWR&UTIL COM NPV	5 500.00	85 380.89	0.02
CAD ALIMENTATION COUCH MULTIPLE VTG SHS NPV	6 513.00	293 672.92	0.05
CAD ALTAGAS LTD COM NPV	1 950.00	43 713.22	0.01
CAD BALLARD POWER SYS COM NPV	1 400.00	16 308.39	0.00
CAD BANK NOVA SCOTIA HALIFAX COM	9 612.00	689 512.19	0.13
CAD BANK OF MONTREAL COM NPV	5 130.00	604 198.63	0.11
CAD BARRICK GOLD CORP COM NPV	13 984.00	343 260.43	0.06
CAD BCE INC COM NEW	769.00	42 665.79	0.01
CAD BLACKBERRY LTD NPV	4 332.00	32 150.55	0.01
CAD BROOKFIELD ASSET M LTD VTG SHS NPV CL 'A'	10 819.50	612 243.11	0.11
CAD CAE INC COM NPV	2 599.00	67 708.63	0.01
CAD CAMECO CORP COM	3 214.00	93 688.60	0.02
CAD CAN PACIFIC RYS COM NPV	7 080.00	584 856.01	0.11
CAD CANADIAN NAT RES LTD COM	9 357.00	579 901.02	0.11
CAD CANADIAN NATL RY CO COM	5 610.00	753 210.04	0.14
CAD CANADIAN TIRE LTD CL A	410.00	61 960.37	0.01
CAD CANADIAN UTILS LTD CL A	1 093.00	33 532.49	0.01
CAD CANOPY GROWTH CORP COM NPV	1 450.00	11 005.16	0.00
CAD CCL INDUSTRIES INC 'B' NON-VTG COM NPV	1 324.00	59 784.32	0.01
CAD CDN IMPERIAL BK OF COMMERCE COM	3 567.00	433 363.16	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 (%)
CAD CENOVUS ENERGY INC COM NPV	10 333.00	172 402.80	0.03
CAD CGI INC COM NPV SUB VOTING SHARES C	1 637.00	130 522.26	0.02
CAD CONSTELLATION SOFT COM STK NPV	145.00	248 080.54	0.05
CAD DOLLARAMA INC COM NPV	2 313.00	131 293.14	0.02
CAD EMERA INC COM	2 233.00	110 787.41	0.02
CAD EMPIRE LTD CL A	1 200.00	42 598.78	0.01
CAD ENBRIDGE INC COM NPV	15 939.00	734 389.70	0.13
CAD FAIRFAX FINL HLDGS SUB-VTG COM NPV	189.00	103 201.37	0.02
CAD FIRSTSERVICE CORP COM NPV	300.00	43 432.21	0.01
CAD FORTIS INC COM NPV	4 027.00	199 343.03	0.04
CAD FRANCO NEVADA CORP COM NPV	1 517.00	241 617.21	0.04
CAD GFL ENVIRON INC COM NPV SUB VTG SHS	1 400.00	45 573.84	0.01
CAD GILDAN ACTIVEWEAR INC COM	1 415.00	53 119.85	0.01
CAD GREAT WEST LIFECO INC COM	2 286.00	67 424.23	0.01
CAD HYDRO ONE INC COM NPV	3 018.00	81 378.84	0.01
CAD IA FINANCIAL CORP COM NPV	933.00	56 777.01	0.01
CAD IGM FINANCIAL INC COM	642.00	22 702.97	0.00
CAD IMPERIAL OIL LTD COM NEW	2 085.00	100 990.75	0.02
CAD INTACT FINL CORP COM NPV	1 401.00	207 191.64	0.04
CAD IVANHOE MINES LTD COM NPV CL 'A'	4 200.00	39 207.40	0.01
CAD KEYERA CORPORATION COM NPV	1 429.00	36 255.56	0.01
CAD KINROSS GOLD CORP COM NPV	7 990.00	46 952.96	0.01
CAD LIGHTSPEED COMMERC COM NPV SUB VTG SHS	700.00	21 369.04	0.00
CAD LOBLAW COS LTD COM	1 221.00	109 660.77	0.02
CAD LUNDIN MINING CORP COM	4 533.00	45 981.43	0.01
CAD MAGNA INTL INC COM NPV	2 319.00	149 011.60	0.03
CAD MANULIFE FINL CORP COM	15 335.00	327 313.64	0.06
CAD METRO INC CL A SUB	2 211.00	127 379.66	0.02
CAD NATL BK OF CANADA COM NPV	2 690.00	206 383.01	0.04
CAD NORTHLAND POWER IN COM NPV	1 949.00	64 849.64	0.01
CAD NUTRIEN LTD NPV	4 522.00	467 821.82	0.09
CAD NUVEI CORPORATION SUB VOTING SHARES (CAD)	400.00	30 102.88	0.01
CAD ONEX CORP SUB VTG	676.00	45 342.68	0.01
CAD OPEN TEXT CO COM NPV	2 081.00	88 318.17	0.02
CAD PAN AMER SILVER COM NPV	1 600.00	43 706.82	0.01
CAD PARKLAND CORP. COM NPV	1 000.00	29 598.49	0.01
CAD PEMBINA PIPELINE C COM NPV	4 381.00	164 745.66	0.03
CAD POWER CORP CDA COM	4 463.00	138 279.57	0.02
CAD QUEBECOR INC CL B	1 470.00	35 071.45	0.01
CAD RESTAURANT BRANDS COM NPV	2 337.00	136 659.45	0.02
CAD RITCHIE BROS AUCTIONEERS COM	900.00	53 205.24	0.01
CAD ROGERS COMMS INC CLASS 'B' COM CAD1.62478	2 799.00	158 566.30	0.03
CAD ROYAL BK OF CANADA COM NPV	11 105.00	1 223 723.79	0.23
CAD SAPUTO INC COM	1 892.00	44 851.78	0.01
CAD SHAW COMMUNICATIONS INC CL B CONV	3 644.00	113 195.79	0.02
CAD SHOPIFY INC COM NPV CL A	890.00	602 432.49	0.11
CAD SUN LIFE FINL INC COM	4 335.00	242 250.51	0.04
CAD SUNCOR ENERGY INC COM NPV 'NEW'	11 430.00	372 443.86	0.07
CAD TC ENERGY CORPORAT COM NPV	7 731.00	436 421.93	0.08
CAD TECK RESOURCES LTD CLASS 'B' SUB-VTG COM NPV	3 619.00	146 260.85	0.03
CAD TELUS CORPORATION NPV	3 194.00	83 516.30	0.01
CAD TFI INTERNATIONAL COM NPV	525.00	55 965.53	0.01
CAD THOMSON-REUTERS CP COM NPV(POST REV SPLIT)	1 391.00	151 155.22	0.03
CAD TMX GROUP LTD COM NPV	500.00	51 471.12	0.01
CAD TOROMONT INDS LTD COM	700.00	66 416.08	0.01
CAD TORONTO-DOMINION COM NPV	14 211.00	1 128 528.95	0.21
CAD TOURMALINE OIL CP COM NPV	2 300.00	106 064.61	0.02
CAD WEST FRASER TIMBER COM NPV	758.00	62 421.74	0.01

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
CAD WESTON GEORGE LTD COM	605.00	74 568.47	0.01
CAD WHEATON PRECIOUS M COM NPV	3 617.00	172 155.36	0.03
CAD WSP GLOBAL INC COM NPV	861.00	114 365.73	0.02
カナダ合計		16 468 557.37	3.04
中国			
USD FUTU HOLDINGS LIM1 SPON ADS EA REP 8 ORD SHS	400.00	13 024.00	0.00
中国合計		13 024.00	0.00
デンマーク			
DKK A.P. MOELLER-MAERSK SER ' B ' DKK1000	47.00	143 207.16	0.03
DKK A.P. MOLLER-MAERSK ' A ' DKK1000	25.00	74 603.42	0.01
DKK AMBU A/S SER ' B ' DKK0.5	1 312.00	19 625.00	0.00
DKK CARLSBERG SER ' B ' DKK20	821.00	101 928.84	0.02
DKK CHR. HANSEN HLDG DKK10	750.00	55 722.59	0.01
DKK COLOPLAST DKK1 B	971.00	148 801.41	0.03
DKK DANSKE BANK A/S DKK10	5 934.00	99 945.16	0.02
DKK DEMANT A/S DKK0.20	687.00	31 445.17	0.01
DKK DSV PANALPINA A/S DKK1	1 607.00	312 609.44	0.06
DKK GENMAB AS DKK1 (BEARER)	529.00	195 051.12	0.04
DKK GN STORE NORD DKK4	915.00	45 535.46	0.01
DKK NOVO-NORDISK AS DKK0.2 SER ' B '	13 175.00	1 475 877.48	0.27
DKK NOVOZYMES A/S SER ' B ' DKK2 (POST CONS)	1 694.00	117 319.51	0.02
DKK ORSTED A/S DKK10	1 471.00	186 852.33	0.04
DKK PANDORA A/S DKK1	718.00	69 551.60	0.01
DKK ROCKWOOL INTL SER ' B ' DKK10	70.00	23 370.50	0.00
DKK TRYG A/S DKK5	3 069.00	75 401.18	0.01
DKK VESTAS WIND SYSTEM DKK0.20 (POST SPLIT)	8 053.00	240 613.69	0.04
デンマーク合計		3 417 461.06	0.63
フィンランド			
EUR ELISA OYJ NPV	1 249.00	75 905.41	0.01
EUR FORTUM OYJ EUR3.40	3 594.00	66 101.22	0.01
EUR KESKO OYJ EUR2 SER ' B '	2 180.00	60 663.68	0.01
EUR KONE CORPORATION NPV ORD ' B '	2 743.00	145 244.63	0.03
EUR NESTE OIL OYJ NPV	3 302.00	152 396.29	0.03
EUR NOKIA OYJ NPV	42 666.00	236 673.27	0.04
SEK NORDEA HOLDING ABP NPV	25 439.00	265 598.07	0.05
EUR ORION CORP SER ' B ' NPV	717.00	32 828.24	0.01
EUR SAMPO PLC SER ' A ' NPV	3 960.00	195 542.45	0.03
EUR STORA ENSO OYJ NPV SER ' R '	4 435.00	87 909.95	0.02
EUR UPM-KYMMENE CORP NPV	4 414.00	145 667.29	0.03
EUR WARTSILA OYJ ABP SER ' B ' EUR3.50	3 915.00	36 181.14	0.01
フィンランド合計		1 500 711.64	0.28
フランス			
EUR ACCOR EUR3	1 421.00	46 214.84	0.01
EUR ADP EUR3	309.00	46 758.00	0.01
EUR AIR LIQUIDE(L ' ) EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)	3 713.00	656 541.34	0.12
EUR AIRBUS EUR1	4 631.00	568 650.00	0.11
EUR ALSTOM EUR7.00	2 493.00	58 999.50	0.01
EUR AMUNDI EUR2.5 (AIW)	464.00	32 111.97	0.01
EUR ARKEMA EUR10	459.00	55 539.32	0.01
EUR AXA EUR2.29	15 130.00	447 205.69	0.08
EUR BIOMERIEUX NPV (POST SPLIT)	300.00	32 291.33	0.01
EUR BNP PARIBAS EUR2	8 855.00	511 641.14	0.09
EUR BOLLORE EURO.16	7 169.00	37 920.70	0.01

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR BOUYGUES EUR1	1 845.00	64 931.31	0.01
EUR BUREAU VERITAS EURO.12	2 059.00	59 427.15	0.01
EUR CAPGEMINI EUR8	1 283.00	289 074.81	0.05
EUR CARREFOUR EUR2.50	5 342.00	116 765.49	0.02
EUR CIE DE ST-GOBAIN EUR4	3 986.00	240 688.69	0.04
EUR CNP ASSURANCES EUR1	1 659.00	40 240.32	0.01
EUR COVIVIO EUR3	531.00	42 621.55	0.01
EUR CREDIT AGRICOLE SA EUR3	8 697.00	105 340.74	0.02
EUR DANONE EURO.25	5 058.00	281 558.02	0.05
EUR DASSAULT AVIATION EURO.80 (POST SUBDIVISION)	140.00	22 384.29	0.00
EUR DASSAULT SYSTEMES EURO.10	5 313.00	264 333.15	0.05
EUR EDENRED EUR2	2 172.00	108 557.08	0.02
EUR EDF EURO.5	4 201.00	39 889.98	0.01
EUR EIFFAGE EUR4	703.00	72 931.67	0.01
EUR ENGIE EUR1	12 884.00	171 078.46	0.03
EUR ESSLORLUXOTTICA EURO.18	2 253.00	416 880.91	0.08
EUR EURAZEO NPV	241.00	20 486.56	0.00
EUR FAURECIA EUR7	877.00	23 077.53	0.00
EUR GECINA EUR7.50	317.00	40 314.76	0.01
EUR GETLINK SE EURO.40	3 268.00	59 432.71	0.01
EUR HERMES INTL NPV	249.00	357 809.88	0.07
EUR IPSEN EUR1	245.00	30 885.50	0.01
EUR KERING EUR4	594.00	380 488.25	0.07
EUR KLEPIERRE EUR1.40	1 876.00	50 471.67	0.01
EUR LA FRANCAISE DES EURO.40 (PROMESSES)	793.00	31 728.64	0.01
EUR LEGRAND SA EUR4	2 107.00	202 505.26	0.04
EUR L'OREAL EURO.20	1 976.00	799 959.30	0.15
EUR LVMH MOET HENNESSY EURO.30	2 188.00	1 580 950.14	0.29
EUR MICHELIN (CGDE) EUR2	1 328.00	181 670.82	0.03
EUR ORANGE EUR4	15 510.00	184 721.08	0.03
EUR ORPEA EUR2.5	446.00	19 542.01	0.00
EUR PERNOD RICARD EUR1.55	1 633.00	362 119.62	0.07
EUR PUBLICIS GROUPE SA EURO.40	1 591.00	97 822.70	0.02
EUR REMY COINTREAU EUR1.60	120.00	24 967.87	0.00
EUR RENAULT SA EUR3.81	1 727.00	45 876.93	0.01
EUR SAFRAN EURO.20	2 684.00	320 316.18	0.06
EUR SANOFI EUR2	8 917.00	917 837.97	0.17
EUR SARTORIUS STEDIM B EURO.20 (POST SUBD)	208.00	86 208.12	0.02
EUR SCHNEIDER ELECTRIC EUR8	4 201.00	711 232.76	0.13
EUR SEB SA EUR1	185.00	26 059.38	0.00
EUR SOC GENERALE EUR1.25	6 401.00	174 205.90	0.03
EUR SODEXO EUR4	677.00	55 590.89	0.01
EUR TELEPERFORMANCE EUR2.50	463.00	178 398.85	0.03
EUR THALES EUR3	804.00	101 936.32	0.02
EUR TOTALENERGIES SE EUR2.5	19 626.00	1 005 151.08	0.19
EUR UBISOFT ENTERTAIN EURO.31	600.00	26 670.22	0.00
EUR UNIBAIL-RODAMCO-WE NPV(1 ORD UNIBAIL-R & 1CLS)	1 103.00	83 674.11	0.02
EUR VALEO EUR1 (POST SUBD)	1 579.00	29 436.44	0.01
EUR VEOLIA ENVIRONNEME EUR5	5 220.00	168 955.68	0.03
EUR VINCI EUR2.50	4 225.00	437 140.99	0.08
EUR VIVENDI SA EUR5.50	5 422.00	71 428.21	0.01
EUR WENDEL EUR4	219.00	22 563.87	0.00
EUR WORLDLINE EURO.68	1 934.00	84 966.39	0.02
フランス合計		13 827 182.04	2.55
ドイツ			
EUR ADIDAS AG NPV (REGD)	1 513.00	356 720.82	0.07
EUR ALLIANZ SE NPV(REGD)(VINKULIERT)	3 181.00	766 444.00	0.14

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR BASF SE NPV	7 087.00	408 145.74	0.08
EUR BAYER AG NPV (REGD)	7 587.00	524 228.05	0.10
EUR BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG EUR1	2 639.00	230 791.87	0.04
EUR BAYERISCHE MOTORENWERKE AG EUR1	434.00	33 947.17	0.01
EUR BECHTLE AG NPV	558.00	31 787.97	0.01
EUR BEIERSDORF AG NPV	843.00	89 294.17	0.02
EUR BRENNTAG AG	1 303.00	106 327.08	0.02
EUR CARL ZEISS MEDITEC NPV	359.00	58 697.91	0.01
EUR COMMERZBANK AG NPV	7 578.00	58 406.13	0.01
EUR CONTINENTAL AG ORD NPV	833.00	60 615.17	0.01
EUR COVESTRO AG NPV	1 578.00	80 484.12	0.01
EUR DAIMLER TRUCK HOLD NPV (YOUNG SHARE)	3 362.00	94 378.60	0.02
EUR DELIVERY HERO SE NPV	1 291.00	57 256.15	0.01
EUR DEUTSCHE BANK AG NPV(REGD)	16 384.00	209 823.36	0.04
EUR DEUTSCHE BOERSE AG NPV(REGD)	1 512.00	274 219.27	0.05
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA ORD NPV (REGD)(VINK)	3 418.00	27 982.75	0.01
EUR DEUTSCHE POST AG NPV(REGD)	7 874.00	381 541.82	0.07
EUR DEUTSCHE TELEKOM NPV(REGD)	25 311.00	476 843.79	0.09
EUR E.ON SE NPV	17 353.00	203 542.99	0.04
EUR EVONIK INDUSTRIES NPV	1 856.00	51 998.67	0.01
EUR FRESENIUS MED CARE NPV	1 557.00	105 260.38	0.02
EUR FRESENIUS SE & CO. KGAA NPV	3 312.00	122 879.55	0.02
EUR FUCHS PETROLUB SE PRF NPV (REG)	491.00	17 908.08	0.00
EUR GEA GROUP AG NPV	1 089.00	45 207.63	0.01
EUR HANNOVER RUECKVERS ORD NPV(REGD)	435.00	74 705.82	0.01
EUR HEIDELBERGCEMENT NPV	1 277.00	73 401.32	0.01
EUR HELLOFRESH SE NPV	1 317.00	60 021.15	0.01
EUR HENKEL AG & CO KGAA	692.00	46 158.73	0.01
EUR HENKEL AG&CO. KGAA NON-VTG PRF NPV	1 440.00	97 222.47	0.02
EUR INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)	10 389.00	358 165.56	0.07
EUR KION GROUP AG NPV	619.00	41 323.82	0.01
EUR KNORR BREMSE AG NPV	614.00	47 575.76	0.01
EUR LANXESS AG NPV	594.00	26 363.86	0.00
EUR LEG IMMOBILIEN SE NPV	608.00	69 847.72	0.01
EUR MERCEDES-BENZ ORD NPV(REGD)	6 723.00	477 320.88	0.09
EUR MERCK KGAA NPV	1 027.00	216 939.99	0.04
EUR MTU AERO ENGINES H NPV (REGD)	436.00	102 213.81	0.02
EUR MUENCHENER RUECKVE NPV(REGD)	1 104.00	298 492.84	0.05
EUR NEMETSCHKE SE ORD NPV	416.00	40 639.32	0.01
EUR PORSCHE AUTO HL SE NON VTG PRF NPV	1 096.00	107 190.92	0.02
EUR PUMA SE NPV	882.00	75 996.31	0.01
EUR RATIONAL AG NPV	28.00	19 533.68	0.00
EUR RWE AG (NEU) NPV	5 141.00	226 116.88	0.04
EUR SAP AG ORD NPV	8 252.00	928 442.16	0.17
EUR SARTORIUS AG NON VTG PRF NPV	212.00	94 753.72	0.02
EUR SCOUT24 AG NPV	851.00	49 236.99	0.01
EUR SIEMENS AG NPV(REGD)	6 030.00	843 088.06	0.16
EUR SIEMENS ENERGY AG NPV	2 906.00	66 995.24	0.01
EUR SIEMENS HEALTHINEE NPV	2 254.00	141 045.03	0.03
EUR SYMRISE AG NPV (BR)	994.00	120 385.28	0.02
EUR TELEFONICA DEUTSCH NPV	6 740.00	18 515.68	0.00
EUR UNIPER SE NPV	992.00	25 827.72	0.00
EUR UNITED INTERNET AG NPV(REGD)	645.00	22 376.62	0.00
EUR VOLKSWAGEN AG NON VTG PRF NPV	1 465.00	255 915.06	0.05
EUR VOLKSWAGEN AG ORD NPV	258.00	64 933.81	0.01
EUR VONOVIA SE NPV	5 890.00	277 278.94	0.05
EUR ZALANDO SE NPV	1 774.00	90 796.69	0.02
ドイツ合計		10 333 555.08	1.91

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
<b>香港</b>			
HKD AIA GROUP LTD NPV	95 400.00	1 004 383.63	0.18
HKD BOC HONG KONG HLDG HKD5	28 000.00	106 187.91	0.02
HKD BUDWEISER BREWING USD0.00001	8 900.00	23 695.00	0.00
HKD CHOW TAI FOOK JEWE HKD1	16 600.00	30 226.52	0.01
HKD CK ASSET HOLDINGS HKD1	18 000.00	123 426.21	0.02
HKD CK HUTCHISON HLDGS HKD1.0	21 000.00	154 321.07	0.03
HKD CK INFRASTRUCTURE HKD1	5 500.00	36 835.69	0.01
HKD CLP HOLDINGS HKD5	13 000.00	126 739.79	0.02
HKD ESR CAYMAN LIMITED USD0.001	10 600.00	32 958.35	0.01
HKD GALAXY ENTERTAINME HKD0.10	18 000.00	108 026.66	0.02
HKD HANG LUNG PROP HKD1	14 000.00	28 245.27	0.01
HKD HANG SENG BANK HKD5	6 100.00	117 772.05	0.02
HKD HENDERSON LAND DEV HKD2	11 000.00	45 790.02	0.01
HKD HK ELECTRIC INVEST UNITS (STAPLED)	8 500.00	8 303.11	0.00
HKD HKT TRUST AND HKT SHARE STAPLED UNIT	26 000.00	35 722.86	0.01
HKD HONG KONG EXCHANGE HKD1	9 532.00	452 050.05	0.08
USD HONGKONG LAND HLD ORD USD0.10(SINGAPORE REG)	11 100.00	54 390.00	0.01
HKD HONGKONG&CHINA GAS HKD0.25	77 175.00	93 519.77	0.02
USD JARDINE MATHESON COM USD0.25(BERMUDA REG)	1 600.00	88 000.00	0.02
USD MELCO RESORTS UNSP ARD EACH REP 3 ORD SHS	1 700.00	12 988.00	0.00
HKD MTR CORP HKD1	10 826.00	58 543.95	0.01
HKD NEW WORLD DEVEL CO NPV POST CON	13 500.00	54 903.98	0.01
HKD POWER ASSETS HOLDINGS LTD HKD1	9 000.00	58 667.67	0.01
HKD SINO LAND CO HKD1	20 881.00	27 089.79	0.00
HKD SITC INTERNATIONAL HKD0.10	11 000.00	38 977.71	0.01
HKD SUN HUNG KAI PROP NPV	9 500.00	113 542.92	0.02
HKD SWIRE PACIFIC 'A' HKD0.60	3 500.00	21 407.41	0.00
HKD SWIRE PROPERTIES LTD HKD1	6 200.00	15 406.19	0.00
HKD TECHTRONIC INDUSTR HKD0.1	10 500.00	170 141.99	0.03
HKD THE LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17 176.00	146 945.88	0.03
HKD WH GROUP LTD USD0.0001	70 577.00	44 609.67	0.01
HKD WHARF REAL ESTATE HKD0.1	12 000.00	59 529.59	0.01
HKD XINYI GLASS HLDGS HKD0.1	15 000.00	36 391.96	0.01
<b>香港合計</b>		<b>3 529 740.67</b>	<b>0.65</b>
<b>アイルランド</b>			
EUR CRH ORD EURO.32	5 676.00	229 564.84	0.04
GBP DCC ORD EURO.25	721.00	56 255.79	0.01
GBP EXPERIAN ORD USD0.10	7 325.00	284 608.05	0.05
EUR FLUTTER ENTERTAINM ORD EURO.09	889.00	103 860.31	0.02
GBP FLUTTER ENTERTAINM ORD EURO.09	350.00	40 921.48	0.01
AUD JAMES HARDIE ID PLC CUFS EURO.5	3 637.00	110 886.93	0.02
EUR KERRY GROUP 'A' ORD EURO.125(DUBLIN LIST)	1 176.00	132 286.96	0.03
EUR KINGSPAN GROUP ORD EURO.13(DUBLIN LISTING)	1 045.00	103 528.52	0.02
EUR SMURFIT KAPPA GRP ORD EURO.001	1 539.00	69 265.30	0.01
<b>アイルランド合計</b>		<b>1 131 178.18</b>	<b>0.21</b>
<b>マン島</b>			
GBP ENTAIN PLC ORD EURO.01	4 219.00	91 295.55	0.02
<b>マン島合計</b>		<b>91 295.55</b>	<b>0.02</b>
<b>イスラエル</b>			
ILS AZRIELI GROUP ILS0.01	406.00	35 851.41	0.01
ILS BANK HAPOLIM B.M. ILS1	8 696.00	86 517.20	0.02
ILS BK LEUMI LE ISRAEL ILS1	12 371.00	133 895.60	0.03
USD CHECK POINT SFTWRE ORD ILS0.01	912.00	126 093.12	0.02

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD CYBER-ARK SOFTWARE COM ILS0.01	300.00	50 625.00	0.01
USD FIVERR INTERNATION COM NPV	204.00	15 518.28	0.00
ILS ICL GROUP LTD ILS1	6 332.00	75 855.03	0.01
USD INMODE LTD COM ILS0.01	351.00	12 955.41	0.00
ILS ISRACARD LTD NPV	0.92	4.56	0.00
ILS ISRAEL DISCOUNT BK ILS0.10 SER ' A '	7 629.00	47 716.36	0.01
USD KORNIT DIGITAL LTD ORD ILS0.01	307.00	25 385.83	0.00
ILS MIZRAHI TEFAHOT BK ILS0.01	842.00	33 033.58	0.01
ILS NICE SYSTEMS ILS1	515.00	113 110.38	0.02
USD TEVA PHARMA IND ADR(CNV 1 ORD ILS0.10)	8 000.00	75 120.00	0.01
USD WIX.COM LTD COM ILS0.01	400.00	41 784.00	0.01
イスラエル合計		873 465.76	0.16

## イタリア

EUR AMPLIFON EURO.02	1 019.00	45 963.86	0.01
EUR ASSIC GENERALI SPA EUR1	8 547.00	197 518.95	0.04
EUR ATLANTIA SPA EUR1	3 967.00	83 422.38	0.01
EUR DAVIDE CAMPARI MIL EURO.01	4 181.00	49 101.76	0.01
EUR DIASORIN SPA EUR1	176.00	27 787.77	0.00
EUR ENEL EUR1	62 607.00	422 694.93	0.08
EUR ENI SPA EUR1	19 616.00	290 151.41	0.05
EUR FERRARI NV EURO.01(NEW)	990.00	218 872.72	0.04
EUR FINECOBANK SPA EURO.33	5 221.00	80 311.44	0.01
EUR INFRASTRUTTURE WIR NPV	2 587.00	29 259.20	0.01
EUR INTESA SANPAOLO NPV	130 230.00	301 900.01	0.06
EUR MEDIABANCA SPA EURO.5	4 710.00	48 318.16	0.01
EUR MONCLER SPA NPV	1 641.00	92 644.07	0.02
EUR NEXI SPA NPV	3 555.00	41 532.44	0.01
EUR POSTE ITALIANE SPA NPV	4 388.00	50 385.42	0.01
EUR PRYSMIAN SPA EURO.10	1 755.00	60 455.62	0.01
EUR RECORDATI EURO.125	757.00	38 441.48	0.01
EUR SNAM EUR1	16 167.00	94 114.32	0.02
EUR TELECOM ITALIA SPA EURO.55	64 800.00	24 045.26	0.00
EUR TERNA SPA ORD EURO.22	10 478.00	90 771.89	0.02
EUR UNICREDIT SPA NPV (POST REV SPLIT)	16 914.00	185 464.81	0.03
イタリア合計		2 473 157.90	0.46

## 日本

JPY アドバンテスト	1 400.00	111 538.62	0.02
JPY イオン	5 300.00	113 947.27	0.02
JPY A G C	1 600.00	64 659.11	0.01
JPY アイシン	1 400.00	48 387.23	0.01
JPY 味の素	3 800.00	108 795.06	0.02
JPY A N Aホールディングス	1 200.00	25 369.31	0.00
JPY アサヒグループホールディングス	3 700.00	135 989.29	0.02
JPY 朝日インテック	1 400.00	27 752.01	0.01
JPY 旭化成	9 300.00	81 410.92	0.02
JPY アステラス製薬	14 900.00	234 594.44	0.04
JPY アズビル	1 100.00	37 066.94	0.01
JPY バンダイナムコホールディングス	1 500.00	114 834.19	0.02
JPY ベネフィット・ワン	300.00	6 401.65	0.00
JPY プリヂストーン	4 600.00	180 323.79	0.03
JPY ブラザー工業	1 700.00	31 331.82	0.01
JPY キヤノン	8 000.00	197 272.92	0.04
JPY カブコン	1 800.00	44 015.65	0.01
JPY 東海旅客鉄道	1 100.00	144 687.95	0.03
JPY 千葉銀行	3 300.00	19 711.64	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 ( % )
JPY 中部電力	4 400.00	45 785.38	0.01
JPY 中外製薬	5 200.00	175 525.44	0.03
JPY コンコルディア・フィナンシャルグループ	5 700.00	21 508.55	0.00
JPY コスモス薬品	100.00	12 218.33	0.00
JPY サイバーエージェント	3 600.00	45 261.38	0.01
JPY 大日本印刷	1 700.00	40 309.78	0.01
JPY ダイフク	800.00	57 936.15	0.01
JPY 第一生命ホールディングス	8 100.00	166 771.58	0.03
JPY 第一三共	13 900.00	306 916.58	0.06
JPY ダイキン工業	2 000.00	369 268.80	0.07
JPY 大東建託	500.00	53 511.84	0.01
JPY 大和ハウス工業	4 600.00	121 314.93	0.02
JPY 大和ハウスリート投資法人	18.00	48 642.64	0.01
JPY 大和証券グループ本社	9 900.00	56 500.35	0.01
JPY デンソー	3 500.00	226 652.94	0.04
JPY 電通グループ	1 400.00	57 903.19	0.01
JPY ディスコ	200.00	56 683.83	0.01
JPY 東日本旅客鉄道	2 400.00	140 589.08	0.03
JPY エーザイ	2 000.00	93 429.45	0.02
JPY E N E O S ホールディングス	24 400.00	92 071.68	0.02
JPY ファナック	1 500.00	267 497.43	0.05
JPY ファーストリテイリング	500.00	259 485.07	0.05
JPY 富士電機	1 000.00	50 751.80	0.01
JPY 富士フイルムホールディングス	2 900.00	179 244.49	0.03
JPY 富士通	1 600.00	242 751.80	0.04
JPY G L P 投資法人	38.00	58 044.90	0.01
JPY G M O ペイメントゲートウェイ	400.00	41 458.29	0.01
JPY 博報堂 D Y ホールディングス	1 800.00	22 912.46	0.00
JPY 浜松ホトニクス	900.00	48 568.49	0.01
JPY 阪急阪神ホールディングス	1 600.00	46 731.21	0.01
JPY 光通信	200.00	23 019.57	0.00
JPY 日野自動車	1 600.00	9 491.25	0.00
JPY ヒロセ電機	200.00	29 429.45	0.01
JPY 日立建機	800.00	21 058.70	0.00
JPY 日立金属	2 100.00	35 312.87	0.01
JPY 日立製作所	7 700.00	391 106.08	0.07
JPY 本田技研工業	13 000.00	373 478.89	0.07
JPY ホシザキ	400.00	27 715.76	0.01
JPY H O Y A	2 900.00	335 217.30	0.06
JPY ヒューリック	1 900.00	17 235.02	0.00
JPY イビデン	700.00	34 891.86	0.01
JPY 出光興産	1 800.00	50 051.49	0.01
JPY 飯田グループホールディングス	1 500.00	26 138.00	0.00
JPY I N P E X	8 000.00	94 912.46	0.02
JPY いすゞ自動車	4 400.00	57 567.04	0.01
JPY 伊藤園	500.00	24 757.98	0.00
JPY 伊藤忠商事	9 400.00	320 935.94	0.06
JPY 伊藤忠テクノソリューションズ	700.00	18 109.17	0.00
JPY 日本航空	1 300.00	24 527.29	0.00
JPY 日本取引所グループ	3 900.00	73 453.35	0.01
JPY 日本都市ファンド投資法人	50.00	42 430.48	0.01
JPY ゆうちょ銀行	3 500.00	28 403.71	0.01
JPY 日本郵政	17 200.00	127 311.89	0.02
JPY かんぽ生命保険	1 400.00	24 637.69	0.00
JPY ジャパンリアルエステイト投資法人	11.00	57 911.43	0.01
JPY 日本たばこ産業	9 000.00	154 788.88	0.03
JPY ジェイ エフ イー ホールディングス	3 900.00	55 363.13	0.01
JPY J S R	1 500.00	44 860.97	0.01

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
JPY 鹿島建設	4 100.00	50 365.40	0.01
JPY カカクコム	900.00	20 443.25	0.00
JPY 関西電力	5 800.00	54 905.87	0.01
JPY 関西ペイント	1 200.00	19 506.49	0.00
JPY 花王	3 600.00	149 042.23	0.03
JPY K D D I	12 700.00	419 060.77	0.08
JPY 京王電鉄	700.00	27 596.29	0.01
JPY 京成電鉄	1 000.00	28 135.94	0.01
JPY キーエンス	1 500.00	707 518.03	0.13
JPY キッコーマン	1 000.00	66 982.49	0.01
JPY 近鉄グループホールディングス	1 200.00	34 652.94	0.01
JPY キリンホールディングス	6 700.00	100 962.31	0.02
JPY 小林製薬	400.00	32 362.51	0.01
JPY 神戸物産	800.00	24 881.57	0.00
JPY コーエーテックモホールディングス	520.00	17 201.24	0.00
JPY 小糸製作所	700.00	28 692.07	0.01
JPY コマツ	7 100.00	172 154.89	0.03
JPY コナミホールディングス	700.00	44 696.19	0.01
JPY コーセー	300.00	31 859.94	0.01
JPY クボタ	7 700.00	146 101.75	0.03
JPY 栗田工業	700.00	26 212.15	0.00
JPY 京セラ	2 600.00	147 420.80	0.03
JPY 協和キリン	2 100.00	49 275.39	0.01
JPY レーザーテック	600.00	102 747.68	0.02
JPY ローソン	400.00	15 406.80	0.00
JPY ライオン	1 600.00	17 954.27	0.00
JPY L I X I L	2 300.00	43 394.44	0.01
JPY エムスリー	3 500.00	128 869.21	0.02
JPY マキタ	1 700.00	55 114.32	0.01
JPY 丸紅	13 500.00	158 607.62	0.03
JPY マツダ	5 000.00	37 445.93	0.01
JPY 日本マクドナルドホールディングス	700.00	29 239.96	0.01
JPY メディカルホールディングス	1 300.00	21 581.87	0.00
JPY 明治ホールディングス	900.00	49 013.39	0.01
JPY メルカリ	600.00	15 942.33	0.00
JPY ミネベアミツミ	3 000.00	66 587.02	0.01
JPY ミスミグループ本社	2 200.00	66 430.48	0.01
JPY 三菱ケミカルホールディングス	10 600.00	71 359.51	0.01
JPY 三菱商事	10 000.00	379 073.12	0.07
JPY 三菱電機	14 700.00	170 768.28	0.03
JPY 三菱地所	9 600.00	143 871.47	0.03
JPY 三菱瓦斯化学	1 100.00	18 859.73	0.00
JPY 三菱H C キャピタル	4 600.00	21 602.47	0.00
JPY 三菱重工業	2 400.00	79 489.19	0.01
JPY 三菱U F J フィナンシャル・グループ	93 200.00	583 810.18	0.11
JPY 三井物産	12 100.00	331 771.78	0.06
JPY 三井化学	1 400.00	35 641.61	0.01
JPY 三井不動産	7 400.00	159 736.36	0.03
JPY 商船三井	2 400.00	67 625.13	0.01
JPY 三浦工業	900.00	22 504.63	0.00
JPY みずほフィナンシャルグループ	18 009.00	232 503.42	0.04
JPY M o n o t a R O	2 300.00	49 913.08	0.01
JPY M S & A D インシュアランスグループホールディングス	3 600.00	117 988.05	0.02
JPY 村田製作所	4 600.00	307 626.78	0.06
JPY 日本電気	1 800.00	76 374.87	0.01
JPY ネクソン	3 500.00	84 547.89	0.02
JPY 日本碍子	2 100.00	30 329.97	0.01
JPY 日本電産	3 500.00	281 095.78	0.05

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 ( 損 ) 益 ( 注 1 )	純資産 比率 ( % )
JPY 日本M & A センター	2 700.00	38 417.30	0.01
JPY 任天堂	900.00	457 285.28	0.08
JPY 日本ビルファンド投資法人	12.00	68 416.07	0.01
JPY N I P P O N E X P R E S S ホールディングス	500.00	34 685.89	0.01
JPY 日本ペイントホールディングス	5 500.00	49 029.87	0.01
JPY 日本プロロジスリート投資法人	18.00	52 869.21	0.01
JPY 日本酸素ホールディングス	900.00	17 284.45	0.00
JPY 日本新薬	500.00	34 315.14	0.01
JPY 日本製鉄	6 800.00	121 629.66	0.02
JPY 日本電信電話	9 300.00	271 625.13	0.05
JPY 日本郵船	1 300.00	115 246.14	0.02
JPY 日産化学	900.00	53 610.71	0.01
JPY 日産自動車	17 400.00	78 531.16	0.01
JPY 日清製粉グループ本社	1 600.00	22 488.98	0.00
JPY 日清食品ホールディングス	600.00	42 364.57	0.01
JPY ニトリホールディングス	600.00	75 929.97	0.01
JPY 日東電工	1 200.00	87 200.82	0.02
JPY 野村ホールディングス	24 900.00	105 692.94	0.02
JPY 野村不動産マスターファンド投資法人	40.00	53 124.61	0.01
JPY 野村不動産ホールディングス	700.00	16 915.35	0.00
JPY 野村総合研究所	2 400.00	79 489.19	0.01
JPY エヌ・ティ・ティ・データ	5 300.00	105 585.17	0.02
JPY 大林組	5 700.00	42 265.71	0.01
JPY オービック	600.00	91 056.64	0.02
JPY 小田急電鉄	2 000.00	33 565.40	0.01
JPY 王子ホールディングス	6 300.00	31 506.49	0.01
JPY オリンパス	8 600.00	165 729.35	0.03
JPY オムロン	1 500.00	101 511.84	0.02
JPY 小野薬品工業	2 900.00	73 255.61	0.01
JPY オープンハウス	500.00	22 327.50	0.00
JPY 日本オラクル	300.00	21 009.27	0.00
JPY オリエンタルランド	1 600.00	309 915.55	0.06
JPY オリックス	10 000.00	201 647.79	0.04
JPY オリックス不動産投資法人	27.00	36 771.16	0.01
JPY 大阪瓦斯	3 100.00	53 431.10	0.01
JPY 大塚商会	900.00	32 218.33	0.01
JPY 大塚ホールディングス	3 200.00	111 574.87	0.02
JPY パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	3 100.00	50 161.90	0.01
JPY パナソニック	17 700.00	173 317.82	0.03
JPY パーソルホールディングス	1 300.00	29 604.12	0.01
JPY ポーラ・オルビスホールディングス	600.00	7 904.43	0.00
JPY 楽天グループ	5 800.00	46 208.86	0.01
JPY リクルートホールディングス	10 700.00	477 279.51	0.09
JPY ルネサスエレクトロニクス	10 000.00	117 981.46	0.02
JPY リソナホールディングス	18 900.00	81 610.63	0.02
JPY リコー	5 800.00	50 748.51	0.01
JPY リンナイ	300.00	22 665.29	0.00
JPY ローム	600.00	47 406.80	0.01
JPY 良品計画	1 700.00	20 042.84	0.00
JPY 参天製薬	2 900.00	29 316.58	0.01
JPY SBIホールディングス	1 800.00	45 973.22	0.01
JPY S C S K	900.00	15 578.99	0.00
JPY セコム	1 700.00	124 206.80	0.02
JPY セイコーエプソン	2 100.00	31 852.52	0.01
JPY 積水化学工業	2 600.00	37 679.92	0.01
JPY 積水ハウス	5 200.00	101 579.40	0.02
JPY セブン&アイ・ホールディングス	6 000.00	287 357.37	0.05
JPY S G ホールディングス	2 600.00	49 525.85	0.01

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
JPY シャープ	1 400.00	13 253.14	0.00
JPY 島津製作所	1 500.00	52 337.80	0.01
JPY シマノ	600.00	139 180.23	0.03
JPY 清水建設	4 000.00	24 222.45	0.00
JPY 信越化学工業	2 800.00	433 466.53	0.08
JPY 塩野義製薬	2 200.00	136 486.10	0.03
JPY 資生堂	3 200.00	163 934.91	0.03
JPY 静岡銀行	2 500.00	17 775.49	0.00
JPY S M C	500.00	283 583.94	0.05
JPY ソフトバンク	22 800.00	268 246.35	0.05
JPY ソフトバンクグループ	9 500.00	435 101.96	0.08
JPY 総合警備保障	600.00	19 773.43	0.00
JPY S O M P Oホールディングス	2 400.00	106 400.82	0.02
JPY ソニーグループ	9 900.00	1 038 327.51	0.19
JPY スクウェア・エニックス・ホールディングス	600.00	26 842.43	0.00
JPY スタンレー電気	1 400.00	26 806.18	0.00
JPY S U B A R U	5 200.00	83 457.06	0.02
JPY S U M C O	2 500.00	41 750.77	0.01
JPY 住友化学	11 700.00	54 174.25	0.01
JPY 住友商事	9 200.00	160 616.27	0.03
JPY 大日本住友製薬	1 100.00	10 947.89	0.00
JPY 住友電気工業	5 200.00	62 635.63	0.01
JPY 住友金属鉱山	2 100.00	106 630.69	0.02
JPY 三井住友フィナンシャルグループ	10 000.00	321 894.96	0.06
JPY 三井住友トラスト・ホールディングス	2 300.00	75 817.10	0.01
JPY 住友不動産	2 400.00	67 012.15	0.01
JPY サントリー食品インターナショナル	1 300.00	49 911.43	0.01
JPY スズキ	2 600.00	90 247.58	0.02
JPY シスメックス	1 300.00	95 570.75	0.02
JPY T & Dホールディングス	4 000.00	55 069.00	0.01
JPY 大成建設	1 500.00	43 686.92	0.01
JPY 大正製薬ホールディングス	500.00	23 398.56	0.00
JPY 武田薬品工業	12 600.00	363 129.15	0.07
JPY T D K	3 100.00	113 911.43	0.02
JPY テルモ	5 200.00	159 545.21	0.03
JPY T I S	1 600.00	37 925.44	0.01
JPY 東武鉄道	1 700.00	41 724.41	0.01
JPY 東宝	800.00	30 549.95	0.01
JPY 東京海上ホールディングス	5 000.00	293 635.43	0.05
JPY 東京センチュリー	300.00	11 159.63	0.00
JPY 東京電力ホールディングス	11 400.00	37 851.29	0.01
JPY 東京エレクトロン	1 200.00	625 334.71	0.12
JPY 東京ガス	2 600.00	47 812.16	0.01
JPY 東急	3 800.00	49 842.22	0.01
JPY 凸版印刷	2 400.00	42 829.25	0.01
JPY 東レ	9 700.00	51 051.37	0.01
JPY 東芝	2 900.00	111 101.96	0.02
JPY 東ソー	2 100.00	31 385.38	0.01
JPY T O T O	1 000.00	40 700.31	0.01
JPY 東洋水産	800.00	28 803.30	0.01
JPY 豊田自動織機	1 100.00	76 762.10	0.01
JPY トヨタ自動車	82 900.00	1 517 983.53	0.28
JPY 豊田通商	1 700.00	70 871.27	0.01
JPY トレンドマイクロ	1 100.00	64 889.81	0.01
JPY ツルハホールディングス	300.00	19 180.23	0.00
JPY ユニ・チャーム	3 300.00	118 514.52	0.02
JPY ユー・エス・エス	1 700.00	28 838.72	0.01
JPY ウエルシアホールディングス	800.00	19 806.39	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 (%)
JPY 西日本旅客鉄道	1 700.00	71 305.46	0.01
JPY ヤクルト本社	900.00	48 346.04	0.01
JPY ヤマハ	1 100.00	48 486.10	0.01
JPY ヤマハ発動機	2 000.00	45 412.98	0.01
JPY ヤマトホールディングス	2 000.00	37 783.73	0.01
JPY 安川電機	1 700.00	67 439.75	0.01
JPY 横河電機	1 600.00	27 669.62	0.01
JPY Zホールディングス	21 600.00	95 458.21	0.02
JPY Z O Z O	1 129.00	30 556.25	0.01
日本合計		28 326 999.06	5.23
ルクセンブルグ			
EUR ARCELORMITTAL NPV(POST STOCK SPLIT)	5 024.00	163 785.64	0.03
EUR AROUNDTOWN SA EURO.01	8 947.00	51 705.65	0.01
EUR EUROFINS SCIENTIFI EURO.01	1 089.00	108 941.78	0.02
EUR TENARIS S.A. USD1	4 327.00	66 222.58	0.01
ルクセンブルグ合計		390 655.65	0.07
マカオ			
HKD SANDS CHINA LTD USD0.01 REG ' S '	25 600.00	62 043.57	0.01
マカオ合計		62 043.57	0.01
オランダ			
EUR ABN AMRO BANK N.V. DR EACH REP SHS	2 581.00	33 432.90	0.01
EUR ADYEN NV EURO.01	158.00	318 019.85	0.06
EUR AEGON NV EURO.12	15 070.00	80 518.19	0.01
USD AERCAP HOLDINGS EURO.01	877.00	44 095.56	0.01
EUR AKZO NOBEL NV EURO.50(POST REV SPLIT)	1 441.00	125 412.37	0.02
EUR ARGEN X NV EURO.10	372.00	116 928.39	0.02
EUR ASM INTL NV EURO.04	388.00	143 370.29	0.03
EUR ASML HOLDING NV EURO.09	3 256.00	2 209 900.92	0.41
EUR CNH INDUSTRIAL NV COM EURO.01	8 257.00	132 249.04	0.02
EUR EURONEXT EUR1.60	525.00	48 308.48	0.01
EUR EXOR NV EURO.01	768.00	59 388.81	0.01
EUR HEINEKEN HOLDING EUR1.6	890.00	70 407.38	0.01
EUR HEINEKEN NV EUR1.60	2 086.00	200 951.13	0.04
EUR IMCD NV EURO.16	380.00	65 640.79	0.01
EUR ING GROEP N.V. EURO.01	31 156.00	329 705.70	0.06
EUR JDE PEETS N.V. EURO.01	632.00	18 233.84	0.00
EUR JUST EAT TAKEAWAY EURO.04	1 411.00	48 283.79	0.01
EUR KON KPN NV EURO.04	25 019.00	87 492.92	0.02
EUR KONINKLIJKE AHOLD EURO.01	8 302.00	268 941.67	0.05
EUR KONINKLIJKE DSM NV EUR1.5	1 409.00	254 755.13	0.05
EUR KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20	7 333.00	226 250.80	0.04
EUR NN GROUP N.V. EURO.12	2 173.00	110 879.78	0.02
EUR PROSUS N.V. EURO.05	7 387.00	399 245.00	0.07
EUR QIAGEN NV EURO.01	1 775.00	87 944.69	0.02
EUR RANDSTAD N.V. EURO.10	834.00	50 703.19	0.01
GBP SHELL PLC ORD EURO.07	60 443.00	1 677 992.29	0.31
EUR STMICROELECTRONICS EUR1.04	5 373.00	236 679.65	0.04
EUR UNIVERSAL MUSIC GR EUR10.00	5 943.00	159 988.93	0.03
EUR WOLTERS KLUWER EURO.12	2 045.00	219 755.16	0.04
オランダ合計		7 825 476.64	1.44
ニュージーランド			
NZD AUCKLAND INTL NPV	6 737.00	36 690.76	0.01
NZD FISHER & PAYKEL HE NPV	4 691.00	79 449.79	0.01

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
NZD MERCURY NZ LTD NPV	7 189.00	29 751.84	0.00
NZD MERIDIAN ENERGY LT NPV	9 326.00	32 757.83	0.01
NZD RYMAN HEALTHCARE G NPV	3 669.00	23 937.51	0.00
NZD SPARK NEW ZEALAND NPV	16 397.00	52 234.59	0.01
AUD XERO LIMITED NPV	1 105.00	85 261.92	0.02
ニュージーランド合計		340 084.24	0.06
ノルウェー			
NOK ADEVINTA ASA SER ' B ' NOK0.2	2 421.00	22 388.16	0.01
NOK AKER BP ASA NOK1	459.00	17 354.23	0.00
NOK DNB BANK ASA NOK12.50	7 484.00	171 265.83	0.03
NOK EQUINOR ASA NOK2.50	7 732.00	292 868.07	0.05
NOK GJENSIDIGE FORSIKR NOK2	1 450.00	36 266.58	0.01
NOK MOWI ASA NOK7.50	3 753.00	102 151.65	0.02
NOK NORSK HYDRO ASA NOK3.6666	9 618.00	94 706.06	0.02
NOK ORKLA ASA NOK1.25	5 876.00	52 658.21	0.01
NOK SCHIBSTED ASA SER ' A ' NOK0.50	639.00	15 938.46	0.00
NOK SCHIBSTED ASA SER ' B ' NOK0.5	612.00	13 186.28	0.00
NOK TELENOR ASA ORD NOK6	5 918.00	85 785.28	0.02
NOK YARA INTERNATIONAL NOK1.7	1 220.00	61 669.72	0.01
ノルウェー合計		966 238.53	0.18
ポルトガル			
EUR EDP ENERGIAS PORTU EUR1(REGD)	24 208.00	120 264.91	0.02
EUR GALP ENERGIA EUR1-B	4 023.00	51 543.34	0.01
EUR JERONIMO MARTINS EUR5	1 886.00	45 599.49	0.01
ポルトガル合計		217 407.74	0.04
ポーランド			
EUR INPOST S.A. EURO.01	1 434.00	9 190.31	0.00
ポーランド合計		9 190.31	0.00
シンガポール			
SGD CAPITALAND INVESTM NPV	26 141.00	77 069.93	0.01
SGD CITY DEVELOPMENTS SGD0.50	2 900.00	16 864.08	0.00
SGD DBS GROUP HLDGS SGD1	14 907.00	394 663.47	0.07
SGD GENTING SINGAPORE LTD	34 800.00	20 956.88	0.00
USD GRAB HLDGS LTD COM USD0.000001 CL A	7 100.00	24 850.00	0.01
SGD KEPPEL CORP NPV	9 900.00	46 963.46	0.01
SGD MAPLETREE LOGISTICS TRUST-UNITS REIT	13 631.00	18 633.28	0.00
SGD OVERSEA-CHINESE BK NPV	28 249.00	258 412.55	0.05
USD SEA LTD ADS EACH REP ONE CL A SHS	2 500.00	299 475.00	0.06
SGD SINGAPORE AIRLINES NPV	11 950.00	48 564.67	0.01
SGD SINGAPORE EXCHANGE SGD0.01	6 400.00	47 148.19	0.01
SGD SINGAPORE TECH ENG NPV	13 000.00	39 575.87	0.01
SGD SINGAPORE TELECOMM NPV	60 000.00	117 042.89	0.02
SGD UOL GROUP LIMITED SGD1	3 800.00	19 767.24	0.00
SGD UTD O/S BANK SGD1	9 400.00	222 402.19	0.04
SGD VENTURE CORP LTD SGD0.25	2 200.00	28 561.72	0.01
SGD WILMAR INTERNATIONAL LTD	13 500.00	46 983.41	0.01
シンガポール合計		1 727 934.83	0.32
スペイン			
EUR ACS ACTIVIDADES CO EURO.5	2 092.00	57 027.76	0.01
EUR AENA SME S.A. EUR10	591.00	99 326.88	0.02
EUR AMADEUS IT GROUP EURO.01	3 430.00	225 853.93	0.04
EUR BANCO SANTANDER SA EURO.50(REGD)	135 743.00	468 206.79	0.09

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR BBVA(BILB-VIZ-ARG) EURO.49	52 273.00	303 021.69	0.06
EUR CAIXABANK SA EUR1	32 819.00	112 359.91	0.02
EUR CELLNEX TELECOM SA EURO.25	3 936.00	191 423.15	0.03
EUR EDP RENOVAVEIS SA EUR5	2 261.00	58 716.48	0.01
EUR ENAGAS SA EUR1.50	1 456.00	32 643.37	0.01
EUR ENDESA SA EUR1.2	2 093.00	46 051.56	0.01
EUR FERROVIAL SA EURO.2	3 301.00	88 626.06	0.02
EUR GRIFOLS SA EURO.25 (CLASS A) POST SUBD	2 276.00	41 733.81	0.01
EUR IBERDROLA SA EURO.75 (POST SUBDIVISION)	46 795.00	516 499.25	0.09
EUR INDITEX EURO.03 (POST SUBD)	8 562.00	188 434.35	0.03
EUR NATURGY ENERGY GRO EUR1	974.00	29 433.87	0.00
EUR RED ELECTRICA CORP EURO.5	2 906.00	60 172.85	0.01
EUR REPSOL SA EUR1	11 772.00	156 181.94	0.03
EUR SIEMENS GAMESA REN EURO.17	2 326.00	41 343.68	0.01
EUR TELEFONICA SA EUR1	42 342.00	206 750.25	0.04
スペイン合計		2 923 807.58	0.54

## スウェーデン

SEK ALFA LAVAL AB NPV	2 579.00	90 021.75	0.02
SEK ASSA ABLOY SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	7 958.00	217 663.60	0.04
SEK ATLAS COPCO AB SER ' A ' NPV (POST SPLIT)	5 272.00	278 155.50	0.05
SEK ATLAS COPCO AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	3 092.00	142 499.95	0.03
SEK BOLIDEN AB NPV (POST SPLIT)	2 264.00	116 146.79	0.02
SEK ELECTROLUX AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	2 010.00	30 863.68	0.01
SEK EMBRACER GROUP AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	3 500.00	29 812.01	0.00
SEK EPIROC AB SER ' A ' NPV (POST SPLIT)	5 444.00	118 116.70	0.02
SEK EPIROC AB SER ' B ' NPV	3 042.00	55 670.23	0.01
SEK EQT AB NPV	2 325.00	92 831.35	0.02
SEK ERICSSON SER ' B ' NPV	23 070.00	213 634.03	0.04
SEK ESSITY AB SER ' B ' NPV	4 995.00	119 094.47	0.02
SEK EVOLUTION AB NPV	1 341.00	139 303.18	0.03
SEK FASTIGHETS AB BALD SER ' B ' NPV	850.00	56 676.40	0.01
SEK GETINGE AB SER ' B ' NPV	1 435.00	58 050.41	0.01
SEK HENNES & MAURITZ SER ' B ' NPV	5 870.00	79 476.85	0.01
SEK HEXAGON AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	15 851.00	225 789.24	0.04
SEK HUSQVARNA AB SER ' B ' NPV	2 846.00	30 129.23	0.00
SEK INDUSTRIVARDEN AB SER ' A ' NPV	1 235.00	35 621.18	0.01
SEK INDUSTRIVARDEN AB SER ' C ' NPV	1 252.00	35 453.23	0.01
SEK INVESTOR AB SER ' A ' NPV (POST SPLIT)	3 301.00	78 067.30	0.01
SEK INVESTOR AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	14 314.00	316 633.16	0.06
SEK KINNEVIK AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	2 046.00	54 336.65	0.01
SEK LATOUR INVESTMENT SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	1 466.00	47 349.19	0.01
SEK LIFCO AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	1 388.00	35 878.83	0.01
SEK LUNDBERGFÖRETAGEN SER ' B ' NPV	770.00	39 708.78	0.01
SEK LUNDIN ENERGY AB NPV	1 579.00	67 654.00	0.01
SEK NIBE INDUSTRIER AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	11 165.00	125 853.94	0.02
SEK SAGAX AB NPV B	900.00	27 716.38	0.00
SEK SANDVIK AB NPV (POST SPLIT)	9 002.00	194 154.34	0.04
SEK SECURITAS SER ' B ' NPV	2 671.00	30 509.25	0.01
SEK SINCH AB NPV (POST SPLIT)	3 775.00	26 110.75	0.00
SEK SKAND ENSKILDA BKN SER ' A ' NPV	12 744.00	140 097.30	0.03
SEK SKANSKA AB SER ' B ' NPV	2 412.00	54 713.48	0.01
SEK SKF AB SER ' B ' NPV	3 008.00	49 690.07	0.01
SEK SVENSKA CELLULOZA SER ' B ' NPV	4 801.00	94 506.45	0.02
SEK SVENSKA HANDELSBKN SER ' A ' NPV (P/S)	11 109.00	103 587.37	0.02
SEK SWEDBANK AB SER ' A ' NPV	6 666.00	100 854.78	0.02
SEK SWEDISH MATCH NPV (POST SPLIT)	12 817.00	97 481.49	0.02

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
SEK TELE2 AB SHS	3 806.00	58 114.66	0.01
SEK TELIA COMPANY AB NPV	20 374.00	82 506.90	0.01
SEK VOLVO AB SER 'A' NPV (POST SPLIT)	1 566.00	30 414.62	0.00
SEK VOLVO AB SER 'B' NPV (POST SPLIT)	11 425.00	216 500.53	0.04
スウェーデン合計		4 237 450.00	0.78
スイス			
CHF ABB LTD CHF0.12 (REGD)	12 788.00	419 249.08	0.08
CHF ADECCO GROUP AG CHF0.1 (REGD)	1 307.00	59 665.38	0.01
CHF ALCON AG CHF0.04	3 989.00	319 466.78	0.06
CHF BACHEM HOLDING AG CHF0.05(REGD)CLS 'B'	41.00	22 766.64	0.00
CHF BALOISE-HLDGS CHF0.1(REGD)	364.00	65 304.43	0.01
CHF BARRY CALLEBAUT AG CHF0.02 (REGD)	26.00	61 309.43	0.01
CHF CLARIANT CHF4.00(REGD)	2 126.00	37 171.79	0.01
GBP COCA-COLA HBC AG ORD CHF6.70	1 678.00	35 338.37	0.01
CHF CREDIT SUISSE GRP CHF0.04(REGD)	20 258.00	161 579.70	0.03
CHF EMS-CHEMIE HLDG AG CHF0.01(REGD)(POST RECON)	68.00	66 614.51	0.01
CHF GEBERIT CHF0.10(REGD)	281.00	174 722.30	0.03
CHF GIVAUDAN AG CHF10	73.00	303 581.64	0.06
GBP GLENORE XSTRATA ORD USD0.01	78 836.00	518 997.10	0.10
CHF HOLCIM LTD CHF2 (REGD)	3 988.00	196 268.97	0.04
CHF JULIUS BAER GRUPPE CHF0.02 (REGD)	1 720.00	100 704.81	0.02
CHF KUEHNE&NAGEL INTL CHF1(REGD)(POST-SUBD)	410.00	117 219.23	0.02
CHF LINDT & SPRUENGLI CHF100(REGD)	1.00	121 488.73	0.02
CHF LINDT & SPRUENGLI PTG CERT CHF10	7.00	83 825.05	0.02
CHF LOGITECH INTL CHF0.25(REGD) (POST-SUBD)	1 385.00	104 147.79	0.02
CHF LONZA GROUP AG CHF1(REGD)	591.00	431 698.13	0.08
CHF NESTLE SA CHF0.10(REGD)	22 056.00	2 880 881.50	0.53
CHF NOVARTIS AG CHF0.50(REGD)	17 076.00	1 507 660.96	0.28
CHF PARTNERS GROUP HLG CHF0.01 (REGD)	181.00	226 876.94	0.04
CHF RICHEMONT(CIE FIN) CHF1.00 (REG) SER 'A'	4 140.00	530 855.75	0.10
CHF ROCHE HLDGS AG CHF1(BR)	233.00	102 542.79	0.02
CHF ROCHE HLDGS AG GENUSSCHEINE NPV	5 549.00	2 209 650.69	0.41
CHF SCHINDLER-HLDG AG CHF0.1(REGD)(POST-SUBD)	154.00	33 117.74	0.01
CHF SCHINDLER-HLDG AG PTG CERT CHF0.10(POST-SUBD)	326.00	70 496.06	0.01
CHF SGS LTD CHF1(REGD)	45.00	125 965.77	0.02
CHF SIKA AG CHF0.01 (REG)	1 125.00	375 794.62	0.07
CHF SONOVA HOLDING AG CHF0.05 (REGD)	439.00	184 902.36	0.03
CHF STRAUMANN HLDG CHF0.1(REGD)	83.00	134 071.72	0.03
CHF SWATCH GROUP CHF0.45(REGD)	314.00	17 197.07	0.00
CHF SWATCH GROUP CHF2.25(BR)	246.00	70 491.93	0.01
CHF SWISS LIFE HLDG CHF5.1(REGD)	263.00	169 817.55	0.03
CHF SWISS PRIME SITE CHF15.3 (REGD)	555.00	55 032.60	0.01
CHF SWISS RE AG CHF0.10	2 255.00	215 931.11	0.04
CHF SWISSCOM AG CHF1(REGD)	206.00	124 237.98	0.02
CHF TEMENOS AG CHF5 (REGD)	513.00	49 613.69	0.01
CHF UBS GROUP CHF0.10 (REGD)	27 834.00	548 816.01	0.10
CHF VAT GROUP AG CHF0.10	181.00	69 705.41	0.01
CHF VIFOR PHARMA AG CHF0.01(ASD CSL BEHRING CSH)	339.00	60 690.30	0.01
CHF ZURICH INSURANCE GRP CHF0.10	1 180.00	585 736.48	0.11
スイス合計		13 751 206.89	2.54
アラブ首長国連邦			
GBP NMC HEALTH PLC ORD GBPO.1	590.00	0.01	0.00
アラブ首長国連邦合計		0.01	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 (%)
イギリス			
GBP 3I GROUP ORD GBP0.738636	7 128.00	130 311.85	0.02
GBP ABRDN PLC ORD GBP0.1396825396	20 365.00	57 622.38	0.01
GBP ADMIRAL GROUP ORD GBP0.001	1 405.00	47 412.76	0.01
GBP ANGLO AMERICAN USD0.54945	10 302.00	538 835.00	0.10
GBP ANTOFAGASTA ORD GBP0.05	2 911.00	64 122.21	0.01
GBP ASSTEAD GROUP ORD GBP0.10	3 561.00	226 599.59	0.04
GBP ASSOCD BRIT FOODS ORD GBP0.0568	2 618.00	57 288.97	0.01
GBP ASTRAZENCA ORD USD0.25	12 203.00	1 627 916.54	0.30
GBP AUTO TRADER GROUP ORD GBP0.01	7 421.00	61 830.00	0.01
GBP AVEVA GROUP ORD GBP0.03556	1 067.00	34 419.21	0.01
GBP AVIVA ORD GBP0.25	28 954.00	172 350.84	0.03
GBP BAE SYSTEMS ORD GBP0.025	25 420.00	240 108.35	0.04
GBP BARCLAYS ORD GBP0.25	135 751.00	265 066.31	0.05
GBP BARRATT DEVEL ORD GBP0.10	8 950.00	61 559.71	0.01
GBP BP ORD USD0.25	153 508.00	758 643.57	0.14
GBP BRIT AMER TOBACCO ORD GBP0.25	17 173.00	722 302.99	0.13
GBP BRITISH LAND CO PLC REIT	6 018.00	42 026.77	0.01
GBP BT GROUP ORD GBP0.05	70 631.00	169 439.27	0.03
GBP BUNZL ORD GBP0.32142857	2 882.00	112 623.29	0.02
GBP BURBERRY GROUP ORD GBP0.0005	2 693.00	59 355.66	0.01
USD COCA-COLA EUROPACI COM EURO.01	1 737.00	84 435.57	0.02
GBP COMPASS GROUP ORD GBP0.1105	14 179.00	308 034.88	0.06
GBP CRODA INTL ORD GBP0.10609756	1 109.00	115 060.99	0.02
GBP DIAGEO ORD GBP0.28 101/108	18 125.00	921 996.51	0.17
GBP FERGUSON PLC (NEW) ORD GBP0.10	1 756.00	239 989.48	0.04
GBP GLAXOSMITHKLINE ORD GBP0.25	39 147.00	849 014.60	0.16
GBP HALMA ORD GBP0.10	2 831.00	93 558.65	0.02
GBP HARGREAVES LANSLOW ORD GBP0.004 (WI)	2 163.00	28 706.97	0.01
GBP HIKMA PHARMACEUTIC ORD GBP0.10	784.00	21 274.75	0.00
GBP HSBC HLDGS ORD USD0.50(UK REG)	158 795.00	1 098 492.85	0.20
GBP IMPERIAL BRANDS PL GBP0.10	7 046.00	149 407.95	0.03
GBP INFORMA PLC (GB) ORD GBP0.001	12 395.00	98 213.02	0.02
GBP INTERCONTL HOTELS ORD GBP0.208521303	1 287.00	87 946.03	0.02
GBP INTERTEK GROUP ORD GBP0.01	1 179.00	81 093.74	0.02
GBP JD SPORTS FASHION ORD GBP0.0005	19 760.00	38 570.21	0.01
GBP JOHNSON MATTHEY ORD GBP1.109245	1 459.00	36 085.85	0.01
GBP KINGFISHER ORD GBP0.157142857	17 516.00	58 901.47	0.01
GBP LAND SECURITIES GP ORD GBP0.106666666	5 621.00	58 141.39	0.01
GBP LEGAL & GENERAL GP ORD GBP0.025	48 184.00	172 560.78	0.03
GBP LLOYDS BANKING GP ORD GBP0.1	563 918.00	349 375.20	0.06
GBP LONDON STOCK EXCH ORD GBP0.06918604	2 600.00	272 699.28	0.05
GBP M&G PLC ORD GBP0.05	19 623.00	57 150.62	0.01
GBP MELROSE INDUST PLC ORD GBP0.076190476	36 676.00	60 289.39	0.01
GBP MONDI ORD EURO.20	4 053.00	79 592.15	0.01
GBP NATIONAL GRID ORD GBP0.12431289	28 272.00	436 418.03	0.08
GBP NATWEST GROUP PLC ORD GBP1	46 264.00	131 512.24	0.02
GBP NEXT ORD GBP0.10	1 113.00	88 394.83	0.02
GBP OCADO GROUP PLC ORD GBP0.02	4 020.00	61 980.25	0.01
GBP PEARSON ORD GBP0.25	6 402.00	63 269.52	0.01
GBP PERSIMMON ORD GBP0.10	2 716.00	76 920.22	0.01
GBP PHOENIX GP HLDGS ORD GBP0.10	5 384.00	43 525.50	0.01
GBP PRUDENTIAL ORD GBP0.05	20 642.00	308 201.80	0.06
GBP RECKITT BENCK GRP ORD GBP0.10	5 617.00	431 312.74	0.08
GBP RELX PLC GBP0.1444	15 262.00	478 856.99	0.09
GBP RENTOKIL INITIAL ORD GBP0.01	13 668.00	94 658.81	0.02
GBP RIO TINTO ORD GBP0.10	8 846.00	708 259.29	0.13
GBP ROLLS-ROYCE HLDGS ORD GBP0.20	69 175.00	92 081.14	0.02

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
GBP SAGE GROUP GBPO.01051948	9 130.00	84 291.35	0.02
GBP SAINSBURY(J) ORD GBPO.28571428	12 928.00	43 013.72	0.01
GBP SCHRODERS VTG SHS GBP1	1 067.00	45 391.21	0.01
GBP SEVERN TRENT ORD GBPO.9789	1 801.00	72 988.20	0.01
GBP SMITH & NEPHEW ORD USD0.20	7 126.00	114 465.86	0.02
GBP SMITHS GROUP ORD GBPO.375	2 798.00	53 509.91	0.01
GBP SPIRAX-SARCO ENG ORD GBPO.269230769	600.00	99 025.25	0.02
GBP SSE PLC ORD GBPO.50	8 058.00	185 508.26	0.03
GBP ST JAMES ' S PLACE ORD GBPO.15	4 287.00	81 760.28	0.02
GBP STANDARD CHARTERED ORD USD0.50	21 747.00	146 086.52	0.03
EUR STELLANTIS N V COM EURO.01	16 035.00	264 051.87	0.05
GBP TAYLOR WIMPEY ORD GBPO.01	24 704.00	42 512.17	0.01
GBP TESCO ORD GBPO.0633333	60 072.00	218 298.88	0.04
GBP UNILEVER PLC ORD GBPO.031111	9 507.00	432 475.88	0.08
EUR UNILEVER PLC ORD GBPO.031111	10 468.00	476 895.43	0.09
GBP UNITED UTILITIES G ORD GBPO.05	5 023.00	74 369.18	0.01
GBP VODAFONE GROUP ORD USD0.2095238(POST CONS)	208 934.00	343 426.05	0.06
GBP WHITBREAD ORD GBPO.76797385	1 453.00	54 657.05	0.01
GBP WPP PLC ORD GBPO.10	10 081.00	133 129.68	0.02
イギリス合計		16 791 675.71	3.10
アメリカ合衆国			
CAD BAUSCH HEALTH COMP COM NPV	2 254.00	51 538.56	0.01
CAD BROOKFIELD RENEWA. CLASS A SUB VOTING SHARES	750.00	32 784.92	0.00
アメリカ合衆国合計		84 323.48	0.01
株式合計		142 676 830.65	26.32
投資信託、クローズド・エンド型			
カナダ			
CAD CANADIAN APARTMENT PROP. REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	700.00	30 066.85	0.01
CAD RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1 415.00	28 582.08	0.00
カナダ合計		58 648.93	0.01
シンガポール			
SGD ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	19 603.00	42 440.46	0.01
SGD CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST REAL ESTATE INV TRUST	28 962.71	48 151.70	0.01
SGD MAPLETREE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7 200.00	10 055.05	0.00
シンガポール合計		100 647.21	0.02
イギリス			
GBP SEGRO PLC REIT	9 027.00	159 918.06	0.03
イギリス合計		159 918.06	0.03
投資信託、クローズド・エンド型合計		319 214.20	0.06
新株引受権			
フランス			
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-RIGHTS 01.04.22	4 201.00	1 570.55	0.00
フランス合計		1 570.55	0.00
新株引受権合計		1 570.55	0.00
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		142 997 615.40	26.38

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
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	1 000 000.00	999 931.94	0.18
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 21-19.05.22	1 500 000.00	1 499 501.67	0.28
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 17.06.21-16.06.22	2 700 000.00	2 697 634.50	0.50
米ドル合計		5 197 068.11	0.96
財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン合計		5 197 068.11	0.96
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		5 197 068.11	0.96
公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引されていない譲渡性のある証券および短期金融商品			
株式			
オーストラリア			
AUD DEXUS NPV (STAPLED)	9 189.00	75 560.25	0.01
オーストラリア合計		75 560.25	0.01
イギリス			
GBP BERKELEY GP HLDGS ORD GBP0.053943	1 045.00	51 458.63	0.01
イギリス合計		51 458.63	0.01
株式合計		127 018.88	0.02
公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引されてい ない譲渡性のある証券および短期金融商品合計		127 018.88	0.02
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 SOURCE MARKETS PLC - MSCI USA SOURCE ETF-A	808 565.00	103 666 118.65	19.13
USD UBS (IRL) ETF PLC-MSCI USA UCITS-ACC-A-USD-ETF	4 013 545.00	103 388 919.20	19.08
USD UBS(IRL)FUND SOLUTION PLC-MSCI USA SF UCITS SHS-A-ETF-ACC	812 979.00	104 305 205.70	19.24
アイルランド合計		311 360 243.55	57.45
ルクセンブルグ			
USD DB X-TRACKERS MSCI USA TRN INDEX ETF-1C CAPITALISATION	174 654.00	22 928 577.12	4.23
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD SUSTAINABLE U-X-ACC	435.08	4 887 066.56	0.90
ルクセンブルグ合計		27 815 643.68	5.13
投資信託、オープン・エンド型合計		339 175 887.23	62.58
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		339 175 887.23	62.58
投資有価証券合計		487 497 589.62	89.94

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 （注１）	純資産 比率 （％）
<b>金融派生商品</b>			
公認の証券取引所に上場されている金融派生商品			
<b>債券関連金融先物</b>			
USD US LONG BOND FUTURE 21.06.22	-1.00	4 281.25	0.00
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.06.22	596.00	-3 055 703.13	-0.56
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 30.06.22	725.00	-2 063 741.80	-0.38
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.06.22	1 339.00	-4 879 344.09	-0.90
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 21.06.22	-1.00	4 171.88	0.00
債券関連金融先物合計		-9 990 335.89	-1.84
<b>金利関連金融先物</b>			
USD 90DAY EURO DOLLAR FUTURE 13.06.22	419.00	-261 237.50	-0.05
金利関連金融先物合計		-261 237.50	-0.05
<b>指数関連金融先物</b>			
CHF SWISS MARKET INDEX FUTURE 17.06.22	-103.00	-627 905.46	-0.12
EUR EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 17.06.22	-1 011.00	-1 788 573.75	-0.33
GBP FTSE 100 INDEX FUTURE 17.06.22	-204.00	-1 034 096.91	-0.19
SEK OMX 30 INDEX FUTURE 13.04.22	-214.00	-53 774.38	-0.01
USD MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 17.06.22	1.00	4 780.00	0.00
USD S&P500 EMINI FUTURE 17.06.22	-1 460.00	-26 134 735.00	-4.82
CAD S&P/TSX 60 IX FUTURE 16.06.22	-79.00	-335 341.26	-0.06
JPY TOPIX INDX FUTURE 09.06.22	-192.00	-2 841 977.36	-0.53
AUD SPI 200 INDEX FUTURES 16.06.22	-69.00	-503 906.22	-0.09
HKD HANG SENG INDEX FUTURE 28.04.22	-26.00	-92 129.12	-0.02
指数関連金融先物合計		-33 407 659.46	-6.17
公認の証券取引所に上場されている金融派生商品合計		-43 659 232.85	-8.06
金融派生商品合計		-43 659 232.85	-8.06

**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	2 194 883.73	HKD	17 125 000.00	22.4.2022	7 786.85	0.00
USD	1 664 885.95	DKK	10 900 000.00	22.4.2022	33 514.76	0.01
USD	370 985.79	NOK	3 300 000.00	22.4.2022	-6 318.21	0.00
USD	2 777 367.38	SEK	25 850 000.00	22.4.2022	2 603.18	0.00
USD	16 238 121.26	JPY	1 875 749 500.00	22.4.2022	778 127.35	0.14
USD	814 471.99	SGD	1 095 900.00	22.4.2022	4 780.11	0.00
USD	4 822 324.89	AUD	6 752 500.00	22.4.2022	-249 651.27	-0.05
USD	8 426 907.11	CAD	10 718 500.00	22.4.2022	-153 642.01	-0.03
USD	10 083 213.16	GBP	7 445 753.16	22.4.2022	281 063.02	0.05
USD	23 291 729.07	EUR	20 498 262.72	22.4.2022	470 985.62	0.09
USD	158 646.58	NZD	240 000.00	22.4.2022	-8 237.03	0.00
USD	7 219 564.78	CHF	6 657 500.00	22.4.2022	-19 727.21	0.00
USD	310 028.74	ILS	1 000 000.00	25.4.2022	-3 430.14	0.00
EUR	660 000.00	USD	741 177.69	22.4.2022	-6 398.80	0.00
USD	683 423.97	GBP	510 000.00	22.4.2022	12 021.57	0.00
JPY	131 500 000.00	USD	1 143 689.59	22.4.2022	-59 861.93	-0.01
USD	4 901 679.50	AUD	6 736 500.00	5.12.2022	-159 984.82	-0.03

銘柄			数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / 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	10 722 903.56	GBP	8 000 003.25	5.12.2022	191 803.68 0.03
USD	1 639 293.35	DKK	10 900 000.00	5.12.2022	6 677.64 0.00
USD	8 480 114.25	CAD	10 747 400.00	5.12.2022	-122 916.91 -0.02
USD	15 200 826.90	JPY	1 744 250 500.00	5.12.2022	816 894.47 0.15
USD	807 603.96	SGD	1 095 900.00	5.12.2022	-2 081.81 0.00
USD	373 599.24	NOK	3 300 000.00	5.12.2022	-3 650.09 0.00
USD	2 191 517.49	HKD	17 125 000.00	5.12.2022	3 785.47 0.00
USD	162 430.51	NZD	240 000.00	5.12.2022	-4 393.58 0.00
USD	2 705 047.12	SEK	25 850 000.00	5.12.2022	-71 105.88 -0.01
USD	309 975.16	ILS	1 000 000.00	5.12.2022	-3 662.06 0.00
USD	7 274 602.24	CHF	6 666 300.00	5.12.2022	19 564.89 0.00
USD	22 244 579.05	EUR	19 895 159.65	5.12.2022	78 375.72 0.01
EUR	2 000 000.00	USD	2 179 878.80	5.12.2022	48 422.33 0.01
EUR	2 000 000.00	USD	2 178 287.00	22.4.2022	48 315.69 0.01
USD	689 470.12	JPY	79 500 000.00	22.4.2022	34 228.30 0.01
USD	214 883.07	AUD	295 000.00	22.4.2022	-6 699.01 0.00
USD	689 811.89	JPY	79 500 000.00	5.12.2022	34 216.48 0.01
USD	214 941.90	AUD	295 000.00	5.12.2022	-6 714.89 0.00
USD	542 413.12	CHF	502 061.00	22.4.2022	-3 522.47 0.00
USD	542 848.55	CHF	502 061.84	5.12.2022	-3 553.11 0.00
USD	495 497.55	CHF	459 830.00	22.4.2022	-4 516.51 0.00
USD	495 895.76	CHF	459 830.80	5.12.2022	-4 545.21 0.00
CHF	680 000.00	USD	731 053.41	22.4.2022	8 371.08 0.00
USD	222 645.36	CAD	284 244.00	22.4.2022	-4 902.30 0.00
USD	373 324.73	GBP	284 725.00	22.4.2022	-1 508.70 0.00
USD	919 466.85	EUR	832 687.11	5.12.2022	-8 271.96 0.00
USD	918 813.98	EUR	832 687.00	22.4.2022	-8 217.58 0.00
USD	199 734.80	SEK	1 923 489.81	5.12.2022	-6 837.81 0.00
USD	222 639.36	CAD	284 243.87	5.12.2022	-4 890.91 0.00
USD	373 287.15	GBP	284 725.83	5.12.2022	-1 522.22 0.00
USD	199 642.89	SEK	1 923 490.00	22.4.2022	-6 826.40 0.00
CHF	673 301.34	USD	724 430.64	5.12.2022	8 333.62 0.00
USD	841 485.92	EUR	766 547.54	5.12.2022	-12 563.45 0.00
USD	840 895.54	EUR	766 547.00	22.4.2022	-12 502.27 0.00
USD	74 776.53	CHF	70 000.00	5.12.2022	-1 405.55 0.00
USD	74 715.54	CHF	70 000.00	22.4.2022	-1 401.69 0.00
GBP	6 873 400.00	USD	8 962 936.97	20.4.2022	85 822.39 0.01
EUR	109 894 800.00	USD	120 997 185.92	20.4.2022	1 341 446.11 0.25
SGD	4 599 300.00	USD	3 366 383.32	20.4.2022	31 777.60 0.01
JPY	4 181 738 900.00	USD	35 464 958.78	20.4.2022	-1 000 327.82 -0.18
CHF	109 093 500.00	USD	116 397 675.28	20.4.2022	2 221 159.46 0.41
EUR	456 900.00	USD	501 223.91	20.4.2022	7 412.72 0.00
CHF	303 400.00	USD	322 609.39	20.4.2022	7 281.52 0.00
JPY	27 235 574.00	USD	230 344.09	5.12.2022	-5 746.39 0.00
USD	160 348.77	EUR	146 071.00	22.4.2022	-2 272.27 0.00
JPY	27 250 000.00	USD	230 357.52	22.4.2022	-5 762.05 0.00
USD	160 467.58	EUR	146 071.42	5.12.2022	-2 277.97 0.00
USD	1 696 165.37	EUR	1 532 641.00	22.4.2022	-10 125.92 0.00
USD	339 781.10	CHF	318 788.20	5.12.2022	-7 161.03 0.00
USD	1 697 369.23	EUR	1 532 640.29	5.12.2022	-10 222.81 0.00
USD	197 536.14	JPY	23 430 000.00	22.4.2022	4 425.25 0.00
USD	174 322.54	SEK	1 638 234.00	22.4.2022	-1 527.09 0.00
USD	174 403.61	SEK	1 638 234.40	5.12.2022	-1 534.08 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	307 442.51	GBP 233 315.00 22.4.2022	289.07 0.00
USD	307 401.66	GBP 233 314.61 5.12.2022	269.35 0.00
USD	197 623.81	JPY 23 430 000.00 5.12.2022	4 408.71 0.00
USD	339 512.61	CHF 318 789.00 22.4.2022	-7 135.03 0.00
USD	971 349.64	JPY 114 995 500.00 20.4.2022	23 591.41 0.00
USD	91 172.79	SGD 123 400.00 20.4.2022	-0.44 0.00
USD	243 025.18	GBP 184 600.00 20.4.2022	1.21 0.00
USD	2 432 361.46	CHF 2 271 200.00 20.4.2022	-37 144.95 -0.01
USD	602 599.34	JPY 71 563 950.00 22.4.2022	12 766.73 0.00
USD	218 485.13	HKD 1 708 020.00 22.4.2022	347.60 0.00
USD	218 517.83	HKD 1 708 019.70 5.12.2022	316.99 0.00
USD	602 851.73	JPY 71 563 950.00 5.12.2022	12 700.82 0.00
GBP	127 900.00	USD 168 518.83 20.4.2022	-139.81 0.00
USD	8 554.97	SGD 11 600.00 20.4.2022	-15.61 0.00
CHF	894 000.00	USD 959 482.37 20.4.2022	12 575.89 0.00
USD	532 601.77	EUR 481 300.00 20.4.2022	-3 197.77 0.00
USD	498 966.37	CHF 465 112.00 22.4.2022	-6 791.28 0.00
USD	499 356.58	CHF 465 112.80 5.12.2022	-6 832.87 0.00
USD	2 948 938.16	EUR 2 671 400.00 20.4.2022	-24 955.25 0.00
GBP	79 500.00	USD 104 717.26 20.4.2022	-56.34 0.00
USD	118 470.35	CAD 149 371.84 5.12.2022	-1 098.16 0.00
USD	118 478.08	CAD 149 372.00 22.4.2022	-1 099.64 0.00
USD	108 119.09	GBP 81 998.99 5.12.2022	176.69 0.00
EUR	587 616.51	USD 647 700.77 5.12.2022	6 992.50 0.00
EUR	600 000.00	USD 660 879.36 22.4.2022	7 101.45 0.00
USD	108 128.23	GBP 81 998.00 22.4.2022	179.89 0.00
CHF	340 700.00	USD 365 450.50 20.4.2022	4 997.21 0.00
SGD	17 100.00	USD 12 594.28 20.4.2022	39.94 0.00
USD	117 180.29	AUD 157 069.00 22.4.2022	-798.27 0.00
USD	117 210.52	AUD 157 068.59 5.12.2022	-807.51 0.00
USD	127 707.07	JPY 15 440 031.00 22.4.2022	449.79 0.00
USD	127 764.35	JPY 15 440 030.00 5.12.2022	438.40 0.00
EUR	2 302 000.00	USD 2 534 389.20 20.4.2022	28 275.56 0.00
CHF	2 043 600.00	USD 2 196 649.35 20.4.2022	25 384.51 0.00
GBP	103 700.00	USD 136 881.47 20.4.2022	-361.50 0.00
SGD	38 300.00	USD 28 205.27 20.4.2022	92.42 0.00
USD	499 619.73	JPY 60 660 000.00 22.4.2022	-342.14 0.00
USD	499 850.85	JPY 60 660 000.00 5.12.2022	-380.82 0.00
USD	530 258.80	EUR 482 000.00 20.4.2022	-6 320.01 0.00
CHF	283 300.00	USD 304 735.88 20.4.2022	3 300.03 0.00
JPY	478 713 700.00	USD 3 925 290.10 20.4.2022	20 123.85 0.00
JPY	174 922 900.00	USD 1 419 753.60 20.4.2022	21 908.19 0.00
EUR	375 600.00	USD 416 863.04 20.4.2022	1 267.66 0.00
USD	45 735.06	GBP 34 800.00 20.4.2022	-78.78 0.00
先渡為替契約合計			4 657 215.35 0.86
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			91 714 780.74 16.92
当座借越およびその他の短期負債			-331.43 0.00
その他の資産および負債			1 802 340.26 0.34
純資産総額			542 012 361.69 100.00

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
システムティック・ アロケーション・ ポートフォリオ・ エクイティ(米ドル)	クラスF - a c c 投資証券	770,287.696 ( 115,961.000 )	459,487.607 ( 232,926.000 )	2,071,148.089 ( 748,749.000 )
	クラスF - a c c (円ヘッジ) 投資証券	224,010.000 ( 220,950.000 )	84,258.000 ( 84,258.000 )	435,585.000 ( 432,525.000 )

(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。