

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2023年2月28日
【計算期間】	第27期中 (自 2022年6月1日 至 2022年11月30日)
【発行者名】	UBS (Lux) ボンド・シキャブ (UBS (Lux) Bond SICAV)
【代表者の役職氏名】	チェアマン・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ ロバート・スティンガー (Robert Süttinger) メンバー・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ 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 同 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 同 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
【縦覧に供する場所】	該当事項なし

(注1) 米ドルの円貨換算は、便宜上、2022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＝132.70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。

(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のため、以下の金額表示は別段の記載がない限り米ドルをもって行う。

(注3) 本書の中で金額および比率を表示する場合、四捨五入してある。従って、合計の数字が一致しない場合がある。また円貨への換算は、本書の中でそれに対応する数字につき所定の換算率で単純計算のうえ、必要な場合四捨五入してある。従って、本書中の同一情報につき異なった円貨表示がなされている場合もある。

(注4) 本書の中で計算期間 (以下「会計年度」ともいう。) とは6月1日に始まり翌年5月31日に終わる一年を指す。

1 【外国投資法人の概況】

UBS (Lux) ボンド・シキャブ・コーポレート・ボンド (米ドル) / ハイ・イールド・ボンド (米ドル) (UBS (Lux) Bond SICAV - USD Corporates (USD) / USD High Yield (USD)) (以下、UBS (Lux) ボンド・シキャブを「本投資法人」、UBS (Lux) ボンド・シキャブ・コーポレート・ボンド (米ドル) / ハイ・イールド・ボンド (米ドル) をそれぞれ「ファンド」または「サブ・ファンド」という。) の概況は以下のとおりである。

(注) ファンドにはクラスP-a c c投資証券以外の投資証券も存在するが、日本で販売されていないため、以下、ファンドについて「投資証券」というときは、上記のクラスP-a c c投資証券を指すものとする。

(1) 【主要な経営指標等の推移】

コーポレート・ボンド (米ドル)

(米ドル)

	2020年11月末日 に終了する 中間会計年度末	2021年5月末日 に終了する 会計年度末	2021年11月末日 に終了する 中間会計年度末	2022年5月末日 に終了する 会計年度末	2022年11月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	34,524,901.55	18,905,106.53	6,516,919.63	-26,071,817.80	-10,315,778.38
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	34,524,901.55	18,905,106.53	6,516,919.63	-26,071,817.80	-10,315,778.38
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	34,524,901.55	18,905,106.53	6,516,919.63	-26,071,817.80	-10,315,778.38
(d) 出資総額 ⁽²⁾	492,705,748.70	471,435,415.69	314,444,853.10	216,964,860.07	194,483,904.75
(e) 発行済投資口総数 (クラスP-a c c投資証券)	5,147,138.599口	5,005,569.831口	4,347,420.533口	3,518,417.388口	3,426,404.299口
(f) 純資産額	492,705,748.70	471,435,415.69	314,444,853.10	216,964,860.07	194,483,904.75
(g) 資産総額	500,224,900.78	473,490,494.43	317,321,042.62	217,332,853.67	196,886,688.12
(h) 1口当たり純資産価格 (クラスP-a c c投資証券)	22.00	21.29	21.62	19.02	18.12
(i) 1口当たり当期純利益金額 または当期純損失金額 (クラスP-a c c投資証券)	1.43	0.65	0.36	-2.23	-0.91
(j) 分配総額	34.00	89,165.95	203,566.53	256,777.54	33,446.60
(k) 1口当たり分配金額 (クラスP-a c c投資証券)	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	98.50%	99.57%	99.09%	99.83%	98.78%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾ (クラスP-a c c投資証券)	9.84%	3.45%	-1.73%	-10.66%	-16.19%

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

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

(3) 自己資本利益率は、当該会計年度末および当該中間会計年度末の1口当たり純資産価格の前年度に対する増減の比率であるが、当該会計年度に初めて当該投資証券が発行された場合には、当初募集価格に対する増減の比率で表すものとする。以下各サブ・ファンドについて同様とする。

(注) 各取引に使用された1口当たりの純資産価格は、純資産価格の調整の結果、上記および財務書類に記載の価格と異なる場合がある (財務書類に対する注記1参照)。以下各サブ・ファンドについて同様とする。

ハイ・イールド・ボンド (米ドル)

(米ドル)

	2020年11月末日 に終了する 中間会計年度末	2021年5月末日 に終了する 会計年度末	2021年11月末日 に終了する 中間会計年度末	2022年5月末日 に終了する 会計年度末	2022年11月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	95,079,241.99	136,296,658.59	10,753,614.01	−31,127,292.55	−24,873,939.63
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	95,079,241.99	136,296,658.59	10,753,614.01	−31,127,292.55	−24,873,939.63
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	95,079,241.99	136,296,658.59	10,753,614.01	−31,127,292.55	−24,873,939.63
(d) 出資総額 ⁽²⁾	1,008,478,746.31	1,416,618,042.26	716,257,416.60	617,826,495.66	498,495,263.71
(e) 発行済投資口総数 (クラスP-a c c 投資証 券)	237,782.855口	227,041.797口	214,707.906口	200,848.696口	188,772.855口
(f) 純資産額	1,008,478,746.31	1,416,618,042.26	716,257,416.60	617,826,495.66	498,495,263.71
(g) 資産総額	1,020,427,489.09	1,436,859,422.46	718,723,339.66	641,822,154.75	501,611,398.84
(h) 1口当たり純資産価格 (クラスP-a c c 投資証 券)	321.40	330.63	331.68	312.83	301.43
(i) 1口当たり当期純利益金額 または当期純損失金額 (クラスP-a c c 投資証 券)	26.19	36.55	0.73	−17.90	−12.54
(j) 分配総額	4,285,577.85	8,626,742.40	4,145,814.63	7,975,339.46	3,838,506.92
(k) 1口当たり分配金額 (クラスP-a c c 投資証 券)	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	98.83%	98.59%	99.66%	96.26%	99.38%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾ (クラスP-a c c 投資証 券)	4.40%	11.86%	3.20%	−5.38%	−9.12%

(2) 【外国投資法人の出資総額】

2022年12月末日現在の出資総額および発行済投資証券総数は以下のとおりである。

なお、原則として、発行可能投資口総口数には制限がない。

	出資総額		発行済投資証券総数	
	千米ドル	百万円	(口)	
コーポレート・ボンド (米ドル)	191,962.80	25,473	クラスP-a c c 投資証券	3,415,417.071
ハイ・イールド・ボンド (米ドル)	501,331.13	66,527	クラスP-a c c 投資証券	188,372.716

(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12月末日現在)

氏 名	役 職 名	略 歴	所有投資口
ロバート・スティンガー (Robert Süttinger)	取締役会長 (チェアマン・オブ・ ザ・ボード・オブ・ ディレクターズ)	UBSアセット・マネジメント・ スイス・エイ・ジー (チューリッ ヒ) マネージング・ディレクター	該当なし
フランチェスカ・ グアニーニ (Francesca Guagnini)	取締役会役員 (メンバー・オブ・ ザ・ボード・オブ・ ディレクターズ)	UBSアセット・マネジメント (UK) リミテッド、ロンドン マネージング・ディレクター	該当なし
ジョゼ・リンダ・デニス (Josée Lynda Denis)	取締役会役員 (メンバー・オブ・ ザ・ボード・オブ・ ディレクターズ)	ルクセンブルグ、インディペンデ ント・ディレクター	該当なし
イオアナ・ナウム (Ioana Naum)	取締役会役員 (メンバー・オブ・ ザ・ボード・オブ・ ディレクターズ)	UBSアセット・マネジメント・ スイス・エイ・ジー (チューリッ ヒ) エグゼクティブ・ディレクター	該当なし
ラファエル・ シュミッターリヒター (Raphael Schmidt- Richter)	取締役会役員 (メンバー・オブ・ ザ・ボード・オブ・ ディレクターズ)	UBSアセット・マネジメント (ドイツ) ゲーエムベーハー、 フランクフルト エグゼクティブ・ ディレクター	該当なし

(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、プライスウォーターハウスクーパース・ソシエテ・コーペラ
ティブ (PricewaterhouseCoopers, Société coopérative) である。

(5) 【その他】

a. 定款の変更

本投資法人の定款は、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。）に基づき、本投資法人の臨時投資主総会の決議により変更することができる。

b. 事業譲渡または事業譲受

投資法人およびそのサブ・ファンドの解散、サブ・ファンドの合併

本投資法人およびそのサブ・ファンドの解散

定足数および多数決の要件に関する法律条件を満たす投資主総会は本投資法人を解散させるものとする。

本投資法人の純資産総額が所定の最低資本金の3分の2または4分の1以下になった場合、本投資法人の取締役会は本投資法人を清算するか否かについて投資主総会の採決を求めなければならない。本投資法人を解散する場合、解散は1名以上の清算人が実行する。投資主総会が、清算人を任命し、清算人の報酬および権限の範囲を決定する。清算人は投資主の最善の利益にかなうように本投資法人の資産を売却し、サブ・ファンドの解散による正味収入を投資主の保有量に比例して当該サブ・ファンドの投資主に分配する。清算手続きの終了時（9か月かかる可能性がある）に投資主に分配できない清算収入は遅滞なく供託金庫（Caisse de Consignation）に預託される。償還日の決められたサブ・ファンドはそれぞれの期間の終了時に自動的に解散および清算される。

サブ・ファンドまたはサブ・ファンド内の投資証券クラスの純資産総額が、当該サブ・ファンドもしくは投資証券クラスの経済的で効率的な運営のため求められる金額を下回った場合、または当該金額に達しない場合、または政治、経済および金融環境に重大な変化がある場合、または合理化の一環として、本投資法人は、評価日または決定が有効となる時間の（投資対象の実際の換金価格および換金コストを勘案した）純資産価格で、該当する投資証券クラスのすべての投資証券を買い戻すことを決定することができる。

本投資法人の取締役会の権利に関係なく、本投資法人の取締役会の提案に応じて、サブ・ファンドの投資主総会はサブ・ファンドが発行した投資証券を消却し、投資主に対して保有する投資証券の純資産価額を返還することで、本投資法人の資本を減資することができる。かかる純資産価額は上記の決定が効力を発生する日に計算し、サブ・ファンドの資産の処分によって実現した実際価格およびかかる処分に起因する費用を織り込むものとする。

投資証券を消却する投資主総会または本投資法人の取締役会の決定は、有価証券報告書「第二部 外国投資法人の詳細情報 第3 管理及び運営 3 投資主・外国投資法人債権者の権利等（1）投資主・外国投資法人債権者の権利（f）報告書を受領する権利」に記載されている方法で公告することによって各サブ・ファンドの投資主に通知する。買戻しのために投資主が提出しなかった清算する投資証券の純資産価額に相当する金額はルクセンブルグの供託金庫に遅滞なく預託される。

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

「合併」とは、以下の取引である。

- a) 一もしくは複数のUCITSまたは当該UCITSのサブ・ファンド、すなわち「吸収対象UCITS」が、清算なしのその解散に基づき、すべての資産および負債を別の既存のUCITSまたは当該UCITSのサブ・ファンド、すなわち「吸収UCITS」に移転し、吸収対象UCITSの投資主が見返りに吸収UCITSの投資証券および適宜、当該投資証券の純資産価額の10%を超えない支払額を受け取る取引。
- b) 二つ以上のUCITSまたは当該UCITSのサブ・ファンド、すなわち「吸収対象UCITS」が、清算なしのその解散に基づき、すべての資産および負債を別のUCITSまたは当該UCITSが設立した当該UCITSのサブ・ファンド、すなわち「吸収UCITS」に移転し、

吸収対象UCITSの投資主が見返りに吸収UCITSの投資証券および適宜、当該投資証券の純資産価額の10%を超えない支払額を受け取る取引。

- c) 負債が完済されるまで存続し続ける一もしくは複数のUCITSまたは当該UCITSのサブ・ファンド、すなわち「吸収対象UCITS」が、すべての純資産を同じUCITSの別のサブ・ファンド、当該UCITSが設立した別のUCITSまたは別の既存のUCITSもしくは当該UCITSのサブ・ファンド、すなわち「吸収UCITS」に移転する取引。

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

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

合併の決定は有価証券報告書「第二部 外国投資法人の詳細情報 第3 管理及び運営 3 投資主・外国投資法人債権者の権利等 (1) 投資主・外国投資法人債権者の権利 (f) 報告書を受領する権利」に記載されている方法で投資主に通知する。決定が公告されてから30日以内に投資主は保有する投資証券の一部または全部を、有価証券報告書「第二部 外国投資法人の詳細情報 第2 手続等 2 買戻し手続等」と題する項に記載する確立された手続きに従って、買戻手数料またはその他の管理事務手数料を計算することなく、その時点の純資産価額で買い戻す権限を有する。買戻しのために提出されなかった投資証券は、上記の決定を実施する日に計算した関係するサブ・ファンドの純資産価額に基づいて交換される。割当てする受益証券が契約型オープン投資信託の法形態を取る投資ファンドの受益証券である場合、上記の決定は割当てに賛成票を投じた投資主だけを拘束する。

本投資法人の総会または関係するサブ・ファンドの投資主総会

サブ・ファンドの清算および合併のいずれの場合についても、投資主総会または当該サブ・ファンドの投資主総会の定足数は要求されず、決定は総会の出席株式の単純多数によって承認されることができる。

c. 出資の状況その他の重要事項

該当事項なし。

d. 訴訟事件その他の重要事項

半期報告書提出前6か月以内において、訴訟事件その他本投資法人に重要な影響を及ぼした事実および重要な影響を及ぼすことが予想される事実はない。

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

コーポレート・ボンド (米ドル)

(2022年12月末日現在)

資産の種類	国名	時価合計 (米ドル)	投資比率 (%)
債券	アメリカ合衆国	125,850,280.76	65.48
	英国	13,978,135.73	7.27
	オーストラリア	9,269,040.14	4.82
	カナダ	8,312,129.70	4.32
	オランダ	4,971,102.77	2.59
	フランス	4,751,090.91	2.47
	日本	4,255,519.03	2.21
	アイルランド	3,339,836.57	1.74
	ノルウェー	3,265,653.16	1.70
	多国籍	1,506,093.75	0.78
	ルクセンブルグ	1,004,705.13	0.52
	バミューダ	923,937.50	0.48
	スペイン	417,952.55	0.22
	小計	181,845,477.70	94.62
投資信託	ルクセンブルグ	912,454.20	0.47
ポートフォリオ合計		182,757,931.90	95.09
現金・その他資産 (負債控除後)		9,434,411.16	4.91
資産総額		192,192,343.06	100.00
負債総額		229,542.27	0.12
合計 (純資産総額)		191,962,800.79 (約25,473百万円)	99.88

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

ハイ・イールド・ボンド（米ドル）

（2022年12月末日現在）

資産の種類	国名	時価合計（米ドル）	投資比率（%）
債券	アメリカ合衆国	369,010,733.32	73.55
	英国	19,393,952.90	3.87
	カナダ	18,412,285.95	3.67
	ルクセンブルグ	16,954,659.29	3.38
	フランス	10,058,007.96	2.00
	デンマーク	7,651,929.89	1.53
	オランダ	6,265,679.15	1.25
	バミューダ	4,696,006.41	0.94
	ドイツ	3,904,275.05	0.78
	アイルランド	3,416,271.68	0.68
	リベリア	3,231,681.93	0.64
	ケイマン諸島	2,482,545.31	0.49
	オーストラリア	1,252,506.09	0.25
	イタリア	1,092,837.32	0.22
	パナマ	894,962.52	0.18
	イスラエル	851,033.50	0.17
	小計	469,569,368.27	93.60
株式	アメリカ合衆国	2,687,673.99	0.54
投資信託	アイルランド	89.04	0.00
ポートフォリオ合計		472,257,131.30	94.13
現金・その他資産（負債控除後）		29,446,256.48	5.87
資産総額		501,703,387.78	100.00
負債総額		372,262.24	0.07
合計（純資産総額）		501,331,125.54 (約66,527百万円)	99.93

(2) 【運用実績】**① 【純資産等の推移】**

2022年12月末日までの1年間における各月末の資産総額および純資産の推移は以下のとおりである。

コーポレート・ボンド (米ドル)

	資産総額		純資産総額		1口当たり 純資産価格 (クラスP-a c c 投資証券)	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円
2022年1月末日	274,838.28	36,471	273,670.07	36,316	20.88	2,771
2月末日	257,611.16	34,185	255,668.51	33,927	20.46	2,715
3月末日	244,073.03	32,388	243,545.88	32,319	19.96	2,649
4月末日	214,647.98	28,484	211,137.27	28,018	18.90	2,508
5月末日	217,332.85	28,840	216,964.86	28,791	19.02	2,524
6月末日	210,761.79	27,968	210,614.60	27,949	18.46	2,450
7月末日	220,460.17	29,255	216,702.44	28,756	19.03	2,525
8月末日	205,539.51	27,275	205,168.86	27,226	18.47	2,451
9月末日	193,198.89	25,637	192,805.98	25,585	17.49	2,321
10月末日	191,363.32	25,394	188,049.40	24,954	17.29	2,294
11月末日	196,886.69	26,127	194,483.90	25,808	18.12	2,405
12月末日	192,192.34	25,504	191,962.80	25,473	17.98	2,386

ハイ・イールド・ボンド (米ドル)

	資産総額		純資産総額		1口当たり 純資産価格 (クラスP-a c c 投資証券)	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円
2022年1月末日	745,495.89	98,927	738,638.97	98,017	328.75	43,625
2月末日	727,713.84	96,568	721,453.73	95,737	325.76	43,228
3月末日	707,885.05	93,936	693,935.70	92,085	323.76	42,963
4月末日	657,128.23	87,201	654,776.31	86,889	312.40	41,455
5月末日	641,822.15	85,170	617,826.50	81,986	312.83	41,513
6月末日	556,210.73	73,809	554,879.73	73,633	290.04	38,488
7月末日	595,112.56	78,971	584,258.81	77,531	306.47	40,669
8月末日	562,157.89	74,598	561,306.22	74,485	298.94	39,669
9月末日	545,778.48	72,425	543,787.34	72,161	286.40	38,005
10月末日	515,173.41	68,364	511,168.95	67,832	295.25	39,180
11月末日	501,611.40	66,564	498,495.26	66,150	301.43	40,000
12月末日	501,703.39	66,576	501,331.13	66,527	299.19	39,703

各サブ・ファンドの投資証券は、ルクセンブルグ証券取引所に上場されている。

同取引所での実質的な取引実績はない。

② 【分配の推移】

該当なし。

③ 【自己資本利益率 (収益率) の推移】

2022年1月1日から2022年12月末日までの1年間の自己資本利益率（収益率）は以下のとおりである。

	収益率	
コーポレート・ボンド（米ドル）	クラスP－a c c投資証券	－16.80%
ハイ・イールド・ボンド（米ドル）	クラスP－a c c投資証券	－11.36%

（注）収益率（%）＝ $100 \times (a - b) / b$

a＝2022年12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額を加えた額）

b＝2021年12月末日現在の1口当たり純資産価格（分配額の額）

（３）【投資リスク】

- ① 当中間計算期間において、2022年11月30日提出の有価証券報告書「第一部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 3 投資リスク」に記載される投資リスクについて、重要な変更はない。
- ② 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。

3【資産運用会社の概況】

(1)【名称及び資本金の額】

A. 管理会社

a) 名称

UBSファンド・マネジメント (ルクセンブルグ) エス・エイ

b) 資本金 (株主資本) の額

2022年12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12月30日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値 (1ユーロ=141.47円) による。

B. 投資運用会社

コーポレート・ボンド (米ドル) およびハイ・イールド・ボンド (米ドル) の投資運用会社

a) 名称

UBSアセット・マネジメント (アメリカス) インク (シカゴ)

b) 資本金の額

2022年12月末日現在の資本金額は、10,167,024米ドル (約13億円)

(2)【大株主の状況】

A. 管理会社

UBSファンド・マネジメント (ルクセンブルグ) エス・エイ

(2022年12月末日現在)

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

B. 投資運用会社

コーポレート・ボンド (米ドル) およびハイ・イールド・ボンド (米ドル) の投資運用会社

UBSアセット・マネジメント (アメリカス) インク (シカゴ)

(2022年12月末日現在)

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

(3) 【役員の状況】

A. 管理会社

UBSファンド・マネジメント (ルクセンブルグ) エス・エイ

(2022年12月末日現在)

氏名	役職名	就任	略歴	所有株式
マイケル・ケール (Michael Kehl)	チェアマン	2022年1月1日	UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー、チューリッヒ、スイス ヘッド・オブ・プロダクト	該当なし
フランチェスカ・ジリ・プリム (Francesca Gigli Prym)	ディレクター／ ボード・メンバー	2019年12月5日	UBSファンド・マネジメント (ルクセンブルグ) エス・エイ、ルクセンブルグ、チーフ・エグゼクティブ・オフィサー	該当なし
ウジェーヌ・デル・シオッポ (Eugène Del Cioppo)	ディレクター／ ボード・メンバー	2022年9月2日	UBSファンド・マネジメント (スイス) エイ・ジー、バーゼル、スイス チーフ・エグゼクティブ・オフィサー	該当なし
アン＝シャルロット・ローヤー (Ann-Charlotte Lawyer)	インディペンデント・ディレクター／ ボード・メンバー	2022年1月1日	ルクセンブルグ大公国、 インディペンデント・ディレクター	該当なし
ミリアム・ウエベル (Miriam Uebel)	インディペンデント・ディレクター／ ボード・メンバー	2022年3月8日	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、ドイツ インスティテューショナル・クライアント・カバレッジ	該当なし

B. 投資運用会社

コーポレート・ボンド（米ドル）およびハイ・イールド・ボンド（米ドル）の投資運用会社

UBSアセット・マネジメント（アメリカス）インク（シカゴ）

（2022年12月末日現在）

氏名	役職名	略歴	所有株式
ジョン・クリーグ (John Krieg)	ディレクター	2021年6月14日就任	非公開
ジェームス・ポーチャー (James Poucher)	チェア・オブ・ザ・ ボード／ディレクター	2022年1月1日就任	非公開

(4) 【事業の内容及び営業の概況】

A. 管理会社

管理会社は、本投資法人と管理会社契約を締結し、当該契約に詳述された業務を遂行する。

管理会社は、本投資法人の所在地事務代行会社としても行為している。

2022年12月末日現在、管理会社は以下のとおり、447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	401	481,891,209.52 オーストラリア・ドル
			2,758,097,733.27 カナダ・ドル
			14,763,434,613.31 スイス・フラン
			5,463,677,997.72 中国元
			485,008,011.70 デンマーク・クローネ
			52,272,014,603.82 ユーロ
			1,957,490,049.61 英ポンド
			323,260,734.40 香港ドル
			422,088,912,557.13 日本円
			30,237,616.11 シンガポール・ドル
			112,237,302,126.19 米ドル
アイルランド	オープン・エンド型 投資信託／投資法人	46	552,126,690.99 オーストラリア・ドル
			177,694,939.91 スイス・フラン
			1,228,359,129.10 ユーロ
			1,783,550,959.69 英ポンド
			19,526,189,426.16 日本円
			29,653,511,159.04 米ドル

B. 投資運用会社

各投資運用会社は、本投資法人と投資運用契約を締結し、当該契約に基づき、投資について本投資法人に対し投資顧問業務を提供し、本投資法人のためその他の一定の業務を遂行する。

コーポレート・ボンド（米ドル）およびハイ・イールド・ボンド（米ドル）の投資運用会社

UBS グローバル・アセット・マネジメント（アメリカス）インク（シカゴ）

2022年12月末日現在、UBSアセット・マネジメント（アメリカス）インク（シカゴ）は51本のサブ・ファンドを運用しており、そのうち運用資産額上位10位のサブ・ファンドは、以下のとおりである。

	名称	基本的性格	設定日	純資産総額 (ユーロ)
1	UBS (Lux) Real Estate Funds Selection - Global	変動資本を有する 投資法人	2008年6月30日	8,720,671,316
2	UBS (Irl) Fund plc - UBS (Irl) Select Money Market Fund - USD Sustainable	公開有限責任会社	2002年9月13日	6,031,194,527
3	UBS (Lux) Equity Sicav - Long Term Themes (USD)	変動資本を有する 投資法人	2016年1月28日	4,473,289,935
4	Focused Fund - Corporate Bond Sustainable USD	契約型投資信託	2003年9月9日	2,217,567,139
5	UBS (Irl) Fund plc - UBS (Irl) Select Money Market Fund - US Treasury	公開有限責任会社	2018年11月14日	1,882,008,548
6	UBS (Lux) Bond Sicav - USD Investment Grade Corporates Sustainable (USD)	変動資本を有する 投資法人	2017年1月30日	1,709,045,458
7	Focused Sicav - US Corporate Bond Sustainable USD	変動資本を有する 投資法人	2016年11月7日	1,542,986,352
8	UBS (Lux) Equity Sicav - USA Growth (USD)	変動資本を有する 投資法人	2004年10月8日	1,234,862,097
9	UBS (Lux) Equity Sicav - US Total Yield Sustainable (USD)	変動資本を有する 投資法人	2013年2月15日	720,537,481
10	UBS (Lux) Equity Sicav - Engage for Impact (USD)	変動資本を有する 投資法人	2017年10月13日	709,241,515

(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。

4【外国投資法人の経理状況】

- a. ファンドの日本語の中間財務書類は、ルクセンブルグにおける法令に準拠して作成された原文の中間財務書類を翻訳したものである。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。
- b. 原文の中間財務書類は、UBS (Lux) ボンド・シキャブおよび全てのサブ・ファンドにつき一括して作成されている。日本語の作成にあたっては関係するサブ・ファンドに関連する部分のみを翻訳している。ただし、各サブ・ファンドには以下に記載した投資証券以外の投資証券も存在するが、以下に記載した投資証券に関連する部分を抜粋して日本語に記載している。
- コーポレート・ボンド（米ドル）クラスP－a c c投資証券
ハイ・イールド・ボンド（米ドル）クラスP－a c c投資証券
- c. ファンドの原文の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。
- d. ファンドの原文の中間財務書類は、米ドルで表示されている。日本語の中間財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円による金額は、2022年12月30日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝132.70円）で換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

(1) 【資産及び負債の状況】

UBS (Lux) ボンド・シキャブ

連結純資産計算書	米ドル	千円
資産	2022年11月30日	2022年11月30日
投資有価証券、取得原価	18,253,696,866.91	2,422,265,574
投資有価証券、未実現評価益（評価損）	-2,639,704,722.72	-350,288,817
投資有価証券合計（注1）	15,613,992,144.19	2,071,976,758
現金性銀行預金、要求払預金 および預金勘定	529,843,103.49 *	70,310,180
その他当座資産（証拠金）	38,465,653.71	5,104,392
有価証券売却に係る未収金（注1）	161,761,225.07	21,465,715
発行に係る未収金	12,255,209.86	1,626,266
有価証券に係る未収利息	136,778,376.11	18,150,491
当座資産に係る未収利息	31,679.37	4,204
分配に係る未収金	360,833.66	47,883
前払費用	1,079,847.50	143,296
その他未収金	3,610,065.08	479,056
金融先物に係る未実現利益（注1）	1,766,855.97	234,462
外国為替先物予約に係る 未実現利益（注1）	67,898,328.26	9,010,108
スワップに係る未実現利益（注1）	11,823,812.79	1,569,020
資産合計	16,579,667,135.06	2,200,121,829
負債		
金融先物に係る未実現損失（注1）	-267,394.36	-35,483
外国為替先物予約に係る 未実現損失（注1）	-49,584,928.50	-6,579,920
スワップに係る未実現損失（注1）	-3,852,139.42	-511,179
当座借越	-14,096,416.80	-1,870,595
その他短期負債（証拠金）	-2,323,738.94	-308,360
当座借越に係る未払利息	-130,980.98	-17,381
スワップに係る未払利息（注1）	-1,228.38	-163
有価証券購入に係る未払金（注1）	-182,283,338.30	-24,188,999
未払買戻代金	-23,118,174.02	-3,067,782
その他負債	-27,456.29	-3,643
報酬引当金（注2）	-5,652,747.62	-750,120
年次税引当金（注3）	-617,773.42	-81,979
その他の手数料および報酬に係る 引当金（注2）	-1,958,971.35	-259,955
引当金合計	-8,229,492.39	-1,092,054
負債合計	-283,915,288.38	-37,675,559
期末純資産	16,295,751,846.68	2,162,446,270

* 2022年11月30日現在、当該現金額は取引の相手方のために担保に供されており、バンク・オブ・アメリカについては40,000.00米ドル、シティバンクについては1,500,000.00米ドル、クレディ・スイスについては2,530,000.00米ドル、HSBC銀行については972,000.00米ドル、JPモルガンについては909,092.00米ドルおよびモルガン・スタンレー（ロンドン）については365,000.00米ドルである。

注記は財務書類の不可分の一部である。

UBS (Lux) ボンド・シキャブ

連結運用計算書

	米ドル	千円
	2022年6月1日－2022年11月30日	2022年6月1日－2022年11月30日
収益		
当座資産に係る利息	3,050,097.46	404,748
有価証券利息	255,644,656.86	33,924,046
配当金	3,688,438.38	489,456
スワップに係る受取利息(注1)	24,526,230.96	3,254,631
貸付証券に係る純収益(注11)	2,639,470.52	350,258
その他収益(注4)	12,766,540.58	1,694,120
収益合計	302,315,434.76	40,117,258
費用		
スワップに係る支払利息(注1)	-25,563,812.70	-3,392,318
報酬(注2)	-36,849,824.89	-4,889,972
年次税(注3)	-1,813,344.50	-240,631
その他の手数料および報酬(注2)	-1,133,821.02	-150,458
現金および当座借越に係る利息	-1,029,936.44	-136,673
費用合計	-66,390,739.55	-8,810,051
投資純利益(損失)	235,924,695.21	31,307,207
実現利益(損失)(注1)		
オプションなしの時価評価証券に係る 実現利益(損失)	-681,677,874.57	-90,458,654
オプションに係る実現利益(損失)	1,688,430.00	224,055
利回り評価証券および金融市場商品に 係る実現利益(損失)	-57,628.88	-7,647
金融先物に係る実現利益(損失)	36,791,213.37	4,882,194
外国為替先物予約に係る実現利益(損失)	-216,042,621.24	-28,668,856
スワップに係る実現利益(損失)	9,560,146.46	1,268,631
外国為替に係る実現利益(損失)	83,623,320.46	11,096,815
実現利益(損失)合計	-766,115,014.40	-101,663,462
当期実現純利益(損失)	-530,190,319.19	-70,356,255
未実現評価益(評価損)の変動(注1)		
オプションなしの時価評価証券に係る 未実現評価益(評価損)	-3,307,226.60	-438,869
オプションに係る未実現評価益(評価損)	-229,252.80	-30,422
利回り評価証券および金融市場商品に 係る未実現評価益(評価損)	-1,970,915.21	-261,540
金融先物に係る未実現評価益(評価損)	-17,260,926.77	-2,290,525
外国為替先物予約に係る未実現評価益 (評価損)	-70,195,945.88	-9,315,002
スワップに係る未実現評価益(評価損)	-28,125,620.04	-3,732,270
未実現評価益(評価損)の変動合計	-121,089,887.30	-16,068,628
運用活動による純資産の純増加(減少)	-651,280,206.49	-86,424,883

注記は財務書類の不可分の一部である。

UBS (Lux) ボンド・シキャブ

連結純資産変動計算書

	米ドル	千円
	2022年6月1日－2022年11月30日	2022年6月1日－2022年11月30日
期首純資産	19,598,140,520.01 *	2,600,673,247
発行額	1,545,137,836.51	205,039,791
買戻額	-4,107,859,025.85	-545,112,893
合計純発行額 (買戻額)	-2,562,721,189.34	-340,073,102
支払配当金	-88,387,277.50	-11,728,992
投資純収益 (損失)	235,924,695.21	31,307,207
実現利益 (損失) 合計	-766,115,014.40	-101,663,462
未実現評価益 (評価損) の変動合計	-121,089,887.30	-16,068,628
運用活動による純資産の純増加 (減少)	-651,280,206.49	-86,424,883
期末純資産	16,295,751,846.68	2,162,446,270

* 2022年11月30日現在の為替レートを使用して計算された。2022年5月31日現在の為替レートを使用した場合、期首連結純資産は20,037,486,566.34米ドルであった。

注記は財務書類の不可分の一部である。

U B S (Lux) ボンド・シキャブコーポレート・ボンド(米ドル)

純資産計算書	米ドル	千円
資産	2022年11月30日	2022年11月30日
投資有価証券、取得原価	211,187,007.64	28,024,516
投資有価証券、未実現評価益(評価損)	-24,652,521.83	-3,271,390
投資有価証券合計(注1)	186,534,485.81	24,753,126
現金性銀行預金、要求払預金 および預金勘定	2,310,450.16	306,597
その他当座資産(証拠金)	102,475.62	13,599
有価証券売却に係る未収金(注1)	6,011,390.83	797,712
発行に係る未収金	36,323.97	4,820
有価証券に係る未収利息	1,866,282.84	247,656
前払費用	25,278.89	3,355
資産合計	196,886,688.12	26,126,864
負債		
金融先物に係る未実現損失(注1)	-16,843.73	-2,235
外国為替先物予約に係る 未実現損失(注1)	-250,699.99	-33,268
有価証券購入に係る未払金(注1)	-1,986,370.00	-263,591
未払買戻代金	-925.54	-123
報酬引当金(注2)	-119,640.02	-15,876
年次税引当金(注3)	-14,557.27	-1,932
その他の手数料および報酬に係る 引当金(注2)	-13,746.82	-1,824
引当金合計	-147,944.11	-19,632
負債合計	-2,402,783.37	-318,849
期末純資産	194,483,904.75	25,808,014

注記は財務書類の不可分の一部である。

U B S (Lux) ボンド・シキャブコーポレート・ボンド(米ドル)

運用計算書	米ドル	千円
収益	2022年6月1日－2022年11月30日	2022年6月1日－2022年11月30日
当座資産に係る利息	36,825.37	4,887
有価証券利息	3,947,801.88	523,873
貸付証券に係る純収益(注11)	3,906.23	518
その他収益(注4)	10,426.18	1,384
収益合計	3,998,959.66	530,662
費用		
報酬(注2)	-765,675.47	-101,605
年次税(注3)	-41,664.55	-5,529
その他の手数料および報酬(注2)	-13,311.28	-1,766
現金および当座借越に係る利息	-1,299.90	-172
費用合計	-821,951.20	-109,073
投資純利益(損失)	3,177,008.46	421,589
実現利益(損失)(注1)		
オプションなしの時価評価証券に係る 実現利益(損失)	-7,014,357.20	-930,805
金融先物に係る実現利益(損失)	-507,108.29	-67,293
外国為替先物予約に係る実現利益(損失)	-354,796.37	-47,081
外国為替に係る実現利益(損失)	508,277.46	67,448
実現利益(損失)合計	-7,367,984.40	-977,732
当期実現純利益(損失)	-4,190,975.94	-556,143
未実現評価益(評価損)の変動(注1)		
オプションなしの時価評価証券に係る 未実現評価益(評価損)	-5,504,438.70	-730,439
金融先物に係る未実現評価益(評価損)	87,125.01	11,561
外国為替先物予約に係る未実現評価益 (評価損)	-707,488.75	-93,884
未実現評価益(評価損)の変動合計	-6,124,802.44	-812,761
運用活動による純資産の純増加(減少)	-10,315,778.38	-1,368,904

注記は財務書類の不可分の一部である。

UBS (Lux) ボンド・シキャプコーポレート・ボンド (米ドル)

純資産の変動	米ドル	千円
	2022年6月1日－2022年11月30日	2022年6月1日－2022年11月30日
期首純資産	216,964,860.07	28,791,237
発行額	8,290,693.45	1,100,175
買戻額	-20,422,423.79	-2,710,056
合計純発行額 (買戻額)	-12,131,730.34	-1,609,881
支払配当金	-33,446.60	-4,438
投資純収益 (損失)	3,177,008.46	421,589
実現利益 (損失) 合計	-7,367,984.40	-977,732
未実現評価益 (評価損) の変動合計	-6,124,802.44	-812,761
運用活動による純資産の純増加 (減少)	-10,315,778.38	-1,368,904
期末純資産	194,483,904.75	25,808,014

発行済投資証券口数の変動

	2022年6月1日－2022年11月30日
クラス	P-acc
期首発行済口数	3,518,417.3880
発行口数	215,063.9960
買戻口数	-307,077.0850
期末発行済口数	3,426,404.2990

注記は財務書類の不可分の一部である。

UBS (Lux) ボンド・シキャプ・ハイ・イールド・ボンド(米ドル)

純資産計算書	米ドル	千円
資産	2022年11月30日	2022年11月30日
投資有価証券、取得原価	544,125,371.66	72,205,437
投資有価証券、未実現評価益(評価損)	-57,481,793.80	-7,627,834
投資有価証券合計(注1)	486,643,577.86	64,577,603
現金性銀行預金、要求払預金 および預金勘定	2,581,812.61 *	342,607
有価証券売却に係る未収金(注1)	2,595,498.64	344,423
発行に係る未収金	1,656,631.87	219,835
有価証券に係る未収利息	8,069,916.99	1,070,878
分配に係る未収金	2.22	0
前払費用	16,428.19	2,180
スワップに係る未実現利益(注1)	47,530.46	6,307
資産合計	501,611,398.84	66,563,833
負債		
外国為替先物予約に係る 未実現損失(注1)	-585,496.24	-77,695
当座借越	-574.59	-76
当座借越に係る未払利息	-5.96	-1
有価証券購入に係る未払金(注1)	-1,294,223.53	-171,743
未払買戻代金	-951,325.73	-126,241
報酬引当金(注2)	-225,733.28	-29,955
年次税引当金(注3)	-20,781.27	-2,758
その他の手数料および報酬に係る 引当金(注2)	-37,994.53	-5,042
引当金合計	-284,509.08	-37,754
負債合計	-3,116,135.13	-413,511
期末純資産	498,495,263.71	66,150,321

* 2022年11月30日現在、当該現金額は取引の相手方のために担保に供されており、バンク・オブ・アメリカについては40,000.00米ドルおよびJPモルガンについては140,000.00米ドルである。

注記は財務書類の不可分の一部である。

UBS (Lux) ボンド・シキャブ・ハイ・イールド・ボンド (米ドル)

運用計算書	米ドル	千円
収益	2022年6月1日－2022年11月30日	2022年6月1日－2022年11月30日
当座資産に係る利息	63,383.84	8,411
有価証券利息	17,097,245.07	2,268,804
配当金	56,685.08	7,522
スワップに係る受取利息 (注1)	278,992.66	37,022
貸付証券に係る純収益 (注11)	45,299.88	6,011
その他収益 (注4)	486,578.85	64,569
収益合計	18,028,185.38	2,392,340
費用		
スワップに係る支払利息 (注1)	-192,504.06	-25,545
報酬 (注2)	-1,457,129.76	-193,361
年次税 (注3)	-62,194.49	-8,253
その他の手数料および報酬 (注2)	-36,313.60	-4,819
現金および当座借越に係る利息	-4,984.77	-661
費用合計	-1,753,126.68	-232,640
投資純利益 (損失)	16,275,058.70	2,159,700
実現利益 (損失) (注1)		
オプションなしの時価評価証券に係る 実現利益 (損失)	-27,940,740.79	-3,707,736
オプションに係る実現利益 (損失)	857,472.00	113,787
金融先物に係る実現利益 (損失)	-405,608.40	-53,824
外国為替先物予約に係る実現利益 (損失)	-90,959.69	-12,070
スワップに係る実現利益 (損失)	-3,494,514.24	-463,722
外国為替に係る実現利益 (損失)	1,449,760.94	192,383
実現利益 (損失) 合計	-29,624,590.18	-3,931,183
当期実現純利益 (損失)	-13,349,531.48	-1,771,483
未実現評価益 (評価損) の変動 (注1)		
オプションなしの時価評価証券に係る 未実現評価益 (評価損)	-8,985,651.56	-1,192,396
オプションに係る未実現評価益 (評価損)	-121,213.06	-16,085
外国為替先物予約に係る未実現評価益 (評価損)	-2,213,054.88	-293,672
スワップに係る未実現評価益 (評価損)	-204,488.65	-27,136
未実現評価益 (評価損) の変動合計	-11,524,408.15	-1,529,289
運用活動による純資産の純増加 (減少)	-24,873,939.63	-3,300,772

注記は財務書類の不可分の一部である。

UBS（Lux）bond・シキャプ・ハイ・イールド・bond（米ドル）

純資産の変動	米ドル	千円
	2022年6月1日－2022年11月30日	2022年6月1日－2022年11月30日
期首純資産	617,826,495.66	81,985,576
発行額	43,410,499.38	5,760,573
買戻額	-134,029,284.78	-17,785,686
合計純発行額（買戻額）	-90,618,785.40	-12,025,113
支払配当金	-3,838,506.92	-509,370
投資純収益（損失）	16,275,058.70	2,159,700
実現利益（損失）合計	-29,624,590.18	-3,931,183
未実現評価益（評価損）の変動合計	-11,524,408.15	-1,529,289
運用活動による純資産の純増加（減少）	-24,873,939.63	-3,300,772
期末純資産	498,495,263.71	66,150,321

発行済投資証券口数の変動

	2022年6月1日－2022年11月30日
クラス	P-acc
期首発行済口数	200,848.6960
発行口数	2,409.2840
買戻口数	-14,485.1250
期末発行済口数	188,772.8550

注記は財務書類の不可分の一部である。

財務書類の注記

(2022年11月30日現在)

注1－重要な会計方針の要約

当財務書類は、ルクセンブルグの投資信託に適用される、一般に公正妥当と認められている会計原則に従って作成されている。重要な会計方針は、以下の通りである。

a) 純資産価額の計算

サブ・ファンドまたは投資証券クラスの1口当たり純資産価格、発行価格、買戻価格および乗換価格は、当該サブ・ファンドまたは投資証券クラスの会計通貨で表示され、毎営業日、各投資証券クラスに帰属するサブ・ファンドの純資産総額を、そのサブ・ファンドの投資証券クラスの発行済口数で除して計算される。

「営業日」という用語は、ルクセンブルグにおける通常の銀行営業日（即ち、通常の営業時間中銀行が営業している日）で、かつ12月24日および12月31日、ルクセンブルグにおける非法定の個別休日ならびに各サブ・ファンドの主たる投資先国の証券取引所が閉鎖されている日、またはサブ・ファンド投資資産の50%以上について適切な評価ができない日を除いた日をいう。

「法定外休日」とは、銀行および金融機関が閉鎖している日をいう。さらに、サブ・ファンドであるUBS (Lux) ボンド・シキャプーチャイナ・フィクスト・インカム（人民元）に関して、中華人民共和国または香港の証券取引所が閉鎖されている日は、本サブ・ファンドの営業日とはみなされない。

サブ・ファンドの各投資証券クラスに帰属する純資産価額のパーセンテージは、投資証券の発行または買戻しがある都度変動する。このパーセンテージは、各投資証券クラスの発行済投資証券が、その投資証券クラスに請求される報酬を考慮した上で計算されたサブ・ファンドの発行済投資証券総数に占める比率により決定される。

b) 評価の原則

- ー 流動資金－現金、銀行預金、為替手形および一覧払いの有価証券ならびに未収金、前払費用、現金配当および未受領の宣言または発生した利息のいずれかを問わない－は、その全額で評価される。ただし、当該価額が全額支払われないかまたは受領できない可能性がある場合を除くものとし、この場合、その価値はその正しい価値を表すために適切とみなす控除額を勘案して決定される。
- ー 証券取引所に上場されている証券、デリバティブおよびその他の投資資産は、入手可能な最新の市場価格で評価される。当該証券、デリバティブ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は、その投資資産に関する代表的市場の取引所において入手可能な最終の価格が適用される。

証券取引所における取引が少ない証券、デリバティブおよびその他の資産で、証券取引者間で市場に連動する価格付がなされている流通市場が存在する場合、本投資法人は、かかる証券および投資資産を当該価格に基づいて評価することがある。

証券取引所に上場されていないものの、公認され、大衆に解放されている他の定期的に開かれる規制市場において取引されている証券、デリバティブおよびその他の投資資産は、当該市場で入手可能な最新の価格により評価される。

- － 証券取引所に上場されておらず、別の規制された市場でも取引されておらず、適切な価格が入手できない有価証券およびその他の投資資産は、予想売却価格に基づいて本投資法人が誠実に選んだその他の原則に従って本投資法人が評価する。
- － 証券取引所に上場されていないデリバティブ（店頭派生商品）は、独立した価格提供業者に基づいて評価される。デリバティブについて、利用できる独立した価格提供業者がただ1社だけの場合、入手した評価額の妥当性は、デリバティブが派生した原商品の市場価格に基づき、本投資法人が認めた計算方法により検証される。
- － 譲渡性証券集合投資事業（UCITS）および／または集合投資事業（UCI）の投資証券はこれらの最新の純資産価額で評価される。その他のUCITSおよび／またはUCIの特定の受益証券または投資証券は、ポートフォリオ・マネージャーまたは投資顧問会社から独立している信頼できるサービス提供業者が提供したその価値の見積り（価格見積り）に基づき評価することができる。
- － 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金融市場商品は、関連するカーブに基づいて評価される。カーブに基づく評価は、金利および信用スプレッドの要素を参照する。このプロセスには次の原則が適用される。各金融市場商品には、残余期間が最も近い金利が加えられる。このように計算された金利は、裏付けとなる借り主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。
- － 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、外国為替取引によるヘッジを行わない有価証券、金融市場商品、デリバティブおよびその他の資産は、ルクセンブルグの為替相場の仲値（買呼値と売呼値の中値）あるいは、もしルクセンブルグの為替相場の仲値が入手不能な場合は、それに最も近い、当該通貨の為替相場の仲値で評価される。
- － 定期預金および信託投資資産は、その名目価額に累積利息を加算した金額で評価される。
- － 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。計算はすべての現金流出入額の正味現在価値を基準とする。特別な場合に、内部計算（ブルームバーグにより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、それぞれの証券に依拠し、適用されるUBS評価方針に基づき決定される。

異常な状況の発生により上述した規則に準拠した評価が実行困難または不正確であることが明らかになった場合、本投資法人は、純資産の適切な評価を行うために、一般に認められかつ検証可能な他の評価基準を適用することを認められている。

異常な状況においては、追加評価は1日以内に行われる。新たな評価額は、それ以後に発行または買戻される投資証券の正式な価額となる。

報酬および手数料ならびに原投資対象の売買スプレッドにより、サブ・ファンドの資産および投資対象の売買に係る実際の費用は、入手可能な最新の価格または該当する場合は投資証券1口当たり純資産価格を計算するために用いられる純資産価額とは異なることがある。当該費用は、サブ・ファンドの価値にマイナスの影響を及ぼすものであり「希薄化」と称される。希薄化の影響を軽減するために、取締役会はその裁量により、投資証券1口当たり純資産価格に対して希薄化調整を行うことができる。

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

- 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。
- 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。
- 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、
- 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、(i) 見積もり税金費用、(ii) サブ・ファンドが負担する可能性がある取引費用および(iii) 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。

スイング・プライシングの技法は、すべてのサブ・ファンドに適用される。

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

c) 外国為替先物予約の評価

外国為替先物予約残高の未実現利益(損失)は、評価日の先物為替実勢レートに基づいて評価される。

d) 金融先物契約の評価

金融先物契約は、評価日に適用可能な最新の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増減は、運用計算書に計上される。実現損益はFIFO法に準拠して計算される(即ち、最初に取得した契約が最初に売却されたものとみなされる)。

e) オプションの評価

規制ある市場で取引されている未決済オプションは、当該商品の決済価格または入手可能な最終市場価格で評価される。公認の証券取引所に上場されていないオプション(OTCオプション)の時価は、ブルームバーグ・オプション・プライサー・ファンクショナルリティーより取得し第三者値付機関に対して確認した日足価格に基づいている。オプションに係る実現損益および未実現評価損益の変動は、それぞれ、運用計算書および純資産変動計算書上のオプションに係る実現損益および未実現評価損益の項目において開示される。

オプションは、投資有価証券に含まれる。

f) 公正価額の価格形成原則

公正価額の価格形成原則が、アジア市場の有価証券に主として投資するファンドに関して適用される。公正価額の原則は、特定時のスナップショット価格でファンドの組入証券の全対象資産を再評価することによって、直近の入手可能な取引所の終値に反映されない重要な変更を考慮する。純資産額はその後、再評価価格に基づいて計算される。公正価額の原則は、ファンドに固有のベンチマークの乖離が3%を超える場合にのみ適用される。

g) 有価証券の売却に係る実現純利益(損失)

有価証券の売却に係る実現利益または損失は、売却された有価証券の平均取得原価に基づいて計算される。

h) 外国通貨の換算

種々のサブ・ファンドの参照通貨以外の通貨表示で保有されている銀行勘定、その他純資産、および保有投資有価証券の評価は、評価日における直物終値の仲値で換算される。異なるサブ・ファンドの参照通貨以外の通貨で表示されている収益および費用は、支払日の直物終値の仲値で換算される。外国為替損益は、運用計算書に計上されている。

種々のサブ・ファンドの参照通貨以外の通貨で表示されている有価証券の取得原価は、取得日の直物終値の仲値で換算されている。

i) 有価証券のポートフォリオ取引の会計処理

有価証券のポートフォリオ取引は取引日の翌銀行営業日に計上されている。

j) 連結財務書類

連結財務書類は米ドル建てで表示されている。投資会社の2022年11月30日現在の連結純資産計算書および連結運用計算書に記載されたさまざまな項目の金額は、各サブ・ファンドの財務書類に計上された対応する項目の金額を、下記の為替レートで米ドルに転換した金額の総額に等しい。

下記の為替レートは、2022年11月30日現在の連結財務書類の換算に使用されたものである。

為替レート

1 米ドル=7.142950人民元

1 米ドル=0.971204ユーロ

k) 「モーゲージ担保証券」

本投資法人はその投資方針に従い、「モーゲージ担保証券」に投資することができる。「モーゲージ担保証券」は、証券の形態に統合されたモーゲージ・プールへの参加を意味するものである。対象モーゲージに係る元本および利息の支払いはモーゲージ担保証券の保有者にパススルーされ、そのうちの元本部分により証券のコスト・ベースが減少する。元本および利息の支払いは、米国の準政府機関により保証されることがある。利益または損失は、各元本に対する支払いがある都度計算される。この利益または損失は、運用計算書の「有価証券の売却に係る実現純利益または損失」に計上されている。さらに、対象モーゲージの期限前返済により証券の残存期間が短縮することがあり、それにより本投資法人の予想利回りが影響を受けることがある。

l) 有価証券売却に係る未収金、有価証券購入に係る未払金

「有価証券売却に係る未収金」という勘定は、外国通貨取引で生じた未収金も含んでいる。「有価証券購入に係る未払金」という勘定には、外国通貨取引により生じた未払金も含まれている。

外国為替取引による未収金および未払金は相殺される。

m) スワップ

本投資法人は、それぞれの分野で専門性を持つ一流金融機関を相手方として、金利スワップ契約、金利スワップションに係る先渡レート契約、およびクレジット・デフォルト・スワップを締結することができる。

未実現損益の変動は、運用計算書の「スワップに係る未実現評価益（評価損）」の変動の個所に含まれている。

スワップの手じまいまたは満期到来により生じた利益または損失は、運用計算書の「スワップに係る実現利益（損失）」に計上されている。

n) サブ・ファンド間投資

2022年11月30日現在、或るサブ・ファンド、UBS (Lux) ボンド・シキャブ—コーポレート・ボンド（米ドル）およびUBS (Lux) ボンド・シキャブ—ハイ・イールド・ボンド（米ドル）は、UBS (Lux) ボンド・シキャブの他のサブ・ファンドに以下の投資を行った。

UBS (Lux) ボンド・シキャブ—コーポレート・ボンド（米ドル）	金額（米ドル）
UBS (Lux) ボンド・シキャブ—マルチ・インカム（米ドル） クラスU—X—ACC—CAP投資証券	2,613,451.50
UBS (Lux) ボンド・シキャブ—グローバルSDGコーポレーツ・ サステナブル（米ドル） クラスU—X—ACC投資証券	913,855.50
合計	3,527,307.00

UBS (Lux) ボンド・シキャブ—ハイ・イールド・ボンド（米ドル）	金額（米ドル）
UBS (Lux) ボンド・シキャブ—マルチ・インカム（米ドル） クラスU—X—ACC—CAP投資証券	3,000,629.50
合計	3,000,629.50

サブ・ファンド間投資の総額は、77,966,428.70米ドルである。したがって、事業期間末現在の調整済み連結純資産は、16,217,785,417.98米ドルであった。

注2—定率報酬

本投資法人は、各投資証券クラスに対して、下の表に示されているように、サブ・ファンドの平均純資産価額に基づいて計算される月次定率報酬を支払う。

UBS (Lux) ボンド・シキャブ—コーポレート・ボンド（米ドル）	上限定率報酬
名称に「P」が付く投資証券クラス	年率1.140%

UBS (Lux) ボンド・シキャプ・ハイ・イールド・ボンド (米ドル)

	上限定率報酬
名称に「P」が付く投資証券クラス	年率1.260%

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」「Q」「QL」「I-A1」「I-A2」および「I-A3」のために支払う。

上記の定率報酬の中から、以下の報酬が支払われる。

1. 本投資法人の運用、事務管理、ポートフォリオ管理および販売に関して（該当する場合）、また保管受託銀行のすべての職務（本投資法人の資産の保管および監督、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、以下の規則に従って本投資法人の純資産価額に基づく上限定率報酬が本投資法人の資産から支払われる。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）。

本報酬は、「定率報酬」として運用計算書に計上されている。

関連する上限定率報酬は、該当する投資証券クラスの運用が開始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」の項に記載されている。

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、投資証券の発行および買戻しの決済に関する資産の売買によって生じるかかる追加の費用は、販売目論見書の「純資産価額、発行、買戻しおよび転換価格」の項に基づくスイング・プライシングの適用によりカバーされる。
 - b) 本投資法人の設立、変更、清算および合併に関する監督官庁への費用ならびに監督官庁およびサブ・ファンドが上場されている証券取引所に関する一切の手数料。
 - c) 本投資法人の設立、変更、清算および合併に関する年次監査および認可に関する監査報酬ならびにファンドの管理事務に関して監査人が提供するサービスに関して監査人に支払われるか、または法律によって許可される一切のその他の報酬。
 - d) 本投資法人の設立、販売国における登録、変更、清算および合併に関する法律顧問、税務顧問および公証人に対する報酬ならびに法律で明白に禁止されない限り、本投資法人およびその投資者の利益の全般的な保護に関する手数料。

- e) 本投資法人の純資産価額の公表に関するコストおよび投資者に対する通知に関する一切のコスト（翻訳コストを含む。）。
- f) 本投資法人の法的文書に関するコスト（目論見書、K I I D、年次報告書および半期報告書ならびに居住国および販売が行われる国で法的に要求されるその他の一切の文書）。
- g) 外国の監督官庁への本投資法人の登録に関するコスト（該当する場合、手数料、翻訳コストおよび外国の代表者または支払代理人に対する報酬を含む。）。
- h) 本投資法人による議決権または債権者の権利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利用者の権利に関するコストおよび手数料。
- j) 管理会社、ポートフォリオ・マネジャーまたは保管受託銀行が投資者の利益の保護のために講じた特別措置に関して生じた一切の費用。
- k) 管理会社が投資者の利益につき集団訴訟に関与する場合、管理会社は、第三者に関して生じた費用（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、証明可能かつ開示されており、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。
- l) 本投資法人の取締役役に支払われる手数料、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）。

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。

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。

本投資法人はまた、本投資法人の所得および資産に賦課されるすべての租税、特に年次税を支払う。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、「最大管理報酬」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。

個別サブ・ファンドに割り当てることができる全てのコストは、それぞれのサブ・ファンドに賦課される。

投資証券クラスに割り当てることができるコストは、それらの投資証券クラスに賦課される。しかしながら、コストが幾つかのサブ・ファンド／投資証券クラスまたは全てのサブ・ファンド／投資証券クラスに関係するものである場合は、そのコストは関係するサブ・ファンド／投資証券クラスの純資産価額に比例した形で、それぞれのサブ・ファンドに賦課される。

それぞれの投資方針に基づきUCIまたはUCITSに投資することができるサブ・ファンドの場合、報酬はサブ・ファンド・レベルと同様に、各投資先ファンド・レベルでも発生する。サブ・ファンドの資産が投資される投資先ファンドの管理報酬の上限は、全ての販売報酬を考慮し3%である。

管理会社または、関連する別の会社によって、直接または間接的に、経営陣が共通であること、共通の支配下にあること、直接または間接に実質的に所有されることにより運用されているファンドの受益証券に対する投資の場合、サブ・ファンドによる投資には、投資対象ファンドの発行または買戻しに関する手数料が科せられないことがある。

本投資法人の現行の手数料については、KIIDで参照することができる。

注3－年次税

現在効力を有する法律および規則に従い、本投資法人はルクセンブルグにおいて、各四半期末の本投資法人純資産に基づき年率0.05%または、一定の投資証券クラスについては0.01%の軽減年率で計算され、四半期毎に支払うべき取得税を課せられる。

この年次税は、ルクセンブルグ法の規定に従い既に年次税を支払った他の集合投資会社のユニットまたは投資証券に投資された純資産部分には適用されない。

注4－その他収益

その他収益は、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では、取締役会の提案に基づき、かつサブ・ファンド別の年次会計報告終了後に、各サブ・ファンドまたは各投資証券クラスに関する分配金支払の可否および支払う分配金の程度が決定される。分配金の支払いにより、本投資法人の純資産価額が法に定められた最低資産価額を下回ることがあってはならない。分配を行う場合、その支払いは期末日後4ヶ月以内に行われる。

取締役会は中間配当を支払う権限を与えられており、分配金の支払いを停止する権限も与えられている。

注6－金融先物、オプションおよびスワップに関する契約

2022年11月30日現在のサブ・ファンドによる金融先物、オプションおよびスワップに関する契約ならびにその通貨は以下のとおりである。

a) 金融先物

UBS (Lux) ボンド・シキャブ	債券に係る金融先物 (買い)	債券に係る金融先物 (売り)
ーコーポレート・ボンド (米ドル)	5,428,515.65米ドル	9,164,234.39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

UBS (Lux) ボンド・シキャブ	その他のスワップに係る オプション、従来型 (売り)
ーハイ・イールド・ボンド (米ドル)	2,544,000.00米ドル

c) スワップ

UBS (Lux) ボンド・シキャブ	クレジット・デフォルト・スワップ (買い)	クレジット・デフォルト・スワップ (売り)
該当なし		
UBS (Lux) ボンド・シキャブ	金利に係るスワップおよび先渡しスワップ (買い)	金利に係るスワップおよび先渡しスワップ (売り)
該当なし		
UBS (Lux) ボンド・シキャブ	指数に係るスワップおよび先渡しスワップ (買い)	指数に係るスワップおよび先渡しスワップ (売り)
ーハイ・イールド・ボンド (米ドル)	ー米ドル	22,992,705.09米ドル

注7ーソフト・コミッション契約

2022年6月1日から2022年11月30日までの期間には、UBS (Lux) ボンド・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」はゼロである。

注8ー総費用比率 (TER)

この比率は、スイス・アセット・マネジメント協会 (AMAS) / スイス・ファンズ・アンド・アセット・マネジメント協会 (SFAMA) の現行の「TERの計算と開示に関するガイドライン」に準拠して計算されたもので、純資産に対し継続的に賦課されている全てのコストおよび手数料 (営業費用) の純資産に対するパーセンテージを過去に遡及して表示している。

過去12ヶ月のTER

UBS (Lux) ボンド・シキャブ	総費用比率 (TER)
ーコーポレート・ボンド (米ドル) クラスP-a c c投資証券	1.20%
ーハイ・イールド・ボンド (米ドル) クラスP-a c c投資証券	1.32%

本報告期間中に、適用される定率報酬は変動する場合がある (注記2を参照のこと。)。

運用期間が12か月未満の投資証券クラスに関する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ー後発事象

サブ・ファンドであるUBS (Lux) ボンド・シキャブーマルチ・インカム (米ドル) が、2022年12月13日付で償還した。

注10ー適用ある法律、実行の場所、および正式言語

投資主、本投資法人および保管受託銀行の間で生じた全ての法的紛争の実行場所はルクセンブルグ地方裁判所であり、適用される法律はルクセンブルグ法である。しかしながら、他の国の投資家からクレームがあった場合は、本投資法人および／もしくは保管受託銀行は、本投資法人の投資証券が購入または販売された国の裁判管轄権に服することを選択することができる。

この財務書類の正式なものは英語版である。しかしながら、本投資法人の投資証券の購入または販売が可能であった他国の投資家に対して売却された投資証券の場合は、本投資法人および保管受託銀行は関係する言語への承認された翻訳（即ち本投資法人および保管銀行が承認した翻訳）を、彼らならびに当行を拘束するものとして認めることがある。

注11－貸付証券

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。貸付証券の収益およびコストは、運用計算書に別個に表示される。担保は、貸付証券に関連して受領される。担保は、一般的に借入れられた証券の少なくとも時価に相当する金額の高格付け証券から構成される。

UBSヨーロッパSE ルクセンブルグ支店は、有価証券貸付代理人としての役割を担う。

貸付証券

UBS (Lux) ボンド・シキャブ	2022年11月30日現在の貸付証券による 相手方エクスポージャー*		2022年11月30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
ーコーポレート・ボンド（米ドル）	6,595,796.51 米ドル	7,002,142.07 米ドル	63.72	36.28	0.00
ーハイ・イールド・ボンド（米ドル）	18,095,653.17 米ドル	19,210,467.49 米ドル	63.72	36.28	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11月30日に証券貸付代理人から直接入手されるため、2022年11月30日現在の財務書類の作成に使用された終値および為替レートとは異なる可能性がある。

	UBS (Lux) ボンド・シキャブ ーコーポレート・ボンド（米ドル）	UBS (Lux) ボンド・シキャブ ーハイ・イールド・ボンド（米ドル）
貸付証券収益	6,510.38 米ドル	75,499.80 米ドル
貸付証券費用*		
ユービーエス・ スイス・エイ・ジー	1,953.11 米ドル	22,649.94 米ドル
UBSヨーロッパSE ルクセンブルグ支店	651.04 米ドル	7,549.98 米ドル
貸付証券純収益	3,906.23 米ドル	45,299.88 米ドル

* 2022年6月1日より、総収入の30%を証券貸付サービス・プロバイダーであるユービーエス・スイス・エイ・ジーが、10%を有価証券貸付代理人であるUBSヨーロッパSEルクセンブルグ支店がコスト/手数料として留保している。

注記は財務書類の不可分の一部である。

(2) 【投資有価証券明細表等】

U B S (Lux) ボンド・シキャプコーポレート・ボンド (米ドル)

2022年11月30日現在の投資有価証券ならびにその他純資産明細書

内容	数量／ 名目金額	先物／為替先物予約／ スワップに係る 未実現利益(損失)の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
公認証券取引所に上場されている譲渡可能証券および金融市場商品			
ノートー固定金利			
米ドル			
USD ABBVIE INC 3.20000% 20-21.11.29	2 000 000.00	1 825 956.28	0.94
USD ABBVIE INC 3.80000% 20-15.03.25	1 250 000.00	1 222 921.15	0.63
USD AERCAP IRELAND CAP/ GBL AVIATION TRUST 6.50000% 20-15.07.25	2 000 000.00	2 020 520.14	1.04
USD AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP 1.65000% 21-29.10.24	1 000 000.00	920 165.71	0.47
USD AIR LEASE CORP 5.85000% 22-15.12.27	1 000 000.00	993 219.19	0.51
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITY INC 1.87500% 20-01.02.33	1 500 000.00	1 115 475.81	0.57
USD AMAZON.COM INC 2.50000% 20-03.06.50	1 540 000.00	1 005 903.05	0.52
USD AMERICAN EXPRESS CO 3.95000% 22-01.08.25	1 000 000.00	979 262.91	0.50
USD AMGEN INC 3.15000% 20-21.02.40	830 000.00	638 149.99	0.33
USD ANHEUSER-BUSCH COS 4.70000% 19-01.02.36	3 500 000.00	3 358 231.38	1.73
USD APPLE INC 1.65000% 20-11.05.30	1 660 000.00	1 381 581.13	0.71
USD APPLE INC 3.45000% 15-09.02.45	2 500 000.00	2 065 787.18	1.06
USD ARCELORMITTAL SA 6.55000% 22-29.11.27	1 000 000.00	1 008 620.37	0.52
USD AT&T INC 3.65000% 20-01.06.51	1 000 000.00	732 377.90	0.38
USD AT&T INC 4.35000% 13-15.06.45	1 500 000.00	1 240 633.88	0.64
USD AT&T INC 4.85000% 19-01.03.39	1 000 000.00	916 309.79	0.47
USD BANK OF NOVA SCOTIA/THE 3.45000% 22-11.04.25	1 000 000.00	967 582.08	0.50
USD BARCLAYS PLC-SUB 4.37500% 14-11.09.24	1 870 000.00	1 821 290.50	0.94
USD BP CAPITAL MARKETS AMERICA INC 3.00000% 20-24.02.50	1 000 000.00	689 093.30	0.35
USD CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 3.30000% 22-07.04.25	1 500 000.00	1 445 344.15	0.74
USD CANADIAN PACIFIC RAILWAY 3.10000% 21-02.12.51	1 000 000.00	703 059.81	0.36
USD CCO LLC/CAPITAL 6.38400% 16-23.10.35	1 120 000.00	1 102 012.18	0.57
USD CIGNA CORP 2.40000% 20-15.03.30	2 000 000.00	1 698 670.94	0.87
USD CITIGROUP INC 3.70000% 16-12.01.26	3 190 000.00	3 062 081.99	1.57
USD CREDIT AGRICOLE SA-144A-SUB 4.37500% 15-17.03.25	1 660 000.00	1 592 205.60	0.82
USD CREDIT SUISSE AG/NEW YORK NY 3.70000% 22-21.02.25	1 000 000.00	910 421.17	0.47
USD CVS HEALTH CORP 5.05000% 18-25.03.48	1 500 000.00	1 392 983.63	0.72
USD DEERE & CO 3.90000% 12-09.06.42	1 000 000.00	899 424.67	0.46
USD ENBRIDGE INC 2.50000% 21-01.08.33	1 500 000.00	1 178 196.17	0.61
USD EQT CORP 3.90000% 17-01.10.27	1 000 000.00	925 711.66	0.48
USD EQUINOR ASA 2.87500% 20-06.04.25	2 490 000.00	2 394 738.05	1.23
USD ESTEE LAUDER COS INC 4.37500% 15-15.06.45	830 000.00	741 809.93	0.38
USD EVERSOURCE ENERGY 3.37500% 22-01.03.32	1 000 000.00	876 078.89	0.45
USD EXELON CORP 4.95000% 16-15.06.35	1 450 000.00	1 404 181.29	0.72
USD FORD MOTOR CREDIT CO 3.37500% 20-13.11.25	1 000 000.00	922 630.00	0.47
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 3.10000% 22-12.01.32	1 000 000.00	802 221.17	0.41
USD GEORGIA POWER CO 3.70000% 20-30.01.50	1 660 000.00	1 263 940.39	0.65
USD GILEAD SCIENCES INC 2.60000% 20-01.10.40	1 660 000.00	1 186 426.34	0.61
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.80000% 20-15.03.30	1 000 000.00	908 907.62	0.47
USD HCA INC 5.00000% 14-15.03.24	1 870 000.00	1 862 475.34	0.96
USD HCA INC 5.25000% 19-15.06.49	1 250 000.00	1 093 157.77	0.56
USD HOME DEPOT INC/THE 4.20000% 13-01.04.43	2 590 000.00	2 319 357.31	1.19
USD INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC 3.00000% 20-15.06.50	1 825 000.00	1 269 325.64	0.65
USD KINROSS GOLD CORP 5.95000% 14-15.03.24	1 000 000.00	1 003 618.49	0.52
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 4.37500% 16-01.06.46	1 000 000.00	842 862.08	0.43

内容	数量／ 名目金額	先物／為替先物予約／ スワップに係る 未実現利益 (損失) の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
USD KROGER CO 3.87500% 16-15.10.46	1 000 000.00	773 165.69	0.40
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.45000% 18-08.05.25	2 000 000.00	1 955 479.14	1.01
USD LOWE ' S COS INC 2.80000% 21-15.09.41	2 250 000.00	1 589 113.91	0.82
USD LSEGA FINANCING PLC-144A 3.20000% 21-06.04.41	2 000 000.00	1 481 474.80	0.76
USD MERCK & CO INC 3.70000% 15-10.02.45	1 150 000.00	963 162.52	0.50
USD MICROSOFT CORP 2.52500% 20-01.06.50	2 000 000.00	1 377 376.70	0.71
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GRP INC 2.19300% 20-25.02.25	2 490 000.00	2 325 915.22	1.20
USD NATWEST GROUP PLC 4.80000% 16-05.04.26	1 660 000.00	1 617 853.40	0.83
USD NEXTERA ENERGY CAP 2.44000% 21-15.01.32	1 500 000.00	1 221 757.19	0.63
USD NORFOLK SOUTHERN CORP 4.10000% 19-15.05.49	1 660 000.00	1 368 087.44	0.70
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 2.20000% 20-14.08.30	1 500 000.00	1 287 145.80	0.66
USD NUTRIEN LTD 5.90000% 22-07.11.24	1 500 000.00	1 517 324.55	0.78
USD NVIDIA CORP 2.85000% 20-01.04.30	830 000.00	732 170.88	0.38
USD ONEOK INC 6.10000% 22-15.11.32	1 000 000.00	1 018 205.09	0.52
USD ORACLE CORP 4.37500% 15-15.05.55	3 000 000.00	2 280 957.12	1.17
USD ORACLE CORP 6.90000% 22-09.11.52	850 000.00	941 438.07	0.48
USD PAYPAL HOLDINGS INC 2.30000% 20-01.06.30	1 660 000.00	1 373 492.20	0.71
USD PEPSICO INC 2.62500% 21-21.10.41	1 660 000.00	1 256 881.56	0.65
USD PRUDENTIAL FINANCIAL INC 3.93500% 18-07.12.49	1 986 000.00	1 560 313.46	0.80
USD PUBLIC STORAGE 3.09400% 17-15.09.27	1 500 000.00	1 403 903.03	0.72
USD QUALCOMM INC 4.30000% 17-20.05.47	250 000.00	219 347.84	0.11
USD QUALCOMM INC 6.00000% 22-20.05.53	850 000.00	925 035.88	0.48
USD QUANTA SERVICES INC 3.05000% 21-01.10.41	1 500 000.00	1 008 683.95	0.52
USD RABOBANK NEDERLAND NV-SUB 3.75000% 16-21.07.26	1 000 000.00	938 702.17	0.48
USD SABINE PASS LIQUEFACTION LLC 5.00000% 17-15.03.27	1 450 000.00	1 431 278.23	0.74
USD SALESFORCE.COM INC 2.70000% 21-15.07.41	830 000.00	612 673.50	0.31
USD SHERWIN-WILLIAMS CO 4.50000% 17-01.06.47	850 000.00	736 300.56	0.38
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 2.69600% 19-16.07.24	2 000 000.00	1 913 635.80	0.98
USD T-MOBILE USA INC 3.60000% 21-15.11.60	1 900 000.00	1 316 918.50	0.68
USD TARGET CORP 1.95000% 22-15.01.27	2 000 000.00	1 828 300.74	0.94
USD TELEFONICA EMISIONES SA 5.52000% 19-01.03.49	500 000.00	427 611.19	0.22
USD TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.12700% 20-29.05.50	1 000 000.00	722 427.06	0.37
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 3.95000% 12-15.10.42	956 000.00	812 490.82	0.42
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.10000% 21-22.03.28	1 500 000.00	1 312 390.92	0.67
USD VICI PROPERTIES LP 5.62500% 22-15.05.52	900 000.00	812 511.00	0.42
USD VODAFONE GROUP PLC 4.87500% 19-19.06.49	1 000 000.00	852 656.96	0.44
USD WALT DISNEY CO 2.75000% 19-01.09.49	1 800 000.00	1 215 400.29	0.62
米ドル合計		103 836 507.20	53.39
ノート合計ー固定金利		103 836 507.20	53.39
ノートー変動金利			
米ドル			
USD BANK OF AMERICA CORP 4.271%/VAR 18-23.07.29	1 500 000.00	1 412 011.65	0.73
USD BARCLAYS PLC 2.894%/VAR 21-24.11.32	1 000 000.00	763 788.46	0.39
USD CITIGROUP INC 2.572%/VAR 20-03.06.31	1 000 000.00	819 545.20	0.42
USD CITIGROUP INC 3.352%/VAR 19-24.04.25	1 000 000.00	967 024.93	0.50
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.272%/VAR 17-29.09.25	2 000 000.00	1 925 439.96	0.99
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 1.992%/VAR 21-27.01.32	1 000 000.00	772 049.00	0.40
USD HSBC HOLDINGS PLC 2.633%/VAR 19-07.11.25	1 000 000.00	929 720.44	0.48
USD HSBC HOLDINGS PLC 2.099%/VAR 20-04.06.26	2 070 000.00	1 876 573.07	0.96
USD JPMORGAN CHASE & CO 2.545%/VAR 21-08.11.32	3 000 000.00	2 401 039.77	1.23
USD JPMORGAN CHASE & CO 4.912%/VAR 22-25.07.33	1 000 000.00	964 314.65	0.50
USD WESTPAC BANKING CORP-SUB 2.668%/VAR 20-15.11.35	1 000 000.00	734 005.10	0.38
米ドル合計		13 565 512.23	6.98
ノート合計ー変動金利		13 565 512.23	6.98

内容	数量／ 名目金額	先物／為替先物予約／ スワップに係る 未実現利益(損失)の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
中期債券－固定金利			
米ドル			
USD ROYAL BANK OF CANADA 2.30000% 21-03.11.31	830 000.00	668 830.48	0.34
米ドル合計		668 830.48	0.34
中期債券合計－固定金利			668 830.48 0.34
中期債券－変動金利			
米ドル			
USD BANK OF AMERICA CORP 3.559%/VAR 19-23.04.27	2 000 000.00	1 886 486.52	0.97
USD BANK OF AMERICA CORP 2.496%/3M LIBOR+99BP 20-13.02.31	4 500 000.00	3 702 160.35	1.90
USD MORGAN STANLEY 3.622%/VAR 20-01.04.31	3 000 000.00	2 673 473.91	1.38
USD MORGAN STANLEY 3.772%/VAR 18-24.01.29	1 240 000.00	1 141 844.54	0.59
米ドル合計		9 403 965.32	4.84
中期債券合計－変動金利			9 403 965.32 4.84
長期債券－固定金利			
米ドル			
USD BALTIMORE GAS & ELECTRIC CO 3.50000% 16-15.08.46	1 040 000.00	784 938.40	0.40
USD CONSOLIDATED EDISON CO OF NEW YORK INC 4.65000% 18-01.12.48	1 240 000.00	1 089 131.06	0.56
USD DUKE ENERGY CAROLINAS LLC 6.05000% 08-15.04.38	765 000.00	811 071.13	0.42
USD DUKE ENERGY OHIO INC 4.30000% 19-01.02.49	1 660 000.00	1 373 942.34	0.71
USD EL PASO NATURAL GAS CO 8.37500% 03-15.06.32	1 050 000.00	1 207 168.10	0.62
USD SAN DIEGO GAS & ELECTRIC CO 4.10000% 19-15.06.49	830 000.00	685 332.76	0.35
USD SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 3.65000% 20-01.02.50	2 000 000.00	1 492 329.02	0.77
USD SOUTHERN CALIFORNIA GAS CO 2.55000% 20-01.02.30	1 500 000.00	1 287 269.61	0.66
米ドル合計		8 731 182.42	4.49
長期債券合計－固定金利			8 731 182.42 4.49
長期債券－変動金利			
米ドル			
USD BP CAPITAL MARKETS PLC-SUB 4.875%/VAR 20-PRP	2 000 000.00	1 759 499.99	0.90
米ドル合計		1 759 499.99	0.90
長期債券合計－変動金利			1 759 499.99 0.90
公認証券取引所に上場されている譲渡可能証券および金融市場商品合計			137 965 497.64 70.94
他の規制市場で取引されている譲渡可能証券および金融市場商品			
ノート－固定金利			
米ドル			
USD AKER BP ASA-144A 3.75000% 20-15.01.30	1 000 000.00	886 235.89	0.46
USD ALCON FINANCE CORP-144A 5.75000% 22-06.12.52	1 000 000.00	1 011 617.64	0.52
USD ANTHEM INC 5.35000% 22-15.10.25	1 000 000.00	1 014 028.94	0.52
USD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK-144A-SUB 2.57000% 20-25.11.35	1 500 000.00	1 094 034.94	0.56
USD BAXTER INTERNATIONAL INC 1.91500% 22-01.02.27	1 000 000.00	891 138.91	0.46
USD CHENIERE CORPUS CHRISTI HLDGS LLC 5.12500% 17-30.06.27	250 000.00	250 338.33	0.13
USD CSL FINANCE PLC-144A 4.25000% 22-27.04.32	1 000 000.00	945 895.80	0.49
USD DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC-144A 3.30000% 15-19.05.25	1 750 000.00	1 678 217.89	0.86

内容	数量／ 名目金額	先物／為替先物予約／ スワップに係る 未実現利益（損失）の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める％
USD DELTA AIR LINES INC-144A 7.00000% 20-01.05.25	2 000 000.00	2 037 975.72	1.05
USD EAST OHIO GAS CO/THE-144A 1.30000% 20-15.06.25	857 000.00	776 370.65	0.40
USD HONEYWELL INTERNATIONAL INC 5.00000% 22-15.02.33	850 000.00	874 842.81	0.45
USD LUNDIN ENERGY FINANCE BV-144A 2.00000% 21-15.07.26	1 750 000.00	1 540 710.41	0.79
USD NESTLE HOLDINGS INC-144A 1.50000% 21-14.09.28	2 070 000.00	1 759 185.48	0.90
USD NXP BV / NXP FUNDING LLC 5.55000% 22-01.12.28	2 070 000.00	2 060 296.87	1.06
USD ONCOR ELECTRIC DELIVERY CO LLC-144A 4.55000% 22-15.09.32	1 000 000.00	984 749.27	0.51
USD PARKER-HANNIFIN CORP 4.25000% 22-15.09.27	1 500 000.00	1 454 739.26	0.75
USD ROCHE HOLDINGS INC-144A 2.07600% 21-13.12.31	1 500 000.00	1 238 759.91	0.64
USD SCENTRE GROUP TRUST 1 / 2-144A 3.25000% 15-28.10.25	2 000 000.00	1 867 216.60	0.96
USD SOCIETE GENERALE SA-144A 4.00000% 17-12.01.27	1 400 000.00	1 290 909.49	0.66
USD TECK RESOURCES LTD 3.90000% 20-15.07.30	1 000 000.00	899 022.75	0.46
USD TRITON CONTAINER INTERNATIONAL LTD-144A 1.15000% 21-07.06.24	1 000 000.00	921 437.50	0.47
USD UNITED AIRLINES INC-144A 4.37500% 21-15.04.26	1 000 000.00	931 025.20	0.48
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 5.25000% 22-15.02.28	1 000 000.00	1 028 648.21	0.53
米ドル合計		27 437 398.47	14.11
ノート合計－固定金利		27 437 398.47	14.11
ノート－変動金利			
米ドル			
USD BNP PARIBAS-144A 3.052%/VAR 20-13.01.31	1 400 000.00	1 160 820.76	0.59
USD ING GROEP NV 3.869%/VAR 22-28.03.26	1 250 000.00	1 200 778.88	0.62
米ドル合計		2 361 599.64	1.21
ノート合計－変動金利		2 361 599.64	1.21
中期債券－固定金利			
米ドル			
USD NBN CO LTD-144A 0.87500% 21-08.10.24	2 500 000.00	2 297 584.00	1.18
米ドル合計		2 297 584.00	1.18
中期債券合計－固定金利		2 297 584.00	1.18
中期債券－変動金利			
米ドル			
USD COMMONWEALTH BANK AUSTRALIA-144A-SUB 3.610%/VAR 19-12.09.34	1 500 000.00	1 225 566.00	0.63
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-144A-SUB 3.933%/VAR 19-02.08.34	1 250 000.00	1 049 484.27	0.54
米ドル合計		2 275 050.27	1.17
中期債券合計－変動金利		2 275 050.27	1.17
長期債券－固定金利			
米ドル			
USD DUKE ENERGY FLORIDA LLC 5.95000% 22-15.11.52	750 000.00	825 139.25	0.42
USD NGPL PIPECO LLC-144A 4.87500% 17-15.08.27	1 240 000.00	1 179 925.66	0.61
USD SYDNEY AIRPORT FINANCE CO PTY LTD-144A 3.62500% 16-28.04.26	1 000 000.00	932 091.10	0.48
米ドル合計		2 937 156.01	1.51
長期債券合計－固定金利		2 937 156.01	1.51
他の規制市場で取引されている譲渡可能証券および金融市場商品合計		37 308 788.39	19.18

内容	数量／ 名目金額	先物／為替先物予約／ スワップに係る 未実現利益（損失）の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める％
公認証券取引所に上場されておらず他の規制市場において取引もされていない譲渡可能証券および金融市場商品			
ノートー固定金利			
米ドル			
USD COMCAST CORP 2.88700% 22-01.11.51	3 250 000.00	2 168 045.19	1.12
USD GE CAPITAL FUNDING LLC 4.55000% 21-15.05.32	1 000 000.00	972 073.18	0.50
米ドル合計		3 140 118.37	1.62
ノートー合計ー固定金利	3 140 118.37		1.62
公認証券取引所に上場されておらず他の規制市場において取引もされていない譲渡可能証券および金融市場商品合計	3 140 118.37		1.62
最近発行された譲渡可能証券および金融市場商品			
ノートー固定金利			
米ドル			
USD BROADCOM INC-144A 4.92600% 22-15.05.37	1 250 000.00	1 096 865.94	0.56
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-144A 6.80000% 22-14.10.25	1 250 000.00	1 294 400.86	0.67
USD MAGALLANES INC-144A 5.05000% 22-15.03.42	2 750 000.00	2 201 507.61	1.13
米ドル合計		4 592 774.41	2.36
ノートー合計ー固定金利		4 592 774.41	2.36
最近発行された譲渡可能証券および金融市場商品合計		4 592 774.41	2.36
ルクセンブルグ2010年12月17日法（改正済）の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs			
投資信託、オープン・エンド型			
ルクセンブルグ			
USD UBS (LUX) BOND SICAV - MULTI INCOME (USD)-U-X-ACC- CAP	270.00	2 613 451.50	1.34
USD UBS(LUX)BOND SICAV-GLBL SDG CORPORATES SUSTNBLE(USD) U-X-ACC	90.00	913 855.50	0.47
ルクセンブルグ合計		3 527 307.00	1.81
投資信託、オープン・エンド型合計		3 527 307.00	1.81
ルクセンブルグ2010年12月17日法（改正済）の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs合計		3 527 307.00	1.81
投資有価証券合計		186 534 485.81	95.91

内容	数量／ 名目金額	先物／為替先物予約／ スワップに係る 未実現利益（損失）の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める％
デリバティブ商品			
公認証券取引所に上場されたデリバティブ商品			
債券先物			
USD US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 22.03.23	-3.00	945.31	0.00
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 22.03.23	-50.00	-39 250.00	-0.02
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.23	-15.00	-9 593.75	-0.01
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.23	50.00	31 054.71	0.02
債券先物合計		-16 843.73	-0.01
公認証券取引所に上場されたデリバティブ商品合計		-16 843.73	-0.01
デリバティブ商品合計		-16 843.73	-0.01
外国為替先物予約			
購入通貨／購入金額／売却通貨／売却金額／満期日			
CHF 10 646 400.00 USD 11 402 194.46 12.1.2023		-164 676.68	-0.09
EUR 6 160 700.00 USD 6 450 456.20 12.1.2023		-84 225.68	-0.04
EUR 75 500.00 USD 78 454.53 12.1.2023		-435.73	0.00
CHF 130 200.00 USD 137 537.65 12.1.2023		-108.58	0.00
EUR 80 400.00 USD 83 713.28 12.1.2023		-631.01	0.00
CHF 138 100.00 USD 146 390.01 12.1.2023		-622.31	0.00
外国為替先物予約合計		-250 699.99	-0.13
現金性銀行預金、要求払預金および預金勘定およびその他の当座資産		2 412 925.78	1.24
その他の資産および負債		5 804 036.88	2.99
純資産合計		194 483 904.75	100.00

注記は財務書類の不可分の一部である。

U B S (Lux) ボンド・シキャブ・ハイ・イールド・ボンド (米ドル)

2022年11月30日現在の投資有価証券ならびにその他純資産明細書

内容	数量／ 名目金額	先物／為替先物予約／ スワップに係る 未実現利益（損失）の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める％
----	-------------	---	---------------

公認証券取引所に上場されている譲渡可能証券および金融市場商品

ノートー固定金利

ユーロ

EUR	BOXER PARENT CO INC-REG-S 6.50000% 20-02.10.25	1 440 000.00	1 414 705.49	0.28
EUR	DKT FINANCE APS-REG-S 7.00000% 18-17.06.23	4 560 000.00	4 570 997.07	0.92
EUR	NIDDA HEALTHCARE HOLDING GMBH-REG-S 7.50000% 22-21.08.26	1 300 000.00	1 290 022.74	0.26
EUR	SUMMER BC HOLDCO A SARL-REG-S 9.25000% 19-31.10.27	1 830 000.00	1 315 943.98	0.27
EUR	TEVA PHARMACEUTICAL FIN 6.00000% 20-31.01.25	1 425 000.00	1 459 731.59	0.29
EUR	TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 3.75000% 21-09.05.27	925 000.00	848 730.84	0.17
ユーロ合計			10 900 131.71	2.19

米ドル

USD	ALTICE FINANCING SA-144A 5.00000% 20-15.01.28	1 384 000.00	1 129 177.92	0.23
USD	ALTICE FRANCE HOLDING SA 6.00000% 20-15.02.28	777 000.00	521 048.79	0.10
USD	ALTICE FRANCE SA/FRANCE-144A 5.12500% 21-15.07.29	1 242 000.00	978 832.62	0.20
USD	ALTICE FRANCE-144A 8.12500% 18-01.02.27	2 955 000.00	2 814 637.50	0.56
USD	APACHE CORP 5.10000% 10-01.09.40	1 992 000.00	1 638 420.00	0.33
USD	ARCONIC INC 6.75000% 98-15.01.28	1 617 000.00	1 649 340.00	0.33
USD	ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-144A 4.12500% 19-15.08.26	215 000.00	189 200.00	0.04
USD	AVIS BUDGET CAR RENT LLC/FIN INC-144A 5.37500% 21-01.03.29	836 000.00	736 055.62	0.15
USD	BOMBARDIER INC-144A 7.12500% 21-15.06.26	2 445 000.00	2 402 188.05	0.48
USD	BUCKEYE PARTNERS LP 5.85000% 13-15.11.43	845 000.00	638 841.12	0.13
USD	BUCKEYE PARTNERS LP 5.60000% 14-15.10.44	595 000.00	446 250.00	0.09
USD	CARNIVAL CORP-144A 7.62500% 20-01.03.26	1 124 000.00	941 361.24	0.19
USD	CELANESE US HOLDINGS LLC 6.33000% 22-15.07.29	1 320 000.00	1 268 353.60	0.25
USD	COMMERCIAL METALS CO 4.12500% 22-15.01.30	760 000.00	654 015.58	0.13
USD	CONSOLIDATED ENERGY FINANCE SA-144A 5.62500% 21-15.10.28	2 163 000.00	1 889 921.25	0.38
USD	DANA INC 4.25000% 21-01.09.30	930 000.00	744 017.40	0.15
USD	DANA INC 5.62500% 20-15.06.28	825 000.00	759 000.00	0.15
USD	DELTA AIR LINES INC 4.37500% 18-19.04.28	470 000.00	429 507.15	0.09
USD	DISH DBS CORP 5.87500% 14-15.11.24	1 105 000.00	1 050 037.30	0.21
USD	ELANCO ANIMAL HEALTH INC 4.90000% 19-28.08.28	420 000.00	387 882.60	0.08
USD	ENCOMPASS HEALTH CORP 4.50000% 19-01.02.28	4 039 000.00	3 632 092.68	0.73
USD	EQT CORP STEP-UP/DOWN 20-01.02.30	1 837 000.00	1 932 631.63	0.39
USD	FIRSTENERGY CORP 4.85000% 17-15.07.47	1 084 000.00	955 134.08	0.19
USD	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 5.12500% 20-16.06.25	3 961 000.00	3 835 483.04	0.77
USD	FORD MOTOR CREDIT CO 4.95000% 22-28.05.27	440 000.00	416 402.80	0.08
USD	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 5.11300% 19-03.05.29	925 000.00	862 368.25	0.17
USD	GENESIS ENERGY LP 8.00000% 20-15.01.27	2 453 000.00	2 341 171.36	0.47
USD	ICAHN ENTERPRISES FINANCE CORP 5.25000% 20-15.05.27	450 000.00	414 445.50	0.08
USD	ICAHN ENTERPRISES LP/FINANCE CORP 6.25000% 19-15.05.26	1 280 000.00	1 263 449.60	0.25
USD	INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC-144A 6.25000% 18-15.01.27	1 100 000.00	1 093 125.00	0.22
USD	ITHACA ENERGY NORTH SEA PLC-REG-S 9.00000% 21-15.07.26	1 273 000.00	1 260 270.00	0.25
USD	JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-144A 7.75000% 20-15.10.25	2 055 000.00	1 869 823.95	0.38
USD	KB HOME 6.87500% 19-15.06.27	945 000.00	942 524.10	0.19
USD	L BRANDS INC 6.69400% 18-15.01.27	450 000.00	437 108.28	0.09
USD	MURPHY OIL CORP 7.05000% 99-01.05.29	2 296 000.00	2 260 660.70	0.45
USD	NEPTUNE ENERGY BONDCO PLC-144A 6.62500% 18-15.05.25	4 072 000.00	3 997 976.90	0.80
USD	NEWELL BRANDS INC 5.37500% 16-01.04.36	1 390 000.00	1 189 770.50	0.24
USD	NEWELL BRANDS INC 5.50000% 16-01.04.46	175 000.00	134 750.00	0.03
USD	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 8.50000% 20-15.07.27	1 423 000.00	1 551 070.00	0.31

内容	数量／ 名目金額	先物／為替先物予約／ スワップに係る 未実現利益（損失）の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める％
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 6.37500% 20-01.09.28	1 333 000.00	1 360 993.00	0.27
USD OCEANEERING INTERNATIONAL INC 4.65000% 14-15.11.24	3 114 000.00	3 017 808.54	0.61
USD OCEANEERING INTERNATIONAL INC 6.00000% 18-01.02.28	246 000.00	222 862.47	0.05
USD PG&E CORP 5.00000% 20-01.07.28	2 540 000.00	2 343 429.40	0.47
USD PRIMO WATER HOLDINGS INC-144A 4.37500% 21-30.04.29	3 404 000.00	2 941 600.64	0.59
USD ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD 7.50000% 97-15.10.27	1 267 000.00	1 113 879.42	0.22
USD SOUTHWESTERN ENERGY CO 5.37500% 21-15.03.30	2 059 000.00	1 935 871.80	0.39
USD SPRINGLEAF FINANCE CORP 7.12500% 18-15.03.26	4 695 000.00	4 548 492.52	0.91
USD TELECOM ITALIA CAPITAL 7.20000% 06-18.07.36	1 225 000.00	1 015 402.50	0.20
USD TELECOM ITALIA CAPITAL 7.72100% 08-06.04.38	1 200 000.00	1 009 356.00	0.20
USD TRANSDIGM INC-SUB 5.50000% 20-15.11.27	1 425 000.00	1 343 062.50	0.27
USD TRANSDIGM INC-SUB 6.37500% 17-15.06.26	1 618 000.00	1 589 086.34	0.32
USD TRANSDIGM INC-SUB 7.50000% 19-15.03.27	1 740 000.00	1 744 350.00	0.35
USD UNITED AIRLINES INC-144A 4.62500% 21-15.04.29	2 090 000.00	1 860 553.62	0.37
USD VEDANTA RESOURCES PLC-REG-S 7.12500% 13-31.05.23	350 000.00	320 250.00	0.06
USD VIRGIN MEDIA VENDOR FINANC-144A 5.00000% 20-15.07.28	1 690 000.00	1 448 769.40	0.29
USD WESTERN GAS PARTNERS LP 5.45000% 14-01.04.44	715 000.00	587 472.64	0.12
USD ZIGGO BV-144A 4.87500% 19-15.01.30	1 038 000.00	882 300.00	0.18
米ドル合計		80 943 886.90	16.23
ノート合計－固定金利		91 844 018.61	18.42
ノート－変動金利			
米ドル			
USD CREDIT AGRICOLE SA-144A-SUB 8.125%/VAR 16-PRP	1 665 000.00	1 691 490.15	0.34
米ドル合計		1 691 490.15	0.34
ノート合計－変動金利		1 691 490.15	0.34
長期債券－固定金利			
ユーロ			
EUR GAMMA BONDCO SARL-REG-S 8.12500% 21-15.11.26	2 345 000.00	2 040 277.22	0.41
EUR JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-REG-S 2.20000% 17-15.01.24	3 160 000.00	3 111 032.53	0.62
EUR LHMC FINCO 2 SARL-REG-S (PIK) 7.25000% 19-02.10.25	1 716 498.00	1 528 794.22	0.31
EUR PINNACLE BIDCO PLC-REG-S 5.50000% 20-15.02.25	1 855 000.00	1 709 290.23	0.34
EUR SUMMER BIDCO BV-REG-S (PIK) 9.00000% 19-15.11.25	2 450 000.00	2 226 040.53	0.45
ユーロ合計		10 615 434.73	2.13
英ポンド			
GBP GALAXY FINCO LTD-REG-S 9.25000% 19-31.07.27	2 800 000.00	2 649 502.89	0.53
英ポンド合計		2 649 502.89	0.53
米ドル			
USD ALTICE FINANCING SA-144A 5.75000% 21-15.08.29	1 637 000.00	1 338 673.12	0.27
USD CHEMOURS CO/THE 5.37500% 17-15.05.27	524 000.00	474 220.00	0.10
USD DEUTSCHE BANK AG-SUB 4.50000% 15-01.04.25	2 720 000.00	2 579 044.21	0.52
USD FORD MOTOR CO 6.62500% 98-01.10.28	1 595 000.00	1 612 162.20	0.32
USD FORD MOTOR CO 7.45000% 99-16.07.31	1 330 000.00	1 402 858.73	0.28
USD INEOS QUATTRO FINANCE 2 PLC-144A 3.37500% 21-15.01.26	1 425 000.00	1 266 939.00	0.25
USD NORDSTROM INC 6.95000% 98-15.03.28	420 000.00	401 074.86	0.08
USD SPRINT CAPITAL CORPORATION 6.87500% 98-15.11.28	1 444 000.00	1 530 076.84	0.31
USD VEDANTA RESOURCES FINANCE II PLC-REG-S 8.00000% 19-23.04.23	3 170 000.00	2 951 666.25	0.59
米ドル合計		13 556 715.21	2.72
長期債券合計－固定金利		26 821 652.83	5.38

内容	数量／ 名目金額	先物／為替先物予約／ スワップに係る 未実現利益(損失)の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
長期債券—変動金利			
ユーロ			
EUR GOLDEN GOOSE SPA-REG-S 3M EURIBOR+487.5BP 21-14.05.27	1 110 000.00	1 058 050.33	0.21
ユーロ合計		1 058 050.33	0.21
米ドル			
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 6.500%/VAR 14-PRP	2 176 000.00	2 146 469.00	0.43
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 6.000%/3M LIBOR+330BP 13-PRP	1 886 000.00	1 867 140.00	0.37
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 6.100%/VAR 14-PRP	1 015 000.00	984 550.00	0.20
米ドル合計		4 998 159.00	1.00
長期債券合計—変動金利		6 056 209.33	1.21
公認証券取引所に上場されている譲渡可能証券および金融市場商品合計		126 413 370.92	25.35
他の規制市場で取引されている譲渡可能証券および金融市場商品			
株式			
米国			
USD CITIGROUP INC 5.95%-FR SUB PERP USD1000 ' A	2 703 000.00	2 686 592.79	0.54
米国合計		2 686 592.79	0.54
株式合計		2 686 592.79	0.54
ノートー固定金利			
米ドル			
USD ACADEMY LTD-144A 6.00000% 20-15.11.27	2 337 000.00	2 212 304.11	0.44
USD ACADIA HEALTHCARE CO INC-144A 5.00000% 20-15.04.29	1 182 000.00	1 090 525.02	0.22
USD AFFINITY GAMING-144A 6.87500% 20-15.12.27	3 871 000.00	3 320 698.64	0.67
USD AHEAD DB HOLDINGS LLC-144A 6.62500% 21-01.05.28	1 796 000.00	1 467 367.92	0.29
USD ALLISON TRANSMISSION INC-144A 5.87500% 19-01.06.29	1 679 000.00	1 587 059.29	0.32
USD AMERICAN AIRLINES INC-144A 5.50000% 21-20.04.26	922 000.00	894 172.38	0.18
USD AMERICAN BUILDER & CONTRACT SUPPLY-144A 4.00000% 19-15.01.28	660 000.00	597 306.60	0.12
USD AMERICAN BUILDERS & CONTRAC SUPPLY-144A 3.87500% 21-15.11.29	837 000.00	690 273.90	0.14
USD AMSTED INDUSTRIES INC-144A 5.62500% 19-01.07.27	876 000.00	827 960.98	0.17
USD AMSTED INDUSTRIES INC-144A 4.62500% 19-15.05.30	559 000.00	472 355.00	0.09
USD ANTERO MIDSTREAM PARTNERS LP-144A 5.37500% 21-15.06.29	1 175 000.00	1 083 937.50	0.22
USD ANTERO RESOURCES FIN CORP-144A 7.62500% 21-01.02.29	830 000.00	846 883.32	0.17
USD ARAMARK SERVICES INC-144A 5.00000% 18-01.02.28	3 035 000.00	2 838 240.95	0.57
USD ARCHROCK PARTNERS LP/FIN CORP-144A 6.87500% 19-01.04.27	1 795 000.00	1 736 662.50	0.35
USD ARCHROCK PARTNERS LP/FIN CORP-144A 6.25000% 19-01.04.28	600 000.00	556 500.00	0.11
USD ARCONIC ROLLED PRODUCTS CORP-144A 6.12500% 20-15.02.28	3 574 000.00	3 355 807.30	0.67
USD ARCOSA INC-144A 4.37500% 21-15.04.29	2 519 000.00	2 190 673.92	0.44
USD ASBURY AUTOMOTIVE GROUP INC-144A 4.62500% 21-15.11.29	980 000.00	855 050.00	0.17
USD ASCENT RESOURCES UTICA HOLDINGS-144A 7.00000% 18-01.11.26	1 100 000.00	1 078 275.87	0.22
USD ASCENT RESOURCES UTICA HOLDINGS-144A 5.87500% 21-30.06.29	1 904 000.00	1 715 960.96	0.34
USD ASGN INC-144A 4.62500% 19-15.05.28	4 044 000.00	3 609 269.99	0.72
USD AVANTOR FUNDING INC-144A 4.62500% 20-15.07.28	2 710 000.00	2 493 200.00	0.50
USD AVIS BUDGET CAR RENT LLC/FIN INC-144A 5.75000% 19-15.07.27	1 585 000.00	1 465 980.76	0.29
USD BEACON ROOFING SUPPLY INC-144A 4.50000% 19-15.11.26	654 000.00	603 297.00	0.12
USD BEACON ROOFING SUPPLY INC-144A 4.12500% 21-15.05.29	861 000.00	724 057.95	0.15
USD BIG RIVER STEEL LLC/BRS FIN CORP-144A 6.62500% 20-31.01.29	2 351 000.00	2 258 634.83	0.45
USD BLOCK INC 3.50000% 22-01.06.31	1 692 000.00	1 373 074.92	0.28

内容	数量／ 名目金額	先物／為替先物予約／ スワップに係る 未実現利益 (損失) の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
USD BLUE RACER MIDSTREAM LLC-144A 7.62500% 20-15.12.25	3 942 000.00	3 977 813.07	0.80
USD BOMBARDIER INC-144A 7.50000% 15-15.03.25	2 010 000.00	2 013 015.00	0.40
USD BOOZ ALLEN HAMILTON INC-144A 4.00000% 21-01.07.29	2 755 000.00	2 442 665.65	0.49
USD BUCKEYE PARTNERS LP-144A 4.50000% 20-01.03.28	1 580 000.00	1 402 250.00	0.28
USD BUILDERS FIRSTSOURCE INC-144A 5.00000% 20-01.03.30	1 598 000.00	1 417 512.06	0.28
USD CAESARS ENTERTAINMENT INC-144A 6.25000% 20-01.07.25	988 000.00	976 442.85	0.20
USD CAESARS ENTERTAINMENT INC-144A 8.12500% 20-01.07.27	3 834 000.00	3 848 569.20	0.77
USD CALIFORNIA RESOURCES CORP-144A 7.12500% 21-01.02.26	3 094 000.00	3 008 915.00	0.60
USD CALPINE CORP-144A 5.12500% 19-15.03.28	2 382 000.00	2 133 439.97	0.43
USD CARNIVAL CORP-144A 5.75000% 21-01.03.27	2 700 000.00	2 011 770.00	0.40
USD CARRIAGE SERVICES INC-144A 4.25000% 21-15.05.29	2 668 000.00	2 002 334.00	0.40
USD CCO HOLDINGS LLC-144A 4.25000% 20-01.02.31	1 650 000.00	1 339 470.00	0.27
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.37500% 19-01.06.29	2 663 000.00	2 416 592.61	0.48
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 4.75000% 19-01.03.30	4 615 000.00	3 967 621.46	0.80
USD CDI-144A *ESCROW* 5.75000% 22-01.04.30	960 000.00	890 524.80	0.18
USD CENTURYLINK INC-144A 5.12500% 19-15.12.26	1 565 000.00	1 338 075.00	0.27
USD CENTURYLINK INC-144A 4.00000% 20-15.02.27	1 665 000.00	1 419 412.50	0.28
USD CHEEVER ESCROW ISSUER LLC-144A 7.12500% 22-01.10.27	200 000.00	187 000.00	0.04
USD CHEMOURS CO/THE-144A 4.62500% 21-15.11.29	987 000.00	794 535.00	0.16
USD CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC-144A 8.00000% 19-15.03.26	1 735 000.00	1 601 214.15	0.32
USD CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC-144A 6.87500% 21-15.04.29	2 478 000.00	1 325 730.00	0.27
USD CHURCHILL DOWNS INC-144A 5.50000% 19-01.04.27	1 740 000.00	1 654 816.85	0.33
USD CINEMARK USA INC-144A 5.87500% 21-15.03.26	1 291 000.00	1 130 464.15	0.23
USD CLEAR CHANNEL OUTDOOR HOLDINGS INC-144A 5.12500% 19-15.08.27	1 590 000.00	1 370 340.08	0.27
USD CLEARWATER PAPER CORP-144A 4.75000% 20-15.08.28	1 537 000.00	1 346 747.78	0.27
USD CLEARWAY ENERGY OPERATING LLC-144A 4.75000% 19-15.03.28	2 465 000.00	2 277 078.14	0.46
USD CNX MIDSTREAM PARTNERS LP-144A 4.75000% 21-15.04.30	2 529 000.00	2 109 169.46	0.42
USD COMMScope INC-144A 6.00000% 19-01.03.26	1 150 000.00	1 112 579.00	0.22
USD COMMScope INC-144A 8.25000% 19-01.03.27	1 510 000.00	1 296 191.55	0.26
USD COMSTOCK RESOURCES INC-144A 6.75000% 21-01.03.29	1 982 000.00	1 935 720.30	0.39
USD COMSTOCK RESOURCES INC-144A 5.87500% 21-15.01.30	1 220 000.00	1 124 047.00	0.23
USD CONSOLIDATED COMMUNICATIONS INC-144A 6.50000% 20-01.10.28	1 392 000.00	1 145 337.60	0.23
USD CONSTELLUM SE-144A 5.62500% 20-15.06.28	1 135 000.00	1 037 903.29	0.21
USD COVERT MERGECO INC 4.87500% 21-01.12.29	903 000.00	763 035.00	0.15
USD CSC HOLDINGS INC-144A 5.37500% 18-01.02.28	1 320 000.00	1 181 588.10	0.24
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 7.50000% 18-01.04.28	1 325 000.00	1 032 055.75	0.21
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 6.50000% 19-01.02.29	3 000 000.00	2 733 960.00	0.55
USD DARLING INGREDIENTS INC-144A 5.25000% 19-15.04.27	1 070 000.00	1 035 599.50	0.21
USD DAVITA INC-144A 4.62500% 20-01.06.30	1 386 000.00	1 121 939.28	0.23
USD DISH NETWORK CORP-144A 11.75000% 22-15.11.27	1 465 000.00	1 505 770.95	0.30
USD DKT FINANCE APS-144A 9.37500% 18-17.06.23	2 867 000.00	2 758 180.15	0.55
USD DYCOM INDUSTRIES INC-144A 4.50000% 21-15.04.29	2 975 000.00	2 555 049.00	0.51
USD ENERGIZER HOLDINGS INC-144A 4.75000% 20-15.06.28	1 490 000.00	1 299 190.60	0.26
USD ENERGIZER HOLDINGS INC-144A 4.37500% 20-31.03.29	852 000.00	724 813.44	0.15
USD ENLINK MIDSTREAM LLC-144A 6.50000% 22-01.09.30	1 470 000.00	1 492 961.40	0.30
USD EQM MIDSTREAM PARTNERS LP-144A 6.50000% 20-01.07.27	1 164 000.00	1 129 080.00	0.23
USD EQM MIDSTREAM PARTNERS LP-144A 7.50000% 22-01.06.27	1 570 000.00	1 586 657.70	0.32
USD FIRST QUANTUM MINERALS LTD-144A 6.87500% 20-15.10.27	2 354 000.00	2 232 957.32	0.45
USD FMG RESOURCES AUGUST 2006 PTY LTD-144A 4.50000% 19-15.09.27	935 000.00	859 508.10	0.17
USD FORESTAR GROUP INC-144A 3.85000% 21-15.05.26	1 659 000.00	1 464 847.23	0.29
USD FORTRESS TRANS & INFRA INV LLC-144A 5.50000% 21-01.05.28	1 158 000.00	1 007 494.74	0.20
USD FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATION-144A 5.87500% 20-15.10.27	3 684 000.00	3 505 399.68	0.70
USD FRONTIER COMMUNICATIONS CORP-144A 6.75000% 20-01.05.29	1 852 000.00	1 555 920.76	0.31
USD GARDA WORLD SECURITY CORP-144A 9.50000% 19-01.11.27	1 199 000.00	1 109 187.61	0.22
USD GARDA WORLD SECURITY CORP-144A 4.62500% 20-15.02.27	1 568 000.00	1 408 205.12	0.28

内容	数量／ 名目金額	先物／為替先物予約／ スワップに係る 未実現利益(損失)の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
USD GARTNER INC-144A 4.50000% 20-01.07.28	1 531 000.00	1 441 314.02	0.29
USD GENESIS ENERGY LP 5.62500% 14-15.06.24	1 550 000.00	1 501 517.69	0.30
USD GENWORTH MORTGAGE HOLDINGS INC-144A 6.50000% 20-15.08.25	4 235 000.00	4 117 394.05	0.83
USD GFL ENVIRONMENTAL INC-144A 4.75000% 21-15.06.29	2 807 000.00	2 458 454.81	0.49
USD GRAPHIC PACKAGING INTERNATIONAL-144A 4.75000% 19-15.07.27	239 000.00	222 712.15	0.04
USD GRAPHIC PACKAGING INTERNATIONL INC-144A 3.50000% 20-15.03.28	535 000.00	465 089.85	0.09
USD GRAY ESCROW II INC-144A 5.37500% 21-15.11.31	2 437 000.00	1 859 357.89	0.37
USD GRAY TELEVISION INC-144A 5.87500% 16-15.07.26	2 420 000.00	2 229 122.50	0.45
USD GREAT LAKES DREDGE & DOCK CORP-144A 5.25000% 21-01.06.29	3 280 000.00	2 643 345.27	0.53
USD GROUP 1 AUTOMOTIVE INC-144A 4.00000% 20-15.08.28	1 612 000.00	1 367 378.21	0.27
USD HESS MIDSTREAM PARTNERS LP-144A 5.12500% 19-15.06.28	1 725 000.00	1 624 018.50	0.33
USD HILCORP ENERGY I LP / HILCORP FINA-144A 6.00000% 22-15.04.30	485 000.00	445 972.57	0.09
USD HILCORP ENERGY I LP/FINANCE CO-144A 6.25000% 18-01.11.28	1 065 000.00	1 014 212.81	0.20
USD HILCORP ENERGY I LP/FINANCE CO-144A 5.75000% 21-01.02.29	3 804 000.00	3 484 680.82	0.70
USD HILTON DOMESTIC OPERATING CO INC-144A 4.00000% 20-01.05.31	1 920 000.00	1 615 038.62	0.32
USD HILTON GRAND VACATIONS BORROWER-144A 5.00000% 21-01.06.29	1 663 000.00	1 440 041.59	0.29
USD HOLLY ENERGY PARTNERS LP FIN CORP-144A 5.00000% 20-01.02.28	1 692 000.00	1 541 686.37	0.31
USD HOLLY ENERGY PARTNERS LP / HOLLY E-144A 6.37500% 22-15.04.27	485 000.00	474 517.28	0.10
USD ILIAD HOLDING SASU-144A 6.50000% 21-15.10.26	3 990 000.00	3 795 467.03	0.76
USD INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC-144A 5.25000% 20-15.01.29	880 000.00	828 722.40	0.17
USD IRON MOUNTAIN INC-144A 4.87500% 17-15.09.27	1 895 000.00	1 781 849.55	0.36
USD JACOBS ENTERTAINMENT INC-144A 6.75000% 22-15.02.29	3 128 000.00	2 815 200.00	0.56
USD KBR INC-144A 4.75000% 20-30.09.28	3 565 000.00	3 162 702.94	0.63
USD L BRANDS INC-144A 6.62500% 20-01.10.30	3 478 000.00	3 256 034.04	0.65
USD LADDER CAPITAL FINANCE HOLDINGS-144A 4.75000% 21-15.06.29	1 319 000.00	1 078 405.67	0.22
USD LCPR SENIOR SECURED FINANCING DAC-144A 6.75000% 19-15.10.27	473 000.00	447 424.89	0.09
USD LCPR SENIOR SECURED FINANCING DAC-144A 5.12500% 21-15.07.29	1 582 000.00	1 307 584.23	0.26
USD LEEWARD RENEWABLE ENERGY LLC-144A 4.25000% 21-01.07.29	1 397 000.00	1 174 737.30	0.24
USD LEGENDS HOSPITALITY HOLDING CO LLC-144A 5.00000% 21-01.02.26	896 000.00	783 897.18	0.16
USD LEVEL 3 FINANCING INC-144A 4.25000% 20-01.07.28	3 921 000.00	3 070 100.97	0.62
USD LIFEPOINT HEALTH INC-144A 4.37500% 20-15.02.27	1 935 000.00	1 604 031.97	0.32
USD LIFEPOINT HEALTH INC-144A 6.75000% 20-15.04.25	1 640 000.00	1 503 757.11	0.30
USD LOGAN MERGER SUB INC-144A 5.50000% 20-01.09.27	2 258 000.00	1 320 929.41	0.27
USD MONEYGRAM INTERNATIONAL INC-144A 5.37500% 21-01.08.26	1 387 000.00	1 398 839.15	0.28
USD MOZART DEBT MERGER SUB INC-144A 5.25000% 21-01.10.29	520 000.00	423 800.00	0.09
USD MUELLER WATER PRODUCTS INC-144A 4.00000% 21-15.06.29	962 000.00	827 479.56	0.17
USD NABORS INDUSTRIES INC-144A 9.00000% 20-01.02.25	3 490 000.00	3 521 026.10	0.71
USD NABORS INDUSTRIES INC-144A 7.37500% 21-15.05.27	785 000.00	763 412.50	0.15
USD NABORS INDUSTRIES LTD-144A 7.25000% 20-15.01.26	805 000.00	766 360.00	0.15
USD NATIONSTAR MORTGAGE HOLDINGS INC-144A 6.00000% 20-15.01.27	1 416 000.00	1 287 299.76	0.26
USD NATIONSTAR MORTGAGE HOLDINGS INC-144A 5.50000% 20-15.08.28	1 114 000.00	934 174.34	0.19
USD NATIONSTAR MORTGAGE HOLDINGS INC-144A 5.12500% 20-15.12.30	161 000.00	125 516.35	0.03
USD NCL CORP LTD-144A 5.87500% 20-15.03.26	1 770 000.00	1 454 320.50	0.29
USD NCR CORP-144A 5.12500% 21-15.04.29	1 500 000.00	1 290 314.62	0.26
USD NESCO HOLDINGS II INC-144A 5.50000% 21-15.04.29	2 817 000.00	2 478 143.07	0.50
USD NEW ENTERPRISE STONE&LINE CO INC-144A 5.25000% 21-15.07.28	2 079 000.00	1 881 495.00	0.38
USD NEXSTAR BROADCASTING INC-144A 4.75000% 20-01.11.28	851 000.00	757 321.92	0.15
USD NEXSTAR BROADCASTING INC-144A 5.62500% 19-15.07.27	1 381 000.00	1 302 172.52	0.26

USD	NOVA CHEMICALS CORP-144A 5.25000% 17-01.06.27	3 105 000.00	2 786 976.49	0.56
-----	---	--------------	--------------	------

内容	数量／ 名目金額	先物／為替先物予約／ スワップに係る 未実現利益(損失)の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
USD NOVELIS CORP-144A 3.25000% 21-15.11.26	693 000.00	619 239.64	0.12
USD NOVELIS CORP-144A 3.87500% 21-15.08.31	403 000.00	330 460.00	0.07
USD NOVELIS CORP-144A 4.75000% 20-30.01.30	3 482 000.00	3 095 840.17	0.62
USD NRG ENERGY INC-144A 5.25000% 19-15.06.29	744 000.00	685 711.32	0.14
USD NRG ENERGY INC-144A 3.62500% 20-15.02.31	986 000.00	788 454.90	0.16
USD OASIS MIDSTREAM PARTNERS LP-144A 8.00000% 21-01.04.29	1 175 000.00	1 183 812.50	0.24
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 6.45000% 19-15.09.36	2 748 000.00	2 754 870.00	0.55
USD ORGANON FINANCE 1 LLC-144A 4.12500% 21-30.04.28	2 613 000.00	2 351 647.74	0.47
USD ORGANON FINANCE 1 LLC-144A 5.12500% 21-30.04.31	2 155 000.00	1 912 368.55	0.38
USD OWENS-BROCKWAY GLASS CONTAINER INC-144A 6.62500% 20-13.05.27	920 000.00	885 065.30	0.18
USD OWENS-BROCKWAY GLASS CONTAINER INC-144A 5.37500% 14-15.01.25	1 219 000.00	1 156 106.46	0.23
USD PATRICK INDUSTRIES INC-144A 7.50000% 19-15.10.27	1 972 000.00	1 877 028.48	0.38
USD PERFORMANCE FOOD GROUP INC-144A 5.50000% 19-15.10.27	2 044 000.00	1 972 460.00	0.40
USD PETSMART FINANCE CORP-144A 4.75000% 21-15.02.28	1 661 000.00	1 517 539.43	0.30
USD PICARD MIDCO INC-144A 6.50000% 22-31.03.29	1 565 000.00	1 366 857.18	0.27
USD PM GENERAL PURCHASER LLC-144A 9.50000% 20-01.10.28	2 935 000.00	2 574 620.62	0.52
USD PRIME SEC SER BORROWER LLC/FIN INC-144A 5.75000% 19-15.04.26	1 000 000.00	990 000.00	0.20
USD RADIATE HOLDCO LLC/FINANCE INC-144A 4.50000% 20-15.09.26	851 000.00	695 862.70	0.14
USD RADIATE HOLDCO LLC/FINANCE INC-144A 6.50000% 20-15.09.28	3 176 000.00	1 714 087.20	0.34
USD ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD-144A 5.50000% 21-31.08.26	1 390 000.00	1 205 825.00	0.24
USD SEAGATE HDD CAYMAN 4.09100% 20-01.06.29	1 925 000.00	1 592 937.50	0.32
USD SELECT MEDICAL CORP-144A 6.25000% 19-15.08.26	2 014 000.00	1 949 270.04	0.39
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 4.12500% 20-01.07.30	755 000.00	637 084.10	0.13
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 4.00000% 21-15.07.28	4 477 000.00	3 956 862.14	0.79
USD SRM ESCROW ISSUER LLC-144A 6.00000% 20-01.11.28	2 506 000.00	2 230 340.00	0.45
USD STANDARD INDUSTRIES INC/NJ-144A 4.75000% 17-15.01.28	480 000.00	435 031.20	0.09
USD SUMMIT MATERIALS LLC/FIN CORP-144A 5.25000% 20-15.01.29	1 215 000.00	1 121 627.25	0.24
USD TENET HEALTHCARE CORP-144A 5.12500% 19-01.11.27	2 796 000.00	2 632 126.44	0.53
USD TENET HEALTHCARE CORP-144A 4.62500% 20-15.06.28	1 943 000.00	1 739 022.25	0.35
USD TENET HEALTHCARE CORP-144A 6.12500% 20-01.10.28	3 296 000.00	2 908 720.00	0.58
USD TERRAFORM POWER OPERATING LLC-144A 4.75000% 19-15.01.30	2 637 000.00	2 373 300.00	0.48
USD TRANSDIGM INC-144A 6.25000% 19-15.03.26	2 385 000.00	2 373 408.90	0.48
USD TRANSDIGM UK HOLDINGS PLC-SUB 6.87500% 19-15.05.26	1 715 000.00	1 690 406.90	0.34
USD TRONOX INC-144A 4.62500% 21-15.03.29	1 727 000.00	1 390 563.13	0.28
USD UBER TECHNOLOGIES INC-144A 7.50000% 19-15.09.27	765 000.00	768 978.00	0.15
USD UBER TECHNOLOGIES INC-144A 4.50000% 21-15.08.29	976 000.00	849 632.40	0.17
USD UNITED AIRLINES INC-144A 4.37500% 21-15.04.26	1 295 000.00	1 205 677.64	0.24
USD UNIVISION COMMUNICATIONS INC-144A 6.62500% 20-01.06.27	2 116 000.00	2 062 107.42	0.41
USD UNIVISION COMMUNICATIONS INC-144A 4.50000% 21-01.05.29	2 638 000.00	2 245 597.50	0.45
USD USA COMPRESSION PARTNERS LLC 6.87500% 19-01.04.26	752 000.00	720 040.00	0.14
USD VENTURE GLOBAL CALCASIEU PASS LLC-144A 3.87500% 21-15.08.29	1 842 000.00	1 591 027.50	0.32
USD VIASAT INC-144A 5.62500% 17-15.09.25	1 087 000.00	1 010 007.79	0.20
USD VIASAT INC-144A 5.62500% 19-15.04.27	395 000.00	363 016.85	0.07
USD VISTRA OPERATIONS CO LLC-144A 5.62500% 19-15.02.27	2 490 000.00	2 408 958.30	0.48
USD VISTRA OPERATIONS CO LLC-144A 5.00000% 19-31.07.27	2 172 000.00	2 038 800.12	0.41
USD WEATHERFORD INTERNATIONAL LTD-144A 11.00000% 19-01.12.24	600 000.00	616 428.00	0.12
USD WEATHERFORD INTERNATIONAL LTD-144A 8.6250% 21-30.04.30	1 303 000.00	1 240 534.18	0.25
USD WEEKLEY HOMES LLC / WEEKLEY FIN-144A 4.87500% 20-15.09.28	967 000.00	783 735.01	0.16
USD WESCO DISTRIBUTION INC-144A 7.25000% 20-15.06.28	1 445 000.00	1 463 857.25	0.29
USD WHITE CAP BUYER LLC-144A 6.87500% 20-15.10.28	2 368 000.00	2 041 117.75	0.41
USD WILLIAMS SCOTSMAN INTL INC-144A 4.62500% 20-15.08.28	2 298 000.00	2 089 341.60	0.42
USD WR GRACE HOLDINGS LLC-144A 4.87500% 21-15.06.27	2 605 000.00	2 333 949.75	0.47
USD WYNDHAM DESTINATIONS INC-144A 6.62500% 20-31.07.26	1 685 000.00	1 651 039.51	0.33
米ドル合計		298 131 985.74	59.81
ノート合計—固定金利		298 131 985.74	59.81

内容	数量／ 名目金額	先物／為替先物予約／ スワップに係る 未実現利益(損失)の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
長期債券－固定金利			
米ドル			
USD HUBBAY MINERALS INC-144A 6.12500% 20-01.04.29	1 550 000.00	1 395 899.00	0.28
米ドル合計		1 395 899.00	0.28
長期債券合計－固定金利		1 395 899.00	0.28
他の規制市場で取引されている譲渡可能証券および金融市場商品合計		302 214 477.53	60.63
公認証券取引所に上場されておらず他の規制市場において取引もされていない譲渡可能証券および金融市場商品			
ノートー固定金利			
米ドル			
USD ACADIA HEALTHCARE CO INC-144A 5.50000% 20-01.07.28	1 420 000.00	1 335 048.12	0.27
USD ALTICE FRANCE HOLDING SA 10.50000% 20-15.05.27	6 890 000.00	5 443 100.00	1.09
USD ASCENT RESOURCES UTICA HOLDINGS-144A 8.25000% 20-31.12.28	740 000.00	737 484.00	0.15
USD CARNIVAL CORP-144A 10.50000% 20-01.02.26	400 000.00	403 708.00	0.08
USD CARNIVAL HOLDINGS BERMUDA-144A 10.37500% 22-01.05.28	2 605 000.00	2 712 326.00	0.54
USD CASCADES INC/CASCADES USA INC-144A 5.37500% 19-15.01.28	1 593 000.00	1 407 574.80	0.28
USD CCO HOLDINGS LLC-144A 4.25000% 21-15.01.34	1 096 000.00	853 784.00	0.17
USD CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC-144A 5.62500% 20-15.03.27	2 882 000.00	2 446 212.78	0.49
USD ENLINK MIDSTREAM LLC-144A 5.62500% 20-15.01.28	1 142 000.00	1 113 450.00	0.22
USD EQT MIDSTREAM PARTNERS LP -144A 4.75000% 21-15.01.31	406 000.00	341 787.06	0.07
USD GRAFTECH FINANCE INC-144A 4.62500% 20-15.12.28	3 493 000.00	2 912 288.75	0.58
USD HESS MIDSTREAM PARTNERS LP-144A 4.25000% 21-15.02.30	637 000.00	544 635.00	0.11
USD INSTALLED BUILDING PRODUCTS INC-144A 5.75000% 19-01.02.28	1 438 000.00	1 259 112.80	0.25
USD IRON MOUNTAIN INC-144A 5.00000% 20-15.07.28	2 010 000.00	1 827 863.85	0.37
USD IRON MOUNTAIN INC-144A 5.25000% 20-15.07.30	1 905 000.00	1 714 500.00	0.34
USD MACYS RETAIL HOLDINGS INC-144A 5.87500% 21-01.04.29	2 607 000.00	2 424 901.05	0.49
USD POWERTEAM SERVICES LLC-144A 9.03300% 20-04.12.25	3 087 000.00	2 568 198.78	0.52
USD QVC INC 4.75000% 20-15.02.27	1 911 000.00	1 434 520.82	0.29
USD ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD-144A 11.62500% 22-15.08.27	980 000.00	1 006 950.00	0.20
USD SCIENCE APPLICATIONS INTRNTNL CORP-144A 4.87500% 20-01.04.28	3 431 000.00	3 160 808.75	0.63
USD SERVICE PROPERTIES TRUST 7.50000% 20-15.09.25	1 731 000.00	1 674 742.50	0.34
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NETHERLANDS 7.12500% 20-31.01.25	1 759 000.00	1 755 701.88	0.35
USD UNITED NATURAL FOODS INC-144A 6.75000% 20-15.10.28	2 444 000.00	2 370 680.00	0.48
USD UNITED RENTALS NORTH AMERICA INC-144A 6.00000% 22-15.12.29	975 000.00	979 875.00	0.20
USD UNIVISION COMMUNICATIONS INC-144A 7.37500% 22-30.06.30	1 175 000.00	1 172 673.50	0.24
USD USA COMPRESSION PARTNERS LLC 6.87500% 19-01.09.27	2 506 000.00	2 392 478.20	0.48
USD VICI PROPERTIES LP /VCI NTE CO INC-144A 4.50000% 22-01.09.26	1 651 000.00	1 546 029.42	0.31
米ドル合計		47 540 435.06	9.54
ノートー合計－固定金利		47 540 435.06	9.54
公認証券取引所に上場されておらず他の規制市場において取引もされていない譲渡可能証券および金融市場商品合計		47 540 435.06	9.54

内容	数量／ 名目金額	先物／為替先物予約／ スワップに係る 未実現利益（損失）の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める％
最近発行された譲渡可能証券および金融市場商品			
ノートー固定金利			
米ドル			
USD BUILDERS FIRSTSOURCE INC-144A 6.37500% 22-15.06.32	490 000.00	452 695.02	0.09
USD DARLING ESCROW CORP-144A 6.00000% 22-15.06.30	1 885 000.00	1 838 233.15	0.37
USD II-VI INC-144A 5.00000% 21-15.12.29	1 795 000.00	1 584 087.50	0.32
USD OPEN TEXT CORP-144A 6.90000% 22-01.12.27	1 270 000.00	1 271 587.50	0.25
USD TENET HEALTHCARE CORP-144A 6.12500% 22-15.06.30	1 470 000.00	1 392 942.60	0.28
USD VICI PROPERTIES LP /VCI NTE CO INC-144A 5.75000% 22-01.02.27	936 000.00	906 999.96	0.18
米ドル合計		7 446 545.73	1.49
ノート合計ー固定金利		7 446 545.73	1.49
最近発行された譲渡可能証券および金融市場商品合計		7 446 545.73	1.49
ルクセンブルグ2010年12月17日法（改正済）の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs			
投資信託、オープン・エンド型			
アイルランド			
USD ISHARES USD HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	1.00	89.62	0.00
アイルランド合計		89.62	0.00
ルクセンブルグ			
USD UBS (LUX) BOND SICAV - MULTI INCOME (USD)-U-X-ACC- CAP	310.00	3 000 629.50	0.60
ルクセンブルグ合計		3 000 629.50	0.60
投資信託、オープン・エンド型合計		3 000 719.12	0.60
ルクセンブルグ2010年12月17日法（改正済）の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs合計		3 000 719.12	0.60
公認証券取引所に上場されておらず他の規制市場において取引もされていないデリバティブ商品			
その他のスワップに係るオプション、従来型			
米ドル			
USD BOA/CDX.NA.HY.39 SWAPTION PUT 96.00000 22-21.12.22	35 000 000.00	12 295.50	0.00
USD BOA/CDX.NA.HY.39 SWAPTION PUT 93.00000 22-21.12.22	-35 000 000.00	-3 153.50	0.00
USD BOA/CDX.NA.HY.39 SWAPTION PUT 89.00000 22-21.12.22	-35 000 000.00	-595.00	0.00
USD JPMORGAN/CDX.NA.HY.39 SWAPTION PUT 95.50000 22-21.12.22	-25 000 000.00	-6 725.00	0.00
USD JPMORGAN/CDX.NA.HY.39 SWAPTION PUT 91.00000 22-21.12.22	-25 000 000.00	-865.00	0.00
USD JPMORGAN/CDX.NA.HY.39 SWAPTION PUT 98.00000 22-21.12.22	25 000 000.00	27 072.50	0.01
米ドル合計		28 029.50	0.01
その他のスワップに係るオプション、従来型合計		28 029.50	0.01
公認証券取引所に上場されておらず他の規制市場において取引もされていないデリバティブ商品合計		28 029.50	0.01
投資有価証券合計		486 643 577.86	97.62

内容	数量／ 名目金額	先物／為替先物予約／ スワップに係る 未実現利益（損失）の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める％
デリバティブ商品			
公認証券取引所に上場されておらず他の規制市場において取引もされていないデリバティブ商品			
指数に係るスワップおよび先渡しスワップ			
USD JPM/IBOXX USD LIQUID HY TR EQS REC PERF 22-20.03.23	23 100 000.00	47 530.46	0.01
USD JPM/IBOXX USD LIQUID HY TR EQS PAYER SOFR 22-20.03.23			
指数に係るスワップおよび先渡しスワップ合計		47 530.46	0.01
公認証券取引所に上場されておらず他の規制市場において取引もされていないデリバティブ商品合計			
		47 530.46	0.01
デリバティブ商品合計		47 530.46	0.01

外国為替先物予約

購入通貨／購入金額／売却通貨／売却金額／満期日						
CHF	49 156 800.00	USD	52 646 471.35	12.1.2023	-760 348.91	-0.15
EUR	8 194 000.00	USD	8 579 388.40	12.1.2023	-112 023.83	-0.02
USD	20 244 383.06	EUR	19 335 000.00	12.1.2023	264 337.43	0.05
USD	2 655 607.59	GBP	2 225 000.00	12.1.2023	1 749.67	0.00
USD	595 869.22	EUR	575 000.00	12.1.2023	1 686.33	0.00
EUR	192 800.00	USD	199 953.34	12.1.2023	-721.23	0.00
USD	1 336 811.01	EUR	1 280 000.00	12.1.2023	14 108.22	0.00
USD	168 961.78	CHF	158 500.00	12.1.2023	1 661.42	0.00
USD	662 409.31	EUR	637 100.00	12.1.2023	4 054.66	0.00
外国為替先物予約合計					-585 496.24	-0.12
現金性銀行預金、要求払預金および預金勘定およびその他の当座資産					2 581 812.61 [*]	0.52
当座借越およびその他の短期負債					-574.59	0.00
その他の資産および負債					9 808 413.61	1.97
純資産合計					498 495 263.71	100.00

* 2022年11月30日現在、当該現金額は取引の相手方のために担保に供されており、バンク・オブ・アメリカについては40,000.00

米ドルおよびJPモルガンについては140,000.00米ドルである。

注記は財務書類の不可分の一部である。

5【販売及び買戻しの実績】

2022年12月末日前1年間における販売および買戻しの実績ならびに2022年12月末日現在の発行済口数は以下のとおりである。

		販売口数	買戻し口数	発行済口数
コーポレート・ ボンド (米ドル)	クラスP-a c c 投資証券	449,330.872 (92,503.370)	1,014,461.507 (24,449.877)	3,415,417.071 (542,211.598)
ハイ・イールド・ ボンド (米ドル)	クラスP-a c c 投資証券	5,701.670 (0.000)	27,289.168 (605.000)	188,372.716 (19,571.178)

(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。