

【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 - ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)
(UBS (Lux) Bond SICAV - Short Term USD Corporates Sustainable (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 - ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(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) ファンドにはクラスF - a c c 投資証券以外の投資証券も存在し、その内クラスP - a c c 投資証券およびクラスP - m d i s t 投資証券は日本で販売されているが、本書の中で、以下、ファンドについて「投資証券」というときは、上記のクラスF - 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】

ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(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⁾	49,167,590.92	62,142,522.42	- 40,748,942.58	- 89,971,191.63	- 24,112,187.12
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	49,167,590.92	62,142,522.42	- 40,748,942.58	- 89,971,191.63	- 24,112,187.12
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	49,167,590.92	62,142,522.42	- 40,748,942.58	- 89,971,191.63	- 24,112,187.12
(d) 出資総額 ⁽²⁾	937,843,109.34	1,008,206,695.37	898,920,108.58	700,977,615.75	665,956,437.30
(e) 発行済投資口総数 (クラスF - a c c 投資証券)	408,482.767口	354,929.249口	354,772.000口	231,925.000口	722,928.000口
(f) 純資産額	937,843,109.34	1,008,206,695.37	898,920,108.58	700,977,615.75	665,956,437.30
(g) 資産総額	951,782,114.78	1,036,369,916.23	903,662,508.86	701,839,173.00	670,524,547.78
(h) 1口当たり純資産価格 (クラスF - a c c 投資証券)	114.90	115.73	115.16	111.82	110.41
(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)	2.98	4.30	- 0.59	- 5.49	- 0.44
(j) 分配総額	285,061.38	354,961.64	47,033.90	69,214.26	19,577.40
(k) 1口当たり分配金額 (クラスF - 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	98.54%	97.28%	99.48%	99.88%	99.32%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾ (クラスF - a c c 投資証券)	4.18%	3.39%	0.23%	- 3.38%	- 4.12%

(1) 営業収益には投資収益および実現および未実現利益(損失)を含めている。以下同じ。

(2) ファンドは変動資本を有する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。以下同じ。

(3) 自己資本利益率は、当該会計年度の1口当たり純資産価格の前年度に対する増減の比率であるが、当該会計年度に初めて当該投資証券が発行された場合には、当初募集価格に対する増減の比率で表すものとする。以下同じ。

(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)。以下同じ。

(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)	
ショート・ターム米ドル コーポレート・サステナ ブル(米ドル)	710,210.30	94,245	クラス F - a c c 投資証券	784,208.759

(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・ シュミット - リヒター (Raphael Schmidt - Richter)	取締役会役員 (メンバー・オブ・ ザ・ボード・オブ・ ディレクターズ)	UBS アセット・マネジメント (ドイツ) ゲーエムベーハー、 フランクフルト エグゼクティブ・ ディレクター	該当なし

(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) 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 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

ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(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	289,854,241.00	40.77
	英国	81,118,059.52	11.41
	オランダ	38,918,043.02	5.47
	オーストラリア	33,843,793.84	4.76
	フランス	29,566,917.76	4.16
	ケイマン諸島	20,309,795.44	2.86
	カナダ	18,835,044.17	2.65
	スペイン	16,856,382.68	2.37
	スイス	16,587,679.74	2.33
	日本	12,639,910.19	1.78
	ドイツ	10,776,262.82	1.52
	フィンランド	10,042,560.76	1.41
	ノルウェー	9,448,080.20	1.33
	アイルランド	8,288,147.22	1.17
	ニュージーランド	8,130,421.08	1.14
	シンガポール	7,334,853.70	1.03
	イタリア	7,234,037.08	1.02
	スウェーデン	6,013,731.69	0.85
	デンマーク	4,778,615.66	0.67
	アラブ首長国連邦	3,980,962.50	0.56
	香港	3,635,563.48	0.51
	中国	3,006,574.00	0.42
	英領ヴァージン諸島	2,655,562.50	0.37
	多国籍	2,478,593.75	0.35
	オーストリア	2,081,137.50	0.29
	ガーンジー	1,947,500.00	0.27
	大韓民国	1,924,400.00	0.27
	ルクセンブルグ	1,760,000.00	0.25
	ジャージー	1,225,889.72	0.17
	ウズベキスタン	931,437.50	0.13
	国際機関	918,868.00	0.13
	バミューダ	540,503.44	0.08
	小計	657,663,569.96	92.50
モーゲージ担保証券、 アセット・バック証券、 その他ディスカウント債	アメリカ合衆国	18,280,849.19	2.57

短期金融商品	スウェーデン	6,808,177.25	0.96
	カナダ	4,864,539.25	0.68
	小計	11,672,716.50	1.64
投資信託	アイルランド	1,000,000.00	0.14
ポートフォリオ合計		688,617,135.65	96.85
現金・その他資産(負債控除後)		22,404,494.20	3.15
資産総額		711,021,629.85	100.00
負債総額		811,330.13	0.11
合計(純資産総額)		710,210,299.72 (約94,245百万円)	99.89

(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。以下同様とする。

(2) 【運用実績】

【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。

ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)

	資産総額		純資産総額		1口当たり 純資産価格 (クラスF - acc 投資証券)	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円
2022年1月末日	1,396,022.79	185,252	822,728.27	109,176	114.28	15,165
2月末日	1,379,588.65	183,071	804,195.37	106,717	113.48	15,059
3月末日	1,253,885.49	166,391	743,161.21	98,617	112.09	14,874
4月末日	1,164,438.89	154,521	686,827.94	91,142	111.29	14,768
5月末日	701,839.17	93,134	700,977.62	93,020	111.82	14,839
6月末日	1,161,732.65	154,162	696,147.78	92,379	110.54	14,669
7月末日	693,744.37	92,060	691,674.81	91,785	111.44	14,788
8月末日	1,144,878.64	151,925	683,960.71	90,762	110.88	14,714
9月末日	1,101,133.16	146,120	663,709.11	88,074	109.15	14,484
10月末日	665,674.83	88,335	662,319.26	87,890	108.77	14,434
11月末日	670,524.55	88,979	665,956.44	88,372	110.41	14,651
12月末日	711,021.63	94,353	710,210.30	94,245	110.86	14,711

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。

【分配の推移】

該当なし。

【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。

ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル（米ドル）	収益率	
	クラスF - a c c 投資証券	- 3.78%

（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（分配落の額）

（３）【投資リスク】

当中間計算期間において、2022年12月9日提出の有価証券届出書「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 3 投資リスク」に記載される投資リスクについて、重要な変更はない。

本投資法人が将来にわたって営業活動を継続するにあたり重要な疑義を生じさせるような事象または状況、その他本投資法人の経営に重要な影響を及ぼす事象は、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

ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル (米ドル) の投資運用会社

a) 名称

UBS アセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー (チューリッヒ)

b) 資本金の額

2022年12月末日現在の資本金額は、500,000スイス・フラン (約7,187万円)

(注) スイス・フランの円貨換算は、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スイスフラン = 143.74円) による。以下同じ。

(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

ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル (米ドル) の投資運用会社

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12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】

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 (ドイチェランド) 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

ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)の投資運用会社

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12月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有株式
ミーダーホフ・マーカス・ ジョアンヌ (Miederhoff Markus Johannes)	ディレクター/ ボード・メンバー	2019年6月20日就任	該当なし
ケッテラー・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】

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
アイルランド	オープン・エンド型 投資信託 / 投資法人	46	112,237,302,126.19 米ドル
			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。

ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル（米ドル）の投資運用会社

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12月末日現在、UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー（チューリッヒ）は119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	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	4,011,635,058
2	UBS(Lux)Bond Sicav - Convert Global(EUR)	変動資本を有する 投資法人	2004年11月18日	3,977,233,016
3	UBS(Lux)Money Market Fund - USD Sustainable	契約型投資信託	1988年11月25日	2,378,744,094

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	2,230,430,392
5	Focused Sicav - World Bank Long Term Bond USD	変動資本を有する 投資法人	2018年 2 月13日	2,054,919,435
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	1,951,759,544
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	1,723,232,665
8	UBS(Lux)Money Market Fund - EUR Sustainable	契約型投資信託	1989年10月 9 日	1,270,613,555
9	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	1,186,463,559
10	UBS(Lux)Strategy Fund - Yield Sustainable(CHF)	契約型投資信託	1991年 9 月10日	1,173,919,642

(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。
ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)クラスF - 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】

U B S (L u x) ボンド・シキャブ - ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(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	689,120,671.52	91,446,313
投資有価証券、未実現評価益(評価損)	- 49,209,922.53	- 6,530,157
投資有価証券合計(注1)	639,910,748.99	84,916,156
現金性銀行預金、要求払預金 および預金勘定	23,426,367.54	3,108,679
その他当座資産(証拠金)	630,893.00	83,720
発行に係る未収金	1,252,638.32	166,225
有価証券に係る未収利息	4,719,120.26	626,227
金融先物に係る未実現利益(注1)	175,000.70	23,223
外国為替先物予約に係る 未実現利益(注1)	409,778.97	54,378
資産合計	670,524,547.78	88,978,607
負債		
当座借越に係る未払利息	- 28.43	- 4
有価証券購入に係る未払金(注1)	- 1,896.60	- 252
未払買戻代金	- 4,380,502.71	- 581,293
定率報酬引当金(注2)	- 105,194.46	- 13,959
年次税引当金(注3)	- 16,292.96	- 2,162
その他の手数料および報酬に係る 引当金(注2)	- 64,195.32	- 8,519
引当金合計	- 185,682.74	- 24,640
負債合計	- 4,568,110.48	- 606,188
期末純資産	665,956,437.30	88,372,419

注記は財務書類の不可分の一部である。

U B S (L u x) ボンド・シキャブ - ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(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	103,088.13	13,680
有価証券利息	10,563,207.77	1,401,738
配当金	51,502.98	6,834
貸付証券に係る純収益(注11)	131,398.97	17,437
その他収益(注4)	240,857.36	31,962
収益合計	11,090,055.21	1,471,650
費用		
スワップに係る支払利息(注1)	- 7,856.93	- 1,043
定率報酬(注2)	- 635,220.77	- 84,294
年次税(注3)	- 47,143.83	- 6,256
その他の手数料および報酬(注2)	- 44,892.93	- 5,957
現金および当座借越に係る利息	- 54.45	- 7
費用合計	- 735,168.91	- 97,557
投資純利益(損失)	10,354,886.30	1,374,093
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)	- 9,551,791.83	- 1,267,523
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)	46,713.85	6,199
金融先物に係る実現利益(損失)	- 2,430,389.39	- 322,513
外国為替先物予約に係る実現利益(損失)	- 8,809,566.22	- 1,169,029
スワップに係る実現利益(損失)	88,999.98	11,810
外国為替に係る実現利益(損失)	1,852,011.51	245,762
実現利益(損失)合計	- 18,804,022.10	- 2,495,294
当期実現純利益(損失)	- 8,449,135.80	- 1,121,200
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)	- 7,713,872.73	- 1,023,631
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)	68,320.00	9,066
金融先物に係る未実現評価益(評価損)	11,563.68	1,535
外国為替先物予約に係る未実現評価益 (評価損)	- 8,029,062.27	- 1,065,457
未実現評価益(評価損)の変動合計	- 15,663,051.32	- 2,078,487
運用活動による純資産の純増加(減少)	- 24,112,187.12	- 3,199,687

注記は財務書類の不可分の一部である。

U B S (L u x) ボンド・シキャブ - ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)

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	700,977,615.75	93,019,730
発行額	183,297,233.02	24,323,543
買戻額	- 194,186,646.95	- 25,768,568
合計純発行額(買戻額)	- 10,889,413.93	- 1,445,025
支払配当金	- 19,577.40	- 2,598
投資純収益(損失)	10,354,886.30	1,374,093
実現利益(損失)合計	- 18,804,022.10	- 2,495,294
未実現評価益(評価損)の変動合計	- 15,663,051.32	- 2,078,487
運用活動による純資産の純増加(減少)	- 24,112,187.12	- 3,199,687
期末純資産	665,956,437.30	88,372,419

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	F-acc
期首発行済口数	231,925.0000
発行口数	553,109.0000
買戻口数	- 62,106.0000
期末発行済口数	722,928.0000

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・シキャブ - 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

- 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。
- 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入額と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、（ ）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。

スイング・ブ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・ブ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) 「モーゲージ担保证券」

本投資法人はその投資方針に従い、「モーゲージ担保证券」に投資することができる。「モーゲージ担保证券」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证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しレート契約、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。

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 - ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)

	上限定率報酬
名称に「F」が付く投資証券クラス	年率0.310%

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)。

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)
- ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)	102,679,688.00米ドル	10,857,031.30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)
該当なし	

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)
該当なし		

注7 - 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 - 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)
- ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)	
クラスF - acc 投資証券	0.31%

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T E R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、T E Rに含まれていない。

注9 - 後発事象

サブ・ファンドであるU B S (L u x) ボンド・シキャブ - 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 - 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。

U B S ヨーロッパ S E 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

U B S (L u x) 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
- ショート・ターム米ドルコーポレート・ サステナブル（米ドル）	35,483,078.43 米ドル	37,669,075.44 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
- ショート・ターム米ドルコーポレート・
サステナブル(米ドル)

貸付証券収益	218,998.28 米ドル
貸付証券費用 [*]	
ユービーエス・ スイス・エイ・ジー	65,699.48 米ドル
UBSヨーロッパSE ルクセンブルグ支店	21,899.83 米ドル
貸付証券純収益	131,398.97 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 (L u x) ボンド・シキャブ - ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(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 - 固定金利			
スイスフラン			
CHF LONZA SWISS FINANCE AG-REG-S 1.00000% 20-28.04.23	4 250 000.00	4 453 634.22	0.67
スイスフラン合計		4 453 634.22	0.67
ユーロ			
EUR INTL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP-REG-S 0.50000% 19-04.07.23	2 000 000.00	2 016 820.77	0.30
ユーロ合計		2 016 820.77	0.30
英ポンド			
GBP BUPA FINANCE PLC-REG-S-SUB 5.00000% 16-08.12.26	1 000 000.00	1 134 927.70	0.17
英ポンド合計		1 134 927.70	0.17
米ドル			
USD ABBVIE INC 2.60000% 20-21.11.24	4 000 000.00	3 831 380.28	0.58
USD ABBVIE INC 3.75000% 18-14.11.23	1 000 000.00	987 099.30	0.15
USD ADOBE INC 3.25000% 15-01.02.25	3 000 000.00	2 933 374.59	0.44
USD AERCAP IRE CAP LTD/GLB AVIA TRUST 4.50000% 20-15.09.23	4 000 000.00	3 950 474.16	0.59
USD AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP 1.65000% 21-29.10.24	2 572 000.00	2 366 666.21	0.36
USD AIA GROUP LTD-REG-S 5.62500% 22-25.10.27	1 380 000.00	1 404 298.76	0.21
USD AIG GLOBAL FUNDING-REG-S 0.65000% 21-17.06.24	5 000 000.00	4 671 750.00	0.70
USD ALLY FINANCIAL INC 3.87500% 19-21.05.24	2 500 000.00	2 432 190.82	0.37
USD AMERICAN EXPRESS CO 3.00000% 17-30.10.24	2 500 000.00	2 421 320.98	0.36
USD AMERICAN TOWER CORP 3.37500% 19-15.05.24	1 000 000.00	973 974.42	0.15
USD AMERICAN TOWER CORP 0.60000% 20-15.01.24	2 000 000.00	1 903 391.70	0.29
USD AMGEN INC 3.62500% 14-22.05.24	2 000 000.00	1 968 047.48	0.30
USD ANALOG DEVICES INC 2.95000% 20-01.04.25	500 000.00	482 215.90	0.07
USD ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC-144A 3.62500% 17-11.09.24	2 000 000.00	1 932 250.00	0.29
USD ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC-REG-S 3.62500% 17-11.09.24	485 000.00	468 570.62	0.07
USD ANZ NEW ZEALAND INT ' L LTD/LONDON-REG-S 2.16600% 22-18.02.25	2 000 000.00	1 872 847.60	0.28
USD APPLE INC 3.00000% 17-09.02.24	4 000 000.00	3 929 726.56	0.59
USD APT PIPELINES LTD-REG-S 4.20000% 15-23.03.25	2 000 000.00	1 923 738.20	0.29
USD APTIV PLC 2.39600% 22-18.02.25	1 300 000.00	1 222 697.00	0.18
USD ASTRAZENECA FINANCE LLC 0.70000% 21-28.05.24	6 100 000.00	5 742 870.68	0.86
USD AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD-REG-S 5.12500% 18-01.10.23	500 000.00	494 430.00	0.07
USD BANCO SANTANDER SA 2.70600% 19-27.06.24	5 400 000.00	5 187 133.62	0.78
USD BANCO SANTANDER SA 5.14700% 22-18.08.25	1 000 000.00	993 662.64	0.15
USD BANK OF IRELAND GROUP PLC-144A 4.50000% 18-25.11.23	500 000.00	489 713.81	0.07
USD BANK OF NOVA SCOTIA/THE 0.70000% 21-15.04.24	2 000 000.00	1 885 137.14	0.28
USD BANK OF SCOTLAND PLC-REG-S 1.60000% 21-29.09.26	1 665 000.00	1 441 699.04	0.22
USD BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUL-REG-S 0.99800% 21-04.02.25	2 000 000.00	1 825 999.76	0.27
USD BARCLAYS BANK PLC 3.75000% 14-15.05.24	500 000.00	490 912.55	0.07
USD BAYER US FINANCE II LLC-REG-S 3.87500% 18-15.12.23	2 000 000.00	1 968 012.26	0.30
USD BBVA BANCOMER SA/TEXAS-REG-S 4.37500% 14-10.04.24	3 200 000.00	3 154 896.00	0.47
USD BMW US CAPITAL LLC-REG-S 0.75000% 21-12.08.24	2 275 000.00	2 122 142.55	0.32

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 BMW US CAPITAL LLC-REG-S 3.25000% 22-01.04.25	4 000 000.00	3 868 445.20	0.58
USD BP CAPITAL MARKETS PLC 3.79600% 18-21.09.25	1 000 000.00	983 699.68	0.15
USD BPCE SA-REG-S 4.00000% 18-12.09.23	4 230 000.00	4 156 533.36	0.62
USD BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 2.90000% 20-26.07.24	3 000 000.00	2 917 824.69	0.44
USD CANADIAN PACIFIC RAILWAY 1.35000% 21-02.12.24	3 000 000.00	2 793 617.01	0.42
USD CCO LLC/CAPITAL 4.90800% 16-23.07.25	2 500 000.00	2 460 728.95	0.37
USD CELANESE US HOLDINGS LLC 5.90000% 22-05.07.24	3 500 000.00	3 478 600.13	0.52
USD CIGNA CORP 0.61300% 21-15.03.24	5 000 000.00	4 731 252.10	0.71
USD COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC-144A 0.80000% 21-03.05.24	4 000 000.00	3 752 293.40	0.56
USD COMCAST CORP 3.70000% 18-15.04.24	3 000 000.00	2 957 574.36	0.44
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 6.50000% 19-08.04.24	3 000 000.00	1 687 125.00	0.25
USD CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 2.37500% 19-22.01.25	1 445 000.00	1 361 177.59	0.21
USD CREDIT SUISSE GROUP AG 3.80000% 16-09.06.23	3 000 000.00	2 872 376.79	0.43
USD CVS HEALTH CORP 2.87500% 16-01.06.26	5 000 000.00	4 704 266.65	0.71
USD DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC-REG-S 3.65000% 19-22.02.24	2 000 000.00	1 962 783.70	0.30
USD DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA-REG-S 2.12500% 20-10.03.25	3 000 000.00	2 810 356.74	0.42
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 3.95000% 18-27.02.23	3 000 000.00	2 984 037.18	0.45
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 0.89800% 21-28.05.24	2 000 000.00	1 870 619.22	0.28
USD ENBRIDGE INC 2.50000% 19-15.01.25	2 500 000.00	2 370 174.88	0.36
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 4.25000% 22-15.06.25	1 100 000.00	1 071 609.04	0.16
USD ENI SPA-REG-S 4.00000% 18-12.09.23	3 465 000.00	3 412 265.89	0.51
USD EVERSOURCE ENERGY 3.80000% 18-01.12.23	1 000 000.00	988 150.80	0.15
USD EVERSOURCE ENERGY 4.20000% 22-27.06.24	1 000 000.00	986 279.86	0.15
USD EXELON GENERATION CO LLC 3.25000% 20-01.06.25	3 000 000.00	2 880 056.70	0.43
USD FISERV INC 2.75000% 19-01.07.24	5 000 000.00	4 812 575.00	0.72
USD FMG RESOURCES AUGUST 2006 PTY LTD-REG-S 5.12500% 17-15.05.24	2 350 000.00	2 320 965.98	0.35
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.30000% 22-10.02.25	800 000.00	734 000.00	0.11
USD GENERAL MILLS INC 4.00000% 18-17.04.25	1 000 000.00	983 829.58	0.15
USD GENERAL MOTORS CO 4.87500% 14-02.10.23	2 000 000.00	1 990 698.78	0.30
USD GENERAL MOTORS CO 5.40000% 20-02.10.23	3 000 000.00	3 003 946.59	0.45
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 2.90000% 20-26.02.25	1 000 000.00	944 885.14	0.14
USD GILEAD SCIENCES INC 3.65000% 15-01.03.26	1 500 000.00	1 452 146.11	0.22
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.50000% 20-01.04.25	1 000 000.00	967 681.31	0.15
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 5.70000% 22-01.11.24	2 500 000.00	2 529 946.80	0.38
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 3.50000% 16-16.11.26	3 000 000.00	2 853 532.44	0.43
USD HARLEY-DAVIDSON FINANCIAL SERVICE-REG-S 3.35000% 20-08.06.25	2 500 000.00	2 352 728.82	0.35
USD HSBC HOLDINGS PLC-SUB 4.25000% 14-14.03.24	3 000 000.00	2 950 306.35	0.44
USD ING BANK NV-REG-S-SUB 5.80000% 13-25.09.23	2 914 000.00	2 914 714.04	0.44
USD ING GROEP NV 3.55000% 19-09.04.24	3 898 000.00	3 812 717.88	0.57
USD INVESCO FINANCE PLC 3.75000% 15-15.01.26	1 000 000.00	961 730.00	0.15
USD KELLOGG CO 2.65000% 16-01.12.23	2 000 000.00	1 952 817.78	0.29
USD KROGER CO 4.00000% 14-01.02.24	2 000 000.00	1 980 819.84	0.30
USD LENNOX INTERNATIONAL INC 1.35000% 20-01.08.25	900 000.00	815 522.31	0.12
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.45000% 18-08.05.25	5 000 000.00	4 888 697.85	0.73
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 3.90000% 19-12.03.24	1 500 000.00	1 471 711.31	0.22
USD MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD 3.60000% 19-15.04.24	1 000 000.00	981 171.41	0.15
USD MARSH & MCLENNAN COS INC 3.87500% 19-15.03.24	3 000 000.00	2 959 290.60	0.44
USD METLIFE INC 3.60000% 14-10.04.24	3 000 000.00	2 951 612.19	0.44
USD MICROSOFT CORP 3.12500% 15-03.11.25	5 000 000.00	4 857 154.70	0.73
USD MONDELEZ INTERNATIONAL HDG NLD BV-REG-S 4.25000% 22-15.09.25	1 800 000.00	1 766 808.99	0.27
USD MOODY 'S CORP 3.75000% 20-24.03.25	3 000 000.00	2 923 312.68	0.44
USD NATWEST MARKETS PLC-144A 1.60000% 21-29.09.26	2 560 000.00	2 216 666.40	0.33
USD NEPTUNE ENERGY BONDCO PLC-REG-S 6.62500% 18-15.05.25	1 500 000.00	1 472 732.16	0.22
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 0.60600% 21-14.09.24	6 000 000.00	5 571 806.82	0.84
USD NOMURA HOLDINGS INC 2.64800% 20-16.01.25	5 000 000.00	4 715 918.50	0.71

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 NOMURA HOLDINGS INC 5.09900% 22-03.07.25	2 000 000.00	1 983 252.80	0.30
USD ORACLE CORP 2.50000% 20-01.04.25	2 000 000.00	1 891 732.52	0.28
USD ORACLE CORP 5.80000% 22-10.11.25	1 030 000.00	1 055 027.53	0.16
USD ORIX CORP 3.25000% 17-04.12.24	500 000.00	478 658.25	0.07
USD PARK AEROSPACE HOLDINGS LTD-144A 5.50000% 17-15.02.24	4 500 000.00	4 433 809.91	0.67
USD PENSKE TRK LEA CO LP/PTL FIN CORP-REG-S 4.40000% 22-01.07.27	1 765 000.00	1 679 044.55	0.25
USD PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP 3.85000% 13-15.10.23	1 000 000.00	986 617.08	0.15
USD QUANTA SERVICES INC 0.95000% 21-01.10.24	2 575 000.00	2 358 104.17	0.35
USD ROPER TECHNOLOGIES INC 3.65000% 18-15.09.23	1 500 000.00	1 482 032.90	0.22
USD SHIMAO PRPTY HLDG LTD-REG-S *DEFAULTED* 6.12500% 19-21.02.24	1 000 000.00	115 000.00	0.02
USD SHIMAO PRPTY HLDG LTD-REG-S *DEFAULTED* 3.97500% 21-16.09.23	600 000.00	70 500.00	0.01
USD SOCIETE GENERALE SA-REG-S-SUB 5.00000% 14-17.01.24	500 000.00	492 925.31	0.07
USD SOCIETE GENERALE-REG-S 2.62500% 19-16.10.24	7 030 000.00	6 622 136.91	1.00
USD SPRINGLEAF FINANCE CORP 6.12500% 19-15.03.24	2 000 000.00	1 950 600.00	0.29
USD SUNCORP-METWAY LTD-REG-S 3.30000% 19-15.04.24	430 000.00	418 017.62	0.06
USD SVENSKA HANDELSBANKEN AB-REG-S 0.55000% 21-11.06.24	2 250 000.00	2 103 012.98	0.32
USD T-MOBILE USA INC 3.50000% 21-15.04.25	3 000 000.00	2 904 617.46	0.44
USD TELECOM ITALIA SPA-144A 5.30300% 14-30.05.24	2 000 000.00	1 937 000.00	0.29
USD THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 1.21500% 21-18.10.24	650 000.00	608 196.17	0.09
USD TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.75000% 14-10.04.24	1 500 000.00	1 481 266.85	0.22
USD UBS AG LONDON-144A 1.37500% 22-13.01.25	2 000 000.00	1 851 286.36	0.28
USD UBS GROUP AG-REG-S 4.12500% 16-15.04.26	2 000 000.00	1 923 157.16	0.29
USD UNITED PARCEL SERVICE INC 3.90000% 20-01.04.25	2 500 000.00	2 466 656.05	0.37
USD UZBEK INDUSTRIAL AND CONS ATB-REG-S 5.75000% 19-02.12.24	1 000 000.00	907 375.00	0.14
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 0.85000% 20-20.11.25	6 333 000.00	5 683 498.29	0.85
USD VMWARE INC 4.50000% 20-15.05.25	4 796 000.00	4 746 165.87	0.71
USD WALT DISNEY CO 1.75000% 19-30.08.24	4 000 000.00	3 800 409.68	0.57
USD WESTPAC BANKING CORP 1.15000% 21-03.06.26	4 108 000.00	3 630 233.85	0.55
USD WILLIAMS COMPANIES INC 4.55000% 14-24.06.24	2 000 000.00	1 979 316.04	0.30
米ドル合計		270 686 573.22	40.65
ノート合計 - 固定金利		278 291 955.91	41.79
ノート - 変動金利			
米ドル			
USD ABN AMRO BANK NV-REG-S-SUB 4.400%/VAR 17-27.03.28	6 200 000.00	6 045 000.00	0.91
USD BANCO SANTANDER SA 0.701%/VAR 21-30.06.24	2 200 000.00	2 128 682.05	0.32
USD BARCLAYS PLC 5.304%/VAR 22-09.08.26	6 000 000.00	5 900 403.54	0.89
USD BNP PARIBAS-REG-S 2.819% /VAR 19-19.11.25	5 000 000.00	4 705 852.30	0.71
USD CITIGROUP INC 2.014%/VAR 22-25.01.26	6 000 000.00	5 570 680.92	0.84
USD CITIGROUP INC 3.352%/VAR 19-24.04.25	7 000 000.00	6 769 174.51	1.02
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S 4.207%/VAR 18-12.06.24	6 500 000.00	6 307 209.03	0.95
USD DANSKE BANK AS-REG-S 3.244%/VAR 19-20.12.25	2 000 000.00	1 864 346.78	0.28
USD DNB BANK ASA-REG-S 0.856%/VAR 21-30.09.25	7 185 000.00	6 593 869.29	0.99
USD ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 5.625%/VAR 14-PRP	1 800 000.00	1 693 363.60	0.25
USD HSBC HOLDINGS PLC 4.292%/VAR 18-12.09.26	4 000 000.00	3 810 656.32	0.57
USD HSBC HOLDINGS PLC 4.180%/VAR 22-09.12.25	3 000 000.00	2 889 717.87	0.43
USD JPM CHASE& CO 3.845%/VAR 22-14.06.25	4 000 000.00	3 927 747.44	0.59
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.220%/VAR 17-01.03.25	7 000 000.00	6 815 197.69	1.02
USD JPMORGAN CHASE & CO 0.824%/VAR 21-01.06.25	1 000 000.00	929 990.52	0.14
USD JPMORGAN CHASE 1.561%/VAR 21-10.12.25	4 000 000.00	3 694 735.64	0.55
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.716%/VAR 22-11.08.26	5 000 000.00	4 851 064.80	0.73
USD MORGAN STANLEY 0.790%/VAR 21-30.05.25	11 000 000.00	10 192 426.75	1.53
USD MORGAN STANLEY 1.593%/VAR 21-04.05.27	5 000 000.00	4 404 907.95	0.66
USD NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-144A 4.363%/VAR 18-01.08.24	2 000 000.00	1 970 857.50	0.29

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 SANTANDER UK GRP HOLD PLC 4.796%/3M LIBOR+157BP 18-15.11.24	4 000 000.00	3 925 048.20	0.59
USD SOCIETE GENERALE SA-REG-S 2.226%/VAR 22-21.01.26	3 120 000.00	2 856 961.20	0.43
USD STANDARD CHARTERED PLC-REG-S 3.885%/VAR 18-15.03.24	10 190 000.00	10 115 752.91	1.52
米ドル合計		107 963 646.81	16.21
ノート合計 - 変動金利		107 963 646.81	16.21
中期債券 - 固定金利			
ユーロ			
EUR CELLNEX TELECOM SA-REG-S 2.87500% 17-18.04.25	1 500 000.00	1 507 546.61	0.23
EUR CTP BV-REG-S 0.62500% 20-27.11.23	1 500 000.00	1 451 404.94	0.22
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA AG-REG-S 2.00000% 21-14.07.24	2 400 000.00	2 376 811.12	0.36
EUR FORTUM OYJ-REG-S 0.87500% 19-27.02.23	2 000 000.00	2 047 574.35	0.31
EUR REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 0.12500% 20-05.10.24	2 000 000.00	1 950 618.39	0.29
EUR WIZZ AIR FINANCE CO BV-REG-S 1.35000% 21-19.01.24	1 400 000.00	1 366 133.44	0.20
ユーロ合計		10 700 088.85	1.61
英ポンド			
GBP FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.74800% 20-14.06.24	400 000.00	449 564.75	0.07
英ポンド合計		449 564.75	0.07
米ドル			
USD AAREAL BANK AG-REG-S 0.62500% 21-14.02.25	2 000 000.00	1 822 105.14	0.27
USD ADCB FINANCE CAYMAN LTD-REG-S-SUB 4.50000% 13-06.03.23	4 000 000.00	3 982 000.00	0.60
USD ARAB PETROLEUM INVESTMENTS CORP-REG-S 1.46000% 20-30.06.25	1 000 000.00	919 274.00	0.14
USD BNP PARIBAS-REG-S 3.80000% 17-10.01.24	4 000 000.00	3 932 104.76	0.59
USD CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 3.25000% 17-04.10.24	2 000 000.00	1 927 826.46	0.29
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC STEP-UP 18-31.05.24	1 258 000.00	1 238 405.90	0.19
USD JOHN DEERE CAPITAL CORP 0.625000% 21-10.09.24	910 000.00	848 782.77	0.13
USD LENOVO GROUP LTD-REG-S 5.87500% 20-24.04.25	2 000 000.00	1 945 880.00	0.29
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 2.50000% 19-07.11.24	1 000 000.00	952 687.50	0.14
USD NORDEA BANK ABP-REG-S 1.50000% 21-30.09.26	5 000 000.00	4 323 910.85	0.65
USD OVERSEA-CHINESE BANKING CORP-144A-SUB 4.25000% 14-19.06.24	2 000 000.00	1 965 807.20	0.29
USD QNB FINANCE LTD-REG-S 3.50000% 19-28.03.24	1 000 000.00	976 437.50	0.15
USD SWIRE PACIFIC MTN FINANCING LTD-REG-S 4.50000% 13-09.10.23	1 500 000.00	1 489 972.50	0.22
USD TORONTO-DOMINION BANK 3.25000% 19-11.03.24	3 000 000.00	2 938 307.22	0.44
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 1.45000% 22-13.01.25	1 700 000.00	1 595 918.30	0.24
米ドル合計		30 859 420.10	4.63
中期債券合計 - 固定金利		42 009 073.70	6.31
中期債券 - ゼロ・クーポン			
ユーロ			
EUR BECTON DICKINSON AND CO 0.00000% 21-13.08.23	840 000.00	847 280.95	0.13
ユーロ合計		847 280.95	0.13
中期債券合計 - ゼロ・クーポン		847 280.95	0.13
中期債券 - 変動金利			
ユーロ			
EUR ALLIANZ SE-REG-S-SUB 4.750%/3M EURIBOR+360BP 13-PRP	1 500 000.00	1 535 022.81	0.23
ユーロ合計		1 535 022.81	0.23

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%
米ドル			
USD AIB GROUP PLC-REG-S 4.263%/VAR 19-10.04.25	1 500 000.00	1 444 067.26	0.22
USD BANK OF AMERICA CORP 2.456%/VAR 19-22.10.25	5 000 000.00	4 704 545.60	0.71
USD BANK OF AMERICA CORP 0.981%/VAR 20-25.09.25	3 000 000.00	2 748 087.03	0.41
USD BANK OF AMERICA CORP 0.810%/VAR 20-24.10.24	7 000 000.00	6 686 667.82	1.00
USD DBS GROUP HOLDINGS LTD-144A-SUB 4.520%/VAR 18-11.12.28	3 000 000.00	2 961 609.24	0.44
USD MACQUARIE GROUP LTD-144A 1.201%/VAR 21-14.10.25	4 000 000.00	3 639 709.60	0.55
USD MACQUARIE GROUP LTD-REG-S 4.150%/3M LIBOR+133BP 18- 27.03.24	2 530 000.00	2 516 149.51	0.38
USD RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S-SUB 4.000%/VAR 17-10.04.29	3 000 000.00	2 834 400.00	0.42
USD UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S-SUB 3.750%/VAR 19-15.04.29	2 453 000.00	2 381 970.68	0.36
米ドル合計		29 917 206.74	4.49
中期債券合計 - 変動金利		31 452 229.55	4.72
長期債券 - 固定金利			
ユーロ			
EUR WIENERBERGER AG-REG-S 2.00000% 18-02.05.24	2 000 000.00	2 010 288.67	0.30
EUR WINTERSHALL DEA FINANCE BV-REG-S 0.45200% 19-25.09.23	2 000 000.00	2 002 776.33	0.30
ユーロ合計		4 013 065.00	0.60
英ポンド			
GBP JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-REG-S 3.87500% 15- 01.03.23	500 000.00	588 751.19	0.09
英ポンド合計		588 751.19	0.09
米ドル			
USD CANADIAN IMPERIAL BANK OF-REG-S 1.15000% 21-08.07.26	4 500 000.00	3 974 582.34	0.60
USD CK HUTCHISON INTERNATIONAL LTD-REG-S 3.25000% 19-11.04.24	4 000 000.00	3 904 916.25	0.59
USD DANONE-REG-S 2.58900% 16-02.11.23	729 000.00	711 803.24	0.11
USD DEUTSCHE BANK AG/LONDON 3.70000% 14-30.05.24	5 000 000.00	4 896 463.30	0.73
USD GILEAD SCIENCES INC 3.70000% 14-01.04.24	3 000 000.00	2 951 340.45	0.44
USD KINDER MORGAN INC 4.30000% 14-01.06.25	2 000 000.00	1 970 431.20	0.30
USD LG CHEM LTD-REG-S 3.25000% 19-15.10.24	2 000 000.00	1 915 300.00	0.29
USD MIZUHO FINANCE GRP CAY 3 LTD-REG-S-SUB 4.60000% 14- 27.03.24	5 000 000.00	4 912 600.00	0.74
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 3.40000% 14-06.05.24	2 000 000.00	1 968 774.20	0.29
USD PRAXAIR INC 2.65000% 15-05.02.25	1 000 000.00	961 553.67	0.14
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC-144A-SUB 4.43600% 14-02.04.24	1 500 000.00	1 472 869.76	0.22
USD UBS AG-REG-S-SUB 5.12500% 14-15.05.24	3 400 000.00	3 334 577.20	0.50
米ドル合計		32 975 211.61	4.95
長期債券合計 - 固定金利		37 577 027.80	5.64
長期債券 - 変動金利			
米ドル			
USD ALLSTATE CORP-SUB 5.750%/3M LIBOR+293.8BP 13-15.08.53	250 000.00	230 375.00	0.04
USD BP CAPITAL MARKETS PLC-SUB 4.375%/VAR 20-PRP	3 800 000.00	3 614 750.00	0.54
USD JP MORGAN CHASE & CO 2.005%/VAR 20-13.03.26	5 000 000.00	4 646 248.20	0.70
USD NBK TIER 1 FINANCING 2 LTD-REG-S-SUB 4.500%/VAR 19-PRP	3 300 000.00	2 991 615.00	0.45
USD SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN-REG-S-SUB 5.125%/VAR 19-PRP	3 000 000.00	2 805 000.00	0.42
USD SWISS RE FINANCE LUXEMBOURG-REG-S-SUB 4.250%/VAR 19-PRP	2 000 000.00	1 695 200.00	0.25
USD VODAFONE GROUP PLC-REG-S-SUB 6.250%/VAR 18-03.10.78	3 000 000.00	2 887 500.00	0.43
米ドル合計		18 870 688.20	2.83
長期債券合計 - 変動金利		18 870 688.20	2.83

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%
転換社債型新株予約権付社債 - 変動金利			
米ドル			
USD BANK OF MONTREAL-SUB 4.338%/VAR 18-05.10.28	5 000 000.00	4 904 596.20	0.74
USD BARCLAYS PLC-SUB COCO 8.000%/VAR 19-PRP	3 000 000.00	2 887 500.00	0.43
米ドル合計		7 792 096.20	1.17
転換社債型新株予約権付社債合計 - 変動金利		7 792 096.20	1.17
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		524 803 999.12	78.80
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			
資産担保証券 - 固定金利			
米ドル			
USD AMERICREDIT AUTOMOBILE RECEIVABLE TRUST 4.04000% 18-18.11.24	1 100 000.00	1 090 123.65	0.16
USD COLT MERGER SUB INC-144A 3.60000% 18-25.02.48	4 338 000.00	1 344 465.33	0.20
USD EXETER AUTOMOBILE RECEIVABLES-144A 4.35000% 18-16.09.24	865 000.00	259 263.47	0.04
米ドル合計		2 693 852.45	0.40
資産担保証券合計 - 固定金利		2 693 852.45	0.40
モーゲージ担保証券 - 固定金利			
米ドル			
USD BWAY 2013-1515 MORTGAGE TRUST-144A 3.45430% 13-10.03.33	4 000 000.00	3 747 632.40	0.57
USD COMM 2015-3BP MORTGAGE TRUST-144A-SUB 3.17800% 15-01.02.35	4 055 000.00	3 745 683.78	0.56
USD COMM 2015-CCRE22 MORTGAGE TRUST 3.92600% 15-01.03.48	1 000 000.00	930 144.50	0.14
USD JP MORGAN CHASE MORTGAGE SEC-144A 3.73450% 18-01.01.31	2 605 000.00	2 594 877.24	0.39
米ドル合計		11 018 337.92	1.66
モーゲージ担保証券合計 - 固定金利		11 018 337.92	1.66
モーゲージ担保証券 - 変動金利			
米ドル			
USD CITYLINE COMMERCIAL MORTGAGE TRUST VAR 21-01.11.31	1 000 000.00	945 142.00	0.14
USD COMM 2014-CCRE15 MORTGAGE TRUST-SUB VAR 14-01.02.47	325 000.00	312 002.27	0.05
USD COMMERCIAL MORTGAGE PASS-THR-144A 3.812163%/VAR 13-01.06.46	2 500 000.00	2 468 961.25	0.37
USD MSCG TRUST 2018-SELF-144A-SUB 1M LIBOR+90BP 18-15.10.37	1 000 000.00	890 341.81	0.13
米ドル合計		4 616 447.33	0.69
モーゲージ担保証券合計 - 変動金利		4 616 447.33	0.69
ノート - 固定金利			
米ドル			
USD AKER BP ASA-144A 3.00000% 20-15.01.25	3 000 000.00	2 838 504.09	0.43
USD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BNK-REG-S-SUB 4.50000% 14-19.03.24	5 000 000.00	4 929 464.50	0.74
USD BAKER HUGHES HOLDINGS LLC / BAKER HUGH 1.23100% 21-15.12.23	1 500 000.00	1 444 259.88	0.22
USD BANK OF NEW ZEALAND-144A 3.50000% 19-20.02.24	4 885 000.00	4 798 193.55	0.72
USD BAXTER INTERNATIONAL INC 1.32200% 22-29.11.24	1 000 000.00	930 077.67	0.14
USD BAYER US FINANCE LLC-144A 3.37500% 14-08.10.24	4 000 000.00	3 868 076.88	0.58
USD BERRY GLOBAL INC 0.95000% 21-15.02.24	1 000 000.00	949 556.50	0.14

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 BLOCK INC 2.75000% 21-01.06.26	1 000 000.00	893 700.00	0.13
USD BROADCOM INC 3.15000% 20-15.11.25	2 000 000.00	1 903 092.14	0.29
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 2.85000% 16-18.05.26	2 000 000.00	1 871 968.74	0.28
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL SA-144A 2.65000% 19-10.09.24	1 000 000.00	955 640.88	0.14
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 2.65000% 19-10.09.24	1 500 000.00	1 433 461.32	0.22
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 6.80000% 22-14.10.25	470 000.00	486 694.72	0.07
USD ERAC USA FINANCE LLC-144A 2.70000% 16-01.11.23	1 000 000.00	975 682.34	0.15
USD GLP CAPITAL LP / GLP FINANC II INC 5.37500% 14-01.11.23	1 000 000.00	990 170.00	0.15
USD LIBERTY MUTUAL GROUP INC-144A 4.25000% 13-15.06.23	1 850 000.00	1 833 707.20	0.28
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 4.15000% 22-26.08.25	1 000 000.00	981 573.14	0.15
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 4.05000% 22- 25.08.25	690 000.00	675 604.93	0.10
USD NORDEA BANK AB-144A 0.62500% 21-24.05.24	2 400 000.00	2 244 238.13	0.34
USD NORDEA BANK ABP -REG-S 3.60000% 22-06.06.25	1 400 000.00	1 356 366.33	0.20
USD NXP BV / NXP FUNDING LLC 4.87500% 22-01.03.24	2 500 000.00	2 471 562.50	0.37
USD PENSKE TRUCK LEASING/PTL FIN CORP-144A 2.70000% 19- 01.11.24	1 235 000.00	1 161 521.82	0.17
USD RABOBANK UTRECHT-144A 2.62500% 19-22.07.24	2 000 000.00	1 913 726.00	0.29
USD ROCHE HOLDINGS INC-144A 0.45000% 21-05.03.24	5 000 000.00	4 741 904.05	0.71
USD SCHLUMBERGER HOLDINGS CORP-144A 3.75000% 19-01.05.24	500 000.00	491 447.52	0.07
USD SUNCORP-METWAY LTD-144A 3.30000% 19-15.04.24	2 350 000.00	2 281 810.29	0.34
USD WEA FIN LLC/ WESTF UK&EUR FIN PLC-REG-S 3.75000% 14- 17.09.24	1 000 000.00	947 363.49	0.14
米ドル合計		50 369 368.61	7.56
ノート合計 - 固定金利		50 369 368.61	7.56
ノート - 変動金利			
米ドル			
USD DANSKE BANK A/S-144A 3.773%/VAR 22-28.03.25	3 000 000.00	2 888 211.78	0.43
USD ING GROEP NV 3.869%/VAR 22-28.03.26	4 000 000.00	3 842 492.44	0.58
米ドル合計		6 730 704.22	1.01
ノート合計 - 変動金利		6 730 704.22	1.01
中期債券 - 固定金利			
米ドル			
USD ASB BANK LTD-REG-S 3.12500% 19-23.05.24	1 500 000.00	1 454 195.40	0.22
USD BRIGHTHOUSE FINANCIAL GLOBAL FUND-REG-S 0.60000% 21- 28.06.23	1 200 000.00	1 167 081.20	0.18
USD CREDIT AGRICOLE SA LONDON-144A 3.25000% 17-04.10.24	2 700 000.00	2 602 565.72	0.39
USD INTESA SANPAOLO SPA-144A-SUB 5.01700% 14-26.06.24	2 000 000.00	1 926 700.84	0.29
米ドル合計		7 150 543.16	1.08
中期債券合計 - 固定金利		7 150 543.16	1.08
長期債券 - 変動金利			
米ドル			
USD BANCO BILBAO VIZCA ARGENTARIA SA 5.862%/VAR 14.09.22- 14.09.26	7 000 000.00	6 969 390.82	1.05
USD SCENTRE GROUP TRUST 2-REG-S-SUB 4.750%/VAR 20-24.09.80	3 700 000.00	3 257 150.33	0.49
米ドル合計		10 226 541.15	1.54
長期債券合計 - 変動金利		10 226 541.15	1.54
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		92 805 794.84	13.94

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 - 固定金利			
米ドル			
USD SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ-144A 0.65000% 21- 11.03.24	5 000 000.00	4 738 059.00	0.71
USD SWEDBANK AB-REG-S 3.35600% 22-04.04.25	1 156 000.00	1 105 408.28	0.17
USD TRITON CONTAINER INTERNATIONAL-REG-S 1.15000% 21-07.06.24	585 000.00	539 040.94	0.08
米ドル合計		6 382 508.22	0.96
ノート合計 - 固定金利		6 382 508.22	0.96
中期債券 - 固定金利			
米ドル			
USD NBN CO LTD-REG-S 0.87500% 21-08.10.24	3 600 000.00	3 308 520.96	0.50
米ドル合計		3 308 520.96	0.50
中期債券合計 - 固定金利		3 308 520.96	0.50
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		9 691 029.18	1.46
法第41条(1) h)に規定されたその他の金融市場商品			
ユーロ・コマーシャル・ペーパー - ゼロ・クーポン			
米ドル			
USD SKANDINAVISKA ENSKILD ECP 0.00000% 19.07.22-18.07.23	7 000 000.00	6 773 678.10	1.02
USD TORONTO DOMINION BANK ECP 0.00000% 19.07.22-18.07.23	5 000 000.00	4 836 247.75	0.72
米ドル合計		11 609 925.85	1.74
ユーロ・コマーシャル・ペーパー合計 - ゼロ・クーポン		11 609 925.85	1.74
法第41条(1) h)に規定されたその他の金融市場商品合計		11 609 925.85	1.74
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 UBS (IRL) SELECT MONEY MARKET FUND-USD-S-DIST	100.00	1 000 000.00	0.15
アイルランド合計		1 000 000.00	0.15
投資信託、オープン・エンド型合計		1 000 000.00	0.15
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		1 000 000.00	0.15
投資有価証券合計		639 910 748.99	96.09

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 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.23	500.00	207 032.00	0.03
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.23	-100.00	-32 031.30	0.00
債券先物合計		175 000.70	0.03
公認証券取引所に上場されたデリバティブ商品合計		175 000.70	0.03
デリバティブ商品合計		175 000.70	0.03
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			
USD			

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
ショート・ターム米ドル コーポレート・ サステナブル(米ドル)	クラス F - a c c 投資証券	754,753.759 (0.000)	328,313.000 (0.000)	784,208.759 (0.000)

(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。