

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2023年 6 月30日

【発行者名】 U B S (L u x) キー・セレクション・シキャブ
(UBS (Lux) Key Selection SICAV)

【代表者の役職氏名】 チェアマン・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ
ロバート・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
弁護士 大 西 信 治

【代理人の住所又は所在地】 東京都千代田区丸の内二丁目 6 番 1 号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所

【事務連絡者氏名】 弁護士 三 浦 健
弁護士 大 西 信 治

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内二丁目 6 番 1 号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所

【電話番号】 03 (6212) 8316

【届出の対象とした募集(売出)外国投資証券に係る外国投資法人の名称】
U B S (L u x) キー・セレクション・シキャブ
- グローバル・アロケーション(米ドル)
- グローバル・アロケーション(ユーロ)
- ダイナミック・アルファ(米ドル)
- デジタル・トランスフォーメーション・テーマ(米ドル)
(UBS (Lux) Key Selection SICAV
- Global Allocation (USD)
- Global Allocation (EUR)
- Dynamic Alpha (USD)
- Digital Transformation Themes (USD))

【届出の対象とした募集(売出)外国投資証券の形態及び金額】

記名式無額面投資証券

グローバル・アロケーション(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

円建クラスP - a c c 投資証券

グローバル・アロケーション(ユーロ)

クラスP - a c c 投資証券

ダイナミック・アルファ(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

ユーロ・ヘッジクラスP - a c c 投資証券

デジタル・トランスフォーメーション・テーマ(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

上限見込額は以下のとおりである。

グローバル・アロケーション(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

15億5,000万米ドル(約2,057億円)

円建クラスP - a c c 投資証券

1,542億8,000万円

グローバル・アロケーション(ユーロ)

クラスP - a c c 投資証券

13億9,200万ユーロ(約1,969億円)

ダイナミック・アルファ(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

12億3,030万米ドル(約1,633億円)

ユーロ・ヘッジクラスP - a c c 投資証券

9億2,870万ユーロ(約1,314億円)

デジタル・トランスフォーメーション・テーマ(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

12億6,030万米ドル(約1,672億円)

(注1) 上限見込額は、便宜上、各サブ・ファンドの投資証券の2022年12月末日現在の1口当たりの純資産価格に基づいて算出されている。(グローバル・アロケーション(米ドル)クラスP - a c c 投資証券については15.50米ドルに1億口、グローバル・アロケーション(米ドル)円建クラスP - a c c 投資証券については15,428円に1,000万口、グローバル・アロケーション(ユーロ)クラスP - a c c 投資証券については13.92ユーロに1億口、ダイナミック・アルファ(米ドル)クラスP - a c c 投資証券については123.03米ドルに1,000万口、ダイナミック・アルファ(米ドル)ユーロ・ヘッジクラスP - a c c 投資証券については92.87ユーロに1,000万口およびデジタル・トランスフォーメーション・テーマ(米ドル)クラスP - a c c 投資証券については126.03米ドルに1,000万口をそれぞれ乗じて算出した金額である。)

(注2) 米ドルおよび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米ドル=132.70円および1ユーロ=141.47円)による。

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

【縦覧に供する場所】

該当事項なし

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2023年3月31日に提出した有価証券届出書(以下「原届出書」といいます。)について、本日、半期報告書を提出しましたので、これに関する記載を訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

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

2【訂正の内容】

半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正内容は、下記のとおりです。

原届出書の下記事項については、半期報告書の記載内容と同一内容に更新または追加されます(ただし、UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・エクイティーズ(米ドル)に関する情報は除きます。)。

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

* 半期報告書の記載内容は、以下のとおりです。

[次へ](#)

1 外国投資法人の概況

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション (米ドル)、UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション (ユーロ)、UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - ダイナミック・アルファ (米ドル)、UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - デジタル・トランスフォーメーション・テーマ (米ドル) および UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・エクイティーズ (米ドル) (以下 UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブを「本投資法人」、UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション (米ドル)、UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション (ユーロ)、UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - ダイナミック・アルファ (米ドル)、UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - デジタル・トランスフォーメーション・テーマ (米ドル) および UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・エクイティーズ (米ドル) をそれぞれ「ファンド」または「サブ・ファンド」という。) の概況は以下のとおりである。

(注) 上記の他、各ファンドにはクラス P - a c c 投資証券、円建クラス P - a c c 投資証券およびユーロ・ヘッジクラス P - a c c 投資証券以外の投資証券も存在するが、その他の投資証券は日本で販売されていないため、以下、各ファンドについて「投資証券」というときは、上記の各クラス P - a c c 投資証券、円建クラス P - a c c 投資証券および / またはユーロ・ヘッジクラス P - a c c 投資証券を指すものとする。

(1) 主要な経営指標等の推移

(グローバル・アロケーション (米ドル))

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	2021年3月末日に 終了する 中間会計年度末	2021年9月末日に 終了する 会計年度末	2022年3月末日に 終了する 中間会計年度末	2022年9月末日に 終了する 会計年度末	2023年3月末日に 終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	40,590,539.10	48,904,898.19	- 21,073,727.05	- 74,070,251.33	15,127,129.11
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	40,590,539.10	48,904,898.19	- 21,073,727.05	- 74,070,251.33	15,127,129.11
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	40,590,539.10	48,904,898.19	- 21,073,727.05	- 74,070,251.33	15,127,129.11
(d) 出資総額 ⁽²⁾	346,606,260.80	339,421,733.18	307,756,565.34	240,728,330.00	238,759,558.05
(e) 発行済投資口総数	(クラス P - a c c 投資証券) 16,190,143.954口 (円建クラス P - a c c 投資証券) 1,283.694口	(クラス P - a c c 投資証券) 15,485,088.907口 (円建クラス P - a c c 投資証券) 1,283.694口	(クラス P - a c c 投資証券) 15,088,115.826口 (円建クラス P - a c c 投資証券) 1,283.694口	(クラス P - a c c 投 資証券) 14,459,087.048口 (円建クラス P - a c c 投資証券) 1,133.000口	(クラス P - a c c 投資証券) 13,445,813.645口 (円建クラス P - a c c 投資証券) 1,133.000口
(f) 純資産額	346,606,260.80	339,421,733.18	307,756,565.34	240,728,330.00	238,759,558.05
(g) 資産総額	352,857,370.39	342,633,714.76	308,936,154.59	251,977,023.89	240,378,322.88
(h) 1口当たり純資産価格	(クラス P - a c c 投資証券) 18.74 (円建クラス P - a c c 投資証券) 15,613円	(クラス P - a c c 投資証券) 19.18 (円建クラス P - a c c 投資証券) 16,132円	(クラス P - a c c 投資証券) 17.96 (円建クラス P - a c c 投資証券) 16,435円	(クラス P - a c c 投 資証券) 14.78円 (円建クラス P - a c c 投資証券) 16,139円	(クラス P - a c c 投資証券) 15.71 (円建クラス P - a c c 投資証券) 15,767円
(i) 1口当たり当期純利益金額 または当期純損失金額	(クラス P - a c c 投資証券) 2.14 (円建クラス P - a c c 投資証券) 15.56	(クラス P - a c c 投資証券) 2.70 (円建クラス P - a c c 投資証券) 18.85	(クラス P - a c c 投資証券) - 1.23 (円建クラス P - a c c 投資証券) - 9.18	(クラス P - a c c 投 資証券) - 4.53 (円建クラス P - a c c 投資証券) - 35.96	(クラス P - a c c 投資証券) 0.99 (円建クラス P - a c c 投資証券) 6.97
(j) 分配総額	なし	なし	なし	なし	なし
(k) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	98.23%	99.06%	99.62%	95.54%	99.33%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾	(クラス P - a c c 投資証券) 29.60% (円建クラス P - a c c 投資証券) 32.55%	(クラス P - a c c 投資証券) 14.99% (円建クラス P - a c c 投資証券) 21.58%	(クラス P - a c c 投資証券) - 4.16% (円建クラス P - a c c 投資証券) 5.26%	(クラス P - a c c 投 資証券) - 22.94% (円建クラス P - a c c 投資証券) 0.04%	(クラス P - a c c 投資証券) - 12.53% (円建クラス P - a c c 投資証券) - 4.06%

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

- (2) ファンドは変動資本を有する会社型投資信託であり、純資産総額を記載している。以下各サブ・ファンドについて同様とする。
- (3) 自己資本利益率は、当該会計年度の1口当たり純資産価格の前年度に対する増減の比率であるが、当該会計年度に初めて当該投資証券が発行された場合には、当初募集価格に対する増減の比率で表すものとする。以下各サブ・ファンドについて同様とする。
- (注1) 2008年4月以降の各取引日に使用された1口当たり純資産価格は、純資産価格の調整の結果、上記および財務書類に記載の1口当たり純資産価格と異なる場合がある(財務書類に対する注記1参照)。以下同じ。
- (注2) グローバル・アロケーション(米ドル)は2004年9月24日に運用を開始し、円建クラスP - a c c 投資証券は2013年8月5日に募集が開始された。
- (注3) 2009年5月31日付でクラスB投資証券はクラスP - a c c 投資証券に名称が変更された。以下各サブ・ファンドについて同じ。
- (注4) 「主要な経営指標等の推移(e)発行済投資口総数、(h)1口当たり純資産価格、(i)1口当たり当期純利益金額または当期純損失金額、(k)1口当たり分配金額および(m)自己資本利益率」は、日本で販売しているクラスのみ記載している。以下同じ。

(グローバル・アロケーション(ユーロ))

(別段の記載がない限り金額はユーロ表示)

	2021年3月末日に 終了する 中間会計年度末	2021年9月末日に 終了する 会計年度末	2022年3月末日に 終了する 中間会計年度末	2022年9月末日に 終了する 会計年度末	2023年3月末日に 終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益	39,963,208.54	53,870,716.39	- 17,372,595.48	- 67,924,974.00	7,870,515.29
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	39,963,208.54	53,870,716.39	- 17,372,595.48	- 67,924,974.00	7,870,515.29
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	39,963,208.54	53,870,716.39	- 17,372,595.48	- 67,924,974.00	7,870,515.29
(d) 出資総額	349,434,041.35	353,908,219.11	326,077,476.21	252,042,193.82	242,364,143.95
(e) 発行済投資口総数	(クラスP - a c c 投資証券) 14,684,325.211口	(クラスP - a c c 投資証券) 14,173,706.335口	(クラスP - a c c 投 資証券) 13,559,853.194口	(クラスP - a c c 投 資証券) 12,351,613.119口	(クラスP - a c c 投 資証券) 11,483,370.058口
(f) 純資産額	349,434,041.35	353,908,219.11	326,077,476.21	252,042,193.82	242,364,143.95
(g) 資産総額	357,872,301.79	358,251,863.46	339,650,347.29	262,662,660.79	245,114,747.32
(h) 1口当たり純資産価格	(クラスP - a c c 投資証券) 16.55	(クラスP - a c c 投資証券) 17.18	(クラスP - a c c 投 資証券) 16.19	(クラスP - a c c 投 資証券) 13.56	(クラスP - a c c 投 資証券) 14.06
(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) 1.67	(クラスP - a c c 投資証券) 2.39	(クラスP - a c c 投 資証券) - 1.01	(クラスP - a c c 投 資証券) - 3.89	(クラスP - a c c 投 資証券) 0.55
(j) 分配総額	549,711.83	839,829.90	658,434.48	994,368.62	620,125.30
(k) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	97.64%	98.79%	96.00%	95.96%	98.88%
(m) 自己資本利益率	(クラスP - a c c 投資証券) 28.10%	(クラスP - a c c 投資証券) 16.40%	(クラスP - a c c 投 資証券) - 2.18%	(クラスP - a c c 投 資証券) - 21.07%	(クラスP - a c c 投 資証券) - 13.16%

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

(ダイナミック・アルファ (米ドル))

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	2021年3月末日に 終了する 中間会計年度末	2021年9月末日に 終了する 会計年度末	2022年3月末日に 終了する 中間会計年度末	2022年9月末日に 終了する 会計年度末	2023年3月末日に 終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益	3,171,909.79	4,633,581.73	133,095.62	- 5,130,544.96	3,384,943.13
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	3,171,909.79	4,633,581.73	133,095.62	- 5,130,544.96	3,384,943.13
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	3,171,909.79	4,633,581.73	133,095.62	- 5,130,544.96	3,384,943.13
(d) 出資総額	45,113,865.47	49,030,139.47	48,774,840.34	44,885,879.32	49,635,798.93
(e) 発行済投資口総数	(クラスP - a c c 投資証券) 33,321.284口 (ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) 6,411.373口	(クラスP - a c c 投資証券) 29,414.659口 (ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) 5,009.118口	(クラスP - a c c 投 資証券) 29,635.566口 (ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) 4,590.903口	(クラスP - a c c 投 資証券) 28,901.371口 (ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) 5,595.423口	(クラスP - a c c 投 資証券) 26,246.284口 (ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) 7,064.038口
(f) 純資産額	45,113,865.47	49,030,139.47	48,774,840.34	44,885,879.32	49,635,798.93
(g) 資産総額	46,311,174.82	50,174,476.94	49,794,736.40	46,499,632.57	50,609,497.84
(h) 1口当たり純資産価格	(クラスP - a c c 投資証券) 128.04 (ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) 99.62ユーロ	(クラスP - a c c 投資証券) 130.94 (ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) 101.47ユーロ	(クラスP - a c c 投 資証券) 129.75 (ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) 100.02ユーロ	(クラスP - a c c 投 資証券) 119.77 (ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) 91.13ユーロ	(クラスP - a c c 投 資証券) 124.12 (ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) 93.12ユーロ
(i) 1口当たり当期純利益金額 または当期純損失金額	(クラスP - a c c 投資証券) 11.55 (ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) 10.19	(クラスP - a c c 投資証券) 16.30 (ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) 14.57	(クラスP - a c c 投 資証券) - 1.18 (ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) - 6.35	(クラスP - a c c 投 資証券) - 11.39 (ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) - 24.56	(クラスP - a c c 投 資証券) 4.65 (ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) 8.84
(j) 分配総額	13,353.71	26,768.32	12,708.63	24,904.57	11,257.78
(k) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	97.41%	97.72%	97.95%	96.53%	98.08%
(m) 自己資本利益率	(クラスP - a c c 投資証券) 17.48% (ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) 16.05%	(クラスP - a c c 投資証券) 10.47% (ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) 9.40%	(クラスP - a c c 投 資証券) 1.34% (ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) 0.40%	(クラスP - a c c 投 資証券) - 8.53% (ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) - 10.19%	(クラスP - a c c 投 資証券) - 4.34% (ユーロ・ヘッジ クラスP - a c c 投資証券) - 6.90%

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

(デジタル・トランスフォーメーション・テーマ (米ドル))

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	2021年3月末日に 終了する 中間会計年度末	2021年9月末日に 終了する 会計年度末	2022年3月末日に 終了する 中間会計年度末	2022年9月末日に 終了する 会計年度末	2023年3月末日に 終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ^(1)	202,167,443.52	292,076,335.30	- 104,090,244.03	- 341,357,114.02	65,664,357.78
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	202,167,443.52	292,076,335.30	- 104,090,244.03	- 341,357,114.02	65,664,357.78
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	202,167,443.52	292,076,335.30	- 104,090,244.03	- 341,357,114.02	65,664,357.78
(d) 出資総額 ^(2)	1,361,212,552.87	1,502,931,307.14	761,596,257.16	527,403,962.77	309,312,598.79
(e) 発行済投資口総数	(クラス P - a c c 投資証券) 385,568.878口	(クラス P - a c c 投資証券) 369,510.189口	(クラス P - a c c 投資証券) 340,676.399口	(クラス P - a c c 投資証券) 335,518.873口	(クラス P - a c c 投資証券) 305,879.088口
(f) 純資産額	1,361,212,552.87	1,502,931,307.14	761,596,257.16	527,403,962.77	309,312,598.79
(g) 資産総額	1,374,052,604.69	1,515,918,114.84	763,893,079.25	531,328,903.24	309,796,570.88
(h) 1口当たり純資産価格	(クラス P - a c c 投資証券) 177.00	(クラス P - a c c 投資証券) 187.77	(クラス P - a c c 投資証券) 171.18	(クラス P - a c c 投資証券) 118.88	(クラス P - a c c 投資証券) 143.73
(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) 12.37	(クラス P - a c c 投資証券) 25.06	(クラス P - a c c 投資証券) - 17.28	(クラス P - a c c 投資証券) - 70.99	(クラス P - a c c 投資証券) 25.64
(j) 分配総額	なし	なし	なし	なし	なし
(k) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	99.07%	99.14%	99.70%	99.26%	99.84%
(m) 自己資本利益率 ^(3)	(クラス P - a c c 投資証券) 77.00%	(クラス P - a c c 投資証券) 24.10%	(クラス P - a c c 投資証券) - 3.29%	(クラス P - a c c 投資証券) - 36.69%	(クラス P - a c c 投資証券) - 16.04%

(注) デジタル・トランスフォーメーション・テーマ (米ドル) は、2020年4月6日に運用を開始した。

(グローバル・エクイティーズ(米ドル))

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	2021年3月末日に 終了する 中間会計年度末	2021年9月末日に 終了する 会計年度末	2022年3月末日に 終了する 中間会計年度末	2022年9月末日に 終了する 会計年度末	2023年3月末日に 終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益	46,111,346.48	54,356,009.07	- 4,911,017.31	- 31,239,908.91	11,491,434.80
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	46,111,346.48	54,356,009.07	- 4,911,017.31	- 31,239,908.91	11,491,434.80
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	46,111,346.48	54,356,009.07	- 4,911,017.31	- 31,239,908.91	11,491,434.80
(d) 出資総額	210,053,909.19	185,067,420.08	163,161,877.84	60,068,666.59	54,790,648.00
(e) 発行済投資口総数	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) 712,486.218口	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) 670,508.641口	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) 650,199.725口	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) 634,111.763口	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) 612,499.230口
(f) 純資産額	210,053,909.19	185,067,420.08	163,161,877.84	60,068,666.59	54,790,648.00
(g) 資産総額	211,427,993.51	186,010,581.82	163,944,844.23	86,768,982.67	54,892,113.60
(h) 1口当たり純資産価格	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) 30.96ユーロ	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) 32.26ユーロ	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) 32.33ユーロ	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) 28.92ユーロ	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) 31.37ユーロ
(i) 1口当たり当期純利益金額 または当期純損失金額	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) 7.83	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) 9.42	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) - 1.41	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) - 9.18	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) 5.93
(j) 分配総額	なし	なし	なし	なし	なし
(k) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	99.35%	99.49%	99.52%	69.23%	99.82%
(m) 自己資本利益率	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) 54.41%	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) 30.66%	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) 4.43%	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) - 10.35%	(ユーロ建クラス P - a c c 投資証券) - 2.97%

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

(2) 外国投資法人の出資総額

2023年4月末日現在の出資総額および発行済投資証券総数は以下のとおりである。

なお、発行可能投資口総口数には原則として制限がない。

	出資総額	発行済投資証券総数(口)	
グローバル・アロケーション (米ドル)	238,371,584.85米ドル (約31,973百万円)	クラス P - a c c 投資証券	13,292,134.401
		円建クラス P - a c c 投資証券	1,133.000
グローバル・アロケーション (ユーロ)	240,626,649.59ユーロ (約35,622百万円)	クラス P - a c c 投資証券	11,395,843.597
ダイナミック・アルファ (米ドル)	50,927,848.42米ドル (約6,831百万円)	クラス P - a c c 投資証券	26,321.215
		ユーロ・ヘッジクラス P - a c c 投資証券	7,038.144
デジタル・ トランスフォーメーション・ テーマ(米ドル)	304,608,005.95米ドル (約40,857百万円)	クラス P - a c c 投資証券	301,135.261
グローバル・エクイティーズ (米ドル)	54,443,075.55米ドル (約7,302百万円)	ユーロ建クラス P - a c c 投資証券	606,448.743

(注) 米ドルおよびユーロの円貨換算は、便宜上、2023年4月28日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=134.13円および1ユーロ=148.04円)による。以下、別段の記載がない限り、米ドルおよびユーロの円換算表示はすべてこれによるものとする。

(3) 主要な投資主の状況

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

(4) 役員の状況

(2023年4月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有株式
ロバート・スティンガー (Robert Süttinger)	チェアマン	UBSアセット・マネジメント・ スイス・エイ・ジー、チューリッヒ マネージング・ディレクター	該当なし
フランチェスカ・ガニーニ (Francesca Guagnini)	メンバー・オブ・ ザ・ボード	UBSアセット・マネジメント(U K)リミテッド、ロンドン マネージング・ディレクター	該当なし
ジョゼ・リンダ・デニス (Josée Lynda Denis)	メンバー・オブ・ ザ・ボード	ルクセンブルグ インディペンデント・ディレクター	該当なし
ラファエル・シュミット・ リヒター (Raphael Schmidt - Richter)	メンバー・オブ・ ザ・ボード	UBSアセット・マネジメント (ドイツ)ゲーエムベーハー、 フランクフルト エグゼクティブ・ディレクター	該当なし
イオアナ・ナウム (Ioana Naum)	メンバー・オブ・ ザ・ボード	UBSアセット・マネジメント・ スイス・エイ・ジー、チューリッヒ、 エグゼクティブ・ディレクター	該当なし

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

(5) その他

a . 定款の変更

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

b . 事業譲渡または事業譲受

合併

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

合併には3種類ある。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

資産の譲渡

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

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

c．出資の状況その他の重要事項

該当事項なし。

d．訴訟事件その他の重要事項

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

[次へ](#)

2 外国投資法人の運用状況

(1) 投資状況

資産別および地域別の投資状況

(グローバル・アロケーション(米ドル))

(2023年4月末日現在)

資産の種類	国・地域名	時価合計(米ドル)	投資比率(%)
投資信託	ルクセンブルグ	169,699,750.82	68.96
	アイルランド	24,035,213.69	9.77
	小計	193,734,964.51	78.73
その他の証券	アイルランド	10,876,582.50	4.42
	イギリス	8,673,942.00	3.52
	小計	19,550,524.50	7.95
短期金融商品	アメリカ合衆国	6,957,608.16	2.83
	小計	6,957,608.16	2.83
ポートフォリオ合計		220,243,097.17	89.50
現金・その他資産		25,827,491.22	10.50
資産総額		246,070,588.39	100.00
負債総額		7,699,003.54	3.13
合計(純資産総額)		238,371,584.85 (約31,973百万円)	96.87

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

(グローバル・アロケーション (ユーロ))

(2023年4月末日現在)

資産の種類	国・地域名	時価合計 (ユーロ)	投資比率 (%)
株式	アメリカ合衆国	64,273,501.25	26.47
	イギリス	7,137,753.76	2.94
	フランス	5,555,868.33	2.29
	オランダ	3,119,462.37	1.28
	ドイツ	2,889,903.11	1.19
	スイス	2,720,090.00	1.12
	デンマーク	2,140,540.20	0.88
	アイルランド	1,847,461.89	0.76
	日本	1,730,532.60	0.71
	フィンランド	1,237,633.82	0.51
	スペイン	987,919.62	0.41
	ノルウェー	597,334.50	0.25
	カナダ	558,769.06	0.23
	ルクセンブルグ	474,145.00	0.20
	香港	460,710.43	0.19
	イタリア	282,129.56	0.12
	スウェーデン	274,396.90	0.11
	ベルギー	256,604.00	0.11
	小計	96,544,756.40	39.77
債券	国際機関	49,453,217.46	20.37
	小計	49,453,217.46	20.37
短期金融商品	アメリカ合衆国	42,574,887.98	17.54
	小計	42,574,887.98	17.54
その他の証券	アイルランド	10,709,110.05	4.41
	イギリス	8,624,482.61	3.55
	小計	19,333,592.66	7.96
投資信託	ルクセンブルグ	14,512,595.51	5.98
	小計	14,512,595.51	5.98
ポートフォリオ合計		222,419,050.01	91.61
現金・その他資産		20,361,315.01	8.39
資産総額		242,780,365.02	100.00
負債総額		2,153,715.43	0.89
合計 (純資産総額)		240,626,649.59 (約35,622百万円)	99.11

(ダイナミック・アルファ (米ドル))

(2023年4月末日現在)

資産の種類	国・地域名	時価合計 (米ドル)	投資比率 (%)
債券	アメリカ合衆国	14,056,159.14	27.00
	ドイツ	2,415,628.67	4.64
	フランス	1,837,005.40	3.53
	ニュージーランド	1,788,549.67	3.44
	カナダ	1,712,286.22	3.29
	イギリス	1,633,123.48	3.14
	アイルランド	1,310,385.69	2.52
	日本	1,296,291.13	2.49
	オーストラリア	1,052,387.28	2.02
	オランダ	1,023,078.53	1.97
	スペイン	493,246.44	0.95
	韓国	399,800.00	0.77
	国際機関	389,621.01	0.75
	ルクセンブルグ	379,861.85	0.73
	フィンランド	316,058.55	0.61
	メキシコ	312,613.99	0.60
	ポーランド	289,891.08	0.56
	ルーマニア	271,132.74	0.52
	スイス	211,584.08	0.41
	ベルギー	209,643.64	0.40
	インド	200,787.50	0.39
	ノルウェー	144,664.13	0.28
	イタリア	92,259.07	0.18
	ジャージー	71,543.36	0.14
	コロンビア	61,173.76	0.12
	ケイマン諸島	25,411.25	0.05
	小計	31,994,187.66	61.45
短期金融商品	アメリカ合衆国	14,833,393.86	28.49
	小計	14,833,393.86	28.49
投資信託	アイルランド	2,503,710.80	4.81
	小計	2,503,710.80	4.81
ポートフォリオ合計		49,331,292.32	94.75
現金・その他資産		2,730,967.43	5.25
資産総額		52,062,259.75	100.00
負債総額		1,134,411.33	2.18
合計 (純資産総額)		50,927,848.42 (約6,831百万円)	97.82

(デジタル・トランスフォーメーション・テーマ (米ドル))

(2023年 4 月末日現在)

資産の種類	国・地域名	時価合計 (米ドル)	投資比率 (%)
株式	アメリカ合衆国	248,323,411.49	80.97
	中国	12,776,740.79	4.17
	オランダ	11,697,872.50	3.81
	台湾	8,636,085.41	2.82
	日本	6,247,045.83	2.04
	アイルランド	5,053,908.99	1.65
	韓国	4,494,593.24	1.47
	スイス	3,311,699.31	1.08
	小計	300,541,357.56	98.00
ポートフォリオ合計		300,541,357.56	98.00
現金・その他資産		6,128,921.55	2.00
資産総額		306,670,279.11	100.00
負債総額		2,062,273.16	0.67
合計 (純資産総額)		304,608,005.95 (約40,857百万円)	99.33

(グローバル・エクイティーズ(米ドル))

(2023年4月末日現在)

資産の種類	国・地域名	時価合計(米ドル)	投資比率(%)
株式	アメリカ合衆国	27,194,982.78	48.06
	イギリス	7,289,503.56	12.88
	日本	4,606,716.82	8.14
	オランダ	3,533,702.13	6.25
	アイルランド	2,532,870.04	4.48
	スイス	2,191,615.42	3.87
	インド	1,682,645.64	2.97
	デンマーク	1,115,903.60	1.97
	ドイツ	948,451.35	1.68
	イタリア	898,131.19	1.59
	フランス	694,239.32	1.23
	アイスランド	428,849.79	0.76
	小計	53,117,611.64	93.87
投資信託	ルクセンブルグ	596,190.00	1.05
	小計	596,190.00	1.05
ポートフォリオ合計		53,713,801.64	94.93
現金・その他資産		2,869,677.58	5.07
資産総額		56,583,479.22	100.00
負債総額		2,140,403.67	3.78
合計(純資産総額)		54,443,075.55 (約7,302百万円)	96.22

(2) 運用実績

純資産等の推移

2023年4月末日までの1年間における各月末の総資産および純資産の推移は以下のとおりである。

(グローバル・アロケーション (米ドル))

	資産総額		純資産総額		1口当たり純資産価格 (クラスP - a c c 投資証券)		1口当たり純資産価格 (円建クラスP - a c c 投資証券)
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円	円
2022年5月末日	289,133.15	38,781	286,650.75	38,448	16.99	2,279	16,475
6月末日	267,313.03	35,855	266,068.78	35,688	15.90	2,133	16,285
7月末日	273,179.44	36,642	270,547.12	36,288	16.30	2,186	16,428
8月末日	263,176.80	35,300	259,526.49	34,810	15.73	2,110	16,450
9月末日	251,977.02	33,798	240,728.33	32,289	14.78	1,982	16,139
10月末日	258,484.28	34,670	246,668.80	33,086	15.24	2,044	17,080
11月末日	257,304.13	34,512	254,256.28	34,103	15.75	2,113	16,577
12月末日	243,043.02	32,599	241,979.65	32,457	15.50	2,079	15,428
2023年1月末日	254,585.64	34,148	252,161.30	33,822	16.26	2,181	15,953
2月末日	241,310.19	32,367	240,534.18	32,263	15.69	2,104	16,117
3月末日	240,378.32	32,242	238,759.56	32,025	15.71	2,107	15,767
4月末日	246,070.59	33,005	238,371.58	31,973	15.80	2,119	16,195

(グローバル・アロケーション (ユーロ))

	資産総額		純資産総額		1口当たり純資産価格 (クラスP - a c c 投資証券)	
	千ユーロ	百万円	千ユーロ	百万円	ユーロ	円
2022年5月末日	311,218.74	46,073	303,663.60	44,954	15.29	2,264
6月末日	291,265.75	43,119	284,501.82	42,118	14.44	2,138
7月末日	295,867.51	43,800	292,600.72	43,317	14.84	2,197
8月末日	292,078.82	43,239	270,876.55	40,101	14.32	2,120
9月末日	262,662.66	38,885	252,042.19	37,312	13.56	2,007
10月末日	266,542.21	39,459	257,058.57	38,055	13.98	2,070
11月末日	262,983.29	38,932	260,739.97	38,600	14.34	2,123
12月末日	254,744.91	37,712	248,655.72	36,811	13.92	2,061
2023年1月末日	262,309.85	38,832	256,083.82	37,911	14.58	2,158
2月末日	248,714.06	36,820	246,806.86	36,537	14.12	2,090
3月末日	245,114.75	36,287	242,364.14	35,880	14.06	2,081
4月末日	242,780.37	35,941	240,626.65	35,622	14.10	2,087

(ダイナミック・アルファ (米ドル))

	資産総額		純資産総額		1口当たり純資産価格 (クラスP - a c c 投資証券)		1口当たり純資産価格 (ユーロ・ヘッジクラス P - a c c 投資証券)	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円	ユーロ	円
2022年5月末日	49,341.31	6,618	47,825.68	6,415	128.12	17,185	98.45	14,575
6月末日	46,724.85	6,267	45,830.58	6,147	122.65	16,451	94.08	13,928
7月末日	48,519.90	6,508	47,337.64	6,349	124.34	16,678	95.10	14,079
8月末日	47,409.17	6,359	46,468.82	6,233	123.26	16,533	94.08	13,928
9月末日	46,499.63	6,237	44,885.88	6,021	119.77	16,065	91.13	13,491
10月末日	45,680.47	6,127	44,744.68	6,002	120.11	16,110	91.21	13,503
11月末日	50,274.33	6,743	46,811.17	6,279	123.14	16,517	93.25	13,805
12月末日	51,703.86	6,935	50,749.69	6,807	123.03	16,502	92.87	13,748
2023年1月末日	52,723.45	7,072	50,320.96	6,750	125.56	16,841	94.53	13,994
2月末日	50,493.96	6,773	49,044.29	6,578	124.09	16,644	93.27	13,808
3月末日	50,609.50	6,788	49,635.80	6,658	124.12	16,648	93.12	13,785
4月末日	52,062.26	6,983	50,927.85	6,831	124.34	16,678	93.12	13,785

(デジタル・トランスフォーメーション・テーマ (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5月末日	647,363.18	86,831	645,292.25	86,553	144.28	19,352
6月末日	593,296.72	79,579	591,829.98	79,382	130.46	17,499
7月末日	644,339.27	86,425	643,096.01	86,258	142.31	19,088
8月末日	604,000.39	81,015	602,595.88	80,826	135.28	18,145
9月末日	531,328.90	71,267	527,403.96	70,741	118.88	15,945
10月末日	549,980.25	73,769	549,228.22	73,668	125.00	16,766
11月末日	304,921.74	40,899	304,103.99	40,789	135.05	18,114
12月末日	281,823.63	37,801	279,791.65	37,528	126.03	16,904
2023年1月末日	304,626.32	40,860	304,132.20	40,793	138.51	18,578
2月末日	296,811.70	39,811	296,472.47	39,766	136.29	18,281
3月末日	309,796.57	41,553	309,312.60	41,488	143.73	19,279
4月末日	306,670.28	41,134	304,608.01	40,857	142.34	19,092

(グローバル・エクイティーズ (米ドル))

	資産総額		純資産総額		1口当たり純資産価格 (ユーロ建クラス P - a c c 投資証券)	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	ユーロ	円
2022年5月末日	106,813.17	14,327	106,550.96	14,292	31.18	4,616
6月末日	92,043.14	12,346	91,863.97	12,322	28.89	4,277
7月末日	92,332.01	12,384	92,263.70	12,375	32.27	4,777
8月末日	96,554.46	12,951	96,473.44	12,940	31.34	4,640
9月末日	86,768.98	11,638	60,068.67	8,057	28.92	4,281
10月末日	71,202.79	9,550	66,961.41	8,982	31.29	4,632
11月末日	58,862.75	7,895	58,613.36	7,862	32.34	4,788
12月末日	56,623.06	7,595	56,512.97	7,580	29.90	4,426
2023年1月末日	61,816.57	8,291	61,694.98	8,275	32.06	4,746
2月末日	57,508.48	7,714	57,481.72	7,710	31.68	4,690
3月末日	54,892.11	7,363	54,790.65	7,349	31.37	4,644
4月末日	56,583.48	7,590	54,443.08	7,302	31.71	4,694

ファンドの投資証券は、ルクセンブルグ証券取引所に上場されている。

同取引所での実質的な取引実績はない。

分配の推移

(グローバル・アロケーション(米ドル))

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

該当事項なし。

(グローバル・アロケーション(ユーロ))

クラスP - a c c 投資証券

該当事項なし。

(ダイナミック・アルファ(米ドル))

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

該当事項なし。

(デジタル・トランスフォーメーション・テーマ(米ドル))

クラスP - a c c 投資証券

該当事項なし。

(グローバル・エクイティーズ(米ドル))

ユーロ建クラスP - a c c 投資証券

該当事項なし。

自己資本利益率(収益率)の推移

2022年5月1日から2023年4月末日までの1年間の自己資本利益率(収益率)は以下のとおりである。

	収益率(%) (注)	
グローバル・アロケーション(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	- 6.95%
	円建クラスP - a c c 投資証券	- 2.37%
グローバル・アロケーション(ユーロ)	クラスP - a c c 投資証券	- 8.20%
ダイナミック・アルファ(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	- 1.96%
	ユーロ・ヘッジクラスP - a c c 投資証券	- 4.59%
デジタル・トランスフォーメーション・テーマ(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	- 3.31%
グローバル・エクイティーズ(米ドル)	ユーロ建クラスP - a c c 投資証券	1.96%

(注) 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$

a = 2023年4月末日現在の1口当たり純資産価格(当該期間の分配金の合計金額を加えた額)

b = 2022年4月末日現在の1口当たり純資産価格(分配落の額)

(3) 投資リスク

当中間計算期間において、2023年3月31日提出の有価証券報告書「第一部ファンド情報 第1ファンドの状況 3 投資リスク」に記載される投資リスクについて、重要な変更はない。

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

[次へ](#)

3 資産運用会社の概況

(1) 名称及び資本金の額

UBS ファンド・マネジメント (ルクセンブルグ) エス・エイ (管理会社)

資本金 (株主資本) の額

2023年4月末日現在の株主資本総額は、13,000,000ユーロ (約19億円)

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

資本金 (株主資本) の額

2023年4月末日現在の資本金額は、10,167,024米ドル (約14億円)

ユービーエス・スイス・エイ・ジー (チューリッヒ) (「投資運用会社」)

資本金 (株主資本) の額

2023年4月末日現在、10,000,000スイス・フラン (約15億円)

(注) スイス・フランの円貨換算は、便宜上、2023年4月28日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値 (1 スイス・フラン = 150.08円) による。以下同じ。

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

資本金 (株主資本) の額

2023年4月末日現在、500,000スイスフラン (約7,504万円)

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

資本金 (株主資本) の額

2023年4月末日現在の株主資本総額は、140,000,000英ポンド (約235億円)

(注) 英ポンドの円貨換算は、便宜上、2023年4月28日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値 (1 英ポンド = 167.65円) による。

(2) 大株主の状況

UBS ファンド・マネジメント (ルクセンブルグ) エス・エイ

(2023年 4 月末日現在)

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

UBS アセット・マネジメント (アメリカス) インク (シカゴ)

(2023年 4 月末日現在)

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

ユービーエス・スイス・エイ・ジー (チューリッヒ)

(2023年 4 月末日現在)

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

UBS アセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー (チューリッヒ)

(2023年 4 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	5,000,000	100

UBS アセット・マネジメント (UK) リミテッド (ロンドン)

(2023年4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・ホールディン グ・リミテッド (UBS Asset Management Holding Ltd)	ブロードゲート 5、ロンドン、英国	139,999,999	99.999
フィルドリュー・ ノミニーズ・リミテッド (Phildrew Nominees Ltd)	ブロードゲート 5、ロンドン、英国	1	0.001

(3) 役員の状況

UBS ファンド・マネジメント (ルクセンブルグ) エス・エイ

(2023年4月末日現在)

氏名	役職名	就任	略歴	所有株式
マイケル・ケール (Michael Kehl)	チェアマン	2022年1月1日	UBS アセット・マネジ メント・スイス・エイ・ ジー、チューリッヒ、ス イス、ヘッド・オブ・プ ロダクト	該当なし
フランチェスカ・ジ リ・ プリム (Francesca Gigli Prym)	ディレクターノ 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)	ディレクターノ 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 ターノ ード・メンバー	2022年1月1日	ルクセンブルグ大公国、 インディペンデント・ ディレクター	該当なし
ミリアム・ウエベル (Miriam Uebel)	インディペンデン ト・ディレク ターノ 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・ランダ ム) 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

UBS アセット・マネジメント (アメリカス) インク (シカゴ)

(2023年4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

ユービーエス・スイス・エイ・ジー (チューリッヒ)

(2023年4月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有ユービーエス・ グループ・エイ・ ジー株式 (2021年12月31日現在)
マーカス・ロナー (Markus Ronner)	チェアマン	2022年4月5日就任	非公開
ロジャー・フォン・メントレン (Roger von Mentlen)	ディレクター/ ボード・メンバー	2020年4月24日就任	非公開
バーバラ・ランバート (Barbara Lambert)	ディレクター/ ボード・メンバー	2022年4月5日就任	非公開
ダニエル・ジェイ・クリティン (Daniel J. Crittin)	ディレクター/ ボード・メンバー	2016年4月25日就任	非公開
クリスチャン・エッケハート・ブルーム (Christian Eckehard Bluhm)	ディレクター/ ボード・メンバー	2016年4月25日就任	非公開
ガブリエラ・フーバー (Gabriela Huber)	ヴァイス・ チェアマン	2015年6月12日就任	非公開

UBS アセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー (チューリッヒ)

(2023年4月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有株式
ミーダーホフ・マーカス・ ジョアンヌ (Miederhoff Markus Johannes)	ディレクター/ ボード・メンバー	2019年6月20日就任	該当なし
ケッター・レト・ユー (Ketterer Reto U.)	ディレクター/ ボード・メンバー	2020年9月24日就任	該当なし
サリバ・ガイレ・フアド (Saliba Gaylee Fouad)	ヴァイス・チェアマン	2021年12月1日就任	該当なし
イヴァノビッチ・アレクサン ダー (Ivanovic Aleksandar)	チェアマン	2020年9月24日就任	該当なし
スティラート・シャープ・ イボンヌ・シルビア (Stillhart Sharp Yvonne Silvia)	社外インディペンデ ント・ディレクター	2019年6月20日就任	該当なし
ビョーハイム・ジェイコブ (Bjorheim Jacob)	社外インディペンデ ント・ディレクター	2019年6月20日就任	該当なし

UBS アセット・マネジメント (UK) リミテッド (ロンドン)

(2023年4月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有株式
イアン・アシュメント (Ian Ashment)	ディレクター/ ボード・メンバー	2019年10月30日就任	非公開
プリシラ・デイヴィス (Priscilla Davies)	チェアマン	2017年9月20日就任	非公開
ルース・ビーチイ (Ruth Beechey)	ディレクター/ ボード・メンバー	2018年3月26日就任	非公開
キース・マーティン・ ジェックス (Keith Martin Jecks)	ノン・エグゼクティ ブ・ ディレクター	2018年10月1日就任	非公開
ミシェル・ベローズ (Michelle Bereaux)	ディレクター/ ボード・メンバー	2022年9月13日就任	非公開

(4) 事業の内容及び営業の概況

U B S ファンド・マネジメント(ルクセンブルグ) エス・エイ

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

2023年4月末日現在、管理会社は以下のとおり、405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	404	479,755,450.49オーストラリア・ドル
			2,180,085,156.04カナダ・ドル
			13,999,083,349.17スイス・フラン
			4,439,064,653.22中国元
			484,773,275.32デンマーク・クローネ
			53,766,150,908.49ユーロ
			2,342,330,175.82英ポンド
			315,044,740.39香港ドル
			590,282,742,849.35日本円
			32,045,815.05シンガポール・ドル
			119,097,176,410.05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	1	425,355,091.22ユーロ

UBS アセット・マネジメント (アメリカス) インク (シカゴ)

2023年4月末日現在、UBS アセット・マネジメント (アメリカス) インク (シカゴ) は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	7,689,072,847.74
2	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	4,459,787,842.12
3	Focused Fund - Corporate Bond Sustainable USD	契約型投資信託	2003年9月9日	2,178,614,248.30
4	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	1,879,573,645.12
5	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	1,556,361,720.58
6	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	1,516,894,557.52
7	UBS (Lux) Equity Fund - Global Sustainable (USD)	契約型投資信託	1997年6月13日	783,905,233.86
8	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	776,438,035.33
9	UBS (Lux) Fund Solutions - J.P. Morgan USD EM IG ESG Diversified Bond UCITS ETF	変動資本を有する投資法人	2019年8月2日	768,182,738.39
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	671,839,822.37

(注1) 一単位当たり純資産価格は開示していない。

(注2) 上記は管理会社から提供された情報に基づく。

ユービーエス・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)

2023年4月末日現在、ユービーエス・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)は42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) Equity Sicav - Long Term Themes (USD)	変動資本を有する 投資法人	2016年1月28日	4,459,787,842
2	UBS (Lux) Strategy Fund - Balanced Sustainable (CHF)	契約型投資信託	1994年7月1日	1,186,727,395
3	UBS (Lux) Strategy Fund - Yield Sustainable (CHF)	契約型投資信託	1991年9月10日	1,169,604,666
4	Global Opportunities Access - Sustainable Equities	変動資本を有する 投資法人	2019年5月13日	1,146,613,736
5	Global Opportunities Access - Sustainable Bonds	変動資本を有する 投資法人	2019年5月13日	1,124,955,436
6	Global Opportunities Access - High Yield and EM Bonds	変動資本を有する 投資法人	2014年11月3日	847,500,897
7	UBS (Lux) Strategy Fund - Yield Sustainable (USD)	契約型投資信託	1991年9月10日	658,711,530
8	UBS (Lux) Strategy Fund - Balanced Sustainable (USD)	契約型投資信託	1994年7月1日	622,942,103
9	Global Opportunities Access - Corporate Bonds	変動資本を有する 投資法人	2015年2月18日	622,496,088
10	UBS (Lux) Strategy Fund - Yield Sustainable (EUR)	契約型投資信託	1991年9月10日	612,721,722

(注1) 一部のファンドについては、ユービーエス・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)は、管理会社の選定およびアセット・アロケーションについてのみ責任を負っている。

(注2) 上記は管理会社から提供された情報に基づく。

UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)

2023年4月末日現在、UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)は117本のサブ・ファンドを運用しており、そのうち運用資産額上位10位のサブ・ファンドは、以下のとおりである。

	名称	基本的性格	設定日	純資産総額 (ユーロ)
1	UBS(Lux)Bond Sicav - Convert Global(EUR)	変動資本を有する 投資法人	2004年11月18日	3,934,596,047
2	Focused Sicav - High Grade Long Term Bond USD	変動資本を有する 投資法人	2006年10月26日	3,184,803,795
3	UBS(Lux)Money Market Fund - USD Sustainable	契約型投資信託	1988年11月25日	2,643,582,010
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	2,489,763,055
5	UBS(Lux)Money Market Fund - EUR Sustainable	契約型投資信託	1989年10月9日	2,240,848,231
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	2,117,511,012
7	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	2,041,811,222
8	Focused Sicav - High Grade Bond USD	変動資本を有する 投資法人	2005年8月30日	1,788,799,394
9	Global Opportunities Access - Global Equities II	変動資本を有する 投資法人	2014年11月3日	1,237,015,606
10	UBS(Lux)Strategy Fund - Balanced Sustainable(CHF)	契約型投資信託	1994年7月1日	1,186,727,395

(注1)ー単位当たり純資産価格は開示していない。

(注2) 上記は管理会社から提供された情報に基づく。

UBS アセット・マネジメント (UK) リミテッド (ロンドン)

2023年4月末日現在、UBS アセット・マネジメント (UK) リミテッド (ロンドン) は98本のサブ・ファンドを運用しており、そのうち運用資産額上位10位のサブ・ファンドは、以下のとおりである。

	名称	基本的性格	設定日 (年/月/日)	純資産総額 (ユーロ)
1	UBS (Lux) Fund Solutions - MSCI World Socially Responsible UCITS ETF	変動資本を有する投資法人	2011年8月19日	3,866,939,396
2	UBS (Lux) Fund Solutions - MSCI Emerging Markets UCITS ETF	変動資本を有する投資法人	2010年11月12日	3,373,896,409
3	UBS (Lux) Fund Solutions - MSCI EMU UCITS ETF	変動資本を有する投資法人	2002年9月19日	2,716,815,642
4	UBS (Lux) Fund Solutions - MSCI Japan UCITS ETF	変動資本を有する投資法人	2001年10月30日	2,461,772,782
5	UBS (Lux) Fund Solutions - MSCI EMU Socially Responsible UCITS ETF	変動資本を有する投資法人	2011年8月17日	2,164,842,509
6	UBS (Lux) Fund Solutions - MSCI United Kingdom UCITS ETF	変動資本を有する投資法人	2013年8月30日	2,139,188,174
7	UBS (Lux) Fund Solutions - MSCI Switzerland 20/35 UCITS ETF	変動資本を有する投資法人	2013年10月31日	1,991,919,871
8	UBS (Lux) Fund Solutions - MSCI Emerging Markets Socially Responsible UCITS ETF	変動資本を有する投資法人	2014年9月4日	1,961,285,574
9	UBS (Lux) Fund Solutions - MSCI USA Socially Responsible UCITS ETF	変動資本を有する投資法人	2011年8月17日	1,536,303,653
10	UBS (Lux) Fund Solutions - MSCI Canada UCITS ETF	変動資本を有する投資法人	2009年9月30日	1,455,957,084

(注1) ー単位当たり純資産価格は開示していない。

(注2) 上記は管理会社から提供された情報に基づく。

[次へ](#)

4 外国投資法人の経理状況

a. ファンドの日本語の中間財務書類は、ルクセンブルグにおける諸法令および一般に認められた会計原則に準拠して作成された原文の中間財務書類を翻訳したものである。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。

b. 原文の中間財務書類は、UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブおよびすべてのサブ・ファンドにつき一括して作成されている。

本書において日本語の作成にあたっては、関係するサブ・ファンドに関連する部分のみを翻訳している。ただし、各サブ・ファンドには以下に記載した投資証券以外の投資証券も存在するが、以下に記載した投資証券に関連する部分を抜粋して日本語に記載している。

グローバル・アロケーション(米ドル)クラスP - a c c 投資証券

グローバル・アロケーション(米ドル)円建クラスP - a c c 投資証券

グローバル・アロケーション(ユーロ)クラスP - a c c 投資証券

ダイナミック・アルファ(米ドル)クラスP - a c c 投資証券

ダイナミック・アルファ(米ドル)ユーロ・ヘッジクラスP - a c c 投資証券

デジタル・トランスフォーメーション・テーマ(米ドル)クラスP - a c c 投資証券

グローバル・エクイティーズ(米ドル)ユーロ建クラスP - a c c 投資証券

c. ファンドの中間財務書類は、外国監査法人等(公認会計士法(昭和23年法律第103号)第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。)の監査を受けていない。

d. 原文の中間財務書類は、ユーロおよび米ドルで表示されている。日本語の中間財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円による金額は、2023年4月28日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1ユーロ=148.04円、1米ドル=134.13円)で換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

(1) 資産及び負債の状況

U B S (L u x) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション (米ドル)
純資産計算書

	2023年 3 月31日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	229,209,444.31	30,743,863
投資有価証券、未実現評価(損)益	(4,896,192.02)	(656,726)
投資有価証券合計(注1)	224,313,252.29	30,087,137
現金預金、要求払預金および預託金勘定	9,505,140.98 *	1,274,925
その他の流動資産(マージン)	4,669,501.49	626,320
発行未収金	6.39	1
流動資産に係る未収利息	2,627.02	352
前払費用	107,529.11	14,423
金融先物に係る未実現利益(注1)	1,780,265.60	238,787
資産合計	240,378,322.88	32,241,944
負 債		
先渡為替契約に係る未実現損失(注1)	(790,730.51)	(106,061)
スワップに係る未実現損失(注1)	(200,480.87)	(26,890)
当座借越に係る未払利息	(2,950.29)	(396)
買戻未払金	(189,943.26)	(25,477)
定率報酬引当金(注2)	(383,318.90)	(51,415)
年次税引当金(注3)	(7,928.25)	(1,063)
その他の手数料および報酬に係る引当金(注2)	(43,412.75)	(5,823)
引当金合計	(434,659.90)	(58,301)
負債合計	(1,618,764.83)	(217,125)
期末現在純資産	238,759,558.05	32,024,820

* 2023年 3 月31日現在、当該現金額は取引の相手方のために担保に供されており、ゴールドマン・サックスについては50,000.00米ドルおよびJ.P. モルガンについては30,000.00米ドルである。

注記は当財務書類の一部である。

U B S (L u x) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション (米ドル)

運用計算書

自2022年10月1日 至2023年3月31日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	115,583.30	15,503
スワップに係る受取利息(注1)	158,042.39	21,198
証券貸付に係る純収益(注11)	5,003.17	671
その他の収益(注4)	10,017.95	1,344
収益合計	288,646.81	38,716
費 用		
スワップに係る支払利息(注1)	(168,178.67)	(22,558)
定率報酬(注2)	(2,335,886.64)	(313,312)
年次税(注3)	(16,524.52)	(2,216)
その他の手数料および報酬(注2)	(36,776.53)	(4,933)
現金および当座借越に係る利息	(50,063.45)	(6,715)
費用合計	(2,607,429.81)	(349,735)
投資純(損)益	(2,318,783.00)	(311,018)
実現(損)益(注1)		
無オプション市場価格証券に係る実現(損)益	(900,451.90)	(120,778)
利回り評価証券および短期金融商品に係る 実現(損)益	152,067.84	20,397
金融先物に係る実現(損)益	(6,427,344.59)	(862,100)
先渡為替契約に係る実現(損)益	74,720.50	10,022
スワップに係る実現(損)益	(53,505.79)	(7,177)
為替差(損)益	289,702.89	38,858
実現(損)益合計	(6,864,811.05)	(920,777)
当期実現純(損)益	(9,183,594.05)	(1,231,795)
未実現評価(損)益の変動(注1)		
無オプション市場価格証券に係る 未実現評価(損)益	23,793,675.36	3,191,446
利回り評価証券および短期金融商品に係る 未実現評価(損)益	(10,782.01)	(1,446)
金融先物に係る未実現評価(損)益	5,100,727.33	684,161
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	(4,372,416.65)	(586,472)
スワップに係る未実現評価(損)益	(200,480.87)	(26,890)
未実現評価(損)益の変動合計	24,310,723.16	3,260,797
運用の結果による純資産の純増(減)	15,127,129.11	2,029,002

注記は当財務書類の一部である。

U B S (L u x) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション (米ドル)

純資産の変動

	自2022年10月1日 至2023年3月31日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	240,728,330.00	32,288,891
発行額	1,988,790.48	266,756
買戻額	(19,084,691.54)	(2,559,830)
純発行(買戻)合計	(17,095,901.06)	(2,293,073)
投資純(損)益	(2,318,783.00)	(311,018)
実現(損)益合計	(6,864,811.05)	(920,777)
未実現評価(損)益の変動合計	24,310,723.16	3,260,797
運用の結果による純資産の純増(減)	15,127,129.11	2,029,002
期末現在純資産	238,759,558.05	32,024,820

発行済投資証券数の変動表

	自2022年10月1日 至2023年3月31日
クラスP-acc	(口)
期首現在発行済投資証券数	14,459,087.0480
期中発行投資証券数	66,008.1100
期中買戻投資証券数	(1,079,281.5130)
期末現在発行済投資証券数	13,445,813.6450
円建クラスP-acc	(口)
期首現在発行済投資証券数	1,133.0000
期中発行投資証券数	0.0000
期中買戻投資証券数	0.0000
期末現在発行済投資証券数	1,133.0000

注記は当財務書類の一部である。

U B S (L u x) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション (米ドル)

最重要数値

	ISIN	2023年 3 月31日	2022年 9 月30日	2021年 9 月30日
純資産額 (米ドル)		238,759,558.05	240,728,330.00	339,421,733.18
クラスP-acc	LU0197216392			
発行済投資証券数 (口)		13,445,813.6450	14,459,087.0480	15,485,088.9070
1口当たり純資産価格 (米ドル)		15.71	14.78	19.18
1口当たり発行・買戻価格 (米ドル) ¹		15.71	14.78	19.18
円建クラスP-acc	LU0953722104			
発行済投資証券数 (口)		1,133.0000	1,133.0000	1,283.6940
1口当たり純資産価格 (日本円)		15,767	16,139	16,132
1口当たり発行・買戻価格 (日本円) ¹		15,767	16,139	16,132

¹ 注記 1 を参照

組入証券の構造

2023年 3 月31日現在

地域別分布表	(純資産に対する百分率)	業種別分布表	(純資産に対する百分率)
ルクセンブルグ	73.01 %	投資信託	82.85 %
アイルランド	14.37	抵当および資金貸出機関	4.53
イギリス	3.66	銀行および金融機関	3.66
アメリカ合衆国	2.91	国および中央政府	2.91
合計	93.95	合計	93.95

注記は当財務書類の一部である。

U B S (L u x) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション (ユーロ)

純資産計算書

	2023年3月31日現在	
	(ユーロ)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	217,646,619.11	32,220,405
投資有価証券、未実現評価(損)益	5,743,117.22	850,211
投資有価証券合計(注1)	223,389,736.33	33,070,617
現金預金、要求払預金および預託金勘定	14,257,242.14 *	2,110,642
その他の流動資産(マージン)	6,147,145.83	910,023
有価証券売却未収金(注1)	560,563.46	82,986
発行未収金	14,924.16	2,209
有価証券に係る未収利息	188,743.57	27,942
流動資産に係る未収利息	2,977.61	441
未収配当金	96,082.81	14,224
前払費用	115,698.00	17,128
その他の未収金	239,013.33	35,384
金融先物に係る未実現利益(注1)	102,620.08	15,192
資産合計	245,114,747.32	36,286,787
負 債		
先渡為替契約に係る未実現損失(注1)	(1,821,634.54)	(269,675)
スワップに係る未実現損失(注1)	(115,357.59)	(17,078)
当座借越に係る未払利息	(71.43)	(11)
有価証券購入未払金(注1)	(173,876.77)	(25,741)
買戻未払金	(198,772.81)	(29,426)
定率報酬引当金(注2)	(371,381.91)	(54,979)
年次税引当金(注3)	(26,775.19)	(3,964)
その他の手数料および報酬に係る引当金(注2)	(42,733.13)	(6,326)
引当金合計	(440,890.23)	(65,269)
負債合計	(2,750,603.37)	(407,199)
期末現在純資産	242,364,143.95	35,879,588

* 2023年3月31日現在、当該現金額は取引の相手方のために担保に供されており、ゴールドマン・サックスについては50,000.00ユーロ、HSBC銀行については13,806.43ユーロおよびJ.P. モルガンについては107,690.18ユーロである。

注記は当財務書類の一部である。

U B S (L u x) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション (ユーロ)
運用計算書

自2022年10月 1 日 至2023年 3 月31日

	(ユーロ)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	156,238.32	23,130
有価証券に係る利息	438,938.48	64,980
配当金(注1)	546,032.38	80,835
スワップに係る受取利息(注1)	585,923.11	86,740
証券貸付に係る純収益(注11)	27,135.39	4,017
その他の収益(注4)	6,470.40	958
収益合計	1,760,738.08	260,660
費 用		
スワップに係る支払利息(注1)	(9,385.52)	(1,389)
定率報酬(注2)	(2,277,564.08)	(337,171)
年次税(注3)	(54,359.05)	(8,047)
その他の手数料および報酬(注2)	(37,743.79)	(5,588)
現金および当座借越に係る利息	(5,533.21)	(819)
費用合計	(2,384,585.65)	(353,014)
投資純(損)益	(623,847.57)	(92,354)
実現(損)益(注1)		
無オプション市場価格証券に係る実現(損)益	(1,390,793.77)	(205,893)
利回り評価証券および短期金融商品に係る 実現(損)益	(366,812.47)	(54,303)
金融先物に係る実現(損)益	(5,632,712.76)	(833,867)
先渡為替契約に係る実現(損)益	11,440,106.48	1,693,593
スワップに係る実現(損)益	(473,362.96)	(70,077)
為替差(損)益	(2,265,177.59)	(335,337)
実現(損)益合計	1,311,246.93	194,117
当期実現純(損)益	687,399.36	101,763
未実現評価(損)益の変動(注1)		
無オプション市場価格証券に係る 未実現評価(損)益	4,689,198.86	694,189
利回り評価証券および短期金融商品に係る 未実現評価(損)益	(4,649,106.96)	(688,254)
金融先物に係る未実現評価(損)益	3,196,774.81	473,251
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	2,959,904.71	438,184
スワップに係る未実現評価(損)益	986,344.51	146,018
未実現評価(損)益の変動合計	7,183,115.93	1,063,388
運用の結果による純資産の純増(減)	7,870,515.29	1,165,151

注記は当財務書類の一部である。

U B S (L u x) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション (ユーロ)

純資産の変動

	自2022年10月 1 日 至2023年 3 月31日	
	(ユーロ)	(千円)
期首現在純資産	252,042,193.82	37,312,326
発行額	3,460,634.15	512,312
買戻額	(20,389,074.01)	(3,018,399)
純発行 (買戻) 合計	(16,928,439.86)	(2,506,086)
支払配当金	(620,125.30)	(91,803)
投資純 (損) 益	(623,847.57)	(92,354)
実現 (損) 益合計	1,311,246.93	194,117
未実現評価 (損) 益の変動合計	7,183,115.93	1,063,388
運用の結果による純資産の純増 (減)	7,870,515.29	1,165,151
期末現在純資産	242,364,143.95	35,879,588

発行済投資証券数の変動表

	自2022年10月 1 日 至2023年 3 月31日
クラスP-acc	(口)
期首現在発行済投資証券数	12,351,613.1190
期中発行投資証券数	115,633.9760
期中買戻投資証券数	(983,877.0370)
期末現在発行済投資証券数	11,483,370.0580

最重要数値

	ISIN	2023年 3 月31日	2022年 9 月30日	2021年 9 月30日
純資産額 (ユーロ)		242,364,143.95	252,042,193.82	353,908,219.11
クラスP-acc	LU0197216558			
発行済投資証券数 (口)		11,483,370.0580	12,351,613.1190	14,173,706.3350
1口当たり純資産価格 (ユーロ)		14.06	13.56	17.18
1口当たり発行・買戻価格 (ユーロ) ¹		14.06	13.56	17.18
¹ 注記 1 を参照				

注記は当財務書類の一部である。

U B S (L u x) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション (ユーロ)

組入証券の構造

2023年3月31日現在

地域別分布表	(純資産に対する百分率)	業種別分布表	(純資産に対する百分率)
アメリカ合衆国	50.57 %	国際機関	20.49 %
国際機関	11.81	国および中央政府	17.79
ルクセンブルグ	6.22	インターネット、ソフトウェア・ITサービス	6.28
イギリス	6.20	銀行および金融機関	6.11
アイルランド	5.29	投資信託	6.09
フランス	2.44	医薬品・化粧品・医療品	5.26
フィリピン	2.26	金融および持株会社	4.59
ドイツ	1.31	抵当および資金貸出機関	4.46
オランダ	1.28	食品・清涼飲料	2.27
スイス	1.20	保険	2.06
デンマーク	0.95	電子工学・半導体	1.84
日本	0.73	小売り・百貨店	1.76
フィンランド	0.49	エネルギー・水道	1.35
スペイン	0.40	コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置	1.24
カナダ	0.30	グラフィックデザイン・出版・メディア	0.95
ノルウェー	0.26	機械工学・産業機器	0.92
香港	0.19	宿泊・仕出し・レジャー	0.90
ベルギー	0.11	たばこ・アルコール	0.88
イタリア	0.11	自動車	0.80
スウェーデン	0.05	繊維・衣服・革製品	0.72
合計	92.17	石油	0.70
		ヘルスケア、社会事業	0.67
		通信	0.66
		不動産	0.60
		バイオテクノロジー	0.57
		航空宇宙産業	0.40
		交通・運輸	0.36
		化学	0.33
		電気装置・部品	0.32
		各種非分類会社	0.20
		各種サービス	0.16
		貿易会社	0.14
		非鉄金属	0.14
		農業・漁業	0.10
		建築業・資材	0.06
		合計	92.17

注記は当財務書類の一部である。

U B S (L u x) キー・セクション・シキャブ - ダイナミック・アルファ (米ドル)

純資産計算書

	2023年 3 月31日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	44,447,104.85	5,961,690
投資有価証券、未実現評価(損)益	(1,009,015.11)	(135,339)
投資有価証券合計(注1)	43,438,089.74	5,826,351
現金預金、要求払預金および預託金勘定	5,288,152.06 *	709,300
その他の流動資産(マージン)	1,508,563.68	202,344
有価証券に係る未収利息	151,715.00	20,350
流動資産に係る未収利息	1,471.46	197
前払費用	87,168.18	11,692
金融先物に係る未実現利益(注1)	49,387.77	6,624
先渡為替契約に係る未実現利益(注1)	84,949.95	11,394
資産合計	50,609,497.84	6,788,252
負 債		
スワップに係る未実現損失(注1)	(114,164.00)	(15,313)
当座借越	(839,887.28)	(112,654)
当座借越に係る未払利息	(3.09)	(0)
定率報酬引当金(注2)	(9,711.68)	(1,303)
年次税引当金(注3)	(1,762.06)	(236)
その他の手数料および報酬に係る引当金(注2)	(8,170.80)	(1,096)
引当金合計	(19,644.54)	(2,635)
負債合計	(973,698.91)	(130,602)
期末現在純資産	49,635,798.93	6,657,650

* 2023年 3 月31日現在、当該現金額は取引の相手方のために担保に供されており、モルガン・スタンレー、ロンドン支店については118,000.00米ドルである。

注記は当財務書類の一部である。

U B S (L u x) キー・セレクション・シキャブ - ダイナミック・アルファ (米ドル)

運用計算書

自2022年10月1日 至2023年3月31日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	93,149.37	12,494
有価証券に係る利息	243,385.61	32,645
スワップに係る受取利息(注1)	61,841.74	8,295
証券貸付に係る純収益(注11)	8,164.20	1,095
その他の収益(注4)	4,067.90	546
収益合計	410,608.82	55,075
費 用		
スワップに係る支払利息(注1)	(4,448.84)	(597)
定率報酬(注2)	(56,733.51)	(7,610)
年次税(注3)	(3,566.06)	(478)
その他の手数料および報酬(注2)	(7,241.58)	(971)
現金および当座借越に係る利息	(16,271.58)	(2,183)
費用合計	(88,261.57)	(11,839)
投資純(損)益	322,347.25	43,236
実現(損)益(注1)		
無オプション市場価格証券に係る実現(損)益	(370,558.57)	(49,703)
オプションに係る実現(損)益	26,266.65	3,523
利回り評価証券および短期金融商品に係る 実現(損)益	164,266.62	22,033
金融先物に係る実現(損)益	(107,934.93)	(14,477)
先渡為替契約に係る実現(損)益	(535,978.67)	(71,891)
スワップに係る実現(損)益	172,447.33	23,130
為替差(損)益	474,870.54	63,694
実現(損)益合計	(176,621.03)	(23,690)
当期実現純(損)益	145,726.22	19,546
未実現評価(損)益の変動(注1)		
無オプション市場価格証券に係る 未実現評価(損)益	2,330,397.48	312,576
オプションに係る未実現評価(損)益	3,099.40	416
利回り評価証券および短期金融商品に係る 未実現評価(損)益	119,567.32	16,038
金融先物に係る未実現評価(損)益	528,802.45	70,928
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	285,884.21	38,346
スワップに係る未実現評価(損)益	(28,533.95)	(3,827)
未実現評価(損)益の変動合計	3,239,216.91	434,476
運用の結果による純資産の純増(減)	3,384,943.13	454,022

注記は当財務書類の一部である。

U B S (L u x) キー・セレクション・シキャブ - ダイナミック・アルファ (米ドル)

純資産の変動

	自2022年10月1日 至2023年3月31日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	44,885,879.32	6,020,543
発行額	3,827,817.56	513,425
買戻額	(2,451,583.30)	(328,831)
純発行(買戻)合計	1,376,234.26	184,594
支払配当金	(11,257.78)	(1,510)
投資純(損)益	322,347.25	43,236
実現(損)益合計	(176,621.03)	(23,690)
未実現評価(損)益の変動合計	3,239,216.91	434,476
運用の結果による純資産の純増(減)	3,384,943.13	454,022
期末現在純資産	49,635,798.93	6,657,650

発行済投資証券数の変動表

	自2022年10月1日 至2023年3月31日	
	(口)	
クラスP-acc	(口)	
期首現在発行済投資証券数	28,901.3710	
期中発行投資証券数	443.4950	
期中買戻投資証券数	(3,098.5820)	
期末現在発行済投資証券数	26,246.2840	
ユーロ・ヘッジクラスP-acc	(口)	
期首現在発行済投資証券数	5,595.4230	
期中発行投資証券数	1,580.8730	
期中買戻投資証券数	(112.2580)	
期末現在発行済投資証券数	7,064.0380	

注記は当財務書類の一部である。

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

最重要数値

	ISIN	2023年 3 月31日	2022年 9 月30日	2021年 9 月30日
純資産額（米ドル）		49,635,798.93	44,885,879.32	49,030,139.47
クラスP-acc	LU0218832805			
発行済投資証券数（口）		26,246.2840	28,901.3710	29,414.6590
1口当たり純資産価格（米ドル）		124.12	119.77	130.94
1口当たり発行・買戻価格（米ドル） ¹		124.19	119.77	130.94
ユーロ・ヘッジクラスP-acc	LU0849401350			
発行済投資証券数（口）		7,064.0380	5,595.4230	5,009.1180
1口当たり純資産価格（ユーロ）		93.12	91.13	101.47
1口当たり発行・買戻価格（ユーロ） ¹		93.18	91.13	101.47
¹ 注記 1 を参照				

組入証券の構造

2023年 3 月31日現在

地域別分布表	（純資産に対する百分率）	業種別分布表	（純資産に対する百分率）
アメリカ合衆国	50.38 %	国および中央政府	60.43 %
アイルランド	7.39	銀行および金融機関	5.34
ドイツ	4.30	投資信託	5.18
フランス	3.42	金融および持株会社	4.23
カナダ	3.13	エネルギー・水道	1.66
ニュージーランド	2.92	石油	1.34
イギリス	2.86	化学	1.26
日本	2.58	国際機関	1.25
オランダ	2.21	公共、非営利機関	1.23
オーストラリア	1.70	保険	1.03
韓国	1.02	交通・運輸	0.86
スペイン	0.91	医薬品・化粧品・医療品	0.58
ルクセンブルグ	0.83	各種サービス	0.51
メキシコ	0.62	不動産	0.38
ポーランド	0.53	通信	0.33
ルーマニア	0.48	たばこ・アルコール	0.32
スイス	0.42	抵当および資金貸出機関	0.26
ベルギー	0.41	電子工学・半導体	0.23
国際機関	0.36	インターネット、ソフトウェア・ITサービス	0.22
ノルウェー	0.29	電気装置・部品	0.21
フィンランド	0.22	グラフィックデザイン・出版・メディア	0.14
イタリア	0.18	機械工学・産業機器	0.13
ジャージー	0.14	コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置	0.09
コロンビア	0.10	航空宇宙産業	0.08
ベネズエラ	0.06	繊維・衣服・革製品	0.08
ケイマン諸島	0.05	バイオテクノロジー	0.06
合計	87.51	各種非分類会社	0.05
		小売り・百貨店	0.03
		合計	87.51

注記は当財務書類の一部である。

U B S (L u x) キー・セレクション・シキャブ
- デジタル・トランスフォーメーション・テーマ(米ドル)
純資産計算書

	2023年3月31日現在	
	(米ドル)	(千円)
資産		
投資有価証券、取得価額	277,606,014.56	37,235,295
投資有価証券、未実現評価(損)益	24,180,627.55	3,243,348
投資有価証券合計(注1)	301,786,642.11	40,478,642
現金預金、要求払預金および預託金勘定	6,016,193.58	806,952
有価証券売却未収金(注1)	60,005.54	8,049
発行未収金	247,905.82	33,252
未収配当金	158,565.42	21,268
前払費用	140,174.71	18,802
その他の未収金	179,180.42	24,033
先渡為替契約に係る未実現利益(注1)	1,207,903.28	162,016
資産合計	309,796,570.88	41,553,014
負債		
買戻未払金	(170,415.41)	(22,858)
定率報酬引当金(注2)	(217,363.00)	(29,155)
年次税引当金(注3)	(24,469.99)	(3,282)
その他の手数料および報酬に係る引当金(注2)	(71,723.69)	(9,620)
引当金合計	(313,556.68)	(42,057)
負債合計	(483,972.09)	(64,915)
期末現在純資産	309,312,598.79	41,488,099

注記は当財務書類の一部である。

U B S (L u x) キー・セレクション・シキャブ
- デジタル・トランスフォーメーション・テーマ(米ドル)
運用計算書

自2022年10月1日 至2023年3月31日

	(米ドル)	(千円)
収益		
流動資産に係る利息	87,823.74	11,780
配当金(注1)	938,534.37	125,886
証券貸付に係る純収益(注11)	10,205.18	1,369
その他の収益(注4)	149,161.65	20,007
収益合計	1,185,724.94	159,041
費用		
定率報酬(注2)	(1,401,591.80)	(187,996)
年次税(注3)	(47,209.13)	(6,332)
その他の手数料および報酬(注2)	(50,666.71)	(6,796)
現金および当座借越に係る利息	(128.00)	(17)
費用合計	(1,499,595.64)	(201,141)
投資純(損)益	(313,870.70)	(42,099)
実現(損)益(注1)		
無オプション市場価格証券に係る実現(損)益	(56,054,721.25)	(7,518,620)
先渡為替契約に係る実現(損)益	951,135.82	127,576
為替差(損)益	118,193.86	15,853
実現(損)益合計	(54,985,391.57)	(7,375,191)
当期実現純(損)益	(55,299,262.27)	(7,417,290)
未実現評価(損)益の変動(注1)		
無オプション市場価格証券に係る未実現評価(損)益	118,186,892.50	15,852,408
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	2,776,727.55	372,442
未実現評価(損)益の変動合計	120,963,620.05	16,224,850
運用の結果による純資産の純増(減)	65,664,357.78	8,807,560

注記は当財務書類の一部である。

U B S (L u x) キー・セレクション・シキャブ
- デジタル・トランスフォーメーション・テーマ(米ドル)

純資産の変動

	自2022年10月 1 日 至2023年 3 月31日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	527,403,962.77	70,740,694
発行額	19,290,313.08	2,587,410
買戻額	(303,046,034.84)	(40,647,565)
純発行(買戻)合計	(283,755,721.76)	(38,060,155)
投資純(損)益	(313,870.70)	(42,099)
実現(損)益合計	(54,985,391.57)	(7,375,191)
未実現評価(損)益の変動合計	120,963,620.05	16,224,850
運用の結果による純資産の純増(減)	65,664,357.78	8,807,560
期末現在純資産	309,312,598.79	41,488,099

発行済投資証券数の変動表

	自2022年10月 1 日 至2023年 3 月31日
クラスP-acc	(口)
期首現在発行済投資証券数	335,518.8730
期中発行投資証券数	2,640.2530
期中買戻投資証券数	(32,280.0380)
期末現在発行済投資証券数	305,879.0880

注記は当財務書類の一部である。

U B S (L u x) キー・セレクション・シキャブ
- デジタル・トランスフォーメーション・テーマ（米ドル）

最重要数値

	ISIN	2023年 3 月31日	2022年 9 月30日	2021年 9 月30日
純資産額（米ドル）		309,312,598.79	527,403,962.77	1,502,931,307.14
クラスP-acc	LU2054465674			
発行済投資証券数（口）		305,879.0880	335,518.8730	369,510.1890
1 口当たり純資産価格（米ドル）		143.73	118.88	187.77
1 口当たり発行・買戻価格（米ドル） ¹		143.73	118.88	187.77

¹ 注記 1 を参照

組入証券の構造

2023年 3 月31日現在

地域別分布表	（純資産に対する百分率）	業種別分布表	（純資産に対する百分率）
アメリカ合衆国	77.66 %	インターネット、ソフトウェア・ITサービス	33.75 %
中国	4.89	電子工学・半導体	18.88
オランダ	3.93	銀行および金融機関	8.48
台湾	3.20	金融および持株会社	7.53
日本	1.94	医薬品・化粧品・医療品	5.26
アイルランド	1.68	コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置	4.77
カナダ	1.63	小売り・百貨店	4.24
韓国	1.48	繊維・衣服・革製品	3.63
スイス	1.16	グラフィックデザイン・出版・メディア	2.76
合計	97.57	保険	2.09
		各種サービス	2.04
		宿泊・仕出し・レジャー	1.97
		電気装置・部品	1.08
		食品・清涼飲料	0.94
		自動車	0.15
		合計	97.57

注記は当財務書類の一部である。

U B S (L u x) キー・セクション・シキャブ - グローバル・エクイティーズ（米ドル）

純資産計算書

	2023年3月31日現在	
	（米ドル）	（千円）
資 産		
投資有価証券、取得価額	51,246,346.94	6,873,673
投資有価証券、未実現評価（損）益	2,777,409.00	372,534
投資有価証券合計（注1）	54,023,755.94	7,246,206
現金預金、要求払預金および預託金勘定	459,369.93	61,615
発行未収金	211,934.98	28,427
流動資産に係る未収利息	6.72	1
未収配当金	71,790.86	9,629
前払費用	74,083.43	9,937
その他の未収金	51,171.74	6,864
資産合計	54,892,113.60	7,362,679
負 債		
当座借越に係る未払利息	(10.39)	(1)
買戻未払金	(2,671.67)	(358)
その他の負債	(21,804.08)	(2,925)
定率報酬引当金（注2）	(59,961.53)	(8,043)
年次税引当金（注3）	(4,878.61)	(654)
その他の手数料および報酬に係る引当金（注2）	(12,139.32)	(1,628)
引当金合計	(76,979.46)	(10,325)
負債合計	(101,465.60)	(13,610)
期末現在純資産	54,790,648.00	7,349,070

注記は当財務書類の一部である。

U B S (L u x) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・エクイティーズ(米ドル)

運用計算書

自2022年10月1日 至2023年3月31日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	9,688.79	1,300
配当金(注1)	373,435.53	50,089
貸付証券に係る純収益(注11)	2,211.99	297
その他の収益(注4)	26,177.98	3,511
収益合計	411,514.29	55,196
費 用		
定率報酬(注2)	(349,343.18)	(46,857)
年次税(注3)	(9,722.70)	(1,304)
その他の手数料および報酬(注2)	(9,014.06)	(1,209)
現金および当座借越に係る利息	(43.70)	(6)
費用合計	(368,123.64)	(49,376)
投資純(損)益	43,390.65	5,820
実現(損)益(注1)		
無オプション市場価格証券に係る実現(損)益	175,910.27	23,595
先渡為替契約に係る実現(損)益	(88,397.62)	(11,857)
為替差(損)益	134,020.42	17,976
実現(損)益合計	221,533.07	29,714
当期実現純(損)益	264,923.72	35,534
未実現評価(損)益の変動(注1)		
無オプション市場価格証券に係る未実現評価(損)益	11,226,511.08	1,505,812
未実現評価(損)益の変動合計	11,226,511.08	1,505,812
運用の結果による純資産の純増(減)	11,491,434.80	1,541,346

注記は当財務書類の一部である。

U B S (L u x) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・エクイティーズ(米ドル)

純資産の変動

	自2022年10月1日 至2023年3月31日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	60,068,666.59	8,057,010
発行額	13,400,202.60	1,797,369
買戻額	(30,169,655.99)	(4,046,656)
純発行(買戻)合計	(16,769,453.39)	(2,249,287)
投資純(損)益	43,390.65	5,820
実現(損)益合計	221,533.07	29,714
未実現評価(損)益の変動合計	11,226,511.08	1,505,812
運用の結果による純資産の純増(減)	11,491,434.80	1,541,346
期末現在純資産	54,790,648.00	7,349,070

発行済投資証券数の変動表

	自2022年10月1日 至2023年3月31日
ユーロ建クラスP-acc	(口)
期首現在発行済投資証券数	634,111.7630
期中発行投資証券数	4,518.4260
期中買戻投資証券数	(26,130.9590)
期末現在発行済投資証券数	612,499.2300

最重要数値

	ISIN	2023年3月31日	2022年9月30日	2021年9月30日
純資産額(米ドル)		54,790,648.00	60,068,666.59	185,067,420.08
ユーロ建クラスP-acc	LU0161942635			
発行済投資証券数(口)		612,499.2300	634,111.7630	670,508.6410
1口当たり純資産価格(ユーロ)		31.37	28.92	32.26
1口当たり発行・買戻価格(ユーロ) ¹		31.37	28.92	32.26

¹ 注記1を参照

注記は当財務書類の一部である。

U B S (L u x) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・エクイティーズ(米ドル)

組入証券の構造

2023年3月31日現在

地域別分布表	(純資産に対する百分率)	業種別分布表	(純資産に対する百分率)
アメリカ合衆国	49.12 %	金融および持株会社	18.41 %
イギリス	15.20	電子工学・半導体	17.54
日本	8.60	インターネット、ソフトウェア・ITサービス	14.88
オランダ	5.16	銀行および金融機関	5.06
アイルランド	4.78	バイオテクノロジー	4.61
スイス	4.28	機械工学・産業機器	4.58
インド	3.03	グラフィックデザイン・出版・メディア	4.26
デンマーク	1.94	食品・清涼飲料	4.11
ドイツ	1.71	たばこ・アルコール	3.89
イタリア	1.64	石油	3.60
フランス	1.26	小売り・百貨店	3.45
ルクセンブルグ	1.06	医薬品・化粧品・医療品	2.93
アイスランド	0.82	交通・運輸	1.89
合計	98.60	自動車	1.82
		繊維・衣服・革製品	1.64
		不動産	1.59
		ゴム・タイヤ	1.26
		各種非分類会社	1.16
		投資信託	1.06
		ヘルスケア、社会事業	0.86
		合計	98.60

注記は当財務書類の一部である。

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ

財務書類に対する注記

2023年3月31日現在

注1 - 重要な会計方針の要約

財務書類は、ルクセンブルグにおける投資信託に関する一般に公正妥当と認められる会計原則に従って作成されている。重要な会計方針は、以下のとおり要約される。

a) 純資産価額の計算

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

この場合の「営業日」は、ルクセンブルグの通常の銀行営業日（即ち、銀行が通常の営業時間に営業を行っている日）を指し、12月24日および31日、ルクセンブルグの個々の法定外休日ならびにサブ・ファンドが投資する主要各国の取引所の休業日またはサブ・ファンドの投資対象の50%以上を適切に評価することができない日等を含まない。

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

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

a) 英国およびアメリカ合衆国において通常の銀行営業日とみなされない日。

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

サブ・ファンドの各投資証券クラスに帰する純資産価額の百分率は、投資証券の発行または買戻しの度に変動する。この百分率は、当該投資証券クラスに課される報酬を考慮し、サブ・ファンドの発行済投資証券総数に対する各投資証券クラスの発行済投資証券の比率によって決定される。

b) 評価原則

- 流動資産は、（現金、銀行預金、為替手形、小切手、約束手形、前払費用、配当金ならびに宣言済または発生済で未受領の利息という形態にかかわらず）いずれも額面として評価されるが、かかる価額が全額支払われるか受領される可能性が低い場合はこの限りではなく、かかる場合、その評価額は、その真正価値に達するために適切とみなされる減額分を考慮して決定される。
- 証券取引所に上場されている証券、派生商品およびその他の資産は、直近の入手可能な市場価格で評価される。当該証券、派生商品またはその他の資産が複数の証券取引所に上場されている場合には、当該資産の主要市場である証券取引所における直近の入手可能な価格が適用される。

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

- 証券取引所に上場されておらずまたは他の規制ある市場で取引されておらず、適正価格を入手することができない証券およびその他の投資対象は、予想販売価格に基づき誠意をもって本投資法人が選ぶその他の原則に従って本投資法人が評価する。
- 証券取引所に上場されていない派生商品(店頭派生商品)は、独立の価格提供業者にに基づいて評価される。派生商品について、利用できる独立の価格提供業者がただ1社の場合、得られた評価の妥当性は、派生商品の原資産の時価に基づき本投資法人および本投資法人の監査人が認めた計算モデルを使用して検証される。
- その他の譲渡性証券集合投資事業(UCITS)および/または集合投資事業(UCIs)の受益証券は、その最終資産価額で評価される。
サブ・ファンドであるUBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - マルチ・ストラテジー・オルタナティブズ(ユーロ)に関して、純資産価額の計算は、マスターファンドの純資産価額を適時に受領することに依拠する。
- 証券取引所または一般に公開されている他の規制市場で取引されていない短期金融商品は、関連するカーブに基づいて評価される。カーブに基づく評価は、金利および信用スプレッドから計算される。このプロセスには次の原則が適用される。残余期間が最も近い金利が、各短期金融商品について補間される。このように計算された金利は、裏付けとなる借り手の信用力を反映する信用スプレッドを加えることによって市場価格に転換される。この信用スプレッドは、借り手の信用格付けに重大な変更がある場合には調整される。
- 関連するサブ・ファンドの会計通貨以外の通貨で表示され、為替取引によるヘッジを行わない証券、短期金融商品、派生商品およびその他の資産は、ルクセンブルグの平均為替レート(買呼値と売呼値の仲値)または入手不可能な場合、当該通貨を最も代表する市場におけるレートを用いて評価される。
- 定期預金および信託預金は、額面価額に累積利息を付して評価される。
- スワップの価値は、外部のサービス提供会社が計算し、別の外部サービス提供会社が第二の独立した評価を提供する。かかる計算はすべての現金流入出額の正味現在価値を基準とする。特別な場合に、内部計算(ブルームバーグから提供されたモデルと市場データに基づく。)および/またはブローカーの報告評価を利用することができる。評価方法は、当該証券に依拠し、適用されるUBS評価方針に従い選択される。

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

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

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

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

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

さらに、特別な状況の場合、当日のうちに追加の評価を行うことができる。かかる新評価が投資証券の事後の発行、買戻しおよび転換について有効となる。再評価は、当該日の唯一の純資産価格が公表される前にのみ行われる。発行、買戻しおよび転換は、唯一の純資産価格に基づいてのみ処理される。

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

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

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

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

化調整は、取締役会が決定した方法に従って計算される。投資主は、一時的措置が導入された時点および終了した時点で、通常の連絡経路を通じて通知される。

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

c) 証券売買実現純(損)益

証券売買実現損益は、売却証券の平均原価に基づいて計算される。

d) 先渡為替契約の評価

未決済の先渡為替契約の未実現(損)益は、評価日に適用される先渡為替レートに基づいて評価される。

e) 金融先物契約の評価

金融先物契約は、評価日に適用される直近の入手可能な公表価格に基づいて評価される。実現損益および未実現損益の変動は、運用計算書に記帳される。実現損益は、先入先出法に従って計算される。すなわち、最初の取得契約が最初に売却されるものと考えられる。

f) 外貨換算

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

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

g) 組入証券取引の会計処理

組入証券取引は、取引日の翌銀行営業日に会計処理される。

h) 連結財務書類

本投資法人の連結財務書類は、ユーロ（EUR）で表示される。本投資法人の2023年3月31日現在の連結純資産計算書および連結運用計算書の各種科目は、以下の為替レートでユーロに換算された各サブ・ファンドの財務書類の対応する科目の合計に等しい。

以下の為替レートが、2023年3月31日現在の連結財務書類の換算に用いられた。

為替レート

1ユーロ = 0.992526 スイスフラン（CHF）

1ユーロ = 1.086450 米ドル（USD）

i) 収益の認識

源泉税控除後の配当金は、「配当落ち」日に収益として認識される。受取利息は、日々ベースで発生する。

j) 有価証券売却未収金、有価証券購入未払金

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

外国為替取引による未収金および未払金は相殺される。

k) サブ・ファンド間投資

2023年3月31日現在、UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション（米ドル）は、UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブの他のサブ・ファンドに以下の投資を行った。

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション（米ドル）	金額（米ドル）
UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - ユーロ・エクイティ・バリュー・オポチュニティ（ユーロ）	14,755,743.24
クラスU - X - ACC 投資証券	
合計	14,755,743.24

サブ・ファンド間投資の総額は、44,056,251.42ユーロである。したがって、報告期間末現在の調整済み連結純資産は、4,430,993,727.07ユーロである。

l) スワップ

本投資法人は、金利スワップ契約、金利スワップションの金利先渡し契約およびクレジット・デフォルト・スワップを締結することができる。ただし、当該契約は、この種の取引を専門とする第一級の金融機関との間で執行される場合に限る。

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

スワップ取引の価値は、外部のサービス提供会社が計算し、また別の外部サービス提供会社が第二の独立した評価を提供する。かかる計算は、インフローとアウトフロー双方のすべてのキャッシュフローの正味現在価値に基づいている。

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

評価方法は、それぞれの証券に依拠し、UBS 評価方針に従って決定される。

当該評価方法は、取締役会によって認可されている。

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

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

注2 - 定率報酬

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

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - デジタル・トランスフォーメーション・テーマ (米ドル)

	定率報酬	上限定率報酬 名称に「ヘッジ」を含む クラス受益証券の料率
名称に「P」が付く投資証券クラス	1.710%	年率1.760%

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

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

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

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

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

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

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

上記の定率報酬から、以下の報酬が支払われる。

1. 本投資法人の運用、管理事務、ポートフォリオ管理、投資助言および販売に関して(該当する場合)、また保管受託銀行のすべての職務(本投資法人の資産の保管および監督、決済取引の取扱いならびに販売目論見書の「保管受託銀行および主たる支払代理人」の項に記載されるその他一切の職務等)に関して、次の規定に従い本投資法人の資産から本投資法人の純資産価額に基づく上限定率報酬が支払われる。当該報酬は、純資産価額の計算毎に比例按分ベースで本投資法人の資産に対し請求され、毎月支払われる(上限定率報酬)。名称に「ヘッジ」を含むクラス投資証券の上限定率報酬には、為替リスクをヘッジするための報酬が含まれる。関連する上限定率報酬は対応する投

資証券クラスが発行されるまで請求されない。上限定率報酬の概要は、販売目論見書の「サブ・ファンドおよび特別な投資方針」に記載されている。

本報酬は、「定率報酬」として運用計算書に計上されている。

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

- a) 資産の売買のための本投資法人の資産の管理に関する一切の追加の費用(市場、手数料、報酬等に合致する買呼値および売呼値のスプレッド、仲介手数料)。かかる費用は、通常、各資産の売買時点で計算される。本書の記載にかかわらず、受益証券の発行および買戻しの決済に関する資産の売買によって生じるかかる追加の費用は、販売目論見書の「純資産価額、発行、買戻しおよび転換価格」の項に基づくスイング・プライシングの原理の適用によりカバーされる。
- b) 本投資法人の設立、変更、清算および合併に関する監督官庁への費用ならびに監督官庁およびサブ・ファンドが上場されている証券取引所に支払う一切の手数料。
- c) 本投資法人の設立、変更、清算および合併に関する年次監査および認可に関する監査報酬ならびにファンドの管理事務に関して監査人が提供するサービスに関して監査法人に支払われるか、または法律によって許可される一切のその他の報酬。アドホック・レポートの作成に関してマスターファンドから請求される費用。ただし、当該費用は、UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - マルチ・ストラテジー・オルタナティブズ(ユーロ)の年次報告書または中間報告書の作成に関連して生じるものとする。
- d) 本投資法人の設立、販売国における登録、変更、清算および合併に関する法律顧問、税務顧問および公証人に対する報酬ならびに法律で明白に禁止されない限り、本投資法人およびその投資者の利益の全般的な保護に関する手数料。
- e) 本投資法人の純資産価額の公表に関するコストおよび投資者に対する通知に関する一切のコスト(翻訳コストを含む。)。
- f) 本投資法人の法的文書に関するコスト(目論見書、K I D s、年次報告書および半期報告書ならびに居住国および販売が行われる国で法的に要求されるその他の一切の文書)。
- g) 外国の監督官庁への本投資法人の登録に関するコスト(該当する場合、外国の監督官庁に支払われる手数料ならびに翻訳コストおよび外国の代表者または支払代理人に対する報酬を含む。)。
- h) 本投資法人による議決権または債権者の権利の使用により発生した費用(外部顧問報酬を含む。)。
- i) 本投資法人の名義で登録された知的財産または本投資法人の使用権に関するコストおよび手数料。
- j) 管理会社、ポートフォリオ・マネジャーまたは保管受託銀行が投資者の利益の保護のために講じた特別措置に関して生じた一切の費用。
- k) 管理会社が投資者の利益につき集団訴訟に関与する場合、管理会社は、第三者に関して生じた費用(例えば、法律コストおよび保管受託銀行に関するコスト)を本投資法人の資産に対して請求することができる。さらに、管理会社は、すべての管理事務コストを請求することができる。ただし、かかるすべての管理事務コストは、証明可能かつ公表されており、および/または本投資法人の総費用率(T E R)の開示において考慮される。
当該手数料および報酬は、「その他の手数料および報酬」として運用計算書に計上されている。

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

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

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

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

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

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

投資証券クラス「K - B」の資産運用を目的として実施された業務に関連するコストは、投資者との個別契約に基づきUBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジーまたは公認の販売パートナーの1つが受け取る資格を有する報酬によって賄われる。

個々のサブ・ファンドに帰属する費用はすべて、それらのサブ・ファンドに請求される。

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

サブ・ファンドが、管理会社により、または共同経営もしくは支配を通じてまたは実質的に直接保有もしくは間接保有を通じて、管理会社と関係する別の会社により、直接的または委託によって運営されるファンドの受益証券への投資を行う場合、対象ファンドの受益証券に関して、投資を行うサブ・ファンドに発行または買戻手数料は課されることはない。

本投資法人の現行の手数料の詳細は、KIDに記載されている。

注3 - 年次税

ルクセンブルグの現行法規に準拠して、本投資法人は、四半期毎に支払われ各四半期末日の各サブ・ファンドの純資産額に基づいて計算される年率0.05%の年次税を課されているが、機関筋の投資証券クラスに関しては年率0.01%になる減額された年次税を課されている。

ルクセンブルグ法の法定条項に準拠して、既に年次税を支払っている他の投資信託の受益証券もしくは投資証券に投資されている純資産の部分に関して、年次税は課されない。

注4 - その他の収益

その他の収益は、主にスイング・プライシングから生じる収益で構成される。

注5 - 収益の分配

各サブ・ファンドの投資主総会は、管理会社の取締役会の提案によりサブ・ファンドの年次決算の終了後に、各サブ・ファンドおよび/または投資証券クラスから分配を行うか、および支払われる分配金の程度を決定する。本投資法人の純資産額が法律に規定されている最低資産額を下回る場合には、分配の支払は行われない。分配が行われる場合、分配金は年度末後4ヵ月以内に支払われる。

分配の詳細については、未監査である。

取締役会は、中間配当金を支払い、また分配金支払を停止する権限を有している。

注6 - ソフト・コミッション契約

2022年10月1日から2023年3月31日までの期間中に、UBS (Lux) キー・セクション・シキャブのために締結された「ソフト・コミッション契約」はなく、「ソフト・コミッション契約」の金額は零である。

注7 - 金融先物およびスワップの契約

2023年3月31日現在の個々のサブ・ファンドおよび各通貨の金融先物およびスワップに係る契約は、以下のように要約できる。

a) 金融先物

UBS (Lux) キー・セクション・シキャブ	指数関連金融先物 (購入)	指数関連金融先物 (売却)
- ダイナミック・アルファ (米ドル)	15,555,259.12 米ドル	5,602,703.49 米ドル
- グローバル・アロケーション (ユーロ)	56,644,410.14 ユーロ	34,980,725.32 ユーロ
- グローバル・アロケーション (米ドル)	45,755,578.96 米ドル	7,095,509.76 米ドル

UBS (Lux) キー・セクション・シキャブ	債券関連金融先物 (購入)	債券関連金融先物 (売却)
- ダイナミック・アルファ (米ドル)	3,890,984.14 米ドル	2,548,414.89 米ドル
- グローバル・アロケーション (ユーロ)	74,823,605.55 ユーロ	63,645,664.20 ユーロ
- グローバル・アロケーション (米ドル)	60,428,426.82 米ドル	45,886,440.83 米ドル

UBS (Lux) キー・セクション・シキャブ	金利関連金融先物 (購入)	金利関連金融先物 (売却)
	該当なし	

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

b) スワップ

UBS (Lux) キー・セクション・シキャブ	クレジット・デフォルト・スワップ (購入)	クレジット・デフォルト・スワップ (売却)
- ダイナミック・アルファ (米ドル)	- 米ドル	4,802,347.01 米ドル

- グローバル・アロケーション(ユーロ)	- ユーロ	9,168,752.79 ユーロ
- グローバル・アロケーション(米ドル)	12,281,994.76 米ドル	- 米ドル

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ	指数スワップおよび 指数先渡しスワップ(購入)	指数スワップおよび 指数先渡しスワップ(売却)
- グローバル・アロケーション(ユーロ)	- ユーロ	24,999,096.66 ユーロ

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ	金利スワップおよび 金利先渡しスワップ(購入)	金利スワップおよび 金利先渡しスワップ(売却)
	該当なし	

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ	シンセティック・エクイティ・ スワップ (購入)	シンセティック・エクイティ・ スワップ (売却)
	該当なし	

注8 - 総費用比率(TER)

この比率は、アセット・マネジメント・アソシエーション・スイス(AMAS)/スイス・ファンズ・アンド・アセット・マネジメント・アソシエーション(SFAMA)の「TERの計算および公表に関するガイドライン」現行版に従って計算された。比率はまた、純資産の百分率として遡及的に計算され、純資産(運用費用)に対し継続ベースで請求されるすべての費用および手数料の合計を表す。

過去12ヵ月のTERは、以下のとおりである。

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ	総費用比率(TER)
- デジタル・トランスフォーメーション・テーマ(米ドル)クラスP - acc 投資証券	1.78%
- ダイナミック・アルファ(米ドル)クラスP - acc 投資証券	2.00%
- ダイナミック・アルファ(米ドル)ユーロ・ヘッジクラスP - acc 投資証券	2.04%
- グローバル・アロケーション(ユーロ)クラスP - acc 投資証券	2.11%
- グローバル・アロケーション(米ドル)クラスP - acc 投資証券	2.12%
- グローバル・アロケーション(米ドル)円建クラスP - acc 投資証券	2.12%
- グローバル・エクイティーズ(米ドル)ユーロ建クラスP - acc 投資証券	2.11%

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

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

注9 - マスター・フィーダー・ストラクチャー

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

注10 - 適用法、業務地および公認言語

ルクセンブルグ地方裁判所は、投資主、管理会社および保管受託銀行との間ですべての法的紛争処理を行う場所である。ルクセンブルグ法が適用される。しかし、他の国の投資家の賠償請求に関する件については、管理会社および/または保管受託銀行は、ファンドの投資証券が売買された国の裁判管轄権に自らおよびファンドを服せしめることを選択することができる。

当財務書類については英語版が公認されたものである。しかし、本投資法人投資証券の購入および売却が可能なその他の国の投資家に対して投資証券が販売される場合、本投資法人および保管受託銀行は、当該国の言語への承認された翻訳(すなわち、本投資法人によって承認されたもの)に自らが拘束されるものと認めることができる。

注11 - 証券貸付

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

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

UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ	2023年3月31日現在の貸付証券による 相手方エクスポージャー*		2023年3月31日 現在の担保内訳 (比重 %)		
	貸付証券の時価	担保(ユービーエス・スイス・エイ・ジー)	株式	債券	現金
- デジタル・トランスフォーメーション・テーマ(米ドル)	22,540,293.61 米ドル	23,107,847.33 米ドル	47.92	52.08	0.00
- ダイナミック・アルファ(米ドル)	3,767,431.24 米ドル	3,987,166.91 米ドル	47.92	52.08	0.00
- グローバル・アロケーション(ユーロ)	21,427,114.39 ユーロ	19,206,250.14 ユーロ	47.92	52.08	0.00
- グローバル・エクイティーズ(米ドル)	3,458,817.63 米ドル	3,340,359.78 米ドル	47.92	52.08	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、2023年3月31日に証券貸付代理人から直接入手されるため、2023年3月31日現在の財務書類の作成に使用された終値および為替レートとは異なる可能性がある。

	UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - デジタル・トランスフォーメーション・テーマ(米ドル)	UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - ダイナミック・アルファ(米ドル)
貸付証券収益	17,008.63 米ドル	13,607.00 米ドル
貸付証券費用**		
ユービーエス・スイス・エイ・ジー	5,102.59 米ドル	4,082.10 米ドル
UBSヨーロッパSE ルクセンブルグ支店	1,700.86 米ドル	1,360.70 米ドル
貸付証券純収益	10,205.18 米ドル	8,164.20 米ドル
	UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション(ユーロ)	UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション(米ドル)
貸付証券収益	45,225.65 ユーロ	8,338.62 米ドル

貸付証券費用^{**}

ユービーエス・ スイス・エイ・ジー	13,567.70 ユーロ	2,501.59 米ドル
UBSヨーロッパSE ルクセンブルグ支店	4,522.56 ユーロ	833.86 米ドル
貸付証券純収益	27,135.39 ユーロ	5,003.17 米ドル

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

貸付証券収益	3,686.65 米ドル
--------	--------------

貸付証券費用^{**}

ユービーエス・ スイス・エイ・ジー	1,106.00 米ドル
UBSヨーロッパSE ルクセンブルグ支店	368.66 米ドル
貸付証券純収益	2,211.99 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。

[次へ](#)

(2) 投資有価証券明細表等

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

2023年3月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある証券および短期金融商品			
商品証券			
イギリス			
USD UBS AG LONDON/ETC UBS BLBG INDUSTRIAL METAL TOT RET 07-PRP	1 939.00	2 441 201.00	1.02
USD UBS AG LONDON/ETC UBS BLOOMBERG CMCI ENERGY INDEX 08-PRP	2 560.00	2 466 560.00	1.03
USD UBS AG/LONDON/CMAGTR USD 16-PRP	21 890.00	3 839 506.00	1.61
イギリス合計		8 747 267.00	3.66

商品証券合計		8 747 267.00	3.66
--------	--	--------------	------

公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある証券および短期金融商品合計		8 747 267.00	3.66
-------------------------------------	--	--------------	------

他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券および短期金融商品

財務省証券 (T-bill)、ゼロ・クーポン

米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 16.06.22-15.06.23	6 000 000.00	5 943 531.48	2.49
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 22.12.22-22.06.23	1 000 000.00	989 780.56	0.41
米ドル合計		6 933 312.04	2.90

財務省証券 (T-bill)、ゼロ・クーポン合計		6 933 312.04	2.90
--------------------------	--	--------------	------

他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券および短期金融商品合計		6 933 312.04	2.90
-------------------------------------	--	--------------	------

ルクセンブルグ2010年12月17日法 (改訂済) の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs

商品証券

アイルランド			
USD ISHARES PHYSICAL GOLD ETC 11-PRP	280 686.00	10 814 129.87	4.53
アイルランド合計		10 814 129.87	4.53

商品証券合計		10 814 129.87	4.53
--------	--	---------------	------

投資信託、オープン・エンド型

アイルランド			
USD UBS IRL INVESTOR SELECTION PLC-O ' CONNOR CHINA-U-B-PF-USD	808.00	8 142 030.16	3.41
EUR UBS(IRE)INVESTOR SELECTION PLC-GLOBAL EQUITY LNG SHT-U-B-CAP	94.00	15 355 455.15	6.43
アイルランド合計		23 497 485.31	9.84

ルクセンブルグ

USD UBS (LUX) BOND SICAV - GLOBAL CORPORATES U-X-DIST	958.00	10 478 546.52	4.39
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD CORPORATES U-X-ACC	1 447.00	14 893 551.37	6.24
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD U-X-ACC	576.00	11 892 879.36	4.98
USD UBS (LUX) BOND SICAV - ASIAN HIGH YIELD U-X-ACC	744.00	5 980 517.52	2.50
USD UBS (LUX) EMERGING ECONOMIES FUND-GLOBAL BONDS (USD)-U-X-ACC	2 042.00	24 545 370.92	10.28
EUR UBS (LUX) EQUITY FUND - EUROPEAN OPP SUST (EUR) U-X-ACC	345.00	12 910 256.01	5.41
USD UBS (LUX) EQUITY FUND - MID CAPS USA U-X-ACC	60.00	544 239.00	0.23

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD UBS (LUX) EQUITY FUND - SMALL CAPS USA (USD) U-X-ACC	60.00	494 959.80	0.21
USD UBS (LUX) EQUITY FUND - CHINA OPPORTUNITY (USD) U-X-ACC	559.00	3 816 835.23	1.60
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - GLB EM OPP(USD)-U-X-ACC	580.00	15 658 689.20	6.56
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - GL HI DIV (USD)-I-X-ACC	60 352.00	15 507 446.40	6.50
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - GLOBAL OPPORTUNITY (USD) U-X-ACC	600.00	6 572 808.00	2.75
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV-GBL DEFENSIVE SUSTAINABLE(USD)U-X-ACC	374.00	35 448 711.10	14.85
EUR UBS (LUX) KEY SELE SICAV - EURO EQU VALUE OPP (EUR) U-X-ACC	1 164.67	14 755 743.24	6.18
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD SUSTAINABLE U-X-ACC	71.00	820 504.40	0.34
ルクセンブルグ合計		174 321 058.07	73.02
投資信託、オープン・エンド型合計		197 818 543.38	82.86
ルクセンブルグ2010年12月17日法(改訂済)の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs合計		208 632 673.25	87.39
投資有価証券合計		224 313 252.29	93.95

金融派生商品

公認の証券取引所に上場されている金融派生商品

債券関連金融先物

EUR EURO BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 08.06.23	120.00	508 458.60	0.22
EUR EURO-BUND FUTURE 08.06.23	-96.00	-498 550.18	-0.21
AUD AUSTRALIA 10YR BOND FUTURE 15.06.23	175.00	339 814.91	0.14
USD US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 21.06.23	65.00	378 828.13	0.16
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.06.23	-276.00	-901 312.50	-0.38
CAD CAN 10YR BOND FUTURE 21.06.23	234.00	881 811.80	0.37
債券関連金融先物合計		709 050.76	0.30

指数関連金融先物

USD MSCI CHINA FUTURE 16.06.23	233.00	371 285.50	0.16
EUR EURO STOXX BANKS PRICE INDEX FUTURE 16.06.23	821.00	-134 688.29	-0.06
EUR EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 16.06.23	-101.00	-223 374.12	-0.09
CHF SWISS MARKET INDEX FUTURE 16.06.23	-13.00	-65 743.53	-0.03
GBP FTSE 100 INDEX FUTURE 16.06.23	23.00	24 599.17	0.01
SEK OMX 30 INDEX FUTURE 21.04.23	-40.00	-25 330.41	-0.01
USD MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 16.06.23	12.00	24 880.00	0.01
USD S&P500 EMINI FUTURE 16.06.23	68.00	667 685.00	0.28
JPY TOPIX INDX FUTURE 08.06.23	23.00	-12 961.15	-0.01
USD RUSSELL 2000 E-MINI INDEX FUTURE 16.06.23	140.00	380 310.00	0.16
CAD S&P/TSX 60 IX FUTURE 15.06.23	7.00	19 354.93	0.01
HKD HANG SENG INDEX FUTURE 27.04.23	9.00	45 197.74	0.02
指数関連金融先物合計		1 071 214.84	0.45

公認の証券取引所に上場されている金融派生商品合計 1 780 265.60 0.75

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

クレジット・デフォルト・スワップ*

USD ICE/MARKIT CDX.NA.HY CDI PAY 5.00000% 23-20.06.28	-12 100 000.00	-200 480.87	-0.09
クレジット・デフォルト・スワップ合計		-200 480.87	-0.09

公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引されていない金融派生商品合計 -200 480.87 -0.09

金融派生商品合計 1 579 784.73 0.66

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 （注１）	純資産 比率 （％）		
先渡為替契約					
購入通貨 / 購入金額 / 売却通貨 / 売却金額 / 満期日					
USD	10 226 508.39	PHP 562 550 000.00	20.4.2023	-132 052.04	-0.06
KRW	1 980 000 000.00	USD 1 594 164.39	20.4.2023	-73 958.02	-0.03
TWD	53 100 000.00	USD 1 769 410.20	20.4.2023	-27 363.73	-0.01
USD	8 556 256.96	CNY 57 605 000.00	20.4.2023	153 157.57	0.06
BRL	48 120 000.00	USD 9 083 872.92	20.4.2023	379 613.98	0.16
USD	79 474.94	CLP 66 600 000.00	20.4.2023	-4 606.71	0.00
JPY	3 817 000 000.00	USD 30 126 496.56	20.4.2023	-1 364 503.88	-0.57
MXN	189 160 000.00	USD 9 874 968.83	20.4.2023	564 312.20	0.24
CAD	2 715 000.00	USD 2 038 054.19	20.4.2023	-31 401.60	-0.01
USD	171 033.22	ILS 580 000.00	20.4.2023	9 883.12	0.00
USD	41 411.12	PLN 180 000.00	20.4.2023	-325.42	0.00
NOK	72 160 000.00	USD 7 345 109.39	20.4.2023	-449 298.32	-0.19
USD	1 953 057.00	CHF 1 795 000.00	20.4.2023	-15 606.89	-0.01
AUD	15 525 000.00	USD 10 895 539.70	20.4.2023	-490 942.28	-0.21
USD	29 029 326.13	EUR 26 565 000.00	20.4.2023	138 818.62	0.06
USD	5 335 591.04	NZD 8 320 000.00	20.4.2023	129 955.14	0.05
SEK	9 640 000.00	USD 933 582.39	20.4.2023	-2 983.89	0.00
USD	13 817 432.48	GBP 11 270 000.00	20.4.2023	-122 544.38	-0.05
SGD	500 000.00	USD 379 134.99	20.4.2023	-2 854.32	0.00
USD	574 545.72	DKK 3 910 000.00	20.4.2023	3 619.24	0.00
USD	13 395 148.74	CNH 89 470 000.00	20.4.2023	348 274.94	0.15
JPY	638 934 774.00	GBP 4 115 000.00	20.4.2023	-275 243.28	-0.12
USD	4 146 815.52	CNH 27 810 000.00	20.4.2023	91 449.92	0.04
USD	1 600 646.73	KRW 1 980 000 000.00	20.4.2023	80 440.36	0.03
USD	1 770 726.00	TWD 53 100 000.00	20.4.2023	28 679.53	0.01
PHP	562 550 000.00	USD 10 265 510.95	20.4.2023	93 049.48	0.04
MXN	47 000 000.00	USD 2 436 063.06	20.4.2023	157 752.80	0.07
USD	2 420 466.35	BRL 12 820 000.00	20.4.2023	-100 770.18	-0.04
CHF	2 010 000.00	EUR 2 010 803.52	20.4.2023	17 618.94	0.01
GBP	639 355.75	EUR 725 000.00	20.4.2023	2 356.44	0.00
USD	7 543 121.82	NZD 11 890 000.00	20.4.2023	103 817.64	0.04
USD	7 435 000.00	KRW 9 626 838 000.00	20.4.2023	43 696.75	0.02
EUR	1 000 000.00	USD 1 069 239.30	20.4.2023	18 300.98	0.01
EUR	752 803.87	USD 800 000.00	20.4.2023	18 704.53	0.01
EUR	399 953.65	CAD 575 000.00	20.4.2023	9 981.59	0.00
USD	1 417 466.85	BRL 7 440 000.00	20.4.2023	-45 715.66	-0.02
EUR	1 960 000.00	USD 2 085 576.22	20.4.2023	46 002.73	0.02
CNH	42 690 000.00	USD 6 229 706.76	20.4.2023	-4 479.95	0.00
CNY	57 605 000.00	USD 8 413 788.07	20.4.2023	-10 688.68	0.00
GBP	958 870.27	MXN 20 930 000.00	20.4.2023	31 070.92	0.01
USD	4 860 000.00	KRW 6 402 199 500.00	20.4.2023	-55 487.10	-0.02
USD	2 428 178.31	AUD 3 665 000.00	20.4.2023	-28 043.88	-0.01
USD	360 684.40	HKD 2 825 000.00	20.4.2023	453.90	0.00
CAD	810 000.00	USD 592 754.48	20.4.2023	5 915.35	0.00
CAD	765 000.00	USD 556 202.07	20.4.2023	9 208.33	0.00
CNH	16 855 000.00	USD 2 447 068.27	20.4.2023	10 795.35	0.01
GBP	5 765 000.00	NOK 74 961 404.88	20.4.2023	-32 707.47	-0.01
GBP	935 284.70	JPY 151 900 000.00	20.4.2023	12 225.38	0.01
USD	2 358 186.11	AUD 3 545 000.00	20.4.2023	-17 614.07	-0.01
GBP	1 930 000.00	USD 2 372 344.81	20.4.2023	14 891.69	0.01
EUR	8 750 000.00	USD 9 457 639.63	20.4.2023	58 337.81	0.02
USD	4 710 000.00	MXN 86 866 007.19	20.4.2023	-83 923.99	-0.04
先渡為替契約合計				-790 730.51	-0.33
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産				14 174 642.47**	5.94
その他の資産および負債				-517 390.93	-0.22
純資産総額				238 759 558.05	100.00

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

** 2023年3月31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、ゴールドマン・サックスについては50,000.00米ドルおよびJ.P. モルガンについては30,000.00米ドルである。

注記は当財務書類の一部である。

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

2023年3月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	ユーロ建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある証券および短期金融商品			
株式			
ベルギー			
EUR EURONAV NPV	6 615.00	101 540.25	0.04
EUR SA D ' IETEREN NV NPV	988.00	176 753.20	0.07
ベルギー合計		278 293.45	0.11
カナダ			
CAD CAN PACIFIC RYS COM NPV	4 615.00	326 646.03	0.14
USD LULULEMON ATHLETIC COM STK USD0.01	1 172.00	392 867.30	0.16
カナダ合計		719 513.33	0.30
デンマーク			
DKK CARLSBERG SER ' B ' DKK20	1 508.00	215 188.58	0.09
DKK DANSKE BANK A/S DKK10	20 814.00	385 584.21	0.16
DKK GENMAB AS DKK1	907.00	315 227.39	0.13
DKK NOVO-NORDISK AS DKK0.2 SER ' B '	6 845.00	997 718.21	0.41
DKK TRYG A/S DKK5	19 291.00	388 187.00	0.16
デンマーク合計		2 301 905.39	0.95
フィンランド			
EUR METSO OUTOTEC OYJ NPV	33 784.00	339 191.36	0.14
SEK NORDEA HOLDING ABP NPV	18 527.00	181 948.14	0.07
EUR SAMPO PLC SER ' A ' NPV	15 526.00	675 070.48	0.28
フィンランド合計		1 196 209.98	0.49
フランス			
EUR AIR LIQUIDE(L ') EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)	3 132.00	482 954.40	0.20
EUR AXA EUR2.29	26 154.00	736 627.41	0.30
EUR DANONE EURO.25	7 780.00	445 871.80	0.19
EUR ESSILORLUXOTTICA EURO.18	2 028.00	336 648.00	0.14
EUR KERING EUR4	390.00	234 000.00	0.10
EUR L ' OREAL EURO.20	846.00	347 917.50	0.14
EUR LVMH MOET HENNESSY EURO.30	1 111.00	938 128.40	0.39
EUR PERNOD RICARD EUR1.55	2 712.00	565 994.40	0.23
EUR SANOFI EUR2	5 558.00	557 133.92	0.23
EUR SCHNEIDER ELECTRIC EUR8	3 013.00	463 037.84	0.19
EUR TELEPERFORMANCE EUR2.50	1 265.00	280 450.50	0.12
EUR TOTAENERGIES SE EUR2.5	9 908.00	538 598.88	0.22
フランス合計		5 927 363.05	2.45
ドイツ			
EUR ALLIANZ SE NPV(REGD)(VINKULIERT)	1 816.00	386 444.80	0.16
EUR BAYER AG NPV (REGD)	2 152.00	126 365.44	0.05
EUR BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG EUR1	2 074.00	209 349.56	0.09
EUR BEIERSDORF AG NPV	3 897.00	467 445.15	0.19
EUR DEUTSCHE TELEKOM NPV(REGD)	28 729.00	642 093.15	0.27
EUR EXASOL AG ORD NPV	7 815.00	30 947.40	0.01
EUR HANNOVER RUECKVERS ORD NPV(REGD)	1 472.00	265 475.20	0.11
EUR INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)	3 586.00	135 120.48	0.06
EUR MUENCHENER RUECKVE NPV(REGD)	1 404.00	452 790.00	0.19
EUR SAP AG ORD NPV	2 607.00	302 568.42	0.12
EUR VONOVIA SE NPV	8 688.00	150 649.92	0.06
ドイツ合計		3 169 249.52	1.31

銘柄	数量 / 額面	ユーロ建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
香港			
HKD AIA GROUP LTD NPV	47 000.00	455 474.51	0.19
香港合計		455 474.51	0.19
アイルランド			
EUR AIB GROUP PLC ORD EURO.625	131 700.00	492 821.40	0.20
USD APTIV PLC COM USD0.01	9 861.00	1 018 275.66	0.42
EUR BANK OF IRELAND GR EUR1	51 481.00	480 008.84	0.20
アイルランド合計		1 991 105.90	0.82
イタリア			
EUR FINECOBANK SPA EURO.33	9 772.00	138 176.08	0.06
EUR INTERCOS SPA NPV	9 000.00	119 790.00	0.05
イタリア合計		257 966.08	0.11
日本			
JPY ファナック	9 500.00	312 734.21	0.13
JPY 三菱UFJフィナンシャル・グループ	38 800.00	227 520.84	0.10
JPY 日本電気	5 700.00	201 043.42	0.08
JPY 日本電信電話	15 300.00	419 228.44	0.17
JPY ソフトバンクグループ	7 900.00	283 119.21	0.12
JPY ソニーグループ	3 900.00	323 256.66	0.13
日本合計		1 766 902.78	0.73
ルクセンブルグ			
EUR MAJOREL GRP SA(LUX EURO.01)	16 100.00	327 635.00	0.14
ルクセンブルグ合計		327 635.00	0.14
オランダ			
EUR ABN AMRO BANK N.V. DR EACH REP SHS	21 661.00	316 683.82	0.13
EUR ASML HOLDING NV EURO.09	935.00	584 562.00	0.24
EUR HEINEKEN NV EUR1.60	6 142.00	608 426.52	0.25
EUR KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20	39 993.00	673 322.15	0.28
EUR OCI N.V. EURO.02	15 854.00	495 596.04	0.20
EUR WOLTERS KLUWER EURO.12	3 664.00	426 306.40	0.18
オランダ合計		3 104 896.93	1.28
ノルウェー			
NOK DNB BANK ASA NOK12.50	10 171.00	167 468.20	0.07
NOK MOWI ASA NOK7.50	14 201.00	241 373.95	0.10
NOK NORSK HYDRO ASA NOK3.6666	33 876.00	231 625.69	0.09
ノルウェー合計		640 467.84	0.26
スペイン			
EUR BCO DE SABADELL EURO.125	222 876.00	220 379.79	0.09
EUR GREENERGY RENEWABLE EURO.35	5 522.00	154 726.44	0.06
EUR IBERDROLA SA EURO.75 (POST SUBDIVISION)	51 784.00	594 739.24	0.25
スペイン合計		969 845.47	0.40
スウェーデン			
SEK KARNOV GROUP AB NPV	27 528.00	132 191.12	0.05
スウェーデン合計		132 191.12	0.05
スイス			
CHF ALCON AG CHF0.04	6 206.00	404 551.66	0.17
CHF NESTLE SA CHF0.10(REGD)	9 132.00	1 025 517.03	0.42
CHF NOVARTIS AG CHF0.50(REGD)	15 396.00	1 299 279.26	0.54
CHF ROCHE HLDGS AG GENUSSSCHEINE NPV	654.00	171 946.36	0.07
スイス合計		2 901 294.31	1.20

銘柄	数量 / 額面	ユーロ建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
イギリス			
GBP ASHTEAD GROUP ORD GBP0.10	6 824.00	385 045.77	0.16
GBP ASTRAZENECA ORD USD0.25	8 983.00	1 148 273.41	0.47
GBP BRIT AMER TOBACCO ORD GBP0.25	12 217.00	394 935.51	0.16
GBP BT GROUP ORD GBP0.05	155 875.00	258 643.05	0.11
GBP HALEON PLC ORD GBP1.25	176 204.00	645 711.39	0.27
GBP HSBC HLDGS ORD USD0.50(UK REG)	49 260.00	308 167.59	0.13
USD LIVANOVA PLC ORD GBP1.00 (DI)	4 000.00	160 449.17	0.07
GBP LONDON STOCK EXCH ORD GBP0.06918604	9 802.00	877 699.53	0.36
GBP OCADO GROUP PLC ORD GBP0.02	27 744.00	168 923.34	0.07
GBP PRUDENTIAL ORD GBP0.05	16 673.00	209 103.91	0.09
EUR RELX PLC GBP0.1444	12 626.00	376 128.54	0.15
GBP SAGE GROUP GBP0.01051948	25 966.00	229 020.08	0.09
GBP SPECTRIS ORD GBP0.05	14 682.00	611 384.53	0.25
EUR UNILEVER PLC ORD GBP0.031111	400.00	19 040.00	0.01
EUR UNILEVER PLC ORD GBP0.031111	8 182.00	390 199.58	0.16
イギリス合計		6 182 725.40	2.55

アメリカ合衆国

USD ABBOTT LABS COM	3 561.00	331 894.57	0.14
USD ABBVIE INC COM USD0.01	17 376.00	2 548 863.84	1.05
USD ADOBE INC COM USD0.0001	571.00	202 536.95	0.08
USD ADVANCED MICRO DEV COM USD0.01	8 747.00	789 077.70	0.33
USD AGCO CORP COM USD0.01	1 636.00	203 587.10	0.08
USD ALLSTATE CORP COM	4 533.00	462 333.04	0.19
USD ALPHABET INC CAP STK USD0.001 CL A	11 881.00	1 134 351.45	0.47
USD AMAZON COM INC COM USD0.01	22 247.00	2 115 046.83	0.87
USD AMER EXPRESS CO COM USD0.20	1 685.00	255 824.70	0.11
USD AMERIPRISE FINL INC COM	5 644.00	1 592 237.10	0.66
USD APA CORPORATION COM USD0.625	27 201.00	902 819.33	0.37
USD APPLE INC COM NPV	14 289.00	2 168 766.26	0.89
USD AVANTOR INC COM USD0.01	10 148.00	197 458.44	0.08
USD BIO RAD LABS INC CL A	2 502.00	1 103 141.46	0.45
USD BJS WHSL CLUB HLDG COM USD0.01	4 895.00	342 733.35	0.14
USD BROADCOM CORP COM USD1.00	1 089.00	643 045.75	0.26
USD BRUNSWICK CORP COM	8 376.00	632 180.04	0.26
USD BUNGE LIMITED COM USD0.01	16 952.00	1 490 409.17	0.61
USD CADENCE DESIGN SYS COM USD0.01	2 907.00	562 135.05	0.23
USD CF INDS HLDGS INC COM	4 987.00	332 742.08	0.14
USD CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC CL A	152.00	238 998.65	0.10
USD COMCAST CORP COM CLS 'A' USD0.01	34 823.00	1 215 094.97	0.50
USD CONSTELLATION BRDS CLASS 'A' COM USD0.01	1 622.00	337 239.25	0.14
USD COOPER COS INC COM USD0.10	1 057.00	363 239.47	0.15
USD CROWN CASTLE INTL COM USD0.01	2 213.00	272 619.93	0.11
USD DEXCOM INC COM	2 702.00	288 939.54	0.12
USD DOLLAR TREE INC	8 378.00	1 106 964.80	0.46
USD ELI LILLY AND CO COM NPV	4 207.00	1 329 806.19	0.55
USD EOG RESOURCES INC COM USD0.01	2 458.00	259 340.55	0.11
USD ESTEE LAUDER COS CLASS 'A' COM USD0.01	863.00	195 770.61	0.08
USD EXPEDIA GROUP INC COM USD0.001	3 861.00	344 822.89	0.14
USD EXXON MOBIL CORP COM NPV	2 587.00	261 116.87	0.11
USD FIDELITY NATL INF COM STK USD0.01	7 554.00	377 752.15	0.16
USD HESS CORPORATION COM USD1	5 150.00	627 319.25	0.26
USD HONEYWELL INTL INC COM USD1	1 764.00	310 309.43	0.13
USD HUBSPOT INC COM USD0.001	733.00	289 266.65	0.12
USD IAC/INTERACTIVECOR COM USD0.0001	4 918.00	233 576.14	0.10
USD INGERSOLL RAND INC COM USD1.00	32 378.00	1 733 859.86	0.72
USD IQVIA HOLDINGS INC COM USD0.01	2 077.00	380 224.15	0.16
USD LAB CORP AMER HLDG COM USD0.1	3 572.00	754 280.68	0.31
USD LAS VEGAS SANDS CORP COM	24 795.00	1 311 125.91	0.54

銘柄	数量 / 額面	ユーロ建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注 1)	純資産 比率 (%)
USD LOWE 'S COS INC COM USD0.50	2 328.00	428 487.42	0.18
USD LYFT INC COM USD0.00001 CLASS A	9 840.00	83 958.58	0.03
USD MARAVAI LIFESCIENC USD0.01 A	7 550.00	97 358.83	0.04
USD MARSH & MCLENNAN COM USD1	6 300.00	965 773.85	0.40
USD MARTIN MARIETTA M. COM USD0.01	424.00	138 566.38	0.06
USD MASTERCARD INC COM USD0.0001 CLASS 'A'	4 210.00	1 408 215.84	0.58
USD MCDONALD 'S CORP COM USD0.01	1 280.00	329 422.25	0.14
USD MICRON TECHNOLOGY COM USD0.10	13 516.00	750 660.81	0.31
USD MICROSOFT CORP COM USD0.0000125	14 558.00	3 863 105.90	1.59
USD MONDELEZ INTL INC COM USD0.01	24 461.00	1 569 718.74	0.65
USD MONSTER BEV CORP USD0.005(NEW)	5 966.00	296 583.98	0.12
USD MSA SAFETY INC COM NPV	2 047.00	251 529.75	0.10
USD MSCI INC COM STK USS0.01	503.00	259 122.90	0.11
USD NETFLIX INC COM USD0.001	3 261.00	1 036 964.68	0.43
USD NEXTERA ENERGY INC COM USD0.01	11 554.00	819 717.72	0.34
USD NIKE INC CLASS 'B' COM NPV	3 665.00	413 710.34	0.17
USD NVIDIA CORP COM USD0.001	4 118.00	1 052 838.93	0.43
USD ON SEMICONDUCTOR COM USD0.01	4 389.00	332 553.25	0.14
USD ORACLE CORP COM USD0.01	6 240.00	533 683.83	0.22
USD PALO ALTO NETWORKS COM USD0.0001	2 545.00	467 889.27	0.19
USD PEPSICO INC CAP USD0.016666	1 975.00	331 393.53	0.14
USD PROLOGIS INC COM USD0.01	8 361.00	960 193.26	0.40
USD REGAL BELOIT CORP. COM USD0.01	7 875.00	1 020 064.20	0.42
USD SALESFORCE.COM INC COM USD0.001	5 430.00	998 486.26	0.41
USD SERVICENOW INC COM USD0.001	1 064.00	455 117.20	0.19
USD SHOALS TECHNOLOGIE COM USD0.00001 CLASS A	8 933.00	187 383.75	0.08
USD SLM CORP COM USD0.20	66 812.00	761 931.69	0.31
USD SNAP INC COM USD0.00001 CL A	27 549.00	284 250.81	0.12
USD SPIRIT AEROSYSTEMS COM STK USD0.01 CLASS 'A'	20 658.00	656 561.03	0.27
USD SPLUNK INC COM USD0.001	6 412.00	565 863.65	0.23
USD TAKE TWO INTERACTI COM USD0.01	11 394.00	1 251 142.90	0.52
USD TESLA INC COM USD0.001	2 735.00	522 254.22	0.22
USD TJX COS INC COM USD1	12 486.00	900 550.38	0.37
USD TRANSDIGM GROUP INC COM	795.00	539 329.70	0.22
USD TWILIO INC COM USD0.001 CL A	2 972.00	182 267.35	0.07
USD UNION PACIFIC CORP COM USD2.50	1 996.00	369 750.07	0.15
USD UNITED RENTALS INC COM	1 137.00	414 173.80	0.17
USD UNITEDHEALTH GRP COM USD0.01	3 383.00	1 471 555.96	0.61
USD VERISK ANALYTICS I CL A USD0.001	1 691.00	298 619.60	0.12
USD VERTEX PHARMACEUTI COM USD0.01	3 675.00	1 065 748.31	0.44
USD VMWARE INC COM STK USD0.01 CLASS 'A'	6 542.00	751 777.53	0.31
USD VOYA FINL INC COM USD0.01	14 778.00	972 005.96	0.40
USD WAYFAIR INC COM USD0.001 A	1 952.00	61 697.89	0.03
USD WELLS FARGO & CO COM USD1 2/3	37 270.00	1 282 297.94	0.53
USD WILLIAMS COS INC COM USD1	52 348.00	1 438 732.83	0.59
USD WORLD WRESTLING ENTMT INC CL A	6 373.00	535 321.44	0.22
USD ZEBRA TECHNOLOGIES CORP CL A	868.00	254 060.47	0.10
アメリカ合衆国合計		63 875 247.13	26.35
株式合計		96 198 287.19	39.69
商品証券			
イギリス			
USD UBS AG LONDON/ETC UBS BLBG INDUSTRIAL METAL TOT RET 07-PRP	2 108.00	2 442 792.58	1.01
USD UBS AG LONDON/ETC UBS BLOOMBERG CMC1 ENERGY INDEX 08-PRP	2 783.00	2 468 056.97	1.02
USD UBS AG/LONDON/CMAGTR USD 16-PRP	24 316.00	3 925 653.64	1.62
イギリス合計		8 836 503.19	3.65
商品証券合計		8 836 503.19	3.65

銘柄	数量 / 額面	ユーロ建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 3.12500% 22-27.04.32	1 000 000.00	878 312.74	0.36
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.25000% 19-18.06.29	2 500 000.00	2 114 869.53	0.87
USD INTERNATIONAL BANK FOR REC & DEV 2.50000% 22-29.03.32	2 900 000.00	2 434 332.06	1.01
USD INTERNATIONAL BK FOR RECONST& DEVELOP 1.62500% 21-03.11.31	4 000 000.00	3 136 470.60	1.29
USD INTERNATIONAL DVPT ASSOCIATION-REG-S 1.00000% 20-03.12.30	2 500 000.00	1 875 304.30	0.77
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 1.75000% 19-23.10.29	2 250 000.00	1 835 667.37	0.76
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 3.62500% 22-21.09.29	2 650 000.00	2 427 107.65	1.00
米ドル合計		14 702 064.25	6.06
ノート、固定利付債合計		14 702 064.25	6.06

ミディアム・ターム・ノート、固定利付債			
米ドル			
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.37500% 17-10.08.27	450 000.00	391 105.97	0.16
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.75000% 18-19.01.28	250 000.00	220 402.22	0.09
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.75000% 19-19.09.29	2 000 000.00	1 635 151.96	0.67
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.87500% 20-24.01.30	2 000 000.00	1 636 043.77	0.68
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.50000% 21-04.03.31	2 300 000.00	1 806 139.87	0.75
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.87500% 22-15.03.29	2 000 000.00	1 660 567.06	0.69
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 3.87500% 22-28.09.32	1 300 000.00	1 213 638.72	0.50
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 4.00000% 23-12.01.33	1 150 000.00	1 083 312.24	0.45
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 1.12500% 21-13.01.31	2 650 000.00	2 019 950.96	0.83
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 3.50000% 22-14.09.29	2 700 000.00	2 453 894.80	1.01
USD INTERNATIONAL BK FOR RECONSTR & DEVE 1.37500% 21-20.04.28	4 450 000.00	3 658 226.56	1.51
米ドル合計		17 778 434.13	7.34
ミディアム・ターム・ノート、固定利付債合計		17 778 434.13	7.34

ボンド、固定利付債			
米ドル			
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.62500% 20-16.09.27	650 000.00	521 797.05	0.22
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 1.12500% 21-20.07.28	5 000 000.00	4 025 128.08	1.66
USD INTL BK FOR RECONS & DEV WORLD BK 3.87500% 23-14.02.30	750 000.00	696 202.26	0.29
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.87500% 20-14.05.30	3 500 000.00	2 650 422.22	1.09
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.75000% 20-26.08.30	2 500 000.00	1 861 175.06	0.77
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 1.25000% 21-10.02.31	4 700 000.00	3 620 415.04	1.49
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 1.12500% 21-13.09.28	4 750 000.00	3 813 669.08	1.57
米ドル合計		17 188 808.79	7.09
ボンド、固定利付債合計		17 188 808.79	7.09

公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある証券および短期金融商品合計	154 704 097.55	63.83
-------------------------------------	----------------	-------

他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券および短期金融商品

財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 19.05.22-18.05.23	14 800 000.00	13 542 657.28	5.59
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 16.06.22-15.06.23	5 000 000.00	4 558 831.88	1.88
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 14.07.22-13.07.23	6 000 000.00	5 450 096.98	2.25
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 11.08.22-10.08.23	5 500 000.00	4 977 281.92	2.05
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 08.12.22-08.06.23	5 000 000.00	4 563 681.21	1.88

銘柄	数量 / 額面	ユーロ建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 22.12.22-22.06.23	11 000 000.00	10 021 249.17	4.14
米ドル合計		43 113 798.44	17.79
財務省証券 (T-bill)、ゼロ・クーポン合計		43 113 798.44	17.79
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券および短期金融商品合計		43 113 798.44	17.79
ルクセンブルグ2010年12月17日法 (改訂済) の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs			
商品証書			
アイルランド			
USD ISHARES PHYSICAL GOLD ETC 11-PRP	305 106.00	10 819 615.65	4.46
アイルランド合計		10 819 615.65	4.46
商品証書合計		10 819 615.65	4.46
投資信託、オープン・エンド型			
ルクセンブルグ			
USD UBS (LUX) BOND SICAV - ASIAN HIGH YIELD U-X-ACC	688.00	5 090 313.44	2.10
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - GL HI DIV (USD)-I-X-ACC	40 810.00	9 651 736.85	3.98
EUR UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - EUR SUSTAINABLE U-X-ACC	1.00	10 174.40	0.01
ルクセンブルグ合計		14 752 224.69	6.09
投資信託、オープン・エンド型合計		14 752 224.69	6.09
ルクセンブルグ2010年12月17日法 (改訂済) の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs合計		25 571 840.34	10.55
投資有価証券合計		223 389 736.33	92.17

金融派生商品

公認の証券取引所に上場されている金融派生商品

債券関連金融先物			
EUR EURO BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 08.06.23	134.00	522 600.00	0.21
EUR EURO-BUND FUTURE 08.06.23	-108.00	-516 240.00	-0.21
AUD AUSTRALIA 10YR BOND FUTURE 15.06.23	188.00	336 010.22	0.14
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.06.23	-463.00	-1 391 674.15	-0.57
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.06.23	217.00	455 641.28	0.19
CAD CAN 10YR BOND FUTURE 21.06.23	271.00	939 982.13	0.38
債券関連金融先物合計		346 319.48	0.14
指数関連金融先物			
USD MSCI CHINA FUTURE 16.06.23	262.00	384 276.31	0.16
EUR EURO STOXX BANKS PRICE INDEX FUTURE 16.06.23	894.00	-134 994.00	-0.06
EUR EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 16.06.23	-15.00	-39 000.00	-0.02
CHF SWISS MARKET INDEX FUTURE 16.06.23	-29.00	-134 988.85	-0.06
GBP FTSE 100 INDEX FUTURE 16.06.23	21.00	20 672.94	0.01
SEK OMX 30 INDEX FUTURE 21.04.23	-111.00	-64 699.11	-0.03
USD MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 16.06.23	410.00	782 346.17	0.33
USD S&P500 EMINI FUTURE 16.06.23	-152.00	-1 731 326.80	-0.70
AUD SPI 200 INDEX FUTURES 15.06.23	13.00	29 851.94	0.01

銘柄	数量 / 額面	ユーロ建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
JPY TOPIX INDX FUTURE 08.06.23	26.00	-13 485.88	-0.01
USD E-MINI RUSSEL 1000 INDEX FUTURE 16.06.23	35.00	97 772.56	0.04
USD RUSSELL 2000 E-MINI INDEX FUTURE 16.06.23	163.00	407 552.12	0.17
CAD S&P/TSX 60 IX FUTURE 15.06.23	10.00	25 449.77	0.01
HKD HANG SENG CHINA ENTERPRISES INDEX FUTURE 27.04.23	67.00	126 873.43	0.05
指数関連金融先物合計		-243 699.40	-0.10
公認の証券取引所に上場されている金融派生商品合計			
		102 620.08	0.04
公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引されていない金融派生商品			
指数スワップおよび指数先渡スワップ			
USD JPM/JPMORGAN EMERGING MARKETS TR EQS PAYER 3ML 22- 15.05.23	-27 400 000.00	-220 655.75	-0.09
USD JPM/JPMORGAN EMERGING MARKETS TR EQS REC PERF 23-15.05.23			
指数スワップおよび指数先渡スワップ合計		-220 655.75	-0.09
クレジット・デフォルト・スワップ*			
USD ICE/MARKIT CDX.NA.IG.S40 V1 CDI REC 1.00000% 23-20.06.28	9 850 000.00	105 298.16	0.04
クレジット・デフォルト・スワップ合計		105 298.16	0.04
公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引されていない金融派生商品合計			
		-115 357.59	-0.05
金融派生商品合計		-12 737.51	-0.01

銘柄		数量 / 額面		ユーロ建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 （注１）		純資産 比率 （％）	
先渡為替契約							
購入通貨 / 購入金額 / 売却通貨 / 売却金額 / 満期日							
USD	11 704 448.36	PHP	643 850 000.00	20.4.2023	-138 963.67	-0.06	
TWD	27 400 000.00	USD	913 028.99	20.4.2023	-12 994.20	-0.01	
USD	518 505.99	KRW	644 000 000.00	20.4.2023	22 151.23	0.01	
USD	4 152 246.57	CNY	27 955 000.00	20.4.2023	68 245.67	0.03	
BRL	50 800 000.00	USD	9 589 791.03	20.4.2023	368 904.58	0.15	
USD	1 206 563.25	CLP	1 011 100 000.00	20.4.2023	-64 492.83	-0.03	
EUR	200 508 471.58	USD	219 085 000.00	20.4.2023	-941 453.25	-0.39	
USD	5 436 793.50	EUR	5 000 000.00	20.4.2023	-836.93	0.00	
EUR	1 447 249.58	HKD	12 260 000.00	20.4.2023	9 751.97	0.00	
JPY	2 396 600 000.00	EUR	17 336 622.80	20.4.2023	-731 297.72	-0.30	
EUR	16 622 979.15	GBP	14 795 000.00	20.4.2023	-204 057.46	-0.08	
EUR	986 733.00	SEK	11 130 000.00	20.4.2023	-1 217.38	0.00	
AUD	13 925 000.00	EUR	8 927 472.38	20.4.2023	-346 362.60	-0.14	
EUR	5 300 739.57	NZD	9 040 000.00	20.4.2023	99 901.17	0.04	
NOK	70 250 000.00	EUR	6 546 829.16	20.4.2023	-373 921.57	-0.15	
EUR	2 613 986.21	DKK	19 430 000.00	20.4.2023	5 245.55	0.00	
EUR	115 535.76	PLN	550 000.00	20.4.2023	-1 727.20	0.00	
MXN	210 840 000.00	EUR	10 139 336.04	20.4.2023	559 785.93	0.23	
EUR	1 258 864.71	CAD	1 835 000.00	20.4.2023	11 788.66	0.01	
CNH	3 875 000.00	EUR	531 834.22	20.4.2023	-12 250.60	-0.01	
EUR	4 897 847.33	CHF	4 890 000.00	20.4.2023	-33 559.07	-0.01	
JPY	712 687 877.00	GBP	4 590 000.00	20.4.2023	-282 585.47	-0.12	
USD	5 104 117.05	CNH	34 230 000.00	20.4.2023	103 458.08	0.04	
USD	2 210 906.47	TWD	66 300 000.00	20.4.2023	32 996.23	0.01	
EUR	2 012 181.14	USD	2 190 000.00	20.4.2023	-1 536.53	0.00	
PHP	643 850 000.00	USD	11 749 087.59	20.4.2023	98 026.40	0.04	
MXN	52 250 000.00	USD	2 708 176.49	20.4.2023	161 432.19	0.07	
USD	2 690 455.96	BRL	14 250 000.00	20.4.2023	-103 393.73	-0.04	
EUR	2 729 461.94	USD	2 990 000.00	20.4.2023	-19 860.36	-0.01	
USD	8 218 767.30	NZD	12 955 000.00	20.4.2023	104 111.32	0.04	
USD	8 080 000.00	KRW	10 461 984 000.00	20.4.2023	43 729.20	0.02	
USD	3 115 000.00	EUR	2 934 395.86	20.4.2023	-70 135.34	-0.03	
GBP	1 139 714.84	MXN	25 530 000.00	20.4.2023	726.87	0.00	
EUR	562 518.71	CAD	815 000.00	20.4.2023	8 640.25	0.00	
USD	5 245 000.00	KRW	6 909 369 625.00	20.4.2023	-55 143.35	-0.02	
USD	2 620 312.48	AUD	3 955 000.00	20.4.2023	-27 836.84	-0.01	
CAD	37 428 100.00	EUR	25 450 184.46	18.4.2023	-9 593.63	0.00	
GBP	19 063 800.00	EUR	21 585 788.56	18.4.2023	99 459.31	0.04	
EUR	531 467.51	CAD	774 700.00	18.4.2023	4 889.20	0.00	
EUR	71 021.18	GBP	62 200.00	18.4.2023	268.11	0.00	
USD	605 019.20	EUR	570 000.00	20.4.2023	-13 681.35	-0.01	
USD	1 000 000.00	EUR	939 309.87	20.4.2023	-19 804.09	-0.01	
CNH	10 500 000.00	EUR	1 436 308.34	20.4.2023	-28 404.35	-0.01	
GBP	6 280 000.00	NOK	81 657 870.37	20.4.2023	-32 794.24	-0.01	
USD	6 040 000.00	EUR	5 623 977.51	20.4.2023	-70 162.57	-0.03	
USD	2 574 380.89	AUD	3 870 000.00	20.4.2023	-17 687.39	-0.01	
EUR	9 550 000.00	USD	10 322 338.11	20.4.2023	58 550.40	0.02	
USD	5 140 000.00	MXN	94 796 449.46	20.4.2023	-84 597.15	-0.02	
GBP	2 105 000.00	USD	2 587 453.79	20.4.2023	14 949.72	0.01	
CHF	615 000.00	EUR	618 503.26	20.4.2023	1 704.29	0.00	
先渡為替契約合計					-1 821 634.54	-0.75	
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産					20 404 387.97 **	8.42	
その他の資産および負債					404 391.70	0.17	
純資産総額					242 364 143.95	100.00	

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

** 2023年3月31日現在、当該現金額は取引の相手方のために担保に供されており、ゴールドマン・サックスについては50,000.00ユーロ、HSBC銀行については13,806.43ユーロおよびJ.P. モルガンについては107,690.18ユーロである。

注記は当財務書類の一部である。

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

2023年3月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
----	------------	--	------------------

公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある証券および短期金融商品

財務省証券 (T-bill)、ゼロ・クーポン

米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 03.11.22-02.11.23	2 600 000.00	2 530 887.81	5.10
米ドル合計		2 530 887.81	5.10

財務省証券 (T-bill)、ゼロ・クーポン合計		2 530 887.81	5.10
--------------------------	--	--------------	------

ノート、固定利付債

ユーロ			
EUR GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 3.37500% 20-27.03.25	45 000.00	48 526.89	0.10
ユーロ合計		48 526.89	0.10

米ドル			
USD AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP 1.65000% 21-29.10.24	300 000.00	280 631.47	0.57
USD AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC 2.05000% 20-15.05.30	40 000.00	34 510.48	0.07
USD ALBEMARLE CORPORATION 5.45000% 14-01.12.44	50 000.00	47 276.67	0.09
USD ALTRIA GROUP INC 4.40000% 19-14.02.26	19 000.00	18 851.17	0.04
USD AMGEN INC 5.15000% 23-02.03.28	65 000.00	66 366.38	0.13
USD AMGEN INC 5.25000% 23-02.03.25	80 000.00	80 879.70	0.16
USD APACHE CORP 4.25000% 12-15.01.44	80 000.00	58 309.08	0.12
USD APT PIPELINES LTD-REG-S 4.20000% 15-23.03.25	30 000.00	29 297.14	0.06
USD APTIV PLC 2.39600% 22-18.02.25	75 000.00	71 441.62	0.14
USD ASTRAZENECA PLC 3.50000% 18-17.08.23	50 000.00	49 676.49	0.10
USD AT&T INC 4.35000% 19-01.03.29	80 000.00	78 323.86	0.16
USD BANK OF ENGLAND-REG-S 0.50000% 20-28.04.23	60 000.00	59 824.68	0.12
USD BANK OF NOVA SCOTIA 5.25000% 22-06.12.24	55 000.00	55 126.48	0.11
USD BAT CAPITAL CORP 3.55700% 18-15.08.27	40 000.00	37 185.26	0.07
USD BAXTER INTERNATIONAL INC 2.60000% 16-15.08.26	50 000.00	46 642.34	0.09
USD CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 3.30000% 22-07.04.25	70 000.00	67 779.97	0.14
USD CANADIAN PACIFIC RAILWAY 1.35000% 21-02.12.24	90 000.00	84 796.20	0.17
USD CELANESE US HOLDINGS LLC 6.05000% 22-15.03.25	65 000.00	65 373.08	0.13
USD CELANESE US HOLDINGS LLC 6.16500% 22-15.07.27	55 000.00	55 313.73	0.11
USD CELANESE US HOLDINGS LLC 5.90000% 22-05.07.24	50 000.00	50 018.88	0.10
USD CITIGROUP INC-SUB 4.60000% 16-09.03.26	30 000.00	29 375.22	0.06
USD COMCAST CORP 3.95000% 18-15.10.25	50 000.00	49 436.64	0.10
USD COSTCO WHOLESALE CORP 1.60000% 20-20.04.30	15 000.00	12 733.84	0.03
USD CVS HEALTH CORP 2.62500% 19-15.08.24	45 000.00	43 623.64	0.09
USD EQT CORP 3.90000% 17-01.10.27	30 000.00	28 197.60	0.06
USD EVERSOURCE ENERGY 2.90000% 22-01.03.27	100 000.00	93 272.36	0.19
USD EXELON CORP 3.40000% 16-15.04.26	25 000.00	24 021.03	0.05
USD FISERV INC 3.20000% 19-01.07.26	40 000.00	37 966.26	0.08
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO 4.35000% 18-09.04.25	105 000.00	102 809.22	0.21
USD GEORGIA POWER CO 2.10000% 20-30.07.23	35 000.00	34 615.73	0.07
USD GILEAD SCIENCES INC 2.50000% 16-01.09.23	30 000.00	29 658.14	0.06
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.50000% 20-01.04.25	130 000.00	126 230.40	0.25
USD ILLINOIS TOOL WORKS INC 2.65000% 16-15.11.26	70 000.00	66 434.05	0.13
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 3.62500% 16-01.12.27	75 000.00	71 692.42	0.14
USD MASTERCARD INC 2.00000% 19-03.03.25	30 000.00	28 698.75	0.06
USD NIKE INC 2.40000% 20-27.03.25	40 000.00	38 704.50	0.08
USD NISOURCE INC 5.25000% 23-30.03.28	10 000.00	10 172.41	0.02
USD ORACLE CORP 2.50000% 20-01.04.25	35 000.00	33 513.27	0.07
USD ORACLE CORP 4.50000% 23-06.05.28	40 000.00	39 518.63	0.08

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 1.12500% 20-01.05.23	100 000.00	99 690.91	0.20
USD QUANTA SERVICES INC 0.95000% 21-01.10.24	85 000.00	79 278.46	0.16
USD SOUTHERN CO 3.25000% 16-01.07.26	50 000.00	47 674.10	0.10
USD TENNESSEE VALLEY AUTHORITY 0.75000% 20-15.05.25	70 000.00	64 802.13	0.13
USD THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 1.21500% 21-18.10.24	35 000.00	33 220.29	0.07
USD UNITED TECHNOLOGIES CORP 3.95000% 18-16.08.25	40 000.00	39 536.75	0.08
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.37600% 18-15.02.25	36 000.00	35 261.47	0.07
USD VIACOMCBS INC 4.75000% 20-15.05.25	42 000.00	41 481.63	0.08
USD VIRGINIA ELECTRIC & POWER CO 3.80000% 18-01.04.28	30 000.00	29 062.94	0.06
USD VISA INC 1.90000% 20-15.04.27	35 000.00	32 193.77	0.06
USD WARNERMEDIA HOLDINGS INC 6.41200% 23-15.03.26	135 000.00	135 681.58	0.27
USD WILLIAMS COS INC/THE 4.30000% 14-04.03.24	65 000.00	64 332.49	0.13
USD WPP FINANCE 2010 3.75000% 14-19.09.24	30 000.00	29 281.23	0.06
USD XCEL ENERGY INC 4.00000% 18-15.06.28	40 000.00	38 866.42	0.08
USD XL GROUP LTD 5.25000% 13-15.12.43	25 000.00	25 529.25	0.05
米ドル合計		3 034 192.21	6.11
ノート、固定利付債合計		3 082 719.10	6.21
ノート、変動利付債			
英ポンド			
GBP M&G PLC-REG-S-SUB 3.875%/VAR 19-20.07.49	100 000.00	119 514.76	0.24
英ポンド合計		119 514.76	0.24
米ドル			
USD ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 5.625%/VAR 14-PRP	185 000.00	178 344.75	0.36
USD NATWEST GROUP PLC 4.519%/VAR 18-25.06.24	200 000.00	199 031.98	0.40
USD SANTANDER HOLDINGS USA INC 6.499%/VAR 23-09.03.29	50 000.00	49 953.90	0.10
米ドル合計		427 330.63	0.86
ノート、変動利付債合計		546 845.39	1.10
ミディアム・ターム・ノート、固定利付債			
豪ドル			
AUD AURIZON NETWORK PTY LTD-REG-S 4.00000% 17-21.06.24	30 000.00	19 967.73	0.04
AUD AUSGRID FINANCE PTY LTD-REG-S 3.75000% 17-30.10.24	50 000.00	33 220.94	0.07
AUD CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 4.50000% 15-05.06.25	45 000.00	29 782.51	0.06
豪ドル合計		82 971.18	0.17
ユーロ			
EUR BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC-REG-S 0.87500% 15-13.10.23	200 000.00	214 028.47	0.43
EUR CANAL DE ISABEL II GESTION SA-REG-S 1.68000% 15-26.02.25	100 000.00	104 505.70	0.21
EUR CREDIT AGRICOLE SA LONDON 1.25000% 16-14.04.26	100 000.00	101 509.41	0.20
EUR CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 3.39000% 22-05.12.25	195 000.00	207 725.25	0.42
EUR CTP NV-REG-S 0.87500% 22-20.01.26	100 000.00	90 510.63	0.18
EUR EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FAC-REG-S 0.50000% 17-11.07.25	190 000.00	194 906.95	0.39
EUR EUROPEAN STABILITY MECHANISM-REG-S 0.12500% 16-22.04.24	130 000.00	136 805.31	0.28
EUR EUROPEAN UNION-REG-S 3.00000% 11-04.09.26	50 000.00	54 385.51	0.11
EUR GLOBALWORTH REAL ESTATE INVEST-REG-S 3.00000% 18-29.03.25	100 000.00	93 862.49	0.19
EUR GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 0.25000% 21-26.01.28	75 000.00	67 894.71	0.14
EUR KBC GROUP NV-REG-S 1.12500% 19-25.01.24	100 000.00	106 447.33	0.21
EUR PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 3.75000% 17-21.02.24	100 000.00	106 594.33	0.22
EUR REDEXIS GAS FINANCE BV-REG-S 1.87500% 15-27.04.27	100 000.00	100 052.70	0.20
EUR REN FINANCE B V-REG-S 2.50000% 15-12.02.25	100 000.00	107 257.44	0.22
EUR ROMANIA-REG-S 2.75000% 20-26.02.26	140 000.00	142 862.74	0.29
ユーロ合計		1 829 348.97	3.69

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注 1)	純資産 比率 (%)
英ポンド			
GBP ANGLIAN WATER SERVICES FINANCING-REG-S 4.50000% 13-22.02.26	100 000.00	122 578.05	0.25
GBP ASIAN DEVELOPMENT BANK-REG-S 4.37500% 23-11.06.26	100 000.00	123 497.35	0.25
GBP LLOYDS BANKING GROUP PLC 2.25000% 17-16.10.24	100 000.00	117 490.44	0.23
GBP MEXICO, UNITED STATES 6.75000% 04-06.02.24	40 000.00	49 878.39	0.10
英ポンド合計		413 444.23	0.83
米ドル			
USD BANK OF AMERICA CORP 3.87500% 15-01.08.25	120 000.00	117 284.65	0.23
USD KOREA WATER RESOURCES CORP-REG-S 3.87500% 18-15.05.23	400 000.00	399 524.00	0.80
USD MORGAN STANLEY 4.00000% 15-23.07.25	130 000.00	127 249.08	0.26
USD MORGAN STANLEY-SUB 4.35000% 14-08.09.26	30 000.00	29 221.67	0.06
USD WALT DISNEY CO/THE 1.85000% 16-30.07.26	20 000.00	18 463.85	0.04
米ドル合計		691 743.25	1.39
ミディアム・ターム・ノート、固定利付債合計		3 017 507.63	6.08
ミディアム・ターム・ノート、ゼロ・クーポン			
ユーロ			
EUR POLAND, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 20-10.02.25	170 000.00	171 802.38	0.35
ユーロ合計		171 802.38	0.35
ミディアム・ターム・ノート、ゼロ・クーポン合計		171 802.38	0.35
ミディアム・ターム・ノート、変動利付債			
ユーロ			
EUR AXA SA-REG-S-SUB 3.250%/VAR 18-28.05.49	100 000.00	96 813.99	0.20
EUR COMMONWEALTH BK OF AUSTRLIA-REG-S-SUB 1.936%/VAR 17-03.10.29	100 000.00	103 657.11	0.21
EUR IBERDROLA INTERNATIONAL BV-REG-S-SUB 2.625%/VAR 18-PRP	100 000.00	106 403.65	0.21
EUR TOTAL SE-REG-S-SUB 2.625%/VAR 15-PRP	100 000.00	102 569.93	0.21
ユーロ合計		409 444.68	0.83
英ポンド			
GBP CYBG PLC-REG-S 3.375%/VAR 18-24.04.26	100 000.00	114 445.07	0.23
英ポンド合計		114 445.07	0.23
ミディアム・ターム・ノート、変動利付債合計		523 889.75	1.06
ボンド、固定利付債			
豪ドル			
AUD AUSTRALIA-REG-S 2.25000% 16-21.05.28	700 000.00	451 084.66	0.91
AUD AUSTRALIA-REG-S 2.75000% 16-21.11.27	310 000.00	205 174.63	0.41
豪ドル合計		656 259.29	1.32
カナダドル			
CAD CANADA HOUSING TRUST-144A 2.35000% 13-15.09.23	180 000.00	131 734.04	0.26
CAD CANADA, GOVERNMENT 1.50000% 19-01.09.24	1 250 000.00	892 882.48	1.80
CAD CANADA, GOVERNMENT 3.75000% 22-01.02.25	200 000.00	147 795.18	0.30
カナダドル合計		1 172 411.70	2.36
ユーロ			
EUR AUTOSTRADE PER L ' ITALIA SPA REG-S 2.00000% 21-15.01.30	100 000.00	90 357.01	0.18
EUR BNZ INTERNATIONAL FUND LTD/LONDON 0.50000% 17-03.07.24	200 000.00	208 972.57	0.42
EUR CAISSE D ' AMORTIS DE LA DETTE SOC-REG-S 1.37500% 14-25.11.24	200 000.00	211 029.87	0.43
EUR FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 1.75000% 13-25.05.23	260 000.00	282 002.44	0.57
EUR IRELAND, REPUBLIC OF-REG-S 1.00000% 16-15.05.26	880 000.00	908 798.04	1.83
EUR JAPAN BANK FOR INTL COOPERATION 3.12500% 23-15.02.28	100 000.00	107 482.30	0.22

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR LG CHEM LTD-REG-S 0.50000% 19-15.04.23	100 000.00	108 405.98	0.22
EUR NETHERLANDS, KINGDOM OF THE-144A-REG-S 1.75000% 13-15.07.23	260 000.00	281 551.60	0.57
EUR RESA SA/BELGIUM-REG-S 1.00000% 16-22.07.26	100 000.00	99 373.23	0.20
EUR SPAIN, KINGDOM OF-REG-S 1.60000% 15-30.04.25	330 000.00	349 308.58	0.70
EUR TAURON POLSKA ENERGIA SA-REG-S 2.37500% 17-05.07.27	100 000.00	89 177.17	0.18
EUR TRANSPORT ET INFRASTRUCTURES GAZ-REG-S 2.20000% 15-05.08.25	100 000.00	105 642.06	0.21
EUR VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FIN NV-REG-S 1.12500% 17-02.10.23	100 000.00	107 383.42	0.22
EUR VVO-YHTYMA OYJ-REG-S 1.62500% 16-17.10.23	100 000.00	106 557.15	0.21
ユーロ合計		3 056 041.42	6.16
英ポンド			
GBP UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 0.75000% 17-22.07.23	240 000.00	293 834.17	0.59
英ポンド合計		293 834.17	0.59
日本円			
JPY JAPAN 0.10000% 18-20.03.28	46 000 000.00	345 613.50	0.70
日本円合計		345 613.50	0.70
ニュージーランド・ドル			
NZD NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 0.50000% 21-15.05.26	870 000.00	482 791.52	0.97
NZD NEW ZEALAND-REG-S 5.50000% 11-15.04.23	300 000.00	187 664.97	0.38
ニュージーランド・ドル合計		670 456.49	1.35
米ドル			
USD BNG BANK NV-REG-S 0.75000% 20-17.04.23	200 000.00	199 692.03	0.40
USD CITIGROUP INC 3.87500% 13-25.10.23	190 000.00	188 415.98	0.38
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 8.12500% 04-21.05.24	50 000.00	51 353.12	0.10
USD CONSUMERS ENERGY CO 4.65000% 23-01.03.28	130 000.00	130 967.90	0.27
USD ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC 3.90000% 14-15.02.24	30 000.00	29 640.97	0.06
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 3.87500% 23-15.03.28	80 000.00	80 636.80	0.16
USD JAPAN BANK FOR INTL COOPERATION 0.62500% 20-22.05.23	400 000.00	397 607.64	0.80
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 3.75000% 23-15.02.28	40 000.00	40 033.18	0.08
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-REG-S 5.50000% 17-31.07.47	200 000.00	152 760.00	0.31
USD NATL RURAL UTIL COOPERATIVE FIN CORP 3.70000% 19-15.03.29	25 000.00	23 748.91	0.05
USD REYNOLDS AMERICAN INC 4.45000% 15-12.06.25	40 000.00	39 277.40	0.08
USD SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 3.70000% 18-01.08.25	35 000.00	34 105.27	0.07
米ドル合計		1 368 239.20	2.76
債券、固定利付債合計		7 562 855.77	15.24
債券、ゼロ・クーポン債			
ユーロ			
EUR FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.00000% 19-25.03.25	480 000.00	493 601.18	0.99
EUR GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 20-11.04.25	1 740 000.00	1 791 901.71	3.61
EUR GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 21-16.06.23	280 000.00	302 521.92	0.61
ユーロ合計		2 588 024.81	5.21
債券、ゼロ・クーポン債合計		2 588 024.81	5.21
債券、変動利付債			
ユーロ			
EUR SWISS LIFE AG VIA DEMETER INV BV-SUB 4.375%/VAR 15-PRP	100 000.00	104 116.68	0.21
EUR UNIBAIL-RODAMCO SE-REG-S-SUB 2.875%/VAR 18-PRP	100 000.00	83 113.43	0.17
ユーロ合計		187 230.11	0.38
日本円			
JPY JAPAN GOVT 0.100%/CPI LINKED 18-10.03.28	52 000 000.00	427 736.87	0.86
日本円合計		427 736.87	0.86

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注 1)	純資産 比率 (%)
米ドル			
USD SCOR SE-REG-S-SUB 5.250%/VAR 18-PRP	200 000.00	145 000.00	0.29
米ドル合計		145 000.00	0.29
ボンド、変動利付債合計		759 966.98	1.53
財務省証券 (T-note)、固定利付債			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.62500% 16-30.04.23	560 000.00	558 701.63	1.12
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.37500% 16-30.09.23	570 000.00	560 782.03	1.13
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.75000% 13-15.11.23	250 000.00	246 865.24	0.50
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.37500% 30.04.20-30.04.25	1 010 000.00	936 775.00	1.88
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.25000% 20-31.05.25	1 850 000.00	1 707 058.60	3.44
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.25000% 20-15.06.23	300 000.00	297 354.44	0.60
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 22-29.02.24	290 000.00	281 877.74	0.57
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.87500% 22-28.02.27	840 000.00	783 792.19	1.58
米ドル合計		5 373 206.87	10.82
財務省証券 (T-note)、固定利付債合計		5 373 206.87	10.82
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある証券および短期金融商品合計		26 157 706.49	52.70
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券および短期金融商品			
財務省証券 (T-bill)、ゼロ・クーポン			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 21.04.22-20.04.23	2 600 000.00	2 594 293.91	5.22
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 19.05.22-18.05.23	2 000 000.00	1 988 300.00	4.00
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 16.06.22-15.06.23	2 400 000.00	2 377 412.59	4.79
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 11.08.22-10.08.23	2 200 000.00	2 163 027.17	4.36
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 08.09.22-07.09.23	2 000 000.00	1 959 180.00	3.95
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 22.12.22-22.06.23	2 200 000.00	2 177 517.23	4.39
米ドル合計		13 259 730.90	26.71
財務省証券 (T-bill)、ゼロ・クーポン合計		13 259 730.90	26.71
ノート、固定利付債			
カナダドル			
CAD TELUS CORP 3.75000% 14-17.01.25	15 000.00	10 872.33	0.02
カナダドル合計		10 872.33	0.02
米ドル			
USD AKER BP ASA-144A 3.00000% 20-15.01.25	150 000.00	144 484.85	0.29
USD BANK OF MONTREAL 5.20000% 23-12.12.24	160 000.00	160 201.10	0.32
USD BROADCOM INC 3.15000% 20-15.11.25	45 000.00	43 055.45	0.09
USD CHEVRON PHILLIPS CHEMICAL CO LLC-144A 3.30000% 18-01.05.23	225 000.00	224 698.14	0.45
USD CHEVRON PHILLIPS CHEMICAL CO LLC-144A 5.12500% 20-01.04.25	40 000.00	40 238.96	0.08
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 5.30000% 21-01.10.29	85 000.00	85 641.06	0.17
USD KINDER MORGAN INC-144A 5.62500% 13-15.11.23	50 000.00	49 953.45	0.10
USD LIBERTY MUTUAL GROUP INC-144A 4.56900% 19-01.02.29	50 000.00	48 148.08	0.10
USD MAGALLANES INC-144A 3.75500% 22-15.03.27	75 000.00	70 629.62	0.14
USD MPLX LP 4.25000% 20-01.12.27	50 000.00	48 415.82	0.10
USD ONCOR ELECTRIC DELIVERY CO 3.70000% 19-15.11.28	20 000.00	19 360.76	0.04
USD UNITD AIRLNS 2016-1 CL B PAS THROUGH TRT 3.65000% 17-07.01.26	50 000.00	26 654.08	0.06
米ドル合計		961 481.37	1.94
ノート、固定利付債合計		972 353.70	1.96

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
ボンド、変動利付債			
ニュージーランド・ドル			
NZD NEW ZEALAND 3.000%/CPI LINKED 13-20.09.30	680 000.00	570 402.85	1.15
ニュージーランド・ドル合計		570 402.85	1.15
ボンド、変動利付債合計		570 402.85	1.15
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券および短期金融商品合計		14 802 487.45	29.82
ルクセンブルグ2010年12月17日法(改訂済)の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs			
投資信託、オープン・エンド型			
アイルランド			
USD ISHARES EDGE MSCI WORLD VALUE FACTOR-ETF-ACCUM	68 840.00	2 477 895.80	4.99
アイルランド合計		2 477 895.80	4.99
投資信託、オープン・エンド型合計		2 477 895.80	4.99
ルクセンブルグ2010年12月17日法(改訂済)の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs合計		2 477 895.80	4.99
投資有価証券合計		43 438 089.74	87.51
金融派生商品			
公認の証券取引所に上場されている金融派生商品			
債券関連金融先物			
EUR EURO-BOBL FUTURE 08.06.23	-2.00	-6 018.93	-0.01
GBP LONG GILT FUTURE 28.06.23	-4.00	-11 869.92	-0.02
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 21.06.23	-5.00	-19 765.63	-0.04
AUD AUSTRALIA 10YR BOND FUTURE 15.06.23	12.00	23 301.59	0.05
USD US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 21.06.23	-1.00	-5 710.94	-0.01
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.06.23	-9.00	-29 390.63	-0.06
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.06.23	18.00	37 968.77	0.07
CAD CAN 10YR BOND FUTURE 21.06.23	10.00	37 684.26	0.07
債券関連金融先物合計		26 198.57	0.05
指数関連金融先物			
USD MSCI WORLD S.C FUTURE 16.06.23	31.00	45 973.00	0.09
USD MSCI WORLD NR INDEX FUTURE 16.06.23	-23.00	-85 560.00	-0.17
EUR EURO STOXX BANKS PRICE INDEX FUTURE 16.06.23	255.00	-41 833.76	-0.08
EUR STOXX 600 OIL & GAS FUTURE 16.06.23	79.00	-33 044.38	-0.07
EUR EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 16.06.23	-78.00	-159 952.60	-0.32
EUR STOXX EUROPE 600 INDEX FUTURE 16.06.23	68.00	48 759.88	0.10
CHF SWISS MARKET INDEX FUTURE 16.06.23	2.00	10 136.28	0.02
GBP FTSE 100 INDEX FUTURE 16.06.23	20.00	21 390.59	0.04
EUR FTSE/MIB IDX FUTURE 16.06.23	12.00	42 436.74	0.09
USD MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 16.06.23	69.00	143 045.00	0.29
USD S&P500 EMINI FUTURE 16.06.23	2.00	24 700.00	0.05
AUD SPI 200 INDEX FUTURES 15.06.23	2.00	4 989.64	0.01
JPY TOPIX INDX FUTURE 08.06.23	6.00	-3 381.17	-0.01
CAD S&P/TSX 60 IX FUTURE 15.06.23	2.00	5 529.98	0.01
指数関連金融先物合計		23 189.20	0.05
公認の証券取引所に上場されている金融派生商品合計		49 387.77	0.10

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引されていない金融派生商品			
クレジット・デフォルト・スワップ*			
EUR ICE/IITRX EUR XOVER S39 V1 CDI REC 5.00000% 23-20.06.28	520 000.00	15 694.80	0.03
USD ICE/MARKIT CDX.EM.3 CDI REC 1.00000% 23-20.06.28	2 700 000.00	-154 711.80	-0.31
USD ICE/MARKIT CDX.NA.H CDI REC 5.00000% 23-20.06.28	1 500 000.00	24 853.00	0.05
クレジット・デフォルト・スワップ合計		-114 164.00	-0.23
公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引され ていない金融派生商品合計			
		-114 164.00	-0.23
金融派生商品合計			
		-64 776.23	-0.13

先渡為替契約

購入通貨 / 購入金額 / 売却通貨 / 売却金額 / 満期日

USD	464 647.70	INR	38 050 000.00	13.4.2023	1 817.67	0.00
USD	521 004.00	TWD	15 900 000.00	13.4.2023	-113.22	0.00
USD	411 917.95	KRW	536 000 000.00	13.4.2023	565.20	0.00
BRL	14 880 000.00	USD	2 852 159.25	13.4.2023	77 783.32	0.16
CLP	565 100 000.00	USD	703 683.41	13.4.2023	10 412.17	0.02
COP	14 325 369 000.00	USD	3 005 610.12	13.4.2023	62 909.24	0.13
USD	5 612 110.32	NZD	9 185 000.00	13.4.2023	-134 722.54	-0.27
USD	5 677 146.63	GBP	4 735 000.00	13.4.2023	-178 772.61	-0.36
NOK	59 670 000.00	USD	5 598 649.88	13.4.2023	101 710.97	0.20
JPY	800 400 000.00	USD	5 874 037.99	13.4.2023	150 010.89	0.30
USD	283 572.87	AUD	430 000.00	13.4.2023	-4 533.91	-0.01
USD	4 866 320.09	CAD	6 730 000.00	13.4.2023	-107 297.47	-0.22
USD	4 069 389.43	CNH	28 240 000.00	13.4.2023	-46 445.58	-0.09
CHF	21 447 600.00	USD	23 153 903.79	13.4.2023	351 070.23	0.71
EUR	1 552 600.00	USD	1 647 750.78	13.4.2023	40 095.93	0.08
USD	12 284 421.33	EUR	11 575 000.00	13.4.2023	-298 874.86	-0.60
USD	1 470 000.00	KRW	1 917 171 060.00	13.4.2023	-1 331.32	0.00
IDR	22 666 135 800.00	USD	1 470 000.00	13.4.2023	45 869.11	0.09
USD	382 028.82	JPY	50 400 000.00	13.4.2023	2 703.40	0.01
USD	19 214.59	EUR	17 800.00	13.4.2023	-135.96	0.00
EUR	1 360 000.00	USD	1 466 240.07	13.4.2023	12 229.29	0.02
先渡為替契約合計					84 949.95	0.17
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産					6 796 715.74**	13.69
当座借越およびその他の短期負債					-839 887.28	-1.69
その他の資産および負債					220 707.01	0.45
純資産総額					49 635 798.93	100.00

* 額面が正：サブ・ファンドは「プロテクションの受取側」、額面が負：サブ・ファンドは「プロテクションの支払側」

** 2023年3月31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、モルガン・スタンレー、ロンドン支店については118,000.00米ドルである。

注記は当財務書類の一部である。

U B S (Lux)キー・セレクション・シキャブ - デジタル・トランスフォーメーション・テーマ（米ドル）

2023年3月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （%）
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある証券および短期金融商品			
株式			
カナダ			
USD LULULEMON ATHLETIC COM STK USD0.01	13 847.00	5 042 938.93	1.63
カナダ合計		5 042 938.93	1.63
中国			
HKD ALIBABA GROUP HLDG USD1	79 300.00	1 014 238.31	0.33
HKD JD.COM INC USD0.00002	178 774.00	3 917 111.32	1.26
HKD MEITUAN USD0.00001 (A & B CLASS)	14 880.00	272 011.92	0.09
USD PINDUODUO INC-4 SHS-A-ADR	38 773.00	2 942 870.70	0.95
HKD TENCENT HLDGS LIM1 HKD0.00002	142 100.00	6 983 761.68	2.26
中国合計		15 129 993.93	4.89
アイルランド			
USD ACCENTURE PLC SHS CL A 'NEW'	18 139.00	5 184 307.59	1.68
アイルランド合計		5 184 307.59	1.68
日本			
JPY ソニーグループ	66 600.00	5 997 452.83	1.94
日本合計		5 997 452.83	1.94
オランダ			
EUR ADYEN NV EURO.01	3 043.00	4 824 213.48	1.56
EUR ASML HOLDING NV EURO.09	10 804.00	7 338 601.23	2.37
オランダ合計		12 162 814.71	3.93
韓国			
KRW SK HYNIX INC KRW5000	67 231.00	4 575 540.18	1.48
韓国合計		4 575 540.18	1.48
スイス			
USD TE CONNECTIVITY LT COM CHF0.57	27 294.00	3 579 608.10	1.16
スイス合計		3 579 608.10	1.16
台湾			
TWD MEDIATEK INC TWD10	129 000.00	3 334 362.43	1.08
USD TAIWAN SEMICON MAN ADS REP 5 ORD TWD10	70 600.00	6 567 212.00	2.12
台湾合計		9 901 574.43	3.20
アメリカ合衆国			
USD ADVANCED MICRO DEV COM USD0.01	86 486.00	8 476 492.86	2.74
USD AIRBNB INC USD0.0001 A	803.00	99 893.20	0.03
USD ALLSTATE CORP COM	28 155.00	3 119 855.55	1.01
USD ALPHABET INC CAP STK USD0.001 CL A	88 136.00	9 142 347.28	2.96
USD AMAZON COM INC COM USD0.01	89 157.00	9 209 026.53	2.98
USD ANALOG DEVICES INC COM	32 106.00	6 331 945.32	2.05
USD APPLE INC COM NPV	51 616.00	8 511 478.40	2.75
USD APPLIED MATLS INC COM	31 232.00	3 836 226.56	1.24
USD ARISTA NETWORKS IN COM USD0.0001	40 207.00	6 749 147.02	2.18
USD BROADCOM CORP COM USD1.00	9 748.00	6 253 731.92	2.02
USD CADENCE DESIGN SYS COM USD0.01	17 780.00	3 735 400.20	1.21
USD CBOE GLOBAL MARKET COM USD0.01	47 158.00	6 330 489.92	2.05
USD CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC CL A	1 692.00	2 890 426.68	0.94

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD DEXCOM INC COM	42 749.00	4 966 578.82	1.61
USD DYNATRACE INC COM USD0.001	76 735.00	3 245 890.50	1.05
USD EPAM SYS INC COM USD0.001	4 995.00	1 493 505.00	0.48
USD EXPEDIA GROUP INC COM USD0.001	32 584.00	3 161 625.52	1.02
USD FORTINET INC COM USD0.001	59 195.00	3 934 099.70	1.27
USD HUBSPOT INC COM USD0.001	16 300.00	6 988 625.00	2.26
USD INTUITIVE SURGICAL COM USD0.001	22 274.00	5 690 338.78	1.84
USD IQVIA HOLDINGS INC COM USD0.01	28 183.00	5 605 316.87	1.81
USD JP MORGAN CHASE & COM USD1	59 656.00	7 773 773.36	2.51
USD LAM RESEARCH CORP COM USD0.001	5 234.00	2 774 648.08	0.90
USD MARVELL TECHNOLOGY COM USD0.002	152 980.00	6 624 034.00	2.14
USD MASTERCARD INC COM USD0.0001 CLASS 'A'	23 802.00	8 649 884.82	2.80
USD MCDONALD'S CORP COM USD0.01	21 777.00	6 089 066.97	1.97
USD MICRON TECHNOLOGY COM USD0.10	23 347.00	1 408 757.98	0.46
USD MICROSOFT CORP COM USD0.0000125	54 550.00	15 726 765.00	5.08
USD MONGODB INC COM USD0.001 CL A	11 035.00	2 572 479.20	0.83
USD NIKE INC CLASS 'B' COM NPV	50 290.00	6 167 565.60	1.99
USD NVIDIA CORP COM USD0.001	21 572.00	5 992 054.44	1.94
USD ORACLE CORP COM USD0.01	81 946.00	7 614 422.32	2.46
USD PALO ALTO NETWORKS COM USD0.0001	29 906.00	5 973 424.44	1.93
USD PROGRESSIVE CP(OH) COM USD1	23 351.00	3 340 594.06	1.08
USD RIVIAN AUTOMOTIVE COM USD0.001 CL A	30 330.00	469 508.40	0.15
USD S&P GLOBAL INC COM USD1	16 252.00	5 603 202.04	1.81
USD SALESFORCE.COM INC COM USD0.001	29 338.00	5 861 145.64	1.90
USD SERVICENOW INC COM USD0.001	6 443.00	2 994 190.96	0.97
USD SNOWFLAKE INC COM USD0.0001 CLASS A	23 242.00	3 586 008.18	1.16
USD TAKE TWO INTERACTI COM USD0.01	41 810.00	4 987 933.00	1.61
USD THE TRADE DESK INC COM USD0.000001 CL A	55 635.00	3 388 727.85	1.10
USD THERMO FISHER SCIE COM USD1	7 912.00	4 560 239.44	1.47
USD TRANSUNION COM USD0.01	41 035.00	2 549 914.90	0.82
USD UNIVERSAL DISPLAY COM USD0.01	31 588.00	4 900 246.44	1.58
USD VISA INC COM STK USD0.0001	22 145.00	4 992 811.70	1.61
USD WALT DISNEY CO. DISNEY COM USD0.01	41 967.00	4 202 155.71	1.36
USD WOLFSPEED INC COM USD0.00125	25 195.00	1 636 415.25	0.53
アメリカ合衆国合計		240 212 411.41	77.66
株式合計		301 786 642.11	97.57
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある証券および短期金融商品合計		301 786 642.11	97.57
投資有価証券合計		301 786 642.11	97.57

銘柄

数量 / 米ドル建評価額 純資産
額面 先物 / 先渡為替契約 / 比率
スワップに係る (%)
未実現 (損) 益
(注 1)

先渡為替契約

購入通貨 / 購入金額 / 売却通貨 / 売却金額 / 満期日

GBP	9 733 800.00	USD	11 679 710.24	13.4.2023	358 377.76	0.12
EUR	12 510 300.00	USD	13 266 047.22	13.4.2023	334 022.79	0.11
CHF	31 330 800.00	USD	33 823 380.18	13.4.2023	512 845.78	0.16
USD	593 912.02	GBP	487 100.00	13.4.2023	-8 499.44	0.00
USD	1 718 228.03	CHF	1 557 600.00	13.4.2023	11 214.31	0.00
USD	677 551.18	EUR	629 400.00	13.4.2023	-6 675.74	0.00
USD	115 005.63	EUR	107 900.00	13.4.2023	-2 293.52	0.00
USD	561 056.32	GBP	461 700.00	13.4.2023	-9 942.18	0.00
CHF	1 079 500.00	USD	1 169 248.09	13.4.2023	13 803.60	0.00
EUR	421 800.00	USD	452 756.32	13.4.2023	5 786.60	0.00
GBP	334 600.00	USD	410 518.00	13.4.2023	3 292.05	0.00
USD	82 796.42	EUR	76 700.00	13.4.2023	-584.90	0.00
USD	315 633.67	GBP	257 800.00	13.4.2023	-3 195.47	0.00
USD	37 470.05	EUR	34 600.00	13.4.2023	-143.95	0.00
USD	42 510.30	EUR	39 200.00	13.4.2023	-104.41	0.00
先渡為替契約合計					1 207 903.28	0.39

現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産

6 016 193.58 1.95

その他の資産および負債

301 859.82 0.09

純資産総額

309 312 598.79 100.00

注記は当財務書類の一部である。

U B S (L u x) キー・セクション・シキャブ - グローバル・エクイティーズ (米ドル)

2023年3月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
株式			
デンマーク			
DKK GENMAB AS DKK1	2 813.00	1 062 175.15	1.94
デンマーク合計		1 062 175.15	1.94
フランス			
EUR MICHELIN (CGDE) EURO.50 (POST SUBDIVISION)	22 636.00	692 166.67	1.26
フランス合計		692 166.67	1.26
ドイツ			
EUR KNORR BREMSE AG NPV	14 056.00	935 815.53	1.71
ドイツ合計		935 815.53	1.71
アイスランド			
EUR MAREL HF ISK1	110 458.00	451 226.67	0.82
アイスランド合計		451 226.67	0.82
インド			
INR HDFC BANK INR1	84 704.00	1 658 933.75	3.03
インド合計		1 658 933.75	3.03
アイルランド			
EUR AIB GROUP PLC ORD EURO.625	398 725.00	1 621 014.85	2.96
USD APTIV PLC COM USD0.01	8 879.00	996 135.01	1.82
アイルランド合計		2 617 149.86	4.78
イタリア			
HKD PRADA SPA EURO.1	127 000.00	900 330.57	1.64
イタリア合計		900 330.57	1.64
日本			
JPY J T O W E R	17 800.00	655 346.01	1.20
JPY キーエンス	3 000.00	1 452 776.31	2.65
JPY ソフトバンクグループ	23 800.00	926 678.18	1.69
JPY ソニーグループ	18 600.00	1 674 964.30	3.06
日本合計		4 709 764.80	8.60
オランダ			
EUR HEINEKEN HOLDING EUR1.6	13 289.00	1 220 718.87	2.23
EUR KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20	53 050.00	970 362.60	1.77
EUR OCI N.V. EURO.02	18 726.00	635 980.41	1.16
オランダ合計		2 827 061.88	5.16
スイス			
CHF ALCON AG CHF0.04	18 537.00	1 312 838.82	2.39
GBP WIZZ AIR HLDGS PLC ORD GBP0.0001	28 120.00	1 033 681.60	1.89
スイス合計		2 346 520.42	4.28

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
イギリス			
GBP ASHTEAD GROUP ORD GBP0.10	18 317.00	1 122 890.55	2.05
GBP BRIT AMER TOBACCO ORD GBP0.25	25 972.00	912 172.02	1.66
GBP HALEON PLC ORD GBP1.25	321 572.00	1 280 296.79	2.34
USD LIVANOVA PLC ORD GBP1.00 (DI)	10 800.00	470 664.00	0.86
GBP LONDON STOCK EXCH ORD GBP0.06918604	13 420.00	1 305 549.75	2.38
GBP SPECTRIS ORD GBP0.05	40 209.00	1 819 123.74	3.32
EUR UNILEVER PLC ORD GBP0.031111	350.00	18 100.26	0.03
EUR UNILEVER PLC ORD GBP0.031111	27 023.00	1 400 137.31	2.56
イギリス合計		8 328 934.42	15.20
アメリカ合衆国			
USD ADOBE INC COM USD0.0001	5 385.00	2 075 217.45	3.79
USD ADVANCED MICRO DEV COM USD0.01	8 802.00	862 684.02	1.57
USD ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC COM	2 209.00	442 506.88	0.81
USD AMAZON COM INC COM USD0.01	18 294.00	1 889 587.26	3.45
USD AMERIPRISE FINL INC COM	5 647.00	1 730 805.50	3.16
USD ARISTA NETWORKS IN COM USD0.0001	6 115.00	1 026 463.90	1.87
USD CALIFORNIA RESOURC COM USD0.01	20 359.00	783 821.50	1.43
USD COMCAST CORP COM CLS 'A' USD0.01	56 093.00	2 126 485.63	3.88
USD FIDELITY NATL INF COM STK USD0.01	18 492.00	1 004 670.36	1.83
USD HESS CORPORATION COM USD1	14 912.00	1 973 454.08	3.60
USD INGERSOLL RAND INC COM USD1.00	35 317.00	2 054 743.06	3.75
USD LAB CORP AMER HLDG COM USD0.1	5 074.00	1 164 077.08	2.13
USD LIFE STORAGE INC COM USD0.01	6 624.00	868 340.16	1.59
USD MICRON TECHNOLOGY COM USD0.10	22 130.00	1 335 324.20	2.44
USD MONDELEZ INTL INC COM USD0.01	11 922.00	831 201.84	1.52
USD ON SEMICONDUCTOR COM USD0.01	18 134.00	1 492 790.88	2.72
USD SNAP INC COM USD0.00001 CL A	18 467.00	207 015.07	0.38
USD TAKE TWO INTERACTI COM USD0.01	8 544.00	1 019 299.20	1.86
USD VERTEX PHARMACEUTI COM USD0.01	4 651.00	1 465 390.57	2.67
USD VMWARE INC COM STK USD0.01 CLASS 'A'	11 552.00	1 442 267.20	2.63
USD WELLS FARGO & CO COM USD1 2/3	29 851.00	1 115 830.38	2.04
アメリカ合衆国合計		26 911 976.22	49.12
株式合計		53 442 055.94	97.54
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある証券および短期金融商品合計			
		53 442 055.94	97.54
ルクセンブルグ2010年12月17日法 (改訂済) の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs			
投資信託、オープン・エンド型			
ルクセンブルグ			
USD UBS-ETF MSCI WORLD-A	2 100.00	581 700.00	1.06
ルクセンブルグ合計		581 700.00	1.06
投資信託、オープン・エンド型合計		581 700.00	1.06
ルクセンブルグ2010年12月17日法 (改訂済) の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs合計			
		581 700.00	1.06
投資有価証券合計		54 023 755.94	98.60
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産			
		459 369.93	0.84
その他の資産および負債			
		307 522.13	0.56
純資産総額		54 790 648.00	100.00

注記は当財務書類の一部である。

[次へ](#)

5 販売及び買戻しの実績

2022年5月1日から2023年4月末日までの1年間における販売および買戻しの実績ならびに2023年4月末日現在の発行済口数は以下のとおりである。

		販売口数	買戻し口数	発行済口数
グローバル・ アロケーション(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	127,091.354 (0)	1,773,729.818 (0)	13,292,134.401 (666,220.000)
	円建クラス P - a c c 投資証券	10,602.000 (0)	10,752.694 (0)	1,133.000 (1,133.000)
グローバル・ アロケーション(ユーロ)	クラスP - a c c 投資証券	238,248.546 (0)	2,274,073.166 (0)	11,395,843.597 (0)
ダイナミック・アルファ (米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	1,406.707 (0)	5,738.316 (0)	26,321.215 (0)
	ユーロ・ヘッジクラス P - a c c 投資証券	2,746.716 (0)	342.920 (0)	7,038.144 (0)
デジタル・トランス フォーメーション・ テーマ(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	8,651.835 (11,098.170)	59,635.005 (32,953.830)	301,135.261 (226,471.607)
グローバル・ エクイティーズ(米ドル)	ユーロ建クラス P - a c c 投資証券	7,946.381 (0)	49,084.998 (0)	606,448.743 (6,931.468)

(注)()内の数字は本邦内における販売、買戻しおよび発行済口数であり、受渡し日を基準として算出している。一方、()の上段の数字は約定日を基準として算出している。