

【表紙】

【提出書類】 半期報告書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2024年2月29日

【計算期間】 第31期中 (自 2023年6月1日 至 2023年11月30日)

【発行者名】 UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ
(UBS (Lux) Strategy 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

【縦覧に供する場所】 該当事項なし

(注1) 米ドルの円貨換算は、便宜上、2023年12月29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＝141.83円) による。以下、別段の記載がない限り、米ドルの円換算表示はすべてこれによるものとする。

(注2) ファンドは、ルクセンブルグ法に基づいて設立されているが、投資証券は米ドル建てまたは円建てのため、以下の金額表示は別段の記載がない限り米ドルまたは円貨をもって行う。

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

(注4) 本書の中で計算期間 (以下「会計年度」ともいう。) とは、別段の記載がない限り6月1日に始まり翌年5月31日に終わる1年を指す。

1 【外国投資法人の概況】

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ・ダイナミック・インカム (米ドル) / フィクスト・インカム・サステナブル (米ドル) / インカム・サステナブル (米ドル) / システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ (米ドル) / システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・メディアム (米ドル) / システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル) (以下、UBS (Lux) ストラテジー・シキャブを「本投資法人」、UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ・ダイナミック・インカム (米ドル) / フィクスト・インカム・サステナブル (米ドル) / インカム・サステナブル (米ドル) / システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ (米ドル) / システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・メディアム (米ドル) / システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル) をそれぞれ「ファンド」または「サブ・ファンド」という。) の概況は以下のとおりである。

(注) ファンドにはクラスP-a c c投資証券、クラスP-m d i s t投資証券およびクラス(日本円・ヘッジ) P-a c c投資証券以外の投資証券も存在する。クラス(日本円・ヘッジ)を含めたP-a c c投資証券およびクラスP-m d i s t投資証券以外の投資証券は日本で販売されていないため、以下、「投資証券」というときは、上記のクラスP-a c c投資証券、クラスP-m d i s t投資証券およびクラス(日本円・ヘッジ) 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】

(ダイナミック・インカム (米ドル))

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	2021年11月末日 に終了する 中間会計年度末	2022年5月末日 に終了する 会計年度末	2022年11月末日 に終了する 中間会計年度末	2023年5月末日 に終了する 会計年度末	2023年11月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	-16,009,716.89	-62,405,768.72	-25,197,117.22	-12,413,525.18	19,411,176.14
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	-16,009,716.89	-62,405,768.72	-25,197,117.22	-12,413,525.18	19,411,176.14
(c) 当期純利益金額また は当期純損失金額	-16,009,716.89	-62,405,768.72	-25,197,117.22	-12,413,525.18	19,411,176.14
(d) 出資総額 ⁽²⁾	638,706,690.39	565,718,810.87	481,816,696.11	467,641,801.58	444,974,093.19
(e) 発行済投資口総数 (クラスP-m d i s t投資証券)	2,668,103.481口	2,662,604.315口	2,490,873.932口	2,509,889.582口	2,329,746.744口
(e) 発行済投資口総数 (クラスP-a c c投資証券)	626,504.082口	568,304.287口	467,607.967口	393,581.104口	364,808.068口
(f) 純資産額	638,706,690.39	565,718,810.87	481,816,696.11	467,641,801.58	444,974,093.19
(g) 資産総額	651,377,333.60	577,538,650.52	486,705,898.23	470,926,413.00	447,809,840.69
(h) 1口当たり純資産価格 (クラスP-m d i s t投資証券)	103.90	93.56	86.97	85.71	86.76
(h) 1口当たり純資産価格 (クラスP-a c c投資証券)	119.96	110.99	106.52	109.16	113.66
(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-m d i s t投資証券)	-2.35	-10.04	-4.47	-2.33	3.64
(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)	-2.71	-12.39	-6.16	-4.13	4.62
(j) 分配総額	14,378,384.65	27,963,032.26	13,674,580.92	29,668,122.23	11,044,849.61
(k) 1口当たり分配金額 (クラスP-m d i s t投資証券)	2.94	5.60	2.76	6.16	2.44
(k) 1口当たり分配金額 (クラスP-a c c投資証券)	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	98.05%	97.95%	99.00%	99.30%	99.37%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾ (クラスP-m d i s t投資証券)	6.67%	-8.91%	-11.08%	-1.81%	6.47%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾ (クラスP-a c c投資証券)	6.62%	-9.27%	-11.20%	-1.65%	6.70%

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

(2) ファンドは変動資本を有する会社型投資信託であり、純資産総額を記載している。以下同じ。

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

(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。

(注1) 各取引に使用された1口当たりの純資産価格は、純資産価格の調整の結果、上記および財務書類に記載の価格と異なる場合がある(財務書類に対する注記1参照)。以下同じ。

(注2) ダイナミック・インカム(米ドル)は2019年1月28日に運用を開始した。

(フィクスト・インカム・サステナブル(米ドル))

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	2021年11月末日 に終了する 中間会計年度末	2022年5月末日 に終了する 会計年度末	2022年11月末日 に終了する 中間会計年度末	2023年5月末日 に終了する 会計年度末	2023年11月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	-1,529,295.67	-9,953,410.23	-3,596,447.96	-3,230,092.60	-1,406,506.35
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	-1,529,295.67	-9,953,410.23	-3,596,447.96	-3,230,092.60	-1,406,506.35
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	-1,529,295.67	-9,953,410.23	-3,596,447.96	-3,230,092.60	-1,406,506.35
(d) 出資総額 ⁽²⁾	88,778,631.73	69,508,472.76	61,043,934.50	64,923,534.47	54,957,250.21
(e) 発行済投資口総数 (クラスP-a c c投資証券) (クラス(日本円・ヘッジ) P-a c c投資証券)	222,369.939口 291,006.106口	187,402.006口 267,622.011口	159,732.545口 298,667.581口	154,723.784口 369,320.163口	122,039.304口 350,518.411口
(f) 純資産額	88,778,631.73	69,508,472.76	61,043,934.50	64,923,534.47	54,957,250.21
(g) 資産総額	88,832,101.35	71,254,439.77	61,843,716.12	65,284,307.92	55,361,001.65
(h) 1口当たり純資産価格 (クラスP-a c c投資証券) (クラス(日本円・ヘッジ) P-a c c投資証券)	256.18 10,383円	238.66 9,628円	230.94 9,154円	234.86 9,059円	238.03 8,917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) (クラス(日本円・ヘッジ) P-a c c投資証券)	-1.20 -4.28円	-20.14 -21.75円	-6.84 -7.90円	-3.05 -7.31円	1.88 -4.88円
(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	99.94%	97.55%	98.71%	99.45%	99.27%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾ (クラスP-a c c投資証券) (クラス(日本円・ヘッジ) P-a c c投資証券)	-1.12% -1.54%	-7.35% -7.87%	-9.85% -11.84%	-1.59% -5.91%	3.07% -2.59%

(注) フィクスト・インカム・サステナブル(米ドル)クラス(日本円・ヘッジ)P-a c c投資証券の初回純資産価格計算日は2015年6月3日であった。

(インカム・サステナブル (米ドル))

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	2021年11月末日 に終了する 中間会計年度末	2022年5月末日 に終了する 会計年度末	2022年11月末日 に終了する 中間会計年度末	2023年5月末日 に終了する 会計年度末	2023年11月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	37,266.98	−9,345,503.65	−3,229,233.37	−2,118,694.05	1,209,024.25
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	37,266.98	−9,345,503.65	−3,229,233.37	−2,118,694.05	1,209,024.25
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	37,266.98	−9,345,503.65	−3,229,233.37	−2,118,694.05	1,209,024.25
(d) 出資総額 ⁽²⁾	124,672,188.51	99,758,473.54	89,945,478.22	92,024,987.25	75,487,338.01
(e) 発行済投資口総数 (クラスP-a c c投資証券) (クラス(日本円・ヘッジ) P-a c c投資証券)	582,564.970口 —	547,628.333口 —	503,687.433口 —	492,951.819口 —	491,292.285口 —
(f) 純資産額	124,672,188.51	99,758,473.54	89,945,478.22	92,024,987.25	75,487,338.01
(g) 資産総額	124,748,596.17	102,332,531.75	90,403,671.94	92,368,410.51	78,069,304.12
(h) 1口当たり純資産価格 (クラスP-a c c投資証券) (クラス(日本円・ヘッジ) P-a c c投資証券)	128.08 —	117.40 —	113.53 —	114.88 —	116.57 —
(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) (クラス(日本円・ヘッジ) P-a c c投資証券)	−0.23 —	−11.51 —	−4.26 —	−3.03 —	1.71 —
(j) 分配総額	66,133.46	66,133.46	8,663.72	33,727.98	109,185.52
(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	99.94%	97.48%	99.49%	99.63%	96.69%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾ (クラスP-a c c投資証券) (クラス(日本円・ヘッジ) P-a c c投資証券)	2.51% —	−8.47% —	−11.36% —	−2.15% —	2.68% —

(注1) インカム・サステナブル (米ドル) は2014年1月28日に運用を開始し、クラス(日本円・ヘッジ) P-a c c投資証券の初回純資産価格計算日は2016年6月7日であった。

(注2) インカム・サステナブル (米ドル) のクラス(日本円・ヘッジ) P-a c c投資証券は、2018年12月21日付で募集を停止し、また、2019年2月19日付で買戻しの受付を停止している。以下同じ。

(システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ (米ドル))

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	2021年11月末日 に終了する 中間会計年度末	2022年5月末日 に終了する 会計年度末	2022年11月末日 に終了する 中間会計年度末	2023年5月末日 に終了する 会計年度末	2023年11月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	-17,261,428.76	-132,362,172.08	-47,526,655.27	-32,042,982.00	15,691,759.82
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	-17,261,428.76	-132,362,172.08	-47,526,655.27	-32,042,982.00	15,691,759.82
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	-17,261,428.76	-132,362,172.08	-47,526,655.27	-32,042,982.00	15,691,759.82
(d) 出資総額 ⁽²⁾	1,027,333,236.14	826,611,490.70	628,440,720.67	516,321,326.56	457,477,832.79
(e) 発行済投資口総数 (クラスP-a c c投資証券)	2,896,817.594口	2,768,662.523口	2,006,982.711口	1,335,171.059口	1,087,911.633口
(f) 純資産額	1,027,333,236.14	826,611,490.70	628,440,720.67	516,321,326.56	457,477,832.79
(g) 資産総額	1,030,577,156.59	834,717,145.04	635,205,701.79	523,722,777.31	459,362,398.29
(h) 1口当たり純資産価格 (クラスP-a c c投資証券)	118.78	107.06	102.10	103.61	105.86
(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)	1.30	-10.76	-6.52	-7.73	2.69
(j) 分配総額	2,374,193.13	4,495,433.80	1,657,279.14	3,068,358.58	1,268,088.19
(k) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	99.69%	99.03%	98.93%	98.59%	99.59%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾ (クラスP-a c c投資証券)	5.62%	-8.85%	-14.04%	-3.22%	3.68%

(注) システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ (米ドル) は2017年6月1日に運用を開始した。

(システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル))

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	2021年11月末日 に終了する 中間会計年度末	2022年5月末日 に終了する 会計年度末	2022年11月末日 に終了する 中間会計年度末	2023年5月末日 に終了する 会計年度末	2023年11月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	-2,410,627.04	-254,517,414.78	-102,366,701.49	-71,852,810.51	45,030,746.32
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	-2,410,627.04	-254,517,414.78	-102,366,701.49	-71,852,810.51	45,030,746.32
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	-2,410,627.04	-254,517,414.78	-102,366,701.49	-71,852,810.51	45,030,746.32
(d) 出資総額 ⁽²⁾	1,930,456,246.87	1,585,129,803.36	1,226,070,417.25	1,035,849,484.36	964,444,607.03
(e) 発行済投資口総数 (クラスP-a c c投資証券)	4,444,497.809口	4,333,907.950口	3,361,314.941口	2,526,594.071口	2,189,663.042口
(f) 純資産額	1,930,456,246.87	1,585,129,803.36	1,226,070,417.25	1,035,849,484.36	964,444,607.03
(g) 資産総額	1,943,208,365.03	1,611,074,677.90	1,242,648,990.27	1,057,338,298.42	969,911,044.76
(h) 1口当たり純資産価格 (クラスP-a c c投資証券)	126.76	111.79	105.82	107.68	111.44
(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)	2.97	-12.28	-7.53	-7.60	4.27
(j) 分配総額	4,434,240.50	8,092,069.87	2,626,065.74	4,839,588.49	1,914,063.19
(k) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	99.34%	98.39%	98.67%	97.97%	99.44%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾ (クラスP-a c c投資証券)	11.09%	-9.69%	-16.52%	-3.68%	5.31%

(注) システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル) は2017年6月1日に運用を開始した。

(システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル))

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	2021年11月末日 に終了する 中間会計年度末	2022年5月末日 に終了する 会計年度末	2022年11月末日 に終了する 中間会計年度末	2023年5月末日 に終了する 会計年度末	2023年11月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	4,818,732.96	-74,708,658.13	-28,107,444.15	-18,033,302.74	13,938,137.24
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	4,818,732.96	-74,708,658.13	-28,107,444.15	-18,033,302.74	13,938,137.24
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	4,818,732.96	-74,708,658.13	-28,107,444.15	-18,033,302.74	13,938,137.24
(d) 出資総額 ⁽²⁾	446,387,788.66	429,108,307.05	354,018,277.42	293,356,127.44	276,796,785.88
(e) 発行済投資口総数 (クラスP-a c c投資証券)	1,053,265.175口	1,353,350.137口	1,237,882.787口	830,170.843口	748,511.731口
(f) 純資産額	446,387,788.66	429,108,307.05	354,018,277.42	293,356,127.44	276,796,785.88
(g) 資産総額	449,518,385.80	437,807,170.32	358,311,864.30	296,558,457.04	277,857,913.69
(h) 1口当たり純資産価格 (クラスP-a c c投資証券)	134.10	115.33	108.90	111.21	115.46
(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)	4.90	-14.61	-6.98	-7.33	4.63
(j) 分配総額	390,645.25	832,422.33	339,000.17	650,234.40	287,438.58
(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	99.30%	98.01%	98.80%	98.92%	99.62%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾ (クラスP-a c c投資証券)	16.39%	-10.73%	-18.79%	-3.57%	6.02%

(注) システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル) は2017年6月1日に運用を開始した。

(2) 【外国投資法人の出資総額】

2023年12月末日現在の出資総額および発行済投資証券総数は以下のとおりである。

なお、原則として、発行可能投資口総口数には制限がない。

	出資総額		発行済投資証券総数(口)	
	米ドル	百万円		
ダイナミック・インカム(米ドル)	455,889,276.01	64,659	クラスP—m d i s t 投資証券	2,321,302.397
			クラスP—a c c 投資証券	364,808.068
フィクスト・インカム・サステナブル(米ドル)	57,003,162.30	8,085	クラスP—a c c 投資証券	121,259.267
			クラス(日本円・ヘッジ) P—a c c投資証券	350,518.411
インカム・サステナブル(米ドル)	77,455,006.32	10,985	クラスP—a c c 投資証券	485,723.361
			クラス(日本円・ヘッジ) P—a c c投資証券	—
システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)	463,841,064.73	65,787	クラスP—a c c 投資証券	1,061,436.661
システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)	985,501,488.50	139,774	クラスP—a c c 投資証券	2,121,206.387
システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)	285,952,359.66	40,557	クラスP—a c c 投資証券	741,871.558

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

(注) 本投資法人に従業員はいない。本投資法人の独立監査法人はプライスウォーターハウスクーパース・ソシエテ・コーペラ
ティブ (PricewaterhouseCoopers, Société coopérative) である。

(5) 【その他】

a. 定款の変更

本投資法人の定款は、投資主総会で補足またはその他に変更することができる。変更は、1915年8月10日法の規定における定足数および過半数に関する要件に従う。

b. 事業譲渡または事業譲受

投資法人およびそのサブ・ファンドの解散、サブ・ファンドの合併

本投資法人およびそのサブ・ファンドの解散

定足数および過半数に関する法律条件を満たす投資主総会は本投資法人を清算することができる。

本投資法人の純資産総額が所定の最低資本金の3分の2または4分の1以下になった場合、本投資法人の取締役会は、本投資法人を清算するか否かについて投資主総会の採決を求めなければならない。本投資法人が解散する場合、清算は投資主総会で指名された一名以上の清算人が実行する。投資主総会では清算人の職務の範囲を決定する。清算人は投資主の最善の利益にかなうように本投資法人の資産を売却して、サブ・ファンドの清算による正味収入を投資主の保有量に比例して当該サブ・ファンドまたは投資証券クラスの投資主に分配する。清算の完了時 (9か月かかる可能性がある) に投資主に分配できない清算収入は遅滞なくルクセンブルグの供託金庫 (Caisse de Consignation) に預託される。

定められた期間を満了したサブ・ファンドは、それぞれの期間の終了時に自動的に解散および清算される。

同一サブ・ファンド内で各サブ・ファンドまたは投資証券クラスの純資産総額が当該サブ・ファンドまたは投資証券クラスを経済的に合理的な管理のため要求される価額またはかかる価額に達しな

かった場合、または政治、経済もしくは金融の状況が著しく変化した場合または合理化の一環として、投資主総会または本投資法人の取締役は、該当する投資証券クラスのすべての投資証券を決定が効力を生じる評価日における純資産価格にて（投資対象の実際の換金率および経費を考慮して）買い戻すことを決定することができる。

下記「本投資法人の総会または関係するサブ・ファンドの投資主総会」の項の規定が投資主総会の決定のために適宜適用される。取締役会はまた、上記に記載される規定に従いサブ・ファンドまたは投資証券クラスを解散または清算できる。投資証券の買い戻しのための投資主総会または本投資法人の取締役会の決定は、有価証券報告書「第二部 外国投資法人の詳細情報 第3 管理及び運営、3 投資主・外国投資法人債権者の権利等（1）投資主・外国投資法人債権者の権利（f）報告書を受領する権利」の項に記載される通り関係するサブ・ファンドの投資主に通知する。

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

「合併」とは、以下の取引である。

- a) 一もしくは複数のUCITSまたは当該UCITSのサブ・ファンド、すなわち「吸収対象UCITS」が、清算なしのその解散に基づき、すべての資産および負債を別の既存のUCITSまたは当該UCITSのサブ・ファンド、すなわち「吸収UCITS」に移転し、吸収対象UCITSの投資主が見返りに吸収UCITSの投資証券および適宜、当該投資証券の純資産価格の10%を超えない支払額を受け取る取引。
- b) 二つ以上のUCITSまたは当該UCITSのサブ・ファンド、すなわち「吸収対象UCITS」が、清算なしのその解散に基づき、すべての資産および負債を設立した別のUCITSまたは当該UCITSが当該UCITSのサブ・ファンド、すなわち「吸収UCITS」に移転し、吸収対象UCITSの投資主が見返りに吸収UCITSの投資証券および適宜、当該投資証券の純資産価格の10%を超えない支払額を受け取る取引。
- c) 負債が完済されるまで存続し続ける一もしくは複数のUCITSまたは当該UCITSのサブ・ファンド、すなわち「吸収対象UCITS」が、すべての純資産を同じUCITSの別のサブ・ファンド、当該UCITSが設立した別のUCITSまたは別の既存のUCITSもしくは当該UCITSのサブ・ファンド、すなわち「吸収UCITS」に移転する取引。

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

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

合併の決定は有価証券報告書「第二部 外国投資法人の詳細情報 第3 管理及び運営、3 投資主・外国投資法人債権者の権利等（1）投資主・外国投資法人債権者の権利（f）報告書を受領する権利」の項に記載される通り投資主に通知する。決定が公告されてから30日以内に投資主は保有する投資証券の一部または全部を、有価証券報告書「第二部 外国投資法人の詳細情報 第2 手続等 2 買戻し手続等」と題する項に記載する手続に従って、買戻手数料またはその他の管理事務手数料を支払わずに、その時点の純資産価額で買い戻す権限を有する。買戻しのために提出されなかった投

投資証券は、交換比率が計算される日と同日に計算した関係するサブ・ファンドの純資産価格に基づいて交換される。割当てる投資証券が集合的投資ファンド（契約型オープン投資信託）の受益証券である場合、上記の決定は割当てに賛成票を投じた投資主だけを拘束する。

本投資法人の総会または関係するサブ・ファンドの投資主総会

サブ・ファンドの清算および合併のいずれの場合についても、本投資法人の総会または関係するサブ・ファンドの投資主総会の定足数は要求されず、決定は総会に出席するまたは委任状による投資証券の単純多数によって承認されることができる。

c. 出資の状況その他の重要事項

該当事項なし。

d. 訴訟事件その他の重要事項

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

2 【外国投資法人の運用状況】

(1) 【投資状況】

資産別および地域別の投資状況

(ダイナミック・インカム (米ドル))

(2023年12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	186,883,956.80	40.87
	アイルランド	45,107,465.94	9.86
	シンガポール	15,886,565.40	3.47
	アメリカ合衆国	65,696.44	0.01
	イギリス	45,753.01	0.01
	小計	247,989,437.59	54.23
株式	アメリカ合衆国	108,083,594.09	23.63
	日本	15,027,741.03	3.29
	イギリス	9,997,085.06	2.19
	オーストラリア	9,403,183.81	2.06
	フランス	6,547,578.71	1.43
	ドイツ	4,970,959.90	1.09
	スイス	4,723,595.88	1.03
	オランダ	2,553,661.87	0.56
	アイルランド	2,343,377.75	0.51
	スペイン	1,487,419.75	0.33
	カナダ	1,105,159.47	0.24
	イタリア	947,662.58	0.21
	フィンランド	688,697.12	0.15
	香港	466,338.46	0.10
	シンガポール	429,854.46	0.09
	ベルギー	366,386.51	0.08
	スウェーデン	316,363.40	0.07
	デンマーク	167,494.37	0.04
	ウルグアイ	143,010.14	0.03
	オーストリア	127,962.30	0.03
	バミューダ	120,267.19	0.03
	イスラエル	112,156.47	0.02
	ニュージーランド	108,382.13	0.02
	ポルトガル	90,006.95	0.02
	ノルウェー	84,407.44	0.02
	ルクセンブルグ	69,344.04	0.02
	マン島	24,739.76	0.01
	小計	170,506,430.64	37.28
短期金融商品	アメリカ合衆国	24,414,511.43	5.34

債券	アメリカ合衆国	2,395,631.23	0.52
従来型 オプション	フランス	－158,493.32	－0.03
	スイス	－164,201.84	－0.04
	カナダ	－423,906.88	－0.09
	イギリス	－683,637.99	－0.15
	小計	－1,430,240.03	－0.31
ポートフォリオ合計		443,875,770.86	97.06
現金・その他資産		13,444,147.86	2.94
資産総額		457,319,918.72	100.00
負債総額		1,430,642.71	0.31
合計（純資産総額）		455,889,276.01 (約64,659百万円)	99.69

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

(フィクスト・インカム・サステナブル (米ドル))

(2023年12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	30,770,687.29	53.79
	アイルランド	8,617,084.88	15.06
	小計	39,387,772.17	68.86
債券	国際機関	16,033,904.56	28.03
ポートフォリオ合計		55,421,676.73	96.89
現金・その他資産		1,778,942.88	3.11
資産総額		57,200,619.61	100.00
負債総額		197,457.31	0.35
合計 (純資産総額)		57,003,162.30 (約8,085百万円)	99.65

(インカム・サステナブル (米ドル))

(2023年12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	68,318,561.38	87.98
	アイルランド	8,636,707.14	11.12
	小計	76,955,268.52	99.10
従来型 オプション	日本	19,435.38	0.03
	アメリカ合衆国	3,080.00	0.00
	小計	22,515.38	0.03
ポートフォリオ合計		76,977,783.90	99.13
現金・その他資産		676,216.14	0.87
資産総額		77,654,000.04	100.00
負債総額		198,993.72	0.26
合計 (純資産総額)		77,455,006.32 (約10,985百万円)	99.74

（システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ（米ドル））

（2023年12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	298,207,841.25	63.92
	アイルランド	69,559,192.27	14.91
	シンガポール	36,060.72	0.01
	イギリス	17,605.13	0.00
	カナダ	5,917.89	0.00
	小計	367,826,617.26	78.84
その他の有価証券	アイルランド	36,965,407.50	7.92
	イギリス	2,259,496.00	0.48
	小計	39,224,903.50	8.41
株式	日本	4,911,135.41	1.05
	イギリス	2,988,203.38	0.64
	カナダ	2,653,720.57	0.57
	フランス	2,547,317.58	0.55
	スイス	2,350,677.48	0.50
	ドイツ	1,858,427.89	0.40
	オーストラリア	1,623,572.51	0.35
	オランダ	1,161,493.60	0.25
	デンマーク	731,766.48	0.16
	スウェーデン	698,825.69	0.15
	スペイン	564,407.54	0.12
	香港	473,203.09	0.10
	イタリア	432,420.05	0.09
	シンガポール	275,043.39	0.06
	アイルランド	262,377.56	0.06
	フィンランド	234,405.14	0.05
	ベルギー	174,794.55	0.04
	イスラエル	156,644.55	0.03
	ノルウェー	146,401.13	0.03
	ニュージーランド	60,971.40	0.01
	オーストリア	43,328.95	0.01
	ルクセンブルグ	43,266.81	0.01
	ポルトガル	39,838.94	0.01
	バミューダ	12,695.88	0.00
	マン島	12,103.73	0.00
	マカオ	8,193.58	0.00
	アメリカ合衆国	5,784.92	0.00
	中国	5,463.00	0.00
	小計	24,476,484.80	5.25
短期金融商品	アメリカ合衆国	15,157,941.16	3.25

ポートフォリオ合計	446,685,946.72	95.74
現金・その他資産	19,877,949.87	4.26
資産総額	466,563,896.59	100.00
負債総額	2,722,831.86	0.58
合計（純資産総額）	463,841,064.73 (約65,787百万円)	99.42

(システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル))

(2023年12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	443,899,332.32	44.75
	アイルランド	295,108,281.07	29.75
	シンガポール	144,242.36	0.01
	イギリス	68,205.75	0.01
	カナダ	22,513.67	0.00
	小計	739,242,575.17	74.53
株式	日本	20,815,213.71	2.10
	イギリス	12,689,795.74	1.28
	カナダ	11,420,835.98	1.15
	フランス	10,829,493.44	1.09
	スイス	10,023,856.60	1.01
	ドイツ	7,902,240.51	0.80
	オーストラリア	6,907,015.07	0.70
	オランダ	4,943,320.23	0.50
	デンマーク	3,081,522.49	0.31
	スウェーデン	2,980,656.04	0.30
	スペイン	2,413,909.80	0.24
	香港	1,986,425.12	0.20
	イタリア	1,848,332.83	0.19
	シンガポール	1,168,487.92	0.12
	アイルランド	1,125,319.22	0.11
	フィンランド	988,796.84	0.10
	ベルギー	761,140.75	0.08
	イスラエル	657,591.60	0.07
	ノルウェー	621,997.01	0.06
	ニュージーランド	266,894.69	0.03
	ルクセンブルグ	179,842.43	0.02
	オーストリア	178,714.22	0.02
	ポルトガル	163,292.21	0.02
	バミューダ	51,270.46	0.01
	マン島	43,573.43	0.00
	マカオ	42,138.43	0.00
	アメリカ合衆国	26,032.16	0.00
	中国	21,852.00	0.00
	小計	104,139,560.93	10.50
その他の有価証券	アイルランド	70,182,605.00	7.08
	イギリス	5,374,260.00	0.54
	小計	75,556,865.00	7.62
短期金融商品	アメリカ合衆国	24,349,559.52	2.45

ワラント	カナダ	0.01	0.00
ポートフォリオ合計		943,288,560.63	95.10
現金・その他資産		48,559,303.86	4.90
資産総額		991,847,864.49	100.00
負債総額		6,346,375.99	0.64
合計（純資産総額）		985,501,488.50 (約139,774百万円)	99.36

(システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル))

(2023年12月末日現在)

資産の種類	国・地域名	時価合計 (米ドル)	投資比率 (%)
投資信託	アイルランド	120,171,476.01	41.79
	ルクセンブルグ	83,397,562.64	29.00
	シンガポール	59,118.72	0.02
	イギリス	31,662.12	0.01
	カナダ	8,249.05	0.00
	小計	203,668,068.54	70.83
株式	日本	9,112,841.45	3.17
	イギリス	5,546,322.81	1.93
	カナダ	4,927,598.42	1.71
	フランス	4,731,023.91	1.65
	スイス	4,364,041.06	1.52
	ドイツ	3,461,718.05	1.20
	オーストラリア	3,020,527.59	1.05
	オランダ	2,157,609.39	0.75
	デンマーク	1,358,947.53	0.47
	スウェーデン	1,299,530.81	0.45
	スペイン	1,056,160.57	0.37
	香港	877,732.58	0.31
	イタリア	801,163.23	0.28
	シンガポール	513,699.41	0.18
	アイルランド	490,977.95	0.17
	フィンランド	437,307.82	0.15
	ベルギー	330,779.10	0.12
	イスラエル	293,643.48	0.10
	ノルウェー	272,637.88	0.09
	ニュージーランド	111,741.26	0.04
	オーストリア	76,216.79	0.03
	ルクセンブルグ	76,093.90	0.03
	ポルトガル	71,084.29	0.02
	バミューダ	23,258.38	0.01
	マン島	19,036.44	0.01
	マカオ	15,216.65	0.01
	アメリカ合衆国	10,123.62	0.00
	中国	5,463.00	0.00
	小計	45,462,497.37	15.81
その他の有価証券	アイルランド	13,092,462.50	4.55
	イギリス	1,650,822.00	0.57
	小計	14,743,284.50	5.13
短期金融商品	アメリカ合衆国	9,109,165.79	3.17

ワラント	カナダ	0.01	0.00
ポートフォリオ合計		272,983,016.21	94.93
現金・その他資産		14,567,674.59	5.07
資産総額		287,550,690.80	100.00
負債総額		1,598,331.14	0.56
合計（純資産総額）		285,952,359.66 (約40,557百万円)	99.44

(2) 【運用実績】

① 【純資産等の推移】

2023年12月末日までの1年間における各月末の資産総額および純資産の推移は以下のとおりである。

(ダイナミック・インカム (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-m d i s t 投資証券)		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	米ドル	円
2023年1月末日	489,977.95	69,494	486,808.01	69,044	88.64	12,572	110.07	15,611
2月末日	468,289.62	66,418	466,376.44	66,146	86.33	12,244	107.93	15,308
3月末日	471,758.77	66,910	470,784.28	66,771	86.69	12,295	109.15	15,481
4月末日	471,047.02	66,809	469,795.39	66,631	86.98	12,336	110.27	15,640
5月末日	470,926.41	66,791	467,641.80	66,326	85.71	12,156	109.16	15,482
6月末日	475,799.80	67,483	474,415.01	67,286	87.18	12,365	111.53	15,818
7月末日	475,685.41	67,466	474,064.51	67,237	88.42	12,541	113.65	16,119
8月末日	460,838.51	65,361	457,899.86	64,944	86.97	12,335	112.31	15,929
9月末日	447,767.24	63,507	444,570.96	63,053	84.80	12,027	110.04	15,607
10月末日	431,559.58	61,208	429,945.92	60,979	82.87	11,753	108.05	15,325
11月末日	447,809.84	63,513	444,974.09	63,111	86.76	12,305	113.66	16,120
12月末日	457,319.92	64,862	455,889.28	64,659	89.09	12,636	117.26	16,631

(フィクスト・インカム・サステナブル (米ドル))

	資産総額		純資産総額		1口当たり純資産価格 (クラスP-a c c 投資証券)		1口当たり純資産価格 (クラス(日本円・ ヘッジ) 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
2023年1月末日	67,125.59	9,520	67,079.61	9,514	235.14	33,350	9,248
2月末日	64,993.85	9,218	64,618.85	9,165	231.11	32,778	9,053
3月末日	66,523.74	9,435	65,562.01	9,299	235.21	33,360	9,167
4月末日	65,264.67	9,256	65,234.52	9,252	236.39	33,527	9,171
5月末日	65,284.31	9,259	64,923.53	9,208	234.86	33,310	9,059
6月末日	63,890.84	9,062	63,854.25	9,056	234.35	33,238	9,002
7月末日	64,275.91	9,116	64,224.45	9,109	235.58	33,412	9,005
8月末日	66,419.05	9,420	66,366.74	9,413	235.16	33,353	8,946
9月末日	67,323.45	9,548	64,314.66	9,122	232.47	32,971	8,801
10月末日	53,429.49	7,578	53,052.81	7,524	231.44	32,825	8,711
11月末日	55,361.00	7,852	54,957.25	7,795	238.03	33,760	8,917
12月末日	57,200.62	8,113	57,003.16	8,085	243.70	34,564	9,078

(インカム・サステナブル (米ドル))

	資産総額		純資産総額		1口当たり純資産価格 (クラスP-a c c 投資証券)		1口当たり純資産価格 (クラス (日本円・ ヘッジ) 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
2023年1月末日	96,026.10	13,619	93,741.76	13,295	115.66	16,404	—
2月末日	93,606.58	13,276	91,946.95	13,041	113.34	16,075	—
3月末日	92,924.05	13,179	92,218.39	13,079	115.27	16,349	—
4月末日	93,209.46	13,220	93,160.38	13,213	115.94	16,444	—
5月末日	92,368.41	13,101	92,024.99	13,052	114.88	16,293	—
6月末日	81,616.43	11,576	78,712.55	11,164	115.44	16,373	—
7月末日	79,466.73	11,271	79,401.62	11,262	116.59	16,536	—
8月末日	77,772.64	11,030	77,709.00	11,021	115.90	16,438	—
9月末日	75,559.61	10,717	75,358.36	10,688	113.80	16,140	—
10月末日	74,740.19	10,600	74,663.43	10,590	112.26	15,922	—
11月末日	78,069.30	11,073	75,487.34	10,706	116.57	16,533	—
12月末日	77,654.00	11,014	77,455.01	10,985	120.15	17,041	—

(システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ (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
2023年1月末日	618,327.00	87,697	613,150.47	86,963	104.25	14,786
2月末日	582,184.50	82,571	579,987.46	82,260	102.73	14,570
3月末日	551,112.01	78,164	548,920.72	77,853	103.75	14,715
4月末日	543,547.08	77,091	540,934.11	76,721	104.28	14,790
5月末日	523,722.78	74,280	516,321.33	73,230	103.61	14,695
6月末日	517,748.51	73,432	515,131.71	73,061	105.48	14,960
7月末日	518,580.24	73,550	511,255.30	72,511	107.25	15,211
8月末日	494,644.31	70,155	492,048.30	69,787	106.31	15,078
9月末日	466,514.28	66,166	464,789.60	65,921	104.39	14,806
10月末日	454,461.24	64,456	450,227.54	63,856	103.19	14,635
11月末日	459,362.40	65,151	457,477.83	64,884	105.86	15,014
12月末日	466,563.90	66,173	463,841.06	65,787	108.77	15,427

(システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム (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
2023年1月末日	1,195,683.06	169,584	1,183,474.33	167,852	108.37	15,370
2月末日	1,130,897.94	160,395	1,125,855.29	159,680	106.81	15,149
3月末日	1,099,394.75	155,927	1,092,128.36	154,897	107.42	15,235
4月末日	1,095,228.24	155,336	1,088,592.41	154,395	108.21	15,347
5月末日	1,057,338.30	149,962	1,035,849.48	146,915	107.68	15,272
6月末日	1,068,441.93	151,537	1,062,905.92	150,752	111.12	15,760
7月末日	1,093,726.90	155,123	1,076,483.30	152,678	114.05	16,176
8月末日	1,033,986.06	146,650	1,029,841.57	146,062	112.45	15,949
9月末日	975,231.26	138,317	971,180.41	137,743	109.79	15,572
10月末日	953,888.24	135,290	937,933.99	133,027	107.79	15,288
11月末日	969,911.04	137,562	964,444.61	136,787	111.44	15,806
12月末日	991,847.86	140,674	985,501.49	139,774	115.11	16,326

(システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (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
2023年1月末日	352,029.31	49,928	348,179.90	49,382	111.66	15,837
2月末日	328,642.55	46,611	327,839.90	46,498	109.93	15,591
3月末日	326,120.73	46,254	324,204.70	45,982	110.64	15,692
4月末日	325,823.44	46,212	324,631.09	46,042	111.60	15,828
5月末日	296,558.46	42,061	293,356.13	41,607	111.21	15,773
6月末日	306,132.14	43,419	304,781.31	43,227	116.11	16,468
7月末日	313,221.64	44,424	307,900.16	43,669	119.81	16,993
8月末日	297,316.34	42,168	295,933.91	41,972	117.45	16,658
9月末日	282,049.38	40,003	280,633.36	39,802	113.95	16,162
10月末日	271,219.07	38,467	269,258.18	38,189	111.26	15,780
11月末日	277,857.91	39,409	276,796.79	39,258	115.46	16,376
12月末日	287,550.69	40,783	285,952.36	40,557	119.85	16,998

ファンドの投資証券は、ルクセンブルグ証券取引所に上場されている。
同取引所での実質的な取引実績はない。

②【分配の推移】

2023年12月末日前1年間における各月の1口当たり分配金は以下のとおりである。

ダイナミック・インカム (米ドル) クラスP—md i s t 投資証券

期間	1口当たりの分配金額	
	米ドル	円
2023年1月	0.60	85
2月	0.60	85
3月	0.60	85
4月	0.40	57
5月	0.39	55
6月	0.41	58
7月	0.41	58
8月	0.41	58
9月	0.41	58
10月	0.41	58
11月	0.41	58
12月	0.41	58

(注) 各月の分配金は、各月末までに宣言された金額である。

ダイナミック・インカム (米ドル)

クラスP—a c c (米ドル) 投資証券

フィクスト・インカム・サステナブル (米ドル)

クラスP—a c c 投資証券

クラス (日本円・ヘッジ) P—a c c 投資証券

インカム・サステナブル (米ドル)

クラスP—a c c 投資証券

クラス (日本円・ヘッジ) P—a c c 投資証券

システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ (米ドル)

クラスP—a c c 投資証券

システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル)

クラスP—a c c 投資証券

システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)

クラスP—a c c 投資証券

該当事項なし

③【自己資本利益率（収益率）の推移】

2023年1月1日から2023年12月末日までの1年間の自己資本利益率（収益率）は以下のとおりである。

	収益率（%）（注）	
ダイナミック・インカム （米ドル）	クラスP—m d i s t 投資証券	16.72
	クラスP—a c c 投資証券	11.18
フィクスト・インカム・サステナブル（米ドル）	クラスP—a c c 投資証券	—0.20
	クラス（日本円・ヘッジ） P—a c c 投資証券	5.80
インカム・サステナブル （米ドル）	クラスP—a c c 投資証券	6.93
	クラス（日本円・ヘッジ） P—a c c 投資証券	—
システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ（米ドル）	クラスP—a c c 投資証券	7.58
システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム（米ドル）	クラスP—a c c 投資証券	10.34
システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック（米ドル）	クラスP—a c c 投資証券	12.33

（注）収益率（%）＝ $100 \times (a - b) / b$

a＝2023年12月末日現在の1口当たり純資産価格（当該期間に支払われた分配金の合計金額を加えた額）

b＝2022年12月末日現在の1口当たり純資産価格（分配額の額）

（3）【投資リスク】

- ① 当中間計算期間において、2023年11月30日提出の有価証券報告書「第一部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 3 投資リスク」に記載される投資リスクについて、重要な変更はない。
- ② 本投資法人が将来にわたって営業活動を継続するにあたり重要な疑義を生じさせるような事象または状況、その他本投資法人の経営に重要な影響を及ぼす事象は、半期報告書提出日現在、存在しない。

3【資産運用会社の概況】

(1)【名称及び資本金の額】

- ① 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12月末日現在の株主資本総額は、13,738,000ユーロ（約22億円）

（注）ユーロの円貨換算は、便宜上、2023年12月29日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1ユーロ＝157.12円）による。以下同じ。

- ② 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12月末日現在の株主資本総額は、500,000スイス・フラン（約8,412万円）

（注）スイス・フランの円貨換算は、便宜上、2023年12月29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＝168.24円）による。以下同じ。

- ③ 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」および「投資顧問会社」）

資本金（株主資本）の額

2023年12月末日現在の株主資本総額は、1,000万スイス・フラン（約17億円）

(2)【大株主の状況】

- ① UBSファンド・マネジメント（ルクセンブルグ）エス・エイ

（2023年12月末日現在）

名称	住所	所有株式数 (株)	比率 (%)
UBSアセット・ マネジメント・エイ・ジー (UBS Asset Management AG)	バーンホフ・シュトラッセ45、CH- 8001 チューリッヒ、スイス	6,869	100

- ② 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12月末日現在）

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

- ③ ユービーエス・スイス・エイ・ジー（チューリッヒ）

（2023年12月末日現在）

名称	住所	所有株式数 (株)	比率 (%)
ユービーエス・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

(3) 【役員の状況】

① UBSファンド・マネジメント (ルクセンブルグ) エス・エイ

(2023年12月末日現在)

氏名	役職名	就任	略歴	所有株式
マイケル・ケール (Michael Kehl)	チェアマン、 ディレクター／ ボード・メンバー	2022年1月1日	UBS アセット・マネジ メント・スイス・エイ・ ジー、チューリッヒ、ス イス ヘッド・オブ・プロダク ト	該当なし
フランチェスカ・ジ リ・プリム (Francesca Gigli Prym)	ディレクター／ ボード・メンバー	2019年12月5日	UBS ファンド・マネジ メント (ルクセンブル グ) エス・エイ、ルクセ ンブルグ、チーフ・エグ ゼクティブ・オフィサー	該当なし
ウジェーヌ・デル・シ オッポ (Eugène Del Cioppo)	ディレクター／ ボード・メンバー	2022年9月2日	UBS ファンド・マネジ メント (スイス) エイ・ ジー、バーゼル、スイス チーフ・エグゼクティ ブ・オフィサー	該当なし
アン＝シャルロット・ ローヤー (Ann-Charlotte Lawyer)	ディレクター／ ボード・メンバー	2022年1月1日	ルクセンブルグ大公国、 インディペンデント・ ディレクター	該当なし

② 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12月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有株式
ミーダーホフ・マーカス (Miederhoff Markus)	ヴァイス・チェアマン	2019年6月20日就任	該当なし
ケッテラー・レト・ユー (Ketterer Reto U.)	ディレクター／ ボード・メンバー	2020年9月24日就任	該当なし
サリバ・ガイレー (Saliba Gaylee)	ディレクター／ ボード・メンバー	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・イボンヌ・ シルビア (Stillhart 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

③ ユービーエス・スイス・エイ・ジー (チューリッヒ)

(2023年12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 (2023年11月30日現在)
ロジャー・フォン・メントレン (Roger von Mentlen)	チェアマン	2023年11月1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
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
クリストフ・ブルーナー (Christoph Brunner)	ディレクター／ ボード・メンバー	2023年11月1日就任	非公開
ピーター・ディレンディンカー (Peter Derendinger)	ディレクター／ ボード・メンバー	2023年11月1日就任	非公開
クラウディア・ディル (Claudia Dill)	ディレクター／ ボード・メンバー	2023年11月1日就任	非公開
ダミアン・フォーゲル (Damian Vogel)	ディレクター／ ボード・メンバー	2023年11月1日就任	非公開

(4) 【事業の内容及び営業の概況】

① UBSファンド・マネジメント (ルクセンブルグ) エス・エイ

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

管理会社は、本投資法人の所在地事務代行会社としても行為している。

2023年12月末日現在、管理会社は以下のとおり、406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	406	452,743,307.32 オーストラリア・ドル
			3,250,490,087.13 カナダ・ドル
			15,049,509,302.66 スイス・フラン
			2,260,285,748.03 中国元
			2,810,336,538.79 デンマーク・クローネ
			50,295,010,720.61 ユーロ
			1,923,928,536.58 英ポンド
			251,600,221.40 香港ドル
			565,505,560,494.50 日本円
			20,025,567.03 シンガポール・ドル
			114,797,454,139.96 米ドル

② 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12月末日現在、UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー (チューリッヒ) は132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	Multi Manager Access II - US Multi Credit Sustainable	変動資本を有する 投資法人	2007年11月27日	4,820,013,736
2	UBS (Lux) Bond Sicav - Convert Global (EUR)	変動資本を有する 投資法人	2004年11月18日	3,824,912,579
3	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	3,644,727,261
4	Multi Manager Access II - Emerging Markets Debt	変動資本を有する 投資法人	2013年12月2日	3,616,431,627
5	Multi Manager Access II - European Multi Credit Sustainable	変動資本を有する 投資法人	2007年8月21日	3,204,007,875
6	UBS (Lux) Money Market Fund - USD	契約型投資信託	1988年11月25日	2,803,358,185
7	Multi Manager Access II - High Yield	変動資本を有する 投資法人	2016年4月13日	2,697,263,096
8	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	2,409,835,218
9	UBS (Lux) Money Market Fund - EUR	契約型投資信託	1989年10月9日	2,382,785,393
10	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	2,137,267,377

(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。

③ ユービーエス・スイス・エイ・ジー (チューリッヒ)

2023年12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56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	Multi Manager Access II - US Multi Credit Sustainable	変動資本を有する 投資法人	2007年11月27日	4,820,013,736
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	4,602,928,891
3	Multi Manager Access II - Emerging Markets Debt	変動資本を有する 投資法人	2013年12月 2 日	3,616,431,627
4	Multi Manager Access II - European Multi Credit Sustainable	変動資本を有する 投資法人	2007年 8 月21日	3,204,007,875
5	Multi Manager Access II - High Yield	変動資本を有する 投資法人	2016年 4 月13日	2,697,263,096
6	Multi Manager Access - Green, Social and Sustainable Bonds	変動資本を有する 投資法人	2022年 3 月10日	2,099,783,891
7	UBS (Lux) Strategy Fund - Balanced Sustainable (CHF)	契約型投資信託	1994年 7 月 1 日	1,216,485,202
8	Global Opportunities Access - Sustainable Equities	変動資本を有する 投資法人	2019年 5 月13日	1,216,117,537
9	Multi Manager Access - EMU Equities Sustainable	変動資本を有する 投資法人	2014年 2 月 7 日	1,167,020,620
10	Global Opportunities Access - Sustainable Bonds	変動資本を有する 投資法人	2019年 5 月13日	1,151,600,288

(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) 一単位当たり純資産価格は開示していない。

(注3) 上記は管理会社から提供された情報に基づく。

4【外国投資法人の経理状況】

- a. ファンドの日本語の中間財務書類は、ルクセンブルグにおける法令に準拠して作成された原文の中間財務書類を翻訳したものである。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。
- b. ファンドの原文の中間財務書類は、UBS (Lux) ストラテジー・シキャブおよび全てのサブ・ファンドにつき一括して作成されている。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。なお、各サブ・ファンドには下記のクラス投資証券以外のクラス投資証券も存在するが、本書においては下記のクラス投資証券に関する部分のみを抜粋して日本語に記載している。
- ーダイナミック・インカム（米ドル）
 - クラスP-a c c 投資証券
 - クラスP-m d i s t 投資証券
 - ーフィクスト・インカム・サステナブル（米ドル）
 - クラスP-a c c 投資証券
 - クラス（日本円・ヘッジ）P-a c c 投資証券
 - ーインカム・サステナブル（米ドル）
 - クラスP-a c c 投資証券
 - ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ（米ドル）
 - クラスP-a c c 投資証券
 - ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック（米ドル）
 - クラスP-a c c 投資証券
 - ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム（米ドル）
 - クラスP-a c c 投資証券
- c. ファンドの原文の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。
- d. ファンドの原文の中間財務書類は、米ドルで表示されている。日本語の中間財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円による金額は、2023年12月29日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝141.83円）で換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

(1) 【資産及び負債の状況】

UBS (Lux) ストラテジー・シキャプーダイナミック・インカム (米ドル)

純資産計算書

	2023年11月30日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	412,508,878.43	58,506,134
投資有価証券、未実現評価 (損) 益	26,906,176.13	3,816,103
投資有価証券合計 (注1)	439,415,054.56	62,322,237
現金預金、要求払預金および預託金勘定	5,590,303.63 *	792,873
有価証券売却未収金 (注1)	1,879,154.80	266,521
発行未収金	299,879.91	42,532
有価証券に係る未収利息	9,470.34	1,343
配当金に係る未収金	399,544.63	56,667
その他の未収金	216,432.82	30,697
資産合計	447,809,840.69	63,512,870
負 債		
先渡為替契約に係る未実現損失 (注1)	(487,294.11)	(69,113)
スワップに係る未実現損失 (注1)	(98,762.57)	(14,007)
有価証券購入未払金 (注1)	(1,541,261.08)	(218,597)
買戻未払金	(268,984.54)	(38,150)
定率報酬引当金 (注2)	(400,273.03)	(56,771)
年次税引当金 (注3)	(21,682.14)	(3,075)
その他の手数料および報酬引当金 (注2)	(17,490.03)	(2,481)
引当金合計	(439,445.20)	(62,327)
負債合計	(2,835,747.50)	(402,194)
期末現在純資産	444,974,093.19	63,110,676

* 2023年11月30日現在、250,000.00米ドルの現金額が取引相手方であるユービーエス・エイ・ジーの担保として使用される。

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS（Lux）ストラテジー・シキャプ・フィクスト・インカム・サステナブル（米ドル）

純資産計算書

	2023年11月30日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	55,435,659.23	7,862,440
投資有価証券、未実現評価（損）益	(1,343,398.95)	(190,534)
投資有価証券合計（注1）	54,092,260.28	7,671,905
現金預金、要求払預金および預託金勘定	731,651.47	103,770
その他の流動資産（マージン）	4,442.60	630
有価証券売却未収金（注1）	441,151.71	62,569
有価証券に係る未収利息	83,532.94	11,847
その他の資産	6,400.14	908
金融先物に係る未実現利益（注1）	1,562.51	222
資産合計	55,361,001.65	7,851,851
負 債		
先渡為替契約に係る未実現損失（注1）	(124,124.79)	(17,605)
有価証券購入未払金（注1）	(230,215.22)	(32,651)
定率報酬引当金（注2）	(47,332.98)	(6,713)
年次税引当金（注3）	(2,078.45)	(295)
引当金合計	(49,411.43)	(7,008)
負債合計	(403,751.44)	(57,264)
期末現在純資産	54,957,250.21	7,794,587

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS（Lux）ストラテジー・シキャプ・インカム・サステナブル（米ドル）

純資産計算書

	2023年11月30日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	77,228,898.04	10,953,375
投資有価証券、未実現評価（損）益	(2,693,928.18)	(382,080)
投資有価証券合計（注１）	74,534,969.86	10,571,295
現金預金、要求払預金および預託金勘定	917,367.06	130,110
その他の流動資産（マージン）	6,218.84	882
有価証券売却未収金（注１）	2,599,924.49	368,747
その他の資産	8,636.36	1,225
金融先物に係る未実現利益（注１）	2,187.51	310
資産合計	78,069,304.12	11,072,569
負 債		
先渡為替契約に係る未実現損失（注１）	(348,830.24)	(49,475)
有価証券購入未払金（注１）	(2,156,086.19)	(305,798)
定率報酬引当金（注２）	(76,280.87)	(10,819)
年次税引当金（注３）	(768.81)	(109)
引当金合計	(77,049.68)	(10,928)
負債合計	(2,581,966.11)	(366,200)
期末現在純資産	75,487,338.01	10,706,369

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャプ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ (米ドル)

純資産計算書

	2023年11月30日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	415,191,444.49	58,886,603
投資有価証券、未実現評価 (損) 益	30,364,142.11	4,306,546
投資有価証券合計 (注1)	445,555,586.60	63,193,149
現金預金、要求払預金および預託金勘定	4,538,785.09	643,736
その他の流動資産 (マージン)	1,974,870.69	280,096
有価証券売却未収金 (注1)	3,004,123.61	426,075
発行未収金	1,058.43	150
配当金に係る未収金	73,014.43	10,356
その他の未収金	177,952.72	25,239
先渡為替契約に係る未実現利益 (注1)	4,037,006.72	572,569
資産合計	459,362,398.29	65,151,369
負 債		
金融先物に係る未実現損失 (注1)	(221,037.25)	(31,350)
スワップに係る未実現損失 (注1)	(171,924.84)	(24,384)
有価証券購入未払金 (注1)	(15,652.33)	(2,220)
買戻未払金	(993,672.55)	(140,933)
定率報酬引当金 (注2)	(437,250.81)	(62,015)
年次税引当金 (注3)	(12,388.03)	(1,757)
その他の手数料および報酬引当金 (注2)	(32,639.69)	(4,629)
引当金合計	(482,278.53)	(68,402)
負債合計	(1,884,565.50)	(267,288)
期末現在純資産	457,477,832.79	64,884,081

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャプ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)

純資産計算書

	2023年11月30日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	239,372,710.00	33,950,231
投資有価証券、未実現評価 (損) 益	30,421,201.20	4,314,639
投資有価証券合計 (注1)	269,793,911.20	38,264,870
現金預金、要求払預金および預託金勘定	4,382,303.87	621,542
その他の流動資産 (マージン)	1,979,252.89	280,717
有価証券売却未収金 (注1)	235,925.60	33,461
発行未収金	13,740.24	1,949
配当金に係る未収金	129,486.50	18,365
その他の未収金	175,245.69	24,855
先渡為替契約に係る未実現利益 (注1)	1,148,047.70	162,828
資産合計	277,857,913.69	39,408,588
負 債		
金融先物に係る未実現損失 (注1)	(362,677.13)	(51,438)
スワップに係る未実現損失 (注1)	(102,748.35)	(14,573)
有価証券購入未払金 (注1)	(14,854.65)	(2,107)
買戻未払金	(241,473.52)	(34,248)
定率報酬引当金 (注2)	(310,550.61)	(44,045)
年次税引当金 (注3)	(16,159.05)	(2,292)
その他の手数料および報酬引当金 (注2)	(12,664.50)	(1,796)
引当金合計	(339,374.16)	(48,133)
負債合計	(1,061,127.81)	(150,500)
期末現在純資産	276,796,785.88	39,258,088

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャプ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル)

純資産計算書

	2023年11月30日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	844,879,540.24	119,829,265
投資有価証券、未実現評価 (損) 益	97,562,279.26	13,837,258
投資有価証券合計 (注1)	942,441,819.50	133,666,523
現金預金、要求払預金および預託金勘定	12,530,090.83 *	1,777,143
その他の流動資産 (マージン)	5,911,314.17	838,402
有価証券売却未収金 (注1)	682,909.52	96,857
発行未収金	27,267.20	3,867
配当金に係る未収金	298,038.99	42,271
その他の未収金	505,713.79	71,725
先渡為替契約に係る未実現利益 (注1)	7,513,890.76	1,065,695
資産合計	969,911,044.76	137,562,483
負 債		
金融先物に係る未実現損失 (注1)	(1,556,730.71)	(220,791)
スワップに係る未実現損失 (注1)	(502,610.53)	(71,285)
当座借越	(655.64)	(93)
有価証券購入未払金 (注1)	(71,602.66)	(10,155)
買戻未払金	(2,207,237.92)	(313,053)
定率報酬引当金 (注2)	(1,027,495.25)	(145,730)
年次税引当金 (注3)	(43,513.68)	(6,172)
その他の手数料および報酬引当金 (注2)	(56,591.34)	(8,026)
引当金合計	(1,127,600.27)	(159,928)
負債合計	(5,466,437.73)	(775,305)
期末現在純資産	964,444,607.03	136,787,179

* 2023年11月30日現在、540,000.00米ドルの現金額が取引相手方であるユービーエス・エイ・ジーの担保として使用される。

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS（Lux）ストラテジー・シキャブダイナミック・インカム（米ドル）

運用計算書

	自2023年6月1日 至2023年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	314,810.67	44,650
有価証券に係る利息	29,319.47	4,158
配当金	2,075,186.49	294,324
貸付証券に係る純収益（注11）	38,416.42	5,449
その他の収益（注4）	85,190.19	12,083
報酬の払戻し	15,174.54	2,152
収益合計	2,558,097.78	362,815
費 用		
定率報酬（注2）	(2,533,976.22)	(359,394)
年次税（注3）	(66,832.87)	(9,479)
現金および当座借越に係る利息	(195,662.53)	(27,751)
費用合計	(2,796,471.62)	(396,624)
投資純（損）益	(238,373.84)	(33,809)
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	(861,879.81)	(122,240)
オプションに係る実現（損）益	(1,146,693.17)	(162,635)
利回り評価有価証券および短期金融商品に係る実現（損）益	276,272.80	39,184
先渡為替契約に係る実現（損）益	1,688,591.13	239,493
スワップに係る実現（損）益	(1,410,642.73)	(200,071)
為替差（損）益	(553,861.12)	(78,554)
実現（損）益合計	(2,008,212.90)	(284,825)
当期実現純（損）益	(2,246,586.74)	(318,633)
未実現評価（損）益の変動（注1）		
無オプション市場価格証券に係る未実現評価（損）益	21,623,712.62	3,066,891
オプションに係る未実現評価（損）益	(662,987.92)	(94,032)
利回り評価有価証券および短期金融商品に係る未実現評価（損）益	330,554.65	46,883
先渡為替契約に係る未実現評価（損）益	(932,101.83)	(132,200)
スワップに係る未実現評価（損）益	1,298,585.36	184,178
未実現評価（損）益の変動合計	21,657,762.88	3,071,721
運用の結果による純資産の純増（減）	19,411,176.14	2,753,087

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS（Lux）ストラテジー・シキャプ・フィクスト・インカム・サステナブル（米ドル）

運用計算書

	自2023年6月1日 至2023年11月30日	
	（米ドル）	（千円）
収 益		
流動資産に係る利息	20,381.73	2,891
有価証券に係る利息	171,124.03	24,271
貸付証券に係る純収益（注11）	4,470.42	634
その他の収益（注4）	29,572.84	4,194
収益合計	225,549.02	31,990
費 用		
定率報酬（注2）	(329,946.70)	(46,796)
年次税（注3）	(6,944.31)	(985)
その他の手数料および報酬（注2）	(9,287.26)	(1,317)
現金および当座借越に係る利息	(68.19)	(10)
費用合計	(346,246.46)	(49,108)
投資純（損）益	(120,697.44)	(17,119)
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	(1,243,572.79)	(176,376)
金融先物に係る実現（損）益	57,022.93	8,088
先渡為替契約に係る実現（損）益	(2,406,403.94)	(341,300)
為替差（損）益	45,800.78	6,496
実現（損）益合計	(3,547,153.02)	(503,093)
当期実現純（損）益	(3,667,850.46)	(520,211)
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	2,150,392.84	304,990
金融先物に係る未実現評価（損）益	1,562.51	222
先渡為替契約に係る未実現評価（損）益	109,388.76	15,515
未実現評価（損）益の変動合計	2,261,344.11	320,726
運用の結果による純資産の純増（減）	(1,406,506.35)	(199,485)

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS（Lux）ストラテジー・シキャプ・インカム・サステナブル（米ドル）

運用計算書

	自2023年6月1日 至2023年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	21,923.99	3,109
配当金	32,991.73	4,679
貸付証券に係る純収益（注11）	0.87	0
その他の収益（注4）	35,614.42	5,051
収益合計	90,531.01	12,840
費 用		
定率報酬（注2）	(471,725.83)	(66,905)
年次税（注3）	(8,047.01)	(1,141)
その他の手数料および報酬（注2）	(11,593.19)	(1,644)
現金および当座借越に係る利息	(42.24)	(6)
費用合計	(491,408.27)	(69,696)
投資純（損）益	(400,877.26)	(56,856)
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	(1,743,713.64)	(247,311)
オプションに係る実現（損）益	(30.00)	(4)
金融先物に係る実現（損）益	67,119.36	9,520
先渡為替契約に係る実現（損）益	263,062.68	37,310
為替差（損）益	(40,507.33)	(5,745)
実現（損）益合計	(1,454,068.93)	(206,231)
当期実現純（損）益	(1,854,946.19)	(263,087)
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	3,704,677.42	525,434
オプションに係る未実現評価（損）益	(12,160.00)	(1,725)
金融先物に係る未実現評価（損）益	2,187.51	310
先渡為替契約に係る未実現評価（損）益	(630,734.49)	(89,457)
未実現評価（損）益の変動合計	3,063,970.44	434,563
運用の結果による純資産の純増（減）	1,209,024.25	171,476

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャプ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ (米ドル)

運用計算書

	自2023年6月1日 至2023年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	268,248.43	38,046
配当金	314,174.11	44,559
貸付証券に係る純収益 (注11)	18,719.28	2,655
その他の収益 (注4)	212,729.19	30,171
収益合計	813,871.01	115,431
費 用		
定率報酬 (注2)	(2,825,343.52)	(400,718)
年次税 (注3)	(55,100.66)	(7,815)
現金および当座借越に係る利息	(72,268.24)	(10,250)
費用合計	(2,952,712.42)	(418,783)
投資純 (損) 益	(2,138,841.41)	(303,352)
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	4,890,050.04	693,556
利回り評価有価証券および短期金融商品に係る実現 (損) 益	266,902.81	37,855
金融先物に係る実現 (損) 益	(2,707,789.73)	(384,046)
先渡為替契約に係る実現 (損) 益	117,702.04	16,694
スワップに係る実現 (損) 益	134,426.06	19,066
為替差 (損) 益	(3,812,938.28)	(540,789)
実現 (損) 益合計	(1,111,647.06)	(157,665)
当期実現純 (損) 益	(3,250,488.47)	(461,017)
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	9,688,554.79	1,374,128
利回り評価有価証券および短期金融商品に係る未実現評価 (損) 益	130,514.94	18,511
金融先物に係る未実現評価 (損) 益	468,444.32	66,439
先渡為替契約に係る未実現評価 (損) 益	7,917,400.28	1,122,925
スワップに係る未実現評価 (損) 益	737,333.96	104,576
未実現評価 (損) 益の変動合計	18,942,248.29	2,686,579
運用の結果による純資産の純増 (減)	15,691,759.82	2,225,562

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)

運用計算書

	自2023年6月1日 至2023年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	195,557.00	27,736
配当金	527,252.28	74,780
貸付証券に係る純収益 (注11)	28,450.91	4,035
その他の収益 (注4)	18,992.81	2,694
収益合計	770,253.00	109,245
費 用		
定率報酬 (注2)	(1,988,028.12)	(281,962)
年次税 (注3)	(51,339.30)	(7,281)
現金および当座借越に係る利息	(38,667.46)	(5,484)
費用合計	(2,078,034.88)	(294,728)
投資純 (損) 益	(1,307,781.88)	(185,483)
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	11,566,365.03	1,640,458
利回り評価有価証券および短期金融商品に係る実現 (損) 益	302,823.45	42,949
金融先物に係る実現 (損) 益	(2,594,528.91)	(367,982)
先渡為替契約に係る実現 (損) 益	2,035,378.00	288,678
スワップに係る実現 (損) 益	70,009.45	9,929
為替差 (損) 益	(1,836,896.72)	(260,527)
実現 (損) 益合計	9,543,150.30	1,353,505
当期実現純 (損) 益	8,235,368.42	1,168,022
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	2,548,116.80	361,399
利回り評価有価証券および短期金融商品に係る未実現評価 (損) 益	114,688.30	16,266
金融先物に係る未実現評価 (損) 益	471,831.98	66,920
先渡為替契約に係る未実現評価 (損) 益	2,156,353.48	305,836
スワップに係る未実現評価 (損) 益	411,778.26	58,403
未実現評価 (損) 益の変動合計	5,702,768.82	808,824
運用の結果による純資産の純増 (減)	13,938,137.24	1,976,846

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャプ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル)

運用計算書

	自2023年6月1日 至2023年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	648,431.69	91,967
配当金	1,237,056.57	175,452
貸付証券に係る純収益 (注11)	58,409.68	8,284
その他の収益 (注4)	451,508.01	64,037
収益合計	2,395,405.95	339,740
費 用		
定率報酬 (注2)	(6,576,984.07)	(932,814)
年次税 (注3)	(163,543.61)	(23,195)
現金および当座借越に係る利息	(159,749.89)	(22,657)
費用合計	(6,900,277.57)	(978,666)
投資純 (損) 益	(4,504,871.62)	(638,926)
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	21,162,896.82	3,001,534
利回り評価有価証券および短期金融商品に係る実現 (損) 益	899,325.66	127,551
金融先物に係る実現 (損) 益	(7,007,467.19)	(993,869)
先渡為替契約に係る実現 (損) 益	2,273,888.48	322,506
スワップに係る実現 (損) 益	321,260.85	45,564
為替差 (損) 益	(7,877,633.84)	(1,117,285)
実現 (損) 益合計	9,772,270.78	1,386,001
当期実現純 (損) 益	5,267,399.16	747,075
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	22,715,673.57	3,221,764
利回り評価有価証券および短期金融商品に係る未実現評価 (損) 益	378,958.74	53,748
金融先物に係る未実現評価 (損) 益	829,640.41	117,668
先渡為替契約に係る未実現評価 (損) 益	13,886,520.26	1,969,525
スワップに係る未実現評価 (損) 益	1,952,554.18	276,931
未実現評価 (損) 益の変動合計	39,763,347.16	5,639,636
運用の結果による純資産の純増 (減)	45,030,746.32	6,386,711

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (Lux) ストラテジー・シキャブダイナミック・インカム (米ドル)

純資産変動計算書

	自2023年6月1日 至2023年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	467,641,801.58	66,325,637
発行額	10,573,887.27	1,499,694
買戻額	(41,607,922.19)	(5,901,252)
純発行 (買戻) 合計	(31,034,034.92)	(4,401,557)
支払配当金	(11,044,849.61)	(1,566,491)
投資純 (損) 益	(238,373.84)	(33,809)
実現 (損) 益合計	(2,008,212.90)	(284,825)
未実現評価 (損) 益の変動合計	21,657,762.88	3,071,721
運用の結果による純資産の純増 (減)	19,411,176.14	2,753,087
期末現在純資産	444,974,093.19	63,110,676

発行済投資証券数の変動表

	自2023年6月1日 至2023年11月30日
クラスP-a c c	(口)
期首現在発行済投資証券数	393,581.1040
期中発行投資証券数	370.0000
期中買戻投資証券数	(29,143.0360)
期末現在発行済投資証券数	364,808.0680
クラスP-m d i s t	(口)
期首現在発行済投資証券数	2,509,889.5820
期中発行投資証券数	67,363.5040
期中買戻投資証券数	(247,506.3420)
期末現在発行済投資証券数	2,329,746.7440

注記は当財務書類と不可分のものである。

月次分配金¹UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ
ーダイナミック・インカム (米ドル)

	分配落ち日	支払日	通貨	1口当たり金額
P-m d i s t	2023年6月15日	2023年6月20日	米ドル	0.39
P-m d i s t	2023年7月17日	2023年7月20日	米ドル	0.41
P-m d i s t	2023年8月16日	2023年8月21日	米ドル	0.41
P-m d i s t	2023年9月15日	2023年9月20日	米ドル	0.41
P-m d i s t	2023年10月16日	2023年10月19日	米ドル	0.41
P-m d i s t	2023年11月15日	2023年11月20日	米ドル	0.41

¹ 注記5を参照

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS（Lux）ストラテジー・シキャプダイナミック・インカム（米ドル）

最重要数値

	ISIN	2023年11月30日	2023年5月31日	2022年5月31日
純資産額（米ドル）		444 974 093.19	467 641 801.58	565 718 810.87
クラスP-a-c-c	LU1917362490			
発行済投資証券数（口）		364 808.0680	393 581.1040	568 304.2870
1口当たり純資産価格（米ドル）		113.66	109.16	110.99
1口当たり発行・買戻価格（米ドル） ¹		113.66	109.16	110.99
クラスP-m-d-i-s-t	LU1917361179			
発行済投資証券数（口）		2 329 746.7440	2 509 889.5820	2 662 604.3150
1口当たり純資産価格（米ドル）		86.76	85.71	93.56
1口当たり発行・買戻価格（米ドル） ¹		86.76	85.71	93.56

¹ 注記1を参照

組入証券の構造

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	41.23	投資信託	54.54
アメリカ合衆国	30.31	国債・中央政府債	6.01
アイルランド	10.17	インターネット・ソフトウェア・ITサービス	4.71
シンガポール	3.74	医薬品・化粧品・医療品	3.58
日本	3.45	金融・持株会社	2.75
オーストラリア	2.18	銀行・金融機関	2.64
イギリス	2.11	コンピュータハードウェア・ネットワーク装置供給業	2.55
フランス	1.49	石油	2.05
ドイツ	1.05	小売り・百貨店	1.89
スイス	1.02	電子機器・半導体	1.78
オランダ	0.61	食品・清涼飲料	1.44
スペイン	0.35	エネルギー・水道	1.25
イタリア	0.23	自動車	1.20
カナダ	0.21	保険	1.08
フィンランド	0.14	通信	1.04
香港	0.10	その他の消費財	0.81
ベルギー	0.09	機械工学・産業機器	0.74
スウェーデン	0.07	交通・運輸	0.70
Uruguay	0.04	たばこ・アルコール	0.65
オーストリア	0.03	不動産	0.65
バミューダ	0.03	建築業・資材	0.61
ポルトガル	0.02	グラフィックデザイン・出版・メディア	0.59
ニュージーランド	0.02	バイオテクノロジー	0.59
イスラエル	0.02	航空宇宙産業	0.57
デンマーク	0.02	その他のサービス業	0.53
ノルウェー	0.02	鉱業・石炭・鉄鋼	0.51
合計	98.75	化学	0.46

業種別分布表(続き)	(純資産に対する
	百分率 %))
電子部品・デバイス	0.45
ヘルスケア・社会福祉	0.42
宿泊・仕出し・レジャー	0.37
各種貿易会社	0.35
非鉄金属	0.30
繊維・衣服・革製品	0.21
林業・紙・パルプ製品	0.16
基金属・宝石	0.15
各種資本財	0.08
環境サービス・リサイクル	0.08
ゴム・タイヤ	0.07
包装業	0.06
その他の非分類会社	0.06
農業・漁業	0.05
写真・光学	0.01
モーゲージ・資金調達機関	0.01
合計	98.75

UBS（Lux）ストラテジー・シキャプ・フィクスト・インカム・サステナブル（米ドル）

純資産変動計算書

	自2023年6月1日 至2023年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	64,923,534.47	9,208,105
発行額	8,418,511.91	1,193,998
買戻額	(16,978,289.82)	(2,408,031)
純発行（買戻）合計	(8,559,777.91)	(1,214,033)
投資純（損）益	(120,697.44)	(17,119)
実現（損）益合計	(3,547,153.02)	(503,093)
未実現評価（損）益の変動合計	2,261,344.11	320,726
運用の結果による純資産の純増（減）	(1,406,506.35)	(199,485)
期末現在純資産	54,957,250.21	7,794,587

発行済投資証券数の変動表

	自2023年6月1日 至2023年11月30日
クラスP-a-c-c	(口)
期首現在発行済投資証券数	154,723.7840
期中発行投資証券数	35,085.4390
期中買戻投資証券数	(67,769.9190)
期末現在発行済投資証券数	122,039.3040
クラス（日本円・ヘッジ）P-a-c-c	(口)
期首現在発行済投資証券数	369,320.1630
期中発行投資証券数	2,167.3430
期中買戻投資証券数	(20,969.0950)
期末現在発行済投資証券数	350,518.4110

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS（Lux）ストラテジー・シキャプ・フィクスト・インカム・サステナブル（米ドル）

最重要数値

	ISIN	2023年5月31日	2023年5月31日	2022年5月31日
純資産額（米ドル）		54 957 250.21	64 923 534.47	69 508 472.76
クラスP-a-c-c	LU0042745397			
発行済投資証券数（口）		122 039.3040	154 723.7840	187 402.0060
1口当たり純資産価格（米ドル）		238.03	234.86	238.66
1口当たり発行・買戻価格（米ドル） ¹		238.03	234.86	238.66
クラス（日本円・ヘッジ）P-a-c-c	LU1203193534			
発行済投資証券数（口）		350 518.4110	369 320.1630	267 622.0110
1口当たり純資産価格（日本円）		8 917	9 059	9 628
1口当たり発行・買戻価格（日本円） ¹		8 917	9 059	9 628

¹ 注記1を参照

組入証券の構造

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	54.37	投資信託	69.49
国際機関	28.94	国際機関	28.94
アイルランド	15.12	合計	98.43
合計	98.43		

UBS（Lux）ストラテジー・シキャプ・インカム・サステナブル（米ドル）

純資産変動計算書

	自2023年6月1日 至2023年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	92,024,987.25	13,051,904
発行額	6,515,120.95	924,040
買戻額	(24,152,608.92)	(3,425,565)
純発行（買戻）合計	(17,637,487.97)	(2,501,525)
支払配当金	(109,185.52)	(15,486)
投資純（損）益	(400,877.26)	(56,856)
実現（損）益合計	(1,454,068.93)	(206,231)
未実現評価（損）益の変動合計	3,063,970.44	434,563
運用の結果による純資産の純増（減）	1,209,024.25	171,476
期末現在純資産	75,487,338.01	10,706,369

発行済投資証券数の変動表

	自2023年6月1日 至2023年11月30日
クラスP-a c c	(口)
期首現在発行済投資証券数	492,951.8190
期中発行投資証券数	46,065.8710
期中買戻投資証券数	(47,725.4050)
期末現在発行済投資証券数	491,292.2850

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS（Lux）ストラテジー・シキャブーインカム・サステナブル（米ドル）

最重要数値

	ISIN	2023年5月31日	2023年5月31日	2022年5月31日
純資産額（米ドル）		75 487 338.01	92 024 987.25	99 758 473.54
クラスP-a c c	LU0994951548			
発行済投資証券数（口）		491 292.2850	492 951.8190	547 628.3330
1口当たり純資産価格（米ドル）		116.57	114.88	117.40
1口当たり発行・買戻価格（米ドル） ¹		116.57	114.88	117.40

¹ 注記1を参照

組入証券の構造

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	87.71	投資信託	98.73
アイルランド	11.02	金融・持株会社	0.01
アメリカ合衆国	0.01	合計	98.74
合計	98.74		

UBS（Lux）ストラテジー・シキャプ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ（米ドル）

純資産変動計算書

	自2023年6月1日 至2023年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	516,321,326.56	73,229,854
発行額	2,242,722.69	318,085
買戻額	(75,509,888.09)	(10,709,567)
純発行（買戻）合計	(73,267,165.40)	(10,391,482)
支払配当金	(1,268,088.19)	(179,853)
投資純（損）益	(2,138,841.41)	(303,352)
実現（損）益合計	(1,111,647.06)	(157,665)
未実現評価（損）益の変動合計	18,942,248.29	2,686,579
運用の結果による純資産の純増（減）	15,691,759.82	2,225,562
期末現在純資産	457,477,832.79	64,884,081

発行済投資証券数の変動表

	自2023年6月1日 至2023年11月30日	
	(口)	
クラスP-a c c		
期首現在発行済投資証券数	1,335,171.0590	
期中発行投資証券数	6,205.1210	
期中買戻投資証券数	(253,464.5470)	
期末現在発行済投資証券数	1,087,911.6330	

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS（Lux）ストラテジー・シキャプ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ（米ドル）

最重要数値

	ISIN	2023年5月31日	2023年5月31日	2022年5月31日
純資産額（米ドル）		457 477 832.79	516 321 326.56	826 611 490.70
クラスP-a c c	LU1599185649			
発行済投資証券数（口）		1 087 911.6330	1 335 171.0590	2 768 662.5230
1口当たり純資産価格（米ドル）		105.86	103.61	107.06
1口当たり発行・買戻価格（米ドル） ¹		105.86	103.61	107.06

¹ 注記1を参照

組入証券の構造

地域別分布表		（純資産に対する 百分率 %）		地域別分布表		（純資産に対する 百分率 %）	
ルクセンブルグ	65.06	投資信託	80.13				
アイルランド	23.18	金融・持株会社	8.55				
アメリカ合衆国	3.31	国債・中央政府債	3.31				
日本	1.13	銀行・金融機関	1.00				
イギリス	1.10	医薬品・化粧品・医療品	0.54				
カナダ	0.58	電子機器・半導体	0.36				
フランス	0.58	石油	0.29				
スイス	0.51	保険	0.25				
ドイツ	0.42	インターネット・ソフトウェア・ITサービス	0.23				
オーストラリア	0.35	自動車	0.23				
オランダ	0.27	エネルギー・水道	0.22				
デンマーク	0.16	食品・清涼飲料	0.19				
スウェーデン	0.14	化学	0.17				
スペイン	0.13	通信	0.16				
香港	0.11	交通・運輸	0.15				
イタリア	0.10	機械工学・産業機器	0.14				
シンガポール	0.07	その他のサービス業	0.13				
フィンランド	0.05	建築業・資材	0.13				
ベルギー	0.04	たばこ・アルコール	0.12				
イスラエル	0.03	小売り・百貨店	0.11				
ノルウェー	0.03	不動産	0.10				
ニュージーランド	0.02	電子部品・デバイス	0.10				
ポルトガル	0.01	鉱業・石炭・鉄鋼	0.10				
オーストリア	0.01	各種貿易会社	0.09				
合計	97.39	グラフィックデザイン・出版・メディア	0.08				

地域別分布表(続き)	(純資産に対する
	百分率　%)
航空宇宙産業	0.08
非鉄金属	0.06
バイオテクノロジー	0.05
繊維・衣服・革製品	0.05
宿泊・仕出し・レジャー	0.04
基金属・宝石	0.04
各種資本財	0.04
その他の消費財	0.03
林業・紙・パルプ製品	0.02
時計・宝飾品	0.02
コンピュータハードウェア・ネットワーク装置供給業	0.02
ゴム・タイヤ	0.02
農業・漁業	0.01
その他の非分類会社	0.01
ヘルスケア・社会福祉	0.01
写真・光学	0.01
合計	97.39

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)

純資産変動計算書

	自2023年6月1日 至2023年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	293,356,127.44	41,606,700
発行額	1,233,730.66	174,980
買戻額	(31,443,770.88)	(4,459,670)
純発行 (買戻) 合計	(30,210,040.22)	(4,284,690)
支払配当金	(287,438.58)	(40,767)
投資純 (損) 益	(1,307,781.88)	(185,483)
実現 (損) 益合計	9,543,150.30	1,353,505
未実現評価 (損) 益の変動合計	5,702,768.82	808,824
運用の結果による純資産の純増 (減)	13,938,137.24	1,976,846
期末現在純資産	276,796,785.88	39,258,088

発行済投資証券数の変動表

クラスP-a c c	自2023年6月1日 至2023年11月30日	
	(口)	
期首現在発行済投資証券数	830,170.8430	
期中発行投資証券数	2,654.1140	
期中買戻投資証券数	(84,313.2260)	
期末現在発行済投資証券数	748,511.7310	

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャプ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)

最重要数値

	ISIN	2023年 5月31日	2023年 5月31日	2022年 5月31日
純資産額 (米ドル)		276 796 785.88	293 356 127.44	429 108 307.05
クラス P-a c c	LU1599187934			
発行済投資証券数 (口)		748 511.7310	830 170.8430	1 353 350.1370
1口当たり純資産価格 (米ドル)		115.46	111.21	115.33
1口当たり発行・買戻価格 (米ドル) ¹		115.46	111.21	115.33

¹ 注記 1 を参照

組入証券の構造

(純資産に対する)		(純資産に対する)	
地域別分布表	百分率 (%)	地域別分布表	百分率 (%)
アイルランド	46.41	投資信託	71.14
ルクセンブルグ	29.62	金融・持株会社	6.16
アメリカ合衆国	4.83	国債・中央政府債	4.83
日本	3.35	銀行・金融機関	2.20
イギリス	2.48	医薬品・化粧品・医療品	1.62
フランス	1.72	電子機器・半導体	1.08
カナダ	1.72	石油	0.87
スイス	1.53	保険	0.74
ドイツ	1.26	インターネット・ソフトウェア・ITサービス	0.69
オーストラリア	1.04	自動車	0.67
オランダ	0.79	エネルギー・水道	0.66
デンマーク	0.48	食品・清涼飲料	0.57
スウェーデン	0.43	通信	0.50
スペイン	0.40	化学	0.49
香港	0.31	交通・運輸	0.44
イタリア	0.30	機械工学・産業機器	0.43
シンガポール	0.20	その他のサービス業	0.39
フィンランド	0.15	建築業・資材	0.39
ベルギー	0.12	たばこ・アルコール	0.35
イスラエル	0.10	小売り・百貨店	0.34
ノルウェー	0.10	不動産	0.30
ニュージーランド	0.04	電子部品・デバイス	0.29
オーストリア	0.03	鉱業・石炭・鉄鋼	0.29
ポルトガル	0.03	各種貿易会社	0.26
バミューダ	0.01	グラフィックデザイン・出版・メディア	0.24
マン島	0.01	航空宇宙産業	0.23
マカオ	0.01	非鉄金属	0.17
合計	97.47	繊維・衣服・革製品	0.14

業種別分布表 (続き)	(純資産に対する)	
	百分率	(%)
バイオテクノロジー	0.13	
基金属・宝石	0.12	
各種資本財	0.12	
宿泊・仕出し・レジャー	0.12	
その他の消費財	0.09	
林業・紙・パルプ製品	0.07	
時計・宝飾品	0.07	
コンピュータハードウェア・ネットワーク装置供給業	0.07	
ゴム・タイヤ	0.05	
農業・漁業	0.04	
その他の非分類会社	0.04	
ヘルスケア・社会福祉	0.03	
写真・光学	0.02	
包装業	0.01	
環境サービス・リサイクル	0.01	
合計	97.47	

UBS（Lux）ストラテジー・シキャプ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム（米ドル）

純資産変動計算書

	自2023年6月1日 至2023年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	1,035,849,484.36	146,914,532
発行額	5,528,775.07	784,146
買戻額	(120,050,335.53)	(17,026,739)
純発行（買戻）合計	(114,521,560.46)	(16,242,593)
支払配当金	(1,914,063.19)	(271,472)
投資純（損）益	(4,504,871.62)	(638,926)
実現（損）益合計	9,772,270.78	1,386,001
未実現評価（損）益の変動合計	39,763,347.16	5,639,636
運用の結果による純資産の純増（減）	45,030,746.32	6,386,711
期末現在純資産	964,444,607.03	136,787,179

発行済投資証券数の変動表

	自2023年6月1日 至2023年11月30日
クラスP-a c c	(口)
期首現在発行済投資証券数	2,526,594.0710
期中発行投資証券数	13,021.9350
期中買戻投資証券数	(349,952.9640)
期末現在発行済投資証券数	2,189,663.0420

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS（Lux）ストラテジー・シキャプ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム（米ドル）

最重要数値

	ISIN	2023年5月31日	2023年5月31日	2022年5月31日
純資産額（米ドル）		964 444 607.03	1 035 849 484.36	1 585 129 803.36
クラスP-a-c-c	LU1599186969			
発行済投資証券数（口）		2 189 663.0420	2 526 594.0710	4 333 907.9500
1口当たり純資産価格（米ドル）		111.44	107.68	111.79
1口当たり発行・買戻価格（米ドル） ¹		111.44	107.68	111.79

¹ 注記1を参照

組入証券の構造

地域別分布表	（純資産に対する 百分率 %）	地域別分布表	（純資産に対する 百分率 %）
ルクセンブルグ	45.58	投資信託	75.19
アイルランド	36.98	金融・持株会社	8.22
アメリカ合衆国	4.00	国債・中央政府債	4.00
日本	2.23	銀行・金融機関	1.54
イギリス	1.73	医薬品・化粧品・医療品	1.08
フランス	1.16	電子機器・半導体	0.73
カナダ	1.15	石油	0.58
スイス	1.02	保険	0.50
ドイツ	0.84	インターネット・ソフトウェア・ITサービス	0.46
オーストラリア	0.70	自動車	0.45
オランダ	0.53	エネルギー・水道	0.44
デンマーク	0.32	食品・清涼飲料	0.38
スウェーデン	0.28	通信	0.33
スペイン	0.26	化学	0.33
香港	0.21	交通・運輸	0.29
イタリア	0.20	機械工学・産業機器	0.28
シンガポール	0.15	建築業・資材	0.26
フィンランド	0.10	その他のサービス業	0.26
ベルギー	0.08	たばこ・アルコール	0.23
ノルウェー	0.06	小売り・百貨店	0.23
イスラエル	0.06	不動産	0.20
ニュージーランド	0.03	電子部品・デバイス	0.20
オーストリア	0.02	鉱業・石炭・鉄鋼	0.19
ポルトガル	0.02	各種貿易会社	0.17
バミューダ	0.01	グラフィックデザイン・出版・メディア	0.16
合計	97.72	航空宇宙産業	0.15

業種別分布表（続き）	（純資産に対する	
	百分率	％）
非鉄金属	0.11	
バイオテクノロジー	0.09	
繊維・衣服・革製品	0.09	
各種資本財	0.08	
宿泊・仕出し・レジャー	0.08	
基金属・宝石	0.08	
その他の消費財	0.06	
林業・紙・パルプ製品	0.05	
時計・宝飾品	0.05	
コンピュータハードウェア・ネットワーク装置供給業	0.04	
ゴム・タイヤ	0.03	
農業・漁業	0.03	
その他の非分類会社	0.03	
ヘルスケア・社会福祉	0.02	
写真・光学	0.01	
環境サービス・リサイクル	0.01	
包装業	0.01	
合計	97.72	

UBS (Lux) ストラテジー・シキャプ

財務書類に対する注記

2023年11月30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、以下のように要約される。

a) 純資産額の計算

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、買戻価格および転換価格は、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属するサブ・ファンドの純資産総額を当該サブ・ファンドの投資証券クラスの投資証券数で除することにより営業日毎に計算される。

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各日）を指し、12月24日と31日、個々の法定外休日およびサブ・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除く。

サブ・ファンドの各投資証券クラスに帰属する純資産価額の百分率は、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、投資証券クラスに請求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、為替手形および要求払約束手形および売掛金、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）いずれも総額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、その真正価値を表す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有価証券、派生商品およびその他の投資対象は最新の市場価格で評価される。当該有価証券、派生商品またはその他の投資対象が複数の証券取引所に上場されている場合は、当該投資対象の主要市場である証券取引所の最新価格を適用する。

通常、証券取引所で取引されるものではなく、証券トレーダー間で流通市場が存在し市場に従い価格が決定される有価証券、派生商品およびその他の投資対象の場合、本投資法人はかかる有価証券、派生商品およびその他の投資対象を当該価格を基準に評価することができる。有価証券、派生商品およびその他の投資対象が証券取引所には上場されていないが、定期的に運用され、公認され、公開されたその他の規制された市場で売買されている場合、かかる市場の最新価格で評価する。
- － 証券取引所に上場されておらず、別の規制された市場でも取引されておらず、適当な価格が入手できない有価証券およびその他の投資対象は、予想売却価格に基づいて本投資法人が誠実に選んだその他の原則に従って本投資法人が評価する。
- － 証券取引所に上場されていない派生商品（店頭派生商品）は独立した価格ソースに基づいて評価する。派生商品进行评估する独立した価格ソースが一つしかない場合、派生商品の原資産の市場価格に基づいて本投資法人が認めた計算方法を使って入手評価の妥当性を検証する。
- － 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（UCI）の受益証券は最新の純資産価額で評価する。その他のUCITSおよび／またはUCIの一部の受益証券また

は投資証券は、投資運用会社または投資顧問会社から独立した信頼できるサービス提供会社により提供されたかかる証券の価値の見積り（価値見積り）に基づいて評価することができる。

- － 証券取引所または公開されている他の規制された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の要素を参照する。このプロセスには次の原則が適用される。各短期金融商品には、残余期間に応じた金利が加えられる。このように計算された金利は、裏付けとなる借主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、借主の信用格付けに重大な変更がある場合、調整される。
- － 該当する注文日と該当する評価日の間にサブ・ファンドが得た受取利息は、該当するサブ・ファンドの資産の評価に含まれる。したがって、評価日における投資証券1口当たりの資産価額は、予定される受取利息を含む。
- － 関係するサブ・ファンドの参照通貨以外の通貨で表示され、外国為替取引によるヘッジを行わない有価証券、短期金融商品、派生商品およびその他の資産は、当該通貨のルクセンブルグにおける取引の公示された仲値（買呼値と売呼値の仲値）またはこれが提供されない場合には当該通貨を最も代表する市場における公示された仲値で評価する。
- － 定期預金および信託投資はその名目価値に累積利息を加えて評価する。
- － スワップの価値は、外部のサービス提供会社が計算し、別の外部サービス提供会社が第二の独立した評価を提供する。計算はすべての現金流入額と正味現在価値を基準とする。特別な場合に、内部計算（ブルームバーグ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書の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の評価方針に基づき決定される。

特別な状況により上記の規則に基づく評価が実行不可能または不正確であることが分かった場合、本投資法人は純資産価額を適正に評価するため誠意をもって一般に認められ、証明可能なその他の評価基準を適用する権限を有する。

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。その後、かかる新評価が投資証券の事後の発行および買戻しについて正式なものとなる。

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

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

- (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の調整が必要であると取締役会が確信するその他のあらゆる場合。

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

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

スイング・プライシングの技法は、すべてのサブ・ファンドに適用される。

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

c) 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、評価日の実勢先渡為替レートに基づいて評価される。

d) 金融先物契約の評価

金融先物契約は、評価日に適用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。

e) オプションの評価

規制ある市場で取引される未決済オプションは、決済価格または当該商品の入手可能な直近の市場価格で評価される。公認の証券取引所に上場されているオプション（店頭オプション）は、ブルームバーグのOV（オプション評価）から入手した日足価格に基づき値洗いされ、第三者値付機関と照合される。オプションに係る実現損益およびオプションに係る未実現評価損益は、オプションに係る実現（損）益およびオプションに係る未実現評価（損）益のポジションに基づき、それぞれ運用計算書および純資産変動計算書に開示される。

オプションは投資有価証券に含まれる。

f) 証券の売却に係る実現純（損）益

証券の売却に係る実現損益は、売却証券の平均原価に基づいて計算される。

g) 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。

h) 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。

i) モーゲージ担保证券

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

「モーゲージ担保証券」について、証券の額面価格に適用されるべき要因が、評価日現在1つ以上である場合、財務書類に表示される額面価格はこの要因を反映するよう調整される。その他の場合、表示される額面価格は、1要因についての影響を反映する。

j) 連結財務書類

連結財務書類は、ユーロで表示される。本投資法人の2023年11月30日現在の連結純資産計算書、連結運用計算書および連結純資産変動計算書の各種科目は、各サブ・ファンドの財務書類の対応する科目を決算日現在の実勢為替レートでユーロに換算した金額の合計に等しい。

以下の為替レートが、2023年11月30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 = 0.948766 スイス・フラン

1 ユーロ = 1.091100 米ドル

k) 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。

l) 収益の認識

源泉税控除後の配当金は、当該証券が「配当落ち」として最初に記載される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。

m) スワップ

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

スワップの価値は、外部のサービス提供会社が計算し、別の外部サービス提供会社が第二の独立した評価を提供する。計算はすべての現金流出入額の正味現在価値を基準とする。

特別な場合に、内部計算（ブルームバーグ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書の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の評価方針に基づき決定される。

かかる評価方法は、本投資法人によって認められている。

未実現損益の変動は、運用計算書の「スワップに係る未実現評価（損）益」の変動の項目に反映される。

手仕舞いまたは満期到来により生じたスワップに係る損益は、運用計算書の「スワップに係る実現（損）益」として計上される。

注2－報酬

本投資法人は、以下の表に表示されるようにサブ・ファンドの平均純資産額で計算される各サブ・ファンドの月次定率報酬を請求する。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブーダイナミック・インカム (米ドル)

	上限定率報酬 (年率)	上限定率報酬 (年率) 名称に「ヘッジ」が付く 投資証券クラス
名称に「P」が付く投資証券クラス	1.340%	1.390%

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブーフィクスト・インカム・サステナブル (米ドル)

	上限定率報酬 (年率)	上限定率報酬 (年率) 名称に「ヘッジ」が付く 投資証券クラス
名称に「P」が付く投資証券クラス	1.080%	1.130%

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブーインカム・サステナブル (米ドル)

	上限定率報酬 (年率)	上限定率報酬 (年率) 名称に「ヘッジ」が付く 投資証券クラス
名称に「P」が付く投資証券クラス	1.300%	1.350%

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブー ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ (米ドル)

	上限定率報酬 (年率)	上限定率報酬 (年率) 名称に「ヘッジ」が付く 投資証券クラス
名称に「P」が付く投資証券クラス	1.320%	1.370%

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブー ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)

	上限定率報酬 (年率)	上限定率報酬 (年率) 名称に「ヘッジ」が付く 投資証券クラス
名称に「P」が付く投資証券クラス	1.680%	1.730%

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル)

上限定率報酬 (年率) 上限定率報酬 (年率)

名称に「ヘッジ」が付く

投資証券クラス

名称に「P」が付く投資証券クラス	1.500%	1.550%
------------------	--------	--------

本投資法人は、投資証券クラス「P」「N」「K-1」「F」「Q」「I-A1」「I-A2」および「I-A3」について、サブ・ファンドの平均純資産価額で計算される月次上限定率管理報酬を支払う。当該上限定率管理報酬は以下のとおり用いられる。

- 以下の規定に従い、本投資法人の純資産価額に基づく上限定率管理報酬は、本投資法人の運用、管理事務、ポートフォリオの管理、投資助言および販売（該当する場合）、ならびに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、支払取引の手続き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」の項に記載されているその他一切の職務等）に関して、本投資法人の資産から支払われる。当該報酬は、純資産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（上限定率管理報酬）。関連する上限定率管理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。上限定率管理報酬の概要は、販売目論見書の「サブ・ファンドおよび特別投資方針」の項にて参照することができる。定率管理報酬に適用される実際の最大料率は、年次報告書および半期報告書で参照することができる。

この報酬は「定率報酬」として運用計算書に表示される。

2. 上限定率管理報酬は、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／売呼値スプレッド、仲介手数料）。かかる費用は、通常、各資産の売買時点で計算される。本書の記載にかかわらず、投資証券の発行および買戻しの決済に関する資産の売買によって生じるかかる追加の費用は、販売目論見書の「純資産価額、発行、買戻しおよび転換価格」の項に基づくスイング・プライシングの原理の適用により賄われる。
- 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事務管理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、かつ法律によって許可される一切のその他の報酬。
- d) 本投資法人の設立、販売国における登録、変更、清算および合併に関する法律顧問、税務顧問および公証人に対する報酬ならびに法律で明白に禁止されない限り、本投資法人およびその投資者の利益の全般的な保護に関する手数料。
- e) 本投資法人の純資産価額の公表に関するコストおよび投資者に対する通知に関する一切のコスト（翻訳コストを含む）。
- f) 本投資法人の法的文書に関するコスト（目論見書、K I D、年次報告書および半期報告書ならびに居住国および販売が行われる国で法的に要求されるその他の一切の文書）。
- g) 外国の監督官庁への本投資法人の登録に関するコスト（該当する場合、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により生じた費用（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、投資運用会社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る費用（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、当該コストは、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比率（T E R）の開示において考慮される。
- l) パフォーマンス報酬（該当する場合）

本投資法人の取締役を支払われる報酬、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を含む。）。

これらの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表示される。

3. 管理会社は、本投資法人の販売業務を賄うために手数料を支払うことができる。

本投資法人の所得および資産に賦課されるすべての租税、特に年次税についても、本投資法人が負担する。

定率管理報酬を有していない他のファンドのプロバイダーの報酬規定との一般的な比較可能性の目的のために、「管理報酬の上限」は、定率管理報酬の80%で設定している。

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。

資産運用目的で投資証券クラス「K-B」に対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・ジーまたはその承認された販売会社の一社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、当該サブ・ファンドに請求される。

個々の投資証券クラスに割当てられる費用は、当該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、これらの費用について当該サブ・ファンド／投資証券がその純資産額に比例して負担する。

その投資方針の条項に従ってその他の投資信託（UCIsまたはUCITS）に投資するサブ・ファンドに関して、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・ファンドの資産における対象ファンドの管理報酬の最高限度は、あらゆるトレーラー・フィーを考慮して、投資金額の最高3%までである。

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、または実質的な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もしくは委託によって運用されるファンドの受益証券への投資を行う場合、ターゲット・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請求されない。

本投資法人の現在発生中の費用の詳細は、KIDで参照することができる。

パフォーマンス報酬

パフォーマンス報酬投資証券クラス（「PF」）の場合、投資運用会社は、該当サブ・ファンドの特別投資方針に定められているベンチマークに対する当該投資証券クラスの正味アウトパフォーマンス（投資成果）に対してパフォーマンス報酬を受取る権利を有する。パフォーマンス報酬は5月31日を

末日とする会計年度毎に計算され、各投資証券クラスの最初の計算期間は、当該投資証券クラスの当初募集期間最終日の翌営業日から翌会計年度の5月31日までとなる（以下「計算期間」という。）。パフォーマンス報酬は、各評価日に当該投資証券クラスの費用として発生し計算され、各計算期間終了時に確定し、当該計算期間終了後可能な限り速やかに投資運用会社に支払われる。

各計算期間のパフォーマンス報酬は、計算期間終了時に算出される正味アウトパフォーマンス（以下に定義）の20%に相当する。

正味アウトパフォーマンスとは、計算期間中にベンチマークの実績を上回る投資証券1口当たり純資産価格（パフォーマンス報酬控除前）の実績に相当する。正味アウトパフォーマンスがマイナスの場合、パフォーマンス報酬は支払われず、マイナスの正味アウトパフォーマンスは次の計算期間に繰越される。マイナスの正味アウトパフォーマンスが繰越された場合、正味アウトパフォーマンスは、前回パフォーマンス報酬が支払われた時点より後（またはその時点までにパフォーマンス報酬が一度も支払われていない場合は、当該投資証券クラスの設定日より後）のベンチマークの累積実績を上回る投資証券1口当たり純資産価格（パフォーマンス報酬控除前）の累積実績とする。これは、マイナスの正味アウトパフォーマンスは、翌計算期間以降にパフォーマンス報酬が請求されるまでに相殺されなければならないことを意味する。

計算期間終了時にパフォーマンス報酬が支払われている場合、次の計算期間の開始時における繰越されたマイナスの正味アウトパフォーマンスはゼロとなる。

疑義を避けるため、パフォーマンス報酬は、当該計算期間のベンチマークの実績がプラスかマイナスかに関係なく支払われる可能性があること、またベンチマークの実績がマイナスで、投資証券クラスがプラスの正味アウトパフォーマンスを達成する場合があります、その場合、投資証券クラスの絶対的な実績がマイナスであっても、パフォーマンス報酬が支払われることに留意されたい。

過去の損失をリセットできるパフォーマンス参照期間は、投資証券クラスが存続する全期間にわたる。マイナスの正味アウトパフォーマンスは、上記の場合を除き、リセットまたは調整されない。

投資運用会社が任命する投資顧問会社が投資助言を行う場合、投資運用会社に支払われるパフォーマンス報酬は投資顧問会社と共有されることがある。

ベンチマーク・インデックスの実績に関する情報は、www.ubs.com/fundsを参照のこと。

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、または幾つかの投資証券クラスに関して年率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た収益で構成される。

注5－収益の分配

当該サブ・ファンドの投資主総会は、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、支払は年度末後4ヶ月以内に行われる。

取締役会は、中間分配金を支払い、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

2023年6月1日から2023年11月30日までの会計期間中に、UBS (Lux) ストラテジー・シキャブのために締結された「ソフト・コミッション契約」はなく、「ソフト・コミッション契約」の金額は零である。

注7－金融先物、オプションおよびスワップ契約

2023年11月30日現在、サブ・ファンドごとの金融先物、オプションおよびスワップ契約ならびに関連する通貨は、以下のように要約される。

a) 金融先物

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ	債券に係る金融先物	
	(購入)	(売却)
－フィクスト・インカム・サステナブル (米ドル)	1 068 515.63 米ドル	567 578.13 米ドル
－インカム・サステナブル (米ドル)	1 495 921.88 米ドル	794 609.38 米ドル
－システマティック・アロケーション		
・ポートフォリオ・ディフェンシブ (米ドル)	3 066 914.07 米ドル	49 213 898.47 米ドル
－システマティック・アロケーション		
・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)	12 439 203.16 米ドル	23 729 125.00 米ドル
－システマティック・アロケーション		
・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル)	－ 米ドル	95 980 023.62 米ドル

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ	指数に係る金融先物	
	(購入)	(売却)
ーシステムティック・アロケーション		
・ポートフォリオ・ディフェンシブ (米ドル)	10 379 560.48 米ドル	805 225.52 米ドル
ーシステムティック・アロケーション		
・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)	18 140 888.72 米ドル	7 119 309.78 米ドル
ーシステムティック・アロケーション		
・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル)	41 668 457.97 米ドル	23 610 375.53 米ドル

債券または指数に係る金融先物契約（該当する場合）は、当該金融先物の時価（契約数×想定取引規模×当該先物の市場価格）に基づき計算される。

b) オプション

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ	指数に係るオプション、従来型 (売却)
ーダイナミック・インカム (米ドル)	808 535.76 米ドル
ーインカム・サステナブル (米ドル)	5 160.00 米ドル

c) スワップ

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ	指数に係るスワップおよび先渡しスワップ	
	(購入)	(売却)
ーダイナミック・インカム (米ドル)	ー 米ドル	98 762.57 米ドル
ーシステムティック・アロケーション		
・ポートフォリオ・ディフェンシブ (米ドル)	ー 米ドル	171 924.84 米ドル
ーシステムティック・アロケーション		
・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)	ー 米ドル	102 748.35 米ドル
ーシステムティック・アロケーション		
・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル)	ー 米ドル	502 610.53 米ドル

注8ー総費用比率 (TER)

この比率は、スイス・アセット・マネジメント協会 (AMAS) の「TERの計算ならびに開示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ヶ月のTERは、以下のとおりである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ	総費用比率 (TER)
ーダイナミック・インカム (米ドル) P-a c c	1.47%
ーダイナミック・インカム (米ドル) P-m d i s t	1.47%
ーフィクスト・インカム・サステナブル (米ドル) P-a c c	1.21%
ーフィクスト・インカム・サステナブル (米ドル) (日本円・ヘッジ) P-a c c	1.26%
ーインカム・サステナブル (米ドル) P-a c c	1.42%
ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ ・ディフェンシブ (米ドル) P-a c c	1.60%
ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ ・ダイナミック (米ドル) P-a c c	1.87%
ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ ・ミディアム (米ドル) P-a c c	1.76%

通貨ヘッジに関連して発生した取引費用、利息費用、貸付証券費用およびその他の費用は、TERに含まれていない。

運用が12ヶ月未満の投資証券クラスのTERは、年率換算されている。

注9－後発事象

期末日より後に財務書類の修正または開示を必要とする事象は発生していない。

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、本投資法人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、他の国の投資者の賠償請求に関する件については、本投資法人および／または保管受託銀行は、本投資法人投資証券が売買された国の裁判管轄権に自らを服す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り、ドイツ語版のみが独立監査人によって監査された。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主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、本投資法人および保管受託銀行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。

(2) 【投資有価証券明細表等】

UBS (Lux) ストラテジー・シキャプ・ダイナミック・インカム (米ドル)

2023年11月30日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

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

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			
オーストラリア			
AUD AMPOL LTD NPV	1 625.00	36 881.33	0.01
AUD ANZ GROUP HLDGS LI NPV	23 339.00	377 123.90	0.08
AUD APA GROUP NPV	7 704.00	43 572.41	0.01
AUD ARISTOCRAT LEISURE NPV	630.00	124 608.11	0.03
AUD ASX LTD NPV	1 321.00	50 871.64	0.01
AUD AURIZON HOLDINGS NPV	13 143.00	30 762.07	0.01
AUD BHP GROUP LTD NPV	56 337.00	1 729 501.68	0.39
AUD BLUESCOPE STEEL NPV	976.00	68 560.22	0.01
AUD BRAMBLES LTD NPV	15 813.00	139 867.36	0.03
AUD CARSALES.COM LTD NPV	2 017.00	37 152.19	0.01
AUD CMNWLTH BK OF AUST NPV	12 805.00	888 600.58	0.20
AUD COCHLEAR LTD NPV	503.00	91 062.70	0.02
AUD COLES GROUP LTD NPV	14 729.00	149 713.75	0.03
AUD COMPUTERSHARE LTD NPV(POST REC)	6 246.00	97 778.70	0.02
AUD CSL NPV	3 646.00	633 935.86	0.14
AUD DEXUS NPV (STAPLED)	7 855.00	36 666.13	0.01
AUD ENDEAVOUR GROUP LI NPV	16 971.00	55 475.42	0.01
AUD FORTESCUE LTD NPV	18 567.00	307 648.13	0.07
AUD GOODMAN GROUP (STAPLED SECURITY)	12 576.00	189 701.26	0.04
AUD GPT GROUP NPV (STAPLED SECURITIES)	17 296.00	47 248.62	0.01
AUD IDP EDUCATION LTD NPV	1 788.00	26 864.19	0.01
AUD IGO LTD NPV	7 308.00	41 574.99	0.01
AUD INSURANCE AUST GRP NPV	18 187.00	71 629.81	0.02
AUD MACQUARIE GP LTD NPV	2 837.00	317 995.37	0.07
AUD MEDIBANK PRIVATE L NPV	34 800.00	79 836.52	0.02
AUD MINERAL RESS LTD NPV	1 476.00	59 864.74	0.01
AUD MIRVAC GROUP STAPLED SECURITIES	33 498.00	45 754.35	0.01
AUD NATL AUSTRALIA BK NPV	23 764.00	447 490.85	0.10
AUD NTHN STAR RES LTD NPV	8 739.00	73 762.63	0.02
AUD ORICA LIMITED NPV	3 330.00	34 488.28	0.01
AUD ORIGIN ENERGY NPV	13 469.00	73 588.31	0.02
AUD PILBARA MINERALS L NPV	28 225.00	68 121.09	0.01
AUD QANTAS AIRWAYS NPV	7 434.00	26 124.30	0.01
AUD QBE INS GROUP NPV	11 594.00	118 155.36	0.03
AUD RAMSAY HEALTH CARE NPV	1 277.00	41 624.50	0.01
AUD REA GROUP LIMITED NPV	415.00	42 719.49	0.01
AUD REECE AUSTRALIA NPV	1 998.00	25 621.13	0.01
AUD RIO TINTO LIMITED NPV	194.00	347 715.20	0.08
AUD SANTOS LIMITED NPV	36 851.00	168 839.32	0.04
AUD SCENTRE GROUP NPV STAPLED UNIT	38 068.00	66 888.62	0.01
AUD SEEK LIMITED NPV	2 152.00	34 073.98	0.01
AUD SONIC HEALTHCARE NPV	5 161.00	99 819.77	0.02
AUD SOUL PATTINSON(WH) NPV	2 286.00	50 777.03	0.01
AUD SOUTH32 LTD NPV	33 285.00	67 974.43	0.02
AUD STOCKLAND NPV (STAPLED)	20 431.00	55 948.18	0.01
AUD SUNCORP GROUP LTD NPV	9 278.00	85 940.34	0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ・ダイナミック・インカム (米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
AUD TELSTRA GROUP LTD NPV	46 525.00	117 840.89	0.03
AUD THE LOTTERY CORPOR NPV	15 414.00	47 013.16	0.01
AUD TRANSURBAN GROUP STAPLED UNITS NPV	23 337.00	200 537.83	0.04
AUD TREASURY WINE ESTA NPV	8 368.00	59 367.91	0.01
AUD VICINITY CENTRES NPV (STAPLED SECURITY)	34 618.00	43 496.82	0.01
AUD WESFARMERS LTD NPV	12 417.00	433 554.62	0.10
AUD WESTPAC BKG CORP NPV	26 726.00	378 690.81	0.08
AUD WISETECH GLOBAL LT NPV	1 320.00	58 465.09	0.01
AUD WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	19 534.00	401 512.58	0.09
GBP WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	1 912.00	38 703.74	0.01
AUD WOOLWORTHS GRP LTD NPV	9 502.00	219 880.51	0.05
オーストラリア合計		9 708 988.80	2.18
オーストリア			
EUR ERSTE GROUP BK AG NPV	941.00	38 101.77	0.01
EUR OMV AG NPV(VAR)	1 144.00	48 867.75	0.01
EUR VERBUND AG CLASS 'A' NPV	377.00	35 992.66	0.01
EUR VOESTALPINE AG NPV	536.00	15 100.30	0.00
オーストリア合計		138 062.48	0.03
ベルギー			
EUR AGEAS NPV	1 100.00	47 384.29	0.01
EUR ANHEUSER-BUSCH IN NPV	2 339.00	147 025.50	0.03
EUR ELIA SYS OPERATOR NPV	68.00	7 378.67	0.00
EUR GPE BRUXELLES LAM NPV	297.00	23 558.92	0.01
EUR KBC GROUP NV NPV	776.00	44 536.08	0.01
EUR SA D' IETEREN NV NPV	95.00	16 232.29	0.00
EUR SOFINA NPV	70.00	15 596.18	0.00
EUR SOLVAY SA NPV	176.00	20 384.37	0.01
EUR UCB NPV	306.00	22 650.19	0.01
EUR UMICORE NPV	1 255.00	33 589.68	0.01
EUR WAREHOUSES DE PAUW NPV (POST SPLIT)	608.00	17 102.16	0.00
ベルギー合計		395 438.33	0.09
バミューダ			
EUR AEGON LIMITED EURO.12	314.00	23 657.40	0.00
USD ARCH CAPITAL GROUP COM USD0.01	828.00	69 295.32	0.02
USD EVEREST GROUP LTD COM USD0.01	87.00	35 717.85	0.01
USD LIBERTY GLOBAL LTD COM USD0.01 CLASS C	161.00	2 711.24	0.00
バミューダ合計		131 381.81	0.03
カナダ			
CAD AGNICO EAGLE MINES LTD COM	1 739.00	93 436.70	0.02
CAD BCE INC COM NEW	204.00	8 039.03	0.00
CAD BROOKFIELD ASSET.M CLASS A LTD VOTING SHS	1 300.00	45 552.97	0.01
CAD CANADIAN TIRE LTD CL A	192.00	19 988.05	0.00
CAD FORTIS INC COM NPV	1 733.00	69 481.05	0.02
CAD GREAT WEST LIFE CO INC COM	983.00	31 443.53	0.01
CAD HYDRO ONE INC COM NPV	1 154.00	32 104.50	0.01
CAD IA FINANCIAL CORP COM NPV	341.00	22 788.66	0.01
CAD IGM FINANCIAL INC COM	389.00	9 665.83	0.00
CAD IMPERIAL OIL LTD COM NEW	761.00	42 909.21	0.01
CAD LUNDIN MINING CORP COM	2 381.00	16 507.28	0.00
CAD MAGNA INTL INC COM NPV	990.00	53 419.18	0.01
CAD MANULIFE FINL CORP COM	6 431.00	126 072.93	0.03
CAD NUTRIEN LTD NPV	1 763.00	94 375.14	0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ・ダイナミック・インカム (米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
CAD OPEN TEXT CO COM NPV	918.00	36 757.92	0.01
CAD SUN LIFE FINL INC COM	2 077.00	104 964.44	0.02
CAD SUNCOR ENERGY INC COM NPV ‘NEW’	671.00	154 132.49	0.03
CAD TELUS CORPORATION NPV	1 572.00	28 150.72	0.01
CAD TMX GROUP LTD COM NPV	1 000.00	21 610.06	0.01
カナダ合計		1 011 399.69	0.23
デンマーク			
DKK A.P. MOELLER-MAERSK SER ‘B’ DKK1000	18.00	28 449.54	0.01
DKK A.P. MOLLER-MAERSK ‘A’ DKK1000	11.00	17 079.97	0.00
DKK CARLSBERG SER ‘B’ DKK20	345.00	42 814.81	0.01
デンマーク合計		88 344.32	0.02
フィンランド			
EUR ELISA OYJ NPV	796.00	35 678.62	0.01
EUR FORTUM OYJ EUR3.40	993.00	13 960.42	0.00
EUR KESKO OYJ EUR2 SER ‘B’	1 885.00	36 105.79	0.01
EUR KONE CORPORATION NPV ORD ‘B’	2 019.00	89 857.55	0.02
EUR METSO CORPORATION RG	255.00	41 922.95	0.01
EUR NESTE OIL OYJ NPV	2 498.00	95 067.80	0.02
EUR NOKIA OYJ NPV	13 518.00	47 463.85	0.01
EUR ORION CORP SER ‘B’ NPV	615.00	24 452.21	0.01
EUR SAMPO PLC NPV A	1 229.00	53 839.62	0.01
EUR STORA ENSO OYJ NPV SER ‘R’	3 298.00	42 857.51	0.01
EUR UPM-KYMMENE CORP NPV	3 120.00	109 207.76	0.02
EUR WARTSILA OYJ ABP SER ‘B’ EUR3.50	1 651.00	22 805.80	0.01
フィンランド合計		613 219.88	0.14
フランス			
EUR ACCOR EUR3	612.00	21 241.23	0.01
EUR ADP EUR3	80.00	9 872.27	0.00
EUR AIR LIQUIDE(L’) EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)	1 370.00	259 797.46	0.06
EUR AIRBUS EUR1	1 612.00	239 555.81	0.05
EUR ALSTOM EUR7.00	1 021.00	12 666.33	0.00
EUR AMUNDI EUR2.5 (AIW)	545.00	33 597.70	0.01
EUR ARKEMA EUR10	307.00	31 239.09	0.01
EUR AXA EUR2.29	11 262.00	351 374.45	0.08
EUR BIOMERIEUX NPV (POST SPLIT)	70.00	7 542.99	0.00
EUR BNP PARIBAS EUR2	2 763.00	174 159.76	0.04
EUR BOLLORE EURO.16	3 753.00	21 477.75	0.01
EUR BOUYGUES EUR1	1 119.00	42 623.05	0.01
EUR BUREAU VERITAS EURO.12	931.00	22 561.23	0.01
EUR CAPGEMINI EUR8	418.00	85 743.00	0.02
EUR CARREFOUR EUR2.50	1 457.00	27 653.41	0.01
EUR CIE DE ST-GOBAIN EUR4	2 823.00	184 225.29	0.04
EUR COVIVIO EUR3	169.00	8 264.62	0.00
EUR CREDIT AGRICOLE SA EUR3	2 879.00	37 764.43	0.01
EUR DANONE EURO.25	3 970.00	255 438.40	0.06
EUR DASSAULT AVIATION EURO.80 (POST SUBDIVISION)	79.00	15 722.31	0.00
EUR DASSAULT SYSTEMES EURO.10	1 623.00	76 084.80	0.02
EUR EDENRED EUR2	749.00	40 861.70	0.01
EUR EIFFAGE EUR4	256.00	25 976.91	0.01
EUR ENGIE EUR1	583.00	79 598.13	0.02
EUR ESSILORLUXOTTICA EURO.18	757.00	144 642.59	0.03
EUR EURAZEO NPV	237.00	17 803.97	0.00
EUR GECINA EUR7.50	154.00	17 071.79	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブーダイナミック・インカム (米ドル)

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 GETLINK SE EURO.40	662.00	12 113.11	0.00
EUR HERMES INTL NPV	80.00	166 213.81	0.04
EUR IPSEN EUR1	79.00	8 921.38	0.00
EUR KERING EUR4	206.00	88 490.61	0.02
EUR KLEPIERRE EUR1.40	348.00	8 771.13	0.00
EUR L' OREAL EURO.20	656.00	308 529.04	0.07
EUR LA FRANCAISE DES EURO.40 (PROMESSES)	574.00	20 792.87	0.01
EUR LEGRAND SA EUR4	628.00	60 586.34	0.01
EUR LVMH MOET HENNESSY EURO.30	737.00	565 069.67	0.13
EUR MICHELIN (CGDE) EURO.50 (POST SUBDIVISION)	015.00	134 971.42	0.03
EUR ORANGE EUR4	632.00	57 130.14	0.01
EUR PERNOD RICARD EUR1.55	541.00	93 589.70	0.02
EUR PUBLICIS GROUPE SA EURO.40	1 462.00	123 754.70	0.03
EUR REMY COINTREAU EUR1.60	73.00	8 701.80	0.00
EUR RENAULT SA EUR3.81	416.00	16 335.77	0.00
EUR SAFRAN EURO.20	935.00	164 269.14	0.04
EUR SANOFI EUR2	7 111.00	663 068.08	0.15
EUR SARTORIUS STEDIM B EURO.20 (POST SUBD)	70.00	15 764.21	0.00
EUR SCHNEIDER ELECTRIC EUR8	1 474.00	271 188.41	0.06
EUR SEB SA EUR1	144.00	16 418.87	0.00
EUR SOC GENERALE EUR1.25	1 911.00	48 113.51	0.01
EUR SODEXO EUR4	250.00	26 841.06	0.01
EUR TELEPERFORMANCE EUR2.50	162.00	22 722.27	0.01
EUR THALES EUR3	291.00	43 483.01	0.01
EUR TOTALENERGIES SE EUR2.5	14 023.00	952 608.84	0.21
EUR UNIBAIL-RODAMCO-WE NPV(1 ORD UNIBAIL-R & 1CLS)	407.00	25 925.26	0.01
EUR VEOLIA ENVIRONNEME EUR5	1 946.00	61 384.04	0.01
EUR VINCI EUR2.50	3 350.00	410 477.28	0.09
EUR VIVENDI SA EUR5.50	1 249.00	11 837.14	0.00
EUR WORLDLINE EURO.68	621.00	9 645.26	0.00
フランス合計		6 662 278.34	1.50

ドイツ

EUR ADIDAS AG NPV (REGD)	422.00	88 469.75	0.02
EUR ALLIANZ SE NPV(REGD)(VINKULIERT)	2 510.00	631 535.23	0.14
EUR BASF SE NPV	2 535.00	118 064.09	0.03
EUR BAYER AG NPV (REGD)	2 694.00	92 180.32	0.02
EUR BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG EUR1	1 838.00	191 700.18	0.04
EUR BAYERISCHE MOTORENWERKE AG EUR1	376.00	35 733.09	0.01
EUR BECHTLE AG NPV	232.00	11 512.59	0.00
EUR BEIERSDORF AG NPV	284.00	39 880.58	0.01
EUR BRENNTAG AG	452.00	39 099.09	0.01
EUR CARL ZEISS MEDITEC NPV	44.00	3 952.05	0.00
EUR COMMERZBANK AG NPV	2 874.00	35 262.31	0.01
EUR CONTINENTAL AG ORD NPV	370.00	28 671.27	0.01
EUR COVESTRO AG NPV	451.00	23 718.55	0.01
EUR DAIMLER TRUCK HOLD NPV (YOUNG SHARE)	1 285.00	41 823.55	0.01
EUR DELIVERY HERO SE NPV	397.00	12 607.32	0.00
EUR DEUTSCHE BANK AG NPV(REGD)	896.00	61 037.99	0.01
EUR DEUTSCHE BOERSE AG NPV(REGD)	486.00	92 426.86	0.02
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA ORD NPV (REGD)(VINK)	2 291.00	19 947.69	0.00
EUR DEUTSCHE POST AG NPV(REGD)	6 091.00	286 039.11	0.06
EUR DEUTSCHE TELEKOM NPV(REGD)	8 746.00	209 702.16	0.05
EUR DR.ING. F.PORSCHER NON-VTG PRF NPV	313.00	28 707.69	0.01
EUR E.ON SE NPV	5 540.00	72 143.42	0.02
EUR EVONIK INDUSTRIES NPV	1 440.00	26 945.80	0.01
EUR FRESENIUS MED CARE NPV	1 193.00	48 982.30	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ・ダイナミック・インカム (米ドル)

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 FRESENIUS SE & CO. KGAA NPV	1 237.00	39 262.50	0.01
EUR GEA GROUP AG NPV	1 045.00	38 447.53	0.01
EUR HANNOVER RUECKVERS ORD NPV(REGD)	146.00	34 886.83	0.01
EUR HEIDELBERGCEMENT NPV	957.00	78 104.87	0.02
EUR HELLOFRESH SE NPV	581.00	8 887.68	0.00
EUR HENKEL AG & CO KGAA	692.00	48 383.04	0.01
EUR HENKEL AG&CO. KGAA NON-VTG PRF NPV	1 054.00	83 031.40	0.02
EUR INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)	3 420.00	132 657.03	0.03
EUR KNORR BREMSE AG NPV	272.00	17 064.80	0.00
EUR LEG IMMOBILIEN SE NPV	291.00	22 270.16	0.01
EUR MERCEDES-BENZ ORD NPV(REGD)	2 087.00	135 671.15	0.03
EUR MERCK KGAA NPV	324.00	56 615.65	0.01
EUR MTU AERO ENGINES H NPV (REGD)	161.00	32 981.50	0.01
EUR MUENCHENER RUECKVE NPV(REGD)	831.00	354 339.96	0.08
EUR NEMETSCHEK SE ORD NPV	217.00	18 950.97	0.00
EUR PORSCHE AUTO HL SE NON VTG PRF NPV	898.00	43 954.18	0.01
EUR PUMA SE NPV	336.00	21 695.96	0.00
EUR RATIONAL AG NPV	16.00	10 256.34	0.00
EUR RHEINMETALL AG NPV	106.00	31 921.22	0.01
EUR RWE AG (NEU) NPV	3 852.00	165 468.85	0.04
EUR SAP AG ORD NPV	2 722.00	432 071.85	0.10
EUR SARTORIUS AG NON VTG PRF NPV	59.00	19 022.78	0.00
EUR SCOUT24 AG NPV	314.00	21 926.75	0.01
EUR SIEMENS AG NPV(REGD)	2 018.00	339 083.33	0.08
EUR SIEMENS ENERGY AG NPV	1 512.00	17 949.21	0.00
EUR SIEMENS HEALTHINEE NPV	771.00	44 535.15	0.01
EUR SYMRISE AG NPV (BR)	417.00	46 954.83	0.01
EUR VOLKSWAGEN AG NON VTG PRF NPV	550.00	63 863.17	0.01
EUR VOLKSWAGEN AG ORD NPV	55.00	7 141.25	0.00
EUR VONOVIA SE NPV	1 748.00	48 672.84	0.01
EUR WACKER CHEMIE AG NPV(BR)	156.00	19 114.76	0.00
EUR ZALANDO SE NPV	467.00	11 138.63	0.00
ドイツ合計		4 686 469.16	1.05
香港			
HKD CK ASSET HOLDINGS HKD1	7 500.00	35 578.02	0.01
HKD CK INFRASTRUCTURE HKD1	3 000.00	14 864.99	0.00
HKD CLP HOLDINGS HKD5	5 000.00	38 890.95	0.01
HKD HANG LUNG PROP HKD1	7 000.00	9 356.87	0.00
HKD HENDERSON LAND DEV HKD2	6 000.00	16 324.60	0.00
HKD HKT TRUST AND HKT SHARE STAPLED UNIT	16 000.00	17 064.65	0.01
HKD HONG KONG EXCHANGE HKD1	100.00	145 515.54	0.03
HKD HONGKONG&CHINA GAS HKD0.25	43 400.00	29 839.83	0.01
USD JARDINE MATHESON COM USD0.25(BERMUDA REG)	500.00	19 305.00	0.01
HKD POWER ASSETS HOLDINGS LTD HKD1	5 500.00	28 696.08	0.01
HKD SINO LAND CO HKD1	15 203.00	15 319.21	0.00
HKD SUN HUNG KAI PROP NPV	5 000.00	49 069.82	0.01
HKD SWIRE PROPERTIES LTD HKD1	3 200.00	6 219.48	0.00
HKD WH GROUP LTD USD0.0001	22 000.00	14 140.30	0.00
HKD XINYI GLASS HLDGS HKD0.1	5 152.00	5 930.18	0.00
香港合計		446 115.52	0.10
アイルランド			
USD ACCENTURE PLC SHS CL A 'NEW'	1 320.00	439 744.80	0.10
USD ALLEGION PLC CIM USD0.01	187.00	19 838.83	0.00
USD APTIV PLC COM USD0.01	578.00	47 881.52	0.01
EUR BANK OF IRELAND GR EUR1	2 211.00	20 722.71	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブーダイナミック・インカム (米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
GBP CRH ORD EURO.32	941.00	311 877.24	0.07
GBP DCC ORD EURO.25	633.00	42 807.92	0.01
USD EATON CORP PLC COM USD0.01	810.00	184 428.90	0.04
GBP EXPERIAN ORD USD0.10	3 288.00	120 835.74	0.03
EUR FLUTTER ENTERTAINM ORD EURO.09	452.00	70 647.63	0.02
AUD JAMES HARDIE ID PLC CDFS EURO.5	3 121.00	100 820.15	0.02
USD JAZZ PHARMA PLC COM USD0.0001	135.00	15 961.05	0.00
EUR KERRY GROUP 'A' ORD EURO.125(DUBLIN LIST)	493.00	39 923.85	0.01
EUR KINGSPAN GROUP ORD EURO.13(DUBLIN LISTING)	408.00	32 408.29	0.01
USD MEDTRONIC PLC USD0.0001	7 387.00	585 567.49	0.13
USD PENTAIR PLC COM USD0.01	368.00	23 750.72	0.01
EUR SMURFIT KAPPA GRP ORD EURO.001	1 526.00	57 942.65	0.01
USD STERIS PLC ORD USD0.001	229.00	46 015.26	0.01
USD TRANE TECHNOLOGIES COM USD1	518.00	116 762.38	0.03
アイルランド合計		2 277 937.13	0.51
マン島			
GBP ENTAIN PLC ORD EURO.01	1 952.00	19 838.27	0.00
マン島合計		19 838.27	0.00
イスラエル			
ILS AZRIELI GROUP ILS0.01	114.00	6 621.25	0.00
ILS BANK HAPOLIM B.M. ILS1	608.00	38 988.77	0.01
ILS BK LEUMI LE ISRAEL ILS1	5 776.00	43 349.86	0.01
USD SOLAREDGE TECHNOLO USD0.0001	151.00	11 986.38	0.00
イスラエル合計		100 946.26	0.02
イタリア			
EUR AMPLIFON EURO.02	337.00	10 490.50	0.00
EUR ASSIC GENERALI SPA EUR1	6 338.00	131 427.02	0.03
EUR DAVIDE CAMPARI MIL EURO.01	1 825.00	19 952.40	0.00
EUR ENEL EUR1	21 845.00	154 594.33	0.04
EUR ENI SPA EUR1	6 423.00	106 299.39	0.02
EUR FINECOBANK SPA EURO.33	3 600.00	48 569.23	0.01
EUR INFRASTRUTTURE WIR NPV	619.00	7 645.42	0.00
EUR INTESA SANPAOLO NPV	44 588.00	128 508.89	0.03
EUR MEDIOBANCA SPA EURO.5	1 786.00	20 997.29	0.01
EUR MONCLER SPA NPV	533.00	29 589.58	0.01
EUR NEXI SPA NPV	1 879.00	14 658.76	0.00
EUR POSTE ITALIANE SPA NPV	1 521.00	16 389.85	0.00
EUR PRYSMIAN SPA EURO.10	712.00	27 446.58	0.01
EUR RECORDATI EURO.125	599.00	28 868.14	0.01
EUR SNAM EUR1	11 722.00	59 127.59	0.01
EUR TELECOM ITALIA SPA EURO.55	18 139.00	5 276.41	0.00
EUR TERNA SPA ORD EURO.22	8 808.00	71 078.59	0.02
EUR UNICREDIT SPA NPV (POST REV SPLIT)	5 092.00	138 813.69	0.03
イタリア合計		1 019 733.66	0.23
日本			
JPY アドバンテスト	2 400.00	75 992.83	0.02
JPY イオン	2 000.00	41 411.03	0.01
JPY A G C	1 400.00	50 853.99	0.01
JPY アイシン	900.00	33 184.97	0.01
JPY 味の素	1 500.00	56 069.27	0.01
JPY A N Aホールディングス	200.00	128.93	0.00
JPY アサヒグループホールディングス	1 600.00	59 038.79	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブダイナミック・インカム (米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
JPY 朝日インテック	500.00	9 694.93	0.00
JPY 旭化成	3 400.00	23 608.08	0.01
JPY アステラス製薬	12 800.00	155 632.97	0.04
JPY アズビル	500.00	16 139.62	0.00
JPY バンダイナムコホールディングス	2 100.00	41 805.39	0.01
JPY ベイカレント・コンサルティング	300.00	10 097.74	0.00
JPY ブリヂストン	000.00	164 994.76	0.04
JPY ブラザー工業	1 100.00	18 572.06	0.00
JPY キヤノン	7 000.00	180 261.78	0.04
JPY カプコン	500.00	16 853.25	0.00
JPY 東海旅客鉄道	2 500.00	60 033.15	0.01
JPY 千葉銀行	3 600.00	26 944.91	0.01
JPY 中部電力	2 000.00	24 716.75	0.01
JPY 中外製薬	2 000.00	70 592.21	0.02
JPY コンコルディア・フィナンシャルグループ	5 400.00	25 346.23	0.01
JPY 大日本印刷	600.00	16 855.28	0.00
JPY 第一生命ホールディングス	2 900.00	60 438.33	0.01
JPY ダイフク	1 200.00	22 590.05	0.01
JPY 第一三共	6 400.00	173 166.03	0.04
JPY ダイキン工業	900.00	134 876.72	0.03
JPY 大東建託	200.00	22 051.61	0.00
JPY 大和ハウス工業	3 800.00	107 932.49	0.02
JPY 大和ハウスリート投資法人	8.00	14 275.37	0.00
JPY 大和証券グループ	200.00	27 142.96	0.01
JPY デンソー	6 400.00	100 176.55	0.02
JPY 電通グループ	600.00	16 173.44	0.00
JPY ディスコ	300.00	65 119.90	0.01
JPY 東日本旅客鉄道	1 000.00	54 080.56	0.01
JPY エーザイ	900.00	46 706.13	0.01
JPY ENEOSホールディングス	9 300.00	36 763.42	0.01
JPY ファナック	6 300.00	175 318.43	0.04
JPY ファーストリテイリング	600.00	152 156.12	0.03
JPY 富士電機	500.00	20 972.71	0.00
JPY 富士フイルムホールディングス	1 200.00	70 294.59	0.02
JPY 富士通	600.00	85 717.19	0.02
JPY G L P投資法人	19.00	17 954.48	0.00
JPY 浜松ホトニクス	400.00	15 844.69	0.00
JPY 阪急阪神ホールディングス	800.00	24 194.54	0.01
JPY 光通信	200.00	31 102.24	0.01
JPY ヒロセ電機	200.00	22 389.83	0.01
JPY 日立建機	400.00	10 376.43	0.00
JPY 日立製作所	3 100.00	215 669.50	0.05
JPY 本田技研工業	32 200.00	328 675.89	0.07
JPY ホシザキ	200.00	6 370.62	0.00
JPY HOYA	1 200.00	135 272.43	0.03
JPY ヒューリック	800.00	7 943.99	0.00
JPY イビデン	500.00	23 915.18	0.01
JPY 出光興産	600.00	16 461.60	0.00
JPY 飯田グループホールディングス	1 400.00	20 928.74	0.00
JPY I N P E X	3 100.00	43 825.89	0.01
JPY いすゞ自動車	000.00	52 910.34	0.01
JPY 伊藤忠商事	8 200.00	318 271.05	0.07
JPY 日本航空	500.00	9 507.22	0.00
JPY 日本取引所グループ	1 800.00	36 758.55	0.01
JPY 日本都市ファンド投資法人	35.00	23 319.92	0.01
JPY ゆうちょ銀行	5 200.00	51 336.97	0.01
JPY 日本郵政	8 300.00	73 239.42	0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブダイナミック・インカム (米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
JPY かんぽ生命保険	200.00	3 740.66	0.00
JPY ジャパンリアルエステイト投資法人	7.00	27 226.30	0.01
JPY 日本たばこ産業	8 400.00	215 973.22	0.05
JPY J F Eホールディングス	2 000.00	29 492.34	0.01
JPY J S R	600.00	16 514.36	0.00
JPY 鹿島建設	3 300.00	52 155.78	0.01
JPY 関西電力	2 200.00	29 331.35	0.01
JPY 花王	3 400.00	131 000.10	0.03
JPY 川崎汽船	500.00	17 549.97	0.00
JPY K D D I	10 600.00	331 619.71	0.07
JPY 京成電鉄	300.00	12 094.57	0.00
JPY キーエンス	600.00	257 110.97	0.06
JPY キッコーマン	400.00	24 527.34	0.01
JPY 近鉄グループホールディングス	700.00	19 631.35	0.00
JPY キリンホールディングス	5 700.00	80 467.41	0.02
JPY 神戸物産	400.00	10 563.13	0.00
JPY 小糸製作所	500.00	7 564.18	0.00
JPY 小松製作所	6 600.00	168 398.55	0.04
JPY コナミホールディングス	300.00	14 844.25	0.00
JPY コーセー	100.00	7 078.84	0.00
JPY クボタ	3 700.00	53 034.13	0.01
JPY 京セラ	2 200.00	121 879.12	0.03
JPY 協和キリン	1 100.00	18 133.05	0.00
JPY レーザーテック	300.00	67 047.72	0.02
JPY L I N Eヤフー	9 000.00	26 214.36	0.01
JPY エムスリー	1 500.00	24 813.14	0.01
JPY マキタ	900.00	23 888.80	0.01
JPY 丸紅	5 000.00	78 026.18	0.02
JPY マツモトキヨシ	1 200.00	20 727.16	0.00
JPY マツダ	2 000.00	21 354.89	0.00
JPY 日本マクドナルドホールディングス	200.00	8 536.54	0.00
JPY 明治ホールディングス	1 600.00	37 046.71	0.01
JPY ミネベアミツミ	900.00	17 125.17	0.00
JPY ミスミグループ本社	800.00	12 987.45	0.00
JPY 三菱ケミカルホールディングス	3 900.00	25 549.77	0.01
JPY 三菱商事	3 800.00	177 000.04	0.04
JPY 三菱電機	13 500.00	183 457.91	0.04
JPY 三菱地所	3 100.00	41 865.26	0.01
JPY 三菱HCキャピタル	3 200.00	20 875.17	0.00
JPY 三菱重工業	1 000.00	55 927.22	0.01
JPY 三菱U F Jフィナンシャル・グループ	37 800.00	320 891.54	0.07
JPY 三井物産	8 800.00	320 963.24	0.07
JPY 三井化学	1 100.00	32 203.47	0.01
JPY 三井不動産	3 100.00	72 805.49	0.02
JPY 商船三井	2 400.00	65 927.56	0.01
JPY みずほフィナンシャルグループ	8 230.00	139 843.48	0.03
JPY Mon o t a R O	400.00	039.64	0.00
JPY MS & A Dインシュアランス グループ ホールディングス	3 000.00	112 280.58	0.03
JPY 村田製作所	5 700.00	111 177.67	0.03
JPY 日本電気	900.00	50 164.03	0.01
JPY ネクソン	1 000.00	21 632.23	0.01
JPY ニデック	1 400.00	53 069.98	0.01
JPY 任天堂	7 100.00	331 959.28	0.07
JPY 日本ビルファンド投資法人	6.00	25 203.77	0.01
JPY N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	400.00	21 837.86	0.01
JPY 日本ペイントホールディングス	2 600.00	19 425.03	0.00
JPY 日本プロロジスリート投資法人	4.00	7 586.84	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブーダイナミック・インカム (米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
JPY 日本酸素ホールディングス	400.00	10 506.31	0.00
JPY 日本製鉄	2 500.00	58 460.45	0.01
JPY 日本電信電話	212 900.00	249 284.61	0.06
JPY 日本郵船	3 400.00	91 396.49	0.02
JPY 日産化学	800.00	29 183.89	0.01
JPY 日産自動車	9 100.00	35 880.48	0.01
JPY 日清食品ホールディングス	200.00	19 839.69	0.00
JPY ニトリホールディングス	300.00	34 619.68	0.01
JPY 日東電工	1 000.00	71 126.59	0.02
JPY 野村ホールディングス	9 600.00	39 436.40	0.01
JPY 野村不動産マスターファンド投資法人	11.00	12 634.36	0.00
JPY 野村不動産ホールディングス	900.00	21 940.68	0.01
JPY 野村総合研究所	1 200.00	33 702.44	0.01
JPY NTTデータグループ	2 500.00	30 388.61	0.01
JPY 大林組	000.00	33 753.85	0.01
JPY オービック	200.00	30 703.15	0.01
JPY 小田急電鉄	1 400.00	19 692.91	0.00
JPY 王子ホールディングス	6 500.00	24 147.19	0.01
JPY オリンパス	400.00	64 466.47	0.01
JPY オムロン	500.00	20 965.94	0.00
JPY 小野薬品工業	2 600.00	47 854.70	0.01
JPY オープンハウス	400.00	11 169.21	0.00
JPY 日本オラクル	200.00	15 469.95	0.00
JPY オリエンタルランド	3 800.00	129 164.27	0.03
JPY オリックス	200.00	76 664.53	0.02
JPY 大阪ガス	2 600.00	50 651.06	0.01
JPY 大塚商会	700.00	28 575.78	0.01
JPY 大塚ホールディングス	1 200.00	46 178.51	0.01
JPY パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	1 200.00	26 007.37	0.01
JPY パナソニック	7 000.00	72 445.63	0.02
JPY 楽天グループ	3 400.00	13 470.29	0.00
JPY リクルートホールディングス	700.00	175 016.07	0.04
JPY ルネサスエレクトロニクス	800.00	84 532.08	0.02
JPY りそなホールディングス	8 300.00	43 146.41	0.01
JPY リコー	1 800.00	14 696.11	0.00
JPY ローム	1 600.00	30 580.04	0.01
JPY SBIホールディングス	1 100.00	23 862.41	0.01
JPY SCSK	1 400.00	25 796.33	0.01
JPY セコム	700.00	48 746.91	0.01
JPY セイコーエプソン	1 700.00	25 275.48	0.01
JPY 積水化学工業	2 800.00	39 783.54	0.01
JPY 積水ハウス	500.00	92 200.77	0.02
JPY セブン&アイ・ホールディングス	2 500.00	92 924.55	0.02
JPY SGホールディングス	700.00	10 121.08	0.00
JPY シャープ	600.00	3 756.62	0.00
JPY 島津製作所	700.00	18 158.76	0.00
JPY シマノ	300.00	46 176.48	0.01
JPY 清水建設	3 500.00	23 002.67	0.01
JPY 信越化学工業	6 100.00	215 058.68	0.05
JPY 塩野義製薬	1 000.00	47 201.27	0.01
JPY 資生堂	1 400.00	37 558.09	0.01
JPY しずおかフィナンシャルグループ	900.00	7 281.09	0.00
JPY SMC	200.00	100 720.40	0.02
JPY ソフトバンク	20 500.00	249 394.60	0.06
JPY ソフトバンクグループ	3 300.00	134 379.55	0.03
JPY SOMPOホールディングス	2 100.00	95 983.36	0.02
JPY ソニーグループ	200.00	364 216.87	0.08

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ・ダイナミック・インカム (米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
JPY スクウェア・エニックス・ホールディングス	200.00	6 942.88	0.00
JPY SUBARU	2 400.00	42 550.14	0.01
JPY SUMCO	2 500.00	37 482.67	0.01
JPY 住友化学	500.00	11 490.85	0.00
JPY 住友商事	3 300.00	69 198.77	0.02
JPY 住友電気工業	700.00	58 306.90	0.01
JPY 住友金属鉱山	1 800.00	52 258.26	0.01
JPY 三井住友フィナンシャルグループ	300.00	211 109.69	0.05
JPY 三井住友トラスト・ホールディングス	1 300.00	48 883.55	0.01
JPY 住友不動産	800.00	22 587.34	0.01
JPY サントリー食品インターナショナル	400.00	12 576.18	0.00
JPY スズキ	1 100.00	44 800.62	0.01
JPY シスメックス	600.00	33 203.23	0.01
JPY T&Dホールディングス	1 400.00	20 706.19	0.00
JPY 大成建設	1 300.00	44 240.54	0.01
JPY 武田薬品工業	5 500.00	154 953.16	0.04
JPY TDK	1 300.00	60 411.95	0.01
JPY テルモ	2 300.00	73 402.10	0.02
JPY T I S	700.00	14 806.37	0.00
JPY 東武鉄道	500.00	12 361.75	0.00
JPY 東宝	300.00	10 412.28	0.00
JPY 東京海上ホールディングス	12 200.00	301 049.15	0.07
JPY 東京電力ホールディングス	6 800.00	29 019.65	0.01
JPY 東京エレクトロン	1 600.00	260 019.62	0.06
JPY 東京ガス	1 000.00	23 181.25	0.01
JPY 東急	2 300.00	27 000.71	0.01
JPY TOPPANホールディングス	800.00	18 745.22	0.00
JPY 東レ	700.00	24 387.80	0.01
JPY 東芝	400.00	12 446.31	0.00
JPY 東ソー	1 400.00	18 627.52	0.00
JPY TOTO	400.00	10 273.62	0.00
JPY 豊田自動織機	500.00	43 004.03	0.01
JPY トヨタ自動車	72 900.00	1 378 016.38	0.31
JPY 豊田通商	1 600.00	88 639.36	0.02
JPY トレンドマイクロ	1 000.00	50 826.94	0.01
JPY ユニ・チャーム	1 400.00	45 105.69	0.01
JPY ユー・エス・エス	1 400.00	27 396.76	0.01
JPY 西日本旅客鉄道	800.00	31 640.68	0.01
JPY ヤクルト本社	1 000.00	22 342.48	0.01
JPY ヤマハ	600.00	14 046.74	0.00
JPY ヤマハ発動機	2 000.00	51 097.51	0.01
JPY ヤマトホールディングス	700.00	12 445.97	0.00
JPY 安川電機	900.00	34 536.48	0.01
JPY 横河電機	1 100.00	20 841.48	0.00
JPY ゼンショーホールディングス	300.00	16 668.58	0.00
JPY ZOZO	138.00	2 917.10	0.00
日本合計		15 364 751.06	3.45
ルクセンブルグ			
EUR ARCELORMITTAL NPV(POST STOCK SPLIT)	1 535.00	38 672.02	0.01
EUR EUROFINS SCIENTIFI EURO.01	295.00	17 175.22	0.00
EUR TENARIS S.A. USD1	1 186.00	20 381.20	0.01
ルクセンブルグ合計		76 228.44	0.02
オランダ			
EUR ABN AMRO BANK N.V. DR EACH REP SHS	806.00	10 830.14	0.00
EUR ADYEN NV EURO.01	56.00	65 439.81	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ・ダイナミック・インカム (米ドル)

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 AERCAP HOLDINGS EURO.01	495.00	33 768.90	0.01
EUR AKZO NOBEL NV EURO.50(POST REV SPLIT)	520.00	39 977.03	0.01
EUR ARGEN X NV EURO.10	162.00	72 011.29	0.02
EUR ASM INTL NV EURO.04	117.00	60 088.95	0.01
EUR ASML HOLDING NV EURO.09	1 085.00	737 534.50	0.17
EUR ASR NEDERLAND N.V. EURO.16	387.00	17 848.75	0.00
EUR BE SEMICONDUCTOR EURO.01	201.00	28 170.51	0.01
EUR CNH INDUSTRIAL NV COM EURO.01	3 013.00	32 020.10	0.01
EUR EURONEXT EUR1.60	424.00	35 252.13	0.01
EUR EXOR NV EURO.01	257.00	25 040.85	0.00
EUR FERRARI NV EURO.01(NEW)	319.00	115 068.93	0.03
EUR FERROVIAL SE EURO.01	1 395.00	48 341.40	0.01
EUR HEINEKEN HOLDING EUR1.6	323.00	25 127.92	0.00
EUR HEINEKEN NV EUR1.60	832.00	76 164.02	0.02
EUR IMCD NV EURO.16	150.00	23 166.78	0.00
EUR ING GROEP N.V. EURO.01	9 598.00	134 863.28	0.03
EUR JDE PEETS N.V. EURO.01	235.00	6 312.78	0.00
EUR KON KPN NV EURO.04	22 343.00	76 718.97	0.02
EUR KONINKLIJKE AHOLD EURO.01	6 025.00	174 602.19	0.04
EUR KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20	2 429.00	49 745.79	0.01
EUR NN GROUP N.V. EURO.12	1 698.00	64 640.28	0.01
USD NXP SEMICONDUCTORS EURO.20	568.00	115 917.44	0.03
EUR OCI N.V. EURO.02	634.00	13 655.29	0.00
EUR PROSUS N.V. EURO.05	3 984.00	132 147.05	0.03
EUR QIAGEN NV EURO.01	619.00	25 428.47	0.01
EUR RANDSTAD N.V. EURO.10	593.00	35 262.72	0.01
EUR STELLANTIS N V COM EURO.01	13 662.00	296 671.31	0.07
EUR UNIVERSAL MUSIC GR EUR10.00	2 168.00	57 339.84	0.01
EUR WOLTERS KLUWER EURO.12	659.00	90 814.11	0.02
オランダ合計		2 719 971.53	0.61
ニュージーランド			
NZD EBOS GROUP LIMITED NPV(POST RECON)	333.00	7 610.07	0.00
NZD MERCURY NZ LTD NPV	1 434.00	5 517.97	0.00
NZD SPARK NEW ZEALAND NPV	8 283.00	26 526.44	0.01
AUD XERO LIMITED NPV	1 029.00	70 308.79	0.01
ニュージーランド合計		109 963.27	0.02
ノルウェー			
NOK AKER BP ASA NOK1	1 079.00	31 042.22	0.01
NOK GJENSIDIGE FORSIKR NOK2	764.00	12 907.23	0.00
NOK ORKLA ASA NOK1.25	2 860.00	21 131.33	0.01
NOK YARA INTERNATIONAL NOK1.7	598.00	20 322.06	0.00
ノルウェー合計		85 402.84	0.02
ポルトガル			
EUR EDP ENERGIAS PORTU EUR1(REGD)	9 345.00	44 731.30	0.01
EUR GALP ENERGIA EUR1-B	906.00	13 498.47	0.01
EUR JERONIMO MARTINS EUR5	2 154.00	53 350.21	0.01
ポルトガル合計		111 579.98	0.03
シンガポール			
SGD DBS GROUP HLDGS SGD1	6 400.00	152 207.40	0.03
SGD OVERSEA-CHINESE BK NPV	11 903.00	111 841.47	0.03
SGD SINGAPORE EXCHANGE SGD0.01	2 900.00	20 490.78	0.00
SGD SINGAPORE TECH ENG NPV	6 800.00	18 903.04	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブダイナミック・インカム (米ドル)

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 (%)
SGD UTD O/S BANK SGD1	500.00	91 780.31	0.02
SGD WILMAR INTERNATIONAL LTD	7 800.00	21 215.35	0.01
シンガポール合計		416 438.35	0.09
スペイン			
EUR ACCIONA SA EUR1	27.00	3 815.03	0.00
EUR ACS ACTIVIDADES CO EURO.5	467.00	18 674.78	0.01
EUR AENA SME S.A. EUR10	195.00	33 606.15	0.01
EUR AMADEUS IT GROUP EURO.01	1 145.00	78 481.62	0.02
EUR BANCO SANTANDER SA EURO.50(REGD)	40 487.00	167 910.57	0.04
EUR BBVA(BILB-VIZ-ARG) EURO.49	16 347.00	151 714.81	0.04
EUR CAIXABANK SA EUR1	10 607.00	47 809.30	0.01
EUR CELLNEX TELECOM SA EURO.25	1 550.00	59 259.82	0.01
EUR EDP RENOVAVEIS SA EUR5	1 369.00	25 019.74	0.01
EUR ENAGAS SA EUR1.50	445.00	8 157.06	0.00
EUR ENDESA SA EUR1.2	2 071.00	43 351.74	0.01
EUR GRIFOLS SA EURO.25 (CLASS A) POST SUBD	706.00	9 987.15	0.00
EUR IBERDROLA SA EURO.75 (POST SUBDIVISION)	37 073.00	458 909.23	0.10
EUR INDITEX EURO.03 (POST SUBD)	6 495.00	268 089.66	0.06
EUR NATURGY ENERGY GRO EUR1	523.00	15 647.09	0.00
EUR RED ELECTRICA CORP EURO.5	2 636.00	44 235.03	0.01
EUR REPSOL SA EUR1	3 287.00	50 353.70	0.01
EUR TELEFONICA SA EUR1	12 271.00	52 939.66	0.01
スペイン合計		1 537 962.14	0.35
スウェーデン			
SEK BOLIDEN AB NPV (POST SPLIT)	1 008.00	26 924.63	0.01
SEK ESSITY AB SER ' B ' NPV	2 143.00	53 683.13	0.01
SEK HOLMEN AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	258.00	10 830.79	0.00
SEK HUSQVARNA AB SER ' B ' NPV	1 461.00	11 170.63	0.00
SEK SKANSKA AB SER ' B ' NPV	1 302.00	20 936.17	0.01
SEK SKF AB SER ' B ' NPV	1 188.00	22 345.47	0.01
SEK TELE2 AB SHS	1 596.00	12 528.76	0.00
SEK VOLVO AB SER ' A ' NPV (POST SPLIT)	671.00	15 867.56	0.00
SEK VOLVO AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	5 180.00	120 245.54	0.03
スウェーデン合計		294 532.68	0.07
スイス			
CHF ABB LTD CHF0.12 (REGD)	5 551.00	221 580.37	0.05
CHF ADECCO GROUP AG CHF0.1 (REGD)	646.00	31 254.35	0.01
CHF BALOISE-HLDGS CHF0.1(REGD)	186.00	28 641.71	0.01
USD BUNGE GLOBAL SA COM USD0.01	290.00	31 862.30	0.01
USD CHUBB LIMITED ORD CHF24.15	899.00	206 257.57	0.05
GBP COCA-COLA HBC AG ORD CHF6.70	1 418.00	39 420.77	0.01
EUR DSM FIRMENICH AG EURO.01	545.00	51 657.20	0.01
CHF EMS-CHEMIE HLDG AG CHF0.01(REGD)(POST RECON)	31.00	22 121.21	0.00
USD GARMIN LTD COM CHF10.00	882.00	107 815.68	0.02
GBP GLENCORE XSTRATA ORD USD0.01	75 952.00	424 797.04	0.09
CHF HELVETIA HOLDING CHF0.02 (REGD) POST SUBD	109.00	15 004.66	0.00
CHF HOLCIM LTD CHF2 (REGD)	1 813.00	134 064.63	0.03
CHF KUEHNE&NAGEL INTL CHF1(REGD)(POST-SUBD)	190.00	55 325.17	0.01
CHF NESTLE SA CHF0.10(REGD)	9 354.00	1 068 736.59	0.24
CHF NOVARTIS AG CHF0.49 (REGD)	7 197.00	704 512.26	0.16
CHF PARTNERS GROUP HLG CHF0.01 (REGD)	80.00	106 031.86	0.02
CHF ROCHE HLDGS AG CHF1(BR)	110.00	31 600.25	0.01
CHF ROCHE HLDGS AG GENUSSCHEINE NPV	2 455.00	666 439.83	0.15
CHF SANDOZ GROUP AG CHF0.05	0.20	5.75	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブーダイナミック・インカム (米ドル)

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 (%)
CHF SGS SA CHF0.04	510.00	43 577.71	0.01
EUR STMICROELECTRONICS EUR1.04	1 723.00	81 693.90	0.02
CHF SWISS RE AG CHF0.10	1 074.00	127 526.31	0.03
CHF SWISSCOM AG CHF1(REGD)	92.00	54 001.27	0.01
USD TE CONNECTIVITY LT COM CHF0.57	627.00	82 137.00	0.02
CHF ZURICH INSURANCE GRP CHF0.10	508.00	255 825.66	0.06
スイス合計		4 591 891.05	1.03
イギリス			
GBP 3I GROUP ORD GBP0.738636	7 229.00	204 262.65	0.05
GBP ABRDN PLC ORD GBP0.1396825396	6 993.00	14 425.61	0.00
GBP ADMIRAL GROUP ORD GBP0.001	816.00	27 901.74	0.01
USD AMCOR PLC ORD USD0.01	9 511.00	90 164.28	0.02
GBP ANGLO AMERICAN USD0.54945	8 768.00	237 758.78	0.05
GBP ANTOFAGASTA ORD GBP0.05	2 738.00	48 821.02	0.01
GBP ASHTEAD GROUP ORD GBP0.10	1 524.00	91 892.93	0.02
GBP ASSOCD BRIT FOODS ORD GBP0.0568	1 171.00	35 252.12	0.01
GBP ASTRAZENECA ORD USD0.25	5 483.00	702 866.30	0.16
GBP AUTO TRADER GROUP ORD GBP0.01	3 013.00	27 646.09	0.01
GBP AVIVA ORD GBP0.33	10 268.00	54 269.88	0.01
GBP BAE SYSTEMS ORD GBP0.025	21 559.00	286 572.47	0.06
GBP BARCLAYS ORD GBP0.25	54 948.00	98 109.43	0.02
GBP BARRATT DEVEL ORD GBP0.10	2 673.00	17 386.39	0.00
GBP BERKELEY GP HLDGS ORD GBP0.053943	362.00	21 245.58	0.00
GBP BP ORD USD0.25	61 296.00	371 770.45	0.08
GBP BRIT AMER TOBACCO ORD GBP0.25	7 742.00	246 200.74	0.06
GBP BT GROUP ORD GBP0.05	27 771.00	43 207.58	0.01
GBP BUNZL ORD GBP0.32142857	1 277.00	48 530.88	0.01
GBP BURBERRY GROUP ORD GBP0.0005	2 289.00	42 408.72	0.01
GBP CENTRICA ORD GBP0.061728395	22 902.00	43 213.75	0.01
USD COCA-COLA EUROPACI COM EURO.01	499.00	30 259.36	0.01
GBP COMPASS GROUP ORD GBP0.1105	6 048.00	153 359.01	0.03
GBP CRODA INTL ORD GBP0.10609756	546.00	30 993.80	0.01
GBP DIAGEO ORD GBP0.28 101/108	7 897.00	276 272.83	0.06
GBP ENDEAVOUR MINING P ORD USD0.01	1 177.00	27 401.53	0.01
USD FERGUSON PLC (NEW) ORD GBP0.10	400.00	68 536.00	0.02
GBP GSK PLC ORD GBP0.3125	14 657.00	263 370.09	0.06
GBP HALEON PLC ORD GBP1.25	19 421.00	81 146.14	0.02
GBP HALMA ORD GBP0.10	1 425.00	38 442.79	0.01
GBP HARGREAVES LANSDOW ORD GBP0.004 (WI)	2 817.00	25 619.45	0.01
GBP HIKMA PHARMACEUTIC ORD GBP0.10	1 069.00	23 324.14	0.01
GBP HSBC HLDGS ORD USD0.50(UK REG)	70 773.00	539 451.97	0.12
GBP IMPERIAL BRANDS PL GBP0.10	6 281.00	146 823.20	0.03
GBP INFORMA PLC (GB) ORD GBP0.001	5 356.00	50 378.58	0.01
GBP INTERCONTL HOTELS ORD GBP0.208521303	503.00	38 945.03	0.01
GBP INTERTEK GROUP ORD GBP0.01	653.00	32 942.61	0.01
GBP JD SPORTS FASHION ORD GBP0.0005	11 257.00	22 380.88	0.00
GBP KINGFISHER ORD GBP0.157142857	12 007.00	33 349.38	0.01
GBP LAND SECURITIES GP ORD GBP0.106666666	1 816.00	14 350.14	0.00
GBP LEGAL & GENERAL GP ORD GBP0.025	19 571.00	56 811.15	0.01
GBP LLOYDS BANKING GP ORD GBP0.1	228 560.00	125 778.50	0.03
GBP LONDON STOCK EXCH ORD GBP0.06918604	1 516.00	170 922.19	0.04
GBP M&G PLC ORD GBP0.05	11 476.00	30 392.66	0.01
GBP MELROSE INDUST PLC ORD GBP0.22857142	5 096.00	33 456.35	0.01
GBP MONDI ORD EURO.20	3 509.00	62 502.02	0.01
GBP NATIONAL GRID ORD GBP0.12431289	26 902.00	349 931.43	0.08
GBP NATWEST GROUP PLC ORD GBP1.0769	19 396.00	51 048.52	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブーダイナミック・インカム (米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
GBP NEXT ORD GBP0.10	865.00	86 837.21	0.02
GBP OCADO GROUP PLC ORD GBP0.02	2 194.00	16 664.97	0.00
GBP PEARSON ORD GBP0.25	288.00	50 874.91	0.01
GBP PERSIMMON ORD GBP0.10	930.00	14 734.33	0.00
GBP PHOENIX GP HLDGS ORD GBP0.10	3 366.00	19 823.04	0.00
GBP PRUDENTIAL ORD GBP0.05	10 338.00	112 944.19	0.03
GBP RECKITT BENCK GRP ORD GBP0.10	5 067.00	346 258.42	0.08
GBP RELX PLC GBP0.1444	13 303.00	511 964.36	0.11
GBP RENTOKIL INITIAL ORD GBP0.01	9 997.00	54 255.00	0.01
GBP RIO TINTO ORD GBP0.10	7 928.00	541 868.02	0.12
GBP ROLLS-ROYCE HLDGS ORD GBP0.20	29 127.00	99 115.50	0.02
GBP SAGE GROUP GBP0.01051948	6 629.00	94 871.37	0.02
GBP SAINSBURY(J) ORD GBP0.28571428	5 420.00	19 616.88	0.00
GBP SCHROEDERS PLC ORD GBP0.20	7 288.00	37 052.60	0.01
GBP SEVERN TRENT ORD GBP0.9789	1 203.00	39 611.61	0.01
GBP SHELL PLC ORD EURO.07	23 683.00	767 526.24	0.17
GBP SMITH & NEPHEW ORD USD0.20	6 488.00	84 065.00	0.02
GBP SMITHS GROUP ORD GBP0.375	1 180.00	24 618.17	0.01
GBP SPIRAX-SARCO ENG ORD GBP0.269230769	257.00	30 088.29	0.01
GBP SSE PLC ORD GBP0.50	215.00	97 781.83	0.02
GBP ST JAMES 'S PLACE ORD GBP0.15	3 975.00	32 638.53	0.01
GBP STANDARD CHARTERED ORD USD0.50	8 103.00	67 005.21	0.01
GBP TAYLOR WIMPEY ORD GBP0.01	18 549.00	30 421.07	0.01
GBP TESCO ORD GBP0.0633333	50 775.00	183 708.27	0.04
GBP UNILEVER PLC ORD GBP0.031111	17 903.00	854 330.90	0.19
GBP UNITED UTILITIES G ORD GBP0.05	2 288.00	31 600.75	0.01
GBP VODAFONE GROUP ORD USD0.2095238(POST CONS)	84 734.00	76 514.98	0.02
GBP WHITBREAD ORD GBP0.76797385	679.00	26 569.62	0.01
USD WILLIS TOWERS WATS COM USD0.000304635	219.00	53 939.70	0.01
GBP WISE PLC CLS A ORD GBP0.01	2 469.00	24 404.92	0.01
GBP WPP PLC ORD GBP0.10	3 863.00	34 565.09	0.01
イギリス合計		9 998 368.12	2.25

アメリカ合衆国

USD 3M CO COM	3 064.00	303 550.48	0.07
USD ABBOTT LABS COM	3 649.00	380 554.21	0.09
USD ABBVIE INC COM USD0.01	10 011.00	1 425 466.29	0.32
USD ADOBE INC COM USD0.0001	945.00	577 404.45	0.13
USD ADVANCED MICRO DEV COM USD0.01	3 378.00	409 278.48	0.09
USD AECOM TECHNOLOGY C COM STK USD0.01	172.00	15 283.92	0.00
USD AES CORP COM	1 271.00	21 873.91	0.00
USD AFLAC INC COM USD0.10	3 237.00	267 732.27	0.06
USD AGILENT TECHNOLOGIES INC COM	585.00	74 763.00	0.02
USD AIR PRODS & CHEMS COM USD1	1 263.00	341 704.65	0.08
USD AIRBNB INC USD0.0001 A	907.00	114 590.38	0.03
USD AKAMAI TECHNOLOGIES INC COM	360.00	41 590.80	0.01
USD ALBEMARLE CORP COM USD0.01	247.00	29 953.69	0.01
USD ALBERTSONS COS INC COM USD0.01 CLASS A	600.00	13 062.00	0.00
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQ INC COM	329.00	35 992.60	0.01
USD ALIGN TECHNOLOGY INC COM	171.00	36 559.80	0.01
USD ALLIANT ENERGY CORP COM	1 194.00	60 380.58	0.01
USD ALLSTATE CORP COM	607.00	83 687.09	0.02
USD ALLY FINANCIAL INC COM USD0.01	1 523.00	44 502.06	0.01
USD ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC COM	261.00	43 913.25	0.01
USD ALPHABET INC CAP STK USD0.001 CL C	11 027.00	1 476 735.84	0.33
USD ALPHABET INC CAP STK USD0.001 CL A	12 417.00	1 645 625.01	0.37
USD ALTRIA GROUP INC COM USD0.333333	10 075.00	423 553.00	0.10

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブーダイナミック・インカム (米ドル)

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 AMAZON COM INC COM USD0.01	19 243.00	2 811 209.87	0.63
USD AMER ELEC PWR INC COM USD6.50	2 928.00	232 922.40	0.05
USD AMER EXPRESS CO COM USD0.20	1 319.00	225 245.63	0.05
USD AMER FINL GP OHIO COM NPV	182.00	20 818.98	0.00
USD AMER INTL GRP COM USD2.50	1 453.00	95 621.93	0.02
USD AMER TOWER CORP COM NEW USD0.01	948.00	197 923.44	0.04
USD AMEREN CORP COM	1 437.00	111 496.83	0.02
USD AMERICAN HOMES 4 R COM USD0.01	523.00	18 969.21	0.00
USD AMERICAN WATER WOR COM STK USD0.01	418.00	55 109.12	0.01
USD AMERIPRISE FINL INC COM	223.00	78 832.73	0.02
USD AMETEK INC COM USD0.01	493.00	76 528.39	0.02
USD AMGEN INC COM USD0.0001	2 994.00	807 302.16	0.18
USD AMPHENOL CORP NEW CL A	1 142.00	103 910.58	0.02
USD ANALOG DEVICES INC COM	1 042.00	191 081.96	0.04
USD ANNALY CAPITAL MGT COM USD0.01(POST REV SPLT)	1 222.00	22 081.54	0.00
USD ANSYS INC COM	212.00	62 192.32	0.01
USD AON PLC COM USD0.01 CL A	442.00	145 192.58	0.03
USD APA CORPORATION COM USD0.625	764.00	27 504.00	0.01
USD APOLLO GLOBAL MANA COM USD0.00001	889.00	81 788.00	0.02
USD APPLE INC COM NPV	32 788.00	6 228 080.60	1.40
USD APPLIED MATLS INC COM	1 693.00	253 577.54	0.06
USD ARAMARK COM USD0.01	612.00	17 142.12	0.00
USD ARCHER DANIELS MIDLAND CO COM	1 135.00	83 683.55	0.02
USD ARES MANAGEMNT COR COM USD0.01 CLASS A	400.00	44 900.00	0.01
USD ARISTA NETWORKS IN COM USD0.0001	571.00	125 454.41	0.03
USD ARROW ELECTRS INC COM	116.00	13 752.96	0.00
USD ASPEN TECHNOLOGY COM USD0.10	67.00	12 613.42	0.00
USD ASSURANT INC COM	98.00	16 465.96	0.00
USD AT&T INC COM USD1	14 890.00	246 727.30	0.06
USD ATLISSIAN CORP COM USD0.1 CL A	303.00	57 857.85	0.01
USD ATMOS ENERGY CORP COM	858.00	97 648.98	0.02
USD AUTO DATA PROCESS COM USD0.10	881.00	202 559.52	0.05
USD AUTODESK INC COM USD0.01	460.00	100 477.80	0.02
USD AUTOZONE INC COM USD0.01	39.00	101 787.27	0.02
USD AVALONBAY COMMUNI COM USD0.01	290.00	50 152.60	0.01
USD AVANTOR INC COM USD0.01	1 210.00	25 627.80	0.01
USD AVERY DENNISON CORP COM	201.00	39 094.50	0.01
USD AXON ENTERPRISE I COM USD0.00001	156.00	35 859.72	0.01
USD BAKER HUGHES COMPA COM USD0.0001 CL A	2 104.00	71 010.00	0.02
USD BALL CORP COM NPV	667.00	36 878.43	0.01
USD BATH & BODY WORKS COM USD0.5	588.00	19 180.56	0.00
USD BAXTER INTL INC COM USD1	1 135.00	40 950.80	0.01
USD BECTON DICKINSON COM USD1	609.00	143 833.62	0.03
USD BENTLEY SYSTEMS IN COM USD0.01 CLASS B	542.00	28 216.52	0.01
USD BERKLEY(WR)CORP COM USD0.20	397.00	28 802.35	0.01
USD BERKSHIRE HATHAWAY CLASS 'B' COM USD0.0033	2 678.00	964 080.00	0.22
USD BEST BUY CO INC COM USD0.10	1 102.00	78 175.88	0.02
USD BILL HOLDINGS INC RG	223.00	14 599.81	0.00
USD BIO RAD LABS INC CL A	71.00	21 649.32	0.00
USD BIO-TECHNE CORP COM USD0.01	320.00	20 128.00	0.00
USD BIOGEN INC COM STK USD0.0005	322.00	75 373.76	0.02
USD BIOMARIN PHARMA COM USD0.001	444.00	40 439.52	0.01
USD BK OF AMERICA CORP COM USD0.01	15 122.00	461 069.78	0.10
USD BK OF NY MELLON CP COM STK USD0.01	413.00	213 236.16	0.05
USD BLACKROCK INC COM STK USD0.01	861.00	646 809.03	0.15
USD BLACKSTONE INC COM USD0.00001	3 969.00	445 996.53	0.10
USD BLOCK INC COM USD0.0000001 CL A	1 106.00	70 153.58	0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブダイナミック・インカム (米ドル)

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 BOEING CO COM USD5	1 185.00	274 481.55	0.06
USD BOOKING HLDGS INC COM USD0.008	80.00	250 056.00	0.06
USD BOOZ ALLEN HAMILTO COM USD0.01 CLASS ‘A’	314.00	39 290.82	0.01
USD BORG WARNER INC COM	250.00	8 422.50	0.00
USD BOSTON PPTYS INC COM USD0.01	289.00	16 452.77	0.00
USD BOSTON SCIENTIFIC COM USD0.01	2 997.00	167 502.33	0.04
USD BRISTOL-MYRS SQUIB COM STK USD0.10	437.00	219 099.06	0.05
USD BROADCOM CORP COM USD1.00	2 399.50	2 221 284.51	0.50
USD BROADRIDGE FIN SOL COM STK USD0.01	236.00	45 741.52	0.01
USD BROWN & BROWN INC COM	402.00	30 045.48	0.01
USD BROWN FORMAN CORP CL B	576.00	33 834.24	0.01
USD BUILDERS 1ST SRCE COM USD0.01	207.00	27 760.77	0.01
USD BURLINGTON STORES COM USD0.0001	149.00	25 268.91	0.01
USD CADENCE DESIGN SYS COM USD0.01	592.00	161 775.84	0.04
USD CAESARS ENT INC COM USD0.00001	361.00	16 143.92	0.00
USD CAMDEN PROP TST SBI USD0.01	209.00	18 864.34	0.00
USD CAMPBELL SOUP CO CAP USD0.0375	1 149.00	46 166.82	0.01
USD CAPITAL ONE FINL COM USD0.01	788.00	87 988.08	0.02
USD CARDINAL HEALTH INC COM	528.00	56 538.24	0.01
USD CARLISLE COS INC COM	103.00	28 882.23	0.01
USD CARLYLE GROUP INC COM USD0.01	143.00	902.04	0.00
USD CARMAX INC COM USD0.50	297.00	18 990.18	0.00
USD CARNIVAL CORP COM USD0.01(PAIRED STOCK)	2 081.00	31 339.86	0.01
USD CARRIER GLOBAL COR COM USD0.01	1 710.00	88 851.60	0.02
USD CATALENT INC COM USD0.01	273.00	10 606.05	0.00
USD CATERPILLAR INC DEL COM	1 077.00	270 025.44	0.06
USD CBOE GLOBAL MARKET COM USD0.01	246.00	44 818.74	0.01
USD CBRE GROUP INC CLASS ‘A’ USD0.01	707.00	55 824.72	0.01
USD CDW CORP COM USD0.01	313.00	66 005.44	0.01
USD CELANESE CORP COM SERIES ‘A’ USD0.0001	623.00	86 385.18	0.02
USD CENCORA INC RG	344.00	69 959.28	0.02
USD CENTENE CORP DEL COM	1 154.00	85 026.72	0.02
USD CENTERPOINT ENERGY INC COM	1 195.00	33 782.65	0.01
USD CERIDIAN HCM HLDG COM USD0.01	263.00	18 120.70	0.00
USD CF INDS HLDGS INC COM	444.00	33 366.60	0.01
USD CH ROBINSON WORLDW COM USD0.1	649.00	53 250.45	0.01
USD CHARLES RIV LABS INTL INC COM	108.00	21 284.64	0.00
USD CHARTER COMMUN INC COM USD0.001 CLASS ‘A’	220.00	88 028.60	0.02
USD CHENIERE ENERGY INC COM NEW	500.00	91 075.00	0.02
USD CHESAPEAKE ENERGY COM USD0.01	657.00	52 763.67	0.01
USD CHEVRON CORP COM USD0.75	10 288.00	1 477 356.80	0.33
USD CHEWY INC COM USD0.01 CL A	200.00	3 484.00	0.00
USD CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC CL A	61.00	134 337.25	0.03
USD CHURCH & DWIGHT INC COM	510.00	49 281.30	0.01
USD CIGNA CORP COM USD0.25	624.00	164 037.12	0.04
USD CINCINNATI FINL CORP COM	310.00	31 864.90	0.01
USD CINTAS CORP COM	214.00	118 395.50	0.03
USD CISCO SYSTEMS COM USD0.001	23 037.00	1 114 530.06	0.25
USD CITIGROUP INC COM USD0.01	100.00	189 010.00	0.04
USD CITIZENS FINL GP COM USD0.01	2 412.00	65 775.24	0.01
USD CLEVELAND CLIFFS COM USD0.125	1 321.00	22 668.36	0.00
USD CLOROX CO DEL COM	662.00	94 897.70	0.02
USD CLOUDFLARE INC COM USD0.001 CL A	539.00	41 583.85	0.01
USD CME GROUP INC COM STK USD0.01 CLASS ‘A’	2 025.00	442 179.00	0.10
USD CMS ENERGY CORP COM	1 711.00	97 116.36	0.02
USD COCA-COLA CO COM USD0.25	23 067.00	1 348 035.48	0.30
USD COGNIZANT TECHNOLO COM CL ‘A’ USD0.01	1 023.00	71 998.74	0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブーダイナミック・インカム (米ドル)

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 COINBASE GLOBAL IN COM USD0.00001 CL A	278.00	34 672.16	0.01
USD COLGATE-PALMOLIVE COM USD1	396.00	346 272.92	0.08
USD COMCAST CORP COM CLS 'A' USD0.01	23 403.00	980 351.67	0.22
USD CONAGRA BRANDS IN COM USD5	2 661.00	75 279.69	0.02
USD CONFLUENT INC COM USD0.00001 CL A	400.00	8 488.00	0.00
USD CONOCOPHILLIPS COM USD0.01	2 531.00	292 507.67	0.07
USD CONSOLIDATED EDISON INC COM	2 039.00	183 734.29	0.04
USD CONSTELLATION BRDS CLASS 'A' COM USD0.01	360.00	86 576.40	0.02
USD CONSTELLATION ENE. COM NPV	697.00	84 364.88	0.02
USD COOPER COS INC COM USD0.10	133.00	44 810.36	0.01
USD COPART INC COM	1 796.00	90 195.12	0.02
USD CORNING INC COM USD0.50	481.00	127 663.69	0.03
USD CORTEVA INC COM USD0.01	1 487.00	67 212.40	0.01
USD COSTAR GROUP INC COM	865.00	71 829.60	0.02
USD COSTCO WHSL CORP NEW COM	912.00	540 578.88	0.12
USD COTERRA ENERGY INC COM USD0.10	273.00	112 166.25	0.03
USD CROWDSTRIKE HOLDIN COM USD0.0005 CL A	506.00	119 916.94	0.03
USD CROWN CASTLE INTL COM USD0.01	956.00	112 119.68	0.03
USD CROWN HOLDINGS INC COM USD5	223.00	19 180.23	0.00
USD CSX CORP COM USD1	389.00	141 764.70	0.03
USD CUMMINS INC COM	804.00	180 224.64	0.04
USD CVS HEALTH CORP COM STK USD0.01	7 174.00	487 473.30	0.11
USD D R HORTON INC COM	685.00	87 453.95	0.02
USD DANAHER CORP COM USD0.01	1 458.00	325 585.98	0.07
USD DARDEN RESTAURANTS INC COM	680.00	106 399.60	0.02
USD DARLING INGR INC COM USD0.01	423.00	18 557.01	0.00
USD DATADOG INC COM USD0.00001 CL A	503.00	58 634.71	0.01
USD DAVITA INC COM USD0.001	49.00	971.54	0.00
USD DECKERS OUTDOOR CORP COM	53.00	35 190.41	0.01
USD DEERE & CO COM USD1	573.00	208 806.93	0.05
USD DELL TECHNOLOGIES COM USD0.01 CL C	1 345.00	102 045.15	0.02
USD DELTA AIRLINES INC COM USD0.0001	97.00	3 582.21	0.00
USD DEVON ENERGY CORP NEW COM	1 289.00	57 966.33	0.01
USD DEXCOM INC COM	842.00	97 267.84	0.02
USD DIAMONDBACK ENERGY COM USD0.01	354.00	54 661.14	0.01
USD DICKS SPORTING GOO COM USD0.01	343.00	44 624.30	0.01
USD DIGITAL REALTY TRU COM STK USD0.01	602.00	83 545.56	0.02
USD DISCOVER FINL SVCS COM STK USD0.01	536.00	49 848.00	0.01
USD DOCUSIGN INC COM USD0.0001	528.00	22 756.80	0.01
USD DOLLAR GENERAL CP COM USD0.875	440.00	57 692.80	0.01
USD DOLLAR TREE INC	496.00	61 300.64	0.01
USD DOMINION ENERGY IN COM STK NPV	1 885.00	85 465.90	0.02
USD DOMINOS PIZZA INC COM USD0.01	94.00	36 931.66	0.01
USD DOORDASH INC COM USD0.00001 CLASS A	478.00	44 922.44	0.01
USD DOVER CORP COM	271.00	38 254.36	0.01
USD DOW INC COM USD0.01	1 412.00	73 071.00	0.02
USD DRAFTKINGS INC NEW COM USD0.0001 CL A	967.00	36 978.08	0.01
USD DROPBOX INC COM USD0.00001 CL A	469.00	13 216.42	0.00
USD DTE ENERGY CO COM	1 229.00	127 951.19	0.03
USD DUKE ENERGY CORP COM USD0.001 (POST REV SPLT)	262.00	393 297.36	0.09
USD DUPONT DE NEMOURS COM USD0.01	974.00	69 679.96	0.02
USD DYNATRACE INC COM USD0.001	628.00	33 629.40	0.01
USD EASTMAN CHEM CO COM	735.00	61 615.05	0.01
USD EBAY INC COM USD0.001	920.00	37 729.20	0.01
USD ECOLAB INC COM	585.00	112 162.05	0.03
USD EDISON INTL COM	2 129.00	142 621.71	0.03
USD EDWARDS LIFESCIENCES CORP COM	1 261.00	85 382.31	0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブダイナミック・インカム (米ドル)

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 ELECTRONIC ARTS INC COM	591.00	81 563.91	0.02
USD ELEVANCE HEALTH INC USD0.01	493.00	236 388.57	0.05
USD ELI LILLY AND CO COM NPV	1 687.00	997 084.48	0.22
USD EMERSON ELEC CO COM	3 166.00	281 457.40	0.06
USD ENPHASE ENERGY INC COM USD0.00001	275.00	27 780.50	0.01
USD ENTEGRIS INC COM	302.00	31 528.80	0.01
USD ENTERGY CORP NEW COM	426.00	43 200.66	0.01
USD EOG RESOURCES INC COM USD0.01	1 270.00	156 298.90	0.04
USD EPAM SYS INC COM USD0.001	130.00	33 564.70	0.01
USD EQT CORPORATION	589.00	23 536.44	0.01
USD EQUIFAX INC COM	262.00	57 040.02	0.01
USD EQUINIX INC COM USD0.001 NEW	213.00	173 597.13	0.04
USD EQUITABLE HOLDINGS COM USD0.01	462.00	14 178.78	0.00
USD EQUITY LIFESTYLE PPTYS INC	362.00	25 738.20	0.01
USD ERIE INDTY CO CL A	28.00	8 277.92	0.00
USD ESSENTIAL UTILS IN COM USD0.50	1 488.00	52 987.68	0.01
USD ESSEX PROP TRUST COM USD0.0001	153.00	32 659.38	0.01
USD ESTEE LAUDER COS CLASS 'A' COM USD0.01	522.00	66 654.18	0.01
USD ETSY INC USD0.001	268.00	20 317.08	0.00
USD EVERGY INC COM NPV	1 351.00	68 955.04	0.02
USD EVERSOURCE ENERGY COM USD5	1 983.00	117 810.03	0.03
USD EXACT SCIENCES CORP COM	348.00	22 272.00	0.00
USD EXELON CORP COM NPV	2 094.00	80 639.94	0.02
USD EXPEDIA GROUP INC COM USD0.001	335.00	45 620.30	0.01
USD EXPEDTRS INTL WASH COM USD0.01	317.00	38 147.78	0.01
USD EXTRA SPACE STORAG COM USD0.01	379.00	49 334.43	0.01
USD EXXON MOBIL CORP COM NPV	22 571.00	2 318 944.54	0.52
USD F M C CORP COM NEW	254.00	13 629.64	0.00
USD F5 NETWORK INC COM STK NPV	148.00	25 336.12	0.01
USD FACTSET RESH SYS INC COM	89.00	40 357.94	0.01
USD FAIR ISAAC CORP COM	65.00	70 694.00	0.02
USD FASTENAL COM USD0.01	1 013.00	60 749.61	0.01
USD FEDEX CORP COM USD0.10	484.00	125 273.72	0.03
USD FIDELITY NATL FINL FNF GROUP COM USD0.0001	1 381.00	61 924.04	0.01
USD FIDELITY NATL INF COM STK USD0.01	1 132.00	66 380.48	0.01
USD FIFTH THIRD BANCORP COM	3 983.00	115 307.85	0.03
USD FIRST CTZNS BANCSHARES INC N C CL A	31.00	45 504.59	0.01
USD FIRST HORIZON CORP COM USD0.625	1 307.00	16 716.53	0.00
USD FIRST SOLAR INC COM STK USD0.001	203.00	32 029.34	0.01
USD FIRSTENERGY CORP COM USD0.10	1 120.00	41 372.80	0.01
USD FISERV INC COM USD0.01	1 311.00	171 229.71	0.04
USD FLEETCOR TECHNOLOG COM STK USD0.001	137.00	32 948.50	0.01
USD FORD MOTOR CO COM STK USD0.01	8 782.00	90 103.32	0.02
USD FORTINET INC COM USD0.001	1 365.00	71 744.40	0.02
USD FORTIVE CORP COM USD0.01	782.00	53 942.36	0.01
USD FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC RG	284.00	19 434.12	0.00
USD FOX CORP COM USD0.01 CL A	532.00	15 715.28	0.00
USD FOX CORP COM USD0.01 CL B	94.00	2 600.04	0.00
USD FRANKLIN RES INC COM	1 400.00	34 720.00	0.01
USD FREEPORT-MCMORAN COM STK USD0.10	3 109.00	116 027.88	0.03
USD GALLAGHER ARTHUR J & CO COM	466.00	116 034.00	0.03
USD GAMING & LEISURE P COM USD0.01	513.00	23 972.49	0.01
USD GARTNER INC COM	167.00	72 618.28	0.02
USD GE HEALTHCARE TECH COM USD0.01 WI	908.00	62 161.68	0.01
USD GEN DYNAMICS CORP COM USD1	462.00	114 100.14	0.03
USD GEN ELEC CO COM USD0.01(POST REV SPLIT)	2 237.00	272 466.60	0.06
USD GENERAL MLS INC COM	3 253.00	207 085.98	0.05

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブダイナミック・インカム (米ドル)

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 GENERAL MOTORS CO COM USD0.01	2 976.00	94 041.60	0.02
USD GENUINE PARTS CO COM STK USD1	275.00	36 514.50	0.01
USD GILEAD SCIENCES COM USD0.001	2 573.00	197 091.80	0.04
USD GLOBAL PAYMENTS COM NPV	552.00	64 274.88	0.01
USD GLOBE LIFE INC COM USD1.00	253.00	31 151.89	0.01
USD GODADDY INC COM CL A USD0.001	251.00	25 115.06	0.01
USD GOLDMAN SACHS GRP COM USD0.01	703.00	240 102.62	0.05
USD GRACO INC COM	226.00	18 256.28	0.00
USD GRAINGER W W INC COM	102.00	80 191.38	0.02
USD HALLIBURTON COM STK USD2.50	1 899.00	70 319.97	0.02
USD HARTFORD FINL SVCS COM USD0.01	670.00	52 367.20	0.01
USD HASBRO INC COM	668.00	31 001.88	0.01
USD HCA HEALTHCARE INC COM USD0.01	405.00	101 444.40	0.02
USD HEALTHPEAK PPTYS I COM USD1	1 012.00	17 527.84	0.00
USD HEICO CORP NEW CL A	206.00	28 306.46	0.01
USD HEICO CORP NEW COM	105.00	17 958.15	0.00
USD HENRY JACK & ASSOC COM USD0.01	192.00	30 468.48	0.01
USD HERSHEY COMPANY COM USD1.00	300.00	56 376.00	0.01
USD HESS CORPORATION COM USD1	591.00	83 070.96	0.02
USD HEWLETT PACKARD EN COM USD0.01	7 540.00	127 501.40	0.03
USD HF SINCLAIR CORPOR COM USD0.01	1 028.00	53 949.44	0.01
USD HILTON WORLDWIDE H COM USD0.01	541.00	90 628.32	0.02
USD HOLOGIC INC COM USD0.01	448.00	31 942.40	0.01
USD HOME DEPOT INC COM USD0.05	5 663.00	1 775 293.87	0.40
USD HONEYWELL INTL INC COM USD1	1 386.00	271 545.12	0.06
USD HORMEL FOODS CORP COM USD0.0586	1 745.00	53 379.55	0.01
USD HOST HOTELS & RESO COM STK USD0.01	1 664.00	29 070.08	0.01
USD HOWMET AEROSPACE I COM USD1.00	678.00	35 662.80	0.01
USD HP INC COM USD0.01	5 059.00	148 431.06	0.03
USD HUBBELL INC COM USD0.001	133.00	39 900.00	0.01
USD HUBSPOT INC COM USD0.001	104.00	51 368.72	0.01
USD HUMANA INC COM USD0.166	266.00	128 972.76	0.03
USD HUNT J B TRANS SVCS INC COM	189.00	35 016.03	0.01
USD HUNTINGTON BANCSHARES INC COM	8 987.00	101 193.62	0.02
USD HUNTINGTON INGALLS COM USD0.01	81.00	19 198.62	0.00
USD IDEX CORP COM	208.00	41 949.44	0.01
USD IDEXX LABORATORIES COM USD0.10	178.00	82 915.96	0.02
USD ILLINOIS TOOL WKS COM NPV	619.00	149 927.99	0.03
USD ILLUMINA INC COM USD0.01	365.00	37 211.75	0.01
USD INCYTE CORPORATION COM USD0.001	456.00	24 779.04	0.01
USD INGERSOLL RAND INC COM USD1.00	801.00	57 215.43	0.01
USD INSULET CORP COM STK USD0.001	147.00	27 796.23	0.01
USD INTEL CORP COM USD0.001	8 559.00	382 587.30	0.09
USD INTERCONTINENTAL E COM USD0.01	1 211.00	137 860.24	0.03
USD INTERNATIONAL FLAVORS&FRAGRANC COM	633.00	47 715.54	0.01
USD INTERPUBLIC GROUP COM USD0.10	1 989.00	61 141.86	0.01
USD INTL BUSINESS MCHN COM USD0.20	5 147.00	816 108.32	0.18
USD INTL PAPER CO COM USD1.00	568.00	20 981.92	0.00
USD INTUIT INC COM USD0.01	582.00	332 589.72	0.07
USD INTUITIVE SURGICAL COM USD0.001	731.00	227 224.04	0.05
USD INVITATION HOMES I COM USD0.01	1 190.00	39 698.40	0.01
USD IQVIA HOLDINGS INC COM USD0.01	373.00	79 859.30	0.02
USD IRON MTN INC NEW COM NPV	517.00	33 165.55	0.01
USD JABIL INC COM USD0.001	271.00	31 251.72	0.01
USD JACOBS SOLUTIONS COM USD1.00	263.00	33 448.34	0.01
USD JOHNSON & JOHNSON COM USD1	13 588.00	2 101 520.08	0.47
USD JOHNSON CTLS INTL COM USD0.01	1 412.00	74 553.60	0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブダイナミック・インカム (米ドル)

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 JP MORGAN CHASE & COM USD1	6 054.00	944 908.32	0.21
USD JUNIPER NETWORKS COM USD0.00001	1 509.00	42 931.05	0.01
USD KELLANOVA COM USD0.25	1 402.00	73 661.08	0.02
USD KENVUE INC COM USD0.01	8 600.00	175 784.00	0.04
USD KEURIG DR PEPPER COM USD0.01	1 860.00	58 720.20	0.01
USD KEYCORP NEW COM	2 289.00	28 360.71	0.01
USD KEYSIGHT TECHNOLOG COM USD0.01 ‘WD’	363.00	49 328.07	0.01
USD KIMBERLY-CLARK CP COM USD1.25	1 944.00	240 531.12	0.05
USD KIMCO REALTY COM USD0.01	1 260.00	24 343.20	0.01
USD KINDER MORGAN INC USD0.01	11 357.00	199 542.49	0.04
USD KKR & CO INC COM NPV CLASS A	1 284.00	97 378.56	0.02
USD KLA CORPORATION COM USD0.001	292.00	159 029.04	0.04
USD KNIGHT SWIFT TRANS CL A COM STK USD0.01	348.00	18 715.44	0.00
USD KRAFT HEINZ CO COM USD0.01	1 791.00	62 882.01	0.01
USD KROGER CO COM USD1	1 542.00	68 264.34	0.02
USD L3HARRIS TECHNOLOG COM USD1.00	391.00	74 606.71	0.02
USD LAB CORP AMER HLDG COM USD0.1	198.00	42 948.18	0.01
USD LAM RESEARCH CORP COM USD0.001	296.00	211 912.32	0.05
USD LAMB WESTON HLDGS COM USD1.00 WI	286.00	28 608.58	0.01
USD LAS VEGAS SANDS CORP COM	829.00	38 233.48	0.01
USD LATTICE SEMICONDUCTOR CORP COM	309.00	18 091.95	0.00
USD LEAR CORP COM USD0.01	161.00	21 533.75	0.00
USD LEIDOS HLDGS INC COM USD0.0001	324.00	34 771.68	0.01
USD LENNAR CORP COM CL ‘A’ USD0.10	490.00	62 680.80	0.01
USD LENNOX INTL INC COM	85.00	34 566.10	0.01
USD LIBERTY BROADBAND COM USD0.01 CL ‘C’	264.00	21 943.68	0.00
USD LIBERTY MEDIA CORP COM USD0.01 FORMULA ONE C	534.00	33 994.44	0.01
USD LIBERTY MEDIA CORP COM USD0.01 SER C SIRIUSXM	334.00	9 014.66	0.00
USD LINDE PLC COM EURO.001	1 026.00	424 528.02	0.10
USD LIVE NATION INC COM	268.00	22 570.96	0.00
USD LKQ CORP COM	463.00	20 617.39	0.00
USD LOCKHEED MARTIN CORP COM	1 276.00	571 354.52	0.13
USD LOEWS CORP COM	357.00	25 093.53	0.01
USD LOWE ‘S’ COS INC COM USD0.50	1 209.00	240 385.47	0.05
USD LPL FINL HLDGS INC COM USD0.001	187.00	41 570.10	0.01
USD LUCID GROUP INC COM USD0.0001 CL A	1 400.00	5 908.00	0.00
USD LULULEMON ATHLETIC COM STK USD0.01	230.00	102 764.00	0.02
USD LYONDELLBASELL IND COM USD0.01	1 454.00	138 275.40	0.03
USD M & T BANK CORP COM USD0.50	1 022.00	130 989.74	0.03
USD MANHATTAN ASSOCIAT COM STK USD0.01	68.00	15 167.40	0.00
USD MARATHON OIL CORP COM USD1	1 357.00	34 508.51	0.01
USD MARATHON PETROLEUM COM USD0.01	863.00	128 750.97	0.03
USD MARKEL GROUP INC COM NPV	34.00	48 929.06	0.01
USD MARKETAXESS HLDGS INC COM	88.00	21 130.56	0.00
USD MARRIOTT INTL INC COM USD0.01 CLASS ‘A’	555.00	112 498.50	0.03
USD MARSH & MCLENNAN COM USD1	1 011.00	201 613.62	0.05
USD MARTIN MARIETTA M. COM USD0.01	134.00	62 255.06	0.01
USD MARVELL TECHNOLOGY COM USD0.002	1 643.00	91 564.39	0.02
USD MASCO CORP COM	376.00	22 766.80	0.01
USD MASTERCARD INC COM USD0.0001 CLASS ‘A’	1 786.00	739 100.38	0.17
USD MATCH GRP INC NEW COM NPV	523.00	16 934.74	0.00
USD MCCORMICK & CO INC COM N/VTG NPV	500.00	32 415.00	0.01
USD MCDONALD ‘S’ CORP COM USD0.01	1 547.00	436 006.48	0.10
USD MCKESSON CORP COM USD0.01	282.00	132 697.92	0.03
USD MERCK & CO INC COM USD0.50	14 309.00	1 466 386.32	0.33
USD META PLATFORMS INC	629.00	1 514 377.35	0.34
USD METLIFE INC COM USD0.01	3 754.00	238 867.02	0.05

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブーダイナミック・インカム (米ドル)

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 METTLER TOLEDO INTERNATIONAL COM	53.00	57 872.29	0.01
USD MGM RESORTS INTL COM STK USD0.01	588.00	23 190.72	0.01
USD MICROCHIP TECHN LGY COM USD0.001	1 128.00	94 120.32	0.02
USD MICRON TECHNOLOGY COM USD0.10	2 314.00	176 141.68	0.04
USD MICROSOFT CORP COM USD0.0000125	14 725.00	5 579 449.75	1.25
USD MID-AMER APARTMENT COM STK USD0.01	302.00	37 592.96	0.01
USD MODERNA INC COM USD0.0001	637.00	49 494.90	0.01
USD MOLINA HEALTHCARE INC COM	154.00	56 296.24	0.01
USD MOLSON COORS BEVER COM USD0.01 CLASS B	1 179.00	72 555.66	0.02
USD MONDELEZ INTL INC COM USD0.01	2 714.00	192 856.84	0.04
USD MONGODB INC COM USD0.001 CL A	156.00	64 855.44	0.01
USD MONOLITHIC PWR SYS INC COM	104.00	57 066.88	0.01
USD MONSTER BEV CORP USD0.005(NEW)	1 691.00	93 258.65	0.02
USD MOODYS CORP COM USD0.01	342.00	124 816.32	0.03
USD MORGAN STANLEY COM STK USD0.01	2 499.00	198 270.66	0.04
USD MOSAIC CO COM USD0.01	629.00	22 574.81	0.01
USD MOTOROLA SOLUTIONS COM USD0.01	372.00	120 107.64	0.03
USD MSCI INC COM STK USS0.01	176.00	91 669.60	0.02
USD NASDAQ INC COM STK USD0.01	703.00	39 255.52	0.01
USD NETAPP INC COM USD0.001	1 278.00	116 796.42	0.03
USD NETFLIX INC COM USD0.001	931.00	441 266.07	0.10
USD NEUROCRINE BIOSCIENCES INC COM	232.00	27 048.88	0.01
AUD NEWMONT CORPORATIO CDI 1:1	2 419.00	96 587.94	0.02
USD NEWS CORP NEW COM USD0.01 CL 'A'	644.00	14 193.76	0.00
USD NEXTERA ENERGY INC COM USD0.01	269.00	249 779.19	0.06
USD NIKE INC CLASS 'B' COM NPV	2 601.00	286 812.27	0.06
USD NISOURCE INC COM NPV	613.00	15 717.32	0.00
USD NORDSON CORP COM	112.00	26 358.08	0.01
USD NORFOLK STHN CORP COM USD1	475.00	103 626.00	0.02
USD NORTHERN TRUST CP COM USD1.666	1 258.00	99 696.50	0.02
USD NORTHROP GRUMMAN COM USD1	312.00	148 249.92	0.03
USD NORTONLIFELOCK INC COM USD0.01	3 318.00	73 261.44	0.02
USD NRG ENERGY INC COM USD0.01	1 209.00	57 838.56	0.01
USD NUCOR CORP COM	511.00	86 854.67	0.02
USD NVIDIA CORP COM USD0.001	5 164.00	2 415 202.80	0.54
USD NVR INC COM STK USD0.01	8.00	49 243.12	0.01
USD OCCIDENTAL PETRLM COM USD0.20	1 275.00	75 416.25	0.02
USD OKTA INC COM USD0.0001 CL A	409.00	27 423.45	0.01
USD OLD DOMINION FGHT LINES INC COM	225.00	87 538.50	0.02
USD OMNICOM GROUP INC COM USD0.15	1 090.00	87 886.70	0.02
USD ON SEMICONDUCTOR COM USD0.01	923.00	65 837.59	0.01
USD ONEOK INC	1 153.00	79 384.05	0.02
USD ORACLE CORP COM USD0.01	3 425.00	398 019.25	0.09
USD OREILLY AUTO NEW COM USD0.01	128.00	125 744.64	0.03
USD OTIS WORLDWIDE COR COM USD0.01	783.00	67 173.57	0.02
USD OVINTIV INC COM USD0.01	665.00	29 486.10	0.01
USD OWENS CORNING COM STK USD0.01	251.00	34 030.58	0.01
USD PACCAR INC COM STK USD1	2 972.00	272 889.04	0.06
USD PACKAGING CORP AMER COM	566.00	95 093.66	0.02
USD PALANTIR TECH INC COM USD0.001 CLASS A	3 443.00	69 032.15	0.02
USD PALO ALTO NETWORKS COM USD0.0001	624.00	184 136.16	0.04
USD PARAMOUNT GLOBAL COM USD0.001 CL B	3 403.00	48 901.11	0.01
USD PARKER-HANNIFIN COM STK USD0.50	277.00	119 990.86	0.03
USD PAYCHEX INC COM	1 872.00	228 327.84	0.05
USD PAYCOM SOFTWARE IN COM USD0.01	118.00	21 435.88	0.00
USD PAYLOCITY HLDG COR COM USD0.001	101.00	15 823.67	0.00
USD PAYPAL HOLDINGS IN COM USD0.0001	2 165.00	124 725.65	0.03

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブダイナミック・インカム (米ドル)

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 PEPSICO INC CAP USD0.016666	7 748.00	1 303 910.92	0.29
USD PFIZER INC COM USD0.05	31 869.00	971 048.43	0.22
USD PG&E CORP COM	022.00	69 057.74	0.02
USD PHILIP MORRIS INTL COM STK NPV 'WI'	8 801.00	821 661.36	0.18
USD PHILLIPS 66 COM USD0.01	2 625.00	338 336.25	0.08
USD PINTEREST INC COM USD0.00001 CL A	1 248.00	42 519.36	0.01
USD PIONEER NATURAL RE COM STK USD0.01	491.00	113 735.24	0.03
USD PNC FINANCIAL SVCS COM USD5	2 261.00	302 883.56	0.07
USD POOL CORPORATION COM USD0.001	97.00	33 690.04	0.01
USD PPG INDS INC COM	460.00	65 315.40	0.01
USD PPL CORP COM USD0.01	1 394.00	36 411.28	0.01
USD PRINCIPAL FINL GP COM USD0.01	1 448.00	106 905.84	0.02
USD PROCTER & GAMBLE COM NPV	13 291.00	2 040 434.32	0.46
USD PROGRESSIVE CP(OH) COM USD1	1 191.00	195 359.73	0.04
USD PROLOGIS INC COM USD0.01	1 950.00	224 113.50	0.05
USD PRUDENTIAL FINL COM USD0.01	813.00	79 495.14	0.02
USD PTC INC COM USD0.01	279.00	43 903.44	0.01
USD PUBLIC STORAGE COM USD0.10	334.00	86 425.84	0.02
USD PUBLIC SVC ENTERPRISE GROUP COM	2 746.00	171 432.78	0.04
USD PULTE GROUP INC COM USD0.01	431.00	38 109.02	0.01
USD QORVO INC COM USD 0.0001	199.00	19 203.50	0.00
USD QUALCOMM INC COM USD0.0001	6 292.00	811 982.60	0.18
USD QUANTA SVCS INC COM	296.00	55 739.76	0.01
USD QUEST DIAGNOSTICS INC COM	295.00	40 482.85	0.01
USD RAYMOND JAMES FINANCIAL INC COM	399.00	41 954.85	0.01
USD REALTY INCOME CORP	1 501.00	80 993.96	0.02
USD REGENCY CENTERS COM USD0.01	258.00	16 197.24	0.00
USD REGENERON PHARMACE COM USD0.001	225.00	185 357.25	0.04
USD REGIONS FINANCIAL CORP NEW COM	872.00	81 264.96	0.02
USD RELIANCE STEEL & ALUMINUM CO COM	90.00	24 773.40	0.01
USD REPLIGEN CORP COM	133.00	20 914.25	0.00
USD REPUBLIC SERVICES COM USD0.01	436.00	70 562.24	0.02
USD RESMED INC COM USD0.004	341.00	53 785.93	0.01
USD REVVITY INC COM USD1.00	264.00	23 469.60	0.01
USD RIVIAN AUTOMOTIVE COM USD0.001 CL A	1 178.00	19 743.28	0.00
USD ROBERT HALF INTL COM USD0.001	606.00	49 679.88	0.01
USD ROBINHOOD MARKETS COM USD0.0001 CL A	1 100.00	9 680.00	0.00
USD ROBLOX CORPORATION COM USD0.0001 CL A	951.00	37 383.81	0.01
USD ROCKWELL AUTOMATIO COM USD1	271.00	74 644.24	0.02
USD ROKU INC COM USD0.0001 CLASS A	222.00	23 132.40	0.01
USD ROLLINS INC COM	455.00	18 536.70	0.00
USD ROPER TECHNOLOGIES COM USD0.01	229.00	123 259.25	0.03
USD ROSS STORES INC COM USD0.01	717.00	93 482.46	0.02
USD ROYAL CARIBBEAN GR COM USD0.01	469.00	50 398.74	0.01
USD ROYALTY PHARMA PLC COM USD0.0001 CLASS A	734.00	19 869.38	0.00
USD RPM INTERNATIONAL COM USD0.01	234.00	24 085.62	0.01
USD RTX CORPORATION COM USD1.00	2 981.00	242 891.88	0.05
USD S&P GLOBAL INC COM USD1	679.00	282 348.57	0.06
USD SALESFORCE.COM INC COM USD0.001	2 041.00	514 127.90	0.12
USD SBA COMMUNICATIONS COM USD0.01 CL A	248.00	61 246.08	0.01
USD SCHEIN HENRY INC COM	332.00	22 154.36	0.00
USD SCHLUMBERGER COM USD0.01	2 933.00	152 633.32	0.03
USD SCHWAB(CHARLES)CP COM USD0.01	3 055.00	187 332.60	0.04
USD SEAGATE TECHNOLOGY COM USD0.00001	959.00	75 856.90	0.02
USD SEAGEN INC COM USD0.001	317.00	67 587.57	0.02
USD SEI INVESTMENT COM USD0.01	129.00	7 568.43	0.00
USD SEMPRA ENERGY COM NPV	3 582.00	261 020.34	0.06

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブダイナミック・インカム (米ドル)

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	SERVICENOW INC COM USD0.001	430.00	294 868.20	0.07
USD	SHERWIN-WILLIAMS COM USD1	526.00	146 648.80	0.03
USD	SIMON PROP GROUP COM USD0.0001	655.00	81 802.95	0.02
USD	SIRIUS XM HLDGS IN COM USD0.001	838.00	22 641.84	0.01
USD	SKYWORKS SOLUTIONS INC COM	312.00	30 242.16	0.01
USD	SMITH A O COM	264.00	19 895.04	0.00
USD	SMUCKER(JM)CO COM NPV	663.00	72 750.99	0.02
USD	SNAP INC COM USD0.00001 CL A	1 923.00	26 595.09	0.01
USD	SNAP-ON INC COM USD1	334.00	91 746.46	0.02
USD	SNOWFLAKE INC COM USD0.0001 CLASS A	519.00	97 405.92	0.02
USD	SOUTHERN CO COM	2 157.00	153 103.86	0.03
USD	SOUTHWEST AIRLINES COM USD1	453.00	11 583.21	0.00
USD	SPLUNK INC COM USD0.001	287.00	43 491.98	0.01
USD	SS&C TECH HLDGS COM USD0.01	307.00	17 271.82	0.00
USD	STANLEY BLACK & DE COM USD2.50	355.00	32 269.50	0.01
USD	STARBUCKS CORP COM USD0.001	2 398.00	238 121.40	0.05
USD	STATE STREET CORP COM STK USD1	1 882.00	137 047.24	0.03
USD	STEEL DYNAMICS INC COM	364.00	43 363.32	0.01
USD	STRYKER CORP COM USD0.10	704.00	208 616.32	0.05
USD	SUN COMMUNITIES COM USD0.01	244.00	31 558.96	0.01
USD	SUPER MICRO COMPUT COM STK USD0.001	105.00	28 714.35	0.01
USD	SYNCHRONY FINANCIA COM USD0.001	2 407.00	77 890.52	0.02
USD	SYNOPSYS INC COM USD0.01	311.00	168 944.53	0.04
USD	SYSCO CORP COM USD1	1 003.00	72 386.51	0.02
USD	T ROWE PRICE GROUP COM USD0.20	1 309.00	131 070.17	0.03
USD	T-MOBILE US INC COM USD0.0001	1 114.00	167 601.30	0.04
USD	TAKE TWO INTERACTI COM USD0.01	330.00	52 206.00	0.01
USD	TARGA RESOURCES CO COM USD0.001	420.00	37 989.00	0.01
USD	TARGET CORP COM STK USD0.0833	2 595.00	347 236.95	0.08
USD	TELEDYNE TECHNOLOGIES INC COM	107.00	43 116.72	0.01
USD	TELEFLEX INC COM	105.00	23 697.45	0.01
USD	TERADYNE INC COM USD0.125	309.00	28 499.07	0.01
USD	TESLA INC COM USD0.001	5 967.00	1 432 557.36	0.32
USD	TEXAS INSTRUMENTS COM USD1	5 133.00	783 860.43	0.18
USD	TEXAS PACIFIC LD COM USD0.01	10.00	16 719.50	0.00
USD	TEXTRON INC COM STK USD0.125	385.00	29 514.10	0.01
USD	THE TRADE DESK INC COM USD0.000001 CL A	920.00	64 823.20	0.01
USD	THERMO FISHER SCIE COM USD1	805.00	399 086.80	0.09
USD	TJX COS INC COM USD1	2 322.00	204 591.42	0.05
USD	TOAST INC COM USD0.000001 CLASS A	800.00	11 896.00	0.00
USD	TORO CO COM	137.00	11 371.00	0.00
USD	TRACTOR SUPPLY CO COM USD0.008	253.00	51 361.53	0.01
USD	TRADEWEB MARKETS I COM USD0.00001 CL A	211.00	20 445.90	0.00
USD	TRANSDIGM GROUP INC COM	122.00	117 470.14	0.03
USD	TRANSUNION COM USD0.01	437.00	25 660.64	0.01
USD	TRAVELERS CO INC COM NPV	472.00	85 252.64	0.02
USD	TRIMBLE INC COM NPV	512.00	23 756.80	0.01
USD	TRUIST FINL CORP COM USD5	7 351.00	236 261.14	0.05
USD	TWILIO INC COM USD0.001 CL A	334.00	21 603.12	0.00
USD	TYLER TECHNOLOGIES INC COM	86.00	35 160.24	0.01
USD	TYSON FOODS INC CL A	1 502.00	70 353.68	0.02
USD	UBER TECHNOLOGIES COM USD0.00001	3 783.00	213 285.54	0.05
USD	UDR INC	476.00	15 898.40	0.00
USD	UIPATH INC COM USD0.00001 CL A	800.00	15 808.00	0.00
USD	ULTA BEAUTY INC COM STK USD0.01	109.00	46 432.91	0.01
USD	UNION PACIFIC CORP COM USD2.50	1 301.00	293 076.27	0.07
USD	UNITED PARCEL SERVICE INC CL B	080.00	618 568.80	0.14

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブーダイナミック・インカム (米ドル)

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 UNITED RENTALS INC COM	162.00	77 115.24	0.02
USD UNITEDHEALTH GRP COM USD0.01	1 939.00	1 072 208.83	0.24
USD UNITY SOFTWARE INC COM USD0.000005	363.00	10 712.13	0.00
USD UNIVERSAL HEALTH S CLASS 'B' COM USD0.01	106.00	14 572.88	0.00
USD US BANCORP COM USD0.01	8 450.00	322 114.00	0.07
USD UTD THERAPEUTIC COM USD0.01	113.00	27 120.00	0.01
USD VAIL RESORTS INC COM	98.00	21 296.38	0.00
USD VALERO ENERGY CORP NEW COM	1 979.00	248 087.44	0.06
USD VEEVA SYSTEMS INC COM USD0.00001 CL 'A'	283.00	49 329.73	0.01
USD VERALTO CORPORATIO COM USD0.01 WI	485.00	37 466.25	0.01
USD VERISIGN INC COM	197.00	41 803.40	0.01
USD VERISK ANALYTICS I CL A USD0.001	290.00	70 014.70	0.02
USD VERIZON COMMUN COM USD0.10	23 730.00	909 570.90	0.20
USD VERTEX PHARMACEUTI COM USD0.01	535.00	189 823.35	0.04
USD VF CORP COM NPV	662.00	11 075.26	0.00
USD VIATRIS INC COM USD0.01	2 492.00	22 876.56	0.01
USD VICI PPTYS INC COM USD0.01	2 116.00	63 247.24	0.01
USD VISA INC COM STK USD0.0001	3 352.00	860 391.36	0.19
USD VISTRA CORP COM USD0.01	603.00	21 352.23	0.00
USD VMWARE INC COM STK USD0.01 CLASS 'A'	228.00	32 490.00	0.01
USD VONTIER CORP COM USD0.0001	0.80	26.98	0.00
USD VULCAN MATERIALS COM STK USD1	254.00	54 244.24	0.01
USD WABTEC CORP COM	375.00	43 710.00	0.01
USD WALGREENS BOOTS AL COM USD0.01	228.00	84 306.32	0.02
USD WALMART INC COM USD0.10	3 044.00	473 920.36	0.11
USD WALT DISNEY CO. DISNEY COM USD0.01	3 738.00	346 475.22	0.08
USD WARNER BROS DISCOV COM USD0.01 SER A WI	716.00	49 282.20	0.01
USD WASTE CONNECTIONS COM NPV (POST REV SPLT)	540.00	73 164.60	0.02
USD WASTE MGMT INC DEL COM	846.00	144 657.54	0.03
USD WATERS CORP COM	156.00	43 775.16	0.01
USD WATSCO INC COM	149.00	56 952.27	0.01
USD WEBSTER FINL CORP CONN COM	393.00	17 626.05	0.00
USD WEC ENERGY GROUP COM USD0.01	1 748.00	146 167.76	0.03
USD WELLS FARGO & CO COM USD1 2/3	7 616.00	339 597.44	0.08
USD WELLTOWER INC COM USD1	1 082.00	96 406.20	0.02
USD WEST PHARMACEUTICA COM USD0.25	158.00	55 420.08	0.01
USD WESTERN DIGITAL CORP COM	794.00	38 358.14	0.01
USD WESTROCK CO COM USD0.01	606.00	24 949.02	0.01
USD WEYERHAEUSER CO COM USD1.25	1 499.00	46 993.65	0.01
USD WHIRLPOOL CORP COM	160.00	17 424.00	0.00
USD WILLIAMS COS INC COM USD1	2 643.00	97 235.97	0.02
USD WOLFSPEED INC COM USD0.00125	345.00	12 716.70	0.00
USD WORKDAY INC COM USD0.001 CL A	438.00	118 575.36	0.03
USD WP CAREY INC COM USD0.001	368.00	22 904.32	0.01
USD WYNN RESORTS LTD COM	288.00	24 312.96	0.01
USD XCEL ENERGY INC COM	3 045.00	185 257.80	0.04
USD XYLEM INC COM USD0.01 WI	503.00	52 880.39	0.01
USD YUM BRANDS INC COM	587.00	73 697.85	0.02
USD ZEBRA TECHNOLOGIES CORP CL A	129.00	30 570.42	0.01
USD ZILLOW GROUP INC COM USD0.0001 CLASS C WI	254.00	10 398.76	0.00
USD ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC COM USD0.01	449.00	52 223.19	0.01
USD ZOETIS INC COM USD0.01 CL 'A'	959.00	169 426.53	0.04
USD ZOOM VIDEO COMMUNI COM USD0.001 CL A	503.00	34 118.49	0.01
USD ZOOMINFO TECHNOLOG COM USD0.01 CLASS A	516.00	7 414.92	0.00
USD ZSCALER INC COM USD0.001	194.00	38 320.82	0.01
アメリカ合衆国合計		108 040 233.49	24.28

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ・ダイナミック・インカム (米ドル)

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 (%)
ウルグアイ			
USD MERCADOLIBRE INC COM STK USD0.001	99.00	160 425.54	0.04
ウルグアイ合計		160 425.54	0.04
株式合計		170 807 902.14	38.39

投資信託、クローズド・エンド型

イギリス			
GBP SEGRO PLC REIT	049.00	41 632.01	0.01
イギリス合計		41 632.01	0.01

アメリカ合衆国			
USD EQUITY RESIDENTIAL SBI USD0.01	766.00	43 539.44	0.01
USD VENTAS INC REIT	910.00	41 714.40	0.01
アメリカ合衆国合計		85 253.84	0.02
投資信託、クローズド・エンド型合計		126 885.85	0.03

財務省証券 (T-bill)、ゼロ・クーポン

米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 20.04.23-18.04.24	5 240 000.00	5 135 085.82	1.15
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 29.12.22-28.12.23	5 130 000.00	5 109 663.09	1.15
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 23.03.23-21.03.24	4 810 000.00	4 732 416.19	1.06
米ドル合計		14 977 165.10	3.36
財務省証券 (T-bill)、ゼロ・クーポン合計		14 977 165.10	3.36

財務省証券 (T-note)、固定利付債

米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.50000% 09-15.02.39	340 000.00	300 740.63	0.07
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.12500% 12-15.02.42	120 000.00	96 848.44	0.02
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.12500% 18-15.11.28	300 000.00	283 734.38	0.06
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.00000% 16-15.11.26	565 000.00	526 840.43	0.12
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 17-15.02.27	560 000.00	523 818.74	0.12
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.37500% 17-15.05.27	240 000.00	224 400.00	0.05
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.87500% 20-15.11.30	470 000.00	373 503.13	0.08
米ドル合計		2 329 885.75	0.52
財務省証券 (T-note)、固定利付債合計		2 329 885.75	0.52
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		188 241 838.84	42.30

他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券および短期金融商品

財務省証券 (T-bill)、ゼロ・クーポン

米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 23.02.23-22.02.24	4 770 000.00	4 712 279.61	1.06
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 26.01.23-25.01.24	4 750 000.00	4 711 659.14	1.06
米ドル合計		9 423 938.75	2.12
財務省証券 (T-bill)、ゼロ・クーポン合計		9 423 938.75	2.12
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		9 423 938.75	2.12

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブダイナミック・インカム (米ドル)

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
譲渡性のある証券および短期金融商品

新株引受権

アメリカ合衆国			
USD ABIONED INC RIGHTS 22-PRP	127.00	129.54	0.00
アメリカ合衆国合計		129.54	0.00
新株引受権合計		129.54	0.00
公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で 取引されていない譲渡性のある証券および短期金融商品合計		129.54	0.00

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 NEUBERGER BERMAN EUROPE LTD-STRATEGIC INC FD-I-ACC	1 986 699.00	25 767 486.03	5.79
USD PIMCO GIS DIVERSIFIED INCOME FUND-INSTITUTIONAL CLASS-USD-ACC	693 057.00	17 194 744.17	3.86
アイルランド合計		42 962 230.20	9.65

ルクセンブルグ

USD UBS (LUX) BD SICAV-ASIAN INVEST GR BDS SUSTAIN (USD) U-X-ACC	559.00	6 693 499.54	1.50
USD UBS (LUX) BD SICAV-USD INVES GRA CORPOR SUSTAI (USD) U-X-ACC	3 570.00	41 567 009.40	9.34
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD U-X-ACC	1 215.00	26 553 812.85	5.97
USD UBS (LUX) BOND SICAV - ASIAN HIGH YIELD U-X-ACC	540.00	4 176 446.40	0.94
USD UBS (LUX) BOND SICAV-SHORT DURATION H Y SUST (USD) I-X-ACC	185 006.00	26 154 298.22	5.88
USD UBS (LUX) EMERGING ECONOMIES FUND-GLOBAL BONDS (USD)-U-X ACC	1 217.00	15 643 464.04	3.52
USD UBS (LUX) INST SICAV - EMG MKTS EQTY PASS (USD) U-X-ACC	1 877.71	25 197 011.92	5.66
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD SUSTAINABLE U-X-ACC	738.00	8 842 029.66	1.99
EUR UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - EUR SUSTAINABLE U-X-ACC	386.00	4 386 968.40	0.99
USD UBS (LUX) SICAV 1 - MEDIUM TERM USD CORP BDS (USD) U-X-ACC	837.00	8 787 336.57	1.97
USD UBS LUX BOND SICAV-EMERGING ECONOMIES CORP USD-I-X-ACC	125 811.00	15 365 297.43	3.45
ルクセンブルグ合計		183 367 174.43	41.21

シンガポール

USD ISHS SOUTHEAST AS TRST - ISH BAR CAP USD AS HI YI BD IDX ETF	2 609 048.00	16 228 278.56	3.65
シンガポール合計		16 228 278.56	3.65
投資信託、オープン・エンド型合計		242 557 683.19	54.51
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		242 557 683.19	54.51

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派生商品

指数に係るオプション、従来型

豪ドル			
AUD RBC/S&P/ASX 200 INDEX CALL 7149.05600 06.12.23	-900.00	-5 589.77	0.00
AUD UBS/S&P/ASX 200 INDEX CALL 7268.76180 20.12.23	-870.00	-5 663.95	0.00
豪ドル合計		-11 253.72	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブダイナミック・インカム (米ドル)

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 (%)
ユーロ			
EUR GS/EURO STOXX 50 CALL 4300.50190 06.12.23	-1 430.00	-134 689.94	-0.03
EUR GS/EURO STOXX 50 PUT 4094.92020 06.12.23	-230.00	-197.45	0.00
EUR TDB/EURO STOXX 50 PUT 4229.21940 13.12.23	-210.00	-1 345.69	0.00
EUR GOLDMAN SACHS/EURO STOXX 50 PUT 4264.97960 20.12.23	-250.00	-3 729.79	0.00
EUR UBS/EURO STOXX 50 CALL 4473.87660 20.12.23	-1 370.00	-19 678.84	-0.01
EUR BNP/EURO STOXX 50 PUT 4283.11940 03.01.24	-180.00	-5 249.80	0.00
ユーロ合計	-164 891.51	-0.04	
英ポンド			
GBP TDB/FTSE 100 INDEX CALL 7586.76300 06.12.23	-420.00	-3 674.15	0.00
GBP RBC/FTSE 100 INDEX CALL 7678.65630 20.12.23	-430.00	-10 860.44	0.00
英ポンド合計	-14 534.59	0.00	
日本円			
JPY UBS/TOPIX INDEX (TOKYO) CALL 2398.14250 06.12.23	-366 300.00	-15 537.06	-0.01
JPY RBC/TOPIX INDEX (TOKYO) CALL 2461.55070 20.12.23	-348 990.00	-10 833.60	0.00
日本円合計	-26 370.66	-0.01	
米ドル			
USD GS/S&P 500 INDEX PUT 4295.12440 06.12.23	-460.00	-211.00	0.00
USD MORGAN STANLEY/S&P 500 INDEX CALL 4505.49780 06.12.23	-4 580.00	-317 484.68	-0.07
USD RBC/MSCI EM INDEX CALL 999.05890 06.12.23	-12 760.00	-28 933.30	-0.01
USD GOLDMAN SACHS/S&P 500 INDEX CALL 4628.96060 13.12.23	-4 580.00	-68 925.34	-0.01
USD GOLDMAN SACHS/S&P 500 INDEX PUT 4412.82240 13.12.23	-400.00	-2 240.20	0.00
USD BNP/MSCI EM INDEX CALL 1025.37330 20.12.23	-12 170.00	-32 840.75	-0.01
USD GOLDMAN SACHS/S&P 500 INDEX CALL 4684.20540 20.12.23	-4 280.00	-38 038.50	-0.01
USD GOLDMAN SACHS/S&P 500 INDEX PUT 4465.48760 20.12.23	-550.00	-8 854.07	0.00
USD GS/S&P 500 INDEX PUT 4459.56840 03.01.24	-430.00	-10 418.26	0.00
USD MORGAN STANLEY/S&P 500 INDEX CALL 4682.54680 03.01.24	-4 510.00	-83 539.18	-0.02
米ドル合計		-591 485.28	-0.13
指数に係るオプション、従来型合計		-808 535.76	-0.18
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 取引されていない派生商品合計		-808 535.76	-0.18
投資有価証券合計		439 415 054.56	98.75

派生商品

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派生商品

指数に係るスワップおよび先渡スワップ			
USD UBS/FTSE EEPRA NAREIT DVLPD TR EQS REC PERF 22-04.12.23	18 871 727.12	-98 762.57	-0.02
USD UBS/FTSE EEPRA NAREIT DVLPD TR EQS PAYER 3ML 22-04.12.23			
指数に係るスワップおよび先渡スワップ合計		-98 762.57	-0.02
公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で 取引されていない派生商品合計		-98 762.57	-0.02
派生商品合計		-98 762.57	-0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブダイナミック・インカム (米ドル)

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／購入額／売却通貨／売却額／満期日 (日-月-年)			
USD 11 319 568.64	AUD 17 589 561.22	7.12.2023	-344 866.68 -0.08
USD 9 027 498.70	JPY 1 355 164 411.00	7.12.2023	-145 798.03 -0.04
USD 2 446 400.40	SGD 3 315 000.00	7.12.2023	-38 001.21 -0.01
USD 268 655.60	NOK 3 000 000.00	7.12.2023	-9 710.77 0.00
USD 2 749 771.37	CAD 3 784 991.00	7.12.2023	-41 981.10 -0.01
USD 1 123 091.36	SEK 12 250 000.00	7.12.2023	-46 138.93 -0.01
USD 4 230 059.99	GBP 3 448 496.81	7.12.2023	-135 672.60 -0.03
USD 104 117.35	ILS 400 000.00	7.12.2023	-3 302.69 0.00
USD 231 406.11	NZD 390 000.00	7.12.2023	-9 479.47 0.00
USD 2 996 611.17	HKD 23 407 627.54	7.12.2023	-637.83 0.00
USD 258 047.20	DKK 1 800 000.00	7.12.2023	-5 435.48 0.00
USD 24 644 058.65	EUR 23 071 980.07	7.12.2023	-534 315.89 -0.12
USD 4 225 127.82	CHF 3 794 000.00	7.12.2023	-140 160.35 -0.03
SGD 70 420 500.00	USD 51 897 464.54	11.1.2024	967 542.44 0.22
USD 148 811.16	SGD 200 000.00	11.1.2024	-1 329.80 0.00
EUR 285 000.00	USD 311 672.30	7.12.2023	-652.76 0.00
USD 438 625.15	SGD 586 000.00	11.1.2024	-1 287.86 0.00
SGD 206 600.00	USD 154 537.94	11.1.2024	557.67 0.00
GBP 175 000.00	USD 221 056.48	7.12.2023	490.25 0.00
JPY 33 000 000.00	USD 222 074.80	7.12.2023	1 306.80 0.00
CHF 155 000.00	USD 176 235.50	7.12.2023	2 103.90 0.00
USD 164 344.62	SGD 219 500.00	11.1.2024	-435.08 0.00
USD 1 451 335.90	EUR 1 330 000.00	7.12.2023	-88.64 0.00
先渡為替契約合計			-487 294.11 -0.11
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			5 590 303.63 [*] 1.26
その他の資産および負債			554 791.68 0.12
純資産総額			444 974 093.19 100.00

* 2023年11月30日現在、250,000.00米ドルの現金額が取引相手方であるユービーエス・エイ・ジーの担保として使用される。

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・フィクスト・インカム・サステナブル(米ドル)

2023年11月30日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

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

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 (%)
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD AFRICAN DEVELOPMENT BANK 0.87500% 21-23.03.26	250 000.00	229 175.32	0.42
USD EUROPEAN BANK FOR RECONSTR & DEVT 0.50000% 20-19.05.25	300 000.00	280 850.64	0.51
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.37500% 17-07.07.27	250 000.00	232 545.12	0.42
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 3.12500% 18-18.09.28	250 000.00	235 521.18	0.43
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.00000% 19-23.07.26	150 000.00	140 230.46	0.26
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 1.50000% 22-13.01.27	350 000.00	319 145.34	0.58
USD INTERN BK FOR RECONSTR & DEVELP 3.50000% 23-12.07.28	450 000.00	432 219.29	0.79
USD INTERNATIONAL BK FOR RECONST & DEV 0.87500% 21-15.07.26	250 000.00	227 144.56	0.41
USD INTERNATIONAL DEVELOPMENT ASSOC-REG-S 0.75000% 20-10.06.27	100 000.00	87 644.45	0.16
USD INTERNATIONAL DEVELOPMENT ASSOC-REG-S 0.37500% 20-23.09.25	125 000.00	115 334.92	0.21
USD INTERNATIONAL DEVELOPMENT ASSOC-REG-S 0.87500% 21-28.04.26	175 000.00	159 813.19	0.29
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 1.62500% 20-15.01.25	350 000.00	336 765.34	0.61
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.50000% 20-28.10.25	550 000.00	507 151.39	0.92
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.75000% 20-24.11.27	100 000.00	86 496.66	0.16
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 4.62500% 23-01.08.28	400 000.00	402 782.75	0.73
米ドル合計		3 792 820.61	6.90
ノート、固定利付債合計		3 792 820.61	6.90

中期債券、固定利付債

米ドル			
USD AFRICAN DEVELOPMENT BANK 0.87500% 21-22.07.26	250 000.00	226 805.00	0.41
USD AFRICAN DEVELOPMENT BANK 3.37500% 22-07.07.25	50 000.00	48 793.10	0.09
USD AFRICAN DEVELOPMENT BANK 4.37500% 22-03.11.27	200 000.00	199 002.51	0.36
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.00000% 15-22.01.25	150 000.00	144 794.18	0.26
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.00000% 16-24.04.26	100 000.00	93 982.44	0.17
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.62500% 17-12.01.27	150 000.00	141 682.84	0.26
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.50000% 17-02.11.27	150 000.00	139 309.25	0.25
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.75000% 18-19.01.28	100 000.00	93 465.93	0.17
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 0.37500% 20-03.09.25	300 000.00	277 550.19	0.51
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 0.50000% 21-04.02.26	375 000.00	342 667.95	0.62
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.00000% 21-14.04.26	400 000.00	367 394.99	0.67
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.25000% 21-09.06.28	275 000.00	239 001.32	0.43
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.5000% 22-20.01.27	300 000.00	273 447.30	0.50
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.87500% 22-06.05.25	150 000.00	145 597.97	0.26
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 3.12500% 22-20.08.27	400 000.00	381 379.66	0.69
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 4.25000% 23-09.01.26	250 000.00	247 700.91	0.45
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 3.75000% 23-25.04.28	300 000.00	291 283.59	0.53
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 4.50000% 23-25.08.28	350 000.00	350 528.08	0.64
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 4.62500% 23-13.06.25	200 000.00	199 042.50	0.36
USD EUROPEAN BANK FOR RECONSTR & DEVT 1.50000% 20-13.02.25	100 000.00	95 795.89	0.17
USD EUROPEAN BANK FOR RECONSTR & DEVT 0.50000% 20-25.11.25	125 000.00	114 903.56	0.21
USD EUROPEAN BANK FOR RECONSTRUCTION & DEV 0.50000% 21-28.01.26	100 000.00	91 380.00	0.17
USD EUROPEAN BANK FOR RECONSTR & DEVT 4.37500% 23-09.03.28	300 000.00	298 807.18	0.54
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.00000% 16-02.06.26	200 000.00	187 405.31	0.34
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 1.75000% 20-14.03.25	200 000.00	191 748.07	0.35
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.87500% 20-03.04.25	200 000.00	189 230.59	0.34
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.87500% 21-20.04.26	425 000.00	389 106.70	0.71
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 4.50000% 23-15.05.26	200 000.00	199 262.69	0.36

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・フィクスト・インカム・サステナブル(米ドル)

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	INTERNATIONAL BK FOR RECONSTR & DEVE	1.37500% 21-20.04.28	550 000.00	482 768.00	0.88
USD	INTERNATIONAL DEVELOPMENT ASSOC-REG-S	4.87500% 23-01.11.28	225 000.00	228 460.59	0.42
USD	INTERNATIONAL FINANCE CORP	1.37500% 19-16.10.24	100 000.00	96 690.97	0.18
USD	INTERNATIONAL FINANCE CORP	0.37500% 20-16.07.25	225 000.00	209 229.99	0.38
USD	INTERNATIONAL FINANCE CORP	0.75000% 21-08.10.26	200 000.00	179 818.11	0.33
USD	INTERNATIONAL FINANCE CORP	3.62500% 22-15.09.25	200 000.00	195 780.28	0.36
USD	INTERNATIONAL FINANCE CORP	4.50000% 23-13.07.28	225 000.00	225 462.85	0.41
USD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK	1.87500% 16-27.10.26	100 000.00	92 736.99	0.17
USD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK	2.50000% 17-22.11.27	300 000.00	278 381.87	0.51
USD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK	2.12500% 15-03.03.25	100 000.00	96 451.20	0.18
米ドル合計			8 046 850.55	14.64	
中期債券、固定利付債合計			8 046 850.55	14.64	

債券、固定利付債

米ドル

USD	AFRICAN DEVELOPMENT BANK	4.37500% 23-14.03.28	100 000.00	99 506.96	0.18
USD	ASIAN DEVELOPMENT BANK	0.62500% 20-29.04.25	450 000.00	423 429.24	0.77
USD	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK	2.12500% 15-15.01.25	275 000.00	266 034.50	0.48
USD	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK	0.62500% 20-15.07.25	350 000.00	326 716.49	0.59
USD	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK	0.62500% 20-16.09.27	275 000.00	238 398.51	0.43
USD	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK	4.00000% 23-12.01.28	200 000.00	196 309.29	0.36
USD	INTERNATIONAL BANK RECONSTRUCTION & DLP	3.12500% 22-15.06.27	400 000.00	381 984.08	0.70
USD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK	2.50000% 14-25.11.24	300 000.00	292 269.43	0.53
USD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK	2.50000% 15-29.07.25	400 000.00	384 774.01	0.70
USD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK	0.75000% 20-11.03.25	300 000.00	284 153.39	0.52
USD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK	0.62500% 20-22.04.25	675 000.00	635 956.86	1.16
USD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK	0.37500% 20-28.07.25	300 000.00	278 533.18	0.51
USD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK	1.12500% 21-13.09.28	300 000.00	257 298.45	0.47
米ドル合計			4 065 364.39	7.40	
債券、固定利付債合計			4 065 364.39	7.40	
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			15 905 035.55	28.94	

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	FEDERATED HERMES SDG ENGAGEMENT HIGH-M- USD	665 390.00	1 383 279.27	2.52	
USD	NEUBERGER BERMAN GLOBAL HIGH YIELD SDG ENGAGEMENT FU-I4- USD	137 077.00	1 424 230.03	2.59	
USD	RECORD UCITS ICAV-RECORD EM SUSTAINABLE FINANCE FUND-A-USD	15 250.00	1 687 549.75	3.07	
EUR	XTRACKERS (IE) PLC - XTRACKERS USD CORPORATE GRE EN-1C- EUR	68 666.00	1 906 002.26	3.47	
EUR	XTRACKERS USD CORPORATE GREEN BOND-ACCUM SHS-1C-HEDGED EUR	77 198.00	1 906 562.75	3.47	
アイルランド合計			8 307 624.06	15.12	

ルクセンブルグ

USD	FOCUSED FUND - CORPORATE BOND SUSTAINABLE USD U-X-ACC	492.00	4 676 927.40	8.51	
USD	FOCUSED SICAV - US CORPORATE BOND SUSTAINABLE USD U-X-ACC	496.00	4 680 900.80	8.52	
USD	UBS (LUX) BD SICAV-USD INVES GRA CORPOR SUSTAI (USD) U-X-ACC	846.00	9 850 333.32	17.92	
EUR	UBS (LUX) BOND SICAV - GREEN SOC SUSTAINABLE BD(EUR)U-X-ACC	1 036.00	9 820 783.18	17.87	
USD	UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD SUSTAINABLE U-X-ACC	71.00	850 655.97	1.55	
ルクセンブルグ合計			29 879 600.67	54.37	
投資信託、オープン・エンド型合計			38 187 224.73	69.49	
ルクセンブルグ2010年12月17日法(改訂済)の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs合計			38 187 224.73	69.49	
投資有価証券合計			54 092 260.28	98.43	

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・フィクスト・インカム・サステナブル (米ドル)

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 (%)
派生商品			
公認の証券取引所に上場されている派生商品			
債券に係る金融先物			
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 19.03.24	-5.00	-6 718.75	-0.01
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 28.03.24	10.00	8 281.26	0.01
債券に係る金融先物合計		1 562.51	0.00
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		1 562.51	0.00
派生商品合計		1 562.51	0.00

先渡為替契約

購入通貨／購入額／売却通貨／売却額／満期日 (日-月-年)

NOK	11 924 471.99	USD	1 067 858.73	7.12.2023	38 598.59	0.07
USD	1 099 254.32	SEK	11 990 000.00	7.12.2023	-45 159.65	-0.08
GBP	43 000.00	USD	52 745.47	7.12.2023	1 691.73	0.00
JPY	94 191.00	USD	627.51	7.12.2023	10.08	0.00
USD	13 579 026.40	EUR	12 712 801.53	7.12.2023	-294 411.31	-0.53
USD	161 287.63	EUR	151 000.00	7.12.2023	-3 498.16	-0.01
EUR	300 000.00	USD	324 762.60	7.12.2023	2 626.39	0.00
JPY	3 069 372 100.00	USD	20 721 376.31	11.1.2024	179 121.98	0.33
AUD	824 000.00	CHF	480 557.71	7.12.2023	-6 483.65	-0.01
AUD	824 000.00	EUR	498 835.85	7.12.2023	2 053.48	0.00
SEK	11 373 000.00	NOK	11 684 569.03	7.12.2023	1 325.73	0.00
先渡為替契約合計					-124 124.79	-0.23
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					736 094.07	1.34
その他の資産および負債					251 458.14	0.46
純資産総額					54 957 250.21	100.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ・インカム・サステナブル(米ドル)

2023年11月30日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

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

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 (%)
投資信託、オープン・エンド型			
アイルランド			
USD FEDERATED HERMES SDG ENGAGEMENT HIGH-M- USD	938 533.00	1 951 116.25	2.58
USD NEUBERGER BERMAN GLOBAL HIGH YIELD SDG ENGAGEMENT FU-I4- USD	188 726.00	1 960 863.14	2.60
USD RECORD UCITS ICAV-RECORD EM SUSTAINABLE FINANCE FUND-A-USD	21 003.00	2 324 170.98	3.08
USD UBS IRL ETF PIC-MSCI ACWI ESG UNIVERSAL UCITS ETF A-DIST	123 191.00	1 826 429.77	2.42
USD UBS IRL ETF PLC-MSCI ACWI SOCIALLY RES UCITS ETF-A-DIST-USD	14 855.00	253 248.04	0.34
アイルランド合計		8 315 828.18	11.02
ルクセンブルグ			
USD FOCUSED FUND - CORPORATE BOND SUSTAINABLE USD U-X-ACC	200.00	1 901 190.00	2.52
USD FOCUSED SICAV - US CORPORATE BOND SUSTAINABLE USD U-X-ACC	208.00	1 962 958.40	2.60
USD FOCUSED SICAV - WORLD BANK LONG TERM BOND USD U-X-ACC	1 395.00	12 213 880.65	16.18
USD FOCUSED SICAV - WORLD BANK BOND USD U-X-ACC	833.00	8 066 447.13	10.69
USD SUSTAINABLE DEVELOPMNT BK BD 1-5 IDX FD-SHS-(USD) U-X-ACC-CAP	87 952.00	911 411.40	1.21
USD SUSTAINABLE DEVELOPMNT BK BD 5-10 IDX FD-SHS-(USD) U-X-ACC-CAP	137 129.00	1 381 451.26	1.83
USD UBS (LUX) BD SICAV-USD INVES GRA CORPOR SUSTAI (USD) U-X-ACC	1 172.00	13 646 088.24	18.08
EUR UBS (LUX) BOND SICAV - GREEN SOC SUSTAINABLE BD(EUR)U-X-ACC	1 189.50	11 275 889.57	14.94
USD UBS (LUX) EQUITY FUND-GLBAL SUSTAINABLE IMPRO (USD) U-X-ACC	202.00	1 836 586.02	2.43
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - GL HI DIV (USD)-I-X-ACC	3 694.00	1 007 353.80	1.33
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - GLOBAL OPPORTUNITY (USD) U-X-ACC	101.00	1 202 801.93	1.59
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - ACTIVE CLIMATE AWARE (USD) I-X-ACC	8 625.00	1 213 278.75	1.61
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - LONG TERM THEMES (USD) U-X-ACC	126.00	1 214 652.60	1.61
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - ENGAGE FOR IMPACT (USD) U-X-ACC	421.00	3 642 390.96	4.82
USD UBS (LUX) FD SOL - SUS DEVELOP BANK BDS UCITS-ETF-A-A	192 267.00	2 147 718.52	2.84
USD UBS (LUX) FD SOL -MSCI EMERG MRKT SOC RES UCITS ETF-USD-A-DT	121 788.00	1 478 993.47	1.96
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD SUSTAINABLE U-X-ACC	92.50	1 108 248.98	1.47
ルクセンブルグ合計		66 211 341.68	87.71
投資信託、オープン・エンド型合計		74 527 169.86	98.73
ルクセンブルグ2010年12月17日法(改訂済)の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs合計		74 527 169.86	98.73

公認の証券取引所に上場されている派生商品

指数に係るオプション、従来型

米ドル			
USD S&P 500 INDEX PUT 4200.00000 15.03.24	4.00	12 960.00	0.02
USD S&P 500 INDEX PUT 3800.00000 15.03.24	-4.00	-5 160.00	-0.01
米ドル合計		7 800.00	0.01
指数に係るオプション、従来型合計		7 800.00	0.01
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		7 800.00	0.01
投資有価証券合計		74 534 969.86	98.74

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ・インカム・サステナブル (米ドル)

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 (%)
派生商品			
公認の証券取引所に上場されている派生商品			
債券に係る金融先物			
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 19.03.24	-7.00	-9 406.25	-0.01
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 28.03.24	14.00	11 593.76	0.01
債券に係る金融先物合計		2 187.51	0.00
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		2 187.51	0.00
派生商品合計		2 187.51	0.00

先渡為替契約

購入通貨／購入額／売却通貨／売却額／満期日 (日-月-年)

USD	470 855.33	GBP	383 858.17	7.12.2023	-15 101.95	-0.02
NOK	15 174 387.41	USD	1 358 894.73	7.12.2023	49 118.31	0.07
USD	24 920.66	NZD	42 000.00	7.12.2023	-1 020.86	0.00
USD	1 558 786.13	SEK	17 002 294.43	7.12.2023	-64 038.17	-0.08
USD	59 038.32	SGD	80 000.00	7.12.2023	-917.07	0.00
USD	245 917.75	CAD	338 499.58	7.12.2023	-3 754.45	0.00
USD	199 986.58	DKK	1 395 000.00	7.12.2023	-4 212.49	-0.01
USD	53 025.29	HKD	414 200.00	7.12.2023	-11.29	0.00
USD	505 474.44	JPY	75 873 437.00	7.12.2023	-8 123.43	-0.01
USD	12 992 214.99	EUR	12 163 423.63	7.12.2023	-281 688.46	-0.37
USD	145 752.79	AUD	226 356.55	7.12.2023	-4 354.50	-0.01
USD	204 327.72	CHF	183 478.32	7.12.2023	-6 778.17	-0.01
USD	119 918.46	CHF	108 000.00	7.12.2023	-4 343.83	-0.01
EUR	220 000.00	USD	238 159.24	7.12.2023	1 926.02	0.00
EUR	235 000.00	USD	257 345.45	7.12.2023	-890.74	0.00
AUD	1 136 000.00	CHF	662 516.45	7.12.2023	-8 938.62	-0.01
AUD	1 136 000.00	EUR	687 715.44	7.12.2023	2 831.02	0.00
SEK	15 677 000.00	NOK	16 106 479.27	7.12.2023	1 827.44	0.00
DKK	940 000.00	USD	138 407.53	7.12.2023	-811.02	0.00
USD	142 603.95	JPY	21 000 000.00	7.12.2023	452.02	0.00
先渡為替契約合計					-348 830.24	-0.46
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					923 585.90	1.22
その他の資産および負債					375 424.98	0.50
純資産総額					75 487 338.01	100.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)

2023年11月30日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

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

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			
オーストラリア			
AUD AMPOL LTD NPV	293.00	6 649.99	0.00
AUD ANZ GROUP HLDGS LI NPV	378.00	70 742.04	0.02
AUD APA GROUP NPV	1 899.00	10 740.40	0.00
AUD ARISTOCRAT LEISURE NPV	821.00	22 095.74	0.01
AUD ASX LTD NPV	256.00	9 858.55	0.00
AUD AURIZON HOLDINGS NPV	3 618.00	8 468.17	0.00
AUD BHP GROUP LTD NPV	7 400.00	227 174.19	0.05
AUD BLUESCOPE STEEL NPV	599.00	8 253.13	0.00
AUD BRAMBLES LTD NPV	1 998.00	17 672.48	0.01
AUD CARSALES.COM LTD NPV	423.00	7 791.46	0.00
AUD CMNWLTH BK OF AUST NPV	2 444.00	169 600.92	0.04
AUD COCHLEAR LTD NPV	95.00	17 198.72	0.01
AUD COLES GROUP LTD NPV	1 985.00	20 176.64	0.01
AUD COMPUTERSHARE LTD NPV(POST REC)	762.00	11 928.81	0.00
AUD CSL NPV	701.00	121 883.99	0.03
AUD DEXUS NPV (STAPLED)	1 293.00	6 035.56	0.00
AUD ENDEAVOUR GROUP LI NPV	2 205.00	7 207.78	0.00
AUD FORTESCUE LTD NPV	2 537.00	42 037.12	0.01
AUD GOODMAN GROUP (STAPLED SECURITY)	2 433.00	36 700.31	0.01
AUD GPT GROUP NPV (STAPLED SECURITIES)	3 496.00	9 550.25	0.00
AUD IDP EDUCATION LTD NPV	323.00	852.98	0.00
AUD IGO LTD NPV	1 140.00	6 485.42	0.00
AUD INSURANCE AUST GRP NPV	3 942.00	15 525.63	0.00
AUD MACQUARIE GP LTD NPV	524.00	58 734.43	0.01
AUD MEDIBANK PRIVATE L NPV	5 132.00	11 773.59	0.00
AUD MINERAL RESS LTD NPV	295.00	11 964.84	0.00
AUD MIRVAC GROUP STAPLED SECURITIES	5 904.00	8 064.17	0.00
AUD NATL AUSTRALIA BK NPV	562.00	85 905.29	0.02
AUD NTHN STAR RES LTD NPV	1 890.00	15 952.78	0.00
AUD ORICA LIMITED NPV	678.00	7 021.94	0.00
AUD ORIGIN ENERGY NPV	2 528.00	13 811.81	0.00
AUD PILBARA MINERALS L NPV	454.00	10 749.74	0.00
AUD QANTAS AIRWAYS NPV	1 395.00	902.26	0.00
AUD QBE INS GROUP NPV	2 091.00	21 309.55	0.01
AUD RAMSAY HEALTH CARE NPV	214.00	6 975.45	0.00
AUD REA GROUP LIMITED NPV	66.00	6 793.94	0.00
AUD REECE AUSTRALIA NPV	289.00	3 705.96	0.00
AUD RIO TINTO LIMITED NPV	529.00	43 858.21	0.01
AUD SANTOS LIMITED NPV	5 203.00	23 838.46	0.01
AUD SCENTRE GROUP NPV STAPLED UNIT	9 745.00	17 122.77	0.01
AUD SEEK LIMITED NPV	501.00	7 932.65	0.00
AUD SONIC HEALTHCARE NPV	685.00	13 248.70	0.00
AUD SOUL PATTINSON(WH) NPV	252.00	5 597.47	0.00
AUD SOUTH32 LTD NPV	7 582.00	15 483.91	0.00
AUD STOCKLAND NPV (STAPLED)	201.00	11 504.00	0.00
AUD SUNCORP GROUP LTD NPV	1 712.00	15 857.93	0.00
AUD TELSTRA GROUP LTD NPV	7 517.00	19 039.44	0.01
AUD THE LOTTERY CORPOR NPV	3 746.00	11 425.41	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ (米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
AUD TRANSURBAN GROUP STAPLED UNITS NPV	397.00	37 783.98	0.01
AUD TREASURY WINE ESTA NPV	972.00	6 895.99	0.00
AUD VICINITY CENTRES NPV (STAPLED SECURITY)	5 992.00	7 528.83	0.00
AUD WESFARMERS LTD NPV	1 627.00	56 808.68	0.01
AUD WESTPAC BKG CORP NPV	5 107.00	72 363.02	0.02
AUD WISETECH GLOBAL LT NPV	240.00	10 630.02	0.00
AUD WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	1 734.00	35 641.59	0.01
GBP WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	1 021.00	20 667.63	0.01
AUD WOOLWORTHS GRP LTD NPV	1 793.00	41 490.82	0.01
オーストラリア合計		1 601 015.54	0.35
オーストリア			
EUR ERSTE GROUP BK AG NPV	482.00	19 516.53	0.01
EUR OMV AG NPV (VAR)	211.00	9 013.20	0.00
EUR VERBUND AG CLASS 'A' NPV	93.00	8 878.82	0.00
EUR VOESTALPINE AG NPV	186.00	5 240.03	0.00
オーストリア合計		42 648.58	0.01
ベルギー			
EUR AGEAS NPV	249.00	10 726.08	0.00
EUR ANHEUSER-BUSCH IN NPV	1 271.00	79 892.86	0.02
EUR ELIA SYS OPERATOR NPV	47.00	5 099.97	0.00
EUR GPE BRUXELLES LAM NPV	114.00	9 042.82	0.00
EUR KBC GROUP NV NPV	386.00	22 153.26	0.01
EUR SA D' IETEREN NV NPV	41.00	7 005.52	0.00
EUR SOFINA NPV	30.00	6 684.08	0.00
EUR SOLVAY SA NPV	112.00	12 971.87	0.01
EUR UCB NPV	170.00	12 583.44	0.00
EUR UMICORE NPV	282.00	7 547.64	0.00
EUR WAREHOUSES DE PAUW NPV (POST SPLIT)	285.00	8 016.64	0.00
ベルギー合計		181 724.18	0.04
バミューダ			
EUR AEGON LIMITED EURO.12	2 635.00	14 449.99	0.00
バミューダ合計		14 449.99	0.00
カナダ			
CAD 1ST QUANTUM MINLS COM NPV	925.00	7 579.56	0.00
CAD AGNICO EAGLE MINES LTD COM	747.00	40 136.41	0.01
CAD AIR CANADA VAR VTG SHS NPV	230.00	2 990.67	0.00
CAD ALGONQUIN PWR&UTIL COM NPV	900.00	5 555.92	0.00
CAD ALIMENTATION COUCH COM NPV	1 147.00	65 477.60	0.02
CAD ALTAGAS LTD COM NPV	432.00	8 793.89	0.00
CAD ARC RESOURCES COM NPV	944.00	15 066.68	0.00
CAD BANK NOVA SCOTIA HALIFAX COM	1 736.00	77 718.92	0.02
CAD BANK OF MONTREAL COM NPV	1 043.00	85 680.09	0.02
CAD BARRICK GOLD CORP COM NPV	2 520.00	44 309.33	0.01
CAD BCE INC COM NEW	52.00	2 049.16	0.00
CAD BROOKFIELD ASSET.M CLASS A LTD VOTING SHS	487.00	17 064.85	0.00
CAD BROOKFIELD CORP CLASS A LID VOTING SHS	2 053.00	72 468.62	0.02
CAD BRP INC SUB VTG NPV	57.00	3 522.96	0.00
CAD CAE INC COM NPV	413.00	8 218.27	0.00
CAD CAMECO CORP COM	620.00	28 492.97	0.01
CAD CANADIAN NAT RES LTD COM	1 624.00	108 530.18	0.02
CAD CANADIAN NATL RY CO COM	823.00	95 578.11	0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ (米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
CAD CANADIAN PAC RY LTD COM NPV	1 366.00	98 421.31	0.02
CAD CANADIAN TIRE LTD CL A	93.00	9 681.71	0.00
CAD CANADIAN UTILS LTD CL A	159.00	3 565.00	0.00
CAD CCL INDUSTRIES INC ‘ B ’ NON-VTG COM NPV	238.00	9 817.71	0.00
CAD CDN IMPERIAL BK OF COMMERCE COM	1 319.00	54 575.28	0.01
CAD CENOVUS ENERGY INC COM NPV	2 074.00	36 819.10	0.01
CAD CGI INC COM NPV SUB VOTING SHARES C	314.00	31 952.34	0.01
CAD CONSTELLATION SOFT COM STK NPV	31.00	72 874.06	0.02
CAD DESCARTES SYSTEMS COM NPV	123.00	9 998.94	0.00
CAD DOLLARAMA INC COM NPV	420.00	30 527.71	0.01
CAD ELEMENT FLEET MGMT COM NPV	525.00	8 464.43	0.00
CAD EMERA INC COM	392.00	13 788.01	0.00
CAD EMPIRE LTD CL A	225.00	6 120.15	0.00
CAD ENBRIDGE INC COM NPV	3 119.00	108 993.04	0.02
CAD FAIRFAX FINL HLDGS SUB-VTG COM NPV	35.00	32 197.11	0.01
CAD FIRSTSERVICE CORP COM NPV	67.00	10 522.54	0.00
CAD FORTIS INC COM NPV	692.00	27 744.31	0.01
CAD FRANCO NEVADA CORP COM NPV	287.00	32 170.42	0.01
CAD GFL ENVIRON INC COM NPV SUB VTG SHS	300.00	8 616.00	0.00
CAD GILDAN ACTIVEWEAR INC COM	240.00	8 694.77	0.00
CAD GREAT WEST LIFE CO INC COM	407.00	13 018.84	0.00
CAD HYDRO ONE INC COM NPV	440.00	12 240.88	0.00
CAD IA FINANCIAL CORP COM NPV	145.00	9 690.19	0.00
CAD IGM FINANCIAL INC COM	124.00	3 081.14	0.00
CAD IMPERIAL OIL LTD COM NEW	318.00	17 930.52	0.00
CAD INTACT FINL CORP COM NPV	268.00	41 568.32	0.01
CAD IVANHOE MINES LTD COM NPV CL ‘ A ’	1 000.00	8 931.67	0.00
CAD KEYERA CORPORATION COM NPV	313.00	7 888.20	0.00
CAD KINROSS GOLD CORP COM NPV	1 763.00	10 402.33	0.00
CAD LOBLAW COS LTD COM	238.00	20 537.67	0.01
CAD LUNDIN MINING CORP COM	1 041.00	7 217.17	0.00
CAD MAGNA INTL INC COM NPV	404.00	21 799.34	0.01
CAD MANULIFE FINL CORP COM	2 684.00	52 616.97	0.01
CAD MEG ENERGY CORP COM NPV	126.00	2 384.60	0.00
CAD METRO INC CL A SUB	358.00	17 957.43	0.00
CAD NATL BK OF CANADA COM NPV	510.00	33 823.21	0.01
CAD NORTHLAND POWER IN COM NPV	447.00	7 272.80	0.00
CAD NUTRIEN LTD NPV	719.00	38 488.79	0.01
CAD ONEX CORP SUB VTG	110.00	7 446.92	0.00
CAD OPEN TEXT CO COM NPV	388.00	15 536.03	0.00
CAD PAN AMER SILVER COM NPV	470.00	7 369.69	0.00
CAD PARKLAND CORP. COM NPV	200.00	6 550.87	0.00
CAD PEMBINA PIPELINE C COM NPV	833.00	27 886.47	0.01
CAD POWER CORP CDA COM	862.00	23 872.92	0.01
CAD QUEBECOR INC CL B	287.00	6 373.54	0.00
CAD RB GLOBAL INC COM NPV	266.00	16 921.12	0.00
CAD RESTAURANT BRANDS COM NPV	418.00	29 753.42	0.01
CAD ROGERS COMMUNICATIONS INC	516.00	22 236.88	0.01
CAD ROYAL BK OF CANADA COM NPV	2 027.00	183 317.28	0.04
CAD SAPUTO INC COM	320.00	6 226.06	0.00
CAD SHOPIFY INC COM NPV CL A	1 764.00	128 606.70	0.03
CAD STANTEC INC COM NPV	171.00	12 753.27	0.00
CAD SUN LIFE FINL INC COM	856.00	43 259.30	0.01
CAD SUNCOR ENERGY INC COM NPV ‘ NEW ’	1 940.00	64 015.64	0.02
CAD TC ENERGY CORPORAT COM NPV	1 489.00	55 887.61	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
CAD TECK RESOURCES LTD CLASS 'B' SUB-VTG COM NPV	650.00	24 507.14	0.01
CAD TELUS CORPORATION NPV	689.00	12 338.33	0.00
CAD TFI INTERNATIONAL COM NPV	120.00	14 210.42	0.00
CAD THOMSON-REUTERS CP NPV POST REV SPLIT	234.00	32 718.75	0.01
CAD TMX GROUP LTD COM NPV	385.00	8 319.87	0.00
CAD TOROMONT INDS LTD COM	100.00	8 076.11	0.00
CAD TORONTO-DOMINION COM NPV	2 699.00	164 704.99	0.04
CAD TOURMALINE OIL CP COM NPV	452.00	21 895.76	0.01
CAD WEST FRASER TIMBER COM NPV	73.00	5 299.01	0.00
CAD WESTON GEORGE LTD COM	84.00	9 859.94	0.00
CAD WHEATON PRECIOUS M COM NPV	657.00	32 151.01	0.01
CAD WSP GLOBAL INC COM NPV	187.00	25 905.68	0.01
カナダ合計		2 649 628.93	0.58
中国			
USD FUTU HOLDINGS LIM SPON ADS EA REP 8 ORD SHS	100.00	5 392.00	0.00
中国合計		5 392.00	0.00
デンマーク			
DKK A.P. MOELLER-MAERSK SER 'B' DKK1000	6.00	9 483.18	0.00
DKK A.P. MOLLER-MAERSK 'A' DKK1000	5.00	7 763.62	0.00
DKK CARLSBERG SER 'B' DKK20	137.00	17 001.82	0.01
DKK CHR. HANSEN HLDG DKK10	147.00	11 780.39	0.00
DKK COLOPLAST DKK1 B	191.00	22 585.19	0.01
DKK DANSKE BANK A/S DKK10	989.00	25 647.15	0.01
DKK DEMANT A/S DKK0.20	157.00	6 672.30	0.00
DKK DSV PANALPINA A/S DKK1	269.00	40 567.60	0.01
DKK GENMAB AS DKK1	92.00	29 095.22	0.01
DKK NOVO NORDISK A/S DKK0.1 B	589.00	467 083.19	0.10
DKK NOVOZYMES A/S SER 'B' DKK2 (POST CONS)	274.00	14 239.03	0.00
DKK ORSTED A/S DKK10	281.00	13 258.07	0.00
DKK PANDORA A/S DKK1	120.00	16 230.29	0.00
DKK ROCKWOOL INTL SER 'B' DKK10	12.00	3 247.11	0.00
DKK TRYG A/S DKK5	479.00	10 353.69	0.00
DKK VESTAS WIND SYSTEM DKK0.20 (POST SPLIT)	1 379.00	38 255.16	0.01
デンマーク合計		733 263.01	0.16
フィンランド			
EUR ELISA OYJ NPV	190.00	8 516.25	0.00
EUR FORTUM OYJ EUR3.40	592.00	8 322.82	0.00
EUR KESKO OYJ EUR2 SER 'B'	371.00	7 106.24	0.00
EUR KONE CORPORATION NPV ORD 'B'	492.00	21 896.94	0.00
EUR METSO CORPORATION RG	1 024.00	10 089.10	0.00
EUR NESTE OIL OYJ NPV	597.00	22 720.37	0.01
EUR NOKIA OYJ NPV	7 215.00	25 333.02	0.01
SEK NORDEA HOLDING ABP NPV	514.00	50 512.38	0.01
EUR ORION CORP SER 'B' NPV	128.00	5 089.24	0.00
EUR SAMPO PLC NPV A	660.00	28 913.06	0.01
EUR STORA ENSO OYJ NPV SER 'R'	810.00	10 525.95	0.00
EUR UPM-KYMMENE CORP NPV	737.00	25 796.83	0.01
EUR WARTSILA OYJ ABP SER 'B' EUR3.50	693.00	9 572.63	0.00
フィンランド合計		234 394.83	0.05

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャプ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ (米ドル)

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 (%)
フランス			
EUR ACCOR EUR3	256.00	8 885.22	0.00
EUR ADP EUR3	50.00	6 170.17	0.00
EUR AIR LIQUIDE(L ') EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)	769.00	145 827.92	0.03
EUR AIRBUS EUR1	869.00	129 140.20	0.03
EUR ALSTOM EUR7.00	428.00	5 309.69	0.00
EUR AMUNDI EUR2.5 (AIW)	98.00	6 041.42	0.00
EUR ARKEMA EUR10	82.00	8 343.99	0.00
EUR AXA EUR2.29	2 692.00	83 990.41	0.02
EUR BIOMERIEUX NPV (POST SPLIT)	56.00	6 034.39	0.00
EUR BNP PARIBAS EUR2	1 544.00	97 322.72	0.02
EUR BOLLORE EURO.16	1 302.00	7 451.11	0.00
EUR BOUYGUES EUR1	246.00	9 370.21	0.00
EUR BUREAU VERITAS EURO.12	423.00	10 250.70	0.00
EUR CAPGEMINI EUR8	240.00	49 230.43	0.01
EUR CARREFOUR EUR2.50	877.00	16 645.19	0.01
EUR CIE DE ST-GOBAIN EUR4	677.00	44 180.13	0.01
EUR COVIVIO EUR3	81.00	3 961.15	0.00
EUR CREDIT AGRICOLE SA EUR3	1 797.00	23 571.61	0.01
EUR DANONE EURO.25	935.00	60 159.93	0.01
EUR DASSAULT AVIATION EURO.80 (POST SUBDIVISION)	30.00	5 970.50	0.00
EUR DASSAULT SYSTEMES EURO.10	960.00	45 003.95	0.01
EUR EDENRED EUR2	350.00	19 094.25	0.01
EUR EIFFAGE EUR4	100.00	10 147.23	0.00
EUR ENGIE EUR1	2 626.00	45 608.71	0.01
EUR ESSILORLUXOTTICA EURO.18	429.00	81 970.50	0.02
EUR EURAZEO NPV	57.00	281.97	0.00
EUR GECINA EUR7.50	57.00	6 318.78	0.00
EUR GETLINK SE EURO.40	494.00	9 039.09	0.00
EUR HERMES INTL NPV	46.00	95 572.94	0.02
EUR IPSEN EUR1	67.00	7 566.23	0.00
EUR KERING EUR4	108.00	46 393.14	0.01
EUR KLEPIERRE EUR1.40	352.00	8 871.95	0.00
EUR L ' OREAL EURO.20	353.00	166 022.49	0.04
EUR LA FRANCAISE DES EURO.40 (PROMESSES)	200.00	7 244.90	0.00
EUR LEGRAND SA EUR4	400.00	38 590.02	0.01
EUR LVMH MOET HENNESSY EURO.30	405.00	310 519.97	0.07
EUR MICHELIN (CGDE) EURO.50 (POST SUBDIVISION)	990.00	33 280.62	0.01
EUR ORANGE EUR4	2 702.00	33 325.91	0.01
EUR PERNOD RICARD EUR1.55	305.00	52 763.14	0.01
EUR PUBLICIS GROUPE SA EURO.40	324.00	27 425.80	0.01
EUR REMY COINTREAU EUR1.60	41.00	887.31	0.00
EUR RENAULT SA EUR3.81	256.00	10 052.78	0.00
EUR SAFRAN EURO.20	502.00	88 195.84	0.02
EUR SANOFI EUR2	1 664.00	155 160.36	0.04
EUR SARTORIUS STEDIM B EURO.20 (POST SUBD)	42.00	9 458.53	0.00
EUR SCHNEIDER ELECTRIC EUR8	799.00	147 001.04	0.03
EUR SEB SA EUR1	48.00	5 472.96	0.00
EUR SOC GENERALE EUR1.25	1 041.00	26 209.40	0.01
EUR SODEXO EUR4	134.00	14 386.81	0.00
EUR TELEPERFORMANCE EUR2.50	84.00	11 781.92	0.00
EUR THALES EUR3	152.00	22 712.77	0.01
EUR TOTALENERGIES SE EUR2.5	3 299.00	224 107.29	0.05
EUR UNIBAIL-RODAMCO-WE NPV(1 ORD UNIBAIL-R & 1CLS)	174.00	11 083.52	0.00
EUR VEOLIA ENVIRONNEME EUR5	1 061.00	33 467.87	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ (米ドル)

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 VINCI EUR2.50	781.00	95 696.34	0.02
EUR VIVENDI SA EUR5.50	867.00	8 216.81	0.00
EUR WORLDLINE EURO.68	376.00	5 839.96	0.00
フランス合計		2 650 630.19	0.58
ドイツ			
EUR ADIDAS AG NPV (REGD)	235.00	49 266.33	0.01
EUR ALLIANZ SE NPV(REGD)(VINKULIERT)	592.00	148 951.73	0.03
EUR BASF SE NPV	1 301.00	60 592.26	0.01
EUR BAYER AG NPV (REGD)	1 430.00	48 930.16	0.01
EUR BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG EUR1	436.00	45 474.04	0.01
EUR BAYERISCHE MOTORENWERKE AG EUR1	97.00	9 218.38	0.00
EUR BECHTLE AG NPV	114.00	5 657.05	0.00
EUR BEIERSDORF AG NPV	148.00	20 782.84	0.01
EUR BRENNTAG AG	219.00	18 944.03	0.00
EUR CARL ZEISS MEDITEC NPV	69.00	6 197.54	0.00
EUR COMMERZBANK AG NPV	1 560.00	19 140.29	0.01
EUR CONTINENTAL AG ORD NPV	167.00	12 940.82	0.00
EUR COVESTRO AG NPV	307.00	16 145.44	0.00
EUR DAIMLER TRUCK HOLD NPV (YOUNG SHARE)	698.00	22 718.16	0.01
EUR DELIVERY HERO SE NPV	267.00	8 478.98	0.00
EUR DEUTSCHE BANK AG NPV(REGD)	2 822.00	35 181.61	0.01
EUR DEUTSCHE BOERSE AG NPV(REGD)	279.00	53 059.87	0.01
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA ORD NPV (REGD)(VINK)	918.00	7 993.01	0.00
EUR DEUTSCHE POST AG NPV(REGD)	1 438.00	67 529.84	0.02
EUR DEUTSCHE TELEKOM NPV(REGD)	746.00	113 794.47	0.03
EUR DR.ING. F.PORSCHE NON-VTG PRF NPV	171.00	15 683.76	0.00
EUR E.ON SE NPV	3 243.00	42 231.25	0.01
EUR EVONIK INDUSTRIES NPV	255.00	771.65	0.00
EUR FRESENIUS MED CARE NPV	298.00	12 235.31	0.00
EUR FRESENIUS SE & CO. KGAA NPV	648.00	20 567.58	0.01
EUR GEA GROUP AG NPV	197.00	7 248.00	0.00
EUR HANNOVER RUECKVERS ORD NPV(REGD)	87.00	20 788.73	0.01
EUR HEIDELBERGCEMENT NPV	209.00	17 057.38	0.00
EUR HELLOFRESH SE NPV	233.00	3 564.25	0.00
EUR HENKEL AG & CO KGAA	155.00	10 837.24	0.00
EUR HENKEL AG&CO. KGAA NON-VTG PRF NPV	237.00	18 670.25	0.00
EUR INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)	1 901.00	73 737.14	0.02
EUR KNORR BREMSE AG NPV	105.00	6 587.52	0.00
EUR LEG IMMOBILIEN SE NPV	103.00	7 882.56	0.00
EUR MERCEDES-BENZ ORD NPV(REGD)	1 169.00	75 994.05	0.02
EUR MERCK KGAA NPV	195.00	34 074.23	0.01
EUR MTU AERO ENGINES H NPV (REGD)	82.00	16 798.03	0.00
EUR MUENCHENER RUECKVE NPV(REGD)	201.00	85 706.78	0.02
EUR NEMETSCHEK SE ORD NPV	96.00	8 383.84	0.00
EUR PORSCHE AUTO HL SE NON VTG PRF NPV	236.00	11 551.43	0.00
EUR PUMA SE NPV	140.00	9 039.98	0.00
EUR RATIONAL AG NPV	8.00	5 128.17	0.00
EUR RHEINMETALL AG NPV	63.00	18 972.05	0.01
EUR RWE AG (NEU) NPV	921.00	39 563.04	0.01
EUR SAP AG ORD NPV	1 533.00	243 338.04	0.05
EUR SARTORIUS AG NON VTG PRF NPV	39.00	12 574.38	0.00
EUR SCOUT24 AG NPV	124.00	8 658.97	0.00
EUR SIEMENS AG NPV(REGD)	1 117.00	187 688.84	0.04
EUR SIEMENS ENERGY AG NPV	770.00	9 140.80	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ (米ドル)

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 SIEMENS HEALTHINEE NPV	398.00	22 989.61	0.01
EUR SYMRISE AG NPV (BR)	202.00	22 745.51	0.01
EUR TALANX AG NPV	96.00	6 976.06	0.00
EUR VOLKSWAGEN AG NON VTG PRF NPV	297.00	34 486.11	0.01
EUR VOLKSWAGEN AG ORD NPV	51.00	6 621.89	0.00
EUR VONOVIA SE NPV	1 090.00	30 350.91	0.01
EUR WACKER CHEMIE AG NPV(BR)	32.00	3 920.98	0.00
EUR ZALANDO SE NPV	382.00	9 111.25	0.00
ドイツ合計		1 936 674.42	0.42
香港			
HKD AIA GROUP LTD NPV	16 800.00	144 977.79	0.03
HKD BOC HONG KONG HLDG HKD5	6 500.00	17 393.70	0.01
HKD BUDWEISER BREWING USD0.00001	2 000.00	3 538.92	0.00
HKD CK ASSET HOLDINGS HKD1	3 000.00	14 231.21	0.00
HKD CK HUTCHISON HLDGS HKD1.0	000.00	20 050.45	0.01
HKD CK INFRASTRUCTURE HKD1	1 500.00	7 432.49	0.00
HKD CLP HOLDINGS HKD5	2 500.00	19 445.48	0.01
HKD ESR CAYMAN LIMITED USD0.001	2 600.00	3 342.25	0.00
HKD GALAXY ENTERTAINME HKD0.10	3 000.00	15 517.97	0.01
HKD HANG LUNG PROP HKD1	3 000.00	010.09	0.00
HKD HANG SENG BANK HKD5	1 200.00	13 290.14	0.00
HKD HENDERSON LAND DEV HKD2	3 000.00	8 162.30	0.00
HKD HKT TRUST AND HKT SHARE STAPLED UNIT	7 000.00	7 465.78	0.00
HKD HONG KONG EXCHANGE HKD1	1 700.00	60 335.71	0.01
USD HONGKONG LAND HLD ORD USD0.10(SINGAPORE REG)	1 300.00	186.00	0.00
HKD HONGKONG&CHINA GAS HKD0.25	20 750.00	14 266.74	0.00
USD JARDINE MATHESON COM USD0.25(BERMUDA REG)	200.00	7 722.00	0.00
HKD MTR CORP HKD1	3 000.00	10 755.03	0.00
HKD NEW WORLD DEVEL CO NPV POST CON	2 000.00	2 975.56	0.00
HKD POWER ASSETS HOLDINGS LTD HKD1	2 500.00	13 043.67	0.00
HKD SINO LAND CO HKD1	6 781.00	6 832.83	0.00
HKD SITC INTERNATIONAL HKD0.10	2 000.00	3 021.65	0.00
HKD SUN HUNG KAI PROP NPV	2 000.00	19 627.93	0.01
HKD SWIRE PACIFIC 'A' HKD0.60	500.00	3 245.71	0.00
HKD SWIRE PROPERTIES LTD HKD1	1 000.00	1 943.59	0.00
HKD TECHTRONIC INDUSTR NPV	2 000.00	20 306.52	0.01
HKD THE LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3 706.00	18 315.76	0.01
HKD WH GROUP LTD USD0.0001	15 358.00	9 871.22	0.00
HKD WHARF REAL ESTATE HKD0.1	2 000.00	6 312.18	0.00
HKD WHARF(HLDGS) HKD1	1 000.00	2 599.13	0.00
HKD XINYI GLASS HLDGS HKD0.1	2 038.00	2 345.83	0.00
香港合計		486 565.63	0.11
アイルランド			
EUR AIB GROUP PLC ORD EURO.625	1 216.00	5 644.11	0.00
EUR BANK OF IRELAND GR EUR1	1 650.00	15 464.71	0.00
GBP CRH ORD EURO.32	1 073.00	67 728.05	0.02
GBP DCC ORD EURO.25	158.00	10 685.07	0.00
GBP EXPERIAN ORD USD0.10	1 338.00	49 172.21	0.01
EUR FLUTTER ENTERTAINM ORD EURO.09	256.00	40 012.82	0.01
AUD JAMES HARDIE ID PLC CUFS EURO.5	681.00	21 998.89	0.01
EUR KERRY GROUP 'A' ORD EURO.125(DUBLIN LIST)	225.00	18 220.82	0.01
EUR KINGSPAN GROUP ORD EURO.13(DUBLIN LISTING)	224.00	17 792.79	0.00
EUR SMURFIT KAPPA GRP ORD EURO.001	380.00	14 428.71	0.00
アイルランド合計		261 148.18	0.06

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ (米ドル)

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 (%)
マン島			
GBP ENTAIN PLC ORD EURO.01	955.00	9 705.71	0.00
マン島合計		9 705.71	0.00
イスラエル			
ILS AZRIELI GROUP ILS0.01	59.00	3 426.79	0.00
ILS BANK HAPOLIM B.M. ILS1	1 770.00	14 976.16	0.00
ILS BK LEUMI LE ISRAEL ILS1	2 035.00	15 273.02	0.00
USD CHECK POINT SFTWRE ORD ILS0.01	154.00	22 484.00	0.01
USD CYBER-ARK SOFTWARE COM ILS0.01	100.00	19 927.00	0.01
ILS ELBIT SYSTEMS LTD ILS1	43.00	8 575.52	0.00
USD GLOBAL-E ONLINE LT COM NPV	100.00	3 425.00	0.00
ILS ICL GROUP LTD ILS1	1 022.00	5 142.79	0.00
ILS ISRAEL DISCOUNT BK ILS0.10 SER 'A'	2 024.00	9 766.46	0.00
ILS MIZRAHI TEFAHOT BK ILS0.01	225.00	8 035.50	0.00
ILS NICE SYSTEMS ILS1	86.00	16 548.32	0.01
USD TEVA PHARMA IND ADR(CNV 1 ORD ILS0.10)	1 500.00	14 730.00	0.00
USD WIX.COM LTD COM ILS0.01	82.00	8 323.00	0.00
イスラエル合計		150 633.56	0.03
イタリア			
EUR AMPLIFON EURO.02	216.00	6 723.88	0.00
EUR ASSIC GENERALI SPA EUR1	1 494.00	30 980.12	0.01
EUR BANCO BPM NPV	851.00	711.34	0.00
EUR DAVIDE CAMPARI MIL EURO.01	739.00	8 079.36	0.00
EUR DIASORIN SPA EUR1	31.00	2 940.67	0.00
EUR ENEL EUR1	11 897.00	84 193.57	0.02
EUR ENI SPA EUR1	3 539.00	58 569.76	0.01
EUR FINECOBANK SPA EURO.33	924.00	12 466.10	0.00
EUR INFRASTRUTTURE WIR NPV	506.00	6 249.73	0.00
EUR INTESA SANPAOLO NPV	22 934.00	66 099.01	0.02
EUR LEONARDO SPA EUR4.40	305.00	682.29	0.00
EUR MEDIOBANCA SPA EURO.5	761.00	8 946.78	0.00
EUR MONCLER SPA NPV	313.00	17 376.25	0.01
EUR NEXI SPA NPV	826.00	6 443.93	0.00
EUR POSTE ITALIANE SPA NPV	817.00	8 803.75	0.00
EUR PRYSMIAN SPA EURO.10	363.00	13 993.13	0.00
EUR RECORDATI EURO.125	138.00	6 650.76	0.00
EUR SNAM EUR1	2 706.00	13 649.49	0.00
EUR TELECOM ITALIA SPA EURO.55	15 282.00	445.34	0.00
EUR TERNA SPA ORD EURO.22	2 019.00	16 292.87	0.01
EUR UNICREDIT SPA NPV (POST REV SPLIT)	2 723.00	74 232.07	0.02
イタリア合計		456 530.20	0.10
日本			
JPY アドバンテスト	1 100.00	34 830.05	0.01
JPY イオン	1 000.00	20 705.52	0.01
JPY A G C	300.00	10 897.28	0.00
JPY アイシン	200.00	7 374.44	0.00
JPY 味の素	700.00	26 165.66	0.01
JPY A N Aホールディングス	300.00	6 193.39	0.00
JPY アサヒグループホールディングス	700.00	25 829.47	0.01
JPY 朝日インテック	300.00	5 816.96	0.00
JPY 旭化成	1 700.00	11 804.04	0.00
JPY アステラス製薬	2 700.00	32 828.83	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ (米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
JPY アズビル	200.00	6 455.85	0.00
JPY バンダイナムコホールディングス	900.00	17 916.60	0.01
JPY ベイカレント・コンサルティング	200.00	6 731.83	0.00
JPY ブリヂストン	800.00	32 998.95	0.01
JPY ブラザー工業	400.00	6 753.48	0.00
JPY キヤノン	1 500.00	38 627.52	0.01
JPY カプコン	300.00	10 111.95	0.00
JPY 東海旅客鉄道	1 000.00	24 013.26	0.01
JPY 千葉銀行	700.00	5 239.29	0.00
JPY 中部電力	1 000.00	12 358.37	0.00
JPY 中外製薬	1 000.00	35 296.11	0.01
JPY コンコルディア・フィナンシャルグループ	1 800.00	8 448.74	0.00
JPY 大日本印刷	300.00	8 427.64	0.00
JPY 第一生命ホールディングス	1 400.00	29 177.12	0.01
JPY ダイフク	500.00	9 412.52	0.00
JPY 第一三共	2 700.00	73 054.42	0.02
JPY ダイキン工業	400.00	59 945.21	0.01
JPY 大東建託	100.00	11 025.81	0.00
JPY 大和ハウス工業	900.00	25 562.96	0.01
JPY 大和ハウスリート投資法人	3.00	5 353.27	0.00
JPY 大和証券グループ	2 000.00	12 925.22	0.00
JPY デンソー	2 600.00	40 696.72	0.01
JPY 電通グループ	300.00	8 086.72	0.00
JPY ディスコ	100.00	21 706.63	0.01
JPY 東日本旅客鉄道	400.00	21 632.23	0.01
JPY エーザイ	400.00	20 758.28	0.01
JPY ENEOSホールディングス	100.00	16 207.53	0.00
JPY ファナック	1 400.00	38 959.65	0.01
JPY ファーストリテイリング	300.00	76 078.06	0.02
JPY 富士電機	200.00	8 389.08	0.00
JPY 富士フイルムホールディングス	600.00	35 147.29	0.01
JPY 富士通	300.00	42 858.59	0.01
JPY GLP投資法人	6.00	5 669.83	0.00
JPY 浜松ホトニクス	200.00	7 922.35	0.00
JPY 阪急阪神ホールディングス	300.00	9 072.95	0.00
JPY 日立建機	200.00	5 188.22	0.00
JPY 日立製作所	1 400.00	97 399.13	0.02
JPY 本田技研工業	6 900.00	70 430.55	0.02
JPY ホシザキ	200.00	6 370.62	0.00
JPY HOYA	500.00	56 363.51	0.01
JPY ヒューリック	700.00	6 950.99	0.00
JPY イビデン	200.00	9 566.07	0.00
JPY 出光興産	300.00	8 230.80	0.00
JPY 飯田グループホールディングス	300.00	484.73	0.00
JPY INPEX	1 500.00	21 206.07	0.01
JPY いすゞ自動車	800.00	10 582.07	0.00
JPY 伊藤忠商事	1 700.00	65 983.02	0.02
JPY 日本航空	200.00	3 802.89	0.00
JPY 日本取引所グループ	800.00	16 337.13	0.00
JPY 日本都市ファンド投資法人	11.00	7 329.12	0.00
JPY ゆうちょ銀行	2 139.00	21 117.27	0.01
JPY 日本郵政	3 200.00	28 236.89	0.01
JPY かんぽ生命保険	300.00	5 610.99	0.00
JPY ジャパンリアルエステイト投資法人	2.00	7 778.94	0.00
JPY 日本たばこ産業	1 800.00	46 279.97	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ (米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
JPY J F Eホールディングス	700.00	10 322.32	0.00
JPY J S R	300.00	8 257.18	0.00
JPY 鹿島建設	600.00	9 482.87	0.00
JPY 関西電力	1 100.00	14 665.67	0.00
JPY 花王	700.00	26 970.61	0.01
JPY 川崎汽船	200.00	7 019.99	0.00
JPY K D D I	2 200.00	68 826.73	0.02
JPY K D X不動産投資法人	2.00	2 293.10	0.00
JPY 京成電鉄	200.00	8 063.04	0.00
JPY キーエンス	300.00	128 555.49	0.03
JPY キッコーマン	200.00	12 263.67	0.00
JPY 近鉄グループホールディングス	300.00	8 413.43	0.00
JPY キリンホールディングス	1 200.00	16 940.51	0.00
JPY 神戸物産	200.00	5 281.56	0.00
JPY コーエーテックモホールディングス	200.00	2 449.35	0.00
JPY 小糸製作所	300.00	538.51	0.00
JPY 小松製作所	1 400.00	35 720.91	0.01
JPY コナミホールディングス	100.00	948.08	0.00
JPY クボタ	1 600.00	22 933.68	0.01
JPY 京セラ	500.00	27 699.80	0.01
JPY 協和キリン	400.00	6 593.84	0.00
JPY レーザーテック	100.00	22 349.24	0.01
JPY L I N Eヤフー	3 700.00	10 777.02	0.00
JPY エムスリー	700.00	11 579.46	0.00
JPY マキタ	300.00	7 962.93	0.00
JPY 丸紅	2 100.00	32 771.00	0.01
JPY マツモトキヨシ	500.00	8 636.32	0.00
JPY マツダ	800.00	8 541.96	0.00
JPY 日本マクドナルドホールディングス	200.00	8 536.54	0.00
JPY 明治ホールディングス	300.00	6 946.26	0.00
JPY ミネベアミツミ	600.00	11 416.78	0.00
JPY ミスミグループ本社	400.00	6 493.73	0.00
JPY 三菱ケミカルホールディングス	1 900.00	12 447.32	0.00
JPY 三菱商事	1 700.00	79 184.23	0.02
JPY 三菱電機	2 900.00	39 409.48	0.01
JPY 三菱地所	1 700.00	22 958.37	0.01
JPY 三菱H Cキャピタル	1 400.00	9 132.88	0.00
JPY 三菱重工業	500.00	27 963.61	0.01
JPY 三菱U F Jフィナンシャル・グループ	16 900.00	143 467.38	0.03
JPY 三井物産	1 900.00	69 298.88	0.02
JPY 三井化学	300.00	8 782.76	0.00
JPY 三井不動産	1 300.00	30 531.34	0.01
JPY 商船三井	500.00	13 734.91	0.00
JPY みずほフィナンシャルグループ	3 600.00	61 170.90	0.01
JPY M o n o t a R O	300.00	3 029.73	0.00
JPY M S & A Dインシュアランス グループ ホールディングス	600.00	22 456.12	0.01
JPY 村田製作所	2 500.00	48 762.13	0.01
JPY 日本電気	400.00	22 295.13	0.01
JPY ネクソン	500.00	10 816.11	0.00
JPY ニデック	600.00	22 744.28	0.01
JPY 任天堂	1 500.00	70 132.24	0.02
JPY 日本ビルファンド投資法人	2.00	8 401.26	0.00
JPY N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	100.00	5 459.46	0.00
JPY 日本ペイントホールディングス	1 500.00	11 206.75	0.00
JPY 日本プロロジスリート投資法人	3.00	5 690.13	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ (米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
JPY 日本酸素ホールディングス	200.00	5 253.15	0.00
JPY 日本製鉄	1 300.00	30 399.43	0.01
JPY 日本電信電話	44 700.00	52 339.23	0.01
JPY 日本郵船	700.00	18 816.92	0.01
JPY 日産化学	200.00	7 295.97	0.00
JPY 日産自動車	3 400.00	13 405.89	0.00
JPY 日清食品ホールディングス	100.00	9 919.84	0.00
JPY ニトリホールディングス	100.00	11 539.89	0.00
JPY 日東電工	200.00	14 225.32	0.00
JPY 野村ホールディングス	300.00	17 664.22	0.01
JPY 野村不動産マスターファンド投資法人	5.00	5 742.89	0.00
JPY 野村不動産ホールディングス	200.00	875.71	0.00
JPY 野村総合研究所	600.00	16 851.22	0.00
JPY NTTデータグループ	1 000.00	12 155.44	0.00
JPY 大林組	900.00	7 594.62	0.00
JPY オービック	100.00	15 351.57	0.00
JPY 小田急電鉄	500.00	7 033.18	0.00
JPY 王子ホールディングス	1 300.00	829.44	0.00
JPY オリンパス	1 800.00	26 372.65	0.01
JPY オムロン	200.00	8 386.38	0.00
JPY 小野薬品工業	600.00	11 043.39	0.00
JPY オープンハウス	100.00	2 792.30	0.00
JPY 日本オラクル	100.00	7 734.97	0.00
JPY オリエンタルランド	1 600.00	54 384.96	0.01
JPY オリックス	1 800.00	32 856.23	0.01
JPY 大阪ガス	500.00	9 740.59	0.00
JPY 大塚商会	100.00	082.25	0.00
JPY 大塚ホールディングス	600.00	23 089.26	0.01
JPY パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	600.00	13 003.69	0.00
JPY パナソニック	3 400.00	35 187.88	0.01
JPY 楽天グループ	2 400.00	9 508.44	0.00
JPY リクルートホールディングス	2 100.00	78 198.67	0.02
JPY ルネサスエレクトロニクス	2 100.00	36 982.79	0.01
JPY りそなホールディングス	3 200.00	16 634.76	0.00
JPY リコー	700.00	5 715.16	0.00
JPY ローム	500.00	9 556.26	0.00
JPY SBIホールディングス	400.00	8 677.24	0.00
JPY SCSK	200.00	3 685.19	0.00
JPY セコム	300.00	20 891.53	0.01
JPY セイコーエプソン	500.00	7 433.96	0.00
JPY 積水化学工業	500.00	7 104.20	0.00
JPY 積水ハウス	900.00	18 440.15	0.01
JPY セブン&アイ・ホールディングス	1 100.00	40 886.80	0.01
JPY SGホールディングス	500.00	7 229.34	0.00
JPY シャープ	200.00	1 252.21	0.00
JPY 島津製作所	300.00	7 782.32	0.00
JPY シマノ	100.00	15 392.16	0.00
JPY 清水建設	900.00	5 914.97	0.00
JPY 信越化学工業	2 700.00	95 189.91	0.02
JPY 塩野義製薬	400.00	18 880.51	0.01
JPY 資生堂	600.00	16 096.32	0.00
JPY しずおかフィナンシャルグループ	700.00	5 663.07	0.00
JPY SMC	100.00	50 360.20	0.01
JPY ソフトバンク	200.00	51 095.48	0.01
JPY ソフトバンクグループ	1 500.00	61 081.61	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ (米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
JPY SOMPOホールディングス	400.00	18 282.54	0.01
JPY ソニーグループ	1 900.00	164 764.77	0.04
JPY スクウェア・エニックス・ホールディングス	100.00	3 471.44	0.00
JPY SUBARU	900.00	15 956.30	0.00
JPY SUMCO	500.00	7 496.53	0.00
JPY 住友化学	1 900.00	851.69	0.00
JPY 住友商事	1 600.00	33 550.92	0.01
JPY 住友電気工業	1 000.00	12 405.72	0.00
JPY 住友金属鉱山	400.00	11 612.95	0.00
JPY 三井住友フィナンシャルグループ	1 900.00	93 281.02	0.02
JPY 三井住友トラスト・ホールディングス	500.00	18 801.37	0.01
JPY 住友不動産	400.00	11 293.67	0.00
JPY サントリー食品インターナショナル	200.00	6 288.09	0.00
JPY スズキ	500.00	20 363.92	0.01
JPY シスメックス	200.00	11 067.74	0.00
JPY T&Dホールディングス	800.00	11 832.11	0.00
JPY 大成建設	200.00	6 806.24	0.00
JPY 武田薬品工業	2 300.00	64 798.59	0.02
JPY TDK	600.00	27 882.44	0.01
JPY テルモ	1 000.00	31 913.96	0.01
JPY T I S	300.00	6 345.59	0.00
JPY 東武鉄道	300.00	7 417.05	0.00
JPY 東宝	100.00	3 470.76	0.00
JPY 東京海上ホールディングス	2 700.00	66 625.63	0.02
JPY 東京電力ホールディングス	2 400.00	10 242.23	0.00
JPY 東京エレクトロン	700.00	113 758.58	0.03
JPY 東京ガス	600.00	13 908.75	0.00
JPY 東急	700.00	8 217.61	0.00
JPY TOPPANホールディングス	400.00	9 372.61	0.00
JPY 東レ	1 900.00	9 858.90	0.00
JPY 東芝	100.00	3 111.58	0.00
JPY 東ソー	300.00	3 991.61	0.00
JPY TOTO	200.00	5 136.81	0.00
JPY 豊田自動織機	200.00	17 201.61	0.01
JPY トヨタ自動車	15 600.00	294 884.16	0.07
JPY 豊田通商	300.00	16 619.88	0.00
JPY トレンドマイクロ	200.00	10 165.39	0.00
JPY ユニ・チャーム	600.00	19 331.01	0.01
JPY ユー・エス・エス	300.00	5 870.73	0.00
JPY 西日本旅客鉄道	300.00	11 865.26	0.00
JPY ヤクルト本社	400.00	8 936.99	0.00
JPY ヤマハ	200.00	682.25	0.00
JPY ヤマハ発動機	400.00	10 219.50	0.00
JPY ヤマトホールディングス	400.00	7 111.98	0.00
JPY 安川電機	300.00	11 512.16	0.00
JPY 横河電機	300.00	5 684.04	0.00
JPY ゼンショーホールディングス	100.00	5 556.19	0.00
JPY ZOO	200.00	227.69	0.00
日本合計		5 147 713.92	1.13
ルクセンブルグ			
EUR ARCELORMITTAL NPV(POST STOCK SPLIT)	709.00	17 862.19	0.01
EUR EUROFINS SCIENTIFI EURO.01	202.00	11 760.66	0.00
EUR TENARIS S.A. USD1	702.00	12 063.75	0.00
ルクセンブルグ合計		41 686.60	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ (米ドル)

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 (%)
マカオ			
HKD SANDS CHINA LTD USD0.01 REG 'S'	3 600.00	8 831.41	0.00
マカオ合計		8 831.41	0.00
オランダ			
EUR ABN AMRO BANK N.V. DR EACH REP SHS	654.00	8 787.73	0.00
EUR ADYEN NV EURO.01	33.00	38 562.75	0.01
USD AERCAP HOLDINGS EURO.01	261.00	17 805.42	0.00
EUR AKZO NOBEL NV EURO.50(POST REV SPLIT)	259.00	19 911.64	0.01
EUR ARGEN X NV EURO.10	84.00	37 339.19	0.01
EUR ASM INTL NV EURO.04	71.00	36 464.23	0.01
EUR ASML HOLDING NV EURO.09	593.00	403 094.89	0.09
EUR ASR NEDERLAND N.V. EURO.16	189.00	8 716.83	0.00
EUR BE SEMICONDUCTOR EURO.01	113.00	15 837.15	0.00
EUR CNH INDUSTRIAL NV COM EURO.01	1 473.00	15 654.03	0.00
EUR EURONEXT EUR1.60	146.00	12 138.71	0.00
EUR EXOR NV EURO.01	151.00	14 712.72	0.00
EUR FERRARI NV EURO.01(NEW)	186.00	67 093.48	0.02
EUR FERROVIAL SE EURO.01	784.00	27 168.22	0.01
EUR HEINEKEN HOLDING EUR1.6	196.00	15 247.90	0.00
EUR HEINEKEN NV EUR1.60	417.00	38 173.55	0.01
EUR IMCD NV EURO.16	84.00	12 973.40	0.00
EUR ING GROEP N.V. EURO.01	5 313.00	74 653.95	0.02
EUR JDE PEETS N.V. EURO.01	220.00	5 909.83	0.00
EUR KON KPN NV EURO.04	528.00	15 547.76	0.00
EUR KONINKLIJKE AHOLD EURO.01	1 393.00	40 368.61	0.01
EUR KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20	1 324.00	27 115.45	0.01
EUR NN GROUP N.V. EURO.12	321.00	12 219.98	0.00
EUR OCI N.V. EURO.02	190.00	092.28	0.00
EUR PROSUS N.V. EURO.05	2 238.00	74 233.21	0.02
EUR QIAGEN NV EURO.01	364.00	14 953.09	0.00
EUR RANDSTAD N.V. EURO.10	163.00	9 692.79	0.00
EUR STELLANTIS N V COM EURO.01	3 303.00	71 724.89	0.02
EUR UNIVERSAL MUSIC GR EUR10.00	1 219.00	32 240.43	0.01
EUR WOLTERS KLUWER EURO.12	378.00	52 090.64	0.01
オランダ合計		1 224 524.75	0.27
ニュージーランド			
NZD AUCLAND INTL NPV	1 929.00	9 436.26	0.01
NZD EBOS GROUP LIMITED NPV(POST RECON)	207.00	730.58	0.00
NZD FISHER & PAYKEL HE NPV	1 001.00	14 566.39	0.00
NZD MERCURY NZ LTD NPV	1 361.00	5 237.07	0.00
NZD MERIDIAN ENERGY LT NPV	2 081.00	6 703.00	0.00
NZD SPARK NEW ZEALAND NPV	2 590.00	8 294.51	0.00
AUD XERO LIMITED NPV	220.00	15 032.01	0.01
ニュージーランド合計		63 999.82	0.02
ノルウェー			
NOK ADEVINTA ASA SER 'B' NOK0.2	398.00	128.14	0.00
NOK AKER BP ASA NOK1	456.00	13 118.86	0.01
NOK DNB BANK ASA NOK12.50	1 260.00	24 092.29	0.01
NOK EQUINOR ASA NOK2.50	1 296.00	41 854.16	0.01
NOK GJENSIDIGE FORSIKR NOK2	356.00	6 014.36	0.00
NOK KONGSBERG GRUPPEN NOK5	149.00	6 419.60	0.00
NOK MOWI ASA NOK7.50	627.00	11 186.04	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)

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 (%)
NOK NORSK HYDRO ASA NOK3.6666	1 746.00	10 169.40	0.00
NOK ORKLA ASA NOK1.25	881.00	6 509.34	0.00
NOK SALMAR ASA NOK0.25	113.00	6 214.64	0.00
NOK TELENOR ASA ORD NOK6	973.00	10 498.38	0.00
NOK YARA INTERNATIONAL NOK1.7	208.00	7 068.54	0.00
ノルウェー合計		147 273.75	0.03
ポルトガル			
EUR EDP ENERGIAS PORTU EUR1(REGD)	147.00	19 850.26	0.01
EUR GALP ENERGIA EUR1-B	788.00	11 740.39	0.00
EUR JERONIMO MARTINS EUR5	481.00	11 913.39	0.00
ポルトガル合計		43 504.04	0.01
シンガポール			
SGD CAPITALAND INVESTM NPV	500.00	10 216.54	0.00
SGD CITY DEVELOPMENTS SGD0.50	400.00	1 876.22	0.00
SGD DBS GROUP HLDGS SGD1	2 600.00	61 834.26	0.02
SGD GENTING SINGAPORE LTD	16 100.00	11 038.14	0.00
USD GRAB HLDGS LTD COM USD0.000001 CL A	2 300.00	6 992.00	0.00
SGD JARDINE CYCLE & CA SGD1	100.00	2 136.97	0.00
SGD KEPPEL CORP NPV	2 100.00	10 495.28	0.00
SGD MAPLETREE LOGISTICS TRUST-UNITS REIT	7 051.00	8 506.00	0.00
SGD OVERSEA-CHINESE BK NPV	861.00	45 674.31	0.01
USD SEA LTD ADS EACH REP ONE CL A SHS	500.00	18 110.00	0.01
SGD SEMBCORP INDUSTRIE SGD0.25 (POST REORG)	1 000.00	3 851.34	0.00
SGD SEMBCORP MARINE NPV	55 347.00	354.44	0.00
SGD SINGAPORE AIRLINES NPV	2 000.00	9 500.97	0.00
SGD SINGAPORE EXCHANGE SGD0.01	1 200.00	8 478.95	0.00
SGD SINGAPORE TECH ENG NPV	3 000.00	8 339.58	0.00
SGD SINGAPORE TELECOMM NPV	13 300.00	23 020.38	0.01
SGD UOL GROUP LIMITED SGD1	700.00	3 094.56	0.00
SGD UTD O/S BANK SGD1	1 700.00	34 672.56	0.01
SGD WILMAR INTERNATIONAL LTD	3 000.00	8 159.75	0.00
シンガポール合計		280 352.25	0.06
スペイン			
EUR ACCIONA SA EUR1	45.00	6 358.39	0.00
EUR ACS ACTIVIDADES CO EURO.5	336.00	13 436.24	0.00
EUR AENA SME S.A. EUR10	106.00	18 267.96	0.00
EUR AMADEUS IT GROUP EURO.01	648.00	44 415.80	0.01
EUR BANCO SANTANDER SA EURO.50(REGD)	23 727.00	98 402.30	0.02
EUR BBVA(BILB-VIZ-ARG) EURO.49	8 788.00	81 560.52	0.02
EUR CAIXABANK SA EUR1	6 143.00	27 688.55	0.01
EUR CELLNEX TELECOM SA EURO.25	854.00	32 650.25	0.01
EUR CORP ACCIONA ENERG EUR1	51.00	1 515.80	0.00
EUR EDP RENOVAVEIS SA EUR5	529.00	9 667.96	0.00
EUR ENAGAS SA EUR1.50	318.00	5 829.09	0.00
EUR ENDESA SA EUR1.2	410.00	8 582.43	0.00
EUR GRIFOLS SA EURO.25 (CLASS A) POST SUBD	451.00	6 379.90	0.00
EUR IBERDROLA SA EURO.75 (POST SUBDIVISION)	9 154.00	113 313.06	0.03
EUR INDITEX EURO.03 (POST SUBD)	1 594.00	65 794.44	0.01
EUR NATURGY ENERGY GRO EUR1	226.00	6 761.46	0.00
EUR RED ELECTRICA CORP EURO.5	645.00	10 823.82	0.00
EUR REPSOL SA EUR1	1 823.00	27 926.62	0.01
EUR TELEFONICA SA EUR1	7 725.00	33 327.27	0.01
スペイン合計		612 701.86	0.13

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ (米ドル)

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 (%)
スウェーデン			
SEK ALFA LAVAL AB NPV	380.00	14 193.54	0.00
SEK ASSA ABLOY SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	1 412.00	36 206.68	0.01
SEK ATLAS COPCO AB SER ' A ' NPV (POST SPLIT)	3 785.00	58 478.89	0.01
SEK ATLAS COPCO AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	2 160.00	28 538.63	0.01
SEK BEIJER REF AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	564.00	6 248.82	0.00
SEK BOLIDEN AB NPV (POST SPLIT)	347.00	9 268.70	0.00
SEK EPIROC AB SER ' A ' NPV (POST SPLIT)	998.00	18 628.84	0.01
SEK EPIROC AB SER ' B ' NPV	644.00	10 146.57	0.00
SEK EQT AB NPV	492.00	11 620.55	0.00
SEK ERICSSON SER ' B ' NPV	218.00	20 915.20	0.01
SEK ESSITY AB SER ' B ' NPV	897.00	22 470.26	0.01
SEK EVOLUTION AB NPV	252.00	26 150.27	0.01
SEK FASTIGHETS AB BALD SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	969.00	5 720.32	0.00
SEK GETINGE AB SER ' B ' NPV	305.00	6 490.69	0.00
SEK HENNES & MAURITZ SER ' B ' NPV	881.00	14 116.04	0.00
SEK HEXAGON AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	2 880.00	28 830.64	0.01
SEK HOLMEN AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	104.00	365.90	0.00
SEK HUSQVARNA AB SER ' B ' NPV	638.00	878.07	0.00
SEK INDUSTRIVARDEN AB SER ' C ' NPV	238.00	7 172.58	0.00
SEK INDUSTRIVARDEN AB SER ' A ' NPV	154.00	635.20	0.00
SEK INDUTRADE AB NPV	416.00	9 130.77	0.00
SEK INVESTOR AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	2 385.00	49 571.57	0.01
SEK LATOUR INVESTMENT SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	200.00	483.32	0.00
SEK LIFCO AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	292.00	6 345.01	0.00
SEK LUNDBERGFÖRETAGEN SER ' B ' NPV	79.00	3 846.40	0.00
SEK NIBE INDUSTRIER AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	2 068.00	12 227.80	0.00
SEK SAAB AB SER ' B ' NPV	125.00	6 432.00	0.00
SEK SAGAX AB NPV B	247.00	5 607.61	0.00
SEK SANDVIK AB NPV (POST SPLIT)	1 461.00	28 860.71	0.01
SEK SECURITAS SER ' B ' NPV	762.00	6 867.48	0.00
SEK SKAND ENSKILDA BKN SER ' A ' NPV	2 307.00	27 960.03	0.01
SEK SKANSKA AB SER ' B ' NPV	535.00	8 602.80	0.00
SEK SKF AB SER ' B ' NPV	501.00	9 423.47	0.00
SEK SVENSKA CELLULOSA SER ' B ' NPV	873.00	12 983.97	0.00
SEK SVENSKA HANDELSBKN SER ' A ' NPV (P/S)	2 004.00	19 009.49	0.01
SEK SWEDBANK AB SER ' A ' NPV	1 265.00	23 220.37	0.01
SEK SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB NPV	256.00	6 097.77	0.00
SEK TELE2 AB SHS	796.00	6 248.68	0.00
SEK TELIA COMPANY AB NPV	2 813.00	6 684.29	0.00
SEK VOLVO AB SER ' A ' NPV (POST SPLIT)	264.00	6 242.98	0.00
SEK VOLVO AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	2 106.00	48 887.47	0.01
SEK VOLVO CAR AB SER ' B ' NPV (WI)	645.00	2 103.25	0.00
スウェーデン合計		649 913.63	0.14
スイス			
CHF ABB LTD CHF0.12 (REGD)	2 222.00	88 696.02	0.02
CHF ADECCO GROUP AG CHF0.1 (REGD)	238.00	11 514.76	0.00
CHF ALCON AG CHF0.04	705.00	53 445.58	0.01
CHF AVOLTA AG CHF5 (REGD)	122.00	283.43	0.00
CHF BACHEM HOLDING AG CHF0.01 (REGD) (SUBD)	49.00	3 662.81	0.00
CHF BALOISE-HLDGS CHF0.1(REGD)	75.00	11 549.08	0.00
CHF BARRY CALLEBAUT AG CHF0.02 (REGD)	5.00	8 377.90	0.00
CHF BKW AG CHF2.5	32.00	5 682.02	0.00
CHF BQE CANT VAUDOISE CHF1	43.00	5 276.41	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ (米ドル)

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 (%)
CHF CLARIANT CHF4.00(REGD)	347.00	5 215.67	0.00
GBP COCA-COLA HBC AG ORD CHF6.70	370.00	10 286.10	0.00
EUR DSM FIRMENICH AG EURO.01	273.00	25 875.99	0.01
CHF EMS-CHEMIE HLDG AG CHF0.01(REGD)(POST RECON)	12.00	8 563.05	0.00
CHF GEBERIT CHF0.10(REGD)	47.00	26 452.53	0.01
CHF GIVAUDAN AG CHF10	14.00	52 680.12	0.01
GBP GLENORE XSTRATA ORD USD0.01	15 388.00	86 064.57	0.02
CHF HELVETIA HOLDING CHF0.02 (REGD) POST SUBD	44.00	6 056.93	0.00
CHF HOLCIM LTD CHF2 (REGD)	721.00	53 315.28	0.01
CHF JULIUS BAER GRUPPE CHF0.02 (REGD)	283.00	14 398.16	0.00
CHF KUEHNE&NAGEL INTL CHF1(REGD)(POST-SUBD)	69.00	20 091.77	0.01
CHF LINDT & SPRUENGLI PTG CERT CHF10	3.00	37 329.65	0.01
CHF LOGITECH INTL CHF0.25(REGD) (POST-SUBD)	216.00	18 938.35	0.01
CHF LONZA GROUP AG CHF1(REGD)	105.00	40 862.52	0.01
CHF NESTLE SA CHF0.10(REGD)	3 777.00	431 539.24	0.10
CHF NOVARTIS AG CHF0.49 (REGD)	2 905.00	284 369.62	0.06
CHF PARTNERS GROUP HLG CHF0.01 (REGD)	34.00	45 063.54	0.01
CHF RICHEMONT(CIE FIN) CHF1.00 (REG) SER ‘A’	730.00	91 675.00	0.02
CHF ROCHE HLDGS AG CHF1(BR)	43.00	12 352.83	0.00
CHF ROCHE HLDGS AG GENUSSCHEINE NPV	984.00	267 118.85	0.06
CHF SANDOZ GROUP AG CHF0.05	545.20	15 681.04	0.00
CHF SCHINDLER-HLDG AG CHF0.1(REGD)(POST-SUBD)	29.00	6 249.90	0.00
CHF SCHINDLER-HLDG AG PTG CERT CHF0.10(POST-SUBD)	54.00	12 156.29	0.00
CHF SGS SA CHF0.04	203.00	17 345.64	0.00
CHF SIG COMBIBLOC GROU CHF0.1	450.00	10 577.88	0.00
CHF SIKA AG CHF0.01 (REG)	217.00	59 194.30	0.01
CHF SONOVA HOLDING AG CHF0.05 (REGD)	72.00	20 890.81	0.01
EUR STMICROELECTRONICS EUR1.04	1 045.00	49 547.37	0.01
CHF STRAUMANN HLDG CHF0.01 (REGD) (POST SPLIT)	163.00	22 541.26	0.01
CHF SWATCH GROUP CHF0.45(REGD)	109.00	5 502.96	0.00
CHF SWATCH GROUP CHF2.25(BR)	42.00	11 085.04	0.00
CHF SWISS LIFE HLDG CHF5.1(REGD)	38.00	24 498.65	0.01
CHF SWISS PRIME SITE CHF15.3 (REGD)	107.00	10 828.59	0.00
CHF SWISS RE AG CHF0.10	416.00	49 395.66	0.01
CHF SWISSCOM AG CHF1(REGD)	35.00	20 543.96	0.01
CHF TEMENOS AG CHF5 (REGD)	100.00	8 512.45	0.00
CHF UBS GROUP CHF0.10 (REGD)	715.00	133 552.35	0.03
CHF VAT GROUP AG CHF0.10	39.00	18 231.84	0.01
CHF ZURICH INSURANCE GRP CHF0.10	203.00	102 229.54	0.02
スイス合計		2 329 303.31	0.51

イギリス

GBP 3I GROUP ORD GBP0.738636	1 452.00	41 027.72	0.01
GBP ABRDN PLC ORD GBP0.1396825396	3 103.00	6 401.07	0.00
GBP ADMIRAL GROUP ORD GBP0.001	291.00	9 950.25	0.00
GBP ANGLO AMERICAN USD0.54945	1 748.00	47 399.90	0.01
GBP ANTOFAGASTA ORD GBP0.05	591.00	10 538.07	0.00
GBP ASHTEAD GROUP ORD GBP0.10	635.00	38 288.72	0.01
GBP ASSOCD BRIT FOODS ORD GBP0.0568	478.00	14 389.85	0.00
GBP ASTRAZENCA ORD USD0.25	2 275.00	291 632.47	0.07
GBP AUTO TRADER GROUP ORD GBP0.01	1 372.00	12 588.94	0.00
GBP AVIVA ORD GBP0.33	3 853.00	20 364.43	0.01
GBP BAE SYSTEMS ORD GBP0.025	483.00	59 590.17	0.01
GBP BARCLAYS ORD GBP0.25	20 915.00	37 343.65	0.01
GBP BARRATT DEVEL ORD GBP0.10	1 511.00	9 828.23	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ (米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
GBP BERKELEY GP HLDGS ORD GBP0.053943	152.00	8 920.80	0.00
GBP BP ORD USD0.25	25 418.00	154 164.40	0.03
GBP BRIT AMER TOBACCO ORD GBP0.25	2 970.00	94 447.97	0.02
GBP BT GROUP ORD GBP0.05	9 911.00	15 420.06	0.00
GBP BUNZL ORD GBP0.32142857	494.00	18 773.89	0.01
GBP BURBERRY GROUP ORD GBP0.0005	537.00	9 949.10	0.00
GBP CENTRICA ORD GBP0.061728395	7 996.00	15 087.64	0.00
USD COCA-COLA EUROPACI COM EURO.01	287.00	17 403.68	0.01
GBP COMPASS GROUP ORD GBP0.1105	2 406.00	61 008.89	0.01
GBP CRODA INTL ORD GBP0.10609756	188.00	10 671.86	0.00
GBP DIAGEO ORD GBP0.28 101/108	3 291.00	115 134.09	0.03
GBP ENDEAVOUR MINING P ORD USD0.01	228.00	5 308.03	0.00
GBP GSK PLC ORD GBP0.3125	5 984.00	107 525.87	0.02
GBP HALEON PLC ORD GBP1.25	8 071.00	33 722.81	0.01
GBP HALMA ORD GBP0.10	588.00	15 862.71	0.00
GBP HARGREAVES LANSDOW ORD GBP0.004 (WI)	537.00	883.79	0.00
GBP HIKMA PHARMACEUTIC ORD GBP0.10	283.00	6 174.68	0.00
GBP HSBC HLDGS ORD USD0.50(UK REG)	29 043.00	221 374.02	0.05
GBP IMPERIAL BRANDS PL GBP0.10	1 275.00	29 804.11	0.01
GBP INFORMA PLC (GB) ORD GBP0.001	2 086.00	19 620.93	0.01
GBP INTERCONTL HOTELS ORD GBP0.208521303	268.00	20 750.03	0.01
GBP INTERTEK GROUP ORD GBP0.01	239.00	12 057.10	0.00
GBP JD SPORTS FASHION ORD GBP0.0005	260.00	8 469.62	0.00
GBP KINGFISHER ORD GBP0.157142857	2 844.00	7 899.20	0.00
GBP LAND SECURITIES GP ORD GBP0.106666666	802.00	6 337.45	0.00
GBP LEGAL & GENERAL GP ORD GBP0.025	9 220.00	26 764.03	0.01
GBP LLOYDS BANKING GP ORD GBP0.1	92 159.00	50 715.88	0.01
GBP LONDON STOCK EXCH ORD GBP0.06918604	623.00	70 240.45	0.02
GBP M&G PLC ORD GBP0.05	3 473.00	9 197.79	0.00
GBP MELROSE INDUST PLC ORD GBP0.22857142	2 110.00	13 852.61	0.00
GBP MONDI ORD EURO.20	671.00	11 951.80	0.00
GBP NATIONAL GRID ORD GBP0.12431289	5 182.00	67 405.57	0.02
GBP NATWEST GROUP PLC ORD GBP1.0769	8 973.00	23 616.13	0.01
GBP NEXT ORD GBP0.10	179.00	17 969.78	0.01
GBP OCADO GROUP PLC ORD GBP0.02	714.00	5 423.33	0.00
GBP PEARSON ORD GBP0.25	865.00	10 262.78	0.00
GBP PERSIMMON ORD GBP0.10	517.00	8 191.03	0.00
GBP PHOENIX GP HLDGS ORD GBP0.10	1 056.00	6 218.99	0.00
GBP PRUDENTIAL ORD GBP0.05	021.00	43 930.02	0.01
GBP RECKITT BENCK GRP ORD GBP0.10	1 045.00	71 411.10	0.02
GBP RELX PLC GBP0.1444	2 793.00	107 488.27	0.02
GBP RENTOKIL INITIAL ORD GBP0.01	3 795.00	20 595.96	0.01
GBP RIO TINTO ORD GBP0.10	1 643.00	112 296.82	0.03
GBP ROLLS-ROYCE HLDGS ORD GBP0.20	12 246.00	41 671.59	0.01
GBP SAGE GROUP GBP0.01051948	1 566.00	22 411.91	0.01
GBP SAINSBURY(J) ORD GBP0.28571428	2 276.00	8 237.64	0.00
GBP SCHROEDERS PLC ORD GBP0.20	1 308.00	6 649.95	0.00
GBP SEVERN TRENT ORD GBP0.9789	364.00	11 985.56	0.00
GBP SHELL PLC ORD EURO.07	9 852.00	319 286.77	0.07
GBP SMITH & NEPHEW ORD USD0.20	1 271.00	16 468.35	0.00
GBP SMITHS GROUP ORD GBP0.375	570.00	11 891.83	0.00
GBP SPIRAX-SARCO ENG ORD GBP0.269230769	117.00	13 697.78	0.00
GBP SSE PLC ORD GBP0.50	1 599.00	37 094.46	0.01
GBP ST JAMES ' S PLACE ORD GBP0.15	900.00	7 389.86	0.00
GBP STANDARD CHARTERED ORD USD0.50	3 640.00	30 099.83	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
GBP TAYLOR WIMPEY ORD GBP0.01	666.00	7 652.41	0.00
GBP TESCO ORD GBP0.0633333	10 304.00	37 280.75	0.01
GBP UNILEVER PLC ORD GBP0.031111	3 677.00	175 466.39	0.04
GBP UNITED UTILITIES G ORD GBP0.05	972.00	13 424.79	0.00
GBP VODAFONE GROUP ORD USD0.2095238(POST CONS)	33 390.00	30 151.25	0.01
GBP WHITBREAD ORD GBP0.76797385	288.00	11 269.59	0.00
GBP WISE PLC CLS A ORD GBP0.01	992.00	9 805.47	0.00
GBP WPP PLC ORD GBP0.10	1 516.00	13 564.77	0.00
イギリス合計		3 123 149.49	0.69
アメリカ合衆国			
CAD BROOKFIELD RENEWA. CLASS A SUB VOTING SHARES	200.00	5 310.32	0.00
アメリカ合衆国合計		5 310.32	0.00
株式合計		25 092 670.10	5.49
投資信託証券			
アイルランド			
USD STAR COMPASS PLC/UBS DYNMC DIVERSIFIED LTD NOTE DUE 30.09.25	21 105 000.00	36 868 324.50	8.06
アイルランド合計		36 868 324.50	8.06
投資信託証券合計		36 868 324.50	8.06
コモディティ証券			
イギリス			
USD UBS AG/LONDON/UBS ETC CMC1 COMPOSITE USD 16-PRP	12 771.00	1 886 595.98	0.41
イギリス合計		1 886 595.98	0.41
コモディティ証券合計		1 886 595.98	0.41
投資信託、クローズド・エンド型			
カナダ			
CAD CANADIAN APARTMENT PROP. REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	100.00	3 409.67	0.00
CAD RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	157.00	2 022.93	0.00
カナダ合計		5 432.60	0.00
シンガポール			
SGD CAPITALAND ASCENDAS REIT- UNITS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6 800.00	14 470.25	0.01
SGD CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST REAL ESTATE INV TRUST	10 545.00	14 380.26	0.00
SGD MAPLETREE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5 700.00	5 851.19	0.00
シンガポール合計		34 701.70	0.01
イギリス			
GBP SEGRO PLC REIT	1 790.00	18 404.86	0.00
イギリス合計		18 404.86	0.00
投資信託、クローズド・エンド型合計		58 539.16	0.01
財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン 米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 20.04.23-18.04.24	4 200 000.00	4 115 908.48	0.90
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 29.12.22-28.12.23	2 330 000.00	2 320 763.16	0.51
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 23.03.23-21.03.24	4 200 000.00	4 132 255.30	0.90
米ドル合計		10 568 926.94	2.31
財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン合計		10 568 926.94	2.31
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		74 475 056.68	16.28

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券および短期金融商品			
財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 23.02.23-22.02.24	2 260 000.00	2 232 652.40	0.49
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 26.01.23-25.01.24	2 350 000.00	2 331 031.36	0.51
米ドル合計		4 563 683.76	1.00
財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン合計		4 563 683.76	1.00
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		4 563 683.76	1.00

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

EUR AMBIENTA X ICAV-AMBIENTA X ALPHA FUND - ACCUM-F- EUR	391.81	474 791.58	0.10
EUR KEPLER LIQUID STRATEGIES ICAV - KLS ARETE MACRO FUND-SI- EUR	7 544.88	963 293.18	0.21
USD MAN FUNDS VI PLC-MAN AHL TARGETRISK-INU-USD-CAP	55 473.13	7 994 232.04	1.75
EUR MERIAN GLOBAL FUNDS PLC-MER GBL EQ AB RETRN-I-ACC-EUR HDG	441 989.03	879 824.62	0.19
EUR TAGES INTERNATIONAL FUNDS ICAV ACCUM SHS INSTIT. FD EUR	5 582.37	623 871.08	0.14
USD UBS(TRL)FUND SOLUTION PLC-MSCI USA SF UCITS SHS-A-ETF-ACC	448 229.00	57 973 938.86	12.67
アイルランド合計		68 909 951.36	15.06

ルクセンブルグ

EUR ALMA PLATINUM IV UBS MULTI-STRATEGY ALTERNATIVES-I0C-E-CAP	1 508.22	15 602 036.07	3.41
USD AQR UCITS FUNDS - GLOBAL RISK PARITY UCITS FUND-A2-CAP	51 046.65	6 142 953.86	1.34
EUR DB PLATINUM IV SYSTEMATIC ALPHA-SHS IIC-E-CAPITALISATION	5 327.66	863 173.66	0.19
USD FOCUSED SICAV - HIGH GRADE BOND USD U-X-ACC	7 890.00	77 140 766.70	16.86
USD FOCUSED SICAV - HIGH GRADE LONG TERM BOND USD U-X-ACC	6 631.00	59 119 940.39	12.92
USD INVESCO FUNDS SICAV BAL RISK ALLOCATION-PI1-USD HDG-CAP	337 662.22	4 345 712.75	0.95
EUR LUMY-MWTOP ENV MKT NEU-EURBA UCITS FUND-SHS-B-CAPITALISATION	5 661.77	717 786.44	0.16
EUR SCHRODER GAIA WELLINGTON PAGOSA-C-EUR HDG-CAPITALISATION	8 291.26	953 872.84	0.21
USD UBS (LUX) BD SICAV-USD INVES GRA CORPOR SUSTAI (USD) F-ACC	620.58	68 324 306.77	14.93
USD UBS (LUX) BOND FUND-EURO HIGH YIELD (EUR)(USD HEDGED) F-ACC	83 307.00	11 073 166.44	2.42
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD (USD) F-ACC	47 359.00	16 588 910.52	3.63
USD UBS (LUX) BOND SICAV - EMERG ECON CORPORATES (USD) F-ACC	127 861.00	14 643 920.33	3.20
USD UBS (LUX) EMERGING ECONOMIES FUND - GLOBAL BONDS (USD) F-ACC	11 837.00	21 970 537.33	4.80
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD SUSTAINABLE U-X-ACC	10.00	119 810.70	0.03

ルクセンブルグ合計 297 606 894.80 65.05

投資信託、オープン・エンド型合計 366 516 846.16 80.11

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 366 516 846.16 80.11

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派生商品

株式に係るワラント債

カナダ

CAD CONSTELLATION SOFTWARE INC/CANADA CALL WARRANT 31.03.40	32.00	0.00	0.00
カナダ合計		0.00	0.00

株式に係るワラント債合計 0.00 0.00

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派生商品合計 0.00 0.00

投資有価証券合計 445 555 586.60 97.39

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ (米ドル)

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 (%)
派生商品			
公認の証券取引所に上場されている派生商品			
債券に係る金融先物			
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 19.03.24	-138.00	-185 437.50	-0.04
USD US LONG BOND FUTURE 19.03.24	-17.00	-28 718.75	-0.01
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.03.24	-234.00	-248 625.00	-0.05
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 28.03.24	15.00	12 656.28	0.00
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 28.03.24	-55.00	-45 546.93	-0.01
債券に係る金融先物合計		-495 671.90	-0.11
指数に係る金融先物			
EUR EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 15.12.23	-1.00	-3 840.67	0.00
CHF SWISS MARKET INDEX FUTURE 15.12.23	1.00	2 944.05	0.00
GBP FTSE 100 INDEX FUTURE 15.12.23	1.00	246.86	0.00
SEK OMX 30 INDEX FUTURE 15.12.23	-1.00	-940.94	0.00
USD MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 15.12.23	200.00	294 750.00	0.06
USD S&P500 EMINI FUTURE 15.12.23	-2.00	-2 887.50	0.00
HKD HANG SENG INDEX FUTURE 28.12.23	1.00	-4 647.71	0.00
AUD SPI 200 INDEX FUTURES 21.12.23	-1.00	-5 204.94	0.00
JPY TOPIX INDX FUTURE 07.12.23	-1.00	-10 180.27	0.00
CAD S&P/TSX 60 IX FUTURE 14.12.23	1.00	395.77	0.00
指数に係る金融先物合計		274 634.65	0.06
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		-221 037.25	-0.05
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派生商品			
指数に係るスワップおよび先渡スワップ			
USD UBS/CMCI EXCESS RETURN INDEX TRS EQS REC PERF 23-04.04.24	11 764 965.42	-171 924.84	-0.04
USD UBS/CMCI EXCESS RETURN INDEX TRS EQS PAY 0.3800% 23-04.04.24			
指数に係るスワップおよび先渡スワップ合計		-171 924.84	-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 取引されていない派生商品合計		-171 924.84	-0.04
派生商品合計		-392 962.09	-0.09

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)

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／購入額／売却通貨／売却額／満期日(日-月-年)			
USD 5 862 216.23	JPY 880 007 527.00	7.12.2023	-94 677.34 -0.02
USD 147 971.15	NZD 249 383.00	7.12.2023	-6 061.59 0.00
USD 397 719.03	SGD 538 930.00	7.12.2023	-6 177.97 0.00
USD 3 429 775.83	CAD 4 721 000.00	7.12.2023	-52 362.81 -0.01
USD 119 904.13	NOK 1 338 935.00	7.12.2023	-4 334.03 0.00
USD 3 887 194.67	GBP 3 168 980.69	7.12.2023	-124 675.73 -0.03
USD 117 015.66	ILS 449 553.00	7.12.2023	-3 711.84 0.00
USD 906 826.00	SEK 9 891 108.48	7.12.2023	-37 254.30 -0.01
USD 1 167 000.39	HKD 9 115 867.54	7.12.2023	-248.40 0.00
USD 407 844.46	DKK 2 844 906.00	7.12.2023	-8 590.79 0.00
USD 2 047 627.44	AUD 3 180 000.00	7.12.2023	-61 174.70 -0.01
USD 29 620 663.30	EUR 27 731 120.23	7.12.2023	-642 215.28 -0.14
USD 2 586 972.04	CHF 2 323 000.00	7.12.2023	-85 817.74 -0.02
SGD 11 804 800.00	USD 8 699 727.91	11.1.2024	162 192.05 0.03
GBP 13 093 200.00	USD 16 113 267.04	11.1.2024	467 934.10 0.10
CHF 78 102 700.00	USD 87 196 900.77	11.1.2024	3 036 301.22 0.66
EUR 81 678 600.00	USD 87 775 744.13	11.1.2024	1 508 731.73 0.33
USD 9 672.73	SGD 13 000.00	11.1.2024	-86.43 0.00
USD 703 506.79	EUR 646 300.00	11.1.2024	-2 976.39 0.00
EUR 500 000.00	USD 543 496.80	7.12.2023	2 151.52 0.00
USD 234 984.12	CHF 207 000.00	11.1.2024	-4 166.04 0.00
USD 726 291.52	EUR 664 500.00	11.1.2024	-86.43 0.00
EUR 1 693 100.00	USD 1 856 091.01	11.1.2024	-5 330.27 0.00
USD 938 817.93	EUR 856 900.00	11.1.2024	2 123.77 0.00
USD 359 322.33	CHF 313 200.00	11.1.2024	-2 522.25 0.00
EUR 640 000.00	USD 698 387.20	7.12.2023	42.66 0.00
先渡為替契約合計			4 037 006.72 0.88
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			6 513 655.78 1.42
その他の資産および負債			1 764 545.78 0.40
純資産総額			457 477 832.79 100.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)

2023年11月30日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

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

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			
オーストラリア			
AUD AMPOL LTD NPV	569.00	12 914.14	0.00
AUD ANZ GROUP HLDGS LI NPV	7 865.00	127 086.83	0.04
AUD APA GROUP NPV	3 309.00	18 715.10	0.01
AUD ARISTOCRAT LEISURE NPV	1 535.00	41 311.76	0.01
AUD ASX LTD NPV	520.00	20 025.17	0.01
AUD AURIZON HOLDINGS NPV	5 868.00	13 734.44	0.00
AUD BHP GROUP LTD NPV	13 425.00	412 136.96	0.15
AUD BLUESCOPE STEEL NPV	1 050.00	14 467.09	0.01
AUD BRAMBLES LTD NPV	3 832.00	33 894.37	0.01
AUD CARSALES.COM LTD NPV	781.00	14 385.65	0.01
AUD CMNWLTH BK OF AUST NPV	362.00	302 700.17	0.11
AUD COCHLEAR LTD NPV	166.00	30 052.50	0.01
AUD COLES GROUP LTD NPV	3 623.00	36 826.19	0.01
AUD COMPUTERSHARE LTD NPV(POST REC)	1 612.00	25 235.23	0.01
AUD CSL NPV	1 255.00	218 208.86	0.08
AUD DEXUS NPV (STAPLED)	3 318.00	15 488.00	0.01
AUD ENDEAVOUR GROUP LI NPV	138.00	13 526.45	0.00
AUD FORTESCUE LTD NPV	572.00	75 756.30	0.03
AUD GOODMAN GROUP (STAPLED SECURITY)	419.00	66 657.91	0.02
AUD GPT GROUP NPV (STAPLED SECURITIES)	5 811.00	15 874.29	0.01
AUD IDP EDUCATION LTD NPV	511.00	7 677.63	0.00
AUD IGO LTD NPV	1 957.00	11 133.31	0.00
AUD INSURANCE AUST GRP NPV	6 964.00	27 427.83	0.01
AUD MACQUARIE GP LTD NPV	964.00	108 053.41	0.04
AUD MEDIBANK PRIVATE L NPV	7 899.00	18 121.51	0.01
AUD MINERAL RESS LTD NPV	422.00	17 115.80	0.01
AUD MIRVAC GROUP STAPLED SECURITIES	14 109.00	19 271.24	0.01
AUD NATL AUSTRALIA BK NPV	8 232.00	155 013.66	0.05
AUD NTHN STAR RES LTD NPV	3 102.00	26 182.82	0.01
AUD ORICA LIMITED NPV	985.00	10 201.49	0.00
AUD ORIGIN ENERGY NPV	799.00	26 219.49	0.01
AUD PILBARA MINERALS L NPV	7 860.00	18 970.13	0.01
AUD QANTAS AIRWAYS NPV	2 260.00	7 942.01	0.00
AUD QBE INS GROUP NPV	3 772.00	38 440.75	0.01
AUD RAMSAY HEALTH CARE NPV	467.00	15 222.12	0.01
AUD REA GROUP LIMITED NPV	114.00	11 734.99	0.00
AUD REECE AUSTRALIA NPV	535.00	6 860.51	0.00
AUD RIO TINTO LIMITED NPV	951.00	78 845.29	0.03
AUD SANTOS LIMITED NPV	8 988.00	41 180.10	0.01
AUD SCENTRE GROUP NPV STAPLED UNIT	16 434.00	28 875.89	0.01
AUD SEEK LIMITED NPV	834.00	13 205.25	0.00
AUD SONIC HEALTHCARE NPV	1 123.00	21 720.13	0.01
AUD SOUL PATTINSON(WH) NPV	502.00	11 150.51	0.00
AUD SOUTH32 LTD NPV	14 567.00	29 748.64	0.01
AUD STOCKLAND NPV (STAPLED)	7 604.00	20 822.77	0.01
AUD SUNCORP GROUP LTD NPV	3 303.00	30 595.06	0.01
AUD TELSTRA GROUP LTD NPV	13 126.00	33 246.20	0.01
AUD THE LOTTERY CORPOR NPV	6 082.00	18 550.28	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
AUD TRANSURBAN GROUP STAPLED UNITS NPV	7 926.00	68 109.13	0.02
AUD TREASURY WINE ESTA NPV	2 244.00	15 920.36	0.01
AUD VICINITY CENTRES NPV (STAPLED SECURITY)	11 417.00	14 345.23	0.01
AUD WESFARMERS LTD NPV	2 997.00	104 643.89	0.04
AUD WESTPAC BKG CORP NPV	9 297.00	131 732.71	0.05
AUD WISETECH GLOBAL LT NPV	427.00	18 912.57	0.01
AUD WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	3 733.00	76 730.14	0.03
GBP WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	1 226.00	24 817.35	0.01
AUD WOOLWORTHS GRP LTD NPV	3 148.00	72 846.12	0.03
オーストラリア合計		2 890 583.73	1.04
オーストリア			
EUR ERSTE GROUP BK AG NPV	958.00	38 790.11	0.01
EUR OMV AG NPV (VAR)	364.00	15 548.83	0.01
EUR VERBUND AG CLASS 'A' NPV	204.00	19 476.14	0.01
EUR VOESTALPINE AG NPV	358.00	10 085.65	0.00
オーストリア合計		83 900.73	0.03
ベルギー			
EUR AGEAS NPV	460.00	19 815.25	0.01
EUR ANHEUSER-BUSCH IN NPV	2 299.00	144 511.17	0.05
EUR ELIA SYS OPERATOR NPV	87.00	9 440.36	0.00
EUR GPE BRUXELLES LAM NPV	229.00	18 164.96	0.01
EUR KBC GROUP NV NPV	633.00	36 329.05	0.02
EUR LOTUS BAKERIES NPV	1.00	8 706.98	0.00
EUR SA D' IETEREN NV NPV	61.00	10 422.84	0.00
EUR SOFINA NPV	39.00	8 689.30	0.00
EUR SOLVAY SA NPV	186.00	21 542.57	0.01
EUR UCB NPV	335.00	24 796.78	0.01
EUR UNICORE NPV	626.00	16 754.69	0.01
EUR WAREHOUSES DE PAUW NPV (POST SPLIT)	456.00	12 826.62	0.00
ベルギー合計		332 000.57	0.12
バミューダ			
EUR AEGON LIMITED EURO.12	012.00	22 001.28	0.01
バミューダ合計		22 001.28	0.01
カナダ			
CAD 1ST QUANTUM MINLS COM NPV	1 735.00	14 216.80	0.01
CAD AGNICO EAGLE MINES LTD COM	1 277.00	68 613.38	0.02
CAD AIR CANADA VAR VTG SHS NPV	592.00	7 697.72	0.00
CAD ALGONQUIN PWR&UTIL COM NPV	2 000.00	12 346.50	0.00
CAD ALIMENTATION COUCH COM NPV	2 088.00	119 195.49	0.04
CAD ALTAGAS LTD COM NPV	707.00	14 391.86	0.01
CAD ARC RESOURCES COM NPV	1 575.00	25 137.74	0.01
CAD BANK NOVA SCOTIA HALIFAX COM	3 137.00	140 440.24	0.05
CAD BANK OF MONTREAL COM NPV	1 884.00	154 766.32	0.06
CAD BARRICK GOLD CORP COM NPV	652.00	81 796.42	0.03
CAD BCE INC COM NEW	187.00	7 369.11	0.00
CAD BROOKFIELD ASSET.M CLASS A LTD VOTING SHS	938.00	32 868.22	0.01
CAD BROOKFIELD CORP CLASS A LID VOTING SHS	3 643.00	128 593.86	0.05
CAD BRP INC SUB VTG NPV	92.00	5 686.17	0.00
CAD CAE INC COM NPV	812.00	16 157.95	0.01
CAD CAMECO CORP COM	1 129.00	51 884.79	0.02
CAD CANADIAN NAT RES LTD COM	2 953.00	197 345.82	0.07

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
CAD CANADIAN NATL RY CO COM	1 484.00	172 342.55	0.06
CAD CANADIAN PAC RY LT COM NPV	2 468.00	177 821.23	0.06
CAD CANADIAN TIRE LTD CL A	144.00	14 991.04	0.01
CAD CANADIAN UTILS LTD CL A	340.00	7 623.26	0.00
CAD CCL INDUSTRIES INC ‘ B ’ NON-VTG COM NPV	384.00	15 840.34	0.01
CAD CDN IMPERIAL BK OF COMMERCE COM	2 314.00	95 744.66	0.03
CAD CENOVUS ENERGY INC COM NPV	3 734.00	66 288.59	0.02
CAD CGI INC COM NPV SUB VOTING SHARES C	534.00	54 339.33	0.02
CAD CONSTELLATION SOFT COM STK NPV	55.00	129 292.69	0.05
CAD DESCARTES SYSTEMS COM NPV	244.00	19 835.29	0.01
CAD DOLLARAMA INC COM NPV	776.00	56 403.58	0.02
CAD ELEMENT FLEET MGMT COM NPV	1 114.00	17 960.72	0.01
CAD EMERA INC COM	695.00	24 445.59	0.01
CAD EMPIRE LTD CL A	396.00	10 771.46	0.00
CAD ENBRIDGE INC COM NPV	5 521.00	192 930.62	0.07
CAD FAIRFAX FINL HLDGS SUB-VTG COM NPV	62.00	57 034.88	0.02
CAD FIRSTSERVICE CORP COM NPV	100.00	15 705.28	0.01
CAD FORTIS INC COM NPV	1 260.00	50 517.09	0.02
CAD FRANCO NEVADA CORP COM NPV	495.00	55 485.56	0.02
CAD GFL ENVIRON INC COM NPV SUB VTG SHS	500.00	14 360.00	0.01
CAD GILDAN ACTIVEWEAR INC COM	488.00	17 679.36	0.01
CAD GREAT WEST LIFECO INC COM	662.00	21 175.60	0.01
CAD HYDRO ONE INC COM NPV	784.00	21 811.03	0.01
CAD IA FINANCIAL CORP COM NPV	252.00	16 840.89	0.01
CAD IGM FINANCIAL INC COM	362.00	8 994.93	0.00
CAD IMPERIAL OIL LTD COM NEW	567.00	31 970.46	0.01
CAD INTACT FINL CORP COM NPV	454.00	70 417.97	0.02
CAD IVANHOE MINES LTD COM NPV CL ‘ A ’	1 800.00	16 077.00	0.01
CAD KEYERA CORPORATION COM NPV	569.00	14 339.88	0.01
CAD KINROSS GOLD CORP COM NPV	3 457.00	20 397.54	0.01
CAD LOBLAW COS LTD COM	423.00	36 501.83	0.01
CAD LUNDIN MINING CORP COM	1 757.00	12 181.14	0.00
CAD MAGNA INTL INC COM NPV	761.00	41 062.62	0.01
CAD MANULIFE FINL CORP COM	831.00	94 706.63	0.03
CAD MEG ENERGY CORP COM NPV	229.00	333.92	0.00
CAD METRO INC CL A SUB	609.00	30 547.69	0.01
CAD NATL BK OF CANADA COM NPV	868.00	57 565.78	0.02
CAD NORTHLAND POWER IN COM NPV	672.00	10 933.60	0.00
CAD NUTRIEN LTD NPV	1 297.00	69 429.70	0.02
CAD ONEX CORP SUB VTG	182.00	12 321.26	0.00
CAD OPEN TEXT CO COM NPV	673.00	26 947.80	0.01
CAD PAN AMER SILVER COM NPV	896.00	14 049.46	0.01
CAD PARKLAND CORP. COM NPV	400.00	13 101.74	0.00
CAD PEMBINA PIPELINE C COM NPV	1 448.00	48 474.92	0.02
CAD POWER CORP CDA COM	1 490.00	41 265.26	0.01
CAD QUEBECOR INC CL B	372.00	8 261.18	0.00
CAD RB GLOBAL INC COM NPV	452.00	28 753.18	0.01
CAD RESTAURANT BRANDS COM NPV	774.00	55 093.66	0.02
CAD ROGERS COMMUNICATIONS INC	985.00	42 448.32	0.01
CAD ROYAL BK OF CANADA COM NPV	3 675.00	332 358.67	0.12
CAD SAPUTO INC COM	743.00	14 456.13	0.01
CAD SHOPIFY INC COM NPV CL A	3 201.00	233 373.05	0.08
CAD STANTEC INC COM NPV	238.00	17 750.16	0.01
CAD SUN LIFE FINL INC COM	1 541.00	77 876.84	0.03
CAD SUNCOR ENERGY INC COM NPV ‘ NEW ’	3 501.00	115 525.12	0.04

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
CAD TC ENERGY CORPORAT COM NPV	2 633.00	98 826.11	0.04
CAD TECK RESOURCES LTD CLASS ' B ' SUB-VTG COM NPV	1 214.00	45 771.79	0.02
CAD TELUS CORPORATION NPV	1 055.00	18 892.50	0.01
CAD TFI INTERNATIONAL COM NPV	213.00	25 223.50	0.01
CAD THOMSON-REUTERS CP NPV POST REV SPLIT	400.00	55 929.49	0.02
CAD TMX GROUP LTD COM NPV	835.00	18 044.40	0.01
CAD TOROMONT INDS LTD COM	200.00	16 152.23	0.01
CAD TORONTO-DOMINION COM NPV	812.00	293 649.65	0.11
CAD TOURMALINE OIL CP COM NPV	868.00	42 047.60	0.01
CAD WEST FRASER TIMBER COM NPV	150.00	10 888.37	0.00
CAD WESTON GEORGE LTD COM	158.00	18 546.08	0.01
CAD WHEATON PRECIOUS M COM NPV	1 216.00	59 506.29	0.02
CAD WSP GLOBAL INC COM NPV	341.00	47 239.76	0.02
カナダ合計		4 757 984.24	1.72
中国			
USD FUTU HOLDINGS LIM1 SPON ADS EA REP 8 ORD SHS	100.00	5 392.00	0.00
中国合計		5 392.00	0.00
デンマーク			
DKK A.P. MOELLER-MAERSK SER ' B ' DKK1000	13.00	20 546.89	0.01
DKK A.P. MOLLER-MAERSK ' A ' DKK1000	8.00	12 421.80	0.00
DKK CARLSBERG SER ' B ' DKK20	257.00	31 893.93	0.01
DKK CHR. HANSEN HLDG DKK10	262.00	20 996.35	0.01
DKK COLOPLAST DKK1 B	337.00	39 849.26	0.01
DKK DANSKE BANK A/S DKK10	1 773.00	45 978.15	0.02
DKK DEMANT A/S DKK0.20	289.00	12 282.12	0.00
DKK DSV PANALPINA A/S DKK1	475.00	71 634.24	0.02
DKK GENMAB AS DKK1	169.00	53 446.65	0.02
DKK NOVO NORDISK A/S DKK0.1 B	8 366.00	851 518.41	0.31
DKK NOVOZYMES A/S SER ' B ' DKK2 (POST CONS)	554.00	28 789.86	0.01
DKK ORSTED A/S DKK10	503.00	23 732.42	0.01
DKK PANDORA A/S DKK1	218.00	29 485.03	0.01
DKK ROCKWOOL INTL SER ' B ' DKK10	18.00	870.67	0.00
DKK TRYG A/S DKK5	797.00	17 227.33	0.01
DKK VESTAS WIND SYSTEM DKK0.20 (POST SPLIT)	2 636.00	73 125.89	0.03
デンマーク合計		1 337 799.00	0.48
フィンランド			
EUR ELISA OYJ NPV	388.00	17 391.09	0.01
EUR FORTUM OYJ EUR3.40	1 179.00	16 575.36	0.01
EUR KESKO OYJ EUR2 SER ' B '	653.00	12 507.74	0.00
EUR KONE CORPORATION NPV ORD ' B '	869.00	38 675.69	0.01
EUR METSO CORPORATION RG	1 590.00	15 665.69	0.01
EUR NESTE OIL OYJ NPV	1 116.00	42 472.25	0.01
EUR NOKIA OYJ NPV	13 550.00	47 576.22	0.02
SEK NORDEA HOLDING ABP NPV	8 091.00	90 539.58	0.03
EUR ORION CORP SER ' B ' NPV	277.00	11 013.43	0.00
EUR SAMPO PLC NPV A	1 198.00	52 481.58	0.02
EUR STORA ENSO OYJ NPV SER ' R '	1 626.00	21 129.87	0.01
EUR UPM-KYMMENE CORP NPV	1 328.00	46 483.30	0.01
EUR WARTSILA OYJ ABP SER ' B ' EUR3.50	1 141.00	15 761.00	0.01
フィンランド合計		428 272.80	0.15

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)

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 (%)
フランス			
EUR ACCOR EUR3	473.00	16 416.84	0.01
EUR ADP EUR3	100.00	12 340.34	0.00
EUR AIR LIQUIDE(L ') EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)	1 370.00	259 797.46	0.09
EUR AIRBUS EUR1	1 544.00	229 450.47	0.08
EUR ALSTOM EUR7.00	785.00	9 738.56	0.00
EUR AMUNDI EUR2.5 (AIW)	177.00	10 911.55	0.00
EUR ARKEMA EUR10	143.00	14 551.11	0.01
EUR AXA EUR2.29	751.00	148 231.23	0.05
EUR BIOMERIEUX NPV (POST SPLIT)	104.00	11 206.73	0.00
EUR BNP PARIBAS EUR2	2 779.00	175 168.28	0.06
EUR BOLLORE EURO.16	2 504.00	14 329.94	0.01
EUR BOUYGUES EUR1	525.00	19 997.41	0.01
EUR BUREAU VERITAS EURO.12	807.00	19 556.30	0.01
EUR CAPGEMINI EUR8	438.00	89 845.54	0.03
EUR CARREFOUR EUR2.50	1 622.00	30 785.05	0.01
EUR CIE DE ST-GOBAIN EUR4	1 211.00	79 028.27	0.03
EUR COVIVIO EUR3	179.00	8 753.66	0.00
EUR CREDIT AGRICOLE SA EUR3	2 947.00	38 656.40	0.01
EUR DANONE EURO.25	1 658.00	106 679.31	0.04
EUR DASSAULT AVIATION EURO.80 (POST SUBDIVISION)	61.00	12 140.02	0.00
EUR DASSAULT SYSTEMES EURO.10	1 744.00	81 757.17	0.03
EUR EDENRED EUR2	653.00	35 624.42	0.01
EUR EIFFAGE EUR4	164.00	16 641.46	0.01
EUR ENGIE EUR1	853.00	84 287.53	0.03
EUR ESSILORLUXOTTICA EURO.18	781.00	149 228.35	0.05
EUR EURAZEO NPV	129.00	9 690.77	0.00
EUR GECINA EUR7.50	130.00	14 411.25	0.01
EUR GETLINK SE EURO.40	1 075.00	19 670.08	0.01
EUR HERMES INTL NPV	84.00	174 524.50	0.06
EUR IPSEN EUR1	120.00	13 551.46	0.00
EUR KERING EUR4	194.00	83 335.82	0.03
EUR KLEPIERRE EUR1.40	465.00	11 720.05	0.00
EUR L ' OREAL EURO.20	630.00	296 300.75	0.11
EUR LA FRANCAISE DES EURO.40 (PROMESSES)	278.00	10 070.42	0.00
EUR LEGRAND SA EUR4	725.00	69 944.42	0.03
EUR LVMH MOET HENNESSY EURO.30	727.00	557 402.51	0.20
EUR MICHELIN (CGDE) EURO.50 (POST SUBDIVISION)	1 839.00	61 821.28	0.02
EUR ORANGE EUR4	866.00	60 016.24	0.02
EUR PERNOD RICARD EUR1.55	541.00	93 589.70	0.03
EUR PUBLICIS GROUPE SA EURO.40	615.00	52 058.24	0.02
EUR REMY COINTREAU EUR1.60	41.00	887.31	0.00
EUR RENAULT SA EUR3.81	471.00	18 495.55	0.01
EUR SAFRAN EURO.20	894.00	157 065.90	0.06
EUR SANOFI EUR2	2 972.00	277 125.35	0.10
EUR SARTORIUS STEDIM B EURO.20 (POST SUBD)	84.00	18 917.06	0.01
EUR SCHNEIDER ELECTRIC EUR8	1 435.00	264 013.14	0.10
EUR SEB SA EUR1	70.00	7 981.40	0.00
EUR SOC GENERALE EUR1.25	1 921.00	48 365.28	0.02
EUR SODEXO EUR4	225.00	24 156.95	0.01
EUR TELEPERFORMANCE EUR2.50	170.00	23 844.35	0.01
EUR THALES EUR3	278.00	41 540.47	0.03
EUR TOTALENERGIES SE EUR2.5	5 986.00	406 640.27	0.15
EUR UNIBAIL-RODAMCO-WE NPV(1 ORD UNIBAIL-R & 1CLS)	324.00	20 638.29	0.01
EUR VEOLIA ENVIRONNEME EUR5	1 798.00	56 715.57	0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)

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 VINCI EUR2.50	1 376.00	168 602.01	0.06
EUR VIVENDI SA EUR5.50	1 931.00	18 300.66	0.01
EUR WORLDLINE EURO.68	631.00	9 800.58	0.00
フランス合計		4 770 321.03	1.72
ドイツ			
EUR ADIDAS AG NPV (REGD)	432.00	90 566.19	0.03
EUR ALLIANZ SE NPV(REGD)(VINKULIERT)	1 058.00	266 200.90	0.10
EUR BASF SE NPV	2 337.00	108 842.52	0.04
EUR BAYER AG NPV (REGD)	2 605.00	89 135.01	0.03
EUR BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG EUR1	790.00	82 395.62	0.03
EUR BAYERISCHE MOTORENWERKE AG EUR1	159.00	15 110.53	0.01
EUR BECHTLE AG NPV	220.00	10 917.11	0.00
EUR BEIERSDORF AG NPV	258.00	36 229.54	0.01
EUR BRENNTAG AG	378.00	32 697.91	0.01
EUR CARL ZEISS MEDITEC NPV	111.00	9 969.95	0.00
EUR COMMERZBANK AG NPV	2 915.00	35 765.36	0.01
EUR CONTINENTAL AG ORD NPV	300.00	23 246.98	0.01
EUR COVESTRO AG NPV	506.00	26 611.06	0.01
EUR DAIMLER TRUCK HOLD NPV (YOUNG SHARE)	1 304.00	42 441.96	0.02
EUR DELIVERY HERO SE NPV	467.00	14 830.27	0.01
EUR DEUTSCHE BANK AG NPV(REGD)	5 219.00	65 064.79	0.02
EUR DEUTSCHE BOERSE AG NPV(REGD)	508.00	96 610.79	0.03
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA ORD NPV (REGD)(VINK)	1 683.00	14 653.84	0.01
EUR DEUTSCHE POST AG NPV(REGD)	2 612.00	122 661.99	0.04
EUR DEUTSCHE TELEKOM NPV(REGD)	8 632.00	206 968.80	0.08
EUR DR.ING. F.PORSCHE NON-VTG PRF NPV	300.00	27 515.36	0.01
EUR E.ON SE NPV	5 951.00	77 495.58	0.03
EUR EVONIK INDUSTRIES NPV	640.00	11 975.91	0.00
EUR FRESENIUS MED CARE NPV	494.00	20 282.69	0.01
EUR FRESENIUS SE & CO. KGAA NPV	1 068.00	33 898.43	0.01
EUR GEA GROUP AG NPV	424.00	15 599.76	0.01
EUR HANNOVER RUECKVERS ORD NPV(REGD)	166.00	39 665.85	0.01
EUR HEIDELBERGCEMENT NPV	373.00	30 442.13	0.01
EUR HELLOFRESH SE NPV	454.00	6 944.94	0.00
EUR HENKEL AG & CO KGAA	275.00	19 227.36	0.01
EUR HENKEL AG&CO. KGAA NON-VTG PRF NPV	463.00	36 473.95	0.01
EUR INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)	3 468.00	134 518.88	0.05
EUR KNORR BREMSE AG NPV	208.00	13 049.56	0.00
EUR LEG IMMOBILIEN SE NPV	228.00	17 448.78	0.01
EUR MERCEDES-BENZ ORD NPV(REGD)	2 127.00	138 271.46	0.05
EUR MERCK KGAA NPV	325.00	56 790.39	0.02
EUR MTU AERO ENGINES H NPV (REGD)	152.00	31 137.81	0.01
EUR MUENCHENER RUECKVE NPV(REGD)	356.00	151 799.07	0.06
EUR NEMETSCHEK SE ORD NPV	167.00	14 584.38	0.01
EUR PORSCHE AUTO HL SE NON VTG PRF NPV	371.00	18 159.24	0.01
EUR PUMA SE NPV	273.00	17 627.96	0.01
EUR RATIONAL AG NPV	15.00	9 615.32	0.00
EUR RHEINMETALL AG NPV	117.00	35 233.80	0.01
EUR RWE AG (NEU) NPV	1 677.00	72 038.23	0.03
EUR SAP AG ORD NPV	2 737.00	434 452.85	0.16
EUR SARTORIUS AG NON VTG PRF NPV	67.00	21 602.14	0.01
EUR SCOUT24 AG NPV	203.00	14 175.57	0.01
EUR SIEMENS AG NPV(REGD)	1 997.00	335 554.71	0.12
EUR SIEMENS ENERGY AG NPV	1 467.00	17 415.00	0.01
EUR SIEMENS HEALTHINEE NPV	698.00	40 318.46	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)

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 SYMRISE AG NPV (BR)	346.00	38 960.13	0.01
EUR TALANX AG NPV	164.00	11 917.43	0.00
EUR VOLKSWAGEN AG NON VTG PRF NPV	537.00	62 353.68	0.02
EUR VOLKSWAGEN AG ORD NPV	80.00	10 387.27	0.00
EUR VONOVIA SE NPV	1 875.00	52 209.14	0.02
EUR WACKER CHEMIE AG NPV(BR)	54.00	6 616.65	0.00
EUR ZALANDO SE NPV	617.00	14 716.34	0.01
ドイツ合計		3 481 397.33	1.26
香港			
HKD AIA GROUP LTD NPV	30 200.00	260 614.83	0.10
HKD BOC HONG KONG HLDG HKD5	11 500.00	30 773.47	0.01
HKD BUDWEISER BREWING USD0.00001	000.00	7 077.83	0.00
HKD CK ASSET HOLDINGS HKD1	5 500.00	26 090.55	0.01
HKD CK HUTCHISON HLDGS HKD1.0	7 000.00	35 088.28	0.02
HKD CK INFRASTRUCTURE HKD1	2 000.00	9 909.99	0.00
HKD CLP HOLDINGS HKD5	500.00	35 001.86	0.01
HKD ESR CAYMAN LIMITED USD0.001	800.00	6 170.31	0.00
HKD GALAXY ENTERTAINME HKD0.10	5 000.00	25 863.28	0.01
HKD HANG LUNG PROP HKD1	6 000.00	8 020.18	0.00
HKD HANG SENG BANK HKD5	2 100.00	23 257.75	0.01
HKD HENDERSON LAND DEV HKD2	3 000.00	8 162.30	0.00
HKD HKT TRUST AND HKT SHARE STAPLED UNIT	12 000.00	12 798.48	0.00
HKD HONG KONG EXCHANGE HKD1	3 200.00	113 573.10	0.04
USD HONGKONG LAND HLD ORD USD0.10(SINGAPORE REG)	2 300.00	7 406.00	0.00
HKD HONGKONG&CHINA GAS HKD0.25	37 350.00	25 680.13	0.01
USD JARDINE MATHESON COM USD0.25(BERMUDA REG)	400.00	15 444.00	0.01
HKD MTR CORP HKD1	5 000.00	17 925.05	0.01
HKD NEW WORLD DEVEL CO NPV POST CON	000.00	5 951.12	0.00
HKD POWER ASSETS HOLDINGS LTD HKD1	000.00	20 869.88	0.01
HKD SINO LAND CO HKD1	12 974.00	13 073.17	0.00
HKD SITC INTERNATIONAL HKD0.10	000.00	6 043.30	0.00
HKD SUN HUNG KAI PROP NPV	3 500.00	34 348.87	0.01
HKD SWIRE PACIFIC ‘ A ’ HKD0.60	1 500.00	9 737.14	0.00
HKD SWIRE PROPERTIES LTD HKD1	2 600.00	5 053.33	0.00
HKD TECHTRONIC INDUSTRIES NPV	3 500.00	35 536.41	0.02
HKD THE LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6 679.00	33 008.90	0.01
HKD WH GROUP LTD USD0.0001	23 326.00	14 992.58	0.01
HKD WHARF REAL ESTATE HKD0.1	5 000.00	15 780.44	0.01
HKD WHARF(HLDGS) HKD1	1 000.00	2 599.13	0.00
HKD XINYI GLASS HLDGS HKD0.1	5 094.00	5 863.42	0.00
香港合計		871 715.08	0.31
アイルランド			
EUR AIB GROUP PLC ORD EURO.625	2 062.00	9 570.86	0.00
EUR BANK OF IRELAND GR EUR1	2 777.00	26 027.57	0.01
GBP CRH ORD EURO.32	1 944.00	122 705.80	0.05
GBP DCC ORD EURO.25	279.00	18 867.95	0.01
GBP EXPERIAN ORD USD0.10	2 359.00	86 694.50	0.03
EUR FLUTTER ENTERTAINM ORD EURO.09	444.00	69 397.23	0.03
AUD JAMES HARDIE ID PLC CUF5 EURO.5	1 158.00	37 407.80	0.01
EUR KERRY GROUP ‘ A ’ ORD EURO.125(DUBLIN LIST)	427.00	34 579.08	0.01
EUR KINGSPAN GROUP ORD EURO.13(DUBLIN LISTING)	441.00	35 029.55	0.01
EUR SMURFIT KAPPA GRP ORD EURO.001	616.00	23 389.69	0.01
アイルランド合計		463 670.03	0.17

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)

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 (%)
マン島			
GBP ENTAIN PLC ORD EURO.01	1 855.00	18 852.45	0.01
マン島合計		18 852.45	0.01
イスラエル			
ILS AZRIELI GROUP ILS0.01	119.00	6 911.66	0.00
ILS BANK HAPOLIM B.M. ILS1	3 206.00	27 126.30	0.01
ILS BK LEUMI LE ISRAEL ILS1	3 805.00	28 557.17	0.01
USD CHECK POINT SFTWRE ORD ILS0.01	258.00	37 668.00	0.01
USD CYBER-ARK SOFTWARE COM ILS0.01	100.00	19 927.00	0.01
ILS ELBIT SYSTEMS LTD ILS1	73.00	14 558.44	0.01
USD GLOBAL-E ONLINE LT COM NPV	200.00	6 850.00	0.00
ILS ICL GROUP LTD ILS1	1 841.00	9 264.07	0.00
ILS ISRAEL DISCOUNT BK ILS0.10 SER 'A'	3 235.00	15 609.93	0.00
ILS MIZRAHI TEFAHOT BK ILS0.01	477.00	17 035.26	0.01
USD MONDAY COM LTD COM NPV	100.00	17 984.00	0.01
ILS NICE SYSTEMS ILS1	159.00	30 595.15	0.01
USD TEVA PHARMA IND ADR(CNV 1 ORD ILS0.10)	2 900.00	28 478.00	0.01
USD WIX.COM LTD COM ILS0.01	167.00	16 950.50	0.01
イスラエル合計		277 515.48	0.10
イタリア			
EUR AMPLIFON EURO.02	367.00	11 424.37	0.00
EUR ASSIC GENERALI SPA EUR1	2 648.00	54 909.87	0.02
EUR BANCO BPM NPV	1 545.00	8 553.49	0.00
EUR DAVIDE CAMPARI MIL EURO.01	1 585.00	17 328.52	0.01
EUR DIASORIN SPA EUR1	40.00	3 794.41	0.00
EUR ENEL EUR1	21 298.00	150 723.28	0.06
EUR ENI SPA EUR1	6 305.00	104 346.52	0.04
EUR FINECOBANK SPA EURO.33	1 736.00	23 421.16	0.01
EUR INFRASTRUTTURE WIR NPV	1 055.00	13 030.57	0.01
EUR INTESA SANPAOLO NPV	41 553.00	119 761.59	0.04
EUR LEONARDO SPA EUR4.40	554.00	8 504.88	0.00
EUR MEDIOBANCA SPA EURO.5	1 347.00	15 836.15	0.01
EUR MONCLER SPA NPV	560.00	31 088.49	0.01
EUR NEXI SPA NPV	1 556.00	12 138.92	0.00
EUR POSTE ITALIANE SPA NPV	1 267.00	13 652.81	0.01
EUR PRYSMIAN SPA EURO.10	677.00	26 097.38	0.01
EUR RECORDATI EURO.125	243.00	11 711.11	0.00
EUR SNAM EUR1	869.00	24 560.00	0.01
EUR TELECOM ITALIA SPA EURO.55	22 963.00	6 679.65	0.00
EUR TERNA SPA ORD EURO.22	3 614.00	29 164.16	0.01
EUR UNICREDIT SPA NPV (POST REV SPLIT)	769.00	130 008.35	0.04
イタリア合計		816 735.68	0.29
日本			
JPY アドバンテスト	2 000.00	63 327.36	0.02
JPY イオン	1 800.00	37 269.93	0.01
JPY A G C	500.00	18 162.14	0.01
JPY アイシン	300.00	11 061.66	0.00
JPY 味の素	1 200.00	44 855.41	0.02
JPY A N Aホールディングス	300.00	6 193.39	0.00
JPY アサヒグループホールディングス	1 300.00	47 969.02	0.02
JPY 朝日インテック	500.00	9 694.93	0.00
JPY 旭化成	3 500.00	24 302.43	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
JPY アステラス製薬	800.00	58 362.36	0.02
JPY アズビル	400.00	12 911.69	0.00
JPY バンダイナムコホールディングス	1 600.00	31 851.73	0.01
JPY ベイカレント・コンサルティング	400.00	13 463.66	0.00
JPY ブリヂストン	1 500.00	61 873.03	0.02
JPY ブラザー工業	500.00	8 441.85	0.00
JPY キヤノン	2 600.00	66 954.38	0.03
JPY カプコン	500.00	16 853.25	0.01
JPY 東海旅客鉄道	1 800.00	43 223.86	0.02
JPY 千葉銀行	1 200.00	8 981.64	0.00
JPY 中部電力	1 500.00	18 537.56	0.01
JPY 中外製薬	1 800.00	63 532.99	0.02
JPY コンコルディア・フィナンシャルグループ	3 400.00	15 958.74	0.01
JPY 大日本印刷	500.00	14 046.07	0.01
JPY 第一生命ホールディングス	2 500.00	52 102.01	0.02
JPY ダイフク	900.00	16 942.54	0.01
JPY 第一三共	800.00	129 874.52	0.05
JPY ダイキン工業	700.00	104 904.12	0.04
JPY 大東建託	200.00	22 051.61	0.01
JPY 大和ハウス工業	1 500.00	42 604.93	0.02
JPY 大和ハウスリート投資法人	5.00	8 922.11	0.00
JPY 大和証券グループ	3 700.00	23 911.66	0.01
JPY デンソー	500.00	70 436.64	0.03
JPY 電通グループ	500.00	13 477.86	0.00
JPY ディスコ	200.00	43 413.27	0.02
JPY 東日本旅客鉄道	800.00	43 264.45	0.02
JPY エーザイ	700.00	36 326.99	0.01
JPY ENEOSホールディングス	8 000.00	31 624.45	0.01
JPY ファナック	2 600.00	72 353.64	0.03
JPY ファーストリテイリング	500.00	126 796.77	0.05
JPY 富士電機	400.00	16 778.17	0.01
JPY 富士フイルムホールディングス	1 000.00	58 578.82	0.02
JPY 富士通	500.00	71 430.99	0.03
JPY G L P投資法人	11.00	10 394.70	0.00
JPY 浜松ホトニクス	400.00	15 844.69	0.01
JPY 阪急阪神ホールディングス	700.00	21 170.22	0.01
JPY 光通信	100.00	15 551.12	0.01
JPY ヒロセ電機	110.00	12 314.40	0.00
JPY 日立建機	300.00	7 782.32	0.00
JPY 日立製作所	2 500.00	173 927.01	0.06
JPY 本田技研工業	12 400.00	126 570.84	0.05
JPY ホシザキ	300.00	9 555.92	0.00
JPY HOYA	900.00	101 454.33	0.04
JPY ヒューリック	700.00	6 950.99	0.00
JPY イビデン	300.00	14 349.11	0.01
JPY 出光興産	492.00	13 498.51	0.00
JPY 飯田グループホールディングス	300.00	484.73	0.00
JPY I N P E X	2 700.00	38 170.93	0.01
JPY いすゞ自動車	1 700.00	22 486.89	0.01
JPY 伊藤忠商事	3 200.00	124 203.34	0.05
JPY 日本航空	400.00	7 605.78	0.00
JPY 日本取引所グループ	1 400.00	28 589.98	0.01
JPY 日本都市ファンド投資法人	19.00	12 659.38	0.00
JPY ゆうちょ銀行	3 829.00	37 801.78	0.01
JPY 日本郵政	6 200.00	54 708.97	0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
JPY かんぽ生命保険	500.00	9 351.64	0.00
JPY ジャパンリアルエステイト投資法人	4.00	15 557.89	0.01
JPY 日本たばこ産業	3 100.00	79 704.40	0.03
JPY J F Eホールディングス	1 200.00	17 695.40	0.01
JPY J S R	400.00	11 009.57	0.00
JPY 鹿島建設	1 100.00	17 385.26	0.01
JPY 関西電力	2 000.00	26 664.86	0.01
JPY 花王	1 200.00	46 235.33	0.02
JPY 川崎汽船	400.00	14 039.98	0.01
JPY K D D I	000.00	125 139.51	0.05
JPY K D X不動産投資法人	4.00	586.19	0.00
JPY 京成電鉄	300.00	12 094.57	0.00
JPY キーエンス	500.00	214 259.14	0.08
JPY キッコーマン	400.00	24 527.34	0.01
JPY 近鉄グループホールディングス	500.00	14 022.39	0.01
JPY キリンホールディングス	2 000.00	28 234.18	0.01
JPY 神戸物産	400.00	10 563.13	0.00
JPY コーエーテックモホールディングス	220.00	2 694.29	0.00
JPY 小糸製作所	600.00	9 077.01	0.00
JPY 小松製作所	2 500.00	63 787.33	0.02
JPY コナミホールディングス	300.00	14 844.25	0.01
JPY コーセー	100.00	7 078.84	0.00
JPY クボタ	2 700.00	38 700.58	0.01
JPY 京セラ	900.00	49 859.64	0.02
JPY 協和キリン	800.00	13 187.68	0.00
JPY レーザーテック	200.00	44 698.48	0.02
JPY L I N Eヤフー	6 900.00	20 097.68	0.01
JPY エムスリー	1 000.00	16 542.09	0.01
JPY マキタ	500.00	13 271.55	0.00
JPY 丸紅	3 700.00	57 739.37	0.02
JPY マツモトキヨシ	900.00	15 545.37	0.01
JPY マツダ	1 400.00	14 948.42	0.01
JPY 日本マクドナルドホールディングス	300.00	12 804.81	0.00
JPY 明治ホールディングス	600.00	13 892.52	0.01
JPY ミネベアミツミ	900.00	17 125.17	0.01
JPY ミスミグループ本社	800.00	12 987.45	0.00
JPY 三菱ケミカルホールディングス	3 600.00	23 584.40	0.01
JPY 三菱商事	3 000.00	139 736.87	0.05
JPY 三菱電機	5 100.00	69 306.32	0.03
JPY 三菱地所	3 000.00	40 514.76	0.02
JPY 三菱H Cキャピタル	2 000.00	13 046.98	0.00
JPY 三菱重工業	900.00	50 334.50	0.02
JPY 三菱U F Jフィナンシャル・グループ	30 100.00	255 524.74	0.09
JPY 三井物産	3 500.00	127 655.83	0.05
JPY 三井化学	500.00	14 637.94	0.01
JPY 三井不動産	2 300.00	54 016.98	0.02
JPY 商船三井	800.00	21 975.85	0.01
JPY みずほフィナンシャルグループ	6 240.00	106 029.56	0.04
JPY M o n o t a R O	800.00	8 079.28	0.00
JPY M S & A Dインシュアランス グループ ホールディングス	1 200.00	44 912.23	0.02
JPY 村田製作所	600.00	89 722.33	0.03
JPY 日本電気	600.00	33 442.69	0.01
JPY ネクソン	1 000.00	21 632.23	0.01
JPY ニデック	1 100.00	41 697.84	0.02
JPY 任天堂	2 700.00	126 238.04	0.05

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
JPY 日本ビルファンド投資法人	5.00	21 003.15	0.01
JPY NIPPON EXPRESSホールディングス	200.00	10 918.93	0.00
JPY 日本ペイントホールディングス	2 500.00	18 677.92	0.01
JPY 日本プロロジスリート投資法人	5.00	9 483.55	0.00
JPY 日本酸素ホールディングス	400.00	10 506.31	0.00
JPY 日本製鉄	2 300.00	53 783.61	0.02
JPY 日本電信電話	79 400.00	92 969.46	0.03
JPY 日本郵船	1 300.00	34 945.72	0.01
JPY 日産化学	300.00	10 943.96	0.00
JPY 日産自動車	6 400.00	25 234.62	0.01
JPY 日清食品ホールディングス	200.00	19 839.69	0.01
JPY ニトリホールディングス	200.00	23 079.79	0.01
JPY 日東電工	400.00	28 450.64	0.01
JPY 野村ホールディングス	8 000.00	32 863.67	0.01
JPY 野村不動産マスターファンド投資法人	10.00	11 485.78	0.00
JPY 野村不動産ホールディングス	400.00	9 751.41	0.00
JPY 野村総合研究所	1 100.00	30 893.90	0.01
JPY NTTデータグループ	1 600.00	19 448.71	0.01
JPY 大林組	1 800.00	15 189.23	0.01
JPY オービック	200.00	30 703.15	0.01
JPY 小田急電鉄	700.00	9 846.45	0.00
JPY 王子ホールディングス	2 600.00	9 658.88	0.00
JPY オリンパス	3 500.00	51 280.14	0.02
JPY オムロン	500.00	20 965.94	0.01
JPY 小野薬品工業	1 100.00	20 246.22	0.01
JPY オープンハウス	200.00	5 584.60	0.00
JPY 日本オラクル	100.00	7 734.97	0.00
JPY オリエンタルランド	2 900.00	98 572.73	0.04
JPY オリックス	3 200.00	58 411.07	0.02
JPY 大阪ガス	1 000.00	19 481.18	0.01
JPY 大塚商会	300.00	12 246.76	0.00
JPY 大塚ホールディングス	1 000.00	38 482.09	0.01
JPY パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	1 000.00	21 672.81	0.01
JPY パナソニック	5 700.00	58 991.44	0.02
JPY 楽天グループ	3 500.00	13 866.47	0.01
JPY リクルートホールディングス	3 800.00	141 502.35	0.05
JPY ルネサスエレクトロニクス	3 400.00	59 876.89	0.02
JPY りそなホールディングス	5 400.00	28 071.16	0.01
JPY リコー	1 400.00	11 430.31	0.00
JPY ローム	800.00	15 290.02	0.01
JPY SBIホールディングス	600.00	13 015.86	0.00
JPY SCSK	300.00	5 527.78	0.00
JPY セコム	600.00	41 783.07	0.02
JPY セイコーエプソン	900.00	13 381.13	0.00
JPY 積水化学工業	900.00	12 787.57	0.00
JPY 積水ハウス	1 500.00	30 733.59	0.01
JPY セブン&アイ・ホールディングス	2 000.00	74 339.64	0.03
JPY SGホールディングス	700.00	10 121.08	0.00
JPY シャープ	1 000.00	6 261.03	0.00
JPY 島津製作所	700.00	18 158.76	0.01
JPY シマノ	200.00	30 784.32	0.01
JPY 清水建設	1 700.00	11 172.73	0.00
JPY 信越化学工業	800.00	169 226.50	0.06
JPY 塩野義製薬	700.00	33 040.89	0.01
JPY 資生堂	1 100.00	29 509.93	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
JPY しずおかフィナンシャルグループ	1 200.00	9 708.12	0.00
JPY SMC	200.00	100 720.40	0.04
JPY ソフトバンク	7 700.00	93 675.04	0.03
JPY ソフトバンクグループ	2 700.00	109 946.90	0.04
JPY SOMPOホールディングス	800.00	36 565.09	0.01
JPY ソニーグループ	3 300.00	286 170.40	0.10
JPY スクウェア・エニックス・ホールディングス	200.00	6 942.88	0.00
JPY SUBARU	1 700.00	30 139.68	0.01
JPY SUMCO	1 100.00	16 492.37	0.01
JPY 住友化学	3 500.00	8 937.33	0.00
JPY 住友商事	2 900.00	60 811.04	0.02
JPY 住友電気工業	2 000.00	24 811.45	0.01
JPY 住友金属鉱山	600.00	17 419.42	0.01
JPY 三井住友フィナンシャルグループ	3 400.00	166 923.94	0.06
JPY 三井住友トラスト・ホールディングス	900.00	33 842.46	0.01
JPY 住友不動産	700.00	19 763.93	0.01
JPY サントリー食品インターナショナル	400.00	12 576.18	0.00
JPY スズキ	1 000.00	40 727.84	0.02
JPY シスメックス	400.00	22 135.49	0.01
JPY T&Dホールディングス	1 200.00	17 748.17	0.01
JPY 大成建設	500.00	17 015.59	0.01
JPY 武田薬品工業	109.00	115 764.10	0.04
JPY TDK	1 000.00	46 470.73	0.02
JPY テルモ	1 800.00	57 445.13	0.02
JPY T I S	600.00	12 691.18	0.00
JPY 東武鉄道	500.00	12 361.75	0.00
JPY 東宝	300.00	10 412.28	0.00
JPY 東京海上ホールディングス	800.00	118 445.57	0.04
JPY 東京電力ホールディングス	3 800.00	16 216.86	0.01
JPY 東京エレクトロン	1 300.00	211 265.94	0.08
JPY 東京ガス	1 100.00	25 499.37	0.01
JPY 東急	1 200.00	14 087.33	0.01
JPY TOPPANホールディングス	600.00	14 058.92	0.01
JPY 東レ	3 200.00	16 604.46	0.01
JPY 東芝	200.00	6 223.15	0.00
JPY 東ソー	700.00	9 313.76	0.00
JPY TOTO	300.00	7 705.21	0.00
JPY 豊田自動織機	400.00	34 403.22	0.01
JPY トヨタ自動車	28 000.00	529 279.27	0.19
JPY 豊田通商	600.00	33 239.76	0.01
JPY トレンドマイクロ	400.00	20 330.77	0.01
JPY ユニ・チャーム	1 100.00	35 440.19	0.01
JPY ユー・エス・エス	600.00	11 741.47	0.00
JPY 西日本旅客鉄道	600.00	23 730.51	0.01
JPY ヤクルト本社	600.00	13 405.49	0.00
JPY ヤマハ	400.00	9 364.49	0.00
JPY ヤマハ発動機	700.00	17 884.13	0.01
JPY ヤマトホールディングス	700.00	12 445.97	0.00
JPY 安川電機	700.00	26 861.70	0.01
JPY 横河電機	700.00	13 262.76	0.00
JPY ゼンショーホールディングス	200.00	11 112.39	0.00
JPY Z O Z O	340.00	7 187.07	0.00
日本合計		9 276 301.46	3.35

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)

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 (%)
ルクセンブルグ			
EUR ARCELORMITTAL NPV(POST STOCK SPLIT)	1 410.00	35 522.83	0.01
EUR EUROFINS SCIENTIFI EURO.01	389.00	22 648.01	0.01
EUR TENARIS S.A. USD1	1 174.00	20 174.98	0.01
ルクセンブルグ合計		78 345.82	0.03
マカオ			
HKD SANDS CHINA LTD USD0.01 REG 'S'	6 800.00	16 681.56	0.01
マカオ合計		16 681.56	0.01
オランダ			
EUR ABN AMRO BANK N.V. DR EACH REP SHS	1 095.00	14 713.41	0.01
EUR ADYEN NV EURO.01	57.00	66 608.38	0.02
USD AERCAP HOLDINGS EURO.01	492.00	33 564.24	0.01
EUR AKZO NOBEL NV EURO.50(POST REV SPLIT)	412.00	31 674.11	0.01
EUR ARGEN X NV EURO.10	147.00	65 343.58	0.02
EUR ASM INTL NV EURO.04	124.00	63 684.02	0.02
EUR ASML HOLDING NV EURO.09	1 064.00	723 259.64	0.26
EUR ASR NEDERLAND N.V. EURO.16	459.00	21 169.45	0.01
EUR BE SEMICONDUCTOR EURO.01	216.00	30 272.79	0.01
EUR CNH INDUSTRIAL NV COM EURO.01	2 832.00	30 096.55	0.01
EUR EURONEXT EUR1.60	228.00	18 956.33	0.01
EUR EXOR NV EURO.01	246.00	23 969.07	0.01
EUR FERRARI NV EURO.01(NEW)	331.00	119 397.55	0.04
EUR FERROVIAL SE EURO.01	1 381.00	47 856.26	0.02
EUR HEINEKEN HOLDING EUR1.6	329.00	25 594.70	0.01
EUR HEINEKEN NV EUR1.60	755.00	69 115.18	0.02
EUR IMCD NV EURO.16	149.00	23 012.34	0.01
EUR ING GROEP N.V. EURO.01	9 647.00	135 551.79	0.05
EUR JDE PEETS N.V. EURO.01	367.00	9 858.68	0.00
EUR KON KPN NV EURO.04	8 092.00	27 785.43	0.01
EUR KONINKLIJKE AHOLD EURO.01	2 542.00	73 666.18	0.03
EUR KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20	2 306.00	47 226.76	0.02
EUR NN GROUP N.V. EURO.12	693.00	26 381.46	0.01
EUR OCI N.V. EURO.02	246.00	5 298.43	0.00
EUR PROSUS N.V. EURO.05	008.00	132 943.12	0.05
EUR QIAGEN NV EURO.01	598.00	24 565.79	0.01
EUR RANDSTAD N.V. EURO.10	284.00	16 888.05	0.01
EUR STELLANTIS N V COM EURO.01	5 849.00	127 011.46	0.05
EUR UNIVERSAL MUSIC GR EUR10.00	2 248.00	59 455.70	0.02
EUR WOLTERS KLUWER EURO.12	684.00	94 259.26	0.03
オランダ合計		2 189 179.71	0.79
ニュージーランド			
NZD AUCKLAND INTL NPV	117.00	20 139.49	0.01
NZD EBOS GROUP LIMITED NPV(POST RECON)	351.00	8 021.42	0.00
NZD FISHER & PAYKEL HE NPV	1 832.00	26 658.96	0.01
NZD MERCURY NZ LTD NPV	1 857.00	7 145.66	0.00
NZD MERIDIAN ENERGY LT NPV	3 396.00	10 938.67	0.00
NZD SPARK NEW ZEALAND NPV	208.00	13 476.18	0.01
AUD XERO LIMITED NPV	381.00	26 032.70	0.01
ニュージーランド合計		112 413.08	0.04

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)

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 (%)
ノルウェー			
NOK ADEVINTA ASA SER 'B' NOK0.2	598.00	6 202.58	0.00
NOK AKER BP ASA NOK1	809.00	23 274.47	0.01
NOK DNB BANK ASA NOK12.50	2 437.00	46 597.55	0.02
NOK EQUINOR ASA NOK2.50	2 328.00	75 182.47	0.03
NOK GJENSIDIGE FORSIKR NOK2	441.00	7 450.37	0.00
NOK KONGSBERG GRUPPEN NOK5	212.00	9 133.93	0.00
NOK MOWI ASA NOK7.50	1 082.00	19 303.50	0.01
NOK NORSK HYDRO ASA NOK3.6666	3 516.00	20 478.58	0.01
NOK ORKLA ASA NOK1.25	1 670.00	12 338.92	0.00
NOK SALMAR ASA NOK0.25	196.00	10 779.38	0.00
NOK TELENOR ASA ORD NOK6	1 594.00	17 198.78	0.01
NOK YARA INTERNATIONAL NOK1.7	509.00	17 297.54	0.01
ノルウェー合計		265 238.07	0.10
ポルトガル			
EUR EDP ENERGIAS PORTU EUR1(REGD)	8 098.00	38 762.34	0.01
EUR GALP ENERGIA EUR1-B	1 412.00	21 037.35	0.01
EUR JERONIMO MARTINS EUR5	730.00	18 080.62	0.01
ポルトガル合計		77 880.31	0.03
シンガポール			
SGD CAPITALAND INVESTM NPV	7 700.00	17 481.64	0.01
SGD CITY DEVELOPMENTS SGD0.50	1 500.00	7 035.82	0.00
SGD DBS GROUP HLDGS SGD1	600.00	109 399.07	0.04
SGD GENTING SINGAPORE LTD	21 800.00	14 946.05	0.01
USD GRAB HLDGS LTD COM USD0.000001 CL A	100.00	12 464.00	0.00
SGD JARDINE CYCLE & CA SGD1	100.00	2 136.97	0.00
SGD KEPPEL CORP NPV	200.00	20 990.56	0.01
SGD MAPLETREE LOGISTICS TRUST-UNITS REIT	8 607.00	10 383.09	0.00
SGD OVERSEA-CHINESE BK NPV	8 814.00	82 816.99	0.03
USD SEA LTD ADS EACH REP ONE CL A SHS	1 000.00	36 220.00	0.01
SGD SEMBCORP INDUSTRIE SGD0.25 (POST REORG)	1 600.00	6 162.15	0.00
SGD SEMBCORP MARINE NPV	101 151.00	7 958.08	0.00
SGD SINGAPORE AIRLINES NPV	000.00	19 001.95	0.01
SGD SINGAPORE EXCHANGE SGD0.01	2 100.00	14 838.15	0.01
SGD SINGAPORE TECH ENG NPV	5 600.00	15 567.21	0.01
SGD SINGAPORE TELECOMM NPV	23 800.00	41 194.37	0.01
SGD UOL GROUP LIMITED SGD1	800.00	3 536.64	0.00
SGD UTD O/S BANK SGD1	3 200.00	65 266.00	0.02
SGD WILMAR INTERNATIONAL LTD	5 700.00	15 503.52	0.01
シンガポール合計		502 902.26	0.18
スペイン			
EUR ACCIONA SA EUR1	72.00	10 173.42	0.00
EUR ACS ACTIVIDADES CO EURO.5	589.00	23 553.41	0.01
EUR AENA SME S.A. EUR10	206.00	35 501.88	0.01
EUR AMADEUS IT GROUP EURO.01	1 199.00	82 182.94	0.03
EUR BANCO SANTANDER SA EURO.50(REGD)	43 046.00	178 523.44	0.07
EUR BBVA(BILB-VIZ-ARG) EURO.49	15 708.00	145 784.33	0.05
EUR CAIXABANK SA EUR1	11 167.00	50 333.40	0.02
EUR CELLNEX TELECOM SA EURO.25	1 441.00	55 092.52	0.02
EUR CORP ACCIONA ENERG EUR1	90.00	2 674.94	0.00
EUR EDP RENOVAVEIS SA EUR5	852.00	15 571.09	0.01
EUR ENAGAS SA EUR1.50	604.00	11 071.61	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)

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 ENDESA SA EUR1.2	900.00	18 839.48	0.01
EUR GRIFOLS SA EURO.25 (CLASS A) POST SUBD	671.00	9 492.05	0.00
EUR IBERDROLA SA EURO.75 (POST SUBDIVISION)	16 207.00	200 618.83	0.07
EUR INDITEX EURO.03 (POST SUBD)	2 874.00	118 628.12	0.04
EUR NATURGY ENERGY GRO EUR1	378.00	11 308.99	0.01
EUR RED ELECTRICA CORP EURO.5	1 082.00	18 157.17	0.01
EUR REPSOL SA EUR1	3 317.00	50 813.27	0.02
EUR TELEFONICA SA EUR1	13 004.00	56 101.98	0.02
スペイン合計		1 094 422.87	0.40
スウェーデン			
SEK ALFA LAVAL AB NPV	730.00	27 266.54	0.01
SEK ASSA ABLOY SER 'B' NPV (POST SPLIT)	2 561.00	65 669.49	0.03
SEK ATLAS COPCO AB SER 'A' NPV (POST SPLIT)	7 011.00	108 321.13	0.04
SEK ATLAS COPCO AB SER 'B' NPV (POST SPLIT)	061.00	53 655.26	0.02
SEK BEIJER REF AB SER 'B' NPV (POST SPLIT)	937.00	10 381.45	0.00
SEK BOLIDEN AB NPV (POST SPLIT)	674.00	18 003.18	0.01
SEK EPIROC AB SER 'A' NPV (POST SPLIT)	1 613.00	30 108.53	0.01
SEK EPIROC AB SER 'B' NPV	1 039.00	16 370.01	0.01
SEK EQT AB NPV	975.00	23 028.53	0.01
SEK ERICSSON SER 'B' NPV	7 184.00	35 622.29	0.02
SEK ESSITY AB SER 'B' NPV	1 532.00	38 377.30	0.02
SEK EVOLUTION AB NPV	461.00	47 838.40	0.02
SEK FASTIGHETS AB BALD SER 'B' NPV (POST SPLIT)	1 459.00	8 612.94	0.00
SEK GETINGE AB SER 'B' NPV	532.00	11 321.47	0.00
SEK HENNES & MAURITZ SER 'B' NPV	1 543.00	24 723.10	0.01
SEK HEXAGON AB SER 'B' NPV (POST SPLIT)	5 315.00	53 206.55	0.02
SEK HOLMEN AB SER 'B' NPV (POST SPLIT)	233.00	9 781.29	0.00
SEK HUSQVARNA AB SER 'B' NPV	998.00	7 630.59	0.00
SEK INDUSTRIVARDEN AB SER 'C' NPV	325.00	9 794.49	0.00
SEK INDUSTRIVARDEN AB SER 'A' NPV	351.00	10 564.65	0.00
SEK INDUTRADE AB NPV	844.00	18 524.93	0.01
SEK INVESTOR AB SER 'B' NPV (POST SPLIT)	315.00	89 686.08	0.03
SEK LATOUR INVESTMENT SER 'B' NPV (POST SPLIT)	427.00	9 571.88	0.00
SEK LIFCO AB SER 'B' NPV (POST SPLIT)	543.00	11 799.11	0.00
SEK LUNDBERGFÖRETAGEN SER 'B' NPV	194.00	9 445.58	0.00
SEK NIBE INDUSTRIER AB SER 'B' NPV (POST SPLIT)	200.00	24 834.02	0.01
SEK SAAB AB SER 'B' NPV	239.00	12 297.99	0.00
SEK SAGAX AB NPV B	543.00	12 327.66	0.00
SEK SANDVIK AB NPV (POST SPLIT)	2 687.00	53 079.20	0.02
SEK SECURITAS SER 'B' NPV	1 465.00	13 203.22	0.00
SEK SKAND ENSKILDA BKN SER 'A' NPV	3 961.00	48 005.94	0.02
SEK SKANSKA AB SER 'B' NPV	824.00	13 249.93	0.01
SEK SKF AB SER 'B' NPV	859.00	16 157.20	0.01
SEK SVENSKA CELLULOSA SER 'B' NPV	1 546.00	22 993.37	0.01
SEK SVENSKA HANDELSBKN SER 'A' NPV (P/S)	3 787.00	35 922.63	0.02
SEK SWEDBANK AB SER 'A' NPV	2 249.00	41 282.69	0.02
SEK SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB NPV	517.00	12 314.63	0.00
SEK TELE2 AB SHS	1 176.00	9 231.72	0.00
SEK TELIA COMPANY AB NPV	6 189.00	14 706.39	0.01
SEK VOLVO AB SER 'A' NPV (POST SPLIT)	516.00	12 202.18	0.00
SEK VOLVO AB SER 'B' NPV (POST SPLIT)	3 833.00	88 977.06	0.03
SEK VOLVO CAR AB SER 'B' NPV (WI)	2 218.00	7 232.57	0.00
スウェーデン合計		1 187 323.17	0.43

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)

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 (%)
スイス			
CHF ABB LTD CHF0.12 (REGD)	022.00	160 546.97	0.06
CHF ADECCO GROUP AG CHF0.1 (REGD)	383.00	18 530.06	0.01
CHF ALCON AG CHF0.04	1 322.00	100 219.93	0.04
CHF AVOLTA AG CHF5 (REGD)	250.00	8 777.53	0.00
CHF BACHEM HOLDING AG CHF0.01 (REGD) (SUBD)	110.00	8 222.64	0.00
CHF BALOISE-HLDGS CHF0.1(REGD)	137.00	21 096.31	0.01
CHF BARRY CALLEBAUT AG CHF0.02 (REGD)	9.00	15 080.21	0.01
CHF BKW AG CHF2.5	30.00	5 326.89	0.00
CHF BQE CANT VAUDOISE CHF1	38.00	662.87	0.00
CHF CLARIANT CHF4.00(REGD)	612.00	9 198.83	0.00
GBP COCA-COLA HBC AG ORD CHF6.70	686.00	19 070.98	0.01
EUR DSM FIRMENICH AG EURO.01	485.00	45 970.17	0.02
CHF EMS-CHEMIE HLDG AG CHF0.01(REGD)(POST RECON)	21.00	14 985.34	0.01
CHF GEBERIT CHF0.10(REGD)	84.00	47 276.87	0.02
CHF GIVAUDAN AG CHF10	25.00	94 071.65	0.03
GBP GLENCORE XSTRATA ORD USD0.01	27 923.00	156 172.42	0.06
CHF HELVETIA HOLDING CHF0.02 (REGD) POST SUBD	72.00	9 911.33	0.00
CHF HOLCIM LTD CHF2 (REGD)	1 338.00	98 940.14	0.03
CHF JULIUS BAER GRUPPE CHF0.02 (REGD)	545.00	27 727.91	0.01
CHF KUEHNE&NAGEL INTL CHF1(REGD)(POST-SUBD)	131.00	38 145.25	0.01
CHF LINDT & SPRUENGLI PTG CERT CHF10	5.00	62 216.09	0.02
CHF LOGITECH INTL CHF0.25(REGD) (POST-SUBD)	438.00	38 402.76	0.01
CHF LONZA GROUP AG CHF1(REGD)	192.00	74 720.03	0.03
CHF NESTLE SA CHF0.10(REGD)	6 885.00	786 642.23	0.28
CHF NOVARTIS AG CHF0.49 (REGD)	5 300.00	518 815.48	0.19
CHF PARTNERS GROUP HLG CHF0.01 (REGD)	62.00	82 174.69	0.03
CHF RICHEMONT(CIE FIN) CHF1.00 (REG) SER ‘A’	1 326.00	166 521.99	0.06
CHF ROCHE HLDGS AG CHF1(BR)	89.00	25 567.48	0.01
CHF ROCHE HLDGS AG GENUSSCHEINE NPV	1 794.00	487 003.28	0.18
CHF SANDOZ GROUP AG CHF0.05	996.40	28 658.46	0.01
CHF SCHINDLER-HLDG AG CHF0.1(REGD)(POST-SUBD)	56.00	12 068.77	0.00
CHF SCHINDLER-HLDG AG PTG CERT CHF0.10(POST-SUBD)	93.00	20 935.83	0.01
CHF SGS SA CHF0.04	342.00	29 222.70	0.01
CHF SIG COMBIBLOC GROU CHF0.1	722.00	16 971.63	0.01
CHF SIKA AG CHF0.01 (REG)	399.00	108 841.12	0.04
CHF SONOVA HOLDING AG CHF0.05 (REGD)	126.00	36 558.91	0.01
EUR STMICROELECTRONICS EUR1.04	1 800.00	85 344.75	0.03
CHF STRAUMANN HLDG CHF0.01 (REGD) (POST SPLIT)	283.00	39 136.05	0.01
CHF SWATCH GROUP CHF0.45(REGD)	228.00	11 510.78	0.00
CHF SWATCH GROUP CHF2.25(BR)	84.00	22 170.09	0.01
CHF SWISS LIFE HLDG CHF5.1(REGD)	76.00	48 997.30	0.02
CHF SWISS PRIME SITE CHF15.3 (REGD)	199.00	20 139.15	0.01
CHF SWISS RE AG CHF0.10	763.00	90 598.30	0.03
CHF SWISSCOM AG CHF1(REGD)	68.00	39 913.98	0.01
CHF TEMENOS AG CHF5 (REGD)	177.00	15 067.03	0.01
CHF UBS GROUP CHF0.10 (REGD)	8 594.00	243 425.01	0.09
CHF VAT GROUP AG CHF0.10	67.00	31 321.37	0.01
CHF ZURICH INSURANCE GRP CHF0.10	370.00	186 329.71	0.07
スイス合計		4 233 209.27	1.53
イギリス			
GBP 3I GROUP ORD GBP0.738636	2 629.00	74 285.03	0.03
GBP ABRDN PLC ORD GBP0.1396825396	205.00	8 674.35	0.00
GBP ADMIRAL GROUP ORD GBP0.001	539.00	18 430.19	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
GBP ANGLO AMERICAN USD0.54945	3 258.00	88 346.04	0.03
GBP ANTOFAGASTA ORD GBP0.05	1 094.00	19 507.01	0.01
GBP ASHTEAD GROUP ORD GBP0.10	1 151.00	69 402.08	0.02
GBP ASSOC BRIT FOODS ORD GBP0.0568	965.00	29 050.64	0.01
GBP ASTRAZENECA ORD USD0.25	084.00	523 528.36	0.19
GBP AUTO TRADER GROUP ORD GBP0.01	2 355.00	21 608.55	0.01
GBP AVIVA ORD GBP0.33	7 543.00	39 867.34	0.01
GBP BAE SYSTEMS ORD GBP0.025	7 985.00	106 140.41	0.04
GBP BARCLAYS ORD GBP0.25	38 956.00	69 555.77	0.03
GBP BARRATT DEVEL ORD GBP0.10	2 635.00	17 139.23	0.01
GBP BERKELEY GP HLDGS ORD GBP0.053943	243.00	14 261.53	0.01
GBP BP ORD USD0.25	45 491.00	275 910.49	0.10
GBP BRIT AMER TOBACCO ORD GBP0.25	5 349.00	170 101.75	0.06
GBP BT GROUP ORD GBP0.05	16 887.00	26 273.68	0.01
GBP BUNZL ORD GBP0.32142857	947.00	35 989.62	0.01
GBP BURBERRY GROUP ORD GBP0.0005	900.00	16 674.46	0.01
GBP CENTRICA ORD GBP0.061728395	13 492.00	25 458.04	0.01
USD COCA-COLA EUROPACI COM EURO.01	489.00	29 652.96	0.01
GBP COMPASS GROUP ORD GBP0.1105	480.00	113 599.26	0.04
GBP CRODA INTL ORD GBP0.10609756	398.00	22 592.55	0.01
GBP DIAGEO ORD GBP0.28 101/108	5 966.00	208 717.70	0.08
GBP ENDEAVOUR MINING P ORD USD0.01	404.00	9 405.45	0.00
GBP GSK PLC ORD GBP0.3125	10 622.00	190 865.60	0.07
GBP HALEON PLC ORD GBP1.25	14 900.00	62 256.19	0.02
GBP HALMA ORD GBP0.10	1 004.00	27 085.30	0.01
GBP HARGREAVES LANSDOW ORD GBP0.004 (WI)	1 127.00	10 249.60	0.00
GBP HIKMA PHARMACEUTIC ORD GBP0.10	404.00	8 814.73	0.00
GBP HSBC HLDGS ORD USD0.50(UK REG)	52 076.00	396 938.12	0.14
GBP IMPERIAL BRANDS PL GBP0.10	2 205.00	51 543.57	0.02
GBP INFORMA PLC (GB) ORD GBP0.001	3 454.00	32 488.35	0.01
GBP INTERCONTL HOTELS ORD GBP0.208521303	452.00	34 996.33	0.01
GBP INTERTEK GROUP ORD GBP0.01	450.00	22 701.65	0.01
GBP JD SPORTS FASHION ORD GBP0.0005	7 125.00	14 165.74	0.01
GBP KINGFISHER ORD GBP0.157142857	770.00	13 248.65	0.00
GBP LAND SECURITIES GP ORD GBP0.1066666666	1 407.00	11 118.19	0.00
GBP LEGAL & GENERAL GP ORD GBP0.025	15 481.00	44 938.60	0.02
GBP LLOYDS BANKING GP ORD GBP0.1	163 715.00	90 093.75	0.03
GBP LONDON STOCK EXCH ORD GBP0.06918604	1 121.00	126 387.71	0.05
GBP M&G PLC ORD GBP0.05	6 951.00	18 408.80	0.01
GBP MELROSE INDUST PLC ORD GBP0.22857142	3 046.00	19 997.66	0.01
GBP MONDI ORD EURO.20	1 331.00	23 707.66	0.01
GBP NATIONAL GRID ORD GBP0.12431289	9 761.00	126 967.54	0.05
GBP NATWEST GROUP PLC ORD GBP1.0769	15 127.00	39 812.90	0.01
GBP NEXT ORD GBP0.10	300.00	30 116.95	0.01
GBP OCADO GROUP PLC ORD GBP0.02	1 683.00	12 783.56	0.00
GBP PEARSON ORD GBP0.25	1 542.00	18 295.03	0.01
GBP PERSIMMON ORD GBP0.10	947.00	15 003.67	0.01
GBP PHOENIX GP HLDGS ORD GBP0.10	1 900.00	11 189.48	0.00
GBP PRUDENTIAL ORD GBP0.05	7 404.00	80 889.80	0.03
GBP RECKITT BENCK GRP ORD GBP0.10	1 862.00	127 241.60	0.05
GBP RELX PLC GBP0.1444	5 059.00	194 695.01	0.07
GBP RENTOKIL INITIAL ORD GBP0.01	6 360.00	34 516.53	0.01
GBP RIO TINTO ORD GBP0.10	2 912.00	199 031.24	0.07
GBP ROLLS-ROYCE HLDGS ORD GBP0.20	22 552.00	76 741.61	0.03
GBP SAGE GROUP GBP0.01051948	2 689.00	38 483.80	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
GBP SAINSBURY(J) ORD GBP0.28571428	654.00	16 844.46	0.01
GBP SCHROEDERS PLC ORD GBP0.20	2 531.00	12 867.75	0.00
GBP SEVERN TRENT ORD GBP0.9789	784.00	25 815.05	0.01
GBP SHELL PLC ORD EURO.07	17 684.00	573 108.73	0.21
GBP SMITH & NEPHEW ORD USD0.20	2 207.00	28 596.10	0.01
GBP SMITHS GROUP ORD GBP0.375	857.00	17 879.47	0.01
GBP SPIRAX-SARCO ENG ORD GBP0.269230769	195.00	22 829.64	0.01
GBP SSE PLC ORD GBP0.50	2 774.00	64 352.73	0.02
GBP ST JAMES 'S PLACE ORD GBP0.15	1 183.00	9 713.56	0.00
GBP STANDARD CHARTERED ORD USD0.50	6 565.00	54 287.20	0.02
GBP TAYLOR WIMPEY ORD GBP0.01	10 640.00	17 450.01	0.01
GBP TESCO ORD GBP0.0633333	19 176.00	69 380.40	0.02
GBP UNILEVER PLC ORD GBP0.031111	670.00	31 972.39	0.01
EUR UNILEVER PLC ORD GBP0.031111	5 912.00	281 987.24	0.10
GBP UNITED UTILITIES G ORD GBP0.05	1 838.00	25 385.56	0.01
GBP VODAFONE GROUP ORD USD0.2095238(POST CONS)	61 542.00	55 572.56	0.02
GBP WHITBREAD ORD GBP0.76797385	473.00	18 508.73	0.01
GBP WISE PLC CLS A ORD GBP0.01	1 307.00	12 919.10	0.00
GBP WPP PLC ORD GBP0.10	3 059.00	27 371.12	0.01
イギリス合計		5 606 789.21	2.03
アメリカ合衆国			
CAD BROOKFIELD RENEWA, CLASS A SUB VOTING SHARES	350.00	9 293.06	0.00
アメリカ合衆国合計		9 293.06	0.00
株式合計		45 208 121.28	16.33
投資信託証券			
アイルランド			
USD STAR COMPASS PLC/UBS DYNMC DIVERSIFIED LTD NOTE DUE 30.09.25	7 475 000.00	13 058 077.50	4.72
アイルランド合計		13 058 077.50	4.72
投資信託証券合計		13 058 077.50	4.72
コモディティ証券			
イギリス			
USD UBS AG/LONDON/UBS ETC CMC1 COMPOSITE USD 16-PRP	8 268.00	1 221 390.30	0.44
イギリス合計		1 221 390.30	0.44
コモディティ証券合計		1 221 390.30	0.44
投資信託、クローズド・エンド型			
カナダ			
CAD CANADIAN APARTMENT PROP. REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	200.00	6 819.34	0.00
CAD RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	403.00	5 192.62	0.00
カナダ合計		12 011.96	0.00
シンガポール			
SGD CAPITALAND ASCENDAS REIT- UNITS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	11 400.00	24 258.95	0.01
SGD CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST REAL ESTATE INV TRUST	17 125.00	23 353.44	0.01
SGD MAPLETREE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5 200.00	5 337.93	0.00
シンガポール合計		52 950.32	0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)

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 SEGRO PLC REIT	2 802.00	28 810.29	0.01
イギリス合計		28 810.29	0.01
投資信託、クローズド・エンド型合計		93 772.57	0.03

財務省証券 (T-bill)、ゼロ・クーポン

米ドル

USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 20.04.23-18.04.24	3 085 000.00	3 023 232.78	1.09
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 29.12.22-28.12.23	2 270 000.00	2 261 001.02	0.82
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 23.03.23-21.03.24	2 850 000.00	2 804 030.39	1.02
米ドル合計		8 088 264.19	2.93
財務省証券 (T-bill)、ゼロ・クーポン合計		8 088 264.19	2.93
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		67 669 625.84	24.45

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% 23.02.23-22.02.24	2 400 000.00	2 370 958.30	0.86
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 26.01.23-25.01.24	2 935 000.00	2 911 309.39	1.05
米ドル合計		5 282 267.69	1.91
財務省証券 (T-bill)、ゼロ・クーポン合計		5 282 267.69	1.91
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券および短期金融商品合計		5 282 267.69	1.91

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

EUR AMBIENTA X ICAV-AMBIENTA X ALPHA FUND - ACCUM-F- EUR	1 391.48	150 431.11	0.05
EUR KEPLER LIQUID STRATEGIES ICAV - KLS ARETE MACRO FUND-SI- EUR	2 269.67	289 779.76	0.10
USD MAN FUNDS VI PLC-MAN AHL TARGETRISK-INU-USD-CAP	25 304.45	3 646 624.43	1.32
EUR MERIAN GLOBAL FUNDS PLC-MER GBL EQ AB RETRN-I-ACC-EUR HDG	132 983.73	264 717.79	0.10
USD SOURCE MARKETS PLC - MSCI USA SOURCE ETF-A	96 054.00	12 446 677.32	4.50
EUR TAGES INTERNATIONAL FUNDS ICAV ACCUM SHS INSTIT. FD EUR	1 808.93	202 161.51	0.07
USD UBS IRL FND SOLUTIONS PLC-MSCI USA SF INDEX-SHS-A-USD-ACC	363 198.00	48 668 023.52	17.58
USD UBS(IRE)FUND SOLUTION PLC-MSCI USA SF UCITS SHS-A-ETF-ACC	380 871.00	49 261 855.14	17.80
アイルランド合計		114 930 270.58	41.52

ルクセンブルグ

EUR ALMA PLATINUM IV UBS MULTI-STRATEGY ALTERNATIVES-IOC-E-CAP	460.37	4 762 398.93	1.72
USD AQR UCITS FUNDS - GLOBAL RISK PARITY UCITS FUND-A2-CAP	23 190.48	2 790 742.36	1.01
EUR DB PLATINUM IV SYSTEMATIC ALPHA-SHS IIC-E-CAPITALISATION	1 603.11	259 730.96	0.09
USD FOCUSED SICAV - HIGH GRADE BOND USD U-X-ACC	2 782.00	27 199 697.46	9.83
USD FOCUSED SICAV - HIGH GRADE LONG TERM BOND USD U-X-ACC	3 087.00	27 522 735.03	9.94
USD INVESCO FUNDS SICAV BAL RISK ALLOCATION-PII-USD HDG-CAP	158 298.52	2 037 301.98	0.74
EUR LUMY-MWTOP ENV MKT NEU-EURBA UCITS FUND-SHS-B- CAPITALISATION	1 741.68	220 806.65	0.08
EUR SCHRODER GAIA WELLINGTON PAGOSA-C-EUR HDG-CAPITALISATION	2 603.93	299 570.65	0.11
USD UBS (LUX) BOND FUND-EURO HIGH YIELD (EUR)(USD HEDGED) F-ACC	16 755.00	2 227 074.60	0.80
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD (USD) F-ACC	9 651.00	3 380 552.28	1.22
USD UBS (LUX) BOND SICAV - EMERG ECON CORPORATES (USD) F-ACC	39 191.00	4 488 545.23	1.62

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャプ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)

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) EMERGING ECONOMIES FUND - GLOBAL BONDS (USD) F-ACC	3 609.00	6 698 628.81	2.42
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD SUSTAINABLE U-X-ACC	2.00	23 962.14	0.01
ルクセンブルグ合計		81 911 747.08	29.59
投資信託、オープン・エンド型合計		196 842 017.66	71.11
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		196 842 017.66	71.11

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派生商品

株式に係るワラント債

カナダ

CAD CONSTELLATION SOFTWARE INC/CANADA CALL WARRANT 31.03.40	57.00	0.01	0.00
カナダ合計		0.01	0.00
株式に係るワラント債合計		0.01	0.00
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 取引されていない派生商品合計		0.01	0.00
投資有価証券合計		269 793 911.20	97.47

派生商品

公認の証券取引所に上場されている派生商品

債券に係る金融先物

USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 19.03.24	-76.00	-102 125.00	-0.03
USD US LONG BOND FUTURE 19.03.24	-9.00	-15 203.13	-0.01
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.03.24	-128.00	-136 000.00	-0.05
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 28.03.24	53.00	44 718.86	0.02
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 28.03.24	15.00	12 421.89	0.00
債券に係る金融先物合計		-196 187.38	-0.07

指数に係る金融先物

EUR EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 15.12.23	-1.00	-3 840.67	0.00
CHF SWISS MARKET INDEX FUTURE 15.12.23	1.00	2 944.05	0.00
GBP FTSE 100 INDEX FUTURE 15.12.23	-1.00	-1 531.80	0.00
SEK OMX 30 INDEX FUTURE 15.12.23	1.00	939.99	0.00
USD MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 15.12.23	360.00	378 085.00	0.13
USD S&P500 EMINI FUTURE 15.12.23	-29.00	-517 237.50	-0.19
HKD HANG SENG INDEX FUTURE 28.12.23	1.00	-4 647.71	0.00
AUD SPI 200 INDEX FUTURES 21.12.23	1.00	1 723.93	0.00
JPY TOPIX INDX FUTURE 07.12.23	-1.00	-10 180.27	0.00
CAD S&P/TSX 60 IX FUTURE 14.12.23	-1.00	-12 744.77	0.00
指数に係る金融先物合計		-166 489.75	-0.06
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		-362 677.13	-0.13

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

指数に係るスワップおよび先渡スワップ

USD UBS/CMCI EXCESS RETURN INDEX TRS EQS REC PERF 23-04.04.24	7 031 158.64	-102 748.35	-0.04
USD UBS/CMCI EXCESS RETURN INDEX TRS EQS PAY 0.3800% 23-04.04.24			
指数に係るスワップおよび先渡スワップ合計		-102 748.35	-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 取引されていない派生商品合計		-102 748.35	-0.04
派生商品合計		-465 425.48	-0.17

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)

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／購入額／売却通貨／売却額／満期日 (日-月-年)			
USD 6 335 106.65	GBP 5 164 145.87	7.12.2023	-202 605.62 -0.07
USD 5 275 646.09	CAD 7 264 120.46	7.12.2023	-82 259.98 -0.03
USD 9 926 583.01	JPY 1 490 130 597.00	7.12.2023	-160 318.64 -0.06
USD 239 909.54	NOK 2 679 001.00	7.12.2023	-8 671.72 0.00
USD 169 580.92	NZD 285 803.00	7.12.2023	-6 946.83 0.00
USD 1 298 373.06	SEK 14 161 866.53	7.12.2023	-53 339.86 -0.02
USD 543 728.91	SGD 736 781.00	7.12.2023	-8 446.02 0.00
USD 223 981.40	ILS 860 496.00	7.12.2023	-7 104.89 0.00
USD 1 254 582.06	HKD 9 800 000.00	7.12.2023	-267.03 0.00
USD 1 402 814.34	DKK 9 785 286.57	7.12.2023	-29 548.71 -0.01
USD 3 314 074.14	AUD 5 146 813.11	7.12.2023	-99 010.92 -0.05
USD 20 327 778.42	EUR 19 031 041.33	7.12.2023	-440 733.21 -0.16
USD 4 099 992.19	CHF 3 681 633.09	7.12.2023	-136 009.23 -0.05
CHF 39 007 700.00	USD 43 549 717.82	11.1.2024	1 516 453.69 0.55
SGD 5 118 600.00	USD 3 773 135.67	11.1.2024	69 421.89 0.02
GBP 2 533 700.00	USD 3 118 590.71	11.1.2024	90 081.68 0.03
EUR 37 079 200.00	USD 39 847 088.12	11.1.2024	684 910.93 0.25
USD 131 373.02	CHF 116 400.00	11.1.2024	-3 105.62 0.00
EUR 330 000.00	USD 358 351.62	7.12.2023	1 776.27 0.00
CHF 50 000.00	USD 56 329.59	7.12.2023	1 199.25 0.00
JPY 29 000 000.00	USD 192 215.20	7.12.2023	089.84 0.00
USD 11 008.47	SGD 14 800.00	11.1.2024	-101.96 0.00
USD 137 973.53	GBP 111 000.00	11.1.2024	-2 596.64 0.00
EUR 630 000.00	USD 684 805.97	7.12.2023	2 710.92 0.00
GBP 130 000.00	USD 161 645.08	7.12.2023	2 932.49 0.00
CHF 1 060 700.00	USD 1 202 449.56	11.1.2024	22 992.80 0.01
GBP 53 300.00	USD 66 265.49	11.1.2024	1 233.52 0.00
SGD 100 900.00	USD 75 224.13	11.1.2024	521.98 0.00
USD 264 219.36	CHF 232 300.00	11.1.2024	-4 160.26 0.00
EUR 889 800.00	USD 975 956.66	11.1.2024	-3 298.87 0.00
USD 142 082.39	CHF 124 600.00	11.1.2024	-1 869.83 0.00
CAD 640 000.00	USD 472 063.78	7.12.2023	-9.40 0.00
JPY 75 000 000.00	USD 507 553.07	7.12.2023	132.38 0.00
USD 501 965.80	EUR 460 000.00	7.12.2023	-30.66 0.00
AUD 660 000.00	USD 437 649.96	7.12.2023	25.96 0.00
先渡為替契約合計			1 148 047.70 0.41
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産			6 361 556.76 2.30
その他の資産および負債			-41 304.30 -0.01
純資産総額			276 796 785.88 100.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル)

2023年11月30日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

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

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			
オーストラリア			
AUD AMPOL LTD NPV	1 469.00	33 340.72	0.00
AUD ANZ GROUP HLDGS LI NPV	17 888.00	289 043.76	0.03
AUD APA GROUP NPV	7 923.00	44 811.03	0.01
AUD ARISTOCRAT LEISURE NPV	3 591.00	96 645.30	0.01
AUD ASX LTD NPV	1 163.00	44 787.06	0.00
AUD AURIZON HOLDINGS NPV	17 786.00	41 629.32	0.00
AUD BHP GROUP LTD NPV	31 248.00	959 289.07	0.10
AUD BLUESCOPE STEEL NPV	2 479.00	34 156.11	0.00
AUD BRAMBLES LTD NPV	8 841.00	78 199.41	0.01
AUD CARSALES.COM LTD NPV	1 738.00	32 013.14	0.00
AUD CMNWLTH BK OF AUST NPV	10 152.00	704 496.14	0.07
AUD COCHLEAR LTD NPV	367.00	66 441.38	0.01
AUD COLES GROUP LTD NPV	7 582.00	77 067.67	0.01
AUD COMPUTERSHARE LTD NPV(POST REC)	3 628.00	56 794.93	0.01
AUD CSL NPV	2 974.00	517 094.14	0.05
AUD DEXUS NPV (STAPLED)	6 081.00	28 385.33	0.00
AUD ENDEAVOUR GROUP LI NPV	8 700.00	28 438.88	0.00
AUD FORTESCUE LTD NPV	10 489.00	173 798.74	0.02
AUD GOODMAN GROUP (STAPLED SECURITY)	10 139.00	152 940.60	0.02
AUD GPT GROUP NPV (STAPLED SECURITIES)	16 195.00	44 240.95	0.00
AUD IDP EDUCATION LTD NPV	1 338.00	20 103.07	0.00
AUD IGO LTD NPV	185.00	23 808.34	0.00
AUD INSURANCE AUST GRP NPV	15 228.00	59 975.74	0.01
AUD MACQUARIE GP LTD NPV	2 236.00	250 630.12	0.03
AUD MEDIBANK PRIVATE L NPV	19 913.00	45 683.47	0.01
AUD MINERAL RESS LTD NPV	1 042.00	42 262.24	0.00
AUD MIRVAC GROUP STAPLED SECURITIES	31 305.00	42 758.97	0.00
AUD NATL AUSTRALIA BK NPV	19 218.00	361 886.86	0.04
AUD NTHN STAR RES LTD NPV	7 814.00	65 955.06	0.01
AUD ORICA LIMITED NPV	2 317.00	23 996.80	0.00
AUD ORIGIN ENERGY NPV	10 280.00	56 165.11	0.01
AUD PILBARA MINERALS L NPV	16 945.00	40 896.79	0.00
AUD QANTAS AIRWAYS NPV	706.00	16 537.66	0.00
AUD QBE INS GROUP NPV	9 079.00	92 524.80	0.01
AUD RAMSAY HEALTH CARE NPV	1 101.00	35 887.69	0.00
AUD REA GROUP LIMITED NPV	239.00	24 602.30	0.00
AUD REECE AUSTRALIA NPV	1 020.00	13 079.85	0.00
AUD RIO TINTO LIMITED NPV	2 261.00	187 454.47	0.02
AUD SANTOS LIMITED NPV	20 097.00	92 077.93	0.01
AUD SCENTRE GROUP NPV STAPLED UNIT	39 814.00	69 956.48	0.01
AUD SEEK LIMITED NPV	1 637.00	25 919.66	0.00
AUD SONIC HEALTHCARE NPV	2 637.00	51 002.66	0.01
AUD SOUL PATTINSON(WH) NPV	1 363.00	30 275.19	0.00
AUD SOUTH32 LTD NPV	33 482.00	68 376.74	0.01
AUD STOCKLAND NPV (STAPLED)	15 984.00	43 770.53	0.00
AUD SUNCORP GROUP LTD NPV	7 939.00	73 537.44	0.01
AUD TELSTRA GROUP LTD NPV	30 324.00	76 806.17	0.01
AUD THE LOTTERY CORPOR NPV	16 472.00	50 240.09	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
AUD TRANSURBAN GROUP STAPLED UNITS NPV	19 179.00	164 807.60	0.02
AUD TREASURY WINE ESTA NPV	387.00	31 124.16	0.00
AUD VICINITY CENTRES NPV (STAPLED SECURITY)	29 036.00	36 483.15	0.00
AUD WESFARMERS LTD NPV	6 954.00	242 807.35	0.03
AUD WESTPAC BKG CORP NPV	21 635.00	306 554.50	0.03
AUD WISETECH GLOBAL LT NPV	1 087.00	48 145.12	0.01
AUD WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	8 324.00	171 096.07	0.02
GBP WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	3 321.00	67 225.48	0.01
AUD WOOLWORTHS GRP LTD NPV	7 210.00	166 842.61	0.02
オーストラリア合計		6 724 871.95	0.70
オーストリア			
EUR ERSTE GROUP BK AG NPV	1 961.00	79 402.31	0.01
EUR OMV AG NPV (VAR)	930.00	39 726.41	0.00
EUR VERBUND AG CLASS 'A' NPV	426.00	40 670.75	0.01
EUR VOESTALPINE AG NPV	919.00	25 890.25	0.00
オーストリア合計		185 689.72	0.02
ベルギー			
EUR AGEAS NPV	971.00	41 827.41	0.00
EUR ANHEUSER-BUSCH IN NPV	5 309.00	333 714.56	0.04
EUR ELIA SYS OPERATOR NPV	187.00	20 291.35	0.00
EUR GPE BRUXELLES LAM NPV	521.00	41 327.27	0.01
EUR KBC GROUP NV NPV	1 610.00	92 400.89	0.01
EUR LOTUS BAKERIES NPV	2.00	17 413.96	0.00
EUR SA D' IETEREN NV NPV	160.00	27 338.60	0.00
EUR SOFINA NPV	96.00	21 389.05	0.00
EUR SOLVAY SA NPV	490.00	56 751.93	0.01
EUR UCB NPV	689.00	50 999.93	0.01
EUR UMICORE NPV	1 205.00	32 251.44	0.00
EUR WAREHOUSES DE PAUW NPV (POST SPLIT)	1 104.00	31 053.93	0.00
ベルギー合計		766 760.32	0.08
バミューダ			
EUR AEGON LIMITED EURO.12	10 724.00	58 809.00	0.01
バミューダ合計		58 809.00	0.01
カナダ			
CAD 1ST QUANTUM MINLS COM NPV	3 876.00	31 760.42	0.00
CAD AGNICO EAGLE MINES LTD COM	2 993.00	160 814.29	0.02
CAD AIR CANADA VAR VTG SHS NPV	1 063.00	13 822.10	0.00
CAD ALGONQUIN PWR&UTIL COM NPV	700.00	29 014.27	0.00
CAD ALIMENTATION COUCH COM NPV	801.00	274 069.70	0.03
CAD ALTAGAS LTD COM NPV	1 886.00	38 391.86	0.00
CAD ARC RESOURCES COM NPV	3 600.00	57 457.68	0.01
CAD BANK NOVA SCOTIA HALIFAX COM	7 255.00	324 798.84	0.03
CAD BANK OF MONTREAL COM NPV	358.00	357 999.81	0.04
CAD BARRICK GOLD CORP COM NPV	11 017.00	193 712.64	0.02
CAD BCE INC COM NEW	402.00	15 841.62	0.00
CAD BROOKFIELD ASSET.M CLASS A LTD VOTING SHS	2 252.00	78 911.77	0.01
CAD BROOKFIELD CORP CLASS A LID VOTIONG SHS	8 635.00	304 805.92	0.03
CAD BRP INC SUB VTG NPV	240.00	14 833.50	0.00
CAD CAE INC COM NPV	1 868.00	37 171.25	0.00
CAD CAMECO CORP COM	2 768.00	127 207.35	0.01
CAD CANADIAN NAT RES LTD COM	6 730.00	449 758.68	0.05

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
CAD CANADIAN NATL RY CO COM	3 371.00	391 487.01	0.04
CAD CANADIAN PAC RY LT COM NPV	5 604.00	403 772.36	0.04
CAD CANADIAN TIRE LTD CL A	377.00	39 247.37	0.00
CAD CANADIAN UTILS LTD CL A	963.00	21 591.77	0.00
CAD CCL INDUSTRIES INC ‘ B ’ NON-VTG COM NPV	1 041.00	42 942.16	0.01
CAD CDN IMPERIAL BK OF COMMERCE COM	5 421.00	224 300.70	0.02
CAD CENOVUS ENERGY INC COM NPV	9 016.00	160 058.35	0.02
CAD CGI INC COM NPV SUB VOTING SHARES C	1 205.00	122 619.65	0.01
CAD CONSTELLATION SOFT COM STK NPV	130.00	305 600.91	0.03
CAD DESCARTES SYSTEMS COM NPV	515.00	41 865.47	0.00
CAD DOLLARAMA INC COM NPV	1 761.00	127 998.34	0.01
CAD ELEMENT FLEET MGMT COM NPV	2 651.00	42 741.35	0.01
CAD EMERA INC COM	1 445.00	50 825.72	0.01
CAD EMPIRE LTD CL A	1 084.00	29 485.50	0.00
CAD ENBRIDGE INC COM NPV	13 066.00	456 589.65	0.05
CAD FAIRFAX FINL HLDGS SUB-VTG COM NPV	142.00	130 628.27	0.01
CAD FIRSTSERVICE CORP COM NPV	300.00	47 115.83	0.01
CAD FORTIS INC COM NPV	2 943.00	117 993.49	0.01
CAD FRANCO NEVADA CORP COM NPV	1 189.00	133 277.44	0.01
CAD GFL ENVIRON INC COM NPV SUB VTG SHS	1 400.00	40 207.99	0.00
CAD GILDAN ACTIVEWEAR INC COM	1 141.00	41 336.37	0.00
CAD GREAT WEST LIFE CO INC COM	1 411.00	45 134.10	0.01
CAD HYDRO ONE INC COM NPV	1 717.00	47 767.26	0.01
CAD IA FINANCIAL CORP COM NPV	680.00	45 443.67	0.01
CAD IGM FINANCIAL INC COM	694.00	17 244.43	0.00
CAD IMPERIAL OIL LTD COM NEW	1 265.00	71 327.40	0.01
CAD INTACT FINL CORP COM NPV	1 037.00	160 844.56	0.02
CAD IVANHOE MINES LTD COM NPV CL ‘ A ’	3 196.00	28 545.61	0.00
CAD KEYERA CORPORATION COM NPV	1 559.00	39 289.77	0.00
CAD KINROSS GOLD CORP COM NPV	8 180.00	48 264.93	0.02
CAD LOBLAW COS LTD COM	1 017.00	87 759.71	0.01
CAD LUNDIN MINING CORP COM	764.00	33 028.43	0.00
CAD MAGNA INTL INC COM NPV	1 725.00	93 078.88	0.01
CAD MANULIFE FINL CORP COM	11 224.00	220 034.61	0.02
CAD MEG ENERGY CORP COM NPV	532.00	10 068.31	0.00
CAD METRO INC CL A SUB	1 520.00	76 243.83	0.01
CAD NATL BK OF CANADA COM NPV	2 117.00	140 399.48	0.02
CAD NORTHLAND POWER IN COM NPV	1 712.00	27 854.64	0.00
CAD NUTRIEN LTD NPV	2 994.00	160 271.80	0.02
CAD ONEX CORP SUB VTG	391.00	26 470.40	0.00
CAD OPEN TEXT CO COM NPV	1 711.00	68 510.67	0.01
CAD PAN AMER SILVER COM NPV	2 126.00	33 336.11	0.00
CAD PARKLAND CORP. COM NPV	800.00	26 203.49	0.00
CAD PEMBINA PIPELINE C COM NPV	3 210.00	107 461.67	0.01
CAD POWER CORP CDA COM	3 687.00	102 110.74	0.01
CAD QUEBECOR INC CL B	958.00	21 274.76	0.00
CAD RB GLOBAL INC COM NPV	1 123.00	71 437.66	0.01
CAD RESTAURANT BRANDS COM NPV	1 744.00	124 138.69	0.01
CAD ROGERS COMMUNICATIONS INC	2 229.00	96 058.17	0.01
CAD ROYAL BK OF CANADA COM NPV	8 518.00	770 348.61	0.08
CAD SAPUTO INC COM	1 368.00	26 616.40	0.00
CAD SHOPIFY INC COM NPV CL A	7 421.00	541 037.61	0.06
CAD STANTEC INC COM NPV	711.00	53 026.75	0.01
CAD SUN LIFE FINL INC COM	3 439.00	173 795.24	0.02
CAD SUNCOR ENERGY INC COM NPV ‘ NEW ’	8 126.00	268 139.72	0.03

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
CAD TC ENERGY CORPORAT COM NPV	6 119.00	229 668.41	0.02
CAD TECK RESOURCES LTD CLASS ' B ' SUB-VTG COM NPV	2 844.00	107 228.14	0.01
CAD TELUS CORPORATION NPV	2 584.00	46 273.20	0.01
CAD TFI INTERNATIONAL COM NPV	490.00	58 025.89	0.01
CAD THOMSON-REUTERS CP NPV POST REV SPLIT	978.00	136 747.60	0.01
CAD TMX GROUP LTD COM NPV	1 940.00	41 923.52	0.00
CAD TOROMONT INDS LTD COM	500.00	40 380.57	0.00
CAD TORONTO-DOMINION COM NPV	11 327.00	691 223.94	0.07
CAD TOURMALINE OIL CP COM NPV	1 927.00	93 347.61	0.01
CAD WEST FRASER TIMBER COM NPV	395.00	28 672.71	0.00
CAD WESTON GEORGE LTD COM	411.00	48 243.28	0.02
CAD WHEATON PRECIOUS M COM NPV	2 692.00	131 735.96	0.01
CAD WSP GLOBAL INC COM NPV	737.00	102 098.84	0.01
カナダ合計		11 100 195.18	1.15
中国			
USD FUTU HOLDINGS LIM SPON ADS EA REP 8 ORD SHS	400.00	21 568.00	0.00
中国合計		21 568.00	0.00
デンマーク			
DKK A.P. MOELLER-MAERSK SER ' B ' DKK1000	27.00	42 674.32	0.00
DKK A.P. MOLLER-MAERSK ' A ' DKK1000	19.00	29 501.77	0.00
DKK CARLSBERG SER ' B ' DKK20	542.00	67 262.68	0.01
DKK CHR. HANSEN HLDG DKK10	689.00	55 215.59	0.01
DKK COLOPLAST DKK1 B	790.00	93 415.19	0.01
DKK DANSKE BANK A/S DKK10	239.00	109 927.46	0.01
DKK DEMANT A/S DKK0.20	562.00	23 884.27	0.00
DKK DSV PANALPINA A/S DKK1	1 111.00	167 548.71	0.02
DKK GENMAB AS DKK1	414.00	130 928.49	0.01
DKK NOVO NORDISK A/S DKK0.1 B	19 390.00	1 973 576.61	0.20
DKK NOVOZYMES A/S SER ' B ' DKK2 (POST CONS)	1 144.00	59 450.53	0.01
DKK ORSTED A/S DKK10	1 187.00	56 004.74	0.01
DKK PANDORA A/S DKK1	517.00	69 925.50	0.01
DKK ROCKWOOL INTL SER ' B ' DKK10	44.00	11 906.08	0.00
DKK TRYG A/S DKK5	1 833.00	39 620.69	0.00
DKK VESTAS WIND SYSTEM DKK0.20 (POST SPLIT)	5 959.00	165 310.00	0.02
デンマーク合計		3 096 152.63	0.32
フィンランド			
EUR ELISA OYJ NPV	900.00	40 340.15	0.00
EUR FORTUM OYJ EUR3.40	3 022.00	42 485.76	0.01
EUR KESKO OYJ EUR2 SER ' B '	1 875.00	35 914.24	0.00
EUR KONE CORPORATION NPV ORD ' B '	1 874.00	83 404.19	0.01
EUR METSO CORPORATION RG	231.00	41 686.49	0.01
EUR NESTE OIL OYJ NPV	2 463.00	93 735.79	0.01
EUR NOKIA OYJ NPV	32 235.00	113 182.24	0.01
SEK NORDEA HOLDING ABP NPV	18 911.00	211 617.10	0.02
EUR ORION CORP SER ' B ' NPV	559.00	22 225.66	0.00
EUR SAMPO PLC NPV A	2 635.00	115 433.20	0.01
EUR STORA ENSO OYJ NPV SER ' R '	3 484.00	45 274.58	0.01
EUR UPM-KYMMENE CORP NPV	3 087.00	108 052.68	0.01
EUR WARTSILA OYJ ABP SER ' B ' EUR3.50	2 538.00	35 058.22	0.00
フィンランド合計		988 410.30	0.10

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル)

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 (%)
フランス			
EUR ACCOR EUR3	1 306.00	45 328.51	0.01
EUR ADP EUR3	181.00	22 336.02	0.00
EUR AIR LIQUIDE(L ') EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)	3 186.00	604 171.31	0.06
EUR AIRBUS EUR1	3 593.00	533 947.90	0.06
EUR ALSTOM EUR7.00	1 872.00	23 223.67	0.00
EUR AMUNDI EUR2.5 (AIW)	398.00	24 535.57	0.00
EUR ARKEMA EUR10	334.00	33 986.50	0.00
EUR AXA EUR2.29	11 242.00	350 750.45	0.04
EUR BIOMERIEUX NPV (POST SPLIT)	293.00	31 572.81	0.00
EUR BNP PARIBAS EUR2	6 499.00	409 650.47	0.04
EUR BOLLORE EURO.16	6 181.00	35 372.75	0.00
EUR BOUYGUES EUR1	1 073.00	40 870.89	0.00
EUR BUREAU VERITAS EURO.12	1 879.00	45 534.43	0.01
EUR CAPGEMINI EUR8	1 039.00	213 126.75	0.02
EUR CARREFOUR EUR2.50	3 950.00	74 969.75	0.01
EUR CIE DE ST-GOBAIN EUR4	2 953.00	192 708.91	0.02
EUR COVIVIO EUR3	278.00	13 595.06	0.00
EUR CREDIT AGRICOLE SA EUR3	7 464.00	97 906.81	0.01
EUR DANONE EURO.25	3 948.00	254 022.88	0.03
EUR DASSAULT AVIATION EURO.80 (POST SUBDIVISION)	148.00	29 454.46	0.00
EUR DASSAULT SYSTEMES EURO.10	164.00	195 204.62	0.02
EUR EDENRED EUR2	1 524.00	83 141.82	0.01
EUR EIFFAGE EUR4	453.00	45 966.95	0.01
EUR ENGIE EUR1	11 031.00	191 587.84	0.02
EUR ESSILORLUXOTTICA EURO.18	1 771.00	338 391.05	0.04
EUR EURAZEO NPV	371.00	27 870.35	0.00
EUR GECINA EUR7.50	295.00	32 702.45	0.00
EUR GETLINK SE EURO.40	2 447.00	44 774.59	0.01
EUR HERMES INTL NPV	191.00	396 835.47	0.04
EUR IPSEN EUR1	225.00	25 408.99	0.00
EUR KERING EUR4	450.00	193 304.73	0.02
EUR KLEPIERRE EUR1.40	1 204.00	30 346.11	0.00
EUR L ' OREAL EURO.20	1 470.00	691 368.42	0.07
EUR LA FRANCAISE DES EURO.40 (PROMESSES)	748.00	27 095.94	0.00
EUR LEGRAND SA EUR4	1 656.00	159 762.70	0.02
EUR LVMH MOET HENNESSY EURO.30	1 695.00	1 299 583.57	0.14
EUR MICHELIN (CGDE) EURO.50 (POST SUBDIVISION)	082.00	137 223.74	0.01
EUR ORANGE EUR4	11 010.00	135 795.08	0.01
EUR PERNOD RICARD EUR1.55	1 261.00	218 145.31	0.02
EUR PUBLICIS GROUPE SA EURO.40	1 484.00	125 616.95	0.01
EUR REMY COINTREAU EUR1.60	147.00	17 522.79	0.00
EUR RENAULT SA EUR3.81	1 144.00	44 923.38	0.01
EUR SAFRAN EURO.20	2 093.00	367 716.91	0.04
EUR SANOFI EUR2	6 906.00	643 952.77	0.07
EUR SARTORIUS STEDIM B EURO.20 (POST SUBD)	197.00	44 365.00	0.01
EUR SCHNEIDER ELECTRIC EUR8	3 370.00	620 016.92	0.07
EUR SEB SA EUR1	120.00	13 682.39	0.00
EUR SOC GENERALE EUR1.25	486.00	112 944.62	0.01
EUR SODEXO EUR4	508.00	54 541.03	0.01
EUR TELEPERFORMANCE EUR2.50	402.00	56 384.88	0.01
EUR THALES EUR3	658.00	98 322.40	0.01
EUR TOTALENERGIES SE EUR2.5	13 963.00	948 532.92	0.10
EUR UNIBAIL-RODAMCO-WE NPV(1 ORD UNIBAIL-R & 1CLS)	681.00	43 378.62	0.01
EUR VEOLIA ENVIRONNEME EUR5	426.00	139 612.42	0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル)

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 VINCI EUR2.50	3 236.00	396 508.80	0.04
EUR VIVENDI SA EUR5.50	3 993.00	37 842.84	0.00
EUR WORLDLINE EURO.68	1 424.00	22 117.30	0.00
フランス合計		11 139 558.57	1.17
ドイツ			
EUR ADIDAS AG NPV (REGD)	982.00	205 870.36	0.02
EUR ALLIANZ SE NPV(REGD)(VINKULIERT)	2 463.00	619 709.67	0.06
EUR BASF SE NPV	5 440.00	253 360.40	0.03
EUR BAYER AG NPV (REGD)	6 058.00	207 285.96	0.02
EUR BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG EUR1	1 848.00	192 743.16	0.02
EUR BAYERISCHE MOTORENWERKE AG EUR1	453.00	43 050.77	0.00
EUR BECHTLE AG NPV	471.00	23 372.54	0.00
EUR BEIERSDORF AG NPV	614.00	86 220.69	0.01
EUR BRENNTAG AG	884.00	76 468.13	0.01
EUR CARL ZEISS MEDITEC NPV	306.00	27 484.72	0.00
EUR COMMERZBANK AG NPV	6 567.00	80 573.28	0.01
EUR CONTINENTAL AG ORD NPV	670.00	51 918.25	0.01
EUR COVESTRO AG NPV	1 116.00	58 691.58	0.01
EUR DAIMLER TRUCK HOLD NPV (YOUNG SHARE)	3 088.00	100 506.72	0.01
EUR DELIVERY HERO SE NPV	1 030.00	32 709.16	0.00
EUR DEUTSCHE BANK AG NPV(REGD)	11 837.00	147 570.79	0.02
EUR DEUTSCHE BOERSE AG NPV(REGD)	1 182.00	224 791.26	0.02
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA ORD NPV (REGD)(VINK)	302.00	37 457.42	0.00
EUR DEUTSCHE POST AG NPV(REGD)	6 135.00	288 105.39	0.03
EUR DEUTSCHE TELEKOM NPV(REGD)	20 084.00	481 552.51	0.05
EUR DR.ING. F.PORSCHE NON-VTG PRF NPV	735.00	67 412.63	0.01
EUR E.ON SE NPV	13 488.00	175 644.49	0.02
EUR EVONIK INDUSTRIES NPV	1 346.00	25 186.84	0.00
EUR FRESENIUS MED CARE NPV	1 401.00	57 522.39	0.01
EUR FRESENIUS SE & CO. KGAA NPV	2 489.00	79 001.11	0.01
EUR GEA GROUP AG NPV	892.00	32 818.37	0.00
EUR HANNOVER RUECKVERS ORD NPV(REGD)	403.00	96 297.21	0.01
EUR HEIDELBERGCEMENT NPV	877.00	71 575.72	0.01
EUR HELLOFRESH SE NPV	908.00	13 889.88	0.00
EUR HENKEL AG & CO KGAA	607.00	42 440.04	0.00
EUR HENKEL AG&CO. KGAA NON-VTG PRF NPV	1 022.00	80 510.52	0.01
EUR INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)	8 101.00	314 226.49	0.03
EUR KNORR BREMSE AG NPV	423.00	26 538.28	0.00
EUR LEG IMMOBILIEN SE NPV	451.00	34 514.92	0.00
EUR MERCEDES-BENZ ORD NPV(REGD)	964.00	322 698.41	0.03
EUR MERCK KGAA NPV	806.00	140 840.17	0.02
EUR MTU AERO ENGINES H NPV (REGD)	345.00	70 674.64	0.01
EUR MUENCHENER RUECKVE NPV(REGD)	828.00	353 060.76	0.04
EUR NEMETSCHEK SE ORD NPV	347.00	30 304.08	0.00
EUR PORSCHE AUTO HL SE NON VTG PRF NPV	912.00	44 639.43	0.01
EUR PUMA SE NPV	616.00	39 775.92	0.00
EUR RATIONAL AG NPV	36.00	23 076.77	0.00
EUR RHEINMETALL AG NPV	278.00	83 717.92	0.01
EUR RWE AG (NEU) NPV	3 806.00	163 492.85	0.02
EUR SAP AG ORD NPV	6 376.00	1 012 083.06	0.11
EUR SARTORIUS AG NON VTG PRF NPV	175.00	56 423.51	0.01
EUR SCOUT24 AG NPV	520.00	36 311.81	0.00
EUR SIEMENS AG NPV(REGD)	654.00	782 008.83	0.08
EUR SIEMENS ENERGY AG NPV	3 452.00	40 979.27	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

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 SIEMENS HEALTHINEE NPV	1 728.00	99 814.18	0.01
EUR SYMRISE AG NPV (BR)	827.00	93 121.46	0.01
EUR TALANX AG NPV	388.00	28 194.90	0.00
EUR VOLKSWAGEN AG NON VTG PRF NPV	1 247.00	144 795.23	0.03
EUR VOLKSWAGEN AG ORD NPV	172.00	22 332.63	0.00
EUR VONOVIA SE NPV	548.00	126 638.48	0.01
EUR WACKER CHEMIE AG NPV(BR)	120.00	14 703.66	0.00
EUR ZALANDO SE NPV	1 377.00	32 843.44	0.00
ドイツ合計		8 119 553.06	0.84
香港			
HKD AIA GROUP LTD NPV	70 000.00	604 074.11	0.06
HKD BOC HONG KONG HLDG HKD5	25 000.00	66 898.84	0.01
HKD BUDWEISER BREWING USD0.00001	7 600.00	13 447.88	0.00
HKD CK ASSET HOLDINGS HKD1	12 500.00	59 296.70	0.01
HKD CK HUTCHISON HLDGS HKD1.0	16 500.00	82 708.09	0.01
HKD CK INFRASTRUCTURE HKD1	500.00	22 297.48	0.00
HKD CLP HOLDINGS HKD5	11 500.00	89 449.19	0.01
HKD ESR CAYMAN LIMITED USD0.001	14 200.00	18 253.84	0.00
HKD GALAXY ENTERTAINME HKD0.10	12 000.00	62 071.88	0.01
HKD HANG LUNG PROP HKD1	10 000.00	13 366.96	0.00
HKD HANG SENG BANK HKD5	900.00	54 268.08	0.01
HKD HENDERSON LAND DEV HKD2	10 000.00	27 207.66	0.00
HKD HKT TRUST AND HKT SHARE STAPLED UNIT	37 000.00	39 461.99	0.00
HKD HONG KONG EXCHANGE HKD1	7 400.00	262 637.80	0.03
USD HONGKONG LAND HLD ORD USD0.10(SINGAPORE REG)	7 300.00	23 506.00	0.00
HKD HONGKONG&CHINA GAS HKD0.25	71 300.00	49 022.58	0.01
USD JARDINE MATHESON COM USD0.25(BERMUDA REG)	900.00	34 749.00	0.00
HKD MTR CORP HKD1	12 500.00	44 812.62	0.01
HKD NEW WORLD DEVEL CO NPV POST CON	9 000.00	13 390.01	0.00
HKD POWER ASSETS HOLDINGS LTD HKD1	11 000.00	57 392.16	0.01
HKD SINO LAND CO HKD1	21 086.00	21 247.18	0.00
HKD SITC INTERNATIONAL HKD0.10	8 000.00	12 086.60	0.00
HKD SUN HUNG KAI PROP NPV	9 000.00	88 325.67	0.01
HKD SWIRE PACIFIC 'A' HKD0.60	2 500.00	16 228.57	0.00
HKD SWIRE PROPERTIES LTD HKD1	8 000.00	15 548.70	0.00
HKD TECHTRONIC INDUSTR NPV	8 500.00	86 302.70	0.01
HKD THE LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15 535.00	76 776.95	0.01
HKD WH GROUP LTD USD0.0001	59 103.00	37 987.92	0.00
HKD WHARF REAL ESTATE HKD0.1	11 000.00	34 716.98	0.00
HKD WHARF(HLDGS) HKD1	3 000.00	7 797.40	0.00
HKD XINYI GLASS HLDGS HKD0.1	5 266.00	6 061.40	0.00
香港合計		2 041 392.94	0.21
アイルランド			
EUR AIB GROUP PLC ORD EURO.625	707.00	21 847.73	0.00
EUR BANK OF IRELAND GR EUR1	6 319.00	59 225.14	0.01
GBP CRH ORD EURO.32	521.00	285 366.73	0.03
GBP DCC ORD EURO.25	561.00	37 938.77	0.00
GBP EXPERIAN ORD USD0.10	5 686.00	208 963.51	0.02
EUR FLUTTER ENTERTAINM ORD EURO.09	1 028.00	160 676.48	0.02
AUD JAMES HARDIE ID PLC CUF5 EURO.5	2 681.00	86 606.48	0.01
EUR KERRY GROUP 'A' ORD EURO.125(DUBLIN LIST)	991.00	80 252.61	0.01
EUR KINGSPAN GROUP ORD EURO.13(DUBLIN LISTING)	1 000.00	79 432.08	0.01
EUR SMURFIT KAPPA GRP ORD EURO.001	1 501.00	56 993.39	0.00
アイルランド合計		1 077 302.92	0.11

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル)

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 (%)
マン島			
GBP ENTAIN PLC ORD EURO.01	246.00	43 152.30	0.00
マン島合計		43 152.30	0.00
イスラエル			
ILS AZRIELI GROUP ILS0.01	352.00	20 444.56	0.00
ILS BANK HAPOLIM B.M. ILS1	7 945.00	67 223.48	0.01
ILS BK LEUMI LE ISRAEL ILS1	8 379.00	62 885.81	0.01
USD CHECK POINT SFTWRE ORD ILS0.01	584.00	85 264.00	0.01
USD CYBER-ARK SOFTWARE COM ILS0.01	200.00	39 854.00	0.00
ILS ELBIT SYSTEMS LTD ILS1	167.00	33 304.93	0.00
USD GLOBAL-E ONLINE LT COM NPV	500.00	17 125.00	0.00
ILS ICL GROUP LTD ILS1	5 213.00	26 232.28	0.00
ILS ISRAEL DISCOUNT BK ILS0.10 SER 'A'	7 145.00	34 476.96	0.00
ILS MIZRAHI TEFAHOT BK ILS0.01	854.00	30 499.18	0.00
USD MONDAY COM LTD COM NPV	100.00	17 984.00	0.00
ILS NICE SYSTEMS ILS1	360.00	69 272.04	0.01
USD TEVA PHARMA IND ADR(CNV 1 ORD ILS0.10)	6 800.00	66 776.00	0.01
USD WIX.COM LTD COM ILS0.01	394.00	39 991.00	0.01
イスラエル合計		611 333.24	0.06
イタリア			
EUR AMPLIFON EURO.02	790.00	24 591.98	0.00
EUR ASSIC GENERALI SPA EUR1	6 392.00	132 546.78	0.01
EUR BANCO BPM NPV	3 590.00	19 875.11	0.00
EUR DAVIDE CAMPARI MIL EURO.01	3 004.00	32 842.20	0.00
EUR DIASORIN SPA EUR1	124.00	11 762.67	0.00
EUR ENEL EUR1	48 873.00	345 868.09	0.04
EUR ENI SPA EUR1	14 716.00	243 546.93	0.03
EUR FINECOBANK SPA EURO.33	3 797.00	51 227.05	0.01
EUR INFRASTRUTTURE WIR NPV	1 793.00	22 145.79	0.00
EUR INTESA SANPAOLO NPV	96 699.00	278 700.12	0.03
EUR LEONARDO SPA EUR4.40	1 288.00	19 773.09	0.00
EUR MEDIOBANCA SPA EURO.5	3 563.00	41 888.78	0.01
EUR MONCLER SPA NPV	1 213.00	67 339.90	0.01
EUR NEXI SPA NPV	415.00	34 443.03	0.00
EUR POSTE ITALIANE SPA NPV	2 958.00	31 874.53	0.00
EUR PRYSMIAN SPA EURO.10	1 582.00	60 983.83	0.01
EUR RECORDATI EURO.125	707.00	34 073.08	0.00
EUR SNAM EUR1	11 982.00	60 439.07	0.01
EUR TELECOM ITALIA SPA EURO.55	62 158.00	18 080.97	0.00
EUR TERNA SPA ORD EURO.22	8 934.00	72 095.37	0.01
EUR UNICREDIT SPA NPV (POST REV SPLIT)	11 385.00	310 368.01	0.03
イタリア合計		1 914 466.38	0.20
日本			
JPY アドバンテスト	800.00	151 985.66	0.02
JPY イオン	200.00	86 963.17	0.01
JPY A G C	1 300.00	47 221.57	0.01
JPY アイシン	1 000.00	36 872.19	0.00
JPY 味の素	2 700.00	100 924.68	0.01
JPY A N Aホールディングス	700.00	14 451.25	0.00
JPY アサヒグループホールディングス	3 100.00	114 387.66	0.01
JPY 朝日インテック	1 200.00	23 267.83	0.00
JPY 旭化成	8 300.00	57 631.48	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
JPY アステラス製薬	10 700.00	130 099.44	0.01
JPY アズビル	600.00	19 367.54	0.00
JPY バンダイナムコホールディングス	3 900.00	77 638.58	0.01
JPY ベイカレント・コンサルティング	700.00	23 561.40	0.00
JPY ブリヂストン	3 400.00	140 245.55	0.02
JPY ブラザー工業	1 200.00	20 260.43	0.00
JPY キヤノン	6 200.00	159 660.43	0.02
JPY カプコン	1 000.00	33 706.50	0.00
JPY 東海旅客鉄道	500.00	108 059.66	0.01
JPY 千葉銀行	3 600.00	26 944.91	0.00
JPY 中部電力	3 800.00	46 961.82	0.01
JPY 中外製薬	200.00	148 243.65	0.02
JPY コンコルディア・フィナンシャルグループ	7 400.00	34 733.72	0.00
JPY 大日本印刷	1 300.00	36 519.77	0.00
JPY 第一生命ホールディングス	5 700.00	118 792.57	0.01
JPY ダイフク	2 100.00	39 532.59	0.00
JPY 第一三共	11 500.00	311 157.71	0.03
JPY ダイキン工業	1 600.00	239 780.84	0.03
JPY 大東建託	400.00	44 103.22	0.01
JPY 大和ハウス工業	3 500.00	99 411.51	0.01
JPY 大和ハウスリート投資法人	9.00	16 059.80	0.00
JPY 大和証券グループ	7 400.00	47 823.32	0.01
JPY デンソー	10 800.00	169 047.93	0.02
JPY 電通グループ	1 300.00	35 042.45	0.00
JPY ディスコ	600.00	130 239.80	0.01
JPY 東日本旅客鉄道	1 900.00	102 753.07	0.01
JPY エーザイ	1 600.00	83 033.11	0.01
JPY ENEOSホールディングス	17 700.00	69 969.09	0.01
JPY ファナック	5 700.00	158 621.44	0.02
JPY ファーストリテイリング	1 100.00	278 952.89	0.03
JPY 富士電機	900.00	37 750.87	0.00
JPY 富士フイルムホールディングス	2 300.00	134 731.29	0.01
JPY 富士通	1 100.00	157 148.17	0.02
JPY G L P投資法人	26.00	24 569.28	0.00
JPY 浜松ホトニクス	900.00	35 650.56	0.00
JPY 阪急阪神ホールディングス	1 500.00	45 364.77	0.01
JPY 光通信	100.00	15 551.12	0.00
JPY ヒロセ電機	220.00	24 628.81	0.00
JPY 日立建機	900.00	23 346.97	0.00
JPY 日立製作所	5 800.00	403 510.67	0.04
JPY 本田技研工業	28 100.00	286 825.86	0.03
JPY ホシザキ	800.00	25 482.46	0.00
JPY HOYA	2 200.00	247 999.46	0.03
JPY ヒューリック	1 900.00	18 866.98	0.00
JPY イビデン	700.00	33 481.25	0.00
JPY 出光興産	958.00	26 283.68	0.00
JPY 飯田グループホールディングス	700.00	10 464.37	0.00
JPY I N P E X	5 900.00	83 410.56	0.01
JPY いすゞ自動車	000.00	52 910.34	0.01
JPY 伊藤忠商事	7 300.00	283 338.86	0.03
JPY 日本航空	1 000.00	19 014.44	0.00
JPY 日本取引所グループ	3 200.00	65 348.53	0.01
JPY 日本都市ファンド投資法人	50.00	33 314.17	0.00
JPY ゆうちょ銀行	8 526.00	84 172.88	0.01
JPY 日本郵政	13 500.00	119 124.36	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
JPY かんぽ生命保険	900.00	16 832.96	0.00
JPY ジャパンリアルエステイト投資法人	9.00	35 005.24	0.00
JPY 日本たばこ産業	7 100.00	182 548.79	0.02
JPY J F Eホールディングス	3 000.00	44 238.51	0.01
JPY J S R	1 000.00	27 523.93	0.00
JPY 鹿島建設	2 700.00	42 672.91	0.01
JPY 関西電力	600.00	61 329.19	0.01
JPY 花王	2 900.00	111 735.38	0.01
JPY 川崎汽船	900.00	31 589.95	0.00
JPY K D D I	9 200.00	287 820.88	0.03
JPY K D X不動産投資法人	11.00	12 612.03	0.00
JPY 京成電鉄	800.00	32 252.17	0.00
JPY キーエンス	1 200.00	514 221.94	0.05
JPY キッコーマン	900.00	55 186.53	0.01
JPY 近鉄グループホールディングス	1 200.00	33 653.74	0.00
JPY キリンホールディングス	5 000.00	70 585.45	0.01
JPY 神戸物産	1 100.00	29 048.60	0.00
JPY コーエーテックモホールディングス	340.00	163.90	0.00
JPY 小糸製作所	1 100.00	16 641.19	0.00
JPY 小松製作所	5 700.00	145 435.11	0.02
JPY コナミホールディングス	600.00	29 688.50	0.00
JPY コーセー	200.00	14 157.68	0.00
JPY クボタ	6 200.00	88 868.00	0.01
JPY 京セラ	2 000.00	110 799.20	0.01
JPY 協和キリン	1 300.00	21 429.97	0.00
JPY レーザーテック	500.00	111 746.20	0.01
JPY L I N Eヤフー	15 400.00	44 855.68	0.01
JPY エムスリー	2 700.00	44 663.65	0.01
JPY マキタ	1 400.00	37 160.35	0.00
JPY 丸紅	9 000.00	140 447.12	0.02
JPY マツモトキヨシ	2 400.00	41 454.32	0.01
JPY マツダ	3 200.00	34 167.82	0.00
JPY 日本マクドナルドホールディングス	700.00	29 877.90	0.00
JPY 明治ホールディングス	1 600.00	37 046.71	0.00
JPY ミネベアミツミ	2 000.00	38 055.94	0.00
JPY ミスミグループ本社	1 600.00	25 974.91	0.00
JPY 三菱ケミカルホールディングス	7 500.00	49 134.17	0.01
JPY 三菱商事	7 000.00	326 052.70	0.03
JPY 三菱電機	12 000.00	163 073.70	0.02
JPY 三菱地所	6 700.00	90 482.97	0.01
JPY 三菱HCキャピタル	5 200.00	33 922.14	0.00
JPY 三菱重工業	1 900.00	106 261.71	0.01
JPY 三菱U F Jフィナンシャル・グループ	69 900.00	593 394.67	0.06
JPY 三井物産	8 200.00	299 079.38	0.03
JPY 三井化学	900.00	26 348.29	0.00
JPY 三井不動産	5 200.00	122 125.34	0.01
JPY 商船三井	2 000.00	54 939.63	0.01
JPY みずほフィナンシャルグループ	15 030.00	255 388.51	0.03
JPY M o n o t a R O	2 000.00	20 198.19	0.00
JPY M S & A Dインシュアランス グループ ホールディングス	2 800.00	104 795.21	0.01
JPY 村田製作所	10 600.00	206 751.45	0.02
JPY 日本電気	1 600.00	89 180.51	0.01
JPY ネクソン	1 900.00	41 101.23	0.01
JPY ニデック	2 700.00	102 349.24	0.01
JPY 任天堂	6 400.00	299 230.90	0.03

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
JPY 日本ビルファンド投資法人	12.00	50 407.55	0.01
JPY NIPPON EXPRESSホールディングス	500.00	27 297.32	0.00
JPY 日本ペイントホールディングス	6 100.00	45 574.12	0.01
JPY 日本プロロジスリート投資法人	13.00	24 657.22	0.00
JPY 日本酸素ホールディングス	1 200.00	31 518.92	0.00
JPY 日本製鉄	5 200.00	121 597.73	0.01
JPY 日本電信電話	190 700.00	223 290.63	0.02
JPY 日本郵船	3 000.00	80 643.96	0.01
JPY 日産化学	900.00	32 831.87	0.00
JPY 日産自動車	13 000.00	51 257.82	0.01
JPY 日清食品ホールディングス	400.00	39 679.37	0.00
JPY ニトリホールディングス	500.00	57 699.46	0.01
JPY 日東電工	900.00	64 013.94	0.01
JPY 野村ホールディングス	19 800.00	81 337.57	0.01
JPY 野村不動産マスターファンド投資法人	21.00	24 120.13	0.00
JPY 野村不動産ホールディングス	700.00	17 064.97	0.00
JPY 野村総合研究所	2 300.00	64 596.34	0.01
JPY NTTデータグループ	3 900.00	47 406.23	0.01
JPY 大林組	100.00	34 597.69	0.00
JPY オービック	400.00	61 406.30	0.01
JPY 小田急電鉄	1 700.00	23 912.81	0.00
JPY 王子ホールディングス	5 800.00	21 546.72	0.00
JPY オリンパス	8 000.00	117 211.76	0.01
JPY オムロン	1 100.00	46 125.07	0.01
JPY 小野薬品工業	2 400.00	44 173.57	0.01
JPY オープンハウス	600.00	16 753.81	0.00
JPY 日本オラクル	300.00	23 204.92	0.00
JPY オリエンタルランド	6 600.00	224 337.95	0.02
JPY オリックス	7 200.00	131 424.90	0.01
JPY 大阪ガス	2 000.00	38 962.36	0.00
JPY 大塚商会	700.00	28 575.78	0.00
JPY 大塚ホールディングス	2 500.00	96 205.23	0.01
JPY パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	2 300.00	49 847.47	0.01
JPY パナソニック	13 700.00	141 786.45	0.02
JPY 楽天グループ	10 300.00	40 807.05	0.01
JPY リクルートホールディングス	8 900.00	331 413.40	0.04
JPY ルネサスエレクトロニクス	8 500.00	149 692.23	0.02
JPY りそなホールディングス	14 000.00	72 777.08	0.01
JPY リコー	3 600.00	29 392.23	0.00
JPY ローム	2 400.00	45 870.06	0.01
JPY SBIホールディングス	1 400.00	30 370.35	0.00
JPY SCSK	700.00	12 898.16	0.00
JPY セコム	1 300.00	90 529.98	0.01
JPY セイコーエプソン	1 900.00	28 249.06	0.00
JPY 積水化学工業	2 200.00	31 258.50	0.00
JPY 積水ハウス	3 500.00	71 711.71	0.01
JPY セブン&アイ・ホールディングス	500.00	167 264.18	0.02
JPY SGホールディングス	2 300.00	33 254.98	0.00
JPY シャープ	2 300.00	14 400.38	0.00
JPY 島津製作所	1 400.00	36 317.52	0.00
JPY シマノ	500.00	76 960.80	0.01
JPY 清水建設	3 700.00	24 317.11	0.00
JPY 信越化学工業	11 200.00	394 861.84	0.04
JPY 塩野義製薬	1 600.00	75 522.04	0.01
JPY 資生堂	2 400.00	64 385.30	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
JPY しずおかフィナンシャルグループ	2 600.00	21 034.26	0.00
JPY SMC	400.00	201 440.80	0.02
JPY ソフトバンク	17 300.00	210 464.71	0.02
JPY ソフトバンクグループ	6 200.00	252 470.66	0.03
JPY SOMPOホールディングス	1 800.00	82 271.45	0.01
JPY ソニーグループ	7 800.00	676 402.75	0.07
JPY スクウェア・エニックス・ホールディングス	400.00	13 885.75	0.00
JPY SUBARU	000.00	70 916.90	0.01
JPY SUMCO	2 400.00	35 983.36	0.00
JPY 住友化学	7 300.00	18 640.71	0.00
JPY 住友商事	6 800.00	142 591.40	0.02
JPY 住友電気工業	800.00	59 547.47	0.01
JPY 住友金属鉱山	1 400.00	40 645.31	0.00
JPY 三井住友フィナンシャルグループ	7 900.00	387 852.68	0.04
JPY 三井住友トラスト・ホールディングス	2 100.00	78 965.74	0.01
JPY 住友不動産	1 700.00	47 998.11	0.01
JPY サントリー食品インターナショナル	700.00	22 008.32	0.00
JPY スズキ	2 400.00	97 746.81	0.01
JPY シスメックス	1 000.00	55 338.72	0.01
JPY T&Dホールディングス	3 300.00	48 807.45	0.01
JPY 大成建設	1 000.00	34 031.18	0.00
JPY 武田薬品工業	9 649.00	271 844.19	0.03
JPY TDK	2 400.00	111 529.75	0.01
JPY テルモ	100.00	130 847.23	0.01
JPY T I S	1 500.00	31 727.94	0.00
JPY 東武鉄道	1 200.00	29 668.21	0.00
JPY 東宝	600.00	20 824.57	0.00
JPY 東京海上ホールディングス	11 100.00	273 905.37	0.03
JPY 東京電力ホールディングス	9 900.00	42 249.20	0.01
JPY 東京エレクトロン	2 900.00	471 285.56	0.05
JPY 東京ガス	2 500.00	57 953.12	0.01
JPY 東急	2 700.00	31 696.49	0.00
JPY TOPPANホールディングス	1 600.00	37 490.45	0.00
JPY 東レ	9 200.00	47 737.82	0.01
JPY 東芝	600.00	18 669.46	0.00
JPY 東ソー	1 200.00	15 966.45	0.00
JPY TOTO	900.00	23 115.64	0.00
JPY 豊田自動織機	900.00	77 407.25	0.01
JPY トヨタ自動車	65 200.00	1 232 464.58	0.13
JPY 豊田通商	1 300.00	72 019.48	0.01
JPY トレンドマイクロ	800.00	40 661.55	0.00
JPY ユニ・チャーム	2 400.00	77 324.04	0.01
JPY ユー・エス・エス	1 000.00	19 569.11	0.00
JPY 西日本旅客鉄道	1 200.00	47 461.02	0.01
JPY ヤクルト本社	1 600.00	35 747.96	0.00
JPY ヤマハ	1 000.00	23 411.24	0.00
JPY ヤマハ発動機	2 000.00	51 097.51	0.01
JPY ヤマトホールディングス	1 700.00	30 225.93	0.00
JPY 安川電機	1 400.00	53 723.41	0.01
JPY 横河電機	1 600.00	30 314.88	0.00
JPY ゼンショーホールディングス	500.00	27 780.97	0.00
JPY ZOZO	920.00	19 447.36	0.00
日本合計		21 527 157.41	2.23

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル)

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 (%)
ルクセンブルグ			
EUR ARCELORMITTAL NPV(POST STOCK SPLIT)	3 294.00	82 987.39	0.01
EUR EUROFINS SCIENTIFI EURO.01	785.00	45 703.56	0.01
EUR TENARIS S.A. USD1	2 651.00	45 556.97	0.00
ルクセンブルグ合計		174 247.92	0.02
マカオ			
HKD SANDS CHINA LTD USD0.01 REG 'S'	14 400.00	35 325.66	0.00
マカオ合計		35 325.66	0.00
オランダ			
EUR ABN AMRO BANK N.V. DR EACH REP SHS	2 924.00	39 289.49	0.00
EUR ADYEN NV EURO.01	132.00	154 250.99	0.02
USD AERCAP HOLDINGS EURO.01	1 084.00	73 950.48	0.01
EUR AKZO NOBEL NV EURO.50(POST REV SPLIT)	1 072.00	82 414.19	0.01
EUR ARGEN X NV EURO.10	349.00	155 135.43	0.02
EUR ASM INTL NV EURO.04	281.00	144 316.20	0.01
EUR ASML HOLDING NV EURO.09	2 474.00	1 681 714.61	0.17
EUR ASR NEDERLAND N.V. EURO.16	1 055.00	48 657.44	0.00
EUR BE SEMICONDUCTOR EURO.01	466.00	65 310.74	0.01
EUR CNH INDUSTRIAL NV COM EURO.01	6 277.00	66 707.65	0.01
EUR EURONEXT EUR1.60	516.00	42 901.18	0.00
EUR EXOR NV EURO.01	618.00	60 214.97	0.01
EUR FERRARI NV EURO.01(NEW)	762.00	274 866.85	0.03
EUR FERROVIAL SE EURO.01	3 194.00	110 682.76	0.01
EUR HEINEKEN HOLDING EUR1.6	801.00	62 314.14	0.01
EUR HEINEKEN NV EUR1.60	1 710.00	156 539.03	0.02
EUR IMCD NV EURO.16	352.00	54 364.71	0.01
EUR ING GROEP N.V. EURO.01	22 447.00	315 406.97	0.03
EUR JDE PEETS N.V. EURO.01	827.00	22 215.61	0.00
EUR KON KPN NV EURO.04	19 017.00	65 298.52	0.01
EUR KONINKLIJKE AHOLD EURO.01	5 975.00	173 153.21	0.02
EUR KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20	5 703.00	116 797.14	0.01
EUR NN GROUP N.V. EURO.12	1 486.00	56 569.76	0.01
EUR OCI N.V. EURO.02	637.00	13 719.91	0.00
EUR PROSUS N.V. EURO.05	9 370.00	310 797.65	0.03
EUR QIAGEN NV EURO.01	1 326.00	54 471.97	0.01
EUR RANDSTAD N.V. EURO.10	612.00	36 392.55	0.00
EUR STELLANTIS N V COM EURO.01	13 840.00	300 536.60	0.03
EUR UNIVERSAL MUSIC GR EUR10.00	5 118.00	135 362.22	0.01
EUR WOLTERS KLUWER EURO.12	1 581.00	217 871.18	0.02
オランダ合計		5 092 224.15	0.53
ニュージーランド			
NZD AUCKLAND INTL NPV	7 378.00	36 091.61	0.00
NZD EBOS GROUP LIMITED NPV(POST RECON)	800.00	18 282.44	0.00
NZD FISHER & PAYKEL HE NPV	002.00	58 236.44	0.01
NZD MERCURY NZ LTD NPV	5 494.00	21 140.69	0.00
NZD MERIDIAN ENERGY LT NPV	7 630.00	24 576.57	0.00
NZD SPARK NEW ZEALAND NPV	12 694.00	40 652.73	0.01
AUD XERO LIMITED NPV	876.00	59 854.72	0.01
ニュージーランド合計		258 835.20	0.03

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル)

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 (%)
ノルウェー			
NOK ADEVINTA ASA SER 'B' NOK0.2	2 223.00	23 057.43	0.00
NOK AKER BP ASA NOK1	1 968.00	56 618.25	0.01
NOK DNB BANK ASA NOK12.50	5 555.00	106 216.42	0.01
NOK EQUINOR ASA NOK2.50	5 429.00	175 328.88	0.02
NOK GJENSIDIGE FORSIKR NOK2	1 163.00	19 648.04	0.00
NOK KONGSBERG GRUPPEN NOK5	469.00	20 206.66	0.00
NOK MOWI ASA NOK7.50	2 437.00	43 477.48	0.01
NOK NORSK HYDRO ASA NOK3.6666	8 191.00	47 707.63	0.01
NOK ORKLA ASA NOK1.25	3 624.00	26 776.21	0.00
NOK SALMAR ASA NOK0.25	461.00	25 353.55	0.00
NOK TELENOR ASA ORD NOK6	3 796.00	40 957.69	0.00
NOK YARA INTERNATIONAL NOK1.7	869.00	29 531.55	0.00
ノルウェー合計		614 879.79	0.06
ポルトガル			
EUR EDP ENERGIAS PORTU EUR1(REGD)	19 027.00	91 075.70	0.01
EUR GALP ENERGIA EUR1-B	3 090.00	46 037.82	0.01
EUR JERONIMO MARTINS EUR5	1 683.00	41 684.49	0.00
ポルトガル合計		178 798.01	0.02
シンガポール			
SGD CAPITALAND INVESTM NPV	20 900.00	47 450.17	0.01
SGD CITY DEVELOPMENTS SGD0.50	2 700.00	12 664.47	0.00
SGD DBS GROUP HLDGS SGD1	10 700.00	254 471.75	0.03
SGD GENTING SINGAPORE LTD	45 000.00	30 851.94	0.00
USD GRAB HLDGS LTD COM USD0.000001 CL A	10 300.00	31 312.00	0.00
SGD JARDINE CYCLE & CA SGD1	300.00	6 410.91	0.00
SGD KEPPEL CORP NPV	8 500.00	42 480.89	0.01
SGD MAPLETREE LOGISTICS TRUST-UNITS REIT	23 747.00	28 647.29	0.00
SGD OVERSEA-CHINESE BK NPV	20 987.00	197 195.40	0.02
USD SEA LTD ADS EACH REP ONE CL A SHS	2 200.00	79 684.00	0.01
SGD SEMBCORP INDUSTRIE SGD0.25 (POST REORG)	3 300.00	12 709.43	0.00
SGD SEMBCORP MARINE NPV	209 936.00	16 516.77	0.00
SGD SINGAPORE AIRLINES NPV	7 900.00	37 528.85	0.00
SGD SINGAPORE EXCHANGE SGD0.01	5 500.00	38 861.83	0.01
SGD SINGAPORE TECH ENG NPV	11 600.00	32 246.37	0.00
SGD SINGAPORE TELECOMM NPV	58 700.00	101 601.23	0.01
SGD UOL GROUP LIMITED SGD1	2 300.00	10 167.84	0.00
SGD UTD OVERSEAS BANK SGD1	7 600.00	155 006.74	0.02
SGD WILMAR INTERNATIONAL LTD	13 700.00	37 262.85	0.00
シンガポール合計		1 173 070.73	0.12
スペイン			
EUR ACCIONA SA EUR1	179.00	25 292.24	0.00
EUR ACS ACTIVIDADES CO EURO.5	1 515.00	60 583.05	0.01
EUR AENA SME S.A. EUR10	483.00	83 239.86	0.01
EUR AMADEUS IT GROUP EURO.01	2 769.00	189 795.30	0.02
EUR BANCO SANTANDER SA EURO.50(REGD)	98 997.00	410 567.40	0.04
EUR BBVA(BILB-VIZ-ARG) EURO.49	36 028.00	334 372.14	0.04
EUR CAIXABANK SA EUR1	25 901.00	116 744.46	0.01
EUR CELLNEX TELECOM SA EURO.25	3 462.00	132 359.68	0.01
EUR CORP ACCIONA ENERG EUR1	205.00	6 092.92	0.00
EUR EDP RENOVAVEIS SA EUR5	2 131.00	38 946.00	0.01
EUR ENAGAS SA EUR1.50	1 667.00	30 556.91	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

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 ENDESA SA EUR1.2	1 749.00	36 611.39	0.00
EUR GRIFOLS SA EURO.25 (CLASS A) POST SUBD	1 705.00	24 119.12	0.00
EUR IBERDROLA SA EURO.75 (POST SUBDIVISION)	38 001.00	470 396.51	0.05
EUR INDITEX EURO.03 (POST SUBD)	6 644.00	274 239.82	0.03
EUR NATURGY ENERGY GRO EUR1	685.00	20 493.80	0.00
EUR RED ELECTRICA CORP EURO.5	2 180.00	36 582.84	0.00
EUR REPSOL SA EUR1	7 662.00	117 374.52	0.01
EUR TELEFONICA SA EUR1	31 882.00	137 545.63	0.02
スペイン合計		2 545 913.59	0.26
スウェーデン			
SEK ALFA LAVAL AB NPV	1 853.00	69 212.19	0.01
SEK ASSA ABLOY SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	5 778.00	148 160.21	0.02
SEK ATLAS COPCO AB SER ' A ' NPV (POST SPLIT)	15 846.00	244 823.37	0.03
SEK ATLAS COPCO AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	9 093.00	120 139.70	0.01
SEK BEIJER REF AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	2 131.00	23 610.33	0.00
SEK BOLIDEN AB NPV (POST SPLIT)	1 533.00	40 947.88	0.01
SEK EPIROC AB SER ' A ' NPV (POST SPLIT)	3 844.00	71 752.76	0.01
SEK EPIROC AB SER ' B ' NPV	2 392.00	37 687.27	0.01
SEK EQT AB NPV	2 374.00	56 071.52	0.01
SEK ERICSSON SER ' B ' NPV	18 491.00	91 688.72	0.01
SEK ESSITY AB SER ' B ' NPV	3 862.00	96 744.87	0.01
SEK EVOLUTION AB NPV	1 040.00	107 921.77	0.01
SEK FASTIGHETS AB BALD SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	3 672.00	21 676.99	0.00
SEK GETINGE AB SER ' B ' NPV	1 179.00	25 090.25	0.00
SEK HENNES & MAURITZ SER ' B ' NPV	3 606.00	57 778.04	0.01
SEK HEXAGON AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	12 765.00	127 785.83	0.01
SEK HOLMEN AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	493.00	20 696.04	0.00
SEK HUSQVARNA AB SER ' B ' NPV	1 701.00	13 005.64	0.00
SEK INDUSTRIVARDEN AB SER ' C ' NPV	871.00	26 249.24	0.00
SEK INDUSTRIVARDEN AB SER ' A ' NPV	766.00	23 055.62	0.00
SEK INDUTRADE AB NPV	1 844.00	40 473.91	0.01
SEK INVESTOR AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	10 101.00	209 946.49	0.02
SEK LATOUR INVESTMENT SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	987.00	22 125.17	0.00
SEK LIFCO AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	1 542.00	33 506.86	0.00
SEK LUNDBERGFÖRETAGEN SER ' B ' NPV	369.00	17 966.07	0.00
SEK NIBE INDUSTRIER AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	9 770.00	57 768.67	0.01
SEK SAAB AB SER ' B ' NPV	557.00	28 661.01	0.00
SEK SAGAX AB NPV B	1 059.00	24 042.34	0.00
SEK SANDVIK AB NPV (POST SPLIT)	6 538.00	129 152.15	0.01
SEK SECURITAS SER ' B ' NPV	2 600.00	23 432.34	0.00
SEK SKAND ENSKILDA BKN SER ' A ' NPV	9 464.00	114 700.37	0.01
SEK SKANSKA AB SER ' B ' NPV	1 787.00	28 734.98	0.00
SEK SKF AB SER ' B ' NPV	2 170.00	40 816.22	0.01
SEK SVENSKA CELLULOSE SER ' B ' NPV	3 478.00	51 727.65	0.01
SEK SVENSKA HANDELSBKN SER ' A ' NPV (P/S)	8 854.00	83 987.04	0.01
SEK SWEDBANK AB SER ' A ' NPV	5 006.00	91 890.25	0.01
SEK SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB NPV	1 208.00	28 773.84	0.00
SEK TELE2 AB SHS	2 438.00	19 138.54	0.00
SEK TELIA COMPANY AB NPV	11 740.00	27 896.76	0.00
SEK VOLVO AB SER ' A ' NPV (POST SPLIT)	1 148.00	27 147.48	0.00
SEK VOLVO AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	9 157.00	212 565.33	0.02
SEK VOLVO CAR AB SER ' B ' NPV (WI)	2 274.00	7 415.18	0.00
スウェーデン合計		2 745 966.89	0.28

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル)

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 (%)
スイス			
CHF ABB LTD CHF0.12 (REGD)	9 320.00	372 028.29	0.04
CHF ADECCO GROUP AG CHF0.1 (REGD)	837.00	40 495.19	0.00
CHF ALCON AG CHF0.04	2 934.00	222 424.56	0.02
CHF AVOLTA AG CHF5 (REGD)	556.00	19 521.22	0.00
CHF BACHEM HOLDING AG CHF0.01 (REGD) (SUBD)	179.00	13 380.48	0.00
CHF BALOISE-HLDGS CHF0.1(REGD)	306.00	47 120.23	0.01
CHF BARRY CALLEBAUT AG CHF0.02 (REGD)	22.00	36 862.75	0.00
CHF BKW AG CHF2.5	129.00	22 905.64	0.00
CHF BQE CANT VAUDOISE CHF1	185.00	22 700.82	0.00
CHF CLARIANT CHF4.00(REGD)	1 120.00	16 834.45	0.00
GBP COCA-COLA HBC AG ORD CHF6.70	1 340.00	37 252.35	0.00
EUR DSM FIRMENICH AG EURO.01	1 133.00	107 390.11	0.01
CHF EMS-CHEMIE HLDG AG CHF0.01(REGD)(POST RECON)	51.00	36 392.96	0.00
CHF GEBERIT CHF0.10(REGD)	190.00	106 935.77	0.01
CHF GIVAUDAN AG CHF10	60.00	225 771.95	0.02
GBP GLENCORE XSTRATA ORD USD0.01	65 220.00	364 773.31	0.04
CHF HELVETIA HOLDING CHF0.02 (REGD) POST SUBD	177.00	24 365.36	0.00
CHF HOLCIM LTD CHF2 (REGD)	3 045.00	225 166.47	0.02
CHF JULIUS BAER GRUPPE CHF0.02 (REGD)	1 242.00	63 189.10	0.01
CHF KUEHNE&NAGEL INTL CHF1(REGD)(POST-SUBD)	306.00	89 102.64	0.01
CHF LINDT & SPRUENGLI CHF100(REGD)	1.00	123 052.15	0.01
CHF LINDT & SPRUENGLI PTG CERT CHF10	4.00	49 772.87	0.01
CHF LOGITECH INTL CHF0.25(REGD) (POST-SUBD)	921.00	80 751.01	0.01
CHF LONZA GROUP AG CHF1(REGD)	452.00	175 903.40	0.02
CHF NESTLE SA CHF0.10(REGD)	15 953.00	1 822 702.03	0.19
CHF NOVARTIS AG CHF0.49 (REGD)	12 283.00	1 202 379.35	0.12
CHF PARTNERS GROUP HLG CHF0.01 (REGD)	141.00	186 881.15	0.02
CHF RICHEMONT(CIE FIN) CHF1.00 (REG) SER ‘A’	3 066.00	385 035.02	0.04
CHF ROCHE HLDGS AG CHF1(BR)	181.00	51 996.78	0.01
CHF ROCHE HLDGS AG GENUSSSCHEINE NPV	156.00	1 128 197.11	0.12
CHF SANDOZ GROUP AG CHF0.05	2 295.80	66 031.81	0.01
CHF SCHINDLER-HLDG AG CHF0.1(REGD)(POST-SUBD)	162.00	34 913.23	0.00
CHF SCHINDLER-HLDG AG PTG CERT CHF0.10(POST-SUBD)	246.00	55 378.64	0.01
CHF SGS SA CHF0.04	860.00	73 483.99	0.01
CHF SIG COMBIBLOC GROU CHF0.1	1 768.00	41 559.34	0.00
CHF SIKA AG CHF0.01 (REG)	940.00	256 417.69	0.03
CHF SONOVA HOLDING AG CHF0.05 (REGD)	311.00	90 236.67	0.01
EUR STMICROELECTRONICS EUR1.04	136.00	196 103.27	0.02
CHF STRAUMANN HLDG CHF0.01 (REGD) (POST SPLIT)	632.00	87 399.23	0.01
CHF SWATCH GROUP CHF0.45(REGD)	404.00	20 396.30	0.00
CHF SWATCH GROUP CHF2.25(BR)	196.00	51 730.21	0.01
CHF SWISS LIFE HLDG CHF5.1(REGD)	170.00	109 599.22	0.01
CHF SWISS PRIME SITE CHF15.3 (REGD)	440.00	44 528.78	0.00
CHF SWISS RE AG CHF0.10	1 744.00	207 081.82	0.02
CHF SWISSCOM AG CHF1(REGD)	149.00	87 458.57	0.01
CHF TEMENOS AG CHF5 (REGD)	328.00	27 920.83	0.00
CHF UBS GROUP CHF0.10 (REGD)	19 914.00	564 063.96	0.06
CHF VAT GROUP AG CHF0.10	166.00	77 602.21	0.01
CHF ZURICH INSURANCE GRP CHF0.10	862.00	434 097.87	0.06
スイス合計		9 827 288.16	1.02
イギリス			
GBP 3I GROUP ORD GBP0.738636	6 047.00	170 864.06	0.02
GBP ABRDN PLC ORD GBP0.1396825396	13 422.00	27 687.78	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
GBP ADMIRAL GROUP ORD GBP0.001	1 484.00	50 742.87	0.01
GBP ANGLO AMERICAN USD0.54945	7 594.00	205 923.83	0.02
GBP ANTOFAGASTA ORD GBP0.05	2 178.00	38 835.71	0.00
GBP ASHTEAD GROUP ORD GBP0.10	2 647.00	159 606.68	0.02
GBP ASSOCD BRIT FOODS ORD GBP0.0568	2 002.00	60 268.79	0.01
GBP ASTRAZENECA ORD USD0.25	9 492.00	1 216 780.40	0.13
GBP AUTO TRADER GROUP ORD GBP0.01	5 663.00	51 961.45	0.01
GBP AVIVA ORD GBP0.33	16 448.00	86 933.29	0.01
GBP BAE SYSTEMS ORD GBP0.025	18 610.00	247 372.96	0.03
GBP BARCLAYS ORD GBP0.25	89 359.00	159 550.12	0.02
GBP BARRATT DEVEL ORD GBP0.10	5 315.00	34 571.16	0.00
GBP BERKELEY GP HLDGS ORD GBP0.053943	591.00	34 685.46	0.00
GBP BP ORD USD0.25	105 899.00	642 295.06	0.07
GBP BRIT AMER TOBACCO ORD GBP0.25	12 572.00	399 797.95	0.04
GBP BT GROUP ORD GBP0.05	44 216.00	68 793.57	0.01
GBP BUNZL ORD GBP0.32142857	2 180.00	82 848.33	0.01
GBP BURBERRY GROUP ORD GBP0.0005	2 565.00	47 522.22	0.00
GBP CENTRICA ORD GBP0.061728395	32 138.00	60 641.14	0.01
USD COCA-COLA EUROPACI COM EURO.01	1 147.00	69 554.08	0.01
GBP COMPASS GROUP ORD GBP0.1105	10 178.00	258 083.33	0.03
GBP CRODA INTL ORD GBP0.10609756	864.00	49 045.13	0.00
GBP DIAGEO ORD GBP0.28 101/108	13 851.00	484 570.71	0.05
GBP ENDEAVOUR MINING P ORD USD0.01	920.00	21 418.35	0.00
GBP GSK PLC ORD GBP0.3125	25 277.00	454 199.74	0.05
GBP HALEON PLC ORD GBP1.25	33 319.00	139 215.71	0.01
GBP HALMA ORD GBP0.10	2 345.00	63 261.99	0.01
GBP HARGREAVES LANSDOW ORD GBP0.004 (WI)	1 665.00	15 142.48	0.00
GBP HIKMA PHARMACEUTIC ORD GBP0.10	1 304.00	28 451.52	0.00
GBP HSBC HLDGS ORD USD0.50(UK REG)	121 078.00	922 891.02	0.10
GBP IMPERIAL BRANDS PL GBP0.10	5 322.00	124 405.83	0.01
GBP INFORMA PLC (GB) ORD GBP0.001	8 329.00	78 342.64	0.01
GBP INTERCONTL HOTELS ORD GBP0.208521303	1 050.00	81 296.78	0.01
GBP INTERTEK GROUP ORD GBP0.01	883.00	44 545.68	0.00
GBP JD SPORTS FASHION ORD GBP0.0005	17 216.00	34 228.41	0.00
GBP KINGFISHER ORD GBP0.157142857	12 742.00	35 390.83	0.00
GBP LAND SECURITIES GP ORD GBP0.106666666	3 768.00	29 774.97	0.00
GBP LEGAL & GENERAL GP ORD GBP0.025	38 747.00	112 475.70	0.01
GBP LLOYDS BANKING GP ORD GBP0.1	402 017.00	221 233.36	0.02
GBP LONDON STOCK EXCH ORD GBP0.06918604	2 628.00	296 295.19	0.03
GBP M&G PLC ORD GBP0.05	14 153.00	37 482.35	0.00
GBP MELROSE INDUST PLC ORD GBP0.22857142	8 938.00	58 679.91	0.01
GBP MONDI ORD EURO.20	3 011.00	53 631.68	0.01
GBP NATIONAL GRID ORD GBP0.12431289	22 237.00	289 250.81	0.03
GBP NATWEST GROUP PLC ORD GBP1.0769	34 180.00	89 958.69	0.01
GBP NEXT ORD GBP0.10	709.00	71 176.39	0.01
GBP OCADO GROUP PLC ORD GBP0.02	3 567.00	27 093.86	0.00
GBP PEARSON ORD GBP0.25	3 842.00	45 583.34	0.00
GBP PERSIMMON ORD GBP0.10	1 844.00	29 215.16	0.00
GBP PHOENIX GP HLDGS ORD GBP0.10	3 691.00	21 737.03	0.00
GBP PRUDENTIAL ORD GBP0.05	17 087.00	186 678.01	0.02
GBP RECKITT BENCK GRP ORD GBP0.10	463.00	304 983.48	0.03
GBP RELX PLC GBP0.1444	11 503.00	442 691.57	0.05
GBP RENTOKIL INITIAL ORD GBP0.01	16 345.00	88 706.41	0.01
GBP RIO TINTO ORD GBP0.10	6 950.00	475 023.05	0.05
GBP ROLLS-ROYCE HLDGS ORD GBP0.20	51 983.00	176 891.57	0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル)

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
GBP SAGE GROUP GBP0.01051948	6 041.00	86 456.17	0.01
GBP SAINSBURY(J) ORD GBP0.28571428	9 360.00	33 877.13	0.00
GBP SCHROEDERS PLC ORD GBP0.20	644.00	23 610.35	0.00
GBP SEVERN TRENT ORD GBP0.9789	1 762.00	58 018.01	0.01
GBP SHELL PLC ORD EURO.07	41 195.00	1 335 060.74	0.14
GBP SMITH & NEPHEW ORD USD0.20	5 638.00	73 051.56	0.01
GBP SMITHS GROUP ORD GBP0.375	1 971.00	41 120.69	0.00
GBP SPIRAX-SARCO ENG ORD GBP0.269230769	428.00	50 108.12	0.01
GBP SSE PLC ORD GBP0.50	6 783.00	157 355.66	0.02
GBP ST JAMES ' S PLACE ORD GBP0.15	3 722.00	30 561.16	0.00
GBP STANDARD CHARTERED ORD USD0.50	14 141.00	116 934.55	0.01
GBP TAYLOR WIMPEY ORD GBP0.01	24 350.00	39 934.94	0.00
GBP TESCO ORD GBP0.0633333	42 698.00	154 484.99	0.02
GBP UNILEVER PLC ORD GBP0.031111	5 399.00	257 640.21	0.03
EUR UNILEVER PLC ORD GBP0.031111	9 950.00	474 589.49	0.05
GBP UNITED UTILITIES G ORD GBP0.05	444.00	61 378.37	0.01
GBP VODAFONE GROUP ORD USD0.2095238(POST CONS)	134 812.00	121 735.52	0.01
GBP WHITBREAD ORD GBP0.76797385	1 256.00	49 147.93	0.00
GBP WISE PLC CLS A ORD GBP0.01	228.00	41 791.82	0.00
GBP WPP PLC ORD GBP0.10	6 607.00	59 117.69	0.01
イギリス合計		13 076 264.69	1.36
アメリカ合衆国			
CAD BROOKFIELD RENEWA. CLASS A SUB VOTING SHARES	900.00	23 896.45	0.00
アメリカ合衆国合計		23 896.45	0.00
株式合計		105 163 085.16	10.90
投資信託証券			
アイルランド			
USD STAR COMPASS PLC/UBS DYNMC DIVERSIFIED LTD NOTE DUE 30.09.25	40 070 000.00	69 998 283.00	7.26
アイルランド合計		69 998 283.00	7.26
投資信託証券合計		69 998 283.00	7.26
コモディティ証券			
イギリス			
USD UBS AG/LONDON/UBS ETC CMCI COMPOSITE USD 16-PRP	23 925.00	3 534 320.63	0.37
イギリス合計		3 534 320.63	0.37
コモディティ証券合計		3 534 320.63	0.37
投資信託、クローズド・エンド型			
カナダ			
CAD CANADIAN APARTMENT PROP. REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	400.00	13 638.68	0.00
CAD RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	546.00	7 035.16	0.00
カナダ合計		20 673.84	0.00
シンガポール			
SGD CAPITALAND ASCENDAS REIT- UNITS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26 700.00	56 817.02	0.01
SGD CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST REAL ESTATE INV TRUST	38 535.00	52 550.35	0.00
SGD MAPLETREE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	19 100.00	19 606.62	0.00
シンガポール合計		128 973.99	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

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 SEGRO PLC REIT	6 935.00	71 305.99	0.01
イギリス合計		71 305.99	0.01
投資信託、クローズド・エンド型合計		220 953.82	0.02
財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン 米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 20.04.23-18.04.24	7 480 000.00	7 330 237.01	0.76
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 29.12.22-28.12.23	7 880 000.00	7 848 761.24	0.81
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 23.03.23-21.03.24	8 700 000.00	8 559 671.70	0.89
米ドル合計		23 738 669.95	2.46
財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン合計		23 738 669.95	2.46
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		202 655 312.56	21.01

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% 23.02.23-22.02.24	7 280 000.00	7 191 906.83	0.75
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 26.01.23-25.01.24	7 680 000.00	7 618 008.88	0.79
米ドル合計		14 809 915.71	1.54
財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン合計		14 809 915.71	1.54
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		14 809 915.71	1.54

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

アイルランド			
EUR AMBIENTA X ICAV-AMBIENTA X ALPHA FUND - ACCUM-F- EUR	7 719.89	834 585.89	0.09
EUR KEPLER LIQUID STRATEGIES ICAV - KLS ARETE MACRO FUND-SI- EUR	13 375.35	1 707 699.21	0.18
USD MAN FUNDS VI PLC-MAN AHL TARGETRISK-INU-USD-CAP	117 808.63	16 977 401.81	1.76
EUR MERIAN GLOBAL FUNDS PLC-MER GBL EQ AB RETRN-I-ACC-EUR HDG	768 224.74	1 529 230.35	0.16
USD SOURCE MARKETS PLC - MSCI USA SOURCE ETF-A	298 352.00	38 660 452.16	4.01
EUR TAGES INTERNATIONAL FUNDS ICAV ACCUM SHS INSTIT. FD EUR	9 853.16	1 101 164.10	0.11
USD UBS IRL FND SOLUTIONS PLC-MSCI USA SF INDEX-SHS-A-USD-ACC	1 105 919.00	148 191 597.71	15.36
USD UBS(IRL)FUND SOLUTION PLC-MSCI USA SF UCITS SHS-A-ETF-ACC	591 823.00	76 546 386.82	7.94
アイルランド合計		285 548 518.05	29.61

ルクセンブルグ

EUR ALMA PLATINUM IV UBS MULTI-STRATEGY ALTERNATIVES-I0C-E-CAP	2 674.33	27 665 117.29	2.87
USD AQR UCITS FUNDS - GLOBAL RISK PARITY UCITS FUND-A2-CAP	107 415.70	12 926 405.34	1.34
EUR DB PLATINUM IV SYSTEMATIC ALPHA-SHS I1C-E-CAPITALISATION	9 260.57	1 500 374.32	0.15
USD FOCUSED SICAV - HIGH GRADE BOND USD U-X-ACC	9 674.50	94 587 876.74	9.81
USD FOCUSED SICAV - HIGH GRADE LONG TERM BOND USD U-X-ACC	9 734.00	86 785 326.46	9.00
USD INVESCO FUNDS SICAV BAL RISK ALLOCATION-PII-USD HDG-CAP	726 063.33	9 344 435.08	0.97
EUR LUMY-MWTOP ENV MKT NEU-EURBA UCITS FUND-SHS-B- CAPITALISATION	9 683.34	1 227 632.27	0.13
EUR SCHRODER GAIA WELLINGTON PAGOSA-C-EUR HDG-CAPITALISATION	14 699.36	1 691 096.46	0.17
USD UBS (LUX) BD SICAV-USD INVES GRA CORPOR SUSTAI (USD) F-ACC	611.09	67 279 474.76	6.98
USD UBS (LUX) BOND FUND-EURO HIGH YIELD (EUR)(USD HEDGED) F-ACC	175 792.00	23 366 272.64	2.42
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD (USD) F-ACC	99 656.00	34 907 503.68	3.62
USD UBS (LUX) BOND SICAV - EMERG ECON CORPORATES (USD) F-ACC	273 736.00	31 350 984.08	3.25

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャプ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

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) EMERGING ECONOMIES FUND - GLOBAL BONDS (USD) F-ACC	25 199.00	46 771 611.91	4.85
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD SUSTAINABLE U-X-ACC	2.00	23 962.14	0.00
ルクセンブルグ合計		439 428 073.17	45.56
投資信託、オープン・エンド型合計		724 976 591.22	75.17
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		724 976 591.22	75.17

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派生商品

株式に係るワラント債

カナダ			
CAD CONSTELLATION SOFTWARE INC/CANADA CALL WARRANT 31.03.40	135.00	0.01	0.00
カナダ合計		0.01	0.00
株式に係るワラント債合計		0.01	0.00
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 取引されていない派生商品合計		0.01	0.00
投資有価証券合計		942 441 819.50	97.72

派生商品

公認の証券取引所に上場されている派生商品

債券に係る金融先物

USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 19.03.24	-130.00	-174 687.50	-0.03
USD US LONG BOND FUTURE 19.03.24	-16.00	-27 015.63	0.00
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.03.24	-222.00	-235 875.00	-0.02
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 28.03.24	-155.00	-129 570.39	-0.01
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 28.03.24	-218.00	-180 531.47	-0.02
債券に係る金融先物合計		-747 679.99	-0.08

指数に係る金融先物

EUR EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 15.12.23	1.00	1 614.83	0.00
CHF SWISS MARKET INDEX FUTURE 15.12.23	-1.00	-5 359.09	0.00
GBP FTSE 100 INDEX FUTURE 15.12.23	-1.00	-1 531.80	0.00
SEK OMX 30 INDEX FUTURE 15.12.23	1.00	939.99	0.00
USD MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 15.12.23	837.00	981 685.00	0.10
USD S&P500 EMINI FUTURE 15.12.23	-101.00	-1 770 762.50	-0.18
HKD HANG SENG INDEX FUTURE 28.12.23	1.00	-4 647.71	0.00
AUD SPI 200 INDEX FUTURES 21.12.23	-1.00	-5 204.94	0.00
JPY TOPIX INDX FUTURE 07.12.23	-1.00	-10 180.27	0.00
CAD S&P/TSX 60 IX FUTURE 14.12.23	1.00	395.77	0.00
指数に係る金融先物合計		-809 050.72	-0.08
公認の証券取引所に上場されている派生商品		-1 556 730.71	-0.16

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派生商品

指数に係るスワップおよび先渡しスワップ

USD UBS/CMCI EXCESS RETURN INDEX TRS EQS REC PERF 23-04.04.24	34 394 073.44	-502 610.53	-0.05
USD UBS/CMCI EXCESS RETURN INDEX TRS EQS PAY 0.3800% 23-04.04.24			
指数に係るスワップおよび先渡しスワップ合計		-502 610.53	-0.05
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 取引されていない派生商品合計		-502 610.53	-0.05
派生商品合計		-2 059 341.24	-0.21

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

ーシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル)

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／購入額／売却通貨／売却額／満期日 (日-月-年)			
USD 7 638 807.93	AUD 11 870 000.00	7.12.2023	-232 727.10 -0.02
USD 14 481 869.19	GBP 11 805 086.97	7.12.2023	-463 150.55 -0.05
USD 12 669 121.72	CAD 17 444 313.87	7.12.2023	-197 542.00 -0.02
USD 22 987 656.88	JPY 3 450 795 790.00	7.12.2023	-371 260.67 -0.04
USD 461 079.09	ILS 1 771 382.42	7.12.2023	-14 625.83 0.00
USD 455 693.34	NZD 768 002.21	7.12.2023	-18 667.32 0.00
USD 3 232 825.84	SEK 35 261 705.13	7.12.2023	-132 811.20 -0.01
USD 1 454 584.66	SGD 1 971 038.00	7.12.2023	-22 594.82 0.00
USD 482 398.63	NOK 5 386 807.00	7.12.2023	-17 436.67 0.00
USD 2 379 768.64	DKK 16 600 000.00	7.12.2023	-50 127.15 -0.01
USD 2 780 790.11	HKD 21 721 770.14	7.12.2023	-591.89 0.00
USD 69 558 444.98	EUR 65 121 215.59	7.12.2023	-1 508 119.38 -0.16
USD 10 753 430.74	CHF 9 656 161.42	7.12.2023	-356 724.04 -0.04
AUD 52 098 200.00	USD 33 229 195.78	11.1.2024	1 360 149.34 0.14
SGD 34 642 500.00	USD 25 530 320.23	11.1.2024	475 970.61 0.05
GBP 23 897 300.00	USD 29 409 432.10	11.1.2024	854 058.72 0.09
SEK 15 952 400.00	USD 1 474 576.17	11.1.2024	50 928.10 0.01
CAD 30 819 100.00	USD 22 321 386.21	11.1.2024	424 384.14 0.04
CHF 139 126 900.00	USD 155 326 697.96	11.1.2024	5 408 662.92 0.56
EUR 124 984 200.00	USD 134 314 020.56	11.1.2024	2 308 654.02 0.24
USD 410 597.11	CHF 363 800.00	11.1.2024	-9 706.40 0.00
USD 101 749.35	GBP 81 600.00	11.1.2024	-1 588.72 0.00
USD 487 707.98	EUR 448 200.00	11.1.2024	-2 228.21 0.00
EUR 710 000.00	USD 770 998.94	7.12.2023	3 821.68 0.00
USD 71 423.90	CAD 98 200.00	11.1.2024	-1 051.76 0.00
USD 870 542.24	EUR 800 100.00	11.1.2024	-4 062.73 0.00
GBP 230 000.00	USD 285 987.45	7.12.2023	5 188.26 0.00
EUR 1 700 000.00	USD 1 847 889.12	7.12.2023	7 315.18 0.00
SGD 892 800.00	USD 665 817.99	11.1.2024	411.25 0.00
USD 707 714.57	CHF 623 900.00	11.1.2024	-13 086.31 0.00
GBP 568 900.00	USD 707 651.18	11.1.2024	12 802.59 0.00
CAD 781 400.00	USD 569 611.00	11.1.2024	7 094.52 0.00
AUD 1 403 100.00	USD 913 596.43	11.1.2024	17 958.02 0.00
USD 560 058.61	CHF 492 400.00	11.1.2024	-8 818.38 0.00
USD 40 169.95	SEK 419 300.00	11.1.2024	72.91 0.00
USD 90 972.18	AUD 139 000.00	11.1.2024	-1 313.52 0.00
USD 3 327 606.53	EUR 3 044 500.00	11.1.2024	-395.99 0.00
USD 83 680.54	GBP 66 100.00	11.1.2024	-28.36 0.00
USD 374 374.45	EUR 340 200.00	11.1.2024	2 495.17 0.00
USD 815 474.03	CAD 1 105 400.00	11.1.2024	-356.88 0.00
USD 768 596.08	CHF 666 500.00	11.1.2024	-1 421.21 0.00
CAD 1 900 000.00	USD 1 401 439.35	7.12.2023	-27.91 0.00
JPY 220 000 000.00	USD 1 488 822.33	7.12.2023	388.33 0.00
先渡為替契約合計			7 513 890.76 0.78
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		18 441 405.00*	1.91
当座借越およびその他の短期負債		-655.64	0.00
その他の資産および負債		-1 892 511.35	-0.20
純資産総額		964 444 607.03	100.00

* 2023年11月30日現在、540,000.00米ドルの現金額が取引相手方であるユービーエス・エイ・ジーの担保として使用される。

注記は当財務書類と不可分のものである。

5【販売及び買戻しの実績】

2023年12月末日前1年間ににおける販売および買戻しの実績ならびに2023年12月末日現在の発行済口数は以下のとおりである。

		販売口数	買戻し口数	発行済口数
ダイナミック・インカム (米ドル)	クラスP－ md i s t 投資証券	240,610.498 (211,318.128)	385,778.570 (186,414.317)	2,321,302.397 (1,140,576.701) (注2)
	クラスP－ a c c 投資証券	773.157 (0.000)	98,658.389 (5,685.331)	364,808.068 (130,315.089)
フィクスト・インカム・サステナブル (米ドル)	クラスP－ a c c 投資証券	35,086.205 (35,041.767)	72,656.965 (67,892.370)	121,259.267 (63,842.826)
	クラス (日本円・ ヘッジ) P－a c c 投資証券	18,678.074 (16,510.731)	20,969.095 (20,969.095)	350,518.411 (346,667.152)
インカム・サステナブル (米ドル)	クラスP－ a c c 投資証券	73,595.223 (0.000)	91,369.869 (1,760.000)	485,723.361 (8,990.000)
	クラス (日本円・ ヘッジ) P－a c c 投資証券	0 (0)	0 (0)	0 (0)
システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ (米ドル)	クラスP－ a c c 投資証券	14,680.543 (2,040.578)	930,088.443 (7,016.014)	1,061,436.661 (42,666.628)
システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル)	クラスP－ a c c 投資証券	81,155.004 (405.325)	1,232,598.994 (20,628.358)	2,121,206.387 (221,900.802) (注3)
システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)	クラスP－ a c c 投資証券	3,356.674 (0.000)	442,942.772 (6,257.050)	741,871.558 (29,645.833)

(注1) () 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。

(注2) ダイナミック・インカム (米ドル) クラスP－md i s t 投資証券の2023年12月末日現在の本邦内の発行済口数は、20,877.950口の他社への出庫分を引いた口数を表示している。本邦内において販売会社に外国証券取引口座約款に基づき保管を委託しているファンド証券以外の口数は含まれていない。

(注3) システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル) クラスP－a c c 投資証券の2023年12月末日現在の本邦内の発行済口数は、3,985.254口の他社への出庫分を引いた口数を表示している。本邦内において販売会社に外国証券取引口座約款に基づき保管を委託しているファンド証券以外の口数は含まれていない。