

## 【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28期中(自 2023年6月1日 至 2023年11月30日)
【発行者名】	UBS (Lux) ボンド・シキャブ (UBS (Lux) Bond SICAV)
【代表者の役職氏名】	チェアマン・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ ロバート・スティンガー (Robert Süttinger) メンバー・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ イオアナ・ナウム (Ioana Naum)
【本店の所在の場所】	ルクセンブルグ大公国、ルクセンブルグL - 1855、 J.F.ケネディ通り33A (33A avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg, Grand Duchy of Luxembourg)
【代理人の氏名又は名称】	弁護士 三 浦 健 同 大 西 信 治
【代理人の住所又は所在地】	東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング 森・濱田松本法律事務所
【事務連絡者氏名】	弁護士 三 浦 健 同 大 西 信 治
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング 森・濱田松本法律事務所
【電話番号】	03 (6212) 8316
【縦覧に供する場所】	該当事項なし

(注1) 米ドルの円貨換算は、便宜上、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のため、以下の金額表示は別段の記載がない限り米ドルをもって行う。

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

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

(注5) 本書は、EDINETコード「G07316」(UBS (Lux) ボンド・シキャブ・コーポレート・ボンド(米ドル)/ハイ・イールド・ボンド(米ドル))と「G14742」(UBS (Lux) ボンド・シキャブ・ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)クラスP - a c c 投資証券/ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)クラスP - m d i s t 投資証券)を統合したものである。

## 1【外国投資法人の概況】

UBS (Lux) ボンド・シキャブ - コーポレート・ボンド (米ドル) / ハイ・イールド・ボンド (米ドル) / ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル (米ドル) (UBS (Lux) Bond SICAV - USD Corporates (USD) / USD High Yield (USD) / Short Term USD Corporates Sustainable (USD)) (以下、UBS (Lux) ボンド・シキャブを「本投資法人」、UBS (Lux) ボンド・シキャブ - コーポレート・ボンド (米ドル) / ハイ・イールド・ボンド (米ドル) / ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル (米ドル) をそれぞれ「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 投資証券およびクラスP - m d i s t 投資証券以外の投資証券も存在し、その内ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル (米ドル) についてはクラスF - a c c 投資証券も日本で販売されているが、以下、ファンドについて「投資証券」というときは、上記のクラスP - a c c 投資証券およびクラスP - m d i s t 投資証券を指すものとする。

## (1)【主要な経営指標等の推移】

## コーポレート・ボンド (米ドル)

(別段の記載がない限り金額は米ドル)

	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 <sup>(1)</sup>	6,516,919.63	-26,071,817.80	-10,315,778.38	-4,221,089.64	5,268,083.22
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	6,516,919.63	-26,071,817.80	-10,315,778.38	-4,221,089.64	5,268,083.22
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	6,516,919.63	-26,071,817.80	-10,315,778.38	-4,221,089.64	5,268,083.22
(d) 出資総額 <sup>(2)</sup>	314,444,853.10	216,964,860.07	194,483,904.75	242,302,312.93	295,980,635.49
(e) 発行済投資口総数 (クラスP - a c c 投資証券)	4,347,420.533口	3,518,417.388口	3,426,404.299口	3,875,002.907口	5,710,196.182口
(f) 純資産額	314,444,853.10	216,964,860.07	194,483,904.75	242,302,312.93	295,980,635.49
(g) 資産総額	317,321,042.62	217,332,853.67	196,886,688.12	246,023,211.49	301,947,192.31
(h) 1口当たり純資産価格 (クラスP - a c c 投資証券)	21.62	19.02	18.12	18.56	18.80
(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)	0.36	-2.23	-0.91	-0.20	0.18
(j) 分配総額	203,566.53	256,777.54	33,446.60	69,277.45	88,805.10
(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	99.09%	99.83%	98.78%	98.49%	98.02%
(m) 自己資本利益率 <sup>(3)</sup> (クラスP - a c c 投資証券)	-1.73%	-10.66%	-16.19%	-2.42%	3.75%

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

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

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

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

## ハイ・イールド・ボンド(米ドル)

(別段の記載がない限り金額は米ドル)

	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 <sup>(1)</sup>	10,753,614.01	- 31,127,292.55	- 24,873,939.63	- 13,007,820.43	29,598,255.69
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	10,753,614.01	- 31,127,292.55	- 24,873,939.63	- 13,007,820.43	29,598,255.69
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	10,753,614.01	- 31,127,292.55	- 24,873,939.63	- 13,007,820.43	29,598,255.69
(d) 出資総額 <sup>(2)</sup>	716,257,416.60	617,826,495.66	498,495,263.71	508,295,783.84	520,392,099.53
(e) 発行済投資口総数 (クラスP-a c c 投資証券)	214,707.906口	200,848.696口	188,772.855口	179,658.969口	170,163.918口
(f) 純資産額	716,257,416.60	617,826,495.66	498,495,263.71	508,295,783.84	520,392,099.53
(g) 資産総額	718,723,339.66	641,822,154.75	501,611,398.84	511,638,860.17	530,948,057.44
(h) 1口当たり純資産価格 (クラスP-a c c 投資証券)	331.68	312.83	301.43	307.44	322.95
(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)	0.73	- 17.90	- 12.54	- 6.85	15.79
(j) 分配総額	4,145,814.63	7,975,339.46	3,838,506.92	6,583,850.93	3,817,409.51
(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	99.66%	96.26%	99.38%	99.35%	98.01%
(m) 自己資本利益率 <sup>(3)</sup> (クラスP-a c c 投資証券)	3.20%	- 5.38%	- 9.12%	- 1.72%	7.14%

## ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)

(別段の記載がない限り金額は米ドル)

	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 <sup>(1)</sup>	- 40,748,942.58	- 89,971,191.63	- 24,112,187.12	2,080,212.91	22,224,028.48
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	- 40,748,942.58	- 89,971,191.63	- 24,112,187.12	2,080,212.91	22,224,028.48
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	- 40,748,942.58	- 89,971,191.63	- 24,112,187.12	2,080,212.91	22,224,028.48
(d) 出資総額 <sup>(2)</sup>	898,920,108.58	700,977,615.75	665,956,437.30	725,107,713.82	685,917,635.16
(e) 発行済投資口総数 (クラスP - a c c 投資証券)	400,564.712口	390,075.573口	308,654.889口	417,962.370口	910,648.279口
(e) 発行済投資口総数 (クラスP - m d i s t 投資証券)	-	-	-	118,150.373口	153,525.799口
(f) 純資産額	898,920,108.58	700,977,615.75	665,956,437.30	725,107,713.82	685,917,635.16
(g) 資産総額	903,662,508.86	701,839,173.00	670,524,547.78	740,346,078.62	694,533,654.29
(h) 1口当たり純資産価格 (クラスP - a c c 投資証券)	148.67	143.95	141.75	144.67	147.86
(h) 1口当たり純資産価格 (クラスP - m d i s t 投資証券)	-	-	-	100.08	100.76
(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)	- 1.16	- 6.00	- 2.81	0.12	3.07
(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)	-	-	-	0.82	2.12
(j) 分配総額	47,033.90	69,214.26	19,577.40	131,987.07	245,370.70
(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
(k) 1口当たり分配金額 (クラスP - m d i s t 投資証券)	-	-	-	1.00	1.4975
(l) 自己資本比率	99.48%	99.88%	99.32%	97.94%	98.76%
(m) 自己資本利益率 <sup>(3)</sup> (クラスP - a c c 投資証券)	- 0.33%	- 3.92%	- 4.65%	0.50%	4.31%
(m) 自己資本利益率 <sup>(3)</sup> (クラスP - m d i s t 投資証券)	-	-	-	1.08%	3.26%

(注) ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)のクラスP - m d i s t 投資証券は、2023年1月9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	
	千米ドル	百万円	(口)	
コーポレート・ボンド(米ドル)	325,988.94	46,235	クラスP - a c c 投資証券	5,960,971.527
ハイ・イールド・ボンド(米ドル)	539,630.69	76,536	クラスP - a c c 投資証券	170,201.267
ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)	693,906.48	98,417	クラスP - a c c 投資証券	908,211.563
			クラスP - m d i s t 投資証券	153,525.799

## (3) 【主要な投資主の状況】

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

## (4) 【役員の状況】

(2023年12月末日現在)

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

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

## (5) 【その他】

## a. 定款の変更

本投資法人の定款は、1915年8月10日の商事会社に関する法律(改正済)(以下「1915年8月10日法」という。)に基づき、本投資法人の臨時投資主総会の決議により変更することができる。

## b. 事業譲渡または事業譲受

投資法人およびそのサブ・ファンドの解散、サブ・ファンドの合併

本投資法人およびそのサブ・ファンドの解散

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

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

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

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

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

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

「合併」とは、以下の取引である。

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

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

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

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

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

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

#### 本投資法人の総会または関係するサブ・ファンドの投資主総会

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

- c. 出資の状況その他の重要事項

該当事項なし。

- d. 訴訟事件その他の重要事項

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

## 2【外国投資法人の運用状況】

## (1)【投資状況】

資産別および地域別の投資状況

コーポレート・ボンド(米ドル)

(2023年12月末日現在)

資産の種類	国名	時価合計(米ドル)	投資比率(%)
債券	アメリカ合衆国	250,718,781.07	74.79
	英国	14,779,406.89	4.41
	オーストラリア	11,561,090.54	3.45
	スペイン	6,359,259.70	1.90
	アイルランド	5,726,401.39	1.71
	オランダ	4,694,325.29	1.40
	フランス	3,701,930.87	1.10
	カナダ	3,570,534.61	1.07
	ドイツ	3,417,867.70	1.02
	シンガポール	2,807,728.00	0.84
	ノルウェー	2,599,129.42	0.78
	スウェーデン	2,039,522.06	0.61
	多国籍	1,543,920.00	0.46
	日本	1,529,353.45	0.46
	デンマーク	1,007,089.48	0.30
	バミューダ	976,440.00	0.29
	小計	317,032,780.47	94.57
投資信託	ルクセンブルグ	971,188.20	0.29
	小計	971,188.20	0.29
ポートフォリオ合計		318,003,968.67	94.86
現金・その他資産(負債控除後)		17,228,477.35	5.14
資産総額		335,232,446.02	100.00
負債総額		9,243,506.88	2.76
合計(純資産総額)		325,988,939.14 (約46,235百万円)	97.24

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

## ハイ・イールド・ボンド(米ドル)

(2023年12月末日現在)

資産の種類	国名	時価合計(米ドル)	投資比率(%)
債券	アメリカ合衆国	377,590,728.27	68.46
	英国	18,939,903.14	3.43
	カナダ	18,821,773.37	3.41
	オランダ	17,610,068.13	3.19
	フランス	12,119,084.60	2.20
	ルクセンブルグ	11,271,332.95	2.04
	バミューダ	9,114,772.66	1.65
	ドイツ	7,284,294.72	1.32
	ケイマン諸島	7,117,748.32	1.29
	イタリア	6,484,454.21	1.18
	リベリア	5,292,638.81	0.96
	アイルランド	3,829,390.12	0.69
	多国籍	3,785,528.86	0.69
	オーストラリア	3,071,786.92	0.56
	ジブラルタル	2,855,796.42	0.52
	パナマ	1,725,804.00	0.31
	ジャージー	1,012,964.26	0.18
	イスラエル	984,352.24	0.18
	香港	393,750.00	0.07
	小計	509,306,172.00	92.35
短期金融商品	アメリカ合衆国	9,753,771.03	1.77
	小計	9,753,771.03	1.77
投資信託	アメリカ合衆国	93.24	0.00
	小計	93.24	0.00
ポートフォリオ合計		519,060,036.27	94.12
現金・その他資産(負債控除後)		32,452,556.67	5.88
資産総額		551,512,592.94	100.00
負債総額		11,881,898.67	2.15
合計(純資産総額)		539,630,694.27 (約76,536百万円)	97.85

## ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)

(2023年12月末日現在)

資産の種類	国名	時価合計(米ドル)	投資比率(%)
債券	アメリカ合衆国	310,550,510.82	44.68
	英国	71,000,883.36	10.22
	オーストラリア	37,813,513.32	5.44
	フランス	36,164,676.18	5.20
	オランダ	26,293,467.71	3.78
	カナダ	21,087,177.46	3.03
	スペイン	18,897,777.56	2.72
	スイス	13,668,174.86	1.97
	アイルランド	13,642,550.99	1.96
	日本	11,313,021.60	1.63
	ドイツ	10,464,643.12	1.51
	ケイマン諸島	9,915,096.80	1.43
	スウェーデン	9,599,661.38	1.38
	フィンランド	5,929,503.65	0.85
	イタリア	5,864,628.89	0.84
	デンマーク	5,862,790.74	0.84
	ニュージーランド	5,693,335.22	0.82
	シンガポール	5,648,672.94	0.81
	香港	5,490,907.48	0.79
	中国	5,417,434.00	0.78
	多国籍	4,436,486.72	0.64
	アラブ首長国連邦	3,156,656.25	0.45
	英領ヴァージン諸島	2,785,650.00	0.40
	ルクセンブルグ	2,626,299.01	0.38
	ノルウェー	2,375,433.44	0.34
	オーストリア	2,181,308.16	0.31
	大韓民国	1,966,860.00	0.28
	ジャージー	1,256,926.23	0.18
	ウズベキスタン	966,360.00	0.14
	インドネシア	883,110.00	0.13
バミューダ	571,217.40	0.08	
小計	653,524,735.29	94.03	
投資信託	ルクセンブルグ	8,991,520.00	1.29
	アイルランド	1,000,000.00	0.14
	小計	9,991,520.00	1.44
短期金融商品	アメリカ合衆国	7,958,937.20	1.15
	小計	7,958,937.20	1.15

モーゲージ担保証券、 アセット・バック証券、 その他ディスカウント債	アメリカ合衆国	5,793,814.47	0.83
	小計	5,793,814.47	0.83
ポートフォリオ合計		677,269,006.96	97.45
現金・その他資産(負債控除後)		17,755,025.58	2.55
資産総額		695,024,032.54	100.00
負債総額		1,117,550.73	0.16
合計(純資産総額)		693,906,481.81 (約98,417百万円)	99.84

## (2) 【運用実績】

## 【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。

## コーポレート・ボンド(米ドル)

	資産総額		純資産総額		1口当たり 純資産価格 (クラスP - a c c 投資証券)	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円
2023年1月末日	206,212.00	29,247	203,359.77	28,843	18.77	2,662
2月末日	204,275.98	28,972	196,685.08	27,896	18.17	2,577
3月末日	234,042.36	33,194	231,778.17	32,873	18.69	2,651
4月末日	243,232.97	34,498	242,409.13	34,381	18.81	2,668
5月末日	246,023.21	34,893	242,302.31	34,366	18.56	2,632
6月末日	266,969.26	37,864	262,881.37	37,284	18.65	2,645
7月末日	272,256.87	38,614	266,549.66	37,805	18.74	2,658
8月末日	275,915.48	39,133	274,795.57	38,974	18.58	2,635
9月末日	269,806.65	38,267	269,302.81	38,195	18.08	2,564
10月末日	271,210.61	38,466	270,408.89	38,352	17.72	2,513
11月末日	301,947.19	42,825	295,980.64	41,979	18.80	2,666
12月末日	335,232.45	47,546	325,988.94	46,235	19.59	2,778

## ハイ・イールド・ボンド(米ドル)

	資産総額		純資産総額		1口当たり 純資産価格 (クラスP - a c c 投資証券)	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円
2023年1月末日	539,934.40	76,579	534,155.89	75,759	310.37	44,020
2月末日	525,429.09	74,522	525,067.07	74,470	304.91	43,245
3月末日	486,708.40	69,030	486,115.71	68,946	307.76	43,650
4月末日	523,188.41	74,204	520,225.77	73,784	310.70	44,067
5月末日	511,638.86	72,566	508,295.78	72,092	307.44	43,604
6月末日	539,148.82	76,467	536,516.66	76,094	311.43	44,170
7月末日	549,720.09	77,967	545,236.98	77,331	315.34	44,725
8月末日	538,344.22	76,353	530,902.67	75,298	316.22	44,849
9月末日	509,133.23	72,210	502,542.50	71,276	312.17	44,275
10月末日	495,213.21	70,236	486,914.59	69,059	308.11	43,699
11月末日	530,948.06	75,304	520,392.10	73,807	322.95	45,804
12月末日	551,512.59	78,221	539,630.69	76,536	334.32	47,417

## ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)

	資産総額		純資産総額		1口当たり 純資産価格 (クラスP - a c c 投資証券)		1口当たり 純資産価格 (クラスP - m d i s t 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	691,318.72	98,050	688,267.92	97,617	143.90	20,409	100.56	14,262
2月末日	682,843.89	96,848	681,530.31	96,661	142.92	20,270	99.61	14,128
3月末日	694,808.26	98,545	693,696.78	98,387	144.08	20,435	100.17	14,207
4月末日	723,915.11	102,673	712,855.24	101,104	144.83	20,541	100.43	14,244
5月末日	740,346.08	105,003	725,107.71	102,842	144.67	20,519	100.08	14,194
6月末日	764,536.39	108,434	758,955.51	107,643	144.32	20,469	99.58	14,123
7月末日	710,268.52	100,737	674,048.77	95,600	145.14	20,585	99.90	14,169
8月末日	629,963.05	89,348	628,552.49	89,148	145.57	20,646	99.94	14,174
9月末日	704,605.09	99,934	702,211.55	99,595	145.42	20,625	99.59	14,125
10月末日	693,615.15	98,375	691,503.89	98,076	145.69	20,663	99.53	14,116
11月末日	694,533.65	98,506	685,917.64	97,284	147.86	20,971	100.76	14,291
12月末日	695,024.03	98,575	693,906.48	98,417	149.75	21,239	101.79	14,437

各サブ・ファンドの投資証券は、ルクセンブルグ証券取引所に上場されている。

同取引所での実質的な取引実績はない。

【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。

コーポレート・ボンド(米ドル)(クラスP - a c c 投資証券)

該当事項なし

ハイ・イールド・ボンド(米ドル)(クラスP - a c c 投資証券)

該当事項なし

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

該当事項なし

ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)(クラスP - m d 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	0.25	35
2月	0.25	35
3月	0.25	35
4月	0.25	35
5月	0.25	35
6月	0.25	35
7月	0.2498	35
8月	0.2499	35
9月	0.2490	35
10月	0.2488	35
11月	0.2519	36
12月	0.2545	36

(注) 各月の分配金は、各月末までに宣言された金額である。

【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	
	コーポレート・ボンド(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券
ハイ・イールド・ボンド(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	11.74%
ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	5.27%
	クラスP - m d i s t 投資証券	4.54%

(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(分配落の額)

ただし、ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)(クラスP - m d i s t 投資証券)については、1口当たり当初発行価格(100.00米ドル)

**(3) 【投資リスク】**

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。

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

## 3【資産運用会社の概況】

## (1)【名称及び資本金の額】

## A. 管理会社

## a) 名称

UBSファンド・マネジメント(ルクセンブルグ)エス・エイ

## b) 資本金(株主資本)の額

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。

## B. 投資運用会社

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

## a) 名称

UBSアセット・マネジメント(アメリカス)インク(シカゴ)

## b) 資本金の額

2023年12月末日現在の資本金額は、10,167,022米ドル(約14億円)

ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)の投資運用会社

## a) 名称

UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)

## b) 資本金の額

2023年12月末日現在の資本金額は、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。

## (2)【大株主の状況】

## A. 管理会社

UBSファンド・マネジメント(ルクセンブルグ)エス・エイ

(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・シュトラセ45、 CH - 8001 チューリッヒ、スイス	6,869	100

## B. 投資運用会社

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

UBSアセット・マネジメント(アメリカス)インク(シカゴ)

(2023年12月末日現在)

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

ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)の投資運用会社

UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)

(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) 【役員の状況】

## A. 管理会社

UBSファンド・マネジメント(ルクセンブルグ)エス・エイ

(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

## B. 投資運用会社

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

UBSアセット・マネジメント(アメリカス)インク(シカゴ)

(2023年12月末日現在)

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

ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)の投資運用会社

UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)

(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

## (4)【事業の内容及び営業の概況】

## A. 管理会社

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

管理会社は、本投資法人の所在地事務代行会社としても行為している。

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			

## B. 投資運用会社

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

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

UBS グローバル・アセット・マネジメント(アメリカス)インク(シカゴ)

2023年12月末日現在、UBSアセット・マネジメント(アメリカス)インク(シカゴ)は57本のサブ・ファンドを運用しており、そのうち運用資産額上位10位のサブ・ファンドは、以下のとおりである。

	名称	基本的性格	設定日	純資産総額 (ユーロ)
1	UBS(Lux)Real Estate Funds Selection - Global	変動資本を有する 投資法人	2008年6月30日	6,817,273,585
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	Focused Fund - Corporate Bond Sustainable USD	契約型投資信託	2003年9月9日	2,149,769,128

7	UBS(Lux)Equity Sicav - USA Growth(USD)	変動資本を有する投資法人	2004年10月8日	1,835,137,265
8	UBS(Lux)Bond Sicav - USD Investment Grade Corporates Sustainable (USD)	変動資本を有する投資法人	2017年1月30日	1,586,670,080
9	Focused Sicav - US Corporate Bond Sustainable USD	変動資本を有する投資法人	2016年11月7日	1,369,129,292
10	Multi Manager Access II - Sustainable Investing Balanced	変動資本を有する投資法人	2018年9月24日	1,054,811,649

(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。

ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)の投資運用会社

UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)

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。

#### 4【外国投資法人の経理状況】

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

連結純資産計算書	米ドル	千円
資産	2023年11月30日	2023年11月30日
投資有価証券、取得原価	15,374,199,295.34	2,180,522,686
投資有価証券、未実現評価益(評価損)	-1,440,694,444.98	-204,333,693
投資有価証券合計(注1)	13,933,504,850.36	1,976,188,993
現金性銀行預金、要求払預金 および預金勘定	354,219,188.15 *	50,238,907
その他当座資産(証拠金)	41,811,218.08	5,930,085
有価証券売却に係る未収金(注1)	42,306,866.34	6,000,383
発行に係る未収金	16,687,800.92	2,366,831
有価証券に係る未収利息	130,753,507.90	18,544,770
当座資産に係る未収利息	15,566.16	2,208
スワップに係る未収利息(注1)	458,824.94	65,075
配当金に係る未収金	3,400.00	482
その他の資産	78,738.15	11,167
その他未収金	2,746,027.24	389,469
金融先物に係る未実現利益(注1)	2,861,090.58	405,788
外国為替先物予約に係る 未実現利益(注1)	82,518,367.97	11,703,580
スワップに係る未実現利益(注1)	22,688,863.67	3,217,962
資産合計	14,630,654,310.46	2,075,065,701
負債		
金融先物に係る未実現損失(注1)	-3,883,247.96	-550,761
外国為替先物予約に係る 未実現損失(注1)	-1,264,766.32	-179,382
スワップに係る未実現損失(注1)	-1,359,493.46	-192,817
当座借越	-23,163,965.60	-3,285,345
その他短期負債(証拠金)	-56,908.05	-8,071
当座借越に係る未払利息	-94,932.88	-13,464
有価証券購入に係る未払金(注1)	-82,821,342.58	-11,746,551
未払買戻代金	-67,401,371.19	-9,559,536
定率報酬引当金(注2)	-4,763,567.34	-675,617
年次税引当金(注3)	-537,968.27	-76,300
その他の手数料および報酬に係る 引当金(注2)	-167,653.32	-23,778
引当金合計	-5,469,188.93	-775,695
負債合計	-185,515,216.97	-26,311,623
期末純資産	14,445,139,093.49	2,048,754,078

\* 2023年11月30日現在、当該現金額は取引の相手方のために担保に供されており、バンク・オブ・アメリカについては70,000.00米ドルおよびHSBC銀行については832,000.00米ドルである。

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ

連結運用計算書	米ドル	千円
	2023年6月1日 - 2023年11月30日	2023年6月1日 - 2023年11月30日
収益		
当座資産に係る利息	9,093,750.76	1,289,767
有価証券利息	244,921,458.74	34,737,210
配当金	1,658,614.59	235,241
スワップに係る受取利息 (注1)	39,348,266.19	5,580,765
貸付証券に係る純収益 (注12)	2,378,658.70	337,365
その他収益 (注4)	7,394,464.86	1,048,757
収益合計	304,795,213.84	43,229,105
費用		
スワップに係る支払利息 (注1)	-50,522,234.98	-7,165,569
定率報酬 (注2)	-31,957,538.89	-4,532,538
年次税 (注3)	-1,689,010.91	-239,552
その他の手数料および報酬 (注2)	-1,199,381.54	-170,108
現金および当座借越に係る利息	-1,287,279.86	-182,575
費用合計	-86,655,446.18	-12,290,342
投資純利益 (損失)	218,139,767.66	30,938,763
実現利益 (損失) (注1)		
オプションなしの時価評価証券に係る実現利益 (損失)	-415,968,254.61	-58,996,778
オプションに係る実現利益 (損失)	-646,706.25	-91,722
利回り評価証券および金融市場商品に係る実現利益 (損失)	1,688,983.05	239,548
金融先物に係る実現利益 (損失)	-1,382,687.25	-196,107
外国為替先物予約に係る実現利益 (損失)	-97,863,774.98	-13,880,019
スワップに係る実現利益 (損失)	-5,632,641.06	-798,877
外国為替に係る実現利益 (損失)	-12,027,185.17	-1,705,816
実現利益 (損失) 合計	-531,832,266.27	-75,429,770
当期実現純利益 (損失)	-313,692,498.61	-44,491,007
未実現評価益 (評価損) の変動 (注1)		
オプションなしの時価評価証券に係る未実現評価益 (評価損)	508,878,235.26	72,174,200
オプションに係る未実現評価益 (評価損)	-31,411.89	-4,455
利回り評価証券および金融市場商品に係る未実現評価益 (評価損)	12,329,413.04	1,748,681
金融先物に係る未実現評価益 (評価損)	5,430,497.37	770,207
外国為替先物予約に係る未実現評価益 (評価損)	198,608,830.42	28,168,690
スワップに係る未実現評価益 (評価損)	27,865,154.05	3,952,115
未実現評価益 (評価損) の変動合計	753,080,718.25	106,809,438
運用活動による純資産の純増加 (減少)	439,388,219.64	62,318,431

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ

連結純資産変動計算書	米ドル	千円
	2023年6月1日 - 2023年11月30日	2023年6月1日 - 2023年11月30日
期首純資産	16,264,253,401.66 *	2,306,759,060
発行額	1,428,622,716.81	202,621,560
買戻額	-3,609,372,207.68	-511,917,260
合計純発行額(買戻額)	-2,180,749,490.87	-309,295,700
支払配当金	-77,753,036.94	-11,027,713
投資純収益(損失)	218,139,767.66	30,938,763
実現利益(損失)合計	-531,832,266.27	-75,429,770
未実現評価益(評価損)の変動合計	753,080,718.25	106,809,438
運用活動による純資産の純増加(減少)	439,388,219.64	62,318,431
期末純資産	14,445,139,093.49	2,048,754,078

\* 2023年11月30日現在の為替レートを使用して計算された。2023年5月31日現在の為替レートを使用した場合、期首連結純資産は16,109,901,840.52米ドルであった。

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ - ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)

純資産計算書	米ドル	千円
資産	2023年11月30日	2023年11月30日
投資有価証券、取得原価	690,006,898.33	97,863,678
投資有価証券、未実現評価益(評価損)	-17,462,884.41	-2,476,761
投資有価証券合計(注1)	672,544,013.92	95,386,917
現金性銀行預金、要求払預金 および預金勘定	11,895,691.78	1,687,166
その他当座資産(証拠金)	324,204.75	45,982
有価証券売却に係る未収金(注1)	991,044.46	140,560
発行に係る未収金	363,695.26	51,583
有価証券に係る未収利息	6,723,758.84	953,631
当座資産に係る未収利息	8.65	1
金融先物に係る未実現利益(注1)	401,953.65	57,009
外国為替先物予約に係る 未実現利益(注1)	1,289,282.98	182,859
資産合計	694,533,654.29	98,505,708
負債		
有価証券購入に係る未払金(注1)	-3,449,568.81	-489,252
未払買戻代金	-4,956,984.09	-703,049
定率報酬引当金(注2)	-171,195.43	-24,281
年次税引当金(注3)	-24,833.82	-3,522
その他の手数料および報酬に係る 引当金(注2)	-13,436.98	-1,906
引当金合計	-209,466.23	-29,709
負債合計	-8,616,019.13	-1,222,010
期末純資産	685,917,635.16	97,283,698

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ - ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)

運用計算書	米ドル	千円
収益	2023年6月1日 - 2023年11月30日	2023年6月1日 - 2023年11月30日
当座資産に係る利息	222,549.37	31,564
有価証券利息	12,217,888.39	1,732,863
配当金	27,023.71	3,833
貸付証券に係る純収益(注12)	73,750.26	10,460
その他収益(注4)	360,441.94	51,121
収益合計	12,901,653.67	1,829,842
費用		
定率報酬(注2)	-963,562.11	-136,662
年次税(注3)	-66,710.26	-9,462
その他の手数料および報酬(注2)	-35,851.35	-5,085
現金および当座借越に係る利息	-7,873.54	-1,117
費用合計	-1,073,997.26	-152,325
投資純利益(損失)	11,827,656.41	1,677,517
実現利益(損失)(注1)		
オプションなしの時価評価証券に係る 実現利益(損失)	-9,579,548.35	-1,358,667
利回り評価証券および金融市場商品に係る 実現利益(損失)	46,722.08	6,627
金融先物に係る実現利益(損失)	-1,436,780.61	-203,779
外国為替先物予約に係る実現利益(損失)	-6,117,229.61	-867,607
外国為替に係る実現利益(損失)	-4,520,549.22	-641,149
実現利益(損失)合計	-21,607,385.71	-3,064,576
当期実現純利益(損失)	-9,779,729.30	-1,387,059
未実現評価益(評価損)の変動(注1)		
オプションなしの時価評価証券に係る 未実現評価益(評価損)	15,613,003.80	2,214,392
利回り評価証券および金融市場商品に係る 未実現評価益(評価損)	383,774.39	54,431
金融先物に係る未実現評価益(評価損)	418,358.85	59,336
外国為替先物予約に係る未実現評価益 (評価損)	15,588,620.74	2,210,934
未実現評価益(評価損)の変動合計	32,003,757.78	4,539,093
運用活動による純資産の純増加(減少)	22,224,028.48	3,152,034

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ - ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)

純資産変動計算書	米ドル		千円	
	2023年6月1日 - 2023年11月30日		2023年6月1日 - 2023年11月30日	
期首純資産	725,107,713.82		102,842,027	
発行額	276,158,279.75		39,167,529	
買戻額	-337,327,016.19		-47,843,091	
合計純発行額(買戻額)	-61,168,736.44		-8,675,562	
支払配当金	-245,370.70		-34,801	
投資純収益(損失)	11,827,656.41		1,677,517	
実現利益(損失)合計	-21,607,385.71		-3,064,576	
未実現評価益(評価損)の変動合計	32,003,757.78		4,539,093	
運用活動による純資産の純増加(減少)	22,224,028.48		3,152,034	
期末純資産	685,917,635.16		97,283,698	

## 発行済投資証券口数の変動

2023年6月1日 - 2023年11月30日

クラス	P-acc
期首発行済口数	417,962.3700
発行口数	763,219.8660
買戻口数	-270,533.9570
期末発行済口数	910,648.2790

クラス	P-mdist
期首発行済口数	118,150.3730
発行口数	47,004.0620
買戻口数	-11,628.6360
期末発行済口数	153,525.7990

月次分配金<sup>1</sup>

UBS (Lux) ボンド・シキャブ - ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)

	権利落ち日	支払日	通貨	1口当たり金額
P-mdist	2023年6月15日	2023年6月20日	米ドル	0.25
P-mdist	2023年7月17日	2023年7月20日	米ドル	0.25
P-mdist	2023年8月16日	2023年8月21日	米ドル	0.2498
P-mdist	2023年9月15日	2023年9月20日	米ドル	0.2499
P-mdist	2023年10月16日	2023年10月19日	米ドル	0.2490
P-mdist	2023年11月15日	2023年11月20日	米ドル	0.2488

<sup>1</sup> 注記5参照

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ - コーポレート・ボンド(米ドル)

純資産計算書	米ドル	千円
資産	2023年11月30日	2023年11月30日
投資有価証券、取得原価	293,446,047.29	41,619,453
投資有価証券、未実現評価益(評価損)	-9,333,027.84	-1,323,703
投資有価証券合計(注1)	284,113,019.45	40,295,750
現金性銀行預金、要求払預金 および預金勘定	10,494,922.37	1,488,495
その他当座資産(証拠金)	172,047.33	24,401
発行に係る未収金	3,456,920.64	490,295
有価証券に係る未収利息	3,247,646.16	460,614
その他の資産	6,369.99	903
外国為替先物予約に係る 未実現利益(注1)	456,266.37	64,712
資産合計	301,947,192.31	42,825,170
負債		
金融先物に係る未実現損失(注1)	-31,429.43	-4,458
有価証券購入に係る未払金(注1)	-5,687,529.14	-806,662
未払買戻代金	-68,768.41	-9,753
定率報酬引当金(注2)	-158,484.82	-22,478
年次税引当金(注3)	-20,345.02	-2,886
引当金合計	-178,829.84	-25,363
負債合計	-5,966,556.82	-846,237
期末純資産	295,980,635.49	41,978,934

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ - コーポレート・ボンド(米ドル)

運用計算書	米ドル	千円
	2023年6月1日 - 2023年11月30日	2023年6月1日 - 2023年11月30日
収益		
当座資産に係る利息	128,071.95	18,164
有価証券利息	6,414,583.47	909,780
貸付証券に係る純収益(注12)	8,526.32	1,209
その他収益(注4)	233,700.82	33,146
収益合計	6,784,882.56	962,300
費用		
定率報酬(注2)	-931,930.31	-132,176
年次税(注3)	-56,907.45	-8,071
その他の手数料および報酬(注2)	-56,034.18	-7,947
費用合計	-1,044,871.94	-148,194
投資純利益(損失)	5,740,010.62	814,106
実現利益(損失)(注1)		
オプションなしの時価評価証券に係る 実現利益(損失)	-6,626,696.14	-939,864
金融先物に係る実現利益(損失)	181,268.53	25,709
外国為替先物予約に係る実現利益(損失)	-170,946.15	-24,245
外国為替に係る実現利益(損失)	-350,994.81	-49,782
実現利益(損失)合計	-6,967,368.57	-988,182
当期実現純利益(損失)	-1,227,357.95	-174,076
未実現評価益(評価損)の変動(注1)		
オプションなしの時価評価証券に係る 未実現評価益(評価損)	5,436,191.66	771,015
金融先物に係る未実現評価益(評価損)	18,570.64	2,634
外国為替先物予約に係る未実現評価益 (評価損)	1,040,678.87	147,599
未実現評価益(評価損)の変動合計	6,495,441.17	921,248
運用活動による純資産の純増加(減少)	5,268,083.22	747,172

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ - コーポレート・ボンド(米ドル)

純資産変動計算書	米ドル		千円	
	2023年6月1日 - 2023年11月30日		2023年6月1日 - 2023年11月30日	
期首純資産		242,302,312.93		34,365,737
発行額	84,099,027.58		11,927,765	
買戻額	-35,599,983.14		-5,049,146	
合計純発行額(買戻額)		48,499,044.44		6,878,619
支払配当金		-88,805.10		-12,595
投資純収益(損失)	5,740,010.62		814,106	
実現利益(損失)合計	-6,967,368.57		-988,182	
未実現評価益(評価損)の変動合計	6,495,441.17		921,248	
運用活動による純資産の純増加(減少)		5,268,083.22		747,172
期末純資産		295,980,635.49		41,978,934

## 発行済投資証券口数の変動

クラス	2023年6月1日 - 2023年11月30日	
	P-acc	
期首発行済口数	3,875,002.9070	
発行口数	2,070,018.9930	
買戻口数	-234,825.7180	
期末発行済口数	5,710,196.1820	

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ - ハイ・イールド・ボンド (米ドル)

純資産計算書	米ドル	千円
資産	2023年11月30日	2023年11月30日
投資有価証券、取得原価	521,646,634.93	73,985,142
投資有価証券、未実現評価益(評価損)	-17,100,047.65	-2,425,300
投資有価証券合計(注1)	504,546,587.28	71,559,842
現金性銀行預金、要求払預金 および預金勘定	11,425,519.61	1,620,481
その他当座資産(証拠金)	1,409,503.55	199,910
有価証券売却に係る未収金(注1)	1,095,710.77	155,405
発行に係る未収金	10,557.08	1,497
有価証券に係る未収利息	9,008,008.81	1,277,606
その他の資産	3,508.18	498
金融先物に係る未実現利益(注1)	240,062.64	34,048
外国為替先物予約に係る 未実現利益(注1)	1,739,226.47	246,674
スワップに係る未実現利益(注1)	1,469,373.05	208,401
資産合計	530,948,057.44	75,304,363
負債		
当座借越	-2.75	0
有価証券購入に係る未払金(注1)	-10,277,820.66	-1,457,703
未払買戻代金	-73,728.21	-10,457
定率報酬引当金(注2)	-182,016.71	-25,815
年次税引当金(注3)	-22,389.58	-3,176
引当金合計	-204,406.29	-28,991
負債合計	-10,555,957.91	-1,497,152
期末純資産	520,392,099.53	73,807,211

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ - ハイ・イールド・ボンド (米ドル)

運用計算書	米ドル	千円
	2023年6月1日 - 2023年11月30日	2023年6月1日 - 2023年11月30日
収益		
当座資産に係る利息	169,442.45	24,032
有価証券利息	16,727,434.35	2,372,452
配当金	58,303.39	8,269
スワップに係る受取利息(注1)	197,193.08	27,968
貸付証券に係る純収益(注12)	49,855.45	7,071
その他収益(注4)	274,049.23	38,868
収益合計	17,476,277.95	2,478,661
費用		
スワップに係る支払利息(注1)	-662,702.82	-93,991
定率報酬(注2)	-1,200,273.43	-170,235
年次税(注3)	-62,439.46	-8,856
その他の手数料および報酬(注2)	-58,368.98	-8,278
現金および当座借越に係る利息	-22,927.87	-3,252
費用合計	-2,006,712.56	-284,612
投資純利益(損失)	15,469,565.39	2,194,048
実現利益(損失)(注1)		
オプションなしの時価評価証券に係る 実現利益(損失)	-10,388,531.60	-1,473,405
オプションに係る実現利益(損失)	-203,238.20	-28,825
利回り評価証券および金融市場商品に係る 実現利益(損失)	491,880.27	69,763
金融先物に係る実現利益(損失)	-986,984.84	-139,984
外国為替先物予約に係る実現利益(損失)	317,672.73	45,056
スワップに係る実現利益(損失)	-483,433.00	-68,565
外国為替に係る実現利益(損失)	-1,368,103.50	-194,038
実現利益(損失)合計	-12,620,738.14	-1,789,999
当期実現純利益(損失)	2,848,827.25	404,049
未実現評価益(評価損)の変動(注1)		
オプションなしの時価評価証券に係る 未実現評価益(評価損)	22,087,573.57	3,132,681
オプションに係る未実現評価益(評価損)	-83,881.20	-11,897
利回り評価証券および金融市場商品に係る 未実現評価益(評価損)	-60,416.21	-8,569
金融先物に係る未実現評価益(評価損)	114,281.39	16,209
外国為替先物予約に係る未実現評価益 (評価損)	2,693,214.77	381,979
スワップに係る未実現評価益(評価損)	1,998,656.12	283,469
未実現評価益(評価損)の変動合計	26,749,428.44	3,793,871
運用活動による純資産の純増加(減少)	29,598,255.69	4,197,921

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ - ハイ・イールド・ボンド (米ドル)

純資産変動計算書	米ドル		千円	
	2023年6月1日 - 2023年11月30日		2023年6月1日 - 2023年11月30日	
期首純資産		508,295,783.84		72,091,591
発行額	60,198,858.20		8,538,004	
買戻額	-73,883,388.69		-10,478,881	
合計純発行額(買戻額)		-13,684,530.49		-1,940,877
支払配当金		-3,817,409.51		-541,423
投資純収益(損失)	15,469,565.39		2,194,048	
実現利益(損失)合計	-12,620,738.14		-1,789,999	
未実現評価益(評価損)の変動合計	26,749,428.44		3,793,871	
運用活動による純資産の純増加(減少)		29,598,255.69		4,197,921
期末純資産		520,392,099.53		73,807,211

## 発行済投資証券口数の変動

クラス	2023年6月1日 - 2023年11月30日	
	P-acc	
期首発行済口数	179,658.9690	
発行口数	2,286.1330	
買戻口数	-11,781.1840	
期末発行済口数	170,163.9180	

注記は財務書類の不可分の一部である。

## 財務書類の注記

(2023年11月30日現在)

## 注1 - 重要な会計方針の要約

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

## a) 純資産価額の計算

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

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

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

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

## b) 評価の原則

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

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

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

- 証券取引所に上場されておらず、別の規制された市場でも取引されておらず、適切な価格が入手できない有価証券およびその他の投資資産は、予想売却価格に基づいて本投資法人が誠実に選んだその他の原則に従って本投資法人が評価する。
- 証券取引所に上場されていないデリバティブ(店頭派生商品)は、独立した価格提供業者に基づいて評価される。デリバティブについて、利用できる独立した価格提供業者がただ1社だけの場合、入手した評価額の妥当性は、デリバティブが派生した原商品の市場価格に基づき、本投資法人が認めた計算方法により検証される。
- 譲渡性証券集合投資事業(UCITS)および/または集合投資事業(UCI)の投資証券はこれらの最新の純資産価額で評価される。その他のUCITSおよび/またはUCIの特定の受益証券または投資証券は、ポートフォリオ・マネージャーまたは投資顧問会社から独立している信頼できるサービス提供業者が提供したその価値の見積り(価格見積り)に基づき評価することができる。
- 証券取引所または一般に公開されている他の規制市場で取引されていない金融市場商品は、関連するカーブに基づいて評価される。カーブに基づく評価は、金利および信用スプレッドの要素を参照する。このプロセスには次の原則が適用される。各金融市場商品には、残余期間が最も近い金利が加えられる。このように計算された金利は、裏付けとなる借り主を反映する信用スプレッドを加えることによって市場価格に転換される。
- 関連するサブ・ファンドの会計通貨以外の通貨で表示され、外国為替取引によるヘッジを行わない有価証券、金融市場商品、デリバティブおよびその他の資産は、ルクセンブルグの為替相場の仲値(買呼値と売呼値の中値)あるいは、もしルクセンブルグの為替相場の仲値が入手不能な場合は、それに最も近い、当該通貨の為替相場の仲値で評価される。
- 定期預金および信託投資資産は、その名目価額に累積利息を加算した金額で評価される。
- スワップの価値は、外部のサービス提供会社が計算し、別の外部サービス提供会社が第二の独立した評価を提供する。計算はすべての現金流出入額の正味現在価値を基準とする。特別な場合に、内部計算(ブルームバーグにより提供されたモデルと市場データに基づく。)および/またはブローカーの報告評価を利用することができる。評価方法は、それぞれの証券に依拠し、適用されるUBS評価方針に基づき決定される。

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

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

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

投資証券は、通常、単一の価格である純資産価格に基づいて発行され、買い戻される。しかしながら、希薄化の影響を軽減するために、投資証券1口当たり純資産価格は、以下に記載するとおり評価日に調整される。これは、サブ・ファンドが関連する評価日において正味申込ポジションにあるかまたは正味買戻ポジションにあるかに関係なく行われる。特定の評価日において、いずれかのサブ・ファンドまたはサブ・ファンドのクラスにおいて取引が行われない場合、未調整の投資証券1口当たり純資産価

格が適用される。かかる希薄化調整が行われる状況は、取締役会の裁量により決定される。希薄化調整を実行するための要件は、通常、関連するサブ・ファンドにおける投資証券の申込みまたは買戻しの規模に左右される。取締役会は、その見解において、既存の投資主(申込みの場合)または残存する投資主(買戻しの場合)が損害を被る可能性がある場合、希薄化調整を行うことができる。希薄化調整は、以下の場合に行われることがある。

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

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

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

スイング・プライシングの技法は、すべてのサブ・ファンドに適用される。

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

#### c) 外国為替先物予約の評価

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

#### d) 金融先物契約の評価

金融先物契約は、評価日に適用可能な最新の公表価格に基づいて評価される。実現損益および未実現損益の増減は、運用計算書に計上される。実現損益はFIFO法に準拠して計算される(即ち、最初に取得した契約が最初に売却されたものとみなされる)。

## e) オプションの評価

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

オプションは、投資有価証券に含まれる。

## f) 公正価額の価格形成原則

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

## g) 有価証券の売却に係る実現純利益(損失)

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

## h) 外国通貨の換算

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

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

## i) 有価証券のポートフォリオ取引の会計処理

有価証券のポートフォリオ取引は取引日の翌銀行営業日に計上されている。

## j) 連結財務書類

連結財務書類は米ドル建てで表示されている。投資会社の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に記載されたさまざまな項目の金額は、各サブ・ファンドの財務書類に計上された対応する項目の金額を、下記の為替レートで米ドルに転換した金額の総額に等しい。

下記の為替レートは、2023年11月30日現在の連結財務書類の換算に使用されたものである。

---

為替レート

---

1 米ドル = 7.130900 人民元

---

1 米ドル = 0.916506 ユーロ

---

償還または統合したサブ・ファンドに関して、連結財務書類の換算に使用された為替レートは、償還日または統合日のものである。

k) 「モーゲージ担保証券」

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

l) 有価証券売却に係る未収金、有価証券購入に係る未払金

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

外国為替取引による未収金および未払金は相殺される。

m) スワップ

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

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

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

n) サブ・ファンド間投資

2023年11月30日現在、或るサブ・ファンドおよびUBS (Lux) ボンド・シキャブ - コーポレート・ボンド(米ドル)は、UBS (Lux) ボンド・シキャブの他のサブ・ファンドに以下の投資を行った。

UBS (Lux) ボンド・シキャブ - コーポレート・ボンド(米ドル)	金額(米ドル)
UBS (Lux) ボンド・シキャブ - グローバルSDGコーポレーツ・サステナブル(米ドル)	950 948.10
クラスU - X - ACC投資証券	
合計	950 948.10

サブ・ファンド間投資の総額は、43,861,663.70米ドルである。したがって、期末現在の調整済み連結純資産は、14,810,308,339.60米ドルであった。

注2 - 定率報酬

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

UBS (Lux) ボンド・シキャブ - ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)	上限定率報酬
名称に「P」が付く投資証券クラス	年率0.810%
UBS (Lux) ボンド・シキャブ - コーポレート・ボンド(米ドル)	上限定率報酬
名称に「P」が付く投資証券クラス	年率1.140%

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ - ハイ・イールド・ボンド(米ドル)

	上限定率報酬
名称に「P」が付く投資証券クラス	年率1.260%

本投資法人は、サブ・ファンドの平均純資産額に基づき計算された月次上限定率報酬を投資証券クラス「P」「K-1」「F」「Q」「QL」「I-A1」「I-A2」「I-A3」および「I-A4」のために支払う。

上記の定率報酬の中から、以下の報酬が支払われる。

1. 本投資法人の運用、事務管理、ポートフォリオ管理および販売に関して(該当する場合)、また保管受託銀行のすべての職務(本投資法人の資産の保管および監督、決済取引の取扱いならびに販売目論見書の「保管受託銀行および主たる支払代理人」の項に記載されるその他一切の職務等)に関して、以下の規則に従って本投資法人の純資産価額に基づく上限定率報酬が本投資法人の資産から支払われる。当該報酬は、純資産価額の計算毎に比例按分ベースで本投資法人の資産に対し請求され、毎月支払われる(上限定率報酬)。

本報酬は、「定率報酬」として運用計算書に計上されている。

関連する上限定率報酬は、該当する投資証券クラスの運用が開始されるまで請求されない。上限定率報酬の概要は、販売目論見書の「サブ・ファンドおよび特別な投資方針」の項に記載されている。

2. 上限定率報酬は、以下の報酬および本投資法人にも請求される追加の費用を含まない。
  - a) 資産の売買のための本投資法人の資産の管理に関する一切の追加の費用(市場、手数料、報酬等に合致する買呼値および売呼値のスプレッド、仲介手数料)。かかる費用は、通常、各資産の売買時点で計算される。本書の記載にかかわらず、投資証券の発行および買戻しの決済に関する資産の売買によって生じるかかる追加の費用は、販売目論見書の「純資産価額、発行、買戻しおよび転換価格」の項に基づくスイング・プライシングの適用によりカバーされる。
  - b) 本投資法人の設立、変更、清算および合併に関する監督官庁への費用ならびに監督官庁およびサブ・ファンドが上場されている証券取引所に関する一切の手数料。
  - c) 本投資法人の設立、変更、清算および合併に関する年次監査および認可に関する監査報酬ならびにファンドの管理事務に関して監査人が提供するサービスに関して監査人に支払われるか、または法律によって許可される一切のその他の報酬。
  - d) 本投資法人の設立、販売国における登録、変更、清算および合併に関する法律顧問、税務顧問および公証人に対する報酬ならびに法律で明白に禁止されない限り、本投資法人およびその投資者の利益の全般的な保護に関する手数料。

- e) 本投資法人の純資産価額の公表に関するコストおよび投資者に対する通知に関する一切のコスト(翻訳コストを含む。 )。
- f) 本投資法人の法的文書に関するコスト(目論見書、K I D s、年次報告書および半期報告書ならびに居住国および販売が行われる国で法的に要求されるその他の一切の文書)。
- g) 外国の監督官庁への本投資法人の登録に関するコスト(該当する場合、手数料、翻訳コストおよび外国の代表者または支払代理人に対する報酬を含む。 )。
- h) 本投資法人による議決権または債権者の権利の使用により発生した費用(外部顧問報酬を含む。 )。
- i) 本投資法人の名義で登録された知的財産または本投資法人の利用者の権利に関するコストおよび手数料。
- j) 管理会社、ポートフォリオ・マネジャーまたは保管受託銀行が投資者の利益の保護のために講じた特別措置に関して生じた一切の費用。
- k) 管理会社が投資者の利益につき集団訴訟に関与する場合、管理会社は、第三者に関して生じた費用(例えば、法律コストおよび保管受託銀行に関するコスト)を本投資法人の資産に対して請求することができる。さらに、管理会社は、すべての管理事務コストを請求することができる。ただし、かかるすべての管理事務コストは、証明可能かつ開示されており、本投資法人の総費用率(T E R)の開示において考慮される。
- l) 本投資法人の取締役を支払われる手数料、コストおよび費用(合理的な立替費用、保険料および取締役会に関連する合理的な交通費ならびに取締役の報酬)。

当該手数料および報酬は、「その他の手数料および報酬」として運用計算書に計上されている。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

本投資法人の現行の手数料については、KIDで参照することができる。

### 注3 - 年次税

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

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

### 注4 - その他収益

その他収益は、主にスイング・プライシングから生じる収益で構成される。

### 注5 - 収益の分配

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

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

注6 - 金融先物、オプションおよびスワップに関する契約

2023年11月30日現在のサブ・ファンドによる金融先物、オプションおよびスワップに関する契約ならびにその通貨は以下のとおりである。

a) 金融先物

UBS (Lux) ボンド・シキャブ	債券に係る金融先物 (買い)	債券に係る金融先物 (売り)
- ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)	138,011,133.15米ドル	16,027,734.45米ドル
- コーポレート・ボンド(米ドル)	42,737,187.60米ドル	9,757,195.32米ドル
- ハイ・イールド・ボンド(米ドル)	44,262,859.44米ドル	-米ドル

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

b) オプション

UBS (Lux) ボンド・シキャブ	その他のスワップに係る オプション、従来型 (売り)
- ハイ・イールド・ボンド(米ドル)	151,855,600.00米ドル

c) スワップ

UBS (Lux) ボンド・シキャブ	クレジット・デフォルト・ スワップ(買い)	クレジット・デフォルト・ スワップ(売り)
- ハイ・イールド・ボンド(米ドル)	-米ドル	31,170,569.30米ドル
UBS (Lux) ボンド・シキャブ	金利に係るスワップおよび先渡 しスワップ(買い)	金利に係るスワップおよび先 渡しスワップ(売り)
	該当なし	

注7 - ソフト・コミッション契約

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

注8 - 総費用比率(TER)

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

過去12ヶ月のTER

UBS (Lux) ボンド・シキャブ	総費用比率(TER)

- ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル) クラスP - a c c 投資証券	0.86%
- ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル) クラスP - m d i s t 投資証券	0.88%
- コーポレート・ボンド(米ドル)クラスP - a c c 投資証券	1.21%
- ハイ・イールド・ボンド(米ドル)クラスP - a c c 投資証券	1.33%

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

運用期間が12か月未満の投資証券クラスに関するT E Rは、年率換算されている。

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

#### 注9 - 償還

サブ・ファンドであるUBS (Lux) ボンド・シキャブ - 2023 (米ドル) が、2023年11月21日付で償還した。

#### 注10 - 後発事象

期末後に財務書類において調整または開示を必要とする事象はなかった。

#### 注11 - 適用ある法律、実行の場所、および正式言語

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

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

#### 注12 - 貸付証券

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

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

#### 貸付証券

2023年11月30日現在の貸付証券による  
相手方エクスポージャー\*

2023年11月30日現在の  
担保内訳  
(比重%)

UBS (Lux) ボンド・シキャブ	貸付証券の時価	担保(ユービーエス・スイス・エイ・ジー)	株式	債券	現金
- ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)	42,991,702.17米ドル	46,167,700.58米ドル	49.21	50.79	0.00
- コーポレート・ボンド(米ドル)	12,418,440.20米ドル	13,219,917.89米ドル	67.81	32.19	0.00
- ハイ・イールド・ボンド(米ドル)	97,360,419.81米ドル	104,764,746.83米ドル	67.81	32.19	0.00

\* 相手方エクスポージャーの価格および為替レート情報は、2023年11月30日に証券貸付代理人から直接入手されるため、2023年11月30日現在の財務書類の作成に使用された終値および為替レートとは異なる可能性がある。

UBS (Lux) ボンド・シキャブ  
- ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)

貸付証券収益	122,917.10米ドル
貸付証券費用*	
ユービーエス・スイス・エイ・ジー	36,875.13米ドル
UBSヨーロッパSE ルクセンブルグ支店	12,291.71米ドル
貸付証券純収益	73,750.26米ドル

	UBS (Lux) ボンド・シキャブ - コーポレート・ボンド(米ドル)	UBS (Lux) ボンド・シキャブ - ハイ・イールド・ボンド(米ドル)
貸付証券収益	14,210.53米ドル	83,092.42米ドル
貸付証券費用*		
ユービーエス・スイス・エイ・ジー	4,263.16米ドル	24,927.73米ドル
UBSヨーロッパSE ルクセンブルグ支店	1,421.05米ドル	8,309.24米ドル
貸付証券純収益	8,526.32米ドル	49,855.45米ドル

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

## (2) 【投資有価証券明細表等】

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ - ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)

## 2023年11月30日現在の投資有価証券ならびにその他純資産明細書

## 公認証券取引所に上場されている譲渡可能証券および金融市場商品

内容	数量/ 名目金額	先物/為替先物予約/ スワップに係る 未実現利益(損失)の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
ノート - 固定金利			
英ポンド			
GBP BUPA FINANCE PLC-REG-S-SUB 5.00000% 16-08.12.26	1 000 000.00	1 216 228.55	0.18
英ポンド合計		1 216 228.55	0.18
米ドル			
USD ABBVIE INC 2.60000% 20-21.11.24	3 000 000.00	2 916 172.50	0.43
USD ABBVIE INC 3.60000% 15-14.05.25	4 400 000.00	4 295 594.51	0.63
USD ABN AMRO BANK NV-144A-SUB 4.75000% 15-28.07.25	250 000.00	242 681.10	0.04
USD ABN AMRO BANK NV-REG-S-SUB 4.75000% 15-28.07.25	2 500 000.00	2 426 811.00	0.35
USD AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP GLO 2.45000% 21-29.10.26	4 000 000.00	3 643 968.12	0.53
USD AIA GROUP LTD-REG-S 5.62500% 22-25.10.27	3 380 000.00	3 446 697.22	0.50
USD AIG GLOBAL FUNDING-REG-S 0.45000% 20-08.12.23	400 000.00	399 725.24	0.06
USD AIG GLOBAL FUNDING-REG-S 0.65000% 21-17.06.24	3 000 000.00	2 917 852.98	0.43
USD ALIBABA GROUP HOLDING LTD 3.40000% 17-06.12.27	3 480 000.00	3 247 153.20	0.47
USD ALLY FINANCIAL INC 3.87500% 19-21.05.24	1 500 000.00	1 483 910.64	0.22
USD AMAZON.COM INC 4.55000% 22-01.12.27	3 000 000.00	2 994 911.76	0.44
USD AMERICAN EXPRESS CO 3.00000% 17-30.10.24	2 500 000.00	2 441 898.63	0.36
USD AMERICAN EXPRESS CO 3.95000% 22-01.08.25	2 000 000.00	1 952 808.36	0.28
USD AMERICAN TOWER CORP 3.37500% 19-15.05.24	1 000 000.00	988 092.69	0.14
USD AMERICAN TOWER CORP 0.60000% 20-15.01.24	2 000 000.00	1 987 349.06	0.29
USD AMGEN INC 5.25000% 23-02.03.25	2 910 000.00	2 899 008.20	0.42
USD ANALOG DEVICES INC 2.95000% 20-01.04.25	500 000.00	485 279.27	0.07
USD ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC-144A 3.62500% 17-11.09.24	2 000 000.00	1 960 780.00	0.29
USD ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC-REG-S 3.62500% 17-11.09.24	485 000.00	475 489.15	0.07
USD ANZ NEW ZEALAND INT ' L LTD/LDN-REG-S 3.40000% 19-19.03.24	1 000 000.00	993 514.33	0.14
USD ANZ NEW ZEALAND INT ' L LTD/LONDON-REG-S 2.16600% 22-18.02.25	2 000 000.00	1 921 221.67	0.28
USD APPLE INC 3.25000% 16-23.02.26	4 000 000.00	3 870 234.16	0.56
USD APPLE INC 4.42100% 23-08.05.26	4 250 000.00	4 221 158.31	0.62
USD APT PIPELINES LTD-REG-S 4.20000% 15-23.03.25	2 000 000.00	1 958 618.19	0.29
USD APTIV PLC 2.39600% 22-18.02.25	1 300 000.00	1 250 091.97	0.18
USD ASB BANK LTD-REG-S 5.34600% 23-15.06.26	3 750 000.00	3 743 894.80	0.55
USD ASTRAZENCA FINANCE LLC 0.70000% 21-28.05.24	2 000 000.00	1 953 749.36	0.28
USD AT&T INC 3.87500% 19-15.01.26	2 000 000.00	1 939 282.60	0.28
USD AT&T INC 5.53900% 23-20.02.26	3 500 000.00	3 500 864.18	0.51
USD BAKER HUGHES A GE CO/ CO-OBLIGATOR 2.06100% 21-15.12.26	1 140 000.00	1 042 236.10	0.15
USD BANCO SANTANDER SA 2.70600% 19-27.06.24	3 000 000.00	2 947 093.50	0.43
USD BANCO SANTANDER SA 2.74600% 20-28.05.25	600 000.00	570 754.56	0.08
USD BANCO SANTANDER SA 5.14700% 22-18.08.25	1 000 000.00	986 130.35	0.14
USD BANCO SANTANDER SA 5.58800% 23-08.08.28	800 000.00	794 542.74	0.12
USD BANK OF NOVA SCOTIA 1.30000% 21-15.09.26	3 000 000.00	2 686 835.37	0.39
USD BANK OF SCOTLAND PLC-REG-S 1.60000% 21-29.09.26	1 665 000.00	1 492 722.28	0.22
USD BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUL-REG-S 0.99800% 21-04.02.25	2 000 000.00	1 890 628.92	0.28
USD BARCLAYS BANK PLC 3.75000% 14-15.05.24	500 000.00	495 390.04	0.07
USD BARCLAYS PLC 3.65000% 15-16.03.25	400 000.00	388 720.51	0.06

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ - ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル (米ドル)

内容	数量 / 名目金額	先物 / 為替先物予約 / スワップに係る 未実現利益 (損失) の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
USD BAYER US FINANCE II LLC-REG-S 3.87500% 18-15.12.23	2 300 000.00	2 298 260.16	0.34
USD BNP PARIBAS-REG-S 3.37500% 18-09.01.25	750 000.00	729 546.42	0.11
USD BP CAPITAL MARKETS PLC 3.79600% 18-21.09.25	1 000 000.00	980 331.75	0.14
USD BROADCOM CORP/CAYMAN FIN LTD 3.87500% 18-15.01.27	2 000 000.00	1 921 912.92	0.28
USD CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 3.94500% 22-04.08.25	1 500 000.00	1 461 800.40	0.21
USD CANADIAN PACIFIC RAILWAY 1.35000% 21-02.12.24	3 000 000.00	2 874 261.81	0.42
USD CARRIER GLOBAL CORP-REG-S 5.80000% 23-30.11.25	1 600 000.00	1 609 264.51	0.23
USD CCO LLC/CAPITAL 4.90800% 16-23.07.25	2 500 000.00	2 458 976.60	0.36
USD CELANESE US HOLDINGS LLC 6.16500% 22-15.07.27	2 500 000.00	2 522 030.20	0.37
USD CIGNA CORP 0.61300% 21-15.03.24	2 500 000.00	2 463 635.40	0.36
USD COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC-144A 0.80000% 21-03.05.24	4 000 000.00	3 912 652.32	0.57
USD COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC-REG-S 0.80000% 21-03.05.24	450 000.00	440 173.39	0.06
USD CONCENTRIX CORP 6.65000% 23-02.08.26	2 500 000.00	2 517 290.22	0.37
USD COOPERATIEVE RABOBANK UA-REG-S 2.62500% 19-22.07.24	600 000.00	588 072.35	0.09
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 6.50000% 19-08.04.24	1 400 000.00	122 500.00	0.02
USD CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 2.37500% 19-22.01.25	1 445 000.00	1 389 541.64	0.20
USD CREDIT SUISSE AG/NEW YORK NY 3.70000% 22-21.02.25	2 000 000.00	1 941 365.06	0.28
USD CREDIT SUISSE AG/NEW YORK NY 7.95000% 23-09.01.25	2 665 000.00	2 716 779.75	0.40
USD CVS HEALTH CORP 2.87500% 16-01.06.26	5 000 000.00	4 726 498.55	0.69
USD DAIMLER TRUCKS FINANCE NORTH-REG-S 5.60000% 23-08.08.25	2 000 000.00	1 998 800.94	0.29
USD DANSKE BANK AS-REG-S 5.37500% 19-12.01.24	2 400 000.00	2 396 895.74	0.35
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 0.89800% 21-28.05.24	2 000 000.00	1 950 623.50	0.28
USD ELEVANCE HEALTH INC 4.90000% 23-08.02.26	3 686 000.00	3 650 441.23	0.53
USD ENBRIDGE INC 2.50000% 19-15.01.25	2 500 000.00	2 412 417.68	0.35
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 1.37500% 21-12.07.26	3 812 000.00	3 416 072.34	0.50
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 4.25000% 22-15.06.25	4 000 000.00	3 908 608.64	0.57
USD EQT CORP 3.90000% 17-01.10.27	3 350 000.00	3 157 652.38	0.46
USD EVERSOURCE ENERGY 4.60000% 22-01.07.27	1 500 000.00	1 461 324.93	0.21
USD EVERSOURCE ENERGY 4.20000% 22-27.06.24	1 000 000.00	990 459.06	0.14
USD EVERSOURCE ENERGY 4.75000% 23-15.05.26	1 825 000.00	1 792 270.21	0.26
USD EXELON GENERATION CO LLC 3.25000% 20-01.06.25	2 000 000.00	1 929 406.02	0.28
USD FISERV INC 2.75000% 19-01.07.24	2 500 000.00	2 455 781.83	0.36
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 6.95000% 23-10.06.26	1 610 000.00	1 627 989.68	0.24
USD GENERAL MILLS INC 4.00000% 18-17.04.25	1 000 000.00	979 474.70	0.14
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 2.90000% 20-26.02.25	1 000 000.00	963 139.94	0.14
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 1.05000% 21-08.03.24	750 000.00	740 464.17	0.11
USD GILEAD SCIENCES INC 3.65000% 15-01.03.26	2 500 000.00	2 418 952.00	0.35
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.50000% 20-01.04.25	1 000 000.00	971 050.91	0.14
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 3.50000% 16-16.11.26	3 000 000.00	2 862 394.05	0.42
USD HARLEY-DAVIDSON FINANCIAL SERVICE-REG-S 3.35000% 20-08.06.25	2 500 000.00	2 396 763.95	0.35
USD HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO 5.90000% 23-01.10.24	4 000 000.00	3 999 326.24	0.58
USD HSBC HOLDINGS PLC-SUB 4.25000% 14-14.03.24	3 000 000.00	2 984 108.76	0.44
USD INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 4.50000% 23-06.02.26	2 500 000.00	2 467 398.05	0.36
USD INVESCO FINANCE PLC 3.75000% 15-15.01.26	1 000 000.00	965 694.25	0.14
USD JOHN DEERE CAPITAL CORP 0.70000% 21-15.01.26	1 000 000.00	916 707.16	0.13
USD KIMCO REALTY OP LLC 3.25000% 16-15.08.26	2 000 000.00	1 869 085.22	0.27
USD LENNOX INTERNATIONAL INC 1.35000% 20-01.08.25	900 000.00	839 100.34	0.12
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.45000% 18-08.05.25	5 000 000.00	4 895 733.15	0.71
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 3.90000% 19-12.03.24	250 000.00	248 641.97	0.04
USD LOWE ' S COS INC 4.80000% 23-01.04.26	3 000 000.00	2 976 088.80	0.43
USD LSEGA FINANCING PLC-REG-S 1.37500% 21-06.04.26	500 000.00	454 763.64	0.07
USD MACQUARIE BANK LTD-REG-S 5.20800% 23-15.06.26	7 500 000.00	7 476 613.80	1.09
USD MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD 3.60000% 19-15.04.24	1 000 000.00	990 673.18	0.14
USD MARSH & MCLENNAN COS INC 3.87500% 19-15.03.24	3 000 000.00	2 983 526.34	0.44

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ - ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)

内容	数量/ 名目金額	先物/為替先物予約/ スワップに係る 未実現利益(損失)の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
USD MERCEDES-BENZ FIN NORTH AMERCA LL-REG-S 3.65000% 19-22.02.24	1 400 000.00	1 393 129.06	0.20
USD MERCEDES-BENZ FIN NORTH AMERCA LL-REG-S 2.12500% 20-10.03.25	1 500 000.00	1 440 164.76	0.21
USD MERCEDES-BENZ FIN NORTH AMERCA LL-REG-S 4.80000% 23-30.03.26	2 000 000.00	1 981 365.80	0.29
USD MERCEDES-BENZ FIN NRTH AMERICA LLC-REG-S 5.20000% 23-03.08.26	3 000 000.00	3 002 279.49	0.44
USD MICRON TECHNOLOGY INC 5.37500% 23-15.04.28	1 000 000.00	994 477.92	0.15
USD MICROSOFT CORP 3.12500% 15-03.11.25	5 000 000.00	4 846 303.90	0.71
USD MOLSON COORS BREWING CO 3.00000% 16-15.07.26	3 000 000.00	2 841 975.78	0.41
USD MONDELEZ INTERNATIONAL HDG NLD BV-REG-S 4.25000% 22-15.09.25	1 800 000.00	1 763 193.42	0.26
USD MOODY 'S CORP 3.75000% 20-24.03.25	3 000 000.00	2 934 824.37	0.43
USD MUFG BANK LTD-REG-S 3.75000% 14-10.03.24	750 000.00	746 201.35	0.11
USD NATWEST MARKETS PLC-144A 1.60000% 21-29.09.26	2 560 000.00	2 295 116.55	0.33
USD NEPTUNE ENERGY BONDCO PLC-REG-S 6.62500% 18-15.05.25	1 000 000.00	995 300.00	0.15
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 0.60600% 21-14.09.24	3 000 000.00	2 888 033.46	0.42
USD NEXTERA ENERGY CAPITAL HOLDINGS INC 4.62500% 22-15.07.27	3 000 000.00	2 940 716.16	0.43
USD NISOURCE INC 3.49000% 17-15.05.27	1 000 000.00	944 945.70	0.14
USD NISOURCE INC 5.25000% 23-30.03.28	400 000.00	399 456.78	0.06
USD NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CO LLC-REG-S 6.95000% 23-15.09.26	2 000 000.00	2 036 869.70	0.30
USD NOMURA HOLDINGS INC 2.64800% 20-16.01.25	5 000 000.00	4 821 090.56	0.70
USD NOMURA HOLDINGS INC 5.09900% 22-03.07.25	2 000 000.00	1 975 045.95	0.29
USD NORDSON CORP 5.60000% 23-15.09.28	1 000 000.00	1 021 585.99	0.15
USD ONEOK INC 5.85000% 20-15.01.26	2 000 000.00	2 013 753.84	0.29
USD ORACLE CORP 2.50000% 20-01.04.25	4 000 000.00	3 842 178.60	0.56
USD ORACLE CORP 3.25000% 17-15.11.27	3 475 000.00	3 239 310.35	0.47
USD ORACLE CORP 5.80000% 22-10.11.25	140 000.00	141 094.63	0.02
USD ORIX CORP 3.25000% 17-04.12.24	500 000.00	488 210.14	0.07
USD PACIFIC GAS & ELECTRIC CO 3.50000% 15-15.06.25	750 000.00	718 408.42	0.10
USD PARK AEROSPACE HOLDINGS LTD-144A 5.50000% 17-15.02.24	4 500 000.00	4 487 671.53	0.65
USD PENSKE TRK LEA CO LP/PTL FIN CORP-REG-S 4.40000% 22-01.07.27	1 765 000.00	1 676 456.39	0.24
USD PFIZER INVESTMENT ENTERPRISES PTE LTD 4.65000% 23-19.05.25	665 000.00	660 370.32	0.10
USD PFIZER INVESTMENT ENTERPRISES PTE LTD 4.45000% 23-19.05.26	5 000 000.00	4 943 922.85	0.72
USD PG&E CORP 5.00000% 20-01.07.28	100 000.00	95 125.83	0.01
USD QUANTA SERVICES INC 0.95000% 21-01.10.24	2 575 000.00	2 470 265.04	0.36
USD RECKITT BENCKISER TREAS SERV-144A 2.75000% 17-26.06.24	2 500 000.00	2 456 781.68	0.36
USD ROCHE HOLDINGS INC-REG-S 0.99100% 21-05.03.26	3 000 000.00	2 750 108.85	0.40
USD SEMPRA ENERGY 3.30000% 22-01.04.25	1 490 000.00	1 442 040.80	0.21
USD SHIMAO PRPTY HLDG LTD-REG-S *DEFAULTED* 6.12500% 19-21.02.24	1 000 000.00	40 000.00	0.01
USD SHIMAO PRPTY HLDG LTD-REG-S *DEFAULTED* 3.97500% 21-16.09.23	600 000.00	24 000.00	0.00
USD SOCIETE GENERALE SA-REG-S-SUB 4.75000% 15-24.11.25	2 000 000.00	1 934 765.50	0.28
USD SOCIETE GENERALE SA-REG-S-SUB 5.00000% 14-17.01.24	500 000.00	498 806.17	0.07
USD SOCIETE GENERALE-REG-S 2.62500% 19-16.10.24	3 500 000.00	3 397 290.54	0.50
USD SOUTHERN CALIFORNIA GAS CO 2.95000% 22-15.04.27	2 000 000.00	1 860 574.58	0.27
USD SPRINGLEAF FINANCE CORP 6.12500% 19-15.03.24	1 000 000.00	998 521.70	0.15
USD STATE STREET CORP 5.27200% 23-03.08.26	1 000 000.00	999 502.24	0.15
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 2.69600% 19-16.07.24	500 000.00	490 779.48	0.07
USD SUNCORP-METWAY LTD-REG-S 3.30000% 19-15.04.24	430 000.00	425 665.08	0.06
USD SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP-REG-S 5.95000% 23-17.07.26	1 010 000.00	1 011 939.20	0.15
USD SWEDBANK AB-REG-S 3.35600% 22-04.04.25	1 156 000.00	1 122 660.96	0.16
USD SWEDBANK AB-REG-S 5.47200% 23-15.06.26	500 000.00	498 672.19	0.07
USD T-MOBILE USA INC 3.50000% 21-15.04.25	1 500 000.00	1 458 889.74	0.21

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ - ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル (米ドル)

内容	数量 / 名目金額	先物 / 為替先物予約 / スワップに係る 未実現利益 (損失) の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
USD TAPESTRY INC 7.00000% 23-27.11.26	835 000.00	844 004.43	0.12
USD TELECOM ITALIA SPA-144A 5.30300% 14-30.05.24	2 000 000.00	1 984 050.40	0.29
USD TELEFONICA EMISIONES SA 4.10300% 17-08.03.27	3 000 000.00	2 885 792.31	0.42
USD TSMC GLOBAL LTD-144A 0.75000% 20-28.09.25	3 000 000.00	2 763 018.90	0.40
USD UBS GROUP AG-REG-S 4.12500% 16-15.04.26	2 000 000.00	1 922 896.40	0.28
USD UBS GROUP AG-REG-S 5.71100% 23-12.01.27	5 000 000.00	4 977 743.75	0.73
USD UNITED RENTALS NORTH AMERICA INC 3.87500% 19-15.11.27	1 000 000.00	939 422.63	0.14
USD UZBEK INDUSTRIAL AND CONS ATB-REG-S 5.75000% 19- 02.12.24	1 000 000.00	965 000.00	0.14
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.62500% 16-15.08.26	1 863 000.00	1 749 437.71	0.26
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 0.85000% 20-20.11.25	4 250 000.00	3 906 122.13	0.57
USD VMWARE INC 4.50000% 20-15.05.25	3 500 000.00	3 445 393.67	0.50
USD WARNERMEDIA HOLDINGS INC 6.41200% 23-15.03.26	6 450 000.00	6 455 850.28	0.94
USD WESTPAC BANKING CORP 1.15000% 21-03.06.26	4 108 000.00	3 738 136.95	0.55
USD WILLIAMS COMPANIES INC 4.55000% 14-24.06.24	1 000 000.00	992 627.75	0.14
USD ZOETIS INC 4.50000% 15-13.11.25	1 263 000.00	1 240 428.69	0.18
米ドル合計		323 336 975.17	47.13
ノート合計 - 固定金利		324 553 203.72	47.31
ノート - 変動金利			
米ドル			
USD BANCO SANTANDER SA 0.701%/VAR 21-30.06.24	2 200 000.00	2 196 768.64	0.32
USD BANK OF AMERICA CORP 5.080%/VAR 23-20.01.27	12 500 000.00	12 361 923.00	1.80
USD BANK OF IRELAND GROUP PLC-REG-S 2.029%/VAR 21-30.09.27	1 290 000.00	1 151 799.72	0.17
USD BANK OF NEW YORK MELLON CORP 4.947%/VAR 23-26.04.27	1 000 000.00	988 794.86	0.14
USD BARCLAYS PLC 3.932%/VAR 19-07.05.25	3 000 000.00	2 970 180.18	0.43
USD BARCLAYS PLC 5.304%/VAR 22-09.08.26	6 000 000.00	5 906 073.00	0.86
USD BNP PARIBAS SA-REG-S 2.591%/VAR 22-20.01.28	3 000 000.00	2 721 415.17	0.40
USD BNP PARIBAS-REG-S 2.819% /VAR 19-19.11.25	5 000 000.00	4 844 895.05	0.71
USD CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 6.312%/VAR 23-08.06.29	2 000 000.00	1 988 267.72	0.29
USD CITIGROUP INC 1.462%/VAR 21-09.06.27	5 000 000.00	4 502 154.45	0.66
USD CITIGROUP INC 2.014%/VAR 22-25.01.26	6 000 000.00	5 718 150.66	0.83
USD DANSKE BANK AS-REG-S 3.244%/VAR 19-20.12.25	2 000 000.00	1 932 635.08	0.28
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 6.819%/VAR 23-20.11.29	960 000.00	978 062.45	0.14
USD DNB BANK ASA-REG-S 1.535%/VAR 21-25.05.27	1 000 000.00	898 419.07	0.13
USD HSBC HOLDINGS PLC 4.292%/VAR 18-12.09.26	6 000 000.00	5 813 267.52	0.85
USD HSBC HOLDINGS PLC 4.180%/VAR 22-09.12.25	3 000 000.00	2 939 805.12	0.43
USD ING GROEP NV 6.083%/VAR 23-11.09.27	1 145 000.00	1 152 884.24	0.17
USD JPMORGAN CHASE & CO 1.578%/VAR 21-22.04.27	3 500 000.00	3 186 702.72	0.46
USD JPMORGAN CHASE & CO 0.824%/VAR 21-01.06.25	1 000 000.00	972 925.82	0.14
USD JPMORGAN CHASE & CO 2.947%/VAR 22-24.02.28	5 000 000.00	4 631 619.45	0.68
USD JPMORGAN CHASE & CO 6.070%/VAR 23-22.10.27	2 780 000.00	2 825 143.86	0.41
USD JPMORGAN CHASE 1.561%/VAR 21-10.12.25	4 000 000.00	3 818 615.16	0.56
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC VAR 21-11.05.27	1 500 000.00	1 354 022.06	0.20
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.716%/VAR 22-11.08.26	5 000 000.00	4 888 594.65	0.71
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 5.063%/VAR 22- 12.09.25	4 000 000.00	3 974 486.24	0.58
USD MORGAN STANLEY 1.593%/VAR 21-04.05.27	18 000 000.00	16 320 013.92	2.38
USD NATWEST GROUP PLC 5.847%/VAR 23-02.03.27	2 000 000.00	1 993 334.14	0.29
USD SANTANDER HOLDINGS USA INC 6.499%/VAR 23-09.03.29	2 705 000.00	2 732 165.29	0.40
USD SANTANDER UK GROUP HOLDINGS 6.833%/VAR 22-21.11.26	2 000 000.00	2 016 656.64	0.29
USD SOCIETE GENERALE SA-REG-S 2.226%/VAR 22-21.01.26	3 120 000.00	2 967 285.36	0.43
USD STANDARD CHARTERED PLC-REG-S 1.822%/VAR 21-23.11.25	1 000 000.00	955 404.07	0.14
USD STANDARD CHARTERED PLC-REG-S 6.187%/VAR 23-06.07.27	4 000 000.00	4 013 442.40	0.59
USD STATE STREET CORP 5.104%/VAR 23-18.05.26	2 000 000.00	1 984 782.62	0.29
USD UBS GROUP AG-REG-S-SUB 6.875%/VAR 15-PRP	1 000 000.00	961 240.00	0.14
米ドル合計		118 661 930.33	17.30
ノート合計 - 変動金利		118 661 930.33	17.30

注記は財務書類の不可分の一部である。

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

内容	数量/ 名目金額	先物/為替先物予約/ スワップに係る 未実現利益(損失)の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
<b>中期債券 - 固定金利</b>			
<b>ユーロ</b>			
EUR BLACKSTONE PROPERTY PARTNERS EUR-REG-S 1.00000% 21-20.10.26	1 500 000.00	1 436 353.50	0.21
EUR CELLNEX TELECOM SA-REG-S 2.87500% 17-18.04.25	1 500 000.00	1 613 306.79	0.23
EUR CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S 2.75000% 20-12.05.26	1 250 000.00	1 103 211.21	0.16
EUR CTP BV-REG-S 2.12500% 20-01.10.25	2 000 000.00	2 063 793.83	0.30
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA AG-REG-S 2.00000% 21-14.07.24	2 400 000.00	2 574 044.56	0.38
EUR WORLEY US FINANCE SUB LTD-REG-S 0.87500% 21-09.06.26	1 500 000.00	1 503 043.72	0.22
<b>ユーロ合計</b>		<b>10 293 753.61</b>	<b>1.50</b>
<b>英ポンド</b>			
GBP FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.74800% 20-14.06.24	400 000.00	496 914.74	0.07
<b>英ポンド合計</b>		<b>496 914.74</b>	<b>0.07</b>
<b>米ドル</b>			
USD AAREAL BANK AG-REG-S 0.62500% 21-14.02.25	2 000 000.00	1 884 567.22	0.28
USD AIA GROUP LTD-REG-S 3.20000% 15-11.03.25	2 000 000.00	1 948 219.94	0.28
USD CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 3.25000% 17-04.10.24	1 400 000.00	1 370 759.84	0.20
USD LENDLEASE US CAPITAL INC-REG-S 4.50000% 16-26.05.26	2 000 000.00	1 895 992.90	0.28
USD LENOVO GROUP LTD-REG-S 5.87500% 20-24.04.25	2 000 000.00	2 000 960.00	0.29
USD NORDEA BANK ABP-REG-S 1.50000% 21-30.09.26	5 000 000.00	4 476 589.45	0.65
USD PACIFIC NATIONAL FINANCE PTY LTD-REG-S 4.75000% 18-22.03.28	3 000 000.00	2 753 310.00	0.40
USD PRICOA GLOBAL FUNDING I-REG-S 1.20000% 21-01.09.26	2 083 000.00	1 864 160.87	0.27
USD QNB FINANCE LTD-REG-S 3.50000% 19-28.03.24	1 000 000.00	990 150.00	0.15
USD ROYAL BANK OF CANADA 4.95000% 23-25.04.25	2 000 000.00	1 985 911.42	0.29
USD TORONTO-DOMINION BANK 3.76600% 22-06.06.25	500 000.00	487 259.07	0.07
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 1.45000% 22-13.01.25	1 700 000.00	1 631 096.88	0.24
<b>米ドル合計</b>		<b>23 288 977.59</b>	<b>3.40</b>
<b>中期債券合計 - 固定金利</b>		<b>34 079 645.94</b>	<b>4.97</b>
<b>中期債券 - ゼロ・クーポン</b>			
<b>スイスフラン</b>			
CHF CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 0.00000% 20-17.12.24	2 000 000.00	2 253 349.43	0.33
<b>スイスフラン合計</b>		<b>2 253 349.43</b>	<b>0.33</b>
<b>中期債券合計 - ゼロ・クーポン</b>		<b>2 253 349.43</b>	<b>0.33</b>
<b>中期債券 - 変動金利</b>			
<b>ユーロ</b>			
EUR UNICAJA BANCO SA-REG-S 7.250%/VAR 22-15.11.27	1 000 000.00	1 130 551.99	0.16
<b>ユーロ合計</b>		<b>1 130 551.99</b>	<b>0.16</b>
<b>米ドル</b>			
USD AIB GROUP PLC-REG-S 4.263%/VAR 19-10.04.25	1 500 000.00	1 487 076.24	0.22
USD BANK OF AMERICA CORP 3.824%/VAR 17-20.01.28	2 000 000.00	1 892 742.20	0.28
USD DBS GROUP HOLDINGS LTD-144A-SUB 4.520%/VAR 18-11.12.28	3 000 000.00	2 999 190.00	0.44
USD MACQUARIE GROUP LTD-144A 1.201%/VAR 21-14.10.25	4 250 000.00	4 074 438.17	0.59
USD QBE INSURANCE GROUP LTD-REG-S-SUB 5.875%/VAR 16-17.06.46	800 000.00	767 000.00	0.11
USD RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S-SUB 4.000%/VAR 17-10.04.29	3 000 000.00	2 963 718.00	0.43
<b>米ドル合計</b>		<b>14 184 164.61</b>	<b>2.07</b>
<b>中期債券合計 - 変動金利</b>		<b>15 314 716.60</b>	<b>2.23</b>

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ - ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)

内容	数量/ 名目金額	先物 / 為替先物予約 / スワップに係る 未実現利益(損失)の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
<b>長期債券 - 固定金利</b>			
<b>ユーロ</b>			
EUR WIENERBERGER AG-REG-S 2.00000% 18-02.05.24	2 000 000.00	2 150 501.37	0.31
<b>ユーロ合計</b>		<b>2 150 501.37</b>	<b>0.31</b>
<b>米ドル</b>			
USD CANADIAN IMPERIAL BANK OF-REG-S 1.15000% 21-08.07.26	1 500 000.00	1 358 961.91	0.20
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 4.92800% 22-09.12.25	4 050 000.00	4 035 267.37	0.59
USD COMMONWEALTH BK OF AUSTRALIA-REG-S-SUB 4.50000% 15-09.12.25	280 000.00	273 417.38	0.04
USD DEUTSCHE BANK AG/LONDON 3.70000% 14-30.05.24	5 000 000.00	4 928 796.35	0.72
USD HUTCHISON WHAMPOA INTERNATIONAL14-REG-S 3.62500% 14-31.10.24	400 000.00	392 812.00	0.06
USD KINDER MORGAN INC 4.30000% 14-01.06.25	2 000 000.00	1 964 790.36	0.29
USD LG CHEM LTD-REG-S 3.25000% 19-15.10.24	2 000 000.00	1 958 780.00	0.29
USD MIZUHO FINANCE GRP CAY 3 LTD-REG-S-SUB 4.60000% 14-27.03.24	3 400 000.00	3 380 682.19	0.49
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 3.40000% 14-06.05.24	2 000 000.00	1 982 423.00	0.29
USD PACIFIC GAS AND ELECTRIC CO 3.15000% 20-01.01.26	2 000 000.00	1 884 580.00	0.27
USD SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 3.70000% 18-01.08.25	3 000 000.00	2 905 050.33	0.42
USD SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 4.90000% 23-01.06.26	750 000.00	744 110.75	0.11
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC-144A-SUB 4.43600% 14-02.04.24	1 500 000.00	1 490 739.21	0.22
USD UBS AG-REG-S-SUB 5.12500% 14-15.05.24	3 400 000.00	3 361 750.00	0.49
USD VODAFONE GROUP PLC 4.12500% 18-30.05.25	800 000.00	785 813.56	0.11
USD WESTPAC BANKING CORP-REG-S 4.18400 23-22.05.28	1 500 000.00	1 456 155.83	0.21
USD XCEL ENERGY INC 3.30000% 15-01.06.25	2 000 000.00	1 931 391.38	0.28
<b>米ドル合計</b>		<b>34 835 521.62</b>	<b>5.08</b>
<b>長期債券合計 - 固定金利</b>		<b>36 986 022.99</b>	<b>5.39</b>
<b>長期債券 - 変動金利</b>			
<b>米ドル</b>			
USD ALLSTATE CORP-SUB 5.750%/3M LIBOR+293.8BP 13-15.08.53	250 000.00	246 444.60	0.04
USD BANK NEGARA INDONESIA PERSERO-REG-S-SUB 4.300%/VAR 21-PRP	1 000 000.00	863 080.00	0.12
USD BP CAPITAL MARKETS PLC-SUB 4.375%/VAR 20-PRP	3 800 000.00	3 661 216.78	0.53
USD JP MORGAN CHASE & CO 2.005%/VAR 20-13.03.26	3 500 000.00	3 333 650.04	0.49
USD NBK TIER 1 FINANCING 2 LTD-REG-S-SUB 4.500%/VAR 19-PRP	3 300 000.00	3 092 100.00	0.45
USD QBE INSURANCE GROUP LTD-REG-S-SUB 6.750%/VAR 14-02.12.44	1 500 000.00	1 488 642.00	0.22
USD SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN-REG-S-SUB 5.125%/VAR 19-PRP	1 000 000.00	949 030.00	0.14
USD VODAFONE GROUP PLC-REG-S-SUB 6.250%/VAR 18-03.10.78	2 217 000.00	2 192 014.41	0.32
<b>米ドル合計</b>		<b>15 826 177.83</b>	<b>2.31</b>
<b>長期債券合計 - 変動金利</b>		<b>15 826 177.83</b>	<b>2.31</b>
<b>転換社債型新株予約権付社債 - 変動金利</b>			
<b>米ドル</b>			
USD BARCLAYS PLC-SUB COCO 8.000%/VAR 19-PRP	2 500 000.00	2 459 273.75	0.36
<b>米ドル合計</b>		<b>2 459 273.75</b>	<b>0.36</b>
<b>転換社債型新株予約権付社債合計 - 変動金利</b>		<b>2 459 273.75</b>	<b>0.36</b>
<b>公認証券取引所に上場されている譲渡可能証券および金融市場商品合計</b>		<b>550 134 320.59</b>	<b>80.20</b>

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ - ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)

内容	数量 / 名目金額	先物 / 為替先物予約 / スワップに係る 未実現利益(損失)の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
<b>他の規制市場で取引されている譲渡可能証券および金融市場商品</b>			
<b>資産担保証券 - 固定金利</b>			
<b>米ドル</b>			
USD SOFI PROFESSIONAL LOAN PROG-144A 2.65000% 17-25.09.40	600 000.00	68 754.47	0.01
USD SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM-144A 3.59000% 18- 25.01.48	200 000.00	45 536.35	0.01
USD SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM-144A 3.60000% 18- 25.02.48	5 338 000.00	1 166 880.71	0.17
<b>米ドル合計</b>		<b>1 281 171.53</b>	<b>0.19</b>
<b>資産担保証券合計 - 固定金利</b>		<b>1 281 171.53</b>	<b>0.19</b>
<b>モーゲージ担保証券 - 固定金利</b>			
<b>米ドル</b>			
USD BAML COMMERCIAL MORTGAGE-144A 3.21800% 15-01.04.33	250 000.00	235 871.40	0.04
USD BWAY 2013-1515 MORTGAGE TRUST-144A 3.45430% 13-10.03.33	2 000 000.00	1 846 338.40	0.27
USD COMM 2015-3BP MORTGAGE TRUST-144A-SUB 3.17800% 15- 01.02.35	2 555 000.00	2 426 221.10	0.35
<b>米ドル合計</b>		<b>4 508 430.90</b>	<b>0.66</b>
<b>モーゲージ担保証券合計 - 固定金利</b>		<b>4 508 430.90</b>	<b>0.66</b>
<b>ノート - 固定金利</b>			
<b>米ドル</b>			
USD AKER BP ASA-144A 2.00000% 21-15.07.26	1 400 000.00	1 276 040.50	0.19
USD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BNK-REG-S-SUB 4.50000% 14- 19.03.24	5 250 000.00	5 223 356.30	0.76
USD BANK OF NEW ZEALAND-144A 3.50000% 19-20.02.24	2 500 000.00	2 487 357.15	0.36
USD BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL-REG-S 5.89600% 23- 13.07.26	2 000 000.00	2 012 579.60	0.29
USD BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT-REG-S 4.52400% 22-13.07.25	2 000 000.00	1 966 188.58	0.29
USD BAXTER INTERNATIONAL INC 1.32200% 22-29.11.24	1 000 000.00	956 642.13	0.14
USD BAYER US FINANCE LLC-144A 3.37500% 14-08.10.24	4 000 000.00	3 908 278.48	0.57
USD BLACKSTONE PRIVATE CREDIT FUND 2.62500% 22-15.12.26	1 000 000.00	880 457.62	0.13
USD BLOCK INC 2.75000% 21-01.06.26	1 000 000.00	922 214.10	0.13
USD BROADCOM INC 3.15000% 20-15.11.25	2 000 000.00	1 919 111.60	0.28
USD CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 5.14400% 23-28.04.25	1 000 000.00	993 362.51	0.15
USD CARRIER GLOBAL CORP 2.24200% 20-15.02.25	1 000 000.00	960 606.12	0.14
USD CENTENE CORP 4.25000% 20-15.12.27	1 500 000.00	1 416 000.00	0.21
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 2.85000% 16- 18.05.26	2 000 000.00	1 895 541.42	0.28
USD CREDIT AGRICOLE SA-144A 5.30100% 23-12.07.28	3 000 000.00	2 990 370.84	0.44
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL N.V 144A 4.25000% 22- 15.06.25	400 000.00	390 860.86	0.06
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 6.80000% 22- 14.10.25	470 000.00	478 483.67	0.07
USD FEDERATION DES CAISSES DESJARDINS-REG-S 2.05000% 20- 10.02.25	750 000.00	717 760.61	0.10
USD FIRSTENERGY TRANSMISSION LLC-144A 4.35000% 14-15.01.25	2 000 000.00	1 967 383.28	0.29
USD GUARDIAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 5.55000% 22-28.10.27	1 000 000.00	1 010 772.30	0.15
USD INTESA SANPAOLO SPA-144A 3.25000% 19-23.09.24	1 930 000.00	1 884 670.57	0.27
USD KEYSpan GAS EAST CORP-144A 2.74200% 16-15.08.26	1 000 000.00	922 971.09	0.13
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 4.15000% 22-26.08.25	1 000 000.00	981 705.59	0.14
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-144A 3.45000% 16- 18.12.26	2 000 000.00	1 894 455.24	0.28
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 4.05000% 22- 25.08.25	690 000.00	674 171.23	0.10
USD MONDELEZ INTERNATIONAL HOLDING NET-144A 0.75000% 21- 24.09.24	500 000.00	479 251.49	0.07
USD NATIONAL BANK OF CANADA 5.25000% 23-17.01.25	1 000 000.00	995 691.03	0.15

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ - ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)

内容	数量/ 名目金額	先物/為替先物予約/ スワップに係る 未実現利益(損失)の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
USD NATIONAL RURL UTILITS COPERTIVE FIN CRP 1.00000% 21-15.06.26	1 000 000.00	902 886.47	0.13
USD NESTLE HOLDINGS INC-144A 3.50000% 18-24.09.25	750 000.00	730 260.41	0.11
USD NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-144A 0.95000% 20-24.06.25	2 000 000.00	1 869 066.26	0.27
USD NIAGARA MOHAWK POWER CORP-144A 3.50800% 14-01.10.24	675 000.00	660 704.70	0.10
USD NORDEA BANK AB-144A 0.62500% 21-24.05.24	1 000 000.00	976 143.14	0.14
USD NORDEA BANK ABP -REG-S 3.60000% 22-06.06.25	1 400 000.00	1 363 020.95	0.20
USD NXP BV / NXP FUNDING LLC 4.87500% 22-01.03.24	2 500 000.00	2 489 350.00	0.36
USD PENSKE TRUCK LEASING CO LP / PTL-REG-S 1.70000% 21-15.06.26	1 000 000.00	902 166.44	0.13
USD PRINCIPAL LIFE GLOBAL FUNDING-144A 1.25000% 20-23.06.25	1 500 000.00	1 402 549.74	0.20
USD RABOBANK UTRECHT-144A 2.62500% 19-22.07.24	1 000 000.00	980 120.58	0.14
USD ROCHE HOLDINGS INC-144A 2.62500% 16-15.05.26	3 000 000.00	2 847 540.42	0.42
USD SIEMENS FINANCIERINGSMATSCHAPPIJ-144A 0.65000% 21-11.03.24	2 500 000.00	2 466 516.45	0.36
USD SKANDINAVISKA ENSK BANK-REG-S 1.20000% 21-09.09.26	4 000 000.00	3 568 880.00	0.52
USD SUNCORP-METWAY LTD-144A 3.30000% 19-15.04.24	2 350 000.00	2 327 436.44	0.34
USD SVENSKA HANDELSBANKEN AB-REG-S 5.25000% 23-15.06.26	2 850 000.00	2 846 054.20	0.41
USD TRITON CONTAINER INTERNATIONAL-REG-S 1.15000% 21-07.06.24	585 000.00	569 079.22	0.08
USD VAR ENERGI ASA-REG-S 5.00000% 22-18.05.27	1 500 000.00	1 435 972.58	0.21
USD WEA FIN LLC/ WESTF UK&EUR FIN PLC-REG-S 3.75000% 14-17.09.24	1 000 000.00	970 937.08	0.14
<b>米ドル合計</b>		<b>71 514 968.99</b>	<b>10.43</b>
<b>ノート合計 - 固定金利</b>		<b>71 514 968.99</b>	<b>10.43</b>
<b>ノート - 変動金利</b>			
<b>米ドル</b>			
USD AIB GROUP PLC-REG-S 7.583%/VAR 22-14.10.26	2 600 000.00	2 659 221.92	0.39
USD BANK OF IRELAND GROUP PLC-REG-S 6.253%/VAR 22-16.09.26	2 500 000.00	2 500 418.03	0.36
USD CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 4.985%/VAR 22-24.07.26	3 000 000.00	2 928 462.72	0.42
USD DANSKE BANK A/S-144A 3.773%/VAR 22-28.03.25	1 500 000.00	1 487 366.31	0.22
USD FEDERATION DES CAISSES DES-REG-S 5.278%/VAR 23-23.01.26	2 500 000.00	2 476 983.62	0.36
USD ING GROEP NV 3.869%/VAR 22-28.03.26	4 000 000.00	3 889 848.52	0.57
USD SKANDINAVISKA ENSKILDA BK AB-REG-S 0/N SOFR+96BP 22-09.06.25	500 000.00	501 147.29	0.07
USD US BANCORP 5.727%/VAR 22-21.10.26	1 500 000.00	1 494 302.17	0.22
<b>米ドル合計</b>		<b>17 937 750.58</b>	<b>2.61</b>
<b>ノート合計 - 変動金利</b>		<b>17 937 750.58</b>	<b>2.61</b>
<b>中期債券 - 固定金利</b>			
<b>米ドル</b>			
USD INTESA SANPAOLO SPA-144A-SUB 5.01700% 14-26.06.24	2 000 000.00	1 975 320.30	0.29
<b>米ドル合計</b>		<b>1 975 320.30</b>	<b>0.29</b>
<b>中期債券合計 - 固定金利</b>		<b>1 975 320.30</b>	<b>0.29</b>
<b>中期債券 - 変動金利</b>			
<b>米ドル</b>			
USD SOCIETE GENERALE SA-REG-S 6.447%/VAR 23-12.01.27	2 000 000.00	2 007 185.66	0.29
USD TRUIST FINANCIAL CORP 5.900%/VAR 22-28.10.26	2 000 000.00	1 990 890.48	0.29
<b>米ドル合計</b>		<b>3 998 076.14</b>	<b>0.58</b>
<b>中期債券合計 - 変動金利</b>		<b>3 998 076.14</b>	<b>0.58</b>

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ - ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)

内容	数量 / 名目金額	先物 / 為替先物予約 / スワップに係る 未実現利益(損失)の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
<b>長期債券 - 固定金利</b>			
米ドル			
USD PRICOA GLOBAL FUNDING I-REG-S 5.10000% 23-30.05.28	2 380 000.00	2 376 468.82	0.34
USD SYDNEY AIRPORT FINANCE CO PTY LTD-REG-S 3.62500% 16- 28.04.26	500 000.00	478 639.88	0.07
<b>米ドル合計</b>		<b>2 855 108.70</b>	<b>0.41</b>
<b>長期債券合計 - 固定金利</b>		<b>2 855 108.70</b>	<b>0.41</b>

<b>長期債券 - 変動金利</b>			
米ドル			
USD BANCO BILBAO VIZCA ARGENTARIA SA 5.862%/VAR 14.09.22- 14.09.26	7 000 000.00	6 970 711.30	1.02
USD SCENTRE GROUP TRUST 2-REG-S-SUB 4.750%/VAR 20-24.09.80	1 781 000.00	1 651 746.89	0.24
<b>米ドル合計</b>		<b>8 622 458.19</b>	<b>1.26</b>
<b>長期債券合計 - 変動金利</b>		<b>8 622 458.19</b>	<b>1.26</b>
<b>他の規制市場で取引されている譲渡可能証券および金融市場商品合計</b>		<b>112 693 285.33</b>	<b>16.43</b>

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

## 投資信託、オープン・エンド型

アイルランド			
USD UBS (IRL) SELECT MONEY MARKET FUND-USD-S-DIST	100.00	1 000 000.00	0.15
<b>アイルランド合計</b>		<b>1 000 000.00</b>	<b>0.15</b>

ルクセンブルグ			
USD UBS LUX BOND FUND - EURO HIGH YIELD EUR (USD HEDGED) U- X-ACC	800.00	8 716 408.00	1.27
<b>ルクセンブルグ合計</b>		<b>8 716 408.00</b>	<b>1.27</b>
<b>投資信託、オープン・エンド型合計</b>		<b>9 716 408.00</b>	<b>1.42</b>
<b>ルクセンブルグ2010年12月17日法(改正済)の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs合計</b>		<b>9 716 408.00</b>	<b>1.42</b>
<b>投資有価証券合計</b>		<b>672 544 013.92</b>	<b>98.05</b>

## デリバティブ商品

## 公認証券取引所に上場されたデリバティブ商品

債券先物			
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 28.03.24	675.00	495 703.80	0.07
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 28.03.24	-150.00	-93 750.15	-0.01
<b>債券先物合計</b>		<b>401 953.65</b>	<b>0.06</b>
<b>公認証券取引所に上場されたデリバティブ商品合計</b>		<b>401 953.65</b>	<b>0.06</b>
<b>デリバティブ商品合計</b>		<b>401 953.65</b>	<b>0.06</b>

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ - ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル(米ドル)

内容	数量 / 名目金額	先物 / 為替先物予約 / スワップに係る 未実現利益(損失)の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
<b>外国為替先物予約</b>			
<b>購入通貨 / 購入金額 / 売却通貨 / 売却金額 / 満期日</b>			
USD	719 715.75	EUR 650 000.00 19.1.2024	8 954.60 0.00
USD	3 368 341.63	CHF 3 000 000.00 16.2.2024	-110 610.90 -0.02
USD	1 785 508.15	GBP 1 475 000.00 29.2.2024	-82 963.16 -0.01
USD	1 127 941.46	EUR 1 030 000.00 26.3.2024	-1 440.85 0.00
USD	7 719 310.49	CHF 6 725 000.00 21.12.2023	-31 616.73 0.00
USD	4 354 969.60	EUR 4 000 000.00 2.5.2024	-38 622.38 -0.02
CHF	2 640 927.00	USD 3 000 000.00 21.12.2023	43 811.59 0.01
USD	1 111 123.00	EUR 1 000 000.00 15.7.2024	9 161.22 0.00
CHF	3 388 385.00	USD 3 840 212.93 21.12.2023	65 084.55 0.01
USD	2 028 088.80	EUR 1 800 000.00 15.7.2024	44 557.59 0.01
USD	4 916 696.40	EUR 4 400 000.00 9.8.2024	62 134.97 0.01
CHF	1 500 000.00	USD 1 746 907.97 16.2.2024	-7 431.71 0.00
EUR	850 000.00	USD 943 826.40 15.7.2024	-7 158.88 0.00
USD	1 489 380.75	EUR 1 350 000.00 30.8.2024	-1 505.05 0.00
USD	1 183 422.90	EUR 1 100 000.00 26.9.2024	-32 861.96 0.00
EUR	80 656 200.00	USD 88 060 035.88 3.1.2024	77 888.38 0.01
CHF	72 542 200.00	USD 82 427 293.13 3.1.2024	1 312 200.53 0.19
USD	128 179.84	CHF 113 000.00 3.1.2024	-2 262.34 0.00
USD	165 620.24	CHF 145 400.00 3.1.2024	-2 223.06 0.00
EUR	304 100.00	USD 334 411.20 3.1.2024	-2 102.68 0.00
CHF	872 600.00	USD 1 001 284.94 3.1.2024	6 005.74 0.00
EUR	1 001 700.00	USD 1 101 264.97 3.1.2024	-6 646.59 0.00
USD	3 825 855.03	CHF 3 325 600.00 3.1.2024	-13 069.90 0.00
外国為替先物予約合計			1 289 282.98 0.19
現金性銀行預金、要求払預金および預金勘定およびその他の当座資産			12 219 896.53 1.78
その他の資産および負債			-537 511.92 -0.08
純資産合計			685 917 635.16 100.00

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ - コーポレート・ボンド(米ドル)

## 2023年11月30日現在の投資有価証券ならびにその他純資産明細書

## 公認証券取引所に上場されている譲渡可能証券および金融市場商品

内容	数量/ 名目金額	先物/為替先物予約/ スワップに係る 未実現利益(損失)の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
ノート - 固定金利			
米ドル			
USD ABBVIE INC 3.20000% 20-21.11.29	2 000 000.00	1 816 008.76	0.61
USD ABBVIE INC 4.25000% 20-21.11.49	1 000 000.00	841 292.24	0.28
USD ADVANCE AUTO PARTS INC 5.90000% 23-09.03.26	2 000 000.00	1 972 357.78	0.67
USD AERCAP IRELAND CAP/ GLBL AVIATION TRUST 6.50000% 20-15.07.25	2 000 000.00	2 009 453.96	0.68
USD AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP 1.65000% 21-29.10.24	262 000.00	251 391.81	0.08
USD AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP GLO 3.30000% 21-30.01.32	750 000.00	621 672.38	0.21
USD AIR LEASE CORP 5.85000% 22-15.12.27	1 000 000.00	1 004 266.76	0.34
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC 2.00000% 21-18.05.32	750 000.00	566 315.84	0.19
USD AMGEN INC 5.75000% 23-02.03.63	2 250 000.00	2 201 824.46	0.74
USD ANHEUSER-BUSCH COS 4.70000% 19-01.02.36	3 500 000.00	3 335 169.81	1.13
USD AON CORP/AON GLOBAL HOLDINGS PLC 5.35000% 23-28.02.33	1 000 000.00	994 534.50	0.34
USD APPLE INC 4.85000% 23-10.05.53	2 500 000.00	2 419 813.93	0.82
USD ARROW ELECTRONICS INC 6.12500% 23-01.03.26	1 000 000.00	998 611.40	0.34
USD ASHTEAD CAPITAL INC-144A 1.50000% 21-12.08.26	1 500 000.00	1 336 476.39	0.45
USD AT&T INC 3.50000% 21-15.09.53	1 000 000.00	665 764.34	0.22
USD AT&T INC 4.35000% 13-15.06.45	2 000 000.00	1 600 594.66	0.54
USD AT&T INC 5.40000% 23-15.02.34	3 000 000.00	2 965 301.19	1.00
USD BARCLAYS PLC-SUB 4.37500% 14-11.09.24	1 870 000.00	1 839 298.30	0.62
USD BHP BILLITON FINANCE USA LTD 5.10000% 23-08.09.28	1 500 000.00	1 506 790.04	0.51
USD BOEING CO 5.80500% 20-01.05.50	1 000 000.00	975 312.65	0.33
USD BP CAPITAL MARKETS AMERICA INC 3.00000% 20-24.02.50	1 000 000.00	662 613.79	0.22
USD BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 5.75000% 23-01.02.31	1 500 000.00	1 562 640.33	0.53
USD CANADIAN PACIFIC RAILWAY 3.10000% 21-02.12.51	1 500 000.00	1 002 010.24	0.34
USD CELANESE US HOLDINGS LLC 6.33000% 22-15.07.29	1 500 000.00	1 527 689.19	0.52
USD CENTENE CORP 2.45000% 21-15.07.28	1 750 000.00	1 516 869.55	0.51
USD CF INDUSTRIES INC 5.15000% 14-15.03.34	1 000 000.00	946 840.50	0.32
USD CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING 5.25000% 22-01.04.53	1 750 000.00	1 401 443.86	0.47
USD CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING LLC 6.15000% 23-10.11.26	2 000 000.00	2 025 182.46	0.68
USD CNH INDUSTRIAL CAPITAL LLC 4.55000% 23-10.04.28	1 000 000.00	963 549.49	0.33
USD CONCENTRIX CORP 6.60000% 23-02.08.28	958 000.00	956 992.20	0.32
USD CONCENTRIX CORP 6.65000% 23-02.08.26	900 000.00	906 224.48	0.31
USD CONSOLIDATED EDISON CO OF NEW YORK INC 5.90000% 23-15.11.53	2 000 000.00	2 031 345.62	0.69
USD CONSTELLATION BRANDS INC 5.00000% 23-02.02.26	1 000 000.00	997 015.57	0.34
USD CREDIT AGRICOLE SA-144A-SUB 4.37500% 15-17.03.25	1 660 000.00	1 615 346.00	0.55
USD CVS HEALTH CORP 5.12500% 23-21.02.30	3 250 000.00	3 203 092.52	1.08
USD DCP MIDSTREAM OPERATING LP 5.60000% 14-01.04.44	1 000 000.00	931 588.40	0.31
USD DCP MIDSTREAM OPERATING LP 5.62500% 20-15.07.27	1 500 000.00	1 513 216.50	0.51
USD EATON CORP 4.15000% 22-15.03.33	1 000 000.00	933 390.97	0.32
USD ENBRIDGE INC 5.70000% 23-08.03.33	1 500 000.00	1 499 986.64	0.51
USD EQT CORP 3.90000% 17-01.10.27	1 250 000.00	1 178 228.50	0.40
USD EXELON CORP 4.95000% 16-15.06.35	1 450 000.00	1 335 613.02	0.45
USD FORD MOTOR CREDIT CO 3.37500% 20-13.11.25	1 000 000.00	942 158.92	0.32
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 6.79800% 23-07.11.28	1 000 000.00	1 021 044.55	0.34
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 7.12200% 23-07.11.33	1 000 000.00	1 042 167.67	0.35
USD GENERAL MOTORS CO 5.95000% 18-01.04.49	1 000 000.00	911 920.48	0.31
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 6.00000% 23-09.01.28	1 500 000.00	1 521 151.59	0.51
USD GILEAD SCIENCES INC 2.60000% 20-01.10.40	1 000 000.00	688 111.54	0.23

注記は財務書類の不可分の一部である。

## U B S ( L u x ) ボンド・シキャブ - コーポレート・ボンド(米ドル)

内容	数量/ 名目金額	先物/為替先物予約/ スワップに係る 未実現利益(損失)の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
USD GILEAD SCIENCES INC 5.55000% 23-15.10.53	1 500 000.00	1 514 240.97	0.51
USD GLOBAL PAYMENTS INC 4.15000% 19-15.08.49	2 000 000.00	1 460 349.78	0.49
USD HCA INC 5.25000% 19-15.06.49	2 250 000.00	1 951 801.92	0.66
USD HEALTHPEAK OP LLC 5.25000% 23-15.12.32	1 250 000.00	1 207 236.20	0.41
USD HEICO CORP 5.25000% 23-01.08.28	1 000 000.00	997 438.27	0.34
USD HOME DEPOT INC 3.30000% 20-15.04.40	1 500 000.00	1 168 817.21	0.39
USD HUMANA INC 5.70000% 23-13.03.26	1 000 000.00	999 950.10	0.34
USD INDIANA MICHIGAN POWER CO 5.62500% 23-01.04.53	1 000 000.00	976 423.79	0.33
USD INTEL CORP 5.70000% 23-10.02.53	1 500 000.00	1 523 936.85	0.51
USD INTEL CORP 5.90000% 23-10.02.63	1 500 000.00	1 568 918.43	0.53
USD INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC 3.00000% 20-15.06.50	1 825 000.00	1 202 930.98	0.41
USD INTUIT INC 5.50000% 23-15.09.53	1 750 000.00	1 795 680.87	0.61
USD INVITATION HOMES OPERATING PARTNER LP 5.45000% 23-15.08.30	1 000 000.00	965 592.97	0.33
USD JONES LANG LASALLE INC 6.87500% 23-01.12.28	2 000 000.00	2 061 609.64	0.70
USD KROGER CO 3.87500% 16-15.10.46	1 000 000.00	732 148.49	0.25
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.45000% 18-08.05.25	2 000 000.00	1 958 293.26	0.66
USD LOWE ' S COS INC 2.80000% 21-15.09.41	1 000 000.00	679 517.09	0.23
USD LSEGA FINANCING PLC-144A 1.37500% 21-06.04.26	526 000.00	478 411.34	0.16
USD LSEGA FINANCING PLC-144A 3.20000% 21-06.04.41	2 000 000.00	1 446 952.08	0.49
USD MARSH & MCLENNAN COS INC 5.75000% 22-01.11.32	2 000 000.00	2 081 223.24	0.70
USD MERCK & CO INC 5.15000% 23-17.05.63	1 000 000.00	972 682.07	0.33
USD NASDAQ INC 5.95000% 23-15.08.53	1 250 000.00	1 265 812.91	0.43
USD NATIONAL GRID PLC 5.80900% 23-12.06.33	1 500 000.00	1 505 735.66	0.51
USD NATIONAL RURAL UTILITIES COOP FIN CORP 4.45000% 23-13.03.26	1 000 000.00	984 612.71	0.33
USD NATIONAL RURAL UTILITIES COOPERATIVE 5.05000% 23-15.09.28	1 000 000.00	1 002 819.26	0.34
USD NEXTERA ENERGY CAPITAL 4.90000% 23-28.02.28	2 500 000.00	2 464 366.75	0.83
USD NISOURCE INC 5.25000% 23-30.03.28	1 000 000.00	998 641.96	0.34
USD NNN REIT INC 5.60000% 23-15.10.33	500 000.00	488 885.25	0.16
USD NORDSON CORP 5.60000% 23-15.09.28	1 250 000.00	1 276 982.49	0.43
USD NVIDIA CORP 3.70000% 20-01.04.60	750 000.00	577 243.77	0.19
USD ONEOK INC 6.62500% 23-01.09.53	2 000 000.00	2 100 130.20	0.71
USD ORACLE CORP 4.37500% 15-15.05.55	3 000 000.00	2 324 159.46	0.78
USD PFIZER INVESTMENT ENTERPRISES PTE LTD 5.30000% 23-19.05.53	2 750 000.00	2 693 517.75	0.91
USD POLARIS INC 6.95000% 23-15.03.29	1 500 000.00	1 543 748.28	0.52
USD PRUDENTIAL FINANCIAL INC 3.93500% 18-07.12.49	1 986 000.00	1 505 271.51	0.51
USD PUBLIC STORAGE 5.35000% 23-01.08.53	2 000 000.00	1 923 418.54	0.65
USD QUALCOMM INC 6.00000% 22-20.05.53	1 350 000.00	1 466 018.26	0.50
USD QUANTA SERVICES INC 3.05000% 21-01.10.41	2 000 000.00	1 358 402.00	0.46
USD RABOBANK NEDERLAND NV-SUB 3.75000% 16-21.07.26	1 000 000.00	946 475.97	0.32
USD SABINE PASS LIQUEFACTION LLC 5.00000% 17-15.03.27	1 450 000.00	1 436 508.24	0.49
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC5.52000% 23-13.01.28	1 000 000.00	1 007 050.87	0.34
USD T-MOBILE USA INC 3.60000% 21-15.11.60	1 900 000.00	1 267 126.04	0.43
USD TAPESTRY INC 7.05000% 23-27.11.25	1 500 000.00	1 518 583.83	0.51
USD TAPESTRY INC 7.85000% 23-27.11.33	2 000 000.00	2 031 169.10	0.69
USD TARGA RESOURCES CORP 4.95000% 22-15.04.52	1 500 000.00	1 230 508.55	0.42
USD TELEFONICA EMISIONES SA 5.52000% 19-01.03.49	750 000.00	666 913.13	0.23
USD TEXAS INSTRUMENTS INC 5.05000% 23-18.05.63	1 000 000.00	949 273.90	0.32
USD TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.12700% 20-29.05.50	1 000 000.00	688 434.54	0.23
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 3.95000% 12-15.10.42	956 000.00	778 945.49	0.26
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 4.86200% 15-21.08.46	1 000 000.00	892 654.18	0.30
USD WARNERMEDIA HOLDINGS INC 6.41200% 23-15.03.26	1 500 000.00	1 501 360.53	0.51
USD WESTERN MIDSTREAM OPERATING LP 6.15000% 23-01.04.33	1 000 000.00	1 007 266.00	0.34
米ドル合計		133 905 878.46	45.24
ノート合計 - 固定金利		133 905 878.46	45.24

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ - コーポレート・ボンド(米ドル)

内容	数量/ 名目金額	先物/為替先物予約/ スワップに係る 未実現利益(損失)の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
<b>ノート - 変動金利</b>			
<b>米ドル</b>			
USD ALLY FINANCIAL INC 6.992%/VAR 23-13.06.29	750 000.00	753 976.57	0.25
USD AMERICAN EXPRESS CO 6.489%/VAR 23-30.10.31	1 500 000.00	1 579 006.65	0.53
USD BANK OF AMERICA CORP 4.271%/VAR 18-23.07.29	2 500 000.00	2 361 029.02	0.80
USD BANK OF AMERICA CORP 5.202%/VAR 23-25.04.29	1 000 000.00	984 667.48	0.33
USD BANK OF AMERICA CORP 5.288%/VAR 23-25.04.34	1 500 000.00	1 442 174.14	0.49
USD BANK OF AMERICA CORP 5.872%/VAR 23-15.09.34	2 000 000.00	2 006 699.08	0.68
USD BARCLAYS PLC 6.692%/VAR 23-13.09.34	1 000 000.00	1 018 923.06	0.34
USD CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 5.817%/VAR 23-01.02.34	750 000.00	703 420.05	0.24
USD CITIGROUP INC 2.572%/VAR 20-03.06.31	3 250 000.00	2 683 524.15	0.91
USD CITIGROUP INC 3.520%/VAR 17-27.10.28	1 000 000.00	929 953.24	0.31
USD CITIGROUP INC 6.270%/VAR 22-17.11.33	1 000 000.00	1 031 263.35	0.35
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 6.720%/VAR 23-18.01.29	1 500 000.00	1 526 301.17	0.52
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.272%/VAR 17-29.09.25	2 000 000.00	1 955 631.36	0.66
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 1.992%/VAR 21-27.01.32	3 500 000.00	2 714 574.80	0.92
USD HSBC HOLDINGS PLC 2.099%/VAR 20-04.06.26	2 070 000.00	1 950 830.53	0.66
USD HSBC HOLDINGS PLC 2.848%/VAR 20-04.06.31	1 000 000.00	830 713.76	0.28
USD JPMORGAN CHASE & CO 4.452%/3M LIBOR+133BP 18-05.12.29	2 500 000.00	2 394 650.85	0.81
USD JPMORGAN CHASE & CO 1.040%/VAR 21-04.02.27	1 000 000.00	906 981.38	0.31
USD JPMORGAN CHASE & CO 2.545%/VAR 21-08.11.32	5 000 000.00	4 019 495.80	1.36
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 5.422%/VAR 23-22.02.29	1 000 000.00	996 926.95	0.34
USD MORGAN STANLEY 5.164%/VAR 23-20.04.29	3 000 000.00	2 950 143.51	1.00
USD MORGAN STANLEY 5.250%/VAR 23-21.04.34	1 500 000.00	1 437 241.77	0.48
USD PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE 5.582%/VAR 23-12.06.29	1 000 000.00	992 888.96	0.33
USD SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC 6.534%/VAR 23-10.01.29	500 000.00	504 208.35	0.17
USD US BANCORP 5.775%/VAR 23-12.06.29	1 250 000.00	1 249 143.68	0.42
USD WESTPAC BANKING CORP-SUB 2.668%/VAR 20-15.11.35	1 000 000.00	778 014.29	0.26
USD WESTPAC BANKING CORP-SUB 3.020%/VAR 21-18.11.36	1 000 000.00	773 959.35	0.26
<b>米ドル合計</b>		<b>41 476 343.30</b>	<b>14.01</b>
<b>ノート合計 - 変動金利</b>		<b>41 476 343.30</b>	<b>14.01</b>
<b>中期債券 - 固定金利</b>			
<b>米ドル</b>			
USD AMERICAN HONDA FINANCE CORP 5.25000% 23-07.07.26	1 500 000.00	1 508 352.65	0.51
USD JOHN DEERE CAPITAL CORP 5.15000% 23-08.09.26	1 000 000.00	1 007 074.29	0.34
USD JOHN DEERE CAPITAL CORP 5.15000% 23-08.09.33	2 000 000.00	2 018 664.98	0.68
<b>米ドル合計</b>		<b>4 534 091.92</b>	<b>1.53</b>
<b>中期債券合計 - 固定金利</b>		<b>4 534 091.92</b>	<b>1.53</b>
<b>中期債券 - 変動金利</b>			
<b>米ドル</b>			
USD BANK OF AMERICA CORP 3.559%/VAR 19-23.04.27	2 000 000.00	1 902 776.66	0.64
USD BANK OF AMERICA CORP 2.496%/3M LIBOR+99BP 20-13.02.31	3 000 000.00	2 490 038.16	0.84
USD MORGAN STANLEY 3.622%/VAR 20-01.04.31	2 250 000.00	1 996 802.46	0.68
<b>米ドル合計</b>		<b>6 389 617.28</b>	<b>2.16</b>
<b>中期債券合計 - 変動金利</b>		<b>6 389 617.28</b>	<b>2.16</b>

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ - コーポレート・ボンド(米ドル)

内容	数量/ 名目金額	先物/為替先物予約/ スワップに係る 未実現利益(損失)の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
<b>長期債券 - 固定金利</b>			
米ドル			
USD BALTIMORE GAS & ELECTRIC CO 3.50000% 16-15.08.46	1 040 000.00	734 186.73	0.25
USD CONSOLIDATED EDISON CO OF NEW YORK INC 4.65000% 18-01.12.48	1 240 000.00	1 046 331.06	0.35
USD DUKE ENERGY CAROLINAS LLC 6.05000% 08-15.04.38	765 000.00	790 684.69	0.27
USD DUKE ENERGY OHIO INC 4.30000% 19-01.02.49	1 660 000.00	1 313 031.34	0.44
USD DUKE ENERGY OHIO INC 5.65000% 23-01.04.53	1 000 000.00	979 276.07	0.33
USD EL PASO NATURAL GAS CO 8.37500% 03-15.06.32	1 050 000.00	1 176 568.95	0.40
USD PACIFIC GAS AND ELECTRIC CO 6.75000% 23-15.01.53	1 000 000.00	1 008 784.51	0.34
USD PACIFIC GAS AND ELECTRIC CO 6.15000% 23-15.01.33	1 750 000.00	1 743 029.12	0.59
USD SAN DIEGO GAS & ELECTRIC CO 4.10000% 19-15.06.49	830 000.00	637 107.33	0.21
USD SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 3.65000% 20-01.02.50	2 000 000.00	1 413 711.92	0.48
USD SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 5.30000% 23-01.03.28	1 000 000.00	1 007 415.86	0.34
USD SOUTHERN CALIFORNIA GAS CO 2.55000% 20-01.02.30	1 500 000.00	1 277 162.91	0.43
USD SPRINT CAPITAL CORPORATION 6.87500% 98-15.11.28	1 000 000.00	1 057 415.79	0.36
米ドル合計		14 184 706.28	4.79
長期債券合計 - 固定金利		14 184 706.28	4.79
<b>長期債券 - 変動金利</b>			
米ドル			
USD BP CAPITAL MARKETS PLC-SUB 4.875%/VAR 20-PRP	2 000 000.00	1 797 529.96	0.61
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 4.223%/VAR 18-01.05.29	1 000 000.00	944 026.44	0.32
米ドル合計		2 741 556.40	0.93
長期債券合計 - 変動金利		2 741 556.40	0.93
公認証券取引所に上場されている譲渡可能証券および金融市場商品合計		203 232 193.64	68.66

## 他の規制市場で取引されている譲渡可能証券および金融市場商品

## ノート - 固定金利

米ドル			
USD AKER BP ASA-144A 3.75000% 20-15.01.30	1 000 000.00	888 965.15	0.30
USD BOOZ ALLEN HAMILTON INC 5.95000% 23-04.08.33	1 000 000.00	1 009 801.96	0.34
USD BOSTON GAS CO-144A 6.11900% 23-20.07.53	1 500 000.00	1 464 001.11	0.50
USD BROADCOM INC-144A 4.92600% 22-15.05.37	2 000 000.00	1 831 862.40	0.62
USD CARRIER GLOBAL CORP-144A 6.20000% 23-15.03.54	3 000 000.00	3 171 143.25	1.07
USD CHENIERE ENERGY PARTNERS LP 4.00000% 21-01.03.31	1 350 000.00	1 190 845.67	0.40
USD COLUMBIA PIPELINES HOL COMPANY LLC-144A 6.05500% 23-15.08.26	2 000 000.00	2 024 239.94	0.68
USD COMCAST CORP 2.88700% 22-01.11.51	3 750 000.00	2 362 401.19	0.80
USD CONSTELLATION ENERGY GENERATION LLC 6.50000% 23-01.10.53	1 500 000.00	1 568 336.19	0.53
USD CSL FINANCE PLC-144A 4.05000% 22-27.04.29	1 000 000.00	955 555.74	0.32
USD CSL FINANCE PLC-144A 4.25000% 22-27.04.32	1 000 000.00	941 065.50	0.32
USD DIAMONDBACK ENERGY INC 6.25000% 22-15.03.33	1 000 000.00	1 035 258.77	0.35
USD EAST OHIO GAS CO/THE-144A 1.30000% 20-15.06.25	857 000.00	802 783.74	0.27
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-144A 6.80000% 22-14.10.25	1 250 000.00	1 272 562.95	0.43
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-144A 7.75000% 22-14.10.52	1 000 000.00	1 151 737.53	0.39
USD HYUNDAI CAPITAL AMERICA-144A 6.10000% 23-21.09.28	1 500 000.00	1 518 123.29	0.51
USD IQVIA INC-144A 5.70000% 23-15.05.28	1 000 000.00	997 130.00	0.34
USD JABIL INC 5.45000% 23-01.02.29	1 000 000.00	990 076.07	0.33
USD KENVUE INC 5.35000% 23-22.03.26	1 500 000.00	1 510 939.38	0.51
USD LIBERTY MUTUAL GROUP INC-144A 3.95100% 19-15.10.50	1 000 000.00	700 501.48	0.24
USD LOWE ' S COS INC 5.80000% 22-15.09.62	750 000.00	725 801.48	0.25

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ - コーポレート・ボンド(米ドル)

内容	数量/ 名目金額	先物/為替先物予約/ スワップに係る 未実現利益(損失)の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
USD MARS INC-144A 4.65000% 23-20.04.31	1 250 000.00	1 214 840.85	0.41
USD MARVELL TECHNOLOGY INC 5.95000% 23-15.09.33	2 000 000.00	2 026 103.32	0.68
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING 11-144A 5.05000% 23-14.06.28	2 000 000.00	1 980 407.06	0.67
USD MERCEDES-BENZ FIN NORTH AMERCA LL-144A 3.30000% 15-19.05.25	1 750 000.00	1 700 272.54	0.57
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-144A 5.40000% 23-12.09.28	2 500 000.00	2 506 050.05	0.85
USD NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CO LLC-144A 6.95000% 23-15.09.26	1 000 000.00	1 018 434.85	0.34
USD NXP BV / NXP FUNDING LLC 5.55000% 22-01.12.28	1 500 000.00	1 502 625.00	0.51
USD PENSKE TRUCK LEASING/PTL FIN CORP-144A 6.05000% 23-01.08.28	1 500 000.00	1 511 444.29	0.51
USD REGAL REXNORD CORP-144A 6.05000% 23-15.04.28	1 250 000.00	1 229 853.28	0.42
USD SCENTRE GROUP TRUST 1 / 2-144A 3.25000% 15-28.10.25	2 250 000.00	2 149 505.14	0.73
USD SOCIETE GENERALE SA-144A 4.00000% 17-12.01.27	1 400 000.00	1 314 690.13	0.44
USD SWEDBANK AB-144A 6.13600% 23-12.09.26	2 000 000.00	2 010 227.66	0.68
USD TECK RESOURCES LTD 3.90000% 20-15.07.30	1 000 000.00	900 464.41	0.30
USD TRITON CONTAINER INTERNATIONAL LTD-144A 1.15000% 21-07.06.24	1 000 000.00	972 785.00	0.33
USD VENTURE GLOBAL LNG INC-144A 9.50000% 23-01.02.29	1 000 000.00	1 031 795.15	0.35
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.35500% 22-15.03.32	3 000 000.00	2 393 064.12	0.81
USD VICI PROPERTIES LP /VCI NTE CO INC-144A 3.75000% 20-15.02.27	1 750 000.00	1 620 377.50	0.55
USD WARNERMEDIA HOLDINGS 5.05000% 23-15.03.42	3 500 000.00	2 889 713.47	0.98
<b>米ドル合計</b>		<b>58 085 786.61</b>	<b>19.63</b>
<b>ノート合計 - 固定金利</b>		<b>58 085 786.61</b>	<b>19.63</b>
<b>ノート - 変動金利</b>			
<b>米ドル</b>			
USD AIB GROUP PLC-144A 6.608%/VAR 23-13.09.29	2 000 000.00	2 038 559.88	0.69
USD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK-144A-SUB 2.570%/VAR 20-25.11.35	1 500 000.00	1 158 614.25	0.39
USD FIFTH THIRD BANCORP 1.707%/VAR 21-01.11.27	616 000.00	542 544.69	0.19
USD HSBC HOLDINGS PLC 6.332%/VAR 23-09.03.44	1 000 000.00	1 015 764.99	0.34
USD ING GROEP NV 3.869%/VAR 22-28.03.26	1 250 000.00	1 215 577.66	0.41
<b>米ドル合計</b>		<b>5 971 061.47</b>	<b>2.02</b>
<b>ノート合計 - 変動金利</b>		<b>5 971 061.47</b>	<b>2.02</b>
<b>中期債券 - 固定金利</b>			
<b>米ドル</b>			
USD KEYBANK NA/CLEVELAND OH 4.70000% 23-26.01.26	750 000.00	718 407.81	0.24
USD NBN CO LTD-144A 6.00000% 23-06.10.33	2 500 000.00	2 603 999.43	0.88
<b>米ドル合計</b>		<b>3 322 407.24</b>	<b>1.12</b>
<b>中期債券合計 - 固定金利</b>		<b>3 322 407.24</b>	<b>1.12</b>
<b>中期債券 - 変動金利</b>			
<b>米ドル</b>			
USD TRUIST FINANCIAL CORP 4.873%/VAR 23-26.01.29	750 000.00	718 870.17	0.24
USD TRUIST FINANCIAL CORP 7.161%/VAR 23-30.10.29	1 000 000.00	1 045 448.06	0.36
<b>米ドル合計</b>		<b>1 764 318.23</b>	<b>0.60</b>
<b>中期債券合計 - 変動金利</b>		<b>1 764 318.23</b>	<b>0.60</b>

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ - コーポレート・ボンド(米ドル)

内容	数量/ 名目金額	先物/為替先物予約/ スワップに係る 未実現利益(損失)の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
<b>長期債券 - 固定金利</b>			
米ドル			
USD AERCAP IRELAND CAPITAL DAC-REG-S 6.45000% 23-15.04.27	665 000.00	673 851.26	0.23
USD DOMINION ENERGY SOUTH CAROLINA INC 6.25000% 23-15.10.53	1 500 000.00	1 599 575.99	0.54
USD DUKE ENERGY FLORIDA LLC 5.95000% 22-15.11.52	750 000.00	769 308.83	0.26
USD NGPL PIPECO LLC-144A 4.87500% 17-15.08.27	1 240 000.00	1 192 387.67	0.40
USD SYDNEY AIRPORT FINANCE CO PTY LTD-144A 3.62500% 16- 28.04.26	1 000 000.00	957 279.76	0.32
米ドル合計		5 192 403.51	1.75
長期債券合計 - 固定金利		5 192 403.51	1.75
<b>長期債券 - 変動金利</b>			
米ドル			
USD CAIXABANK SA-144A 6.208%/VAR 23-18.01.29	1 000 000.00	994 268.73	0.33
USD DNB BANK ASA-144A 5.896%/VAR 22-09.10.26	1 000 000.00	999 862.28	0.34
米ドル合計		1 994 131.01	0.67
長期債券合計 - 変動金利		1 994 131.01	0.67
他の規制市場で取引されている譲渡可能証券および金融市場商品合計		76 330 108.07	25.79
<b>最近発行された譲渡可能証券および金融市場商品</b>			
ノート - 固定金利			
米ドル			
USD ROCHE HOLDINGS INC-144A 5.59300% 23-13.11.33	2 500 000.00	2 597 311.70	0.88
米ドル合計		2 597 311.70	0.88
ノート合計 - 固定金利		2 597 311.70	0.88
ノート - 変動金利			
米ドル			
USD DANSKE BANK A/S-144A 6.466%/VAR 23-09.01.26	1 000 000.00	1 002 457.94	0.34
米ドル合計		1 002 457.94	0.34
ノート合計 - 変動金利		1 002 457.94	0.34
最近発行された譲渡可能証券および金融市場商品合計		3 599 769.64	1.22
<b>ルクセンブルグ2010年12月17日法(改正済)の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs</b>			
投資信託、オープン・エンド型			
ルクセンブルグ			
USD UBS(LUX)BOND SICAV-GLBL SDG CORPORATES SUSTNBLE(USD) U- X-ACC	90.00	950 948.10	0.32
ルクセンブルグ合計		950 948.10	0.32
投資信託、オープン・エンド型合計		950 948.10	0.32
ルクセンブルグ2010年12月17日法(改正済)の第41条(1)e)に規定された UCITS/その他のUCIs合計		950 948.10	0.32
投資有価証券合計		284 113 019.45	95.99

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ - コーポレート・ボンド(米ドル)

内容	数量 / 名目金額	先物 / 為替先物予約 / スワップに係る 未実現利益(損失)の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
<b>デリバティブ商品</b>			
<b>公認証券取引所に上場されたデリバティブ商品</b>			
<b>債券先物</b>			
USD US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.03.24	15.00	20 273.45	0.01
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.03.24	-84.00	-56 437.50	-0.02
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 28.03.24	200.00	6 883.06	0.00
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 28.03.24	-5.00	-2 148.44	0.00
<b>債券先物合計</b>		<b>-31 429.43</b>	<b>-0.01</b>
<b>公認証券取引所に上場されたデリバティブ商品合計</b>		<b>-31 429.43</b>	<b>-0.01</b>
<b>デリバティブ商品合計</b>		<b>-31 429.43</b>	<b>-0.01</b>
<b>外国為替先物予約</b>			
<b>購入通貨 / 購入金額 / 売却通貨 / 売却金額 / 満期日</b>			
EUR 2 978 800.00	USD 3 200 353.61	11.1.2024	55 830.96 0.02
CHF 10 178 600.00	USD 11 363 786.07	11.1.2024	395 700.73 0.13
EUR 52 100.00	USD 57 109.60	11.1.2024	-158.07 0.00
CHF 169 900.00	USD 193 231.73	11.1.2024	3 056.25 0.00
CHF 136 600.00	USD 156 877.99	11.1.2024	938.01 0.00
CHF 204 200.00	USD 235 014.62	11.1.2024	900.65 0.00
EUR 61 600.00	USD 67 338.33	11.1.2024	-2.16 0.00
<b>外国為替先物予約合計</b>			<b>456 266.37 0.15</b>
現金性銀行預金、要求払預金および預金勘定およびその他の当座資産		10 666 969.70	3.60
その他の資産および負債		775 809.40	0.27
<b>純資産合計</b>		<b>295 980 635.49</b>	<b>100.00</b>

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ - ハイ・イールド・ボンド(米ドル)

## 2023年11月30日現在の投資有価証券ならびにその他純資産明細書

## 公認証券取引所に上場されている譲渡可能証券および金融市場商品

内容	数量 / 名目金額	先物 / 為替先物予約 / スワップに係る 未実現利益(損失)の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
<b>短期財務省証券 - ゼロ・クーポン</b>			
<b>米ドル</b>			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 23.03.23-21.03.24	13 900 000.00	13 675 797.31	2.63
<b>米ドル合計</b>		<b>13 675 797.31</b>	<b>2.63</b>
<b>短期財務省証券合計 - ゼロ・クーポン</b>		<b>13 675 797.31</b>	<b>2.63</b>
<b>ノート - 固定金利</b>			
<b>ユーロ</b>			
EUR ALLWYN ENTERTAINMENT FINANCING UK-REG-S 7.25000% 23-30.04.30	1 710 000.00	1 910 093.30	0.37
EUR CHROME HOLDCO REG-S-SUB 5.00000% 21-31.05.29	1 530 000.00	1 175 312.40	0.23
EUR NIDDA HEALTHCARE HOLDING GMBH-REG-S 7.50000% 22-21.08.26	6 410 000.00	7 129 717.58	1.37
EUR OLYMPUS WATER US HOLDING CORP-REG-S 9.62500% 23-15.11.28	1 000 000.00	1 117 500.26	0.21
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 3.75000% 21-09.05.27	925 000.00	948 317.83	0.18
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 7.37500% 23-15.09.29	2 710 000.00	3 096 830.18	0.60
<b>ユーロ合計</b>		<b>15 377 771.55</b>	<b>2.96</b>
<b>米ドル</b>			
USD ALTICE FINANCING SA-144A 5.00000% 20-15.01.28	1 119 000.00	958 149.23	0.18
USD ALTICE FRANCE-144A 8.12500% 18-01.02.27	3 655 000.00	3 143 923.18	0.60
USD AMERICAN AIRLINES INC-144A 7.25000% 23-15.02.28	1 390 000.00	1 372 825.84	0.26
USD AMERICAN AXLE & MANUFACTURING INC 6.50000% 18-01.04.27	1 140 000.00	1 099 710.46	0.21
USD ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-144A 4.12500% 19-15.08.26	215 000.00	190 198.68	0.04
USD BOMBARDIER INC-144A 7.87500% 19-15.04.27	2 695 000.00	2 696 956.57	0.52
USD BOMBARDIER INC-144A 7.12500% 21-15.06.26	1 260 000.00	1 259 893.65	0.24
USD BOMBARDIER INC-144A 6.00000% 21-15.02.28	725 000.00	683 421.98	0.13
USD BRANDYWINE OPERATING PARTNERSHIP LP 4.55000% 14-01.10.29	363 000.00	299 609.13	0.06
USD BUCKEYE PARTNERS LP 5.85000% 13-15.11.43	995 000.00	751 866.78	0.15
USD BUCKEYE PARTNERS LP 5.60000% 14-15.10.44	595 000.00	421 701.04	0.08
USD CARNIVAL CORP-144A 5.75000% 21-01.03.27	2 365 000.00	2 240 364.50	0.43
USD COMMERCIAL METALS CO 4.12500% 22-15.01.30	760 000.00	665 322.85	0.13
USD DANA INC 5.62500% 20-15.06.28	825 000.00	786 307.50	0.15
USD DISH DBS CORP 5.87500% 14-15.11.24	835 000.00	733 017.28	0.14
USD FORD MOTOR CO 5.29100% 16-08.12.46	530 000.00	430 813.04	0.08
USD FORD MOTOR CO 6.10000% 22-19.08.32	450 000.00	437 803.76	0.08
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 5.11300% 19-03.05.29	1 335 000.00	1 254 595.36	0.24
USD GENESIS ENERGY LP 8.00000% 20-15.01.27	905 000.00	905 831.22	0.17
USD ICAHN ENTERPRISES FINANCE CORP 5.25000% 20-15.05.27	450 000.00	407 250.00	0.08
USD ICAHN ENTERPRISES LP/FINANCE CORP 6.25000% 19-15.05.26	3 955 000.00	3 734 274.62	0.72
USD JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-144A 7.75000% 20-15.10.25	2 540 000.00	2 565 786.08	0.49
USD L BRANDS INC 6.87500% 15-01.11.35	865 000.00	818 380.04	0.16
USD MACYS RETAIL HOLDINGS INC 4.50000% 14-15.12.34	600 000.00	447 000.00	0.09
USD MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-144A 5.75000% 18-15.06.26	1 265 000.00	1 220 754.96	0.23
USD NAVIENT CORP 11.50000% 23-15.03.31	1 385 000.00	1 489 432.25	0.29
USD NEPTUNE ENERGY BONDCO PLC-144A 6.62500% 18-15.05.25	2 560 000.00	2 547 968.00	0.49
USD NEWELL BRANDS INC STEP-UP 16-01.04.36	1 390 000.00	1 227 568.49	0.24
USD NEWELL BRANDS INC STEP-UP/DOWN 16-01.04.46	385 000.00	308 029.75	0.06
USD NORDSTROM INC 4.37500% 19-01.04.30	365 000.00	303 474.68	0.06
USD NOVA CHEMICALS CORP-144A 8.50000% 23-15.11.28	589 000.00	608 437.00	0.12
USD OCEANEERING INTERNATIONAL INC 6.00000% 18-01.02.28	1 337 000.00	1 296 328.46	0.25

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ - ハイ・イールド・ボンド(米ドル)

内容	数量/ 名目金額	先物 / 為替先物予約 / スワップに係る 未実現利益(損失)の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
USD PG&E CORP 5.00000% 20-01.07.28	2 540 000.00	2 416 196.33	0.46
USD PRIMO WATER HOLDINGS INC-144A 4.37500% 21-30.04.29	1 464 000.00	1 298 939.02	0.25
USD RKPF OVERSEAS 2020 A LTD-REG-S 5.20000% 21-12.01.26	1 575 000.00	468 546.75	0.09
USD ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD 7.50000% 97-15.10.27	1 267 000.00	1 308 687.17	0.25
USD ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD-144A 5.50000% 21-01.04.28	440 000.00	420 340.23	0.08
USD SERVICE PROPERTIES TRUST 5.25000% 16-15.02.26	3 145 000.00	2 956 300.00	0.57
USD SOUTHWESTERN ENERGY CO 5.37500% 21-15.03.30	2 214 000.00	2 099 228.24	0.40
USD SPRINGLEAF FINANCE CORP 7.12500% 18-15.03.26	6 045 000.00	6 095 534.87	1.17
USD SPRINGLEAF FINANCE CORP 5.37500% 19-15.11.29	1 840 000.00	1 656 077.29	0.32
USD TELECOM ITALIA CAPITAL 7.72100% 08-06.04.38	1 020 000.00	1 017 616.77	0.20
USD TENET HEALTHCARE CORP 6.12500% 22-15.06.30	2 300 000.00	2 240 458.98	0.43
USD TRANSDIGM INC-SUB 5.50000% 20-15.11.27	1 790 000.00	1 722 748.09	0.33
USD TRANSDIGM INC-SUB 7.50000% 19-15.03.27	1 590 000.00	1 590 553.32	0.31
USD UNITED AIRLINES INC-144A 4.62500% 21-15.04.29	2 355 000.00	2 102 331.11	0.40
USD VIRGIN MEDIA VENDOR FINANC-144A 5.00000% 20-15.07.28	1 690 000.00	1 516 998.42	0.29
USD ZIGGO BV-144A 4.87500% 19-15.01.30	1 038 000.00	887 846.14	0.17
<b>米ドル合計</b>		<b>67 105 399.11</b>	<b>12.89</b>
<b>ノート合計 - 固定金利</b>		<b>82 483 170.66</b>	<b>15.85</b>
<b>ノート - 変動金利</b>			
<b>ユーロ</b>			
EUR VODAFONE GROUP PLC-REG-S-SUB 3.000%/VAR 20-27.08.80	1 250 000.00	1 152 474.38	0.22
<b>ユーロ合計</b>		<b>1 152 474.38</b>	<b>0.22</b>
<b>ノート合計 - 変動金利</b>		<b>1 152 474.38</b>	<b>0.22</b>
<b>中期債券 - 固定金利</b>			
<b>米ドル</b>			
USD NAVIENT CORP 6.75000% 18-15.06.26	3 580 000.00	3 566 389.55	0.69
<b>米ドル合計</b>		<b>3 566 389.55</b>	<b>0.69</b>
<b>中期債券合計 - 固定金利</b>		<b>3 566 389.55</b>	<b>0.69</b>
<b>長期債券 - 固定金利</b>			
<b>ユーロ</b>			
EUR 888 ACQUISITIONS LTD-REG-S 7.5580% 22-15.07.27	2 700 000.00	2 743 434.57	0.53
EUR ALTICE FRANCE-REG-S 2.50000% 19-15.01.25	2 900 000.00	2 957 834.19	0.57
EUR CIRSA FINANCE INTERNATIONAL SARL-REG-S 10.37500% 22-30.11.27	3 000 000.00	3 543 163.94	0.68
EUR IPD 3 BV-REG-S 8.00000% 23-15.06.28	2 290 000.00	2 594 700.90	0.50
EUR LHMC FINCO 2 SARL-REG-S (PIK) 7.25000% 19-02.10.25	3 325 158.00	3 582 728.90	0.69
EUR SUMMER BIDCO BV-REG-S (PIK) 9.00000% 19-15.11.25	4 830 000.00	6 255 748.33	1.20
EUR SUMMER BIDCO BV-REG-S (PIK) 9.00000% 20-15.11.25	600 000.00	813 957.55	0.15
<b>ユーロ合計</b>		<b>22 491 568.38</b>	<b>4.32</b>
<b>英ポンド</b>			
GBP BELLIS ACQUISITION CO PLC-REG-S 4.50000% 21-16.02.26	3 000 000.00	3 541 388.79	0.68
GBP GALAXY FINCO LTD-REG-S 9.25000% 19-31.07.27	3 070 000.00	3 491 990.15	0.67
<b>英ポンド合計</b>		<b>7 033 378.94</b>	<b>1.35</b>
<b>米ドル</b>			
USD ALTICE FINANCING SA-144A 5.75000% 21-15.08.29	1 837 000.00	1 510 166.29	0.29
USD CHEMOURS CO/THE 5.37500% 17-15.05.27	524 000.00	498 036.54	0.10
USD CLOUD SOFTWARE GROUP INC-144A 9.00000% 23-30.09.29	2 635 000.00	2 371 397.39	0.46
USD FORD MOTOR CO 7.45000% 99-16.07.31	2 330 000.00	2 453 128.34	0.47

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ - ハイ・イールド・ボンド(米ドル)

内容	数量/ 名目金額	先物 / 為替先物予約 / スワップに係る 未実現利益(損失)の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
USD NORDSTROM INC 6.95000% 98-15.03.28	420 000.00	424 819.50	0.08
USD TELECOM ITALIA CAPITAL 6.00000% 05-30.09.34	350 000.00	315 865.98	0.06
USD VZ SECURED FINANCING BV-144A 5.00000% 22-15.01.32	1 700 000.00	1 394 281.66	0.27
<b>米ドル合計</b>		<b>8 967 695.70</b>	<b>1.73</b>
<b>長期債券合計 - 固定金利</b>		<b>38 492 643.02</b>	<b>7.40</b>
<b>長期債券 - 変動金利</b>			
<b>ユーロ</b>			
EUR GOLDEN GOOSE SPA-REG-S 3M EURIBOR+487.5BP 21-14.05.27	2 990 000.00	3 270 544.97	0.63
<b>ユーロ合計</b>		<b>3 270 544.97</b>	<b>0.63</b>
<b>米ドル</b>			
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 6.500%/VAR 14-PRP	1 176 000.00	1 165 702.01	0.22
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 6.100%/VAR 14-PRP	1 015 000.00	1 009 729.21	0.19
<b>米ドル合計</b>		<b>2 175 431.22</b>	<b>0.41</b>
<b>長期債券合計 - 変動金利</b>		<b>5 445 976.19</b>	<b>1.04</b>
<b>公認証券取引所に上場されている譲渡可能証券および金融市場商品合計</b>		<b>144 816 451.11</b>	<b>27.83</b>

## 他の規制市場で取引されている譲渡可能証券および金融市場商品

## ノート - 固定金利

## 米ドル

USD ACADEMY LTD-144A 6.00000% 20-15.11.27	2 637 000.00	2 573 105.49	0.49
USD ACADIA HEALTHCARE CO INC-144A 5.00000% 20-15.04.29	597 000.00	557 311.44	0.11
USD ADT CORP-144A 4.87500% 16-15.07.32	1 655 000.00	1 450 309.60	0.28
USD AFFINITY GAMING-144A 6.87500% 20-15.12.27	3 661 000.00	3 154 561.67	0.61
USD AHEAD DB HOLDINGS LLC-144A 6.62500% 21-01.05.28	1 796 000.00	1 541 488.84	0.30
USD ALLISON TRANSMISSION INC-144A 5.87500% 19-01.06.29	1 679 000.00	1 625 051.38	0.31
USD AMERICAN AIRLINES INC-144A 5.50000% 21-20.04.26	842 000.00	690 761.37	0.13
USD AMERICAN AIRLINES INC-144A 5.75000% 21-20.04.29	805 000.00	771 221.65	0.15
USD AMERICAN BUILDER & CONTRACT SUPPLY-144A 4.00000% 19-15.01.28	660 000.00	607 487.36	0.12
USD AMSTED INDUSTRIES INC-144A 4.62500% 19-15.05.30	579 000.00	498 311.77	0.10
USD ANTERO MIDSTREAM PARTNERS LP-144A 5.37500% 21-15.06.29	1 260 000.00	1 179 918.43	0.23
USD ARAMARK SERVICES INC-144A 5.00000% 18-01.02.28	515 000.00	487 370.86	0.09
USD ARCHROCK PARTNERS LP/FIN CORP-144A 6.87500% 19-01.04.27	2 010 000.00	1 991 614.41	0.38
USD ARCHROCK PARTNERS LP/FIN CORP-144A 6.25000% 19-01.04.28	600 000.00	585 750.00	0.11
USD ARSENAL AIC PARENT LLC-144A 8.00000% 23-01.10.30	1 720 000.00	1 754 931.69	0.34
USD ASBURY AUTOMOTIVE GROUP INC-144A 4.62500% 21-15.11.29	1 015 000.00	914 110.52	0.18
USD ASCENT RESOURCES UTICA HOLDINGS-144A 7.00000% 18-01.11.26	1 100 000.00	1 084 840.35	0.21
USD ASCENT RESOURCES UTICA HOLDINGS-144A 8.25000% 20-31.12.28	740 000.00	740 654.90	0.14
USD ASCENT RESOURCES UTICA HOLDINGS-144A 5.87500% 21-30.06.29	2 039 000.00	1 873 798.38	0.36
USD ASGN INC-144A 4.62500% 19-15.05.28	4 204 000.00	3 912 158.32	0.75
USD ASHTON WOODS FINANCE CO-144A 4.62500% 21-01.08.29	630 000.00	530 044.16	0.10
USD ASHTON WOODS USA LLC/ASHTON FIN CO-144A 6.62500% 20-15.01.28	670 000.00	632 255.55	0.12
USD BEACON ROOFING SUPPLY INC-144A 4.12500% 21-15.05.29	871 000.00	769 194.03	0.15
USD BEACON ROOFING SUPPLY INC-144A 6.50000% 23-01.08.30	1 470 000.00	1 468 358.23	0.28
USD BIG RIVER STEEL LLC/BRS FIN CORP-144A 6.62500% 20-31.01.29	2 646 000.00	2 641 455.34	0.51
USD BLOCK INC 3.50000% 22-01.06.31	1 692 000.00	1 416 044.78	0.27
USD BLUE RACER MIDSTREAM LLC-144A 7.62500% 20-15.12.25	3 347 000.00	3 380 647.82	0.65
USD BOMBARDIER INC-144A 8.75000% 23-15.11.30	1 610 000.00	1 648 317.39	0.32
USD BUCKEYE PARTNERS LP-144A 4.50000% 20-01.03.28	1 685 000.00	1 537 387.20	0.30

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ - ハイ・イールド・ボンド(米ドル)

内容	数量 / 名目金額	先物 / 為替先物予約 / スワップに係る 未実現利益(損失)の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
USD BUILDERS FIRSTSOURCE INC-144A 5.00000% 20-01.03.30	1 598 000.00	1 488 187.99	0.29
USD BUILDERS FIRSTSOURCE INC-144A 6.37500% 22-15.06.32	755 000.00	742 884.06	0.14
USD CAESARS ENTERTAINMENT INC-144A 8.12500% 20-01.07.27	4 239 000.00	4 318 493.97	0.83
USD CALLON PETROLEUM CO-144A 8.00000% 21-01.08.28	2 640 000.00	2 677 073.52	0.51
USD CALPINE CORP-144A 5.12500% 19-15.03.28	2 452 000.00	2 307 657.88	0.44
USD CARNIVAL CORP-144A 6.00000% 21-01.05.29	1 800 000.00	1 651 500.00	0.32
USD CARNIVAL HOLDINGS BERMUDA-144A 10.37500% 22-01.05.28	4 050 000.00	4 403 971.33	0.85
USD CARRIAGE SERVICES INC-144A 4.25000% 21-15.05.29	2 668 000.00	2 257 661.60	0.43
USD CASCADES INC/CASCADES USA INC-144A 5.37500% 19-15.01.28	928 000.00	874 691.04	0.17
USD CATALENT PHARMA SOLUTIONS INC-144A 5.00000% 19-15.07.27	850 000.00	802 584.88	0.15
USD CCO HOLDINGS LLC-144A 4.25000% 20-01.02.31	2 360 000.00	1 968 708.46	0.38
USD CCO HOLDINGS LLC-144A 4.25000% 21-15.01.34	1 286 000.00	1 003 168.99	0.19
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.37500% 19-01.06.29	3 123 000.00	2 896 025.39	0.56
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 4.75000% 19-01.03.30	5 405 000.00	4 730 248.44	0.91
USD CDI-144A *ESCROW* 5.75000% 22-01.04.30	940 000.00	882 560.83	0.17
USD CENTURYLINK INC-144A 4.00000% 20-15.02.27	755 000.00	398 881.60	0.08
USD CHEMOURS CO/THE-144A 4.62500% 21-15.11.29	1 427 000.00	1 198 996.44	0.23
USD CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC-144A 8.00000% 19-15.03.26	1 855 000.00	1 785 923.51	0.34
USD CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC-144A 5.62500% 20-15.03.27	3 082 000.00	2 749 941.00	0.53
USD CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC-144A 6.87500% 21-15.04.29	2 713 000.00	1 600 670.00	0.31
USD CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC-144A 6.12500% 21-01.04.30	1 200 000.00	669 924.00	0.13
USD CIVITAS RESOURCES INC-144A 8.75000% 23-01.07.31	2 795 000.00	2 892 738.36	0.56
USD CLEAR CHANNEL OUTDOOR HOLDINGS INC-144A 5.12500% 19-15.08.27	1 930 000.00	1 786 409.12	0.34
USD CLEARWATER PAPER CORP-144A 4.75000% 20-15.08.28	1 592 000.00	1 420 678.36	0.27
USD CLEARWAY ENERGY OPERATING LLC-144A 4.75000% 19-15.03.28	2 875 000.00	2 690 447.71	0.52
USD CLOUD SOFTWARE GROUP INC-144A 6.50000% 22-31.03.29	4 510 000.00	4 153 162.67	0.80
USD CNT PRNT / CDK GB II LLC / CDK FNC-144A 8.00000% 23-15.06.29	1 520 000.00	1 559 200.80	0.30
USD CNX MIDSTREAM PARTNERS LP-144A 4.75000% 21-15.04.30	2 719 000.00	2 367 504.81	0.45
USD COMMSCOPE INC-144A 6.00000% 19-01.03.26	1 345 000.00	1 153 337.50	0.22
USD COMMSCOPE TECHNOLOGIES LLC-144A 6.00000% 15-15.06.25	403 000.00	316 355.00	0.06
USD COMPRESSCO PARTNERS/FINANCE-144A 7.50000% 18-01.04.25	1 925 000.00	1 902 766.25	0.37
USD COMSTOCK RESOURCES INC-144A 6.75000% 21-01.03.29	1 227 000.00	1 129 657.68	0.22
USD COMSTOCK RESOURCES INC-144A 5.87500% 21-15.01.30	643 000.00	557 764.12	0.11
USD CONSTELLIUM SE-144A 5.62500% 20-15.06.28	1 135 000.00	1 084 452.32	0.21
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 5.25000% 14-01.06.24	11 505 000.00	10 959 682.56	2.11
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 7.50000% 18-01.04.28	1 725 000.00	1 179 734.57	0.23
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 6.50000% 19-01.02.29	1 125 000.00	951 502.50	0.18
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 5.75000% 19-15.01.30	4 215 000.00	2 381 475.00	0.46
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 4.50000% 21-15.11.31	975 000.00	689 988.48	0.13
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 11.25000% 23-15.05.28	825 000.00	823 551.05	0.16
USD DARLING ESCROW CORP-144A 6.00000% 22-15.06.30	1 950 000.00	1 882 696.53	0.36
USD DAVITA INC-144A 4.62500% 20-01.06.30	1 586 000.00	1 340 510.72	0.26
USD DIRECTV FINANCING CO INC-144A 5.87500% 21-15.08.27	735 000.00	661 383.28	0.13
USD DISH DBS CORP 7.37500% 20-01.07.28	490 000.00	242 220.35	0.05
USD DISH DBS CORP 7.75000% 16-01.07.26	440 000.00	262 625.00	0.05
USD DISH NETWORK CORP-144A 11.75000% 22-15.11.27	3 520 000.00	3 494 048.80	0.67
USD ENERGIZER HOLDINGS INC-144A 4.75000% 20-15.06.28	1 625 000.00	1 452 530.62	0.28
USD ENERGIZER HOLDINGS INC-144A 4.37500% 20-31.03.29	1 177 000.00	1 015 144.85	0.19
USD ENLINK MIDSTREAM LLC-144A 6.50000% 22-01.09.30	1 935 000.00	1 947 571.02	0.37
USD EQM MIDSTREAM PARTNERS LP-144A 6.50000% 20-01.07.27	1 164 000.00	1 165 851.93	0.22
USD EQM MIDSTREAM PARTNERS LP-144A 7.50000% 22-01.06.27	1 570 000.00	1 604 676.59	0.31
USD EQT MIDSTREAM PARTNERS LP -144A 4.75000% 21-15.01.31	531 000.00	472 925.53	0.09

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ - ハイ・イールド・ボンド(米ドル)

内容	数量/ 名目金額	先物 / 為替先物予約 / スワップに係る 未実現利益(損失)の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
USD ERA GROUP INC-144A 6.87500% 21-01.03.28	2 865 000.00	2 728 654.68	0.52
USD FIRST QUANTUM MINERALS LTD-144A 6.87500% 20-15.10.27	1 179 000.00	951 287.94	0.18
USD FIRST QUANTUM MINERALS LTD-144A 8.62500% 23-01.06.31	600 000.00	483 774.00	0.09
USD FMG RESOURCES AUGUST 2006 PTY-144A 5.87500% 22-15.04.30	790 000.00	758 261.57	0.15
USD FMG RESOURCES AUGUST 2006 PTY-144A 6.12500% 22-15.04.32	740 000.00	714 237.90	0.14
USD FORESTAR GROUP INC-144A 3.85000% 21-15.05.26	1 724 000.00	1 604 624.86	0.31
USD FORTRESS TRANS & INFRA INV LLC-144A 5.50000% 21-01.05.28	2 035 000.00	1 911 038.18	0.37
USD FREEDOM MORTGAGE CORP-144A 12.00000% 23-01.10.28	2 575 000.00	2 720 487.65	0.52
USD FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATIO-144A 5.87500% 20-15.10.27	2 579 000.00	2 422 910.15	0.47
USD FRONTIER COMMUNICATIONS CORP-144A 6.75000% 20-01.05.29	2 262 000.00	1 915 596.87	0.37
USD FRONTIER COMMUNICATIONS HLDGS LLC-144A 8.75000% 22-15.05.30	665 000.00	663 112.50	0.13
USD GARDA WORLD SECURITY CORP-144A 9.50000% 19-01.11.27	1 199 000.00	1 156 475.15	0.22
USD GARDA WORLD SECURITY CORP-144A 4.62500% 20-15.02.27	1 433 000.00	1 362 531.51	0.26
USD GARTNER INC-144A 4.50000% 20-01.07.28	1 006 000.00	942 233.78	0.18
USD GENESIS ENERGY LP / GENESI ERGY FINANCE 8.87500% 23-15.04.30	1 026 000.00	1 043 130.83	0.20
USD GENWORTH MORTGAGE HOLDINGS INC-144A 6.50000% 20-15.08.25	2 610 000.00	2 577 998.53	0.49
USD GFL ENVIRONMENTAL INC-144A 4.75000% 21-15.06.29	582 000.00	531 562.43	0.10
USD GOODYEAR TIRE & RUBBER CO 5.25000% 22-15.07.31	3 215 000.00	2 789 012.50	0.54
USD GRAY ESCROW II INC-144A 5.37500% 21-15.11.31	1 937 000.00	1 380 895.83	0.26
USD GRAY TELEVISION INC-144A 5.87500% 16-15.07.26	1 920 000.00	1 795 200.00	0.34
USD GTCR W-2 MERGER SUB LLC-144A 7.50000% 23-15.01.31	1 800 000.00	1 833 750.00	0.35
USD HILCORP ENERGY I LP / HILCORP FINA-144A 6.00000% 22-15.04.30	960 000.00	895 490.40	0.17
USD HILCORP ENERGY I LP/FINANCE CO-144A 6.25000% 18-01.11.28	1 065 000.00	1 036 207.51	0.20
USD HILCORP ENERGY I LP/FINANCE CO-144A 5.75000% 21-01.02.29	2 529 000.00	2 376 855.36	0.46
USD HILTON DOMESTIC OPERATING CO INC-144A 4.00000% 20-01.05.31	2 165 000.00	1 904 794.93	0.37
USD HILTON GRAND VACATIONS BORROWER-144A 5.00000% 21-01.06.29	2 023 000.00	1 786 683.07	0.34
USD HOME POINT CAPITAL INC-144A 5.00000% 21-01.02.26	1 435 000.00	1 368 224.31	0.26
USD HOWARD MIDSTREAM ENERGY-144A 8.87500% 23-15.07.28	2 750 000.00	2 859 764.41	0.55
USD HUDSON PACIFIC PROPERTIES LP 5.95000% 22-15.02.28	953 000.00	803 503.82	0.15
USD I1-VI INC-144A 5.00000% 21-15.12.29	1 915 000.00	1 733 119.95	0.33
USD ILIAD HOLDING SASU-144A 6.50000% 21-15.10.26	3 400 000.00	3 317 087.60	0.64
USD INSTALLED BUILDING PRODUCTS INC-144A 5.75000% 19-01.02.28	1 358 000.00	1 277 849.33	0.25
USD INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC-144A 5.25000% 20-15.01.29	1 080 000.00	1 018 847.17	0.20
USD IRON MOUNTAIN INC-144A 4.87500% 17-15.09.27	1 895 000.00	1 793 864.42	0.34
USD IRON MOUNTAIN INC-144A 5.00000% 20-15.07.28	2 010 000.00	1 876 962.12	0.36
USD IRON MOUNTAIN INC-144A 5.25000% 20-15.07.30	1 905 000.00	1 746 984.63	0.34
USD JACOBS ENTERTAINMENT INC-144A 6.75000% 22-15.02.29	3 238 000.00	2 901 960.36	0.56
USD KBR INC-144A 4.75000% 20-30.09.28	3 565 000.00	3 182 039.03	0.61
USD KNIFE RIVER HOLDING CO-144A 7.75000% 23-01.05.31	1 395 000.00	1 432 751.49	0.27
USD L BRANDS INC-144A 6.62500% 20-01.10.30	2 953 000.00	2 922 854.89	0.56
USD LADDER CAPITAL FIN HLDG LLLP/CORP-144A 4.25000% 20-01.02.27	1 430 000.00	1 319 435.55	0.25
USD LADDER CAPITAL FINANCE HOLDINGS-144A 4.75000% 21-15.06.29	1 589 000.00	1 383 448.55	0.27
USD LCM INVESTMENTS HOLDINGS II LLC-144A 8.25000% 23-01.08.31	1 400 000.00	1 407 308.49	0.27
USD LCPR SENIOR SECURED FINANCING DAC-144A 6.75000% 19-15.10.27	473 000.00	444 773.72	0.09
USD LCPR SENIOR SECURED FINANCING DAC-144A 5.12500% 21-15.07.29	2 042 000.00	1 714 127.70	0.33
USD LEEWARD RENEWABLE ENERGY LLC-144A 4.25000% 21-01.07.29	1 447 000.00	1 217 385.99	0.23
USD LEVEL 3 FINANCING INC-144A 10.50000% 23-15.05.30	490 000.00	454 475.00	0.09
USD LITHIA MOTORS INC-144A 4.37500% 20-15.01.31	1 760 000.00	1 516 715.90	0.29

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ - ハイ・イールド・ボンド (米ドル)

内容	数量 / 名目金額	先物 / 為替先物予約 / スワップに係る 未実現利益 (損失) の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
USD MACQUARIE AIRFINANCE HOLDINGS LTD-144A 8.12500% 23-30.03.29	1 875 000.00	1 910 906.25	0.37
USD MACY ' S RETAIL HOLDINGS LLC-144A 6.12500% 22-15.03.32	660 000.00	591 891.30	0.11
USD MACYS RETAIL HOLDINGS INC-144A 5.87500% 21-01.04.29	577 000.00	542 322.30	0.10
USD MAUSER PACKAGING SOLUTIONS HOLDING-144A 7.87500% 23-15.08.26	2 685 000.00	2 667 229.87	0.51
USD MEDLINE BORROWER LP-144A 5.25000% 21-01.10.29	3 092 000.00	2 798 152.40	0.54
USD NABORS INDUSTRIES INC-144A 7.37500% 21-15.05.27	890 000.00	860 514.30	0.16
USD NABORS INDUSTRIES LTD-144A 7.25000% 20-15.01.26	1 865 000.00	1 781 895.60	0.34
USD NATIONAL FINANCIAL PARTNERS-144A 6.87500% 20-15.08.28	1 435 000.00	1 277 660.23	0.25
USD NATIONSTAR MORTGAGE HOLDINGS INC-144A 5.50000% 20-15.08.28	1 869 000.00	1 729 521.95	0.33
USD NATIONSTAR MORTGAGE HOLDINGS INC-144A 5.12500% 20-15.12.30	181 000.00	156 400.29	0.03
USD NCL CORP LTD-144A 5.87500% 20-15.03.26	1 885 000.00	1 786 037.50	0.34
USD NCL CORP LTD-144A 8.37500% 23-01.02.28	1 390 000.00	1 437 218.30	0.28
USD NCR CORP-144A 5.12500% 21-15.04.29	1 655 000.00	1 515 730.26	0.29
USD NEPTUNE BIDCO UNITED STATE INCORP-144A 9.29000% 22-15.04.29	4 080 000.00	3 789 050.71	0.73
USD NESCO HOLDINGS II INC-144A 5.50000% 21-15.04.29	3 282 000.00	2 942 690.43	0.57
USD NEXSTAR BROADCASTING INC-144A 4.75000% 20-01.11.28	1 516 000.00	1 341 884.37	0.26
USD NORDSTROM INC 4.25000% 21-01.08.31	325 000.00	256 587.50	0.05
USD NOVA CHEMICALS CORP-144A 5.25000% 17-01.06.27	2 680 000.00	2 412 395.56	0.46
USD NOVELIS CORP-144A 4.75000% 20-30.01.30	1 327 000.00	1 204 713.37	0.23
USD NRG ENERGY INC-144A 5.25000% 19-15.06.29	1 604 000.00	1 494 322.00	0.29
USD NRG ENERGY INC-144A 3.62500% 20-15.02.31	1 776 000.00	1 452 160.25	0.28
USD OLYMPUS WATER US HOLDING CORP-144A 7.12500% 22-01.10.27	500 000.00	479 840.76	0.09
USD OLYMPUS WATER US HOLDING CORP-144A 9.75000% 23-15.11.28	3 095 000.00	3 183 374.63	0.61
USD OLYMPUS WATER US HOLDING CORP-144A 6.2500% 21-01.10.29	1 100 000.00	902 346.49	0.17
USD ONTARIO GAMING GTA LP-144A 8.00000% 23-01.08.30	1 520 000.00	1 535 367.43	0.29
USD OPEN TEXT CORP / OPEN TEXT-144A 3.87500% 21-01.12.29	1 300 000.00	1 137 022.77	0.22
USD ORGANON FINANCE 1 LLC-144A 4.12500% 21-30.04.28	1 643 000.00	1 458 933.73	0.28
USD ORGANON FINANCE 1 LLC-144A 5.12500% 21-30.04.31	845 000.00	664 831.98	0.13
USD OWENS-BROCKWAY GLASS CONTAINER-144A 7.25000% 23-15.05.31	255 000.00	253 090.05	0.05
USD PATRICK INDUSTRIES INC-144A 7.50000% 19-15.10.27	1 792 000.00	1 779 106.60	0.34
USD PETSMART FINANCE CORP-144A 4.75000% 21-15.02.28	761 000.00	695 939.90	0.13
USD PETSMART INC / PETSMART FINANCE-144A 7.75000% 21-15.02.29	2 750 000.00	2 592 315.52	0.50
USD PRA GROUP INC-144A 7.37500% 20-01.09.25	1 715 000.00	1 647 429.00	0.32
USD PRA GROUP INC-144A 8.37500% 23-01.02.28	295 000.00	267 712.50	0.05
USD PRIME SEC SER BORROWER LLC/FIN INC-144A 5.75000% 19-15.04.26	1 000 000.00	989 071.10	0.19
USD QVC INC 4.75000% 20-15.02.27	866 000.00	662 585.02	0.13
USD RAISING CANE ' S RESTAURANTS LLC-144A 9.37500% 23-01.05.29	1 515 000.00	1 590 818.27	0.31
USD REGIONALCARE HOSPITAL PTRS HLDNGS-144A 9.75000% 18-01.12.26	1 340 000.00	1 295 601.51	0.25
USD ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD-144A 11.62500% 22-15.08.27	3 240 000.00	3 513 938.76	0.67
USD SABRE GLBL INC-144A 11.25000% 22-15.12.27	2 705 000.00	2 450 939.10	0.47
USD SCIENTIFIC GAMES INTERNATIONAL INC-144A 7.50000% 23-01.09.31	2 255 000.00	2 288 071.83	0.44
USD SEAGATE HDD CAYMAN-144A 8.25000% 23-15.12.29	1 390 000.00	1 480 350.00	0.28
USD SERVICE PROPERTIES TRUST 7.50000% 20-15.09.25	2 031 000.00	2 039 237.73	0.39
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 4.12500% 20-01.07.30	3 195 000.00	2 695 781.25	0.52
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 4.00000% 21-15.07.28	1 462 000.00	1 306 284.43	0.25
USD SMYRNA READY MIX CONCRETE LLC-144A 8.87500% 23-15.11.31	1 380 000.00	1 403 598.86	0.27
USD SMYRNA READY MIX CONCRETE-144A 6.00000% 20-01.11.28	2 091 000.00	1 986 918.59	0.38
USD STANDARD INDUSTRIES INC/NJ-144A 4.75000% 17-15.01.28	540 000.00	507 502.53	0.10
USD STAR PARENT INC-144A 9.00000% 23-01.10.30	1 345 000.00	1 396 861.86	0.27

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ - ハイ・イールド・ボンド (米ドル)

内容	数量 / 名目金額	先物 / 為替先物予約 / スワップに係る 未実現利益 (損失) の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
USD SUMMIT MATERIALS LLC/FIN CORP-144A 5.25000% 20-15.01.29	695 000.00	649 825.00	0.12
USD TALEN ENERGY SUPPLY LLC-144A 8.62500% 23-01.06.30	3 200 000.00	3 352 387.20	0.64
USD TENET HEALTHCARE CORP-144A 4.62500% 20-15.06.28	2 023 000.00	1 884 207.10	0.36
USD TENET HEALTHCARE CORP-144A 6.12500% 20-01.10.28	1 221 000.00	1 183 759.50	0.23
USD TERRAFORM POWER OPERATING LLC-144A 4.75000% 19-15.01.30	2 727 000.00	2 454 300.00	0.47
USD TRANSDIGM INC-144A 7.12500% 23-01.12.31	490 000.00	498 398.60	0.10
USD TRANSOCEAN AQUILA LTD-144A 8.00000% 23-30.09.28	1 130 000.00	1 132 226.09	0.22
USD TRANSOCEAN INC-144A 11.50000% 20-30.01.27	735 000.00	764 400.00	0.15
USD TRANSOCEAN INC-144A 8.75000% 23-15.02.30	245 000.00	237 704.51	0.05
USD TRANSOCEAN TITAN FINANCING LTD-144A 8.37500% 23-01.02.28	2 250 000.00	2 295 000.00	0.44
USD TRONOX INC-144A 4.62500% 21-15.03.29	2 097 000.00	1 782 995.43	0.34
USD UNITED NATURAL FODDS INC-144A 6.75000% 20-15.10.28	1 554 000.00	1 190 690.34	0.23
USD UNITI GROUP LP/FINANCE/CAPITAL-144A 10.50000% 23-15.02.28	2 899 000.00	2 851 515.54	0.55
USD UNIVISION COMMUNICATIONS INC-144A 4.50000% 21-01.05.29	1 683 000.00	1 476 704.76	0.28
USD UNIVISION COMMUNICATIONS INC-144A 7.37500% 22-30.06.30	1 590 000.00	1 560 433.31	0.30
USD UNIVISION COMMUNICATIONS INC-144A 8.00000% 23-15.08.28	245 000.00	247 655.80	0.05
USA COMPRESSION PARTNERS LLC 6.87500% 19-01.04.26	752 000.00	747 752.32	0.14
USA COMPRESSION PARTNERS LLC 6.87500% 19-01.09.27	2 756 000.00	2 720 517.88	0.52
USD VENTURE GLOBAL CALCASIEU PASS LLC-144A 3.87500% 21-15.08.29	1 912 000.00	1 676 550.20	0.32
USD VENTURE GLOBAL CALCASIEU PASS LLC-144A 4.12500% 21-15.08.31	170 000.00	146 637.68	0.03
USD VENTURE GLOBAL LNG INC-144A 8.12500% 23-01.06.28	1 635 000.00	1 621 048.54	0.31
USD VENTURE GLOBAL LNG INC-144A 8.37500% 23-01.06.31	2 460 000.00	2 423 908.65	0.47
USD VENTURE GLOBAL LNG INC-144A 9.50000% 23-01.02.29	2 200 000.00	2 269 949.33	0.44
USD VENTURE GLOBAL LNG INC-144A 9.87500% 23-01.02.32	1 485 000.00	1 521 890.68	0.29
USD VISTAJET MALTA FIN PLC/XO MANAGE-144A 9.50000% 23-01.06.28	1 430 000.00	1 168 429.17	0.22
USD WEATHERFORD INTERNATIONAL LTD-144A 8.6250% 21-30.04.30	1 403 000.00	1 444 290.29	0.28
USD WEEKLEY HOMES LLC / WEEKLEY FIN-144A 4.87500% 20-15.09.28	1 002 000.00	918 056.50	0.18
USD WESCO DISTRIBUTION INC-144A 7.25000% 20-15.06.28	720 000.00	732 125.89	0.14
USD WHITE CAP BUYER LLC-144A 6.87500% 20-15.10.28	1 493 000.00	1 362 262.13	0.26
USD WILLIAMS SCOTSMAN INC-144A 7.37500% 23-01.10.31	1 470 000.00	1 505 435.82	0.29
USD WR GRACE HOLDINGS LLC-144A 5.62500% 21-15.08.29	2 395 000.00	2 016 039.15	0.39
USD WYNDHAM DESTINATIONS INC-144A 6.62500% 20-31.07.26	1 975 000.00	1 974 140.88	0.38
USD ZF NORTH AMERICA CAPITAL INC-144A 6.87500% 23-14.04.28	2 000 000.00	2 028 498.00	0.39
米ドル合計		342 944 997.73	65.90
ノート合計 - 固定金利		342 944 997.73	65.90

## 中期債券 - 固定金利

米ドル

USD MINERAL RESOURCES LTD-144A 8.50000% 22-01.05.30	1 480 000.00	1 496 220.80	0.29
米ドル合計		1 496 220.80	0.29
中期債券合計 - 固定金利		1 496 220.80	0.29

## 中期債券 - 変動金利

米ドル

USD INTESA SANPAOLO SPA-144A-SUB 7.700%/VAR 15-PRP	1 400 000.00	1 345 159.34	0.26
USD UNICREDIT SPA-144A-SUB 5.459%/VAR 20-30.06.35	1 900 000.00	1 659 764.61	0.32
米ドル合計		3 004 923.95	0.58
中期債券合計 - 変動金利		3 004 923.95	0.58

## 長期債券 - 固定金利

米ドル

USD ADIENT GLOBAL HOLDINGS LTD-144A 7.00000% 23-15.04.28	980 000.00	995 745.66	0.19
--	------------	------------	------

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ - ハイ・イールド・ボンド(米ドル)

内容	数量 / 名目金額	先物 / 為替先物予約 / スワップに係る 未実現利益(損失)の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
USD EMERALD DEBT MERGER SUB LLC-144A 6.62500% 23-15.12.30	1 625 000.00	1 620 937.50	0.31
USD HUDBAY MINERALS INC-144A 6.12500% 20-01.04.29	1 995 000.00	1 887 569.25	0.36
米ドル合計		4 504 252.41	0.86
長期債券合計 - 固定金利		4 504 252.41	0.86
長期債券 - 変動金利			
米ドル			
USD VISTRA ENERGY CORP-144A-SUB 7.000%/VAR 21-PRP	160 000.00	152 000.00	0.03
米ドル合計		152 000.00	0.03
長期債券合計 - 変動金利		152 000.00	0.03
他の規制市場で取引されている譲渡可能証券および金融市場商品合計		352 102 394.89	67.66

## 公認証券取引所に上場されておらず他の規制市場において取引もされていない譲渡可能証券および金融市場商品

## ノート - 固定金利

米ドル			
USD FORTRESS TRANS & INFRA INV LLC-144A 7.87500% 23-01.12.30	725 000.00	737 552.42	0.14
米ドル合計		737 552.42	0.14
ノート合計 - 固定金利		737 552.42	0.14
公認証券取引所に上場されておらず他の規制市場において取引もされていない譲渡可能証券および金融市場商品合計		737 552.42	0.14

## 最近発行された譲渡可能証券および金融市場商品

## ノート - 固定金利

米ドル			
USD B&G FOODS INC-144A 8.00000% 23-15.09.28	505 000.00	516 112.02	0.10
USD CIVITAS RESOURCES INC-144A 8.37500% 23-01.07.28	1 275 000.00	1 305 843.53	0.25
USD CRSTWOD MIDSTREM PATNR / FINAC CRP-144A 7.37500% 23-01.02.31	1 340 000.00	1 377 600.40	0.26
USD DIAMOND FOREIGN ASSET CO/DIAMOND FIN-144A 8.50000% 23-01.10.30	1 852 000.00	1 857 339.31	0.36
USD LIFEPOINT HEALTH INC-144A 9.87500% 23-15.08.30	525 000.00	510 536.25	0.10
USD SERVICE PROPERTIES TRUST-144A 8.62500% 23-15.11.31	1 270 000.00	1 302 428.36	0.25
米ドル合計		6 869 859.87	1.32
ノート合計 - 固定金利		6 869 859.87	1.32
最近発行された譲渡可能証券および金融市場商品合計		6 869 859.87	1.32

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

## 投資信託、オープン・エンド型

アイルランド			
USD ISHARES USD HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	1.00	90.19	0.00
TOTAL Ireland		90.19	0.00
投資信託、オープン・エンド型合計		90.19	0.00
ルクセンブルグ2010年12月17日法(改正済)の第41条(1)e)に規定された UCITS/その他のUCIs合計		90.19	0.00

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS (Lux) ボンド・シキャブ - ハイ・イールド・ボンド (米ドル)

内容	数量 / 名目金額	先物 / 為替先物予約 / スワップに係る 未実現利益 (損失) の 米ドル建て評価額 (注1)	純資産額に 占める%
公認証券取引所に上場されておらず他の規制市場において取引もされていないデリバティブ商品			
その他のスワップに係るオプション、従来型			
米ドル			
USD BOA/CDX.NA.HY.41 V1 SWAPTION PUT 100.00000% 23-20.12.23	76 000 000.00	24 829.20	0.01
USD BOA/CDX.NA.HY.41 V1 SWAPTION PUT 98.00000% 23-20.12.23	-76 000 000.00	-4 088.80	0.00
USD BOA/CDX.NA.HY.41 V1 SWAPTION PUT 95.00000% 23-20.12.23	-76 000 000.00	-501.60	0.00
米ドル合計		20 238.80	0.01
その他のスワップに係るオプション、従来型合計		20 238.80	0.01
公認証券取引所に上場されておらず他の規制市場において取引もされていないデリバティブ商品合計		20 238.80	0.01
投資有価証券合計		504 546 587.28	96.96

## デリバティブ商品

## 公認証券取引所に上場されたデリバティブ商品

債券先物			
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.03.24	208.00	149 500.00	0.03
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 28.03.24	75.00	54 492.30	0.01
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 28.03.24	57.00	36 070.34	0.01
債券先物合計		240 062.64	0.05
公認証券取引所に上場されたデリバティブ商品合計		240 062.64	0.05

## 公認証券取引所に上場されておらず他の規制市場において取引もされていないデリバティブ商品

クレジット・デフォルト・スワップ*			
USD ICE/MARKIT CDX.NA.HY.S41 V2 CDI REC 5.00000% 23-20.12.28	9 900 000.00	484 941.60	0.09
USD ICE/MARKIT CDX.NA.HY.S41 V2 CDI REC 5.00000% 23-20.12.28	20 097 000.00	984 431.45	0.19
クレジット・デフォルト・スワップ合計		1 469 373.05	0.28
公認証券取引所に上場されておらず他の規制市場において取引もされていないデリバティブ商品合計		1 469 373.05	0.28
デリバティブ商品合計		1 709 435.69	0.33

## 外国為替先物予約

購入通貨 / 購入金額 / 売却通貨 / 売却金額 / 満期日			
AUD 13 292 300.00	USD 8 478 845.80	11.1.2024	346 256.64 0.06
USD 5 728 718.58	GBP 4 655 000.00	11.1.2024	-166 363.70 -0.03
CHF 47 006 500.00	USD 52 479 890.14	11.1.2024	1 827 413.06 0.35
USD 40 621 694.40	EUR 37 800 000.00	11.1.2024	-698 225.23 -0.13
EUR 19 591 200.00	USD 21 053 643.90	11.1.2024	361 880.16 0.07
AUD 182 600.00	USD 118 625.01	11.1.2024	2 607.86 0.00
EUR 74 100.00	USD 80 692.21	11.1.2024	307.95 0.00
USD 99 962.17	EUR 91 500.00	11.1.2024	-58.27 0.00
AUD 14 263 700.00	USD 9 408 442.07	11.1.2024	61 598.01 0.01
EUR 205 600.00	USD 225 392.66	11.1.2024	-647.28 0.00
CHF 649 100.00	USD 745 457.54	11.1.2024	4 457.27 0.00
外国為替先物予約合計			1 739 226.47 0.33

現金性銀行預金、要求払預金および預金勘定およびその他の当座資産	12 835 023.16	2.47
当座借越およびその他の短期負債	-2.75	0.00
その他の資産および負債	-438 170.32	-0.09
純資産合計	520 392 099.53	100.00

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

注記は財務書類の不可分の一部である。

## 5【販売及び買戻しの実績】

2023年12月末日前1年間における販売および買戻しの実績ならびに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
コーポレート・ ボンド(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	2,937,360.883 (575,970.323)	391,806.427 (53,768.476)	5,960,971.527 (1,064,413.445)
ハイ・イールド・ ボンド(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	4,818.437 (0.000)	22,989.886 (0.000)	170,201.267 (19,571.178)
ショート・ターム 米ドル コーポレート・ サステナブル (米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	944,733.268 (586,872.367)	350,469.367 (217,488.868)	908,211.563 (369,383.499)
	クラスP - m d i s t 投資証券	165,254.435 (165,154.435)	11,728.636 (11,628.636)	153,525.799 (153,525.799)

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