

## 【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2025年2月28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外国法共同事業

【事務連絡者氏名】 弁護士 三 浦 健  
同 大 西 信 治  
同 白 川 剛 士

【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外国法共同事業

【電話番号】 03 (6212) 8316

【届出の対象とした募集（売出）外国投資証券に係る外国投資法人の名称】 UBS (Lux) ボンド・シキャブ  
ーショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル  
(米ドル)  
(UBS (Lux) Bond SICAV - Short Term USD Corporates Sustainable  
(USD) )

【届出の対象とした募集（売出）外国投資証券の形態及び金額】 記名式無額面投資証券  
ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル (米ドル)  
クラスF-a c c 投資証券  
上限見込額は、以下の通りである。  
ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル (米ドル)  
クラスF-a c c 投資証券

12億3,540万米ドル (約1,763億円)

(注1) 上限見込額は、便宜上、ファンドの投資証券の2024年9月末日現在の1口当たりの純資産価格に基づいて算出されている  
(ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル (米ドル) クラスF-a c c 投資証券については、123.54米ドルに  
1,000万口を乗じて算出した金額である。)

(注2) 米ドルの円貨換算は、便宜上、2024年9月30日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値 (1米ドル＝  
142.73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3) ファンドは、ルクセンブルグ法に基づいて設立されているが、投資証券は米ドル建てのため、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。

【縦覧に供する場所】

該当事項なし

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出しましたので、2024年11月29日に提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報により更新および追加するため、本訂正届出書を提出するものです。

なお、本訂正届出書の記載事項のうち外貨数字の円貨換算については、直近の為替レートを用いておりますので、訂正前の換算レートとは異なっております。

## 2【訂正の内容】

### （1）半期報告書に係る訂正

半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正内容は、下記のとおりです。

原届出書の下記事項については、半期報告書の記載内容と同一内容に更新または追加されます。

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

※ 半期報告書の記載内容は以下のとおりです。

[次へ](#)

## 1 外国投資法人の概況

UBS (Lux) ボンド・シキャブーショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル (米ドル)  
(UBS (Lux) Bond SICAV - Short Term USD Corporates Sustainable (USD)) (以下、UBS (Lux)  
ボンド・シキャブを「本投資法人」、UBS (Lux) ボンド・シキャブーショート・ターム米ドルコーポ  
レート・サステナブル (米ドル) を「ファンド」または「サブ・ファンド」という。) の概況は以下の  
とおりである。

(注) ファンドにはクラスF-a-c-c投資証券以外の投資証券も存在し、その内クラスP-a-c-c投資証券およびクラスP-m-d  
i-s-t投資証券は日本で販売されているが、本書の中で、以下、ファンドについて「投資証券」というときは、上記のクラ  
スF-a-c-c投資証券を指すものとする。

### (1) 主要な経営指標等の推移

ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル (米ドル)

(別段の記載がない限り金額は米ドル)

|                                                        | 2022年11月末日<br>に終了する<br>中間会計年度末 | 2023年5月末日<br>に終了する<br>会計年度末 | 2023年11月末日<br>に終了する<br>中間会計年度末 | 2024年5月末日<br>に終了する<br>会計年度末 | 2024年11月末日<br>に終了する<br>中間会計年度末 |
|--------------------------------------------------------|--------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|
| (a) 営業収益 <sup>(1)</sup>                                | -24,112,187.12                 | 2,080,212.91                | 22,224,028.48                  | 36,420,195.40               | 21,779,877.53                  |
| (b) 経常利益金額または<br>経常損失金額                                | -24,112,187.12                 | 2,080,212.91                | 22,224,028.48                  | 36,420,195.40               | 21,779,877.53                  |
| (c) 当期純利益金額または<br>当期純損失金額                              | -24,112,187.12                 | 2,080,212.91                | 22,224,028.48                  | 36,420,195.40               | 21,779,877.53                  |
| (d) 出資総額 <sup>(2)</sup>                                | 665,956,437.30                 | 725,107,713.82              | 685,917,635.16                 | 666,370,855.77              | 753,765,952.46                 |
| (e) 発行済投資口総数<br>(クラスF-a-c-c投資証券)                       | 722,928,000口                   | 794,917,371口                | 678,041,371口                   | 736,940,911口                | 798,699,715口                   |
| (f) 純資産額                                               | 665,956,437.30                 | 725,107,713.82              | 685,917,635.16                 | 666,370,855.77              | 753,765,952.46                 |
| (g) 資産総額                                               | 670,524,547.78                 | 740,346,078.62              | 694,533,654.29                 | 682,693,075.50              | 754,485,964.54                 |
| (h) 1口当たり純資産価格<br>(クラスF-a-c-c投資証券)                     | 110.41                         | 113.01                      | 115.83                         | 119.09                      | 123.56                         |
| (i) 1口当たり<br>当期純利益金額または<br>当期純損失金額<br>(クラスF-a-c-c投資証券) | -0.44                          | 2.27                        | 2.92                           | 5.76                        | 4.42                           |
| (j) 分配総額                                               | 19,577.40                      | 131,987.07                  | 245,370.70                     | 486,858.27                  | 325,771.17                     |
| (k) 1口当たり分配金額<br>(クラスF-a-c-c投資証券)                      | 該当事項なし                         | 該当事項なし                      | 該当事項なし                         | 該当事項なし                      | 該当事項なし                         |
| (l) 自己資本比率                                             | 99.32%                         | 97.94%                      | 98.76%                         | 97.61%                      | 99.90%                         |
| (m) 自己資本利益率 <sup>(3)</sup><br>(クラスF-a-c-c投資証券)         | -4.12%                         | 1.06%                       | 4.91%                          | 5.38%                       | 6.67%                          |

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

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

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

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

## (2) 外国投資法人の出資総額

2024年12月末日現在の出資総額および発行済投資証券総数は以下のとおりである。

なお、原則として、発行可能投資口総口数には制限がない。

|                                        | 出資総額       |         | 発行済投資証券総数           |             |
|----------------------------------------|------------|---------|---------------------|-------------|
|                                        | 千米ドル       | 百万円     | (口)                 |             |
| ショート・ターム米ドル<br>コーポレート・サステナ<br>ブル (米ドル) | 719,953.84 | 113,882 | クラス<br>F-a c c 投資証券 | 808,850.241 |

(注) 米ドルの円貨換算は、便宜上、2024年12月30日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売相場場の仲値 (1米ドル＝158.18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。

## (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

(2024年12月末日現在)

| 氏 名                                                   | 役 職 名                                        | 略 歴                                                             | 所有投資口 |
|-------------------------------------------------------|----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|-------|
| ロバート・スティンガー<br>(Robert Süttinger)                     | 取締役会長<br>(チェアマン・オブ・<br>ザ・ボード・オブ・<br>ディレクターズ) | UBSアセット・マネジメント・<br>スイス・エイ・ジー (チューリッ<br>ヒ)、マネージング・ディレクター         | 該当なし  |
| フランチェスカ・<br>グアニーニ<br>(Francesca Guagnini)             | 取締役会役員<br>(メンバー・オブ・<br>ザ・ボード・オブ・<br>ディレクターズ) | UBSアセット・マネジメント<br>(UK) リミテッド、ロンドン、<br>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<br>(Josée Lynda Denis)                    | 取締役会役員<br>(メンバー・オブ・<br>ザ・ボード・オブ・<br>ディレクターズ) | ルクセンブルグ、<br>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<br>(Ioana Naum)                              | 取締役会役員<br>(メンバー・オブ・<br>ザ・ボード・オブ・<br>ディレクターズ) | UBSアセット・マネジメント・<br>スイス・エイ・ジー (チューリッ<br>ヒ)、エグゼクティブ・ディレクター        | 該当なし  |
| ラファエル・<br>シュミッターリヒター<br>(Raphael Schmidt-<br>Richter) | 取締役会役員<br>(メンバー・オブ・<br>ザ・ボード・オブ・<br>ディレクターズ) | UBSアセット・マネジメント<br>(ドイツ) ゲーエムベーハー、<br>フランクフルト、<br>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、2025年1月1日以降アーnst・アンド・ヤング、ルクセンブルグである。

## (5) その他

### a. 定款の変更

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

### b. 事業譲渡または事業譲受

投資法人およびそのサブ・ファンドの解散、サブ・ファンドの合併

本投資法人およびそのサブ・ファンドの解散

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

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

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

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

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

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

「合併」とは、以下の取引である。

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

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

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

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

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

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

[次へ](#)

## 2 外国投資法人の運用状況

### (1) 投資状況

資産別および地域別の投資状況

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)

(2024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   | 321,348,543.12 | 44.38    |
|       | 英国        | 80,678,216.18  | 11.14    |
|       | フランス      | 43,154,129.43  | 5.96     |
|       | オーストラリア   | 31,532,640.59  | 4.36     |
|       | オランダ      | 31,333,033.97  | 4.33     |
|       | スペイン      | 23,880,498.14  | 3.30     |
|       | カナダ       | 19,265,501.75  | 2.66     |
|       | アイルランド    | 16,375,412.37  | 2.26     |
|       | ドイツ       | 12,431,704.60  | 1.72     |
|       | スイス       | 11,011,234.32  | 1.52     |
|       | スウェーデン    | 9,639,396.46   | 1.33     |
|       | シンガポール    | 8,465,350.46   | 1.17     |
|       | ルクセンブルグ   | 8,275,851.83   | 1.14     |
|       | 日本        | 6,898,921.59   | 0.95     |
|       | デンマーク     | 6,463,581.16   | 0.89     |
|       | 中国        | 5,491,674.40   | 0.76     |
|       | イタリア      | 5,009,809.33   | 0.69     |
|       | ノルウェー     | 4,772,446.70   | 0.66     |
|       | フィンランド    | 4,729,523.95   | 0.65     |
|       | 大韓民国      | 4,600,595.00   | 0.64     |
|       | ニュージーランド  | 3,786,369.63   | 0.52     |
|       | 香港        | 3,529,614.45   | 0.49     |
|       | アラブ首長国連邦  | 3,238,389.00   | 0.45     |
|       | リベリア      | 2,985,900.00   | 0.41     |
|       | 英領ヴァージン諸島 | 2,913,840.00   | 0.40     |
|       | 国際機関      | 2,794,216.36   | 0.39     |
|       | メキシコ      | 2,452,645.00   | 0.34     |
|       | バミューダ     | 2,293,512.00   | 0.32     |
|       | オーストリア    | 2,025,696.88   | 0.28     |
|       | チリ        | 2,016,250.00   | 0.28     |
|       | 多国籍       | 1,968,762.60   | 0.27     |
|       | ベルギー      | 1,889,164.82   | 0.26     |
|       | ケイマン諸島    | 1,836,977.80   | 0.25     |
|       | トルコ       | 1,421,882.00   | 0.20     |
|       | インドネシア    | 947,500.00     | 0.13     |
|       | 小計        | 691,458,785.89 | 95.50    |



|                                          |         |                                 |        |
|------------------------------------------|---------|---------------------------------|--------|
| 投資信託                                     | ルクセンブルグ | 10,059,416.00                   | 1.39   |
|                                          | アイルランド  | 1,000,000.00                    | 0.14   |
|                                          | 小計      | 11,059,416.00                   | 1.53   |
| モーゲージ担保证券、<br>アセット・バック証券、<br>その他ディスカウント債 | アメリカ合衆国 | 3,294,464.42                    | 0.46   |
|                                          | 小計      | 3,294,464.42                    | 0.46   |
| ポートフォリオ合計                                |         | 705,812,666.31                  | 97.49  |
| 現金・その他資産（負債控除後）                          |         | 18,196,272.20                   | 2.51   |
| 資産総額                                     |         | 724,008,938.51                  | 100.00 |
| 負債総額                                     |         | 4,055,096.75                    | 0.56   |
| 合計（純資産総額）                                |         | 719,953,841.76<br>(約113,882百万円) | 99.44  |

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

## （２）運用実績

### ① 純資産等の推移

2024年12月末日までの１年間における各月末の資産総額および純資産の推移は以下のとおりである。

ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル（米ドル）

|           | 資産総額       |         | 純資産総額      |         | 1口当たり<br>純資産価格<br>(クラスF－a c c<br>投資証券) |        |
|-----------|------------|---------|------------|---------|----------------------------------------|--------|
|           | 千米ドル       | 百万円     | 千米ドル       | 百万円     | 米ドル                                    | 円      |
| 2024年1月末日 | 692,613.42 | 109,558 | 691,363.77 | 109,360 | 118.03                                 | 18,670 |
| 2月末日      | 695,584.97 | 110,028 | 682,770.87 | 108,001 | 117.81                                 | 18,635 |
| 3月末日      | 650,054.92 | 102,826 | 648,959.19 | 102,652 | 118.40                                 | 18,729 |
| 4月末日      | 637,804.90 | 100,888 | 637,329.89 | 100,813 | 118.09                                 | 18,679 |
| 5月末日      | 682,693.08 | 107,988 | 666,370.86 | 105,407 | 119.09                                 | 18,838 |
| 6月末日      | 648,980.59 | 102,656 | 647,162.01 | 102,368 | 119.70                                 | 18,934 |
| 7月末日      | 655,622.27 | 103,706 | 654,397.09 | 103,513 | 121.30                                 | 19,187 |
| 8月末日      | 664,030.42 | 105,036 | 661,987.32 | 104,713 | 122.45                                 | 19,369 |
| 9月末日      | 667,345.50 | 105,561 | 666,027.84 | 105,352 | 123.54                                 | 19,542 |
| 10月末日     | 651,226.61 | 103,011 | 650,771.72 | 102,939 | 123.02                                 | 19,459 |
| 11月末日     | 754,485.96 | 119,345 | 753,765.95 | 119,231 | 123.56                                 | 19,545 |
| 12月末日     | 724,008.94 | 114,524 | 719,953.84 | 113,882 | 123.83                                 | 19,587 |

サブ・ファンドの投資証券は、ルクセンブルグ証券取引所に上場されている。

同取引所での実質的な取引実績はない。

**② 分配の推移**

該当なし。

**③ 自己資本利益率（収益率）の推移**

2024年1月1日から2024年12月末日までの1年間の自己資本利益率（収益率）は以下のとおりである。

| ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル（米ドル） | 収益率            |       |
|-------------------------------|----------------|-------|
|                               | クラスF－a c c投資証券 | 5.51% |

（注）収益率（％）＝ $100 \times (a - b) / b$

a＝2024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＝2023年12月末日現在の1口当たり純資産価格（分配落の額）

**（3）投資リスク**

- ① 当中間計算期間において、2024年11月29日提出の有価証券報告書「第一部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 3 投資リスク」に記載される投資リスクについて、重要な変更はない。
- ② 本投資法人が将来にわたって営業活動を継続するにあたり重要な疑義を生じさせるような事象または状況、その他本投資法人の経営に重要な影響を及ぼす事象は、半期報告書提出日現在、存在しない。

[次へ](#)

### 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アセット・マネジメント (ヨーロッパ) エス・エイ

##### b) 資本金 (株主資本) の額

2024年12月末日現在の株主資本総額は、13,742,000ユーロ (約23億円)

(注) ユーロの円貨換算は、便宜上、2024年12月30日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値 (1ユーロ＝164.92円) による。以下同じ。

##### B. 投資運用会社

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

##### a) 名称

UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー (チューリッヒ)

##### b) 資本金の額

2024年12月末日現在の資本金額は、500,000スイス・フラン (約8,768万円)

(注) スイス・フランの円貨換算は、便宜上、2024年12月30日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値 (1スイス・フラン＝175.35円) による。以下同じ。

#### (2) 大株主の状況

##### A. 管理会社

UBSアセット・マネジメント (ヨーロッパ) エス・エイ

(2024年12月末日現在)

| 名称                                                    | 住所                                    | 所有株式数<br>(株) | 比率<br>(%) |
|-------------------------------------------------------|---------------------------------------|--------------|-----------|
| UBSアセット・<br>マネジメント・エイ・ジー<br>(UBS Asset Management AG) | バーンホフ・シュトラッセ45、<br>CH-8001 チューリッヒ、スイス | 6,871        | 100       |

##### B. 投資運用会社

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

UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー (チューリッヒ)

(2024年12月末日現在)

| 名称                                                    | 住所                                    | 所有株式数<br>(株) | 比率<br>(%) |
|-------------------------------------------------------|---------------------------------------|--------------|-----------|
| UBSアセット・<br>マネジメント・エイ・ジー<br>(UBS Asset Management AG) | バーンホフ・シュトラッセ45、<br>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アセット・マネジメント (ヨーロッパ) エス・エイ

(2024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<br>(Michael Kehl)               | チェアマン、<br>ディレクター／<br>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、<br>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<br>(Francesca Gigli Prym) | ディレクター／<br>ボード・メンバー           | 2019年12月5日 | UBSアセット・マネジメント (ヨーロッパ) エス・エイ、ルクセンブルグ、<br>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<br>(Eugène Del Cioppo)     | ディレクター／<br>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、<br>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<br>(Ann-Charlotte Lawyer) | ディレクター／<br>ボード・メンバー           | 2022年1月1日  | ルクセンブルグ大公国、<br>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

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)

(2024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<br>(Miederhoff Markus)           | ヴァイス・チェアマン             | 2019年6月20日就任 | 該当なし |
| ケッターラー・レト・ユー<br>(Ketterer Reto U.)           | ディレクター／<br>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<br>(Saliba Gaylee)                  | ディレクター／<br>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・<br>アレクサンダー<br>(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<br>(Stillhart Yvonne)            | 社外インディペンデント・<br>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<br>(Bjorheim Jacob)             | 社外インディペンデント・<br>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、本投資法人与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。

2024年12月末日現在、管理会社は以下のとおり、469本の投資信託／投資法人のサブ・ファンドの管理・運用を行っている。

| 国別 (設立国) | 種類別 (基本的性格)            | 本数  | 純資産額の合計 (通貨別)              |
|----------|------------------------|-----|----------------------------|
| ルクセンブルグ  | オープン・エンド型<br>投資信託／投資法人 | 469 | 609,330,539.61オーストラリア・ドル   |
|          |                        |     | 2,520,239,154.45カナダ・ドル     |
|          |                        |     | 17,388,039,411.62スイス・フラン   |
|          |                        |     | 2,750,459,068.89中国元        |
|          |                        |     | 4,273,255,710.46デンマーク・クローネ |
|          |                        |     | 68,939,450,718.28ユーロ       |
|          |                        |     | 3,385,406,010.69英ポンド       |
|          |                        |     | 209,881,622.69香港ドル         |
|          |                        |     | 1,001,035,532,928.54日本円    |
|          |                        |     | 60,491,737.18シンガポール・ドル     |
|          |                        |     | 132,262,594,652.81米ドル      |

## B. 投資運用会社

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

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

UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー (チューリッヒ)

2024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166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<br>(ユーロ) |
|---|-------------------------------------------------------------------|------------------|-------------|----------------|
| 1 | Multi Manager Access II - US<br>Multi Credit Sustainable          | 変動資本を有する<br>投資法人 | 2007年11月27日 | 5,001,304,384  |
| 2 | Multi Manager Access II -<br>Emerging Markets Debt                | 変動資本を有する<br>投資法人 | 2013年12月2日  | 4,505,326,194  |
| 3 | UBS (Lux) Bond Sicav - Convert<br>Global (EUR)                    | 変動資本を有する<br>投資法人 | 2004年11月18日 | 4,349,131,566  |
| 4 | Multi Manager Access II -<br>European Multi Credit<br>Sustainable | 変動資本を有する<br>投資法人 | 2007年8月21日  | 4,065,635,723  |
| 5 | Focused Sicav - High Grade<br>Long Term Bond USD                  | 変動資本を有する<br>投資法人 | 2006年10月26日 | 4,024,693,668  |

|    |                                                                                    |                  |             |               |
|----|------------------------------------------------------------------------------------|------------------|-------------|---------------|
| 6  | Credit Suisse Index Fund (Lux)<br>- CSIF (Lux) Equity Emerging<br>Markets ESG Blue | 変動資本を有する<br>投資法人 | 2017年5月26日  | 3,701,304,290 |
| 7  | UBS (Lux) Money Market Fund -<br>USD                                               | 契約型投資信託          | 1988年11月25日 | 3,623,895,024 |
| 8  | Multi Manager Access II - High<br>Yield                                            | 変動資本を有する<br>投資法人 | 2016年4月13日  | 3,302,877,823 |
| 9  | UBS (Lux) Money Market Fund -<br>EUR                                               | 契約型投資信託          | 1989年10月9日  | 3,260,083,794 |
| 10 | Multi Manager Access - Green,<br>Social and Sustainable Bonds                      | 変動資本を有する<br>投資法人 | 2022年3月10日  | 2,084,253,406 |

(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。

[次へ](#)

#### 4 外国投資法人の経理状況

- a. ファンドの日本語の中間財務書類は、ルクセンブルグにおける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「特定有価証券の内容等の開示に関する内閣府令」に基づき、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第328条第5項ただし書の規定の適用によるものである。
- b. 原文の中間財務書類は、UBS (Lux) ボンド・シキャブおよび全てのサブ・ファンドにつき一括して作成されている。日本語の作成にあたっては関係するサブ・ファンドに関連する部分のみを翻訳している。ただし、各サブ・ファンドには以下に記載した投資証券以外の投資証券も存在するが、以下に記載した投資証券に関連する部分を抜粋して日本語に記載している。
- －ショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル（米ドル）クラスF－a c c投資証券
- c. ファンドの原文の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。
- d. ファンドの原文の中間財務書類は、米ドルで表示されている。日本語の中間財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円による金額は、2024年12月30日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝158.18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・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                         | 2024年11月30日    | 2024年11月30日 |
| 投資有価証券、取得原価                | 708,153,298.85 | 112,015,689 |
| 投資有価証券、未実現評価益（評価損）         | 9,157,967.75   | 1,448,607   |
| 投資有価証券合計（注１）               | 717,311,266.60 | 113,464,296 |
| 現金性銀行預金、要求払預金<br>および預金勘定   | 26,522,181.47  | 4,195,279   |
| その他当座資産（証拠金）               | 813,352.05     | 128,656     |
| 発行に係る未収金                   | 121,233.93     | 19,177      |
| 有価証券に係る未収利息                | 7,625,941.90   | 1,206,271   |
| 当座資産に係る未収利息                | 8.01           | 1           |
| 金融先物に係る未実現利益（注１）           | 99,063.68      | 15,670      |
| 外国為替先物予約に係る<br>未実現利益（注１）   | 1,992,916.90   | 315,240     |
| 資産合計                       | 754,485,964.54 | 119,344,590 |
| 負債                         |                |             |
| 未払買戻代金                     | -472,205.18    | -74,693     |
| 定率報酬引当金（注２）                | -197,715.15    | -31,275     |
| 年次税引当金（注３）                 | -28,720.27     | -4,543      |
| その他の手数料および報酬に係る<br>引当金（注２） | -21,371.48     | -3,381      |
| 引当金合計                      | -247,806.90    | -39,198     |
| 負債合計                       | -720,012.08    | -113,892    |
| 期末純資産                      | 753,765,952.46 | 119,230,698 |

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                                 | 2024年6月1日－2024年11月30日 | 2024年6月1日－2024年11月30日 |
| 当座資産に係る利息                          | 152,068.13            | 24,054                |
| 有価証券利息                             | 12,988,014.20         | 2,054,444             |
| 配当金                                | 22,658.67             | 3,584                 |
| 貸付証券に係る純収益（注12）                    | 82,598.84             | 13,065                |
| その他収益（注4）                          | 108,473.48            | 17,158                |
| 収益合計                               | 13,353,813.32         | 2,112,306             |
| 費用                                 |                       |                       |
| 定率報酬（注2）                           | -1,122,007.90         | -177,479              |
| 年次税（注3）                            | -71,914.51            | -11,375               |
| その他の手数料および報酬（注2）                   | -57,601.33            | -9,111                |
| 現金および当座借越に係る利息                     | -3,191.10             | -505                  |
| 費用合計                               | -1,254,714.84         | -198,471              |
| 投資純利益（損失）                          | 12,099,098.48         | 1,913,835             |
| 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<br>実現利益（損失）      | -1,581,897.96         | -250,225              |
| オプションに係る実現利益（損失）                   | -79,005.00            | -12,497               |
| 利回り評価証券および金融市場商品に係る<br>実現利益（損失）    | -0.03                 | 0                     |
| 金融先物に係る実現利益（損失）                    | 606,866.42            | 95,994                |
| 外国為替先物予約に係る実現利益（損失）                | -1,306,675.48         | -206,690              |
| 外国為替に係る実現利益（損失）                    | -5,598.64             | -886                  |
| 実現利益（損失）合計                         | -2,366,310.69         | -374,303              |
| 当期実現純利益（損失）                        | 9,732,787.79          | 1,539,532             |
| 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<br>未実現評価益（評価損）   | 12,507,971.81         | 1,978,511             |
| オプションに係る未実現評価益（評価損）                | 78,225.30             | 12,374                |
| 利回り評価証券および金融市場商品に係る<br>未実現評価益（評価損） | 71,151.82             | 11,255                |
| 金融先物に係る未実現評価益（評価損）                 | 52,188.08             | 8,255                 |
| 外国為替先物予約に係る未実現評価益<br>（評価損）         | -662,447.27           | -104,786              |
| 未実現評価益（評価損）の変動合計                   | 12,047,089.74         | 1,905,609             |
| 運用活動による純資産の純増加（減少）                 | 21,779,877.53         | 3,445,141             |

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS（Lux）bond・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                    |
|--------------------|-----------------------|-----------------------|
|                    | 2024年6月1日－2024年11月30日 | 2024年6月1日－2024年11月30日 |
| 期首純資産              | 666,370,855.77        | 105,406,542           |
| 発行額                | 194,561,251.93        | 30,775,699            |
| 買戻額                | -128,620,261.60       | -20,345,153           |
| 合計純発行額（買戻額）        | 65,940,990.33         | 10,430,546            |
| 支払配当金              | -325,771.17           | -51,530               |
| 投資純収益（損失）          | 12,099,098.48         | 1,913,835             |
| 実現利益（損失）合計         | -2,366,310.69         | -374,303              |
| 未実現評価益（評価損）の変動合計   | 12,047,089.74         | 1,905,609             |
| 運用活動による純資産の純増加（減少） | 21,779,877.53         | 3,445,141             |
| 期末純資産              | 753,765,952.46        | 119,230,698           |

## 発行済投資証券口数の変動

|         | 2024年6月1日－2024年11月30日 |
|---------|-----------------------|
| クラス     | F-acc                 |
| 期首発行済口数 | 736,940.9110          |
| 発行口数    | 203,682.8040          |
| 買戻口数    | -141,924.0000         |
| 期末発行済口数 | 798,699.7150          |

## 財務書類の注記

(2024年11月30日現在)

## 注1－重要な会計方針の要約

当財務書類は、ルクセンブルグの投資信託に適用される一般に公正妥当と認められている会計原則に従って作成されている。重要な会計方針は、以下の通りである。

## a) 純資産価額の計算

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

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

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

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

## b) 評価の原則

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

スイング・プライシングの技法は、すべてのサブ・ファンドに適用される。

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

#### c) 外国為替先物予約の評価

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

#### d) 金融先物契約の評価

金融先物契約は、評価日に適用可能な最新の公表価格に基づいて評価される。実現損益および未実現損益の増減は、運用計算書に計上される。実現損益はF I F O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（O T C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2024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、2024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=7.233050人民元

---

1 米ドル=0.946790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しレート契約、およびクレジット・デフォルト・スワップを締結することができる。

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

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

n) サブ・ファンド間投資

2024年11月30日現在、或るサブ・ファンドは、UBS (Lux) ボンド・シキャプの他のサブ・ファンドに投資を行った。

サブ・ファンド間投資の総額は、37,238,261.80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、15,983,719,436.74米ドルであった。



## 注2 一定率報酬

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・シキャプーショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル (米ドル)

|                  | 上限定率報酬   |
|------------------|----------|
| 名称に「F」が付く投資証券クラス | 年率0.290% |

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

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

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

本投資法人はまた、本投資法人の所得および資産に賦課されるすべての租税、特に年次税を支払う。報酬制度を用いない他のファンド・プロバイダーとの一般的比較可能性を持たせることを目的に、「最大管理報酬」は定率報酬の80%と定める。

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

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

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

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

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

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

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

本投資法人の現行の手数料については、KIDで参照することができる。

### 注3－年次税

本投資法人はルクセンブルグの法律に基づく。ルクセンブルグ大公国の現行法に従い、本投資法人は、ルクセンブルグの源泉徴収税、所得税、キャピタル・ゲイン税または富裕税の対象とならない。ただし、各サブ・ファンドは、純資産総額について年利0.05%またはF、I-A1、I-A2、I-A3、I-B、I-X、およびU-Xクラスについては0.01%のルクセンブルグの年次税を課せられ、各四半期末に支払わなければならない。かかる税金は、各四半期末に各サブ・ファンドの純資産総額について計算される。0.01%の軽減税率の恩恵を受ける条件が満たされなくなった場合には、F、I-A1、I-A2、I-A3、I-A4、I-B、I-X、およびU-Xクラスの投資証券については0.05%課税されることがある。

### 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ー金融先物およびスワップに関する契約

2024年11月30日現在のサブ・ファンドによる金融先物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<br>(買い) | 債券に係る金融先物<br>(売り) |
|---------------------------------|-------------------|-------------------|
| ーショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル (米ドル) | 144,276,563.20米ドル | 38,736,562.68米ドル  |
|                                 |                   |                   |
| UBS (Lux) ボンド・シキャブ              | 金利に係る金融先物<br>(買い) | 債券に係る金融先物<br>(売り) |
| 該当なし                            |                   |                   |

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

## b) スワップ

| UBS (Lux) ボンド・シキャブ | クレジット・デフォルト・スワップ (買い)    | クレジット・デフォルト・スワップ (売り)    |
|--------------------|--------------------------|--------------------------|
| 該当なし               |                          |                          |
|                    |                          |                          |
| UBS (Lux) ボンド・シキャブ | 金利に係るスワップおよび先渡しスワップ (買い) | 金利に係るスワップおよび先渡しスワップ (売り) |
| 該当なし               |                          |                          |

## 注7ーソフト・コミッション契約

2024年6月1日から2024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ー総費用比率 (TER)

この比率は、スイス・アセット・マネジメント協会 (AMAS) の現行の「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T E R

| UBS (Lux) ボンド・シキャブ                                 | 総費用比率 (T E R) |
|----------------------------------------------------|---------------|
| ーショート・ターム米ドルコーポレート・サステナブル (米ドル)<br>クラスF-a c c 投資証券 | 0.32%         |

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

運用期間が12か月未満の投資証券クラスに関する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ー償還

以下の償還が生じた。

| サブ・ファンド                       | 日付          |
|-------------------------------|-------------|
| UBS (Lux) ボンド・シキャブー2024 (米ドル) | 2024年10月15日 |

## 注10ー後発事象

期末後に財務書類に調整または開示を必要とする事象はなかった。

## 注11ー適用ある法律、実行の場所、および正式言語

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

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

## 注12ー貸付証券

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

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

貸付証券

| UBS（Lux）ボンド・シキャプ                   | 2024年11月30日現在の貸付証券による<br>相手方エクスポージャー* |                          | 2024年11月30日現在の<br>担保内訳<br>(比重 %) |       |      |
|------------------------------------|---------------------------------------|--------------------------|----------------------------------|-------|------|
|                                    | 貸付証券の時価                               | 担保（ユービーエス・<br>スイス・エイ・ジー） | 株式                               | 債券    | 現金   |
| ーショート・ターム米ドルコーポレート・<br>サステナブル（米ドル） | 35,642,176.96 米ドル                     | 37,420,764.44 米ドル        | 47.48                            | 52.52 | 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、2024年11月30日に証券貸付代理人から直接入手されるため、2024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・シキャプ<br>ーショート・ターム米ドルコーポレート・<br>サステナブル（米ドル） |                |
|--------------------------------------------------------|----------------|
| 貸付証券収益                                                 | 137,664.73 米ドル |
| 貸付証券費用*                                                |                |
| ユービーエス・<br>スイス・エイ・ジー                                   | 41,299.42 米ドル  |
| UBSヨーロッパSE<br>ルクセンブルグ支店                                | 13,766.47 米ドル  |
| 貸付証券純収益                                                | 82,598.84 米ドル  |

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

[次へ](#)

## (2) 投資有価証券明細表等

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

2024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／<br>名目金額  | 先物／為替先物予約／<br>スワップに係る<br>未実現利益 (損失) の<br>米ドル建て評価額<br>(注1) | 純資産額に<br>占める% |
|------------------------------------------------------------------|--------------|-----------------------------------------------------------|---------------|
| ノートー固定金利                                                         |              |                                                           |               |
| 英ポンド                                                             |              |                                                           |               |
| GBP BUPA FINANCE PLC-REG-S-SUB 5.00000% 16-08.12.26              | 1 000 000.00 | 1 263 014.43                                              | 0.17          |
| 英ポンド合計                                                           |              | 1 263 014.43                                              | 0.17          |
| 米ドル                                                              |              |                                                           |               |
| USD ABBVIE INC 2.95000% 20-21.11.26                              | 1 115 000.00 | 1 082 926.43                                              | 0.14          |
| USD ABBVIE INC 4.80000% 24-15.03.27                              | 1 700 000.00 | 1 712 576.28                                              | 0.23          |
| USD ABBVIE INC 4.80000% 24-15.03.29                              | 3 000 000.00 | 3 026 209.53                                              | 0.40          |
| USD ABN AMRO BANK NV-144A-SUB 4.75000% 15-28.07.25               | 250 000.00   | 249 039.51                                                | 0.03          |
| USD ABN AMRO BANK NV-REG-S-SUB 4.75000% 15-28.07.25              | 2 500 000.00 | 2 490 395.08                                              | 0.33          |
| USD AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP GLO 2.45000% 21-29.10.26 | 4 000 000.00 | 3 823 674.04                                              | 0.51          |
| USD AFRICA FINANCE CORP-REG-S 3.12500% 20-16.06.25               | 1 000 000.00 | 985 550.00                                                | 0.13          |
| USD AIA GROUP LTD-REG-S 5.62500% 22-25.10.27                     | 3 380 000.00 | 3 468 763.10                                              | 0.46          |
| USD AIR LEASE CORP 5.30000% 24-25.06.26                          | 500 000.00   | 503 691.94                                                | 0.07          |
| USD ALIBABA GROUP HOLDING LTD 3.40000% 17-06.12.27               | 3 480 000.00 | 3 348 142.80                                              | 0.44          |
| USD AMAZON.COM INC 1.65000% 21-12.05.28                          | 2 000 000.00 | 1 829 447.92                                              | 0.24          |
| USD AMAZON.COM INC 4.55000% 22-01.12.27                          | 2 000 000.00 | 2 014 510.34                                              | 0.27          |
| USD AMGEN INC 2.20000% 20-21.02.27                               | 2 000 000.00 | 1 900 523.50                                              | 0.25          |
| USD ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC-REG-S 4.00000% 17-11.09.27        | 1 000 000.00 | 973 440.00                                                | 0.13          |
| USD AON NORTH AMERICA INC 5.12500% 24-01.03.27                   | 2 500 000.00 | 2 526 747.50                                              | 0.34          |
| USD APPLE INC 1.40000% 21-05.08.28                               | 1 000 000.00 | 902 935.33                                                | 0.12          |
| USD APPLE INC 3.25000% 16-23.02.26                               | 2 000 000.00 | 1 974 020.14                                              | 0.26          |
| USD ASB BANK LTD-REG-S 5.34600% 23-15.06.26                      | 3 750 000.00 | 3 790 088.89                                              | 0.50          |
| USD ASTRAZENECA FINANCE LLC 1.20000% 21-28.05.26                 | 2 000 000.00 | 1 908 460.56                                              | 0.25          |
| USD AT&T INC 1.65000% 20-01.02.28                                | 2 500 000.00 | 2 282 091.53                                              | 0.30          |
| USD AT&T INC 2.30000% 20-01.06.27                                | 3 000 000.00 | 2 837 635.56                                              | 0.38          |
| USD AT&T INC 3.87500% 19-15.01.26                                | 2 000 000.00 | 1 981 090.94                                              | 0.26          |
| USD AT&T INC 4.25000% 17-01.03.27                                | 2 000 000.00 | 1 986 496.06                                              | 0.26          |
| USD BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENT 5.38100% 24-13.03.29             | 2 200 000.00 | 2 239 130.38                                              | 0.30          |
| USD BANCO SANTANDER SA 5.58800% 23-08.08.28                      | 800 000.00   | 818 835.63                                                | 0.11          |
| USD BANK OF MONTREAL 5.26600% 23-11.12.26                        | 1 600 000.00 | 1 621 506.03                                              | 0.22          |
| USD BANK OF NOVA SCOTIA 1.30000% 21-15.09.26                     | 3 000 000.00 | 2 834 207.49                                              | 0.38          |
| USD BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUL-REG-S 0.99800% 21-04.02.25 | 2 000 000.00 | 1 986 634.06                                              | 0.26          |
| USD BARCLAYS PLC 4.33700% 17-10.01.28                            | 3 992 000.00 | 3 930 580.25                                              | 0.52          |
| USD BBVA BANCOMER SA/TEXAS-REG-S 1.87500% 20-18.09.25            | 1 000 000.00 | 972 810.00                                                | 0.13          |
| USD BNP PARIBAS SA-REG-S 3.37500% 18-09.01.25                    | 750 000.00   | 748 734.53                                                | 0.10          |
| USD BROADCOM CORP/CAYMAN FIN LTD 3.87500% 18-15.01.27            | 2 000 000.00 | 1 969 954.94                                              | 0.26          |
| USD CANADIAN PACIFIC RAILWAY CO 1.75000% 21-02.12.26             | 2 500 000.00 | 2 362 693.17                                              | 0.31          |
| USD CCO LLC/CAPITAL 4.90800% 16-23.07.25                         | 461 000.00   | 460 752.99                                                | 0.06          |
| USD CELANESE US HOLDINGS LLC 6.16500% 22-15.07.27                | 4 000 000.00 | 4 081 081.64                                              | 0.54          |
| USD CENTRAL AMERICAN BANK ECONOMIC IN-REG-S 5.00000% 24-25.01.27 | 1 800 000.00 | 1 815 768.00                                              | 0.24          |
| USD CONCENTRIX CORP 6.65000% 23-02.08.26                         | 2 500 000.00 | 2 547 923.70                                              | 0.34          |
| USD CONSTELLATION ENERGY GENERATION LLC 3.25000% 20-01.06.25     | 2 000 000.00 | 1 981 872.08                                              | 0.26          |
| USD COUNTRY GARDEN HOLD-REG-S *DEFAULTED* 6.50000% 19-08.04.24   | 1 400 000.00 | 129 500.00                                                | 0.02          |

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/<br>名目金額  | 先物／為替先物予約／<br>スワップに係る<br>未実現利益 (損失) の<br>米ドル建て評価額<br>(注1) | 純資産額に<br>占める% |
|------------------------------------------------------------------|--------------|-----------------------------------------------------------|---------------|
| USD CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 2.37500% 19-22.01.25         | 1 445 000.00 | 1 439 943.95                                              | 0.19          |
| USD CVS HEALTH CORP 2.87500% 16-01.06.26                         | 5 000 000.00 | 4 857 935.60                                              | 0.64          |
| USD CVS HEALTH CORP 5.00000% 23-30.01.29                         | 600 000.00   | 601 654.98                                                | 0.08          |
| USD DAIMLER TRUCK FIN NORTH AMERICA-REG-S 5.00000% 24-15.01.27   | 1 000 000.00 | 1 004 930.47                                              | 0.13          |
| USD DAIMLER TRUCKS FINANCE NORTH-REG-S 5.60000% 23-08.08.25      | 2 000 000.00 | 2 013 093.34                                              | 0.27          |
| USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 5.25000% 23-01.02.28       | 1 350 000.00 | 1 374 391.50                                              | 0.18          |
| USD DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC 3.95000% 17-20.03.28            | 2 500 000.00 | 2 390 839.23                                              | 0.32          |
| USD ELEVANCE HEALTH INC 4.90000% 23-08.02.26                     | 1 686 000.00 | 1 685 917.17                                              | 0.22          |
| USD ENBRIDGE INC 1.60000% 21-04.10.26                            | 1 500 000.00 | 1 418 250.61                                              | 0.19          |
| USD ENBRIDGE INC 5.25000% 24-05.04.27                            | 3 000 000.00 | 3 044 110.86                                              | 0.40          |
| USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 1.37500% 21-12.07.26     | 3 812 000.00 | 3 624 027.92                                              | 0.48          |
| USD ENI SPA-REG-S 4.75000% 18-12.09.28                           | 4 100 000.00 | 4 104 191.14                                              | 0.54          |
| USD EQT CORP 3.90000% 17-01.10.27                                | 3 350 000.00 | 3 274 165.28                                              | 0.43          |
| USD EQT CORP 5.70000% 22-01.04.28                                | 2 000 000.00 | 2 045 414.00                                              | 0.27          |
| USD EVERSOURCE ENERGY 4.60000% 22-01.07.27                       | 3 000 000.00 | 2 993 317.62                                              | 0.40          |
| USD EVERSOURCE ENERGY 4.75000% 23-15.05.26                       | 1 825 000.00 | 1 825 080.67                                              | 0.24          |
| USD EVERSOURCE ENERGY 5.00000% 24-01.01.27                       | 1 410 000.00 | 1 418 882.41                                              | 0.19          |
| USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 6.95000% 23-10.06.26                | 3 210 000.00 | 3 286 035.24                                              | 0.44          |
| USD GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC 5.65000% 23-15.11.27          | 2 000 000.00 | 2 057 573.82                                              | 0.27          |
| USD GENERAL MOTORS CO 4.20000% 17-01.10.27                       | 5 000 000.00 | 4 920 672.50                                              | 0.65          |
| USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 1.25000% 21-08.01.26         | 750 000.00   | 721 194.44                                                | 0.10          |
| USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 5.40000% 24-08.05.27         | 1 150 000.00 | 1 165 626.66                                              | 0.15          |
| USD GILEAD SCIENCES INC 3.65000% 15-01.03.26                     | 2 500 000.00 | 2 469 508.87                                              | 0.33          |
| USD HARLEY-DAVIDSON FINANCIAL SERVICE-REG-S 3.35000% 20-08.06.25 | 2 500 000.00 | 2 472 019.63                                              | 0.33          |
| USD HCA INC 5.87500% 15-15.02.26                                 | 1 500 000.00 | 1 511 660.43                                              | 0.20          |
| USD HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO 1.75000% 20-01.04.26           | 2 000 000.00 | 1 921 765.46                                              | 0.25          |
| USD HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO 4.40000% 24-25.09.27           | 5 000 000.00 | 4 971 406.40                                              | 0.66          |
| USD ING GROEP NV 3.95000% 17-29.03.27                            | 4 000 000.00 | 3 930 437.04                                              | 0.52          |
| USD ING GROEP NV 4.55000% 18-02.10.28                            | 2 500 000.00 | 2 481 120.35                                              | 0.33          |
| USD INVESCO FINANCE PLC 3.75000% 15-15.01.26                     | 2 000 000.00 | 1 977 915.84                                              | 0.26          |
| USD JM SMUCKER CO/THE 3.37500% 17-15.12.27                       | 1 500 000.00 | 1 452 835.30                                              | 0.19          |
| USD KIMCO REALTY OP, LLC 3.25000% 16-15.08.26                    | 2 000 000.00 | 1 945 896.62                                              | 0.26          |
| USD LENNOX INTERNATIONAL INC 1.35000% 20-01.08.25                | 900 000.00   | 879 226.35                                                | 0.12          |
| USD LG ELECTRONICS INC-REG-S 5.62500% 24-24.04.27                | 2 000 000.00 | 2 028 040.00                                              | 0.27          |
| USD LOWE ' S COS INC 4.80000% 23-01.04.26                        | 3 000 000.00 | 3 008 211.93                                              | 0.40          |
| USD LSEGA FINANCING PLC-REG-S 1.37500% 21-06.04.26               | 500 000.00   | 478 831.87                                                | 0.06          |
| USD LYB INTERNATIONAL FINANCE II BV 3.50000% 17-02.03.27         | 1 500 000.00 | 1 461 213.08                                              | 0.19          |
| USD MACQUARIE BANK LTD-REG-S 5.20800% 23-15.06.26                | 7 500 000.00 | 7 561 524.45                                              | 1.00          |
| USD MERCEDES-BENZ FIN NORTH AMERICA-REG-S 2.12500% 20-10.03.25   | 1 500 000.00 | 1 489 037.90                                              | 0.20          |
| USD MERCEDES-BENZ FIN NORTH AMERICA-REG-S 5.20000% 23-03.08.26   | 3 000 000.00 | 3 024 187.38                                              | 0.40          |
| USD MERCEDES-BENZ FINANCE NORTH AMERI-REG-S 3.75000% 18-22.02.28 | 3 000 000.00 | 2 914 570.17                                              | 0.39          |
| USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 3.00000% 17-19.09.27  | 1 200 000.00 | 1 151 601.66                                              | 0.15          |
| USD MICROSOFT CORP 3.12500% 15-03.11.25                          | 4 000 000.00 | 3 951 870.96                                              | 0.52          |
| USD MICROSOFT CORP 3.30000% 17-06.02.27                          | 2 000 000.00 | 1 961 736.84                                              | 0.26          |
| USD MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-REG-S 5.12500% 17-15.01.28   | 2 000 000.00 | 1 735 884.00                                              | 0.23          |
| USD MOLSON COORS BEVERAGE CO 3.00000% 16-15.07.26                | 3 000 000.00 | 2 920 020.81                                              | 0.39          |
| USD MONDELEZ INTERNATIONAL INC 4.75000% 24-20.02.29              | 1 000 000.00 | 1 006 419.40                                              | 0.13          |
| USD MONDELEZ INTERNATIONAL HDG NLD BV-REG-S 4.25000% 22-15.09.25 | 1 800 000.00 | 1 792 928.36                                              | 0.24          |
| USD MOODY ' S CORP 3.75000% 20-24.03.25                          | 1 500 000.00 | 1 494 593.82                                              | 0.20          |
| USD NATWEST MARKETS PLC-144A 1.60000% 21-29.09.26                | 2 560 000.00 | 2 422 307.68                                              | 0.32          |

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／<br>名目金額  | 先物／為替先物予約／<br>スワップに係る<br>未実現利益 (損失) の<br>米ドル建て評価額<br>(注1) | 純資産額に<br>占める% |
|------------------------------------------------------------------|--------------|-----------------------------------------------------------|---------------|
| USD NATWEST MARKETS PLC-REG-S 1.60000% 21-29.09.26               | 1 665 000.00 | 1 575 446.21                                              | 0.21          |
| USD NEXTERA ENERGY CAPITAL HOLDINGS INC 4.62500% 22-15.07.27     | 3 000 000.00 | 3 008 920.92                                              | 0.40          |
| USD NISOURCE INC 3.49000% 17-15.05.27                            | 2 270 000.00 | 2 213 003.85                                              | 0.29          |
| USD NISOURCE INC 5.25000% 23-30.03.28                            | 400 000.00   | 407 095.30                                                | 0.05          |
| USD NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CO LLC-REG-S 2.00000% 21-09.03.26    | 2 000 000.00 | 1 902 348.56                                              | 0.25          |
| USD NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CO LLC-REG-S 6.95000% 23-15.09.26    | 2 000 000.00 | 2 027 120.04                                              | 0.27          |
| USD NISSAN MOTOR CO LTD-REG-S 4.34500% 20-17.09.27               | 1 000 000.00 | 949 928.61                                                | 0.13          |
| USD NOMURA HOLDINGS INC 5.09900% 22-03.07.25                     | 2 000 000.00 | 2 000 739.09                                              | 0.27          |
| USD NORDSON CORP 5.60000% 23-15.09.28                            | 1 000 000.00 | 1 032 648.93                                              | 0.14          |
| USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 5.00000% 24-01.08.27               | 1 000 000.00 | 1 002 846.00                                              | 0.13          |
| USD ONEOK INC 5.85000% 20-15.01.26                               | 2 000 000.00 | 2 019 274.44                                              | 0.27          |
| USD ORACLE CORP 1.65000% 21-25.03.26                             | 700 000.00   | 672 968.60                                                | 0.09          |
| USD ORACLE CORP 2.80000% 20-01.04.27                             | 1 500 000.00 | 1 442 608.44                                              | 0.19          |
| USD ORACLE CORP 3.25000% 17-15.11.27                             | 3 500 000.00 | 3 381 906.36                                              | 0.45          |
| USD ORACLE CORP 5.80000% 22-10.11.25                             | 140 000.00   | 141 343.68                                                | 0.02          |
| USD ORIX CORP 3.25000% 17-04.12.24                               | 500 000.00   | 499 951.36                                                | 0.07          |
| USD PACIFIC GAS & ELECTRIC CO 3.50000% 15-15.06.25               | 750 000.00   | 743 655.63                                                | 0.10          |
| USD PENSKE TRK LEA CO LP/PTL FIN CORP-REG-S 4.40000% 22-01.07.27 | 1 765 000.00 | 1 748 717.54                                              | 0.23          |
| USD PFIZER INVESTMENT ENTERPRISES PTE LTD 4.45000% 23-19.05.26   | 5 500 000.00 | 5 494 761.97                                              | 0.73          |
| USD PFIZER INVESTMENT ENTERPRISES PTE LTD 4.45000% 23-19.05.28   | 3 000 000.00 | 2 993 144.64                                              | 0.40          |
| USD PG&E CORP 5.00000% 20-01.07.28                               | 100 000.00   | 98 177.90                                                 | 0.01          |
| USD PROSUS NV-REG-S 3.25700% 22-19.01.27                         | 1 000 000.00 | 951 310.00                                                | 0.13          |
| USD QUALCOMM INC 3.25000% 17-20.05.27                            | 2 000 000.00 | 1 946 243.36                                              | 0.26          |
| USD ROCHE HOLDINGS INC-REG-S 0.99100% 21-05.03.26                | 3 000 000.00 | 2 874 611.31                                              | 0.38          |
| USD ROLLS-ROYCE PLC-144A 5.75000% 20-15.10.27                    | 3 000 000.00 | 3 053 046.00                                              | 0.40          |
| USD SEMPRA 3.30000% 22-01.04.25                                  | 1 490 000.00 | 1 482 114.76                                              | 0.20          |
| USD SHIMAO PRPTY HLDG LTD-REG-S *DEFAULTED* 6.12500% 19-21.02.24 | 1 000 000.00 | 66 250.00                                                 | 0.01          |
| USD SHIMAO PRPTY HLDG LTD-REG-S *DEFAULTED* 3.97500% 21-16.09.23 | 600 000.00   | 38 250.00                                                 | 0.01          |
| USD SK BATTERY AMERICA INC-REG-S 4.87500% 24-23.01.27            | 1 395 000.00 | 1 394 944.20                                              | 0.19          |
| USD SK HYNIX INC-REG-S 6.37500% 23-17.01.28                      | 2 500 000.00 | 2 597 500.00                                              | 0.34          |
| USD SOUTHERN CALIFORNIA GAS CO 2.95000% 22-15.04.27              | 2 000 000.00 | 1 928 653.36                                              | 0.26          |
| USD SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 0.94800% 21-12.01.26     | 2 000 000.00 | 1 919 493.92                                              | 0.25          |
| USD SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP-REG-S 5.95000% 23-17.07.26    | 1 010 000.00 | 1 020 413.10                                              | 0.14          |
| USD SUNTORY HOLDINGS LTD-REG-S 5.12400% 24-11.06.29              | 2 000 000.00 | 2 029 155.28                                              | 0.27          |
| USD SWEDBANK AB-REG-S 5.47200% 23-15.06.26                       | 500 000.00   | 506 825.98                                                | 0.07          |
| USD SWEDBANK AB-REG-S 6.13600% 23-12.09.26                       | 1 450 000.00 | 1 481 999.65                                              | 0.20          |
| USD T-MOBILE USA INC 2.25000% 21-15.02.26                        | 2 000 000.00 | 1 939 450.20                                              | 0.26          |
| USD T-MOBILE USA INC 3.50000% 21-15.04.25                        | 1 500 000.00 | 1 492 090.90                                              | 0.20          |
| USD TELEFONICA EMISIONES SA 4.10300% 17-08.03.27                 | 4 392 000.00 | 4 337 085.90                                              | 0.58          |
| USD TSMC GLOBAL LTD-144A 0.75000% 20-28.09.25                    | 3 000 000.00 | 2 894 580.00                                              | 0.38          |
| USD UBS AG/STAMFORD CT 3.70000% 22-21.02.25                      | 2 000 000.00 | 1 994 202.12                                              | 0.26          |
| USD UBS GROUP AG-REG-S 4.12500% 16-15.04.26                      | 2 000 000.00 | 1 978 172.20                                              | 0.26          |
| USD UBS GROUP AG-REG-S 5.71100% 23-12.01.27                      | 5 000 000.00 | 5 040 031.30                                              | 0.67          |
| USD ULKER BISKUVI SANAYI AS-REG-S 7.87500% 24-08.07.31           | 1 400 000.00 | 1 434 125.00                                              | 0.19          |
| USD UNITED RENTALS NORTH AMERICA INC 3.87500% 19-15.11.27        | 1 000 000.00 | 965 512.20                                                | 0.13          |
| USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.62500% 16-15.08.26              | 55 000.00    | 53 474.86                                                 | 0.01          |
| USD VISTRA OPERATIONS CO LLC-REG-S 5.62500% 19-15.02.27          | 1 250 000.00 | 1 250 017.77                                              | 0.17          |
| USD VMWARE LLC 3.90000% 17-21.08.27                              | 1 000 000.00 | 979 387.06                                                | 0.13          |
| USD VMWARE LLC 4.50000% 20-15.05.25                              | 1 500 000.00 | 1 496 584.82                                              | 0.20          |
| USD WARNERMEDIA HOLDINGS INC 6.41200% 23-15.03.26                | 6 450 000.00 | 6 450 108.43                                              | 0.86          |
| USD WESTPAC BANKING CORP 1.15000% 21-03.06.26                    | 4 108 000.00 | 3 911 076.36                                              | 0.52          |
| 米ドル合計                                                            |              | 290 647 781.99                                            | 38.56         |
| ノート合計—固定金利                                                       |              | 291 910 796.42                                            | 38.73         |

注記は財務書類の不可分の一部である。

## UBS (Lux) ボンド・シキャプーショート・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/<br>名目金額   | 先物／為替先物予約／<br>スワップに係る<br>未実現利益 (損失) の<br>米ドル建て評価額<br>(注1) | 純資産額に<br>占める% |
|------------------------------------------------------------------|---------------|-----------------------------------------------------------|---------------|
| ノートー変動金利                                                         |               |                                                           |               |
| ユーロ                                                              |               |                                                           |               |
| EUR RAIFFEISEN BANK INTL AG-REG-S-SUB 2.875%/VAR 20-18.06.32     | 1 000 000.00  | 1 017 662.43                                              | 0.13          |
| EUR RAIFFEISEN BANK INTL AG-REG-S-SUB COCO 6.000%/VAR 20-PRP     | 1 000 000.00  | 1 039 429.66                                              | 0.14          |
| ユーロ合計                                                            |               | 2 057 092.09                                              | 0.27          |
| 米ドル                                                              |               |                                                           |               |
| USD ABN AMRO BANK NV-REG-S 6.339%/VAR 23-18.09.27                | 700 000.00    | 717 210.05                                                | 0.10          |
| USD ABN AMRO BANK NV-REG-S 2.470%/VAR 21-13.12.29                | 1 700 000.00  | 1 541 817.60                                              | 0.21          |
| USD AIB GROUP PLC-REG-S 6.608%/VAR 23-13.09.29                   | 2 950 000.00  | 3 111 643.03                                              | 0.41          |
| USD BANCO SANTANDER SA 1.722%/VAR 21-14.09.27                    | 2 400 000.00  | 2 264 798.52                                              | 0.30          |
| USD BANCO SANTANDER SA 6.527%/VAR 23-07.11.27                    | 3 000 000.00  | 3 091 852.08                                              | 0.41          |
| USD BANK OF AMERICA CORP 5.080%/VAR 23-20.01.27                  | 14 000 000.00 | 14 039 878.58                                             | 1.86          |
| USD BANK OF AMERICA CORP 5.933%/VAR 23-15.09.27                  | 2 000 000.00  | 2 038 022.26                                              | 0.27          |
| USD BANK OF IRELAND GROUP PLC-REG-S 2.029%/VAR 21-30.09.27       | 1 290 000.00  | 1 224 204.52                                              | 0.16          |
| USD BANK OF NEW YORK MELLON CORP/THE 4.947%/VAR 23-26.04.27      | 1 000 000.00  | 1 004 330.17                                              | 0.13          |
| USD BARCLAYS PLC 5.304%/VAR 22-09.08.26                          | 6 000 000.00  | 6 010 143.36                                              | 0.80          |
| USD BARCLAYS PLC 5.674%/VAR 24-12.03.28                          | 4 000 000.00  | 4 064 803.52                                              | 0.54          |
| USD BARCLAYS PLC 6.490%/VAR 23-13.09.29                          | 3 500 000.00  | 3 676 223.91                                              | 0.49          |
| USD BNP PARIBAS SA-REG-S 1.323000%/VAR 21-13.01.27               | 2 000 000.00  | 1 918 432.24                                              | 0.26          |
| USD BNP PARIBAS SA-REG-S 2.591%/VAR 22-20.01.28                  | 3 000 000.00  | 2 858 909.97                                              | 0.38          |
| USD BPCE SA-REG-S 6.612%/VAR 23-19.10.27                         | 2 000 000.00  | 2 054 808.32                                              | 0.27          |
| USD CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 6.312%/VAR 23-08.06.29            | 5 000 000.00  | 5 194 045.80                                              | 0.69          |
| USD CITIGROUP INC 1.462%/VAR 21-09.06.27                         | 7 000 000.00  | 6 656 082.79                                              | 0.88          |
| USD CITIGROUP INC 2.014%/VAR 22-25.01.26                         | 3 500 000.00  | 3 483 452.24                                              | 0.46          |
| USD CITIGROUP INC 5.610%/VAR 22-29.09.26                         | 1 500 000.00  | 1 508 992.26                                              | 0.20          |
| USD DANSKE BANK A/S-REG-S 4.298%/VAR 22-01.04.28                 | 4 000 000.00  | 3 944 517.48                                              | 0.52          |
| USD DANSKE BANK A/S-REG-S 5.427%/VAR 24-01.03.28                 | 2 500 000.00  | 2 531 839.38                                              | 0.34          |
| USD DANSKE BANK AS-REG-S 3.244%/VAR 19-20.12.25                  | 2 000 000.00  | 1 998 255.86                                              | 0.27          |
| USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 6.819%/VAR 23-20.11.29          | 3 960 000.00  | 4 182 796.17                                              | 0.56          |
| USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 7.146%/VAR 23-13.07.27          | 3 000 000.00  | 3 097 807.35                                              | 0.41          |
| USD DNB BANK ASA-REG-S 1.535%/VAR 21-25.05.27                    | 1 000 000.00  | 952 156.57                                                | 0.13          |
| USD DNB BANK ASA-REG-S 1.605%/VAR 21-30.03.28                    | 2 500 000.00  | 2 324 350.10                                              | 0.31          |
| USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 6.484%/VAR 23-24.10.29           | 2 000 000.00  | 2 116 009.58                                              | 0.28          |
| USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 0.855%/VAR 21-12.02.26               | 1 000 000.00  | 992 174.15                                                | 0.13          |
| USD HSBC HOLDINGS PLC 2.206%/VAR 21-17.08.29                     | 4 500 000.00  | 4 070 629.48                                              | 0.54          |
| USD HSBC HOLDINGS PLC 4.583%/VAR 18-19.06.29                     | 3 000 000.00  | 2 959 917.33                                              | 0.39          |
| USD HSBC HOLDINGS PLC 4.292%/VAR 18-12.09.26                     | 6 000 000.00  | 5 970 686.82                                              | 0.79          |
| USD HSBC HOLDINGS PLC 5.597%/VAR 24-17.05.28                     | 3 000 000.00  | 3 043 025.10                                              | 0.40          |
| USD ING GROEP NV 6.083%/VAR 23-11.09.27                          | 1 145 000.00  | 1 168 149.38                                              | 0.16          |
| USD JPMORGAN CHASE & CO 1.040%/VAR 21-04.02.27                   | 3 000 000.00  | 2 871 535.35                                              | 0.38          |
| USD JPMORGAN CHASE & CO 1.578%/VAR 21-22.04.27                   | 3 500 000.00  | 3 349 002.37                                              | 0.45          |
| USD JPMORGAN CHASE & CO 2.947%/VAR 22-24.02.28                   | 8 000 000.00  | 7 698 559.20                                              | 1.02          |
| USD JPMORGAN CHASE & CO 6.070%/VAR 23-22.10.27                   | 4 000 000.00  | 4 094 731.48                                              | 0.54          |
| USD LLOYDS BANKING GROUP PLC VAR 21-11.05.27                     | 1 500 000.00  | 1 431 513.95                                              | 0.19          |
| USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.716%/VAR 22-11.08.26              | 5 000 000.00  | 4 987 275.40                                              | 0.66          |
| USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 5.462%/VAR 24-05.01.28              | 5 541 000.00  | 5 603 806.01                                              | 0.74          |
| USD MACQUARIE GROUP LTD-REG-S 3.763%/VAR 17-28.11.28             | 3 500 000.00  | 3 384 189.62                                              | 0.45          |
| USD MORGAN STANLEY 0.985%/VAR 20-10.12.26                        | 3 000 000.00  | 2 883 912.39                                              | 0.38          |
| USD MORGAN STANLEY 1.593%/VAR 21-04.05.27                        | 19 500 000.00 | 18 632 663.59                                             | 2.47          |
| USD NATIONWIDE BUI SOC-REG-S 4.302%/3M LIBOR+145.2BP 18-08.03.29 | 2 000 000.00  | 1 959 141.44                                              | 0.26          |
| USD NATWEST GROUP PLC 5.847%/VAR 23-02.03.27                     | 2 000 000.00  | 2 021 595.32                                              | 0.27          |
| USD NATWEST GROUP PLC O/N SOFR+130BP 24-15.11.28                 | 3 000 000.00  | 3 029 833.98                                              | 0.40          |
| USD SANTANDER HOLDINGS USA INC 6.499%/VAR 23-09.03.29            | 2 705 000.00  | 2 806 391.57                                              | 0.37          |

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／<br>名目金額  | 先物／為替先物予約／<br>スワップに係る<br>未実現利益 (損失) の<br>米ドル建て評価額<br>(注1) | 純資産額に<br>占める% |
|-----------------------------------------------------------------|--------------|-----------------------------------------------------------|---------------|
| USD SANTANDER UK GROUP HOLDINGS 6.833%/VAR 22-21.11.26          | 2 000 000.00 | 2 031 750.88                                              | 0.27          |
| USD SOCIETE GENERALE SA-REG-S 1.488%/VAR 20-14.12.26            | 1 600 000.00 | 1 539 996.35                                              | 0.21          |
| USD SOCIETE GENERALE SA-REG-S 2.226%/VAR 22-21.01.26            | 3 120 000.00 | 3 105 808.21                                              | 0.41          |
| USD STANDARD CHARTERED PLC-REG-S 6.187%/VAR 23-06.07.27         | 4 000 000.00 | 4 071 773.76                                              | 0.54          |
| USD STANDARD CHARTERED PLC-REG-S 5.688%/VAR 24-14.05.28         | 3 200 000.00 | 3 248 166.47                                              | 0.43          |
| USD UBS GROUP AG-REG-S 4.488%/VAR 22-12.05.26                   | 3 000 000.00 | 2 992 479.60                                              | 0.40          |
| USD UBS GROUP AG-REG-S-SUB 6.875%/VAR 15-PRP                    | 1 000 000.00 | 1 002 050.00                                              | 0.13          |
| USD WESTINGHOUSE AIR BRAKE STEP-UP/RATING LINKED 18-15.09.28    | 600 000.00   | 597 710.41                                                | 0.08          |
| USD WESTPAC BANKING CORP-SUB 2.668%/VAR 20-15.11.35             | 3 000 000.00 | 2 589 579.93                                              | 0.34          |
| 米ドル合計                                                           |              | 191 745 433.25                                            | 25.44         |
| ノート合計—変動金利                                                      |              | 193 802 525.34                                            | 25.71         |
| 中期債券—固定金利                                                       |              |                                                           |               |
| ユーロ                                                             |              |                                                           |               |
| EUR BLACKSTONE PROPERTY PARTNERS EUR-REG-S 1.00000% 21-20.10.26 | 1 500 000.00 | 1 519 193.21                                              | 0.20          |
| EUR CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S 2.75000% 20-12.05.26            | 1 250 000.00 | 1 287 679.43                                              | 0.17          |
| EUR FRESENIUS SE & CO KGAA-REG-S 4.25000% 22-28.05.26           | 2 000 000.00 | 2 157 719.43                                              | 0.29          |
| EUR GRAND CITY PROPERTIES SA-REG-S 4.37500% 24-09.01.30         | 700 000.00   | 764 473.86                                                | 0.10          |
| EUR P3 GROUP SARL-REG-S 0.87500% 22-26.01.26                    | 3 000 000.00 | 3 087 224.01                                              | 0.41          |
| EUR WORLEY US FINANCE SUB LTD-REG-S 0.87500% 21-09.06.26        | 1 500 000.00 | 1 536 346.41                                              | 0.20          |
| ユーロ合計                                                           |              | 10 352 636.35                                             | 1.37          |
| 米ドル                                                             |              |                                                           |               |
| USD AAREAL BANK AG-REG-S 0.62500% 21-14.02.25                   | 2 000 000.00 | 1 980 056.78                                              | 0.26          |
| USD CBQ FINANCE LTD-REG-S 2.00000% 21-12.05.26                  | 2 400 000.00 | 2 293 512.00                                              | 0.30          |
| USD CNH INDUSTRIAL NV 3.85000% 17-15.11.27                      | 2 000 000.00 | 1 962 328.46                                              | 0.26          |
| USD EUROCLEAR BANK SA-REG-S 1.26100% 21-03.08.26                | 2 000 000.00 | 1 881 769.36                                              | 0.25          |
| USD LENDLEASE US CAPITAL INC-REG-S 4.50000% 16-26.05.26         | 2 000 000.00 | 1 971 848.18                                              | 0.26          |
| USD LENOVO GROUP LTD-REG-S 5.87500% 20-24.04.25                 | 2 000 000.00 | 2 003 040.00                                              | 0.27          |
| USD MCDONALD ' S CORP 3.80000% 18-01.04.28                      | 4 000 000.00 | 3 914 510.96                                              | 0.52          |
| USD NORDEA BANK ABP-REG-S 1.50000% 21-30.09.26                  | 5 000 000.00 | 4 724 143.80                                              | 0.63          |
| USD PACIFIC NATIONAL FINANCE PTY LTD-REG-S 4.75000% 18-22.03.28 | 3 000 000.00 | 2 901 243.00                                              | 0.39          |
| USD QNB FINANCE LTD-REG-S 1.62500% 20-22.09.25                  | 800 000.00   | 777 500.00                                                | 0.10          |
| USD ROYAL BANK OF CANADA 4.87500% 23-12.01.26                   | 2 000 000.00 | 2 008 252.40                                              | 0.27          |
| USD RYDER SYSTEM INC 5.30000% 24-15.03.27                       | 1 500 000.00 | 1 519 541.08                                              | 0.20          |
| 米ドル合計                                                           |              | 27 937 746.02                                             | 3.71          |
| 中期債券合計—固定金利                                                     |              | 38 290 382.37                                             | 5.08          |
| 中期債券—ゼロ・クーポン                                                    |              |                                                           |               |
| スイスフラン                                                          |              |                                                           |               |
| CHF UBS SWITZERLAND AG-REG-S 0.00000% 20-17.12.24               | 2 000 000.00 | 2 269 012.49                                              | 0.30          |
| スイスフラン合計                                                        |              | 2 269 012.49                                              | 0.30          |
| 中期債券合計—ゼロ・クーポン                                                  |              | 2 269 012.49                                              | 0.30          |
| 中期債券—変動金利                                                       |              |                                                           |               |
| ユーロ                                                             |              |                                                           |               |
| EUR UNICAJA BANCO SA-REG-S 7.250%/VAR 22-15.11.27               | 1 000 000.00 | 1 135 681.16                                              | 0.15          |
| EUR VIRGIN MONEY UK PLC-REG-S 4.000%/VAR 24-18.03.28            | 825 000.00   | 891 632.95                                                | 0.12          |
| ユーロ合計                                                           |              | 2 027 314.11                                              | 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・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／<br>名目金額  | 先物／為替先物予約／<br>スワップに係る<br>未実現利益 (損失) の<br>米ドル建て評価額<br>(注1) | 純資産額に<br>占める% |
|------------------------------------------------------------------|--------------|-----------------------------------------------------------|---------------|
| <b>米ドル</b>                                                       |              |                                                           |               |
| USD AUSTRALIA & NZ BANK GRP LTD-REG-S-SUB 5.731%/VAR 24-18.09.34 | 3 000 000.00 | 3 051 879.96                                              | 0.41          |
| USD BANK OF AMERICA CORP 3.824%/VAR 17-20.01.28                  | 6 000 000.00 | 5 885 889.06                                              | 0.78          |
| USD QBE INSURANCE GROUP LTD-REG-S-SUB 5.875%/VAR 16-17.06.46     | 800 000.00   | 801 247.74                                                | 0.11          |
| USD ROYAL BANK OF CANADA 5.069%/VAR 24-23.07.27                  | 1 000 000.00 | 1 006 279.51                                              | 0.13          |
| <b>米ドル合計</b>                                                     |              | <b>10 745 296.27</b>                                      | <b>1.43</b>   |
| <b>中期債券合計－変動金利</b>                                               |              | <b>12 772 610.38</b>                                      | <b>1.70</b>   |
| <b>長期債券－固定金利</b>                                                 |              |                                                           |               |
| <b>ユーロ</b>                                                       |              |                                                           |               |
| EUR DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG-REG-S 3.25000% 24-15.01.27        | 4 000 000.00 | 4 281 133.49                                              | 0.57          |
| <b>ユーロ合計</b>                                                     |              | <b>4 281 133.49</b>                                       | <b>0.57</b>   |
| <b>米ドル</b>                                                       |              |                                                           |               |
| USD CANADIAN IMPERIAL BANK OF-REG-S 1.15000% 21-08.07.26         | 1 500 000.00 | 1 422 682.07                                              | 0.19          |
| USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 4.92800% 22-09.12.25    | 2 000 000.00 | 2 006 132.66                                              | 0.27          |
| USD COMMONWEALTH BK OF AUSTRALIA-REG-S-SUB 4.50000% 15-09.12.25  | 280 000.00   | 278 271.24                                                | 0.04          |
| USD KINDER MORGAN INC 4.30000% 14-01.06.25                       | 2 000 000.00 | 1 992 983.68                                              | 0.26          |
| USD LATAM AIRLINES GROUP SA-REG-S 7.87500% 24-15.04.30           | 2 000 000.00 | 2 040 480.00                                              | 0.27          |
| USD PACIFIC GAS AND ELECTRIC CO 3.15000% 20-01.01.26             | 2 000 000.00 | 1 962 981.72                                              | 0.26          |
| USD SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 3.70000% 18-01.08.25           | 3 000 000.00 | 2 977 636.41                                              | 0.39          |
| USD SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 4.90000% 23-01.06.26           | 750 000.00   | 752 574.72                                                | 0.10          |
| USD WESTPAC BANKING CORP-REG-S 4.18400 23-22.05.28               | 1 500 000.00 | 1 488 737.88                                              | 0.20          |
| USD XCEL ENERGY INC 3.30000% 15-01.06.25                         | 2 000 000.00 | 1 982 110.48                                              | 0.26          |
| <b>米ドル合計</b>                                                     |              | <b>16 904 590.86</b>                                      | <b>2.24</b>   |
| <b>長期債券合計－固定金利</b>                                               |              | <b>21 185 724.35</b>                                      | <b>2.81</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   | 250 621.50                                                | 0.03          |
| USD ARGENTUM NETHERLANDS BV-REG-S-SUB 4.625%/VAR 17-PRP          | 665 000.00   | 660 311.75                                                | 0.09          |
| USD BANCO SANTANDER SA 5.552%/VAR 24-14.03.28                    | 3 000 000.00 | 3 034 831.17                                              | 0.40          |
| USD BANK NEGARA INDONESIA PERSERO-REG-S-SUB 4.300%/VAR 21-PRP    | 1 000 000.00 | 954 687.50                                                | 0.13          |
| USD BP CAPITAL MARKETS PLC-SUB 4.375%/VAR 20-PRP                 | 1 201 000.00 | 1 185 994.10                                              | 0.16          |
| USD JP MORGAN CHASE & CO 2.005%/VAR 20-13.03.26                  | 3 500 000.00 | 3 472 523.50                                              | 0.46          |
| USD NBK TIER 1 FINANCING 2 LTD-REG-S-SUB 4.500%/VAR 19-PRP       | 3 300 000.00 | 3 243 372.00                                              | 0.43          |
| USD QBE INSURANCE GROUP LTD-REG-S-SUB 6.750%/VAR 14-02.12.44     | 1 500 000.00 | 1 500 000.00                                              | 0.20          |
| USD SKANDINAVISKA ENSKILDA BANK-REG-S-SUB COCO 5.125%/VAR 19-PRP | 1 000 000.00 | 994 184.00                                                | 0.13          |
| USD WESTPAC BANKING CORP-SUB 4.322%/VAR 16-23.11.31              | 1 000 000.00 | 985 347.51                                                | 0.13          |
| <b>米ドル合計</b>                                                     |              | <b>16 281 873.03</b>                                      | <b>2.16</b>   |
| <b>長期債券合計－変動金利</b>                                               |              | <b>16 281 873.03</b>                                      | <b>2.16</b>   |
| <b>中期財務省証券－固定金利</b>                                              |              |                                                           |               |
| <b>米ドル</b>                                                       |              |                                                           |               |
| USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.50000% 24-30.09.29               | 2 500 000.00 | 2 435 351.55                                              | 0.32          |
| <b>米ドル合計</b>                                                     |              | <b>2 435 351.55</b>                                       | <b>0.32</b>   |
| <b>中期財務省証券合計－固定金利</b>                                            |              | <b>2 435 351.55</b>                                       | <b>0.32</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>578 948 275.93</b>                                     | <b>76.81</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／<br>名目金額 | 先物／為替先物予約／<br>スワップに係る<br>未実現利益 (損失) の<br>米ドル建て評価額<br>(注1) | 純資産額に<br>占める% |
|----|-------------|-----------------------------------------------------------|---------------|
|----|-------------|-----------------------------------------------------------|---------------|

## 他の規制市場で取引されている譲渡可能証券および金融市場商品

## 資産担保証券－固定金利

## 米ドル

|               |                                                          |              |            |      |
|---------------|----------------------------------------------------------|--------------|------------|------|
| USD           | SOFI PROFESSIONAL LOAN PROG-144A 2.65000% 17-25.09.40    | 600 000.00   | 42 825.32  | 0.01 |
| USD           | SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM-144A 3.59000% 18-25.01.48 | 200 000.00   | 29 805.95  | 0.00 |
| USD           | SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM-144A 3.60000% 18-25.02.48 | 5 338 000.00 | 759 044.32 | 0.10 |
| 米ドル合計         |                                                          |              | 831 675.59 | 0.11 |
| 資産担保証券合計－固定金利 |                                                          |              | 831 675.59 | 0.11 |

## モーゲージ担保証券－固定金利

## 米ドル

|                  |                                                         |              |              |      |
|------------------|---------------------------------------------------------|--------------|--------------|------|
| USD              | BAMLL COMMERCIAL MORTGAGE-144A 3.21800% 15-01.04.33     | 250 000.00   | 247 279.05   | 0.03 |
| USD              | BWAY 2013-1515 MORTGAGE TRUST-144A 3.45430% 13-10.03.33 | 2 000 000.00 | 1 910 732.60 | 0.26 |
| USD              | COMM 2015-3BP MORTGAGE TRUST-144A 3.17800% 15-01.02.35  | 2 555 000.00 | 2 478 350.00 | 0.33 |
| 米ドル合計            |                                                         |              | 4 636 361.65 | 0.62 |
| モーゲージ担保証券合計－固定金利 |                                                         |              | 4 636 361.65 | 0.62 |

## ノートー固定金利

## 米ドル

|            |                                                               |              |               |      |
|------------|---------------------------------------------------------------|--------------|---------------|------|
| USD        | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL-REG-S 5.89600% 23-13.07.26 | 2 000 000.00 | 2 035 974.54  | 0.27 |
| USD        | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT-REG-S 4.52400% 22-13.07.25        | 2 000 000.00 | 1 996 955.60  | 0.26 |
| USD        | BLOCK INC 2.75000% 21-01.06.26                                | 1 000 000.00 | 965 761.30    | 0.13 |
| USD        | BROADCOM INC 3.15000% 20-15.11.25                             | 3 500 000.00 | 3 447 752.83  | 0.46 |
| USD        | CARRIER GLOBAL CORP 2.49300% 20-15.02.27                      | 1 000 000.00 | 956 700.09    | 0.13 |
| USD        | CENTENE CORP 4.25000% 20-15.12.27                             | 4 000 000.00 | 3 868 031.20  | 0.51 |
| USD        | CHENIERE ENERGY INC 4.62500% 21-15.10.28                      | 3 103 000.00 | 3 066 926.38  | 0.41 |
| USD        | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 2.85000% 16-18.05.26     | 2 000 000.00 | 1 953 480.06  | 0.26 |
| USD        | CREDIT AGRICOLE SA-144A 5.30100% 23-12.07.28                  | 3 000 000.00 | 3 053 529.72  | 0.40 |
| USD        | ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV -144A 4.25000% 22-15.06.25      | 400 000.00   | 398 276.17    | 0.05 |
| USD        | ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 6.80000% 22-14.10.25      | 1 970 000.00 | 2 005 613.90  | 0.27 |
| USD        | FIRSTENERGY TRANSMISSION LLC-144A 4.35000% 14-15.01.25        | 2 000 000.00 | 1 998 002.68  | 0.26 |
| USD        | GUARDIAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 5.55000% 22-28.10.27       | 2 500 000.00 | 2 563 909.85  | 0.34 |
| USD        | HCA INC 3.12500% 23-15.03.27                                  | 2 000 000.00 | 1 926 326.98  | 0.25 |
| USD        | INTESA SANPAOLO SPA-144A 4.00000% 19-23.09.29                 | 1 000 000.00 | 951 728.17    | 0.13 |
| USD        | JANE STREET GROUP / JSG FINANCE-REG-S 7.12500% 24-30.04.31    | 1 000 000.00 | 1 040 621.86  | 0.14 |
| USD        | KEYSPAN GAS EAST CORP-144A 2.74200% 16-15.08.26               | 1 500 000.00 | 1 444 955.57  | 0.19 |
| USD        | KYNDRYL HOLDINGS INC 2.05000% 22-15.10.26                     | 1 000 000.00 | 949 616.54    | 0.13 |
| USD        | KYNDRYL HOLDINGS INC 2.70000% 22-15.10.28                     | 1 000 000.00 | 920 328.61    | 0.12 |
| USD        | MARVELL TECHNOLOGY INC 2.45000% 21-15.04.28                   | 3 000 000.00 | 2 777 224.68  | 0.37 |
| USD        | METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-144A 3.45000% 16-18.12.26    | 2 000 000.00 | 1 957 941.86  | 0.26 |
| USD        | NATIONAL RURL UTILITS COPERTIVE FIN CRP 1.00000% 21-15.06.26  | 1 000 000.00 | 948 944.52    | 0.13 |
| USD        | NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-144A 0.95000% 20-24.06.25        | 2 000 000.00 | 1 958 296.02  | 0.26 |
| USD        | PENSKE TRUCK LEASING CO LP / PTL-REG-S 1.70000% 21-15.06.26   | 1 000 000.00 | 952 544.40    | 0.13 |
| USD        | PRINCIPAL LIFE GLOBAL FUNDING-144A 1.25000% 20-23.06.25       | 1 500 000.00 | 1 471 168.80  | 0.19 |
| USD        | ROCHE HOLDINGS INC-144A 2.62500% 16-15.05.26                  | 3 000 000.00 | 2 924 884.92  | 0.39 |
| USD        | ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD-144A 5.50000% 21-31.08.26         | 3 000 000.00 | 2 992 500.00  | 0.40 |
| USD        | SKANDINAVISKA ENSK BANK-REG-S 1.20000% 21-09.09.26            | 4 000 000.00 | 3 773 870.24  | 0.50 |
| USD        | SOCIETE GENERALE SA-144A 4.00000% 17-12.01.27                 | 2 000 000.00 | 1 956 551.52  | 0.26 |
| USD        | SVENSKA HANDELSBANKEN AB-REG-S 5.25000% 23-15.06.26           | 2 850 000.00 | 2 880 686.78  | 0.38 |
| USD        | VAR ENERGI ASA-REG-S 5.00000% 22-18.05.27                     | 1 500 000.00 | 1 495 465.50  | 0.20 |
| 米ドル合計      |                                                               |              | 61 634 571.29 | 8.18 |
| ノート合計－固定金利 |                                                               |              | 61 634 571.29 | 8.18 |

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／<br>名目金額  | 先物／為替先物予約／<br>スワップに係る<br>未実現利益 (損失) の<br>米ドル建て評価額<br>(注1) | 純資産額に<br>占める% |
|------------------------------------------------------------------|--------------|-----------------------------------------------------------|---------------|
| <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                   | 4 600 000.00 | 4 694 497.11                                              | 0.62          |
| USD AMERICAN EXPRESS CO 5.645%/VAR 24-23.04.27                   | 3 000 000.00 | 3 034 273.89                                              | 0.40          |
| USD BANK OF IRELAND GROUP PLC-REG-S 6.253%/VAR 22-16.09.26       | 2 500 000.00 | 2 521 015.00                                              | 0.33          |
| USD BNP PARIBAS SA-144A 1.675%/VAR 21-30.06.27                   | 2 000 000.00 | 1 900 062.12                                              | 0.25          |
| USD BNP PARIBAS SA-144A 2.591%/VAR 22-20.01.28                   | 4 000 000.00 | 3 811 879.95                                              | 0.51          |
| USD BNP PARIBAS SA-REG-S 2.219%/VAR 20-09.06.26                  | 500 000.00   | 492 557.11                                                | 0.07          |
| USD CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 4.508%/VAR 24-11.09.27    | 5 000 000.00 | 4 981 842.30                                              | 0.66          |
| USD ING GROEP NV 3.869%/VAR 22-28.03.26                          | 1 500 000.00 | 1 494 216.32                                              | 0.20          |
| USD SKANDINAVISKA ENSKILDA BK AB-REG-S 0/N SOFR+96BP 22-09.06.25 | 500 000.00   | 501 835.00                                                | 0.07          |
| USD US BANCORP 5.727%/VAR 22-21.10.26                            | 1 500 000.00 | 1 511 236.50                                              | 0.20          |
| <b>米ドル合計</b>                                                     |              | <b>24 943 415.30</b>                                      | <b>3.31</b>   |
| <b>ノート合計—変動金利</b>                                                |              | <b>24 943 415.30</b>                                      | <b>3.31</b>   |
| <b>中期債券—固定金利</b>                                                 |              |                                                           |               |
| <b>米ドル</b>                                                       |              |                                                           |               |
| USD MET TOWER GLOBAL FUNDING-REG-S 4.85000% 24-16.01.27          | 1 852 000.00 | 1 865 808.44                                              | 0.25          |
| <b>米ドル合計</b>                                                     |              | <b>1 865 808.44</b>                                       | <b>0.25</b>   |
| <b>中期債券合計—固定金利</b>                                               |              | <b>1 865 808.44</b>                                       | <b>0.25</b>   |
| <b>中期債券—変動金利</b>                                                 |              |                                                           |               |
| <b>米ドル</b>                                                       |              |                                                           |               |
| USD BPCE SA-REG-S 5.975%/VAR 23-18.01.27                         | 7 900 000.00 | 7 965 562.10                                              | 1.06          |
| USD CREDIT AGRICOLE SA/LONDON-REG-S 1.907%/VAR 20-16.06.26       | 2 000 000.00 | 1 966 229.02                                              | 0.26          |
| USD MORGAN STANLEY 5.652%/VAR 24-13.04.28                        | 1 000 000.00 | 1 019 211.83                                              | 0.13          |
| USD SOCIETE GENERALE SA-REG-S 6.447%/VAR 23-12.01.27             | 5 699 000.00 | 5 774 169.24                                              | 0.77          |
| USD TRUIST FINANCIAL CORP 5.900%/VAR 22-28.10.26                 | 2 000 000.00 | 2 018 205.34                                              | 0.27          |
| <b>米ドル合計</b>                                                     |              | <b>18 743 377.53</b>                                      | <b>2.49</b>   |
| <b>中期債券合計—変動金利</b>                                               |              | <b>18 743 377.53</b>                                      | <b>2.49</b>   |
| <b>長期債券—固定金利</b>                                                 |              |                                                           |               |
| <b>米ドル</b>                                                       |              |                                                           |               |
| USD AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP GLO 6.45000% 24-15.04.27 | 1 000 000.00 | 1 036 083.33                                              | 0.14          |
| USD PRICOA GLOBAL FUNDING I-REG-S 5.10000% 23-30.05.28           | 2 380 000.00 | 2 420 390.77                                              | 0.32          |
| USD SYDNEY AIRPORT FINANCE CO PTY LTD-REG-S 3.62500% 16-28.04.26 | 500 000.00   | 491 014.90                                                | 0.06          |
| <b>米ドル合計</b>                                                     |              | <b>3 947 489.00</b>                                       | <b>0.52</b>   |
| <b>長期債券合計—固定金利</b>                                               |              | <b>3 947 489.00</b>                                       | <b>0.52</b>   |
| <b>長期債券—変動金利</b>                                                 |              |                                                           |               |
| <b>米ドル</b>                                                       |              |                                                           |               |
| USD BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENT 5.862%/VAR 22-14.09.26           | 7 000 000.00 | 7 037 040.64                                              | 0.92          |
| USD SCENTRE GROUP TRUST 2-REG-S-SUB 4.750%/VAR 20-24.09.80       | 236 000.00   | 233 848.36                                                | 0.03          |
| <b>米ドル合計</b>                                                     |              | <b>7 270 889.00</b>                                       | <b>0.95</b>   |
| <b>長期債券合計—変動金利</b>                                               |              | <b>7 270 889.00</b>                                       | <b>0.95</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>123 873 587.80</b>                                     | <b>16.43</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／<br>名目金額  | 先物／為替先物予約／<br>スワップに係る<br>未実現利益 (損失) の<br>米ドル建て評価額<br>(注1) | 純資産額に<br>占める% |
|-------------------------------------------------------------|--------------|-----------------------------------------------------------|---------------|
| 最近発行された譲渡可能証券および金融市場商品                                      |              |                                                           |               |
| ノートー固定金利                                                    |              |                                                           |               |
| 米ドル                                                         |              |                                                           |               |
| USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-144A 5.12500% 24-26.06.29 | 3 500 000.00 | 3 531 810.87                                              | 0.47          |
| 米ドル合計                                                       |              | 3 531 810.87                                              | 0.47          |
| ノートー固定金利                                                    |              | 3 531 810.87                                              | 0.47          |
| 最近発行された譲渡可能証券および金融市場商品合計                                    |              | 3 531 810.87                                              | 0.47          |

## 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   | 0.13  |
| アイルランド合計                                                         |        | 1 000 000.00   | 0.13  |
| ルクセンブルグ                                                          |        |                |       |
| USD UBS LUX BOND FUND - EURO HIGH YIELD EUR (USD HEDGED) U-X-ACC | 800.00 | 9 957 592.00   | 1.32  |
| ルクセンブルグ合計                                                        |        | 9 957 592.00   | 1.32  |
| 投資信託、オープン・エンド型合計                                                 |        | 10 957 592.00  | 1.45  |
| 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       |        | 10 957 592.00  | 1.45  |
| 投資有価証券合計                                                         |        | 717 311 266.60 | 95.16 |

## デリバティブ商品

## 公認証券取引所に上場されたデリバティブ商品

|                                          |         |             |       |
|------------------------------------------|---------|-------------|-------|
| 債券先物                                     |         |             |       |
| USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.25 | 700.00  | 265 001.36  | 0.03  |
| USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.25 | -360.00 | -165 937.68 | -0.02 |
| 債券先物合計                                   |         | 99 063.68   | 0.01  |
| 公認証券取引所に上場されたデリバティブ商品合計                  |         | 99 063.68   | 0.01  |
| デリバティブ商品合計                               |         | 99 063.68   | 0.01  |

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／<br>名目金額   | 先物／為替先物予約／<br>スワップに係る<br>未実現利益 (損失) の<br>米ドル建て評価額<br>(注1) | 純資産額に<br>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                                    | 479 699.71    | CHF 400 000.00 17.12.2024                                 | 24 920.17 0.00               |
| USD                                    | 1 103 227.00  | EUR 1 000 000.00 16.1.2025                                | 44 815.18 0.01               |
| USD                                    | 5 423 389.14  | EUR 4 910 650.00 16.1.2025                                | 225 899.12 0.03              |
| USD                                    | 4 306 897.24  | EUR 3 939 950.00 17.1.2025                                | 136 619.35 0.02              |
| USD                                    | 1 876 625.92  | CHF 1 600 000.00 17.12.2024                               | 57 507.76 0.01               |
| USD                                    | 1 270 945.40  | GBP 1 000 000.00 6.12.2024                                | -94.60 0.00                  |
| USD                                    | 993 211.20    | EUR 900 000.00 20.3.2025                                  | 37 688.40 0.00               |
| USD                                    | 4 742 823.03  | EUR 4 300 000.00 17.1.2025                                | 191 446.76 0.02              |
| USD                                    | 1 521 135.72  | EUR 1 350 000.00 20.3.2025                                | 87 851.52 0.01               |
| USD                                    | 1 454 636.30  | EUR 1 300 000.00 20.3.2025                                | 74 436.70 0.01               |
| EUR                                    | 66 691 900.00 | USD 70 076 380.54 3.1.2025                                | 469 719.93 0.06              |
| CHF                                    | 60 199 000.00 | USD 67 966 174.41 3.1.2025                                | 642 106.61 0.09              |
| <b>外国為替先物予約合計</b>                      |               |                                                           | <b>1 992 916.90 0.26</b>     |
| <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</b> |               |                                                           | <b>27 335 533.52 3.63</b>    |
| <b>その他の資産および負債</b>                     |               |                                                           | <b>7 027 171.76 0.94</b>     |
| <b>純資産合計</b>                           |               |                                                           | <b>753 765 952.46 100.00</b> |

注記は財務書類の不可分の一部である。

[次へ](#)



5 販売及び買戻しの実績

2024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2024年12月末日現在の発行済口数は以下のとおりである。

|                                       |                    | 販売口数                         | 買戻し口数                    | 発行済口数                        |
|---------------------------------------|--------------------|------------------------------|--------------------------|------------------------------|
| ショート・ターム米ドル<br>コーポレート・<br>サステナブル（米ドル） | クラス<br>F－a c c投資証券 | 408,950.008<br>(131,410.000) | 284,831.000<br>(950.000) | 808,850.241<br>(143,560.000) |

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

[次へ](#)

## (2) その他の訂正

(下線の部分は訂正部分を示します。)

## 第二部 ファンド情報

## 第1 ファンドの状況

## 7 管理及び運営の概要

&lt;訂正前&gt;

(前略)

|               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|---------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| (3) 本邦における代理人 | <p>東京都千代田区丸の内二丁目6番1号<br/>丸の内パークビルディング<br/>森・濱田松本法律事務所</p> <p>上記代理人は、本投資法人から日本国内において、</p> <p>(a) 本投資法人に対するルクセンブルグおよび日本の法律上の問題ならびに日本証券業協会の規則上の問題について一切の通信、請求、訴状、その他訴訟関係書類を受領する権限、および</p> <p>(b) 日本における投資証券の公募、販売、買戻しの取引に関する一切の紛争、見解の相違に関する一切の裁判上、裁判外の行為を行う権限を委任されており、また関東財務局長に対する投資証券の当初の募集に関する届出および継続開示ならびに金融庁長官に対する投資証券に関する届出等の代理人は下記のとおりである。</p> <p>弁護士 三浦 健<br/>同 大西 信治</p> <p>東京都千代田区丸の内二丁目6番1号<br/>丸の内パークビルディング<br/>森・濱田松本法律事務所</p> |
|---------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

&lt;訂正後&gt;

(前略)

|               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|---------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| (3) 本邦における代理人 | <p>東京都千代田区丸の内二丁目6番1号<br/>丸の内パークビルディング<br/>森・濱田松本法律事務所外国法共同事業</p> <p>上記代理人は、本投資法人から日本国内において、</p> <p>(a) 本投資法人に対するルクセンブルグおよび日本の法律上の問題ならびに日本証券業協会の規則上の問題について一切の通信、請求、訴状、その他訴訟関係書類を受領する権限、および</p> <p>(b) 日本における投資証券の公募、販売、買戻しの取引に関する一切の紛争、見解の相違に関する一切の裁判上、裁判外の行為を行う権限を委任されており、また関東財務局長に対する投資証券の当初の募集に関する届出および継続開示ならびに金融庁長官に対する投資証券に関する届出等の代理人は下記のとおりである。</p> <p>弁護士 三浦 健<br/>同 大西 信治</p> <p>東京都千代田区丸の内二丁目6番1号<br/>丸の内パークビルディング<br/>森・濱田松本法律事務所外国法共同事業</p> |
|---------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

### 第三部 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

&lt;訂正前&gt;

(前略)

##### (3) 本邦における代理人

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

上記代理人は、本投資法人から日本国内において、

- (a) 本投資法人に対するルクセンブルグおよび日本の法律上の問題ならびに日本証券業協会の規則上の問題について一切の通信、請求、訴状、その他訴訟関係書類を受領する権限、および
- (b) 日本における投資証券の公募、販売、買戻しの取引に関する一切の紛争、見解の相違に関する一切の裁判上、裁判外の行為を行う権限を委任されており、また関東財務局長に対する投資証券の当初の募集に関する届出および継続開示ならびに金融庁長官に対する投資証券に関する届出等の代理人は下記のとおりである。

弁護士 三浦 健

同 大西 信治

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

(後略)

<訂正後>

(前略)

(3) 本邦における代理人

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外国法共同事業

上記代理人は、本投資法人から日本国内において、

- (a) 本投資法人に対するルクセンブルグおよび日本の法律上の問題ならびに日本証券業協会の規則上の問題について一切の通信、請求、訴状、その他訴訟関係書類を受領する権限、および
- (b) 日本における投資証券の公募、販売、買戻しの取引に関する一切の紛争、見解の相違に関する一切の裁判上、裁判外の行為を行う権限を委任されており、また関東財務局長に対する投資証券の当初の募集に関する届出および継続開示ならびに金融庁長官に対する投資証券に関する届出等の代理人は下記のとおりである。

弁護士 三浦 健

同 大西 信治

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外国法共同事業

(後略)