

【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) ストラテジー・シキャブ
(UBS (Lux) Strategy SICAV)

【代表者の役職氏名】 チェアマン・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ
ロバート・スティングァー (Robert Süttinger)
メンバー・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ
イオアナ・ナウム (Ioana Naum)

【本店の所在の場所】 ルクセンブルグ大公国、ルクセンブルグ L - 1855、
J.F. ケネディ通り33A
(33A avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg, Grand Duchy of
Luxembourg)

【代理人の氏名又は名称】 弁護士 三 浦 健
弁護士 大 西 信 治

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

【事務連絡者氏名】 弁護士 三 浦 健
弁護士 大 西 信 治
弁護士 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) ストラテジー・シキャブ
- ダイナミック・インカム(米ドル)
- インカム・サステナブル(米ドル)
- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・
ディフェンシブ(米ドル)
- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・
ミディアム(米ドル)
- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・
ダイナミック(米ドル)
(UBS (Lux) Strategy SICAV
- Dynamic Income (USD)
- Income Sustainable (USD)
- Systematic Allocation Portfolio Defensive (USD)
- Systematic Allocation Portfolio Medium (USD)
- Systematic Allocation Portfolio Dynamic (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

ダイナミック・インカム(米ドル)

クラスP - m d i s t 投資証券

クラスP - a c c 投資証券

インカム・サステナブル(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

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

クラスP - a c c 投資証券

システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム
(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック
(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

上限見込額は以下のとおりである。

ダイナミック・インカム(米ドル)

クラスP - m d i s t 投資証券

9億2,690万米ドル(約1,342億円)

クラスP - a c c 投資証券

12億6,620万米ドル(約1,833億円)

インカム・サステナブル(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

12億5,990万米ドル(約1,824億円)

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

クラスP - a c c 投資証券

11億6,340万米ドル(約1,685億円)

システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム
(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

12億5,980万米ドル(約1,824億円)

システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック
(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

13億3,870万米ドル(約1,938億円)

- (注1) 上限見込額は、便宜上、ファンドの投資証券の2024年8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(ダイナミック・インカム(米ドル)クラスP - m d i s t米ドル投資証券については92.69米ドルに1,000万口、クラスP - a c c米ドル投資証券については126.62米ドルに1,000万口、インカム・サステナブル(米ドル)クラスP - a c c投資証券については125.99米ドルに1,000万口、システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)クラスP - a c c投資証券については116.34米ドルに1,000万口、システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)クラスP - a c c投資証券については125.98米ドルに1,000万口およびシステムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)クラスP - a c c投資証券については133.87米ドルに1,000万口をそれぞれ乗じて算出した金額である。)。
- (注2) 米ドルの円貨換算は、特に記載がない限り、2024年8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=144.80円)による。以下同じ。

【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、半期報告書に係る訂正の外貨数字の円換算については、直近の為替レートを用いておりますので、訂正前の換算レートとは異なっております。

2【訂正の内容】

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

半期報告書の記載内容は以下のとおりです。（原届出書に対する訂正内容に該当しない箇所は省略します。）

[次へ](#)

1 外国投資法人の概況

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

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

(1) 主要な経営指標等の推移

(ダイナミック・インカム (米ドル))

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	2022年11月末日 に終了する 中間会計年度末	2023年5月末日 に終了する 会計年度末	2023年11月末日 に終了する 中間会計年度末	2024年5月末日 に終了する 会計年度末	2024年11月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	- 25,197,117.22	- 12,413,525.18	19,411,176.14	49,279,121.13	28,114,547.68
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	- 25,197,117.22	- 12,413,525.18	19,411,176.14	49,279,121.13	28,114,547.68
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	- 25,197,117.22	- 12,413,525.18	19,411,176.14	49,279,121.13	28,114,547.68
(d) 出資総額 ⁽²⁾	481,816,696.11	467,641,801.58	444,974,093.19	457,800,364.57	448,933,996.32
(e) 発行済投資口総数 (クラス P - m d i s t 投資証券)	2,490,873.932口	2,509,889.582口	2,329,746.744口	2,316,269.779口	2,268,161.134口
(クラス P - a c c 投資証券)	467,607.967口	393,581.104口	364,808.068口	359,440.752口	365,656.634口
(f) 純資産額	481,816,696.11	467,641,801.58	444,974,093.19	457,800,364.57	448,933,996.32
(g) 資産総額	486,705,898.23	470,926,413.00	447,809,840.69	461,160,667.15	449,831,610.33
(h) 1口当たり純資産価格 (クラス P - m d i s t 投資証券)	86.97	85.71	86.76	90.18	93.27
(クラス P - a c c 投資証券)	106.52	109.16	113.66	121.52	129.17
(i) 1口当たり当期純利益金額 または当期純損失金額 (クラス P - m d i s t 投資証券)	- 4.47	- 2.33	3.64	9.65	5.65
(クラス P - a c c 投資証券)	- 6.16	- 4.13	4.62	12.83	7.48
(j) 分配総額	13,674,580.92	29,668,122.23	11,044,849.61	21,854,912.37	10,328,020.02
(k) 1口当たり分配金額 (クラス P - m d i s t 投資証券)	2.76	6.16	2.44	4.9557	2.5340
(クラス P - a c c 投資証券)	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	99.00%	99.30%	99.37%	99.27%	99.80%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾ (クラス P - m d i s t 投資証券)	- 11.08%	- 1.81%	6.47%	11.00%	13.32%
(クラス P - a c c 投資証券)	- 11.20%	- 1.65%	6.70%	11.32%	13.65%

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

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

- (3) 自己資本利益率は、当該会計年度末および当該中間会計年度末の 1 口当たり純資産価格の前年度に対する増減の比率であるが、当該会計年度に初めて当該投資証券が発行された場合には、当初募集価格に対する増減の比率で表すものとする。以下同じ。
- (4) 「主要な経営指標等の推移(e) 発行済投資口総数、(h) 1 口当たり純資産価格、(i) 1 口当たり当期純利益金額または当期純損失金額、(k) 1 口当たり分配金額および(m) 自己資本利益率」は、日本で販売しているクラスのみ記載している。以下同じ。
- (注 1) 各取引に使用された 1 口当たりの純資産価格は、純資産価格の調整の結果、上記および財務書類に記載の価格と異なる場合がある(財務書類に対する注記 1 参照)。以下同じ。
- (注 2) ダイナミック・インカム(米ドル)は2019年 1 月28日に運用を開始した。

(インカム・サステナブル(米ドル))

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	2022年11月末日 に終了する 中間会計年度末	2023年 5 月末日 に終了する 会計年度末	2023年11月末日 に終了する 中間会計年度末	2024年 5 月末日 に終了する 会計年度末	2024年11月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ^(1)	- 3,229,233.37	- 2,118,694.05	1,209,024.25	4,132,353.16	3,161,511.98
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	- 3,229,233.37	- 2,118,694.05	1,209,024.25	4,132,353.16	3,161,511.98
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	- 3,229,233.37	- 2,118,694.05	1,209,024.25	4,132,353.16	3,161,511.98
(d) 出資総額 ^(2)	89,945,478.22	92,024,987.25	75,487,338.01	73,400,443.11	72,485,089.41
(e) 発行済投資口総数 (クラス P - a c c 投資証券)	503,687.433口	492,951.819口	491,292.285口	460,623.723口	449,816.921口
(f) 純資産額	89,945,478.22	92,024,987.25	75,487,338.01	73,400,443.11	72,485,089.41
(g) 資産総額	90,403,671.94	92,368,410.51	78,069,304.12	74,188,657.06	72,555,491.55
(h) 1 口当たり純資産価格 (クラス P - a c c 投資証券)	113.53	114.88	116.57	121.10	126.48
(i) 1 口当たり当期純利益金額 または当期純損失金額 (クラス P - a c c 投資証券)	- 4.26	- 3.03	1.71	6.57	5.42
(j) 分配総額	8,663.72	33,727.98	109,185.52	210,610.58	94,818.12
(k) 1 口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	99.49%	99.63%	96.69%	98.94%	99.90%
(m) 自己資本利益率 ^(3) (クラス P - a c c 投資証券)	- 11.36%	- 2.15%	2.68%	5.41%	8.50%

(注) インカム・サステナブル(米ドル)は2014年 1 月28日に運用を開始した。

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

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	2022年11月末日 に終了する 中間会計年度末	2023年 5 月末日 に終了する 会計年度末	2023年11月末日 に終了する 中間会計年度末	2024年 5 月末日 に終了する 会計年度末	2024年11月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ^(1)	- 47,526,655.27	- 32,042,982.00	15,691,759.82	38,986,492.57	16,170,564.96
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	- 47,526,655.27	- 32,042,982.00	15,691,759.82	38,986,492.57	16,170,564.96
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	- 47,526,655.27	- 32,042,982.00	15,691,759.82	38,986,492.57	16,170,564.96
(d) 出資総額 ^(2)	628,440,720.67	516,321,326.56	457,477,832.79	405,059,242.07	373,769,883.98
(e) 発行済投資口総数 (クラス P - a c c 投資証券)	2,006,982.711口	1,335,171.059口	1,087,911.633口	917,515.866口	809,087.529口
(f) 純資産額	628,440,720.67	516,321,326.56	457,477,832.79	405,059,242.07	373,769,883.98
(g) 資産総額	635,205,701.79	523,722,777.31	459,362,398.29	405,551,181.21	375,740,910.62
(h) 1口当たり純資産価格 (クラス P - a c c 投資証券)	102.10	103.61	105.86	113.00	118.34
(i) 1口当たり当期純利益金額 または当期純損失金額 (クラス P - a c c 投資証券)	- 6.52	- 7.73	2.69	11.18	5.65
(j) 分配総額	1,657,279.14	3,068,358.58	1,268,088.19	2,419,945.03	773,542.33
(k) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	98.93%	98.59%	99.59%	99.88%	99.48%
(m) 自己資本利益率 ^(3) (クラス P - a c c 投資証券)	- 14.04%	- 3.22%	3.68%	9.06%	11.79%

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

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

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	2022年11月末日 に終了する 中間会計年度末	2023年 5 月末日 に終了する 会計年度末	2023年11月末日 に終了する 中間会計年度末	2024年 5 月末日 に終了する 会計年度末	2024年11月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ^(1)	- 102,366,701.49	- 71,852,810.51	45,030,746.32	125,806,827.30	51,601,543.71
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	- 102,366,701.49	- 71,852,810.51	45,030,746.32	125,806,827.30	51,601,543.71
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	- 102,366,701.49	- 71,852,810.51	45,030,746.32	125,806,827.30	51,601,543.71
(d) 出資総額 ^(2)	1,226,070,417.25	1,035,849,484.36	964,444,607.03	957,497,503.57	919,575,809.74
(e) 発行済投資口総数 (クラス P - a c c 投資証券)	3,361,314.941口	2,526,594.071口	2,189,663.042口	2,004,160.458口	1,894,328.670口
(f) 純資産額	1,226,070,417.25	1,035,849,484.36	964,444,607.03	957,497,503.57	919,575,809.74
(g) 資産総額	1,242,648,990.27	1,057,338,298.42	969,911,044.76	960,331,656.90	928,361,266.13
(h) 1口当たり純資産価格 (クラス P - a c c 投資証券)	105.82	107.68	111.44	122.45	129.89
(i) 1口当たり当期純利益金額 または当期純損失金額 (クラス P - a c c 投資証券)	- 7.53	- 7.60	4.27	16.07	7.70
(j) 分配総額	2,626,065.74	4,839,588.49	1,914,063.19	3,700,935.81	1,759,228.61
(k) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	98.67%	97.97%	99.44%	99.70%	99.05%
(m) 自己資本利益率 ^(3) (クラス P - a c c 投資証券)	- 16.52%	- 3.68%	5.31%	13.72%	16.56%

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

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

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	2022年11月末日 に終了する 中間会計年度末	2023年 5 月末日 に終了する 会計年度末	2023年11月末日 に終了する 中間会計年度末	2024年 5 月末日 に終了する 会計年度末	2024年11月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ^(1)	- 28,107,444.15	- 18,033,302.74	13,938,137.24	43,756,958.86	18,787,012.13
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	- 28,107,444.15	- 18,033,302.74	13,938,137.24	43,756,958.86	18,787,012.13
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	- 28,107,444.15	- 18,033,302.74	13,938,137.24	43,756,958.86	18,787,012.13
(d) 出資総額 ^(2)	354,018,277.42	293,356,127.44	276,796,785.88	270,857,808.66	270,225,363.86
(e) 発行済投資口総数 (クラス P - a c c 投資証券)	1,237,882.787口	830,170.843口	748,511.731口	681,202.979口	638,956.163口
(f) 純資産額	354,018,277.42	293,356,127.44	276,796,785.88	270,857,808.66	270,225,363.86
(g) 資産総額	358,311,864.30	296,558,457.04	277,857,913.69	271,469,298.03	271,492,792.89
(h) 1口当たり純資産価格 (クラス P - a c c 投資証券)	108.90	111.21	115.46	129.67	139.32
(i) 1口当たり当期純利益金額 または当期純損失金額 (クラス P - a c c 投資証券)	- 6.98	- 7.33	4.63	20.10	10.02
(j) 分配総額	339,000.17	650,234.40	287,438.58	558,195.18	263,469.17
(k) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	98.80%	98.92%	99.62%	99.77%	99.53%
(m) 自己資本利益率 ^(3) (クラス P - a c c 投資証券)	- 18.79%	- 3.57%	6.02%	16.60%	20.67%

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

(2) 外国投資法人の出資総額

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(口)	
	米ドル	百万円		
ダイナミック・インカム(米ドル)	642,055,510.65	101,560	クラスP - m d i s t 投資証券	2,253,377.829
			クラスP - a c c 投資証券	787,526.452
インカム・サステナブル(米ドル)	71,023,961.02	11,235	クラスP - a c c 投資証券	444,391.436
システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)	328,533,632.58	51,967	クラスP - a c c 投資証券	790,982.946
システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)	877,843,479.77	138,857	クラスP - a c c 投資証券	1,868,058.365
システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)	261,946,029.26	41,435	クラスP - a c c 投資証券	640,259.432

(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買相場の仲値(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(改訂済)により、当該サブ・ファンドの主要な投資主に関する情報は公開できない。

(4) 役員の状況

(2024年12月末日現在)

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

(注) 本投資法人に従業員はいない。本投資法人の独立監査法人は2025年1月1日以降アーンスト・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、投資主総会で補足またはその他に変更することができる。変更は、1915年8月10日法の規定における定足数および過半数に関する要件に従う。

b . 事業譲渡または事業譲受

投資法人およびそのサブ・ファンドの解散、サブ・ファンドの合併

本投資法人およびそのサブ・ファンドの解散

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

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

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

同一サブ・ファンド内で各サブ・ファンドまたは投資証券クラスの純資産総額が当該サブ・ファンドまたは投資証券クラスを経済的に合理的な管理のため要求される価額またはかかる価額に達しなかった場合、または政治、経済もしくは金融の状況が著しく変化した場合または合理化の一環とし

て、投資主総会または本投資法人の取締役は、該当する投資証券クラスのすべての投資証券を決定が効力を生じる評価日における純資産価格にて(投資対象の実際の換金率および経費を考慮して)買い戻すことを決定することができる。

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

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

「合併」とは、以下の取引である。

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

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

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

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

て交換される。割当てする投資証券が集合的投資ファンド(契約型オープン投資信託)の受益証券である場合、上記の決定は割当てに賛成票を投じた投資主だけを拘束する。

本投資法人の総会または関係するサブ・ファンドの投資主総会

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

c．出資の状況その他の重要事項

該当事項なし。

d．訴訟事件その他の重要事項

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

[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

(ダイナミック・インカム(米ドル))

(2024年12月末日現在)

資産の種類	国・地域名	時価合計(米ドル)	投資比率 (%)
投資信託	ルクセンブルグ	311,541,190.61	48.35
	アイルランド	38,860,877.70	6.03
	シンガポール	10,158,142.24	1.58
	イギリス	349,819.32	0.05
	アメリカ合衆国	77,229.36	0.01
	小計	360,987,259.23	56.02
株式	アメリカ合衆国	134,136,950.14	20.82
	日本	21,312,350.62	3.31
	イギリス	15,396,592.82	2.39
	オーストラリア	12,149,162.64	1.89
	フランス	9,050,553.43	1.40
	ドイツ	7,403,294.05	1.15
	スイス	5,316,059.35	0.82
	オランダ	3,576,166.26	0.55
	アイルランド	2,549,584.14	0.40
	スペイン	2,130,201.04	0.33
	カナダ	1,643,213.42	0.25
	イタリア	1,564,415.87	0.24
	フィンランド	796,864.61	0.12
	シンガポール	716,699.59	0.11
	スウェーデン	653,942.97	0.10
	香港	498,797.31	0.08
	ベルギー	469,575.02	0.07
	イスラエル	186,024.72	0.03
	デンマーク	183,418.48	0.03
	オーストリア	166,765.49	0.03
	ニュージーランド	153,844.54	0.02
	ウルグアイ	144,537.40	0.02
	ルクセンブルグ	114,743.36	0.02
	バミューダ	114,712.93	0.02
	ノルウェー	101,808.41	0.02
	ポルトガル	100,144.57	0.02
	ジャージー	24,796.80	0.00
	マン島	23,271.96	0.00
	中国	23,232.66	0.00

	ポーランド	14,856.52	0.00
	小計	220,716,581.12	34.25
短期金融商品	アメリカ合衆国	30,172,497.11	4.68
債券	アメリカ合衆国	19,051,016.56	2.96
	アイルランド	0.03	0.00
	小計	19,051,016.59	2.96
従来型 オプション	スイス	- 54,093.78	- 0.01
	カナダ	- 112,343.08	- 0.02
	イギリス	- 303,905.96	- 0.05
	小計	- 470,342.82	- 0.07
ポートフォリオ合計		630,457,011.23	97.83
現金・その他資産		13,953,970.28	2.17
資産総額		644,410,981.51	100.00
負債総額		2,355,470.86	0.37
合計 (純資産総額)		642,055,510.65 (約101,560百万円)	99.63

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

(インカム・サステナブル (米ドル))

(2024年12月末日現在)

資産の種類	国・地域名	時価合計 (米ドル)	投資比率 (%)
投資信託	ルクセンブルグ	59,332,177.14	81.80
	アイルランド	10,775,046.25	14.86
	小計	70,107,223.39	96.66
ポートフォリオ合計		70,107,223.39	96.66
現金・その他資産		2,424,874.30	3.34
資産総額		72,532,097.69	100.00
負債総額		1,508,136.67	2.08
合計 (純資産総額)		71,023,961.02 (約11,235百万円)	97.92

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

(2024年12月末日現在)

資産の種類	国・地域名	時価合計(米ドル)	投資比率 (%)
投資信託	ルクセンブルグ	213,475,508.30	64.01
	アイルランド	57,061,064.72	17.11
	シンガポール	17,586.10	0.01
	イギリス	8,773.05	0.00
	小計	270,562,932.17	81.13
その他の 有価証券	アイルランド	24,953,910.50	7.48
	イギリス	336,193.00	0.10
	小計	25,290,103.50	7.58
株式	日本	3,264,448.32	0.98
	イギリス	1,948,136.27	0.58
	カナダ	1,777,391.96	0.53
	フランス	1,478,120.22	0.44
	スイス	1,383,331.20	0.41
	ドイツ	1,288,962.97	0.39
	オーストラリア	980,914.16	0.29
	オランダ	717,277.28	0.22
	スウェーデン	487,861.59	0.15
	デンマーク	395,260.95	0.12
	スペイン	361,470.64	0.11
	イタリア	310,635.65	0.09
	香港	270,177.83	0.08
	シンガポール	210,080.50	0.06
	フィンランド	133,018.08	0.04
	イスラエル	121,676.26	0.04
	ベルギー	100,690.69	0.03
	アイルランド	88,404.72	0.03
	ノルウェー	80,430.76	0.02
	ニュージーランド	43,670.08	0.01
	オーストリア	27,085.82	0.01
	ルクセンブルグ	24,065.50	0.01
	ポルトガル	19,499.00	0.01
	バミューダ	7,143.21	0.00
	マカオ	5,381.09	0.00
	マン島	4,845.46	0.00
	ポーランド	3,624.37	0.00
	中国	2,191.76	0.00
	小計	15,535,796.34	4.66
短期金融商品	アメリカ合衆国	11,539,902.46	3.46

ポートフォリオ合計	322,928,734.47	96.84
現金・その他資産	10,551,154.37	3.16
資産総額	333,479,888.84	100.00
負債総額	4,946,256.26	1.48
合計 (純資産総額)	328,533,632.58 (約51,967百万円)	98.52

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

(2024年12月末日現在)

資産の種類	国・地域名	時価合計 (米ドル)	投資比率 (%)
投資信託	ルクセンブルグ	396,997,544.96	44.58
	アイルランド	268,083,946.29	30.10
	シンガポール	88,142.88	0.01
	イギリス	45,287.89	0.01
	カナダ	2,964.12	0.00
	小計	665,217,886.14	74.70
株式	日本	17,150,367.59	1.93
	イギリス	10,406,122.54	1.17
	カナダ	9,469,043.44	1.06
	フランス	7,888,534.80	0.89
	スイス	7,380,645.98	0.83
	ドイツ	6,782,671.24	0.76
	オーストラリア	5,245,289.58	0.59
	オランダ	3,836,855.35	0.43
	スウェーデン	2,588,695.92	0.29
	デンマーク	2,117,227.14	0.24
	スペイン	1,927,440.36	0.22
	イタリア	1,645,785.44	0.18
	香港	1,435,263.53	0.16
	シンガポール	1,141,372.91	0.13
	イスラエル	718,874.37	0.08
	フィンランド	718,357.60	0.08
	ベルギー	566,878.51	0.06
	アイルランド	466,364.37	0.05
	ノルウェー	435,370.75	0.05
	ニュージーランド	216,940.98	0.02
	オーストリア	146,725.34	0.02
	ルクセンブルグ	127,208.65	0.01
	ポルトガル	99,921.61	0.01
	バミューダ	34,412.98	0.00
	マカオ	26,905.43	0.00
	中国	26,518.45	0.00
	マン島	21,662.54	0.00
	ポーランド	17,130.30	0.00
	小計	82,638,587.70	9.28
その他の 有価証券	アイルランド	58,260,674.00	6.54
	イギリス	4,861,809.23	0.55
	小計	63,122,483.23	7.09

短期金融商品	アメリカ合衆国	53,347,644.67	5.99
ワラント	カナダ	0.01	0.00
ポートフォリオ合計		864,326,601.75	97.06
現金・その他資産		26,184,706.80	2.94
資産総額		890,511,308.55	100.00
負債総額		12,667,828.78	1.42
合計(純資産総額)		877,843,479.77 (約138,857百万円)	98.58

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

(2024年12月末日現在)

資産の種類	国・地域名	時価合計 (米ドル)	投資比率 (%)
投資信託	アイルランド	109,506,952.63	41.54
	ルクセンブルグ	77,468,600.57	29.38
	シンガポール	31,466.45	0.01
	イギリス	21,480.35	0.01
	カナダ	2,964.12	0.00
	小計	187,031,464.12	70.94
株式	日本	7,638,462.23	2.90
	イギリス	4,665,505.46	1.77
	カナダ	4,248,740.20	1.61
	フランス	3,532,707.80	1.34
	スイス	3,308,752.46	1.26
	ドイツ	3,025,125.35	1.15
	オーストラリア	2,354,956.05	0.89
	オランダ	1,717,448.48	0.65
	スウェーデン	1,164,000.03	0.44
	デンマーク	946,236.00	0.36
	スペイン	869,031.93	0.33
	イタリア	731,012.47	0.28
	香港	637,773.13	0.24
	シンガポール	511,958.19	0.19
	イスラエル	321,706.30	0.12
	フィンランド	318,614.04	0.12
	ベルギー	255,793.89	0.10
	アイルランド	218,965.96	0.08
	ノルウェー	189,013.62	0.07
	ニュージーランド	96,555.35	0.04
	オーストリア	67,267.37	0.03
	ルクセンブルグ	61,084.05	0.02
	ポルトガル	44,478.45	0.02
	バミューダ	16,021.88	0.01
	マカオ	13,990.82	0.01
	中国	12,601.70	0.00
	マン島	9,467.14	0.00
	ポーランド	7,043.60	0.00
	小計	36,984,313.95	14.03
短期金融商品	アメリカ合衆国	19,961,020.27	7.57
その他の 有価証券	アイルランド	10,721,714.50	4.07
	イギリス	1,768,986.44	0.67

	小計	12,490,700.94	4.74
ワラント	カナダ	0.01	0.00
ポートフォリオ合計		256,467,499.29	97.28
現金・その他資産		7,168,664.22	2.72
資産総額		263,636,163.51	100.00
負債総額		1,690,134.25	0.64
合計(純資産総額)		261,946,029.26 (約41,435百万円)	99.36

（２）運用実績

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。

（ダイナミック・インカム（米ドル））

	資産総額		純資産総額		1口当たり純資産価格 （クラスP - m d i s t 投資証券）		1口当たり純資産価格 （クラスP - a c c 投資証券）	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円	米ドル	円
2024年1月末日	456,933.25	72,278	455,916.48	72,117	89.07	14,089	117.78	18,630
2月末日	463,853.19	73,372	462,157.19	73,104	89.56	14,167	118.99	18,822
3月末日	460,941.43	72,912	459,805.26	72,732	91.02	14,398	121.49	19,217
4月末日	458,332.90	72,499	457,662.85	72,393	89.14	14,100	119.55	18,910
5月末日	461,160.67	72,946	457,800.36	72,415	90.18	14,265	121.52	19,222
6月末日	458,963.26	72,599	457,516.13	72,370	90.56	14,325	122.58	19,390
7月末日	461,083.56	72,934	460,499.10	72,842	91.83	14,526	124.86	19,750
8月末日	453,304.67	71,704	452,241.26	71,536	92.69	14,662	126.62	20,029
9月末日	458,079.20	72,459	456,121.43	72,149	93.68	14,818	128.55	20,334
10月末日	444,712.75	70,345	443,634.24	70,174	92.20	14,584	127.11	20,106
11月末日	449,831.61	71,154	448,934.00	71,012	93.27	14,753	129.17	20,432
12月末日	644,410.98	101,933	642,055.51	101,560	91.84	14,527	127.79	20,214

（インカム・サステナブル（米ドル））

	資産総額		純資産総額		1口当たり純資産価格 （クラスP - a c c 投資証券）	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円
2024年1月末日	75,389.70	11,925	75,346.54	11,918	120.02	18,985
2月末日	75,731.72	11,979	75,223.22	11,899	120.00	18,982
3月末日	75,756.03	11,983	75,186.14	11,893	121.50	19,219
4月末日	74,625.05	11,804	72,943.33	11,538	119.45	18,895
5月末日	74,188.66	11,735	73,400.44	11,610	121.10	19,156
6月末日	71,639.96	11,332	71,524.35	11,314	122.26	19,339
7月末日	71,826.37	11,361	71,741.26	11,348	124.19	19,644
8月末日	72,955.40	11,540	72,895.04	11,531	125.99	19,929
9月末日	73,274.89	11,591	73,222.54	11,582	127.29	20,135
10月末日	71,203.48	11,263	71,173.20	11,258	124.89	19,755
11月末日	72,555.49	11,477	72,485.09	11,466	126.48	20,007
12月末日	72,532.10	11,473	71,023.96	11,235	125.12	19,791

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

	資産総額		純資産総額		1口当たり純資産価格 （クラスP - a c c 投資証券）	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円
2024年1月末日	459,167.83	72,631	455,426.27	72,039	109.51	17,322
2月末日	451,590.73	71,433	447,037.84	70,712	110.60	17,495
3月末日	442,639.10	70,017	440,823.73	69,729	112.61	17,813
4月末日	420,711.93	66,548	418,716.19	66,233	111.15	17,582
5月末日	405,551.18	64,150	405,059.24	64,072	113.00	17,874
6月末日	399,273.89	63,157	397,930.34	62,945	114.32	18,083
7月末日	397,118.22	62,816	396,509.17	62,720	115.64	18,292
8月末日	401,069.75	63,441	400,589.33	63,365	116.34	18,403
9月末日	405,610.03	64,159	402,834.26	63,720	118.19	18,695
10月末日	382,785.19	60,549	378,719.13	59,906	116.74	18,466
11月末日	375,740.91	59,435	373,769.88	59,123	118.34	18,719
12月末日	333,479.89	52,750	328,533.63	51,967	117.30	18,555

（システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム（米ドル））

	資産総額		純資産総額		1口当たり純資産価格 （クラスP - a c c 投資証券）	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円
2024年1月末日	981,648.08	155,277	972,378.05	153,811	116.38	18,409
2月末日	982,504.60	155,413	970,553.27	153,522	118.80	18,792
3月末日	983,466.28	155,565	975,973.52	154,379	121.84	19,273
4月末日	951,818.26	150,559	944,637.63	149,423	120.10	18,997
5月末日	960,331.66	151,905	957,497.50	151,457	122.45	19,369
6月末日	962,599.25	152,264	959,954.81	151,846	124.54	19,700
7月末日	957,409.64	151,443	951,294.02	150,476	125.32	19,823
8月末日	963,425.87	152,395	959,345.02	151,749	125.98	19,928
9月末日	972,161.44	153,776	963,897.84	152,469	128.37	20,306
10月末日	931,902.15	147,408	924,366.99	146,216	127.50	20,168
11月末日	928,361.27	146,848	919,575.81	145,459	129.89	20,546
12月末日	890,511.31	140,861	877,843.48	138,857	128.60	20,342

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

	資産総額		純資産総額		1口当たり純資産価格 （クラスP - a c c 投資証券）	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円
2024年1月末日	287,218.71	45,432	284,450.53	44,994	121.56	19,228
2月末日	291,699.03	46,141	286,618.75	45,337	125.16	19,798
3月末日	291,801.72	46,157	290,241.09	45,910	129.02	20,408
4月末日	268,457.59	42,465	267,398.29	42,297	126.68	20,038
5月末日	271,469.30	42,941	270,857.81	42,844	129.67	20,511
6月末日	272,275.16	43,068	271,888.79	43,007	132.68	20,987
7月末日	272,099.59	43,041	271,464.10	42,940	133.36	21,095
8月末日	275,167.46	43,526	274,610.45	43,438	133.87	21,176
9月末日	281,212.05	44,482	278,125.78	43,994	136.62	21,611
10月末日	274,145.00	43,364	271,162.39	42,892	136.02	21,516
11月末日	271,492.79	42,945	270,225.36	42,744	139.32	22,038
12月末日	263,636.16	41,702	261,946.03	41,435	137.76	21,791

ファンドの投資証券は、ルクセンブルグ証券取引所に上場されている。

同取引所での実質的な取引実績はない。

分配の推移

2024年12月末日前1年間における各月の1口当たり分配金は以下のとおりである。

ダイナミック・インカム(米ドル)クラスP - m d i s t 投資証券

期間	1口当たりの分配金額	
	米ドル	円
2024年1月	0.4200	66
2月	0.4200	66
3月	0.4323	68
4月	0.4234	67
5月	0.4100	65
6月	0.4100	65
7月	0.4285	68
8月	0.4285	68
9月	0.4285	68
10月	0.4285	68
11月	0.4285	68
12月	0.4285	68

(注) 各月の分配金は、各月末までに宣言された金額である。

ダイナミック・インカム(米ドル)

クラスP - a c c (米ドル) 投資証券

インカム・サステナブル(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

該当事項なし

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。

	収益率(%) (注)	
	クラスP - m d i s t 投資証券	8.78
ダイナミック・インカム (米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	8.98
インカム・サステナブル (米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	4.14
システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	7.84
システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	11.72
システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	14.94

(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金額を加えた額)

b = 2023年12月末日現在の1口当たり純資産価格(分配額の額)

(3) 投資リスク

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。

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

[次へ](#)

3 資産運用会社の概況

(1) 名称及び資本金の額

UBS アセット・マネジメント (ヨーロッパ) エス・エイ (「管理会社」)

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。

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

資本金 (株主資本) の額

2024年12月末日現在の株主資本総額は、500,000スイス・フラン (約8,768万円)

(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。

ユービーエス・スイス・エイ・ジー (チューリッヒ) (「投資運用会社」および「投資顧問会社」)

資本金 (株主資本) の額

2024年12月末日現在の株主資本総額は、1,000万スイス・フラン (約18億円)

(2) 大株主の状況

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

UBS アセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー (チューリッヒ)

(2024年12月末日現在)

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

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

(3) 役員の状況

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

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 (Miederhoff Markus)	ヴァイス・チェアマン	2019年 6 月20日就任	該当なし
ケッテラー・レト・ユー (Ketterer Reto U.)	ディレクター / ボード・メンバー	2020年 9 月24日就任	該当なし
サリバ・ガイレ (Saliba Gaylee)	ディレクター / ボード・メンバー	2021年12月 1 日就任	該当なし
イヴァノビッチ・アレクサン ダー (Ivanovic Aleksandar)	チェアマン	2020年 9 月24日就任	該当なし
スティラート・イボンヌ (Stillhart Yvonne)	社外インディペンデ ント・ディレクター	2019年 6 月20日就任	該当なし
ビョーハイム・ジェイコブ (Bjorheim Jacob)	社外インディペンデ ント・ディレクター	2019年 6 月20日就任	該当なし

ユービーエス・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
ロジャー・フォン・メントレン (Roger von Mentlen)	チェアマン	2023年11月1日就任	非公開
バーバラ・ランバート (Barbara Lambert)	ディレクター/ ボード・メンバー	2022年4月5日就任	非公開
ダニエル・ジェイ・クリティン (Daniel J. Crittin)	ディレクター/ ボード・メンバー	2016年4月25日就任	非公開
ガブリエラ・フーバー (Gabriela Huber)	ヴァイス・ チェアマン	2015年6月12日就任	非公開
クリストフ・ブルーナー (Christoph Brunner)	ディレクター/ ボード・メンバー	2023年11月1日就任	非公開
ピーター・ディレンディンカー (Peter Derendinger)	ディレクター/ ボード・メンバー	2023年11月1日就任	非公開
クラウディア・ディル (Claudia Dill)	ディレクター/ ボード・メンバー	2023年11月1日就任	非公開
ダミアン・フォーゲル (Damian Vogel)	ディレクター/ ボード・メンバー	2023年11月1日就任	非公開

(4) 事業の内容及び営業の概況

UBS アセット・マネジメント(ヨーロッパ) エス・エイ

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

管理会社は、本投資法人の所在地事務代行会社としても行為している。

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)	種別(基本的性格)	本数	純資産額の合計(通貨別)
ルクセンブルグ	オープン・エンド型 投資信託 / 投資法人	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

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 (ユーロ)
1	Multi Manager Access II - US Multi Credit Sustainable	変動資本を有する 投資法人	2007年11月27日	5,001,304,384
2	Multi Manager Access II - Emerging Markets Debt	変動資本を有する 投資法人	2013年12月2日	4,505,326,194
3	UBS (Lux) Bond Sicav - Convert Global (EUR)	変動資本を有する 投資法人	2004年11月18日	4,349,131,566
4	Multi Manager Access II - European Multi Credit Sustainable	変動資本を有する 投資法人	2007年8月21日	4,065,635,723
5	Focused Sicav - High Grade Long Term Bond USD	変動資本を有する 投資法人	2006年10月26日	4,024,693,668
6	Credit Suisse Index Fund (Lux)- CSIF (Lux) Equity Emerging Markets ESG Blue	変動資本を有する 投資法人	2017年5月26日	3,701,304,290
7	UBS (Lux) Money Market Fund - USD	契約型投資信託	1988年11月25日	3,623,895,024
8	Multi Manager Access II - High Yield	変動資本を有する 投資法人	2016年4月13日	3,302,877,823
9	UBS (Lux) Money Market Fund - EUR	契約型投資信託	1989年10月9日	3,260,083,794
10	Multi Manager Access - Green, Social and Sustainable Bonds	変動資本を有する 投資法人	2022年3月10日	2,084,253,406

(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。

ユービーエス・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)

2024年12月末日現在、ユービーエス・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)は55本のサブ・ファンドを運用しており、そのうち運用資産額上位10位のサブ・ファンドは、以下のとおりである。

	名称	基本的性格	設定日	純資産総額 (ユーロ)
1	Multi Manager Access II - US Multi Credit Sustainable	変動資本を有する 投資法人	2007年11月27日	5,001,304,384
2	Multi Manager Access II - Emerging Markets Debt	変動資本を有する 投資法人	2013年12月 2 日	4,505,326,194
3	Multi Manager Access II - European Multi Credit Sustainable	変動資本を有する 投資法人	2007年 8 月21日	4,065,635,723
4	UBS (Lux) Equity Sicav - Long Term Themes (USD)	変動資本を有する 投資法人	2016年 1 月28日	3,921,783,730
5	Multi Manager Access II - High Yield	変動資本を有する 投資法人	2016年 4 月13日	3,302,877,823
6	Multi Manager Access - Green, Social and Sustainable Bonds	変動資本を有する 投資法人	2022年 3 月10日	2,084,253,406
7	UBS(Lux)Strategy Fund - Balanced Sustainable (CHF)	契約型投資信託	1994年 7 月 1 日	1,925,352,277
8	UBS (Lux) Strategy Fund - Yield Sustainable (CHF)	契約型投資信託	1991年 9 月10日	1,682,821,373
9	Multi Manager Access - EMU Equities Sustainable	変動資本を有する 投資法人	2014年 2 月 7 日	1,601,062,221
10	Global Opportunities Access - Sustainable Equities	変動資本を有する 投資法人	2019年 5 月13日	1,158,039,060

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

(注2) 一単位当たり純資産価格は開示していない。

(注3) 上記は管理会社から提供された情報に基づく。

[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. ファンドの原文の中間財務書類は、UBS (Lux) ストラテジー・シキャブおよび全てのサブ・ファンドにつき一括して作成されている。本書において日本語の作成にあたっては、関係するサブ・ファンドに関連する部分のみを記載している。なお、各サブ・ファンドには下記のクラス投資証券以外のクラス投資証券も存在するが、本書においては下記のクラス投資証券に関する部分のみを抜粋して日本語に記載している。
- ダイナミック・インカム(米ドル)
クラス P - a c c 投資証券
クラス P - m d i s t 投資証券
 - インカム・サステナブル(米ドル)
クラス P - a c c 投資証券
 - システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)
クラス P - a c c 投資証券
 - システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)
クラス P - a c c 投資証券
 - システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)
クラス P - a c c 投資証券
- 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

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

純資産計算書

	2024年11月30日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	396,482,344.45	62,715,577
投資有価証券、未実現評価(損)益	44,226,606.77	6,995,765
投資有価証券合計(注1)	440,708,951.22	69,711,342
現金預金、要求払預金および預託金勘定	4,857,855.42	768,416
有価証券売却未収金(注1)	316,803.32	50,112
発行未収金	1,632,791.78	258,275
有価証券に係る未収利息	130,556.94	20,651
配当金に係る未収金	317,776.98	50,266
その他の資産	1,255.44	199
その他の未収金	217,948.91	34,475
先渡為替契約に係る未実現利益(注1)	1,254,711.87	198,470
スワップに係る未実現利益(注1)	392,958.45	62,158
資産合計	449,831,610.33	71,154,364
負 債		
有価証券購入未払金(注1)	(357,519.59)	(56,552)
買戻未払金	(124,685.90)	(19,723)
定率報酬引当金(注2)	(395,982.52)	(62,637)
年次税引当金(注3)	(19,426.00)	(3,073)
引当金合計	(415,408.52)	(65,709)
負債合計	(897,614.01)	(141,985)
期末現在純資産	448,933,996.32	71,012,380

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ - インカム・サステナブル(米ドル)

純資産計算書

	2024年11月30日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	67,713,149.02	10,710,866
投資有価証券、未実現評価(損)益	3,707,859.34	586,509
投資有価証券合計(注1)	71,421,008.36	11,297,375
現金預金、要求払預金および預託金勘定	704,686.73	111,467
その他の流動資産(マージン)	36,809.05	5,822
発行未収金	0.34	0
流動資産に係る未収利息	11.46	2
その他の資産	43,087.90	6,816
金融先物に係る未実現利益(注1)	11,406.29	1,804
先渡為替契約に係る未実現利益(注1)	338,481.42	53,541
資産合計	72,555,491.55	11,476,828
負 債		
買戻未払金	(0.25)	(0)
定率報酬引当金(注2)	(69,451.74)	(10,986)
年次税引当金(注3)	(950.15)	(150)
引当金合計	(70,401.89)	(11,136)
負債合計	(70,402.14)	(11,136)
期末現在純資産	72,485,089.41	11,465,691

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

純資産計算書

	2024年11月30日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	309,024,239.71	48,881,454
投資有価証券、未実現評価(損)益	56,422,078.05	8,924,844
投資有価証券合計(注1)	365,446,317.76	57,806,299
現金預金、要求払預金および預託金勘定	5,851,568.34	925,601
その他の流動資産(マージン)	1,555,565.38	246,059
有価証券売却未収金(注1)	1,289,846.34	204,028
発行未収金	134.69	21
配当金に係る未収金	50,995.94	8,067
その他の未収金	140,210.75	22,179
金融先物に係る未実現利益(注1)	1,406,271.42	222,444
資産合計	375,740,910.62	59,434,697
負 債		
先渡為替契約に係る未実現損失(注1)	(291,099.90)	(46,046)
スワップに係る未実現損失(注1)	(64,051.85)	(10,132)
買戻未払金	(1,245,326.83)	(196,986)
定率報酬引当金(注2)	(345,196.69)	(54,603)
年次税引当金(注3)	(10,054.37)	(1,590)
その他の手数料および報酬引当金(注2)	(15,297.00)	(2,420)
引当金合計	(370,548.06)	(58,613)
負債合計	(1,971,026.64)	(311,777)
期末現在純資産	373,769,883.98	59,122,920

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

純資産計算書

	2024年11月30日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	200,879,250.83	31,775,080
投資有価証券、未実現評価(損)益	60,173,109.15	9,518,182
投資有価証券合計(注1)	261,052,359.98	41,293,262
現金預金、要求払預金および預託金勘定	3,551,747.98	561,815
その他の流動資産(マージン)	3,314,673.95	524,315
有価証券売却未収金(注1)	1,477,215.13	233,666
発行未収金	19,482.89	3,082
配当金に係る未収金	105,514.51	16,690
その他の資産	19,644.92	3,107
その他の未収金	147,446.34	23,323
金融先物に係る未実現利益(注1)	1,445,561.63	228,659
先渡為替契約に係る未実現利益(注1)	359,145.56	56,810
資産合計	271,492,792.89	42,944,730
負 債		
スワップに係る未実現損失(注1)	(41,295.08)	(6,532)
買戻未払金	(918,852.71)	(145,344)
定率報酬引当金(注2)	(291,630.02)	(46,130)
年次税引当金(注3)	(15,651.22)	(2,476)
引当金合計	(307,281.24)	(48,606)
負債合計	(1,267,429.03)	(200,482)
期末現在純資産	270,225,363.86	42,744,248

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム（米ドル）

純資産計算書

	2024年11月30日現在	
	（米ドル）	（千円）
資 産		
投資有価証券、取得価額	713,240,531.46	112,820,387
投資有価証券、未実現評価（損）益	180,659,898.73	28,576,783
投資有価証券合計（注１）	893,900,430.19	141,397,170
現金預金、要求払預金および預託金勘定	14,219,140.08 *	2,249,184
その他の流動資産（マージン）	8,005,488.98	1,266,308
有価証券売却未収金（注１）	6,958,675.47	1,100,723
発行未収金	571,982.21	90,476
配当金に係る未収金	245,340.84	38,808
その他の未収金	419,217.97	66,312
金融先物に係る未実現利益（注１）	3,910,708.09	618,596
先渡為替契約に係る未実現利益（注１）	130,282.30	20,608
資産合計	928,361,266.13	146,848,185
負 債		
スワップに係る未実現損失（注１）	(204,712.98)	(32,381)
当座借越	(752.95)	(119)
買戻未払金	(7,525,934.29)	(1,190,452)
定率報酬引当金（注２）	(952,556.69)	(150,675)
年次税引当金（注３）	(41,726.88)	(6,600)
その他の手数料および報酬引当金（注２）	(59,772.60)	(9,455)
引当金合計	(1,054,056.17)	(166,731)
負債合計	(8,785,456.39)	(1,389,683)
期末現在純資産	919,575,809.74	145,458,502

* 2024年11月30日現在、20,000.00米ドルの現金額が取引相手方であるユービーエス・エイ・ジーの担保として使用される。

注記は当財務書類と不可分のものである。

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

運用計算書

	自2024年 6 月 1 日 至2024年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	109,511.93	17,323
有価証券に係る利息	298,469.68	47,212
配当金	1,947,545.73	308,063
貸付証券に係る純収益(注12)	11,686.49	1,849
その他の収益(注4)	35,530.53	5,620
報酬の払戻し	15,332.72	2,425
収益合計	2,418,077.08	382,491
費 用		
定率報酬(注2)	(2,518,973.85)	(398,451)
年次税(注3)	(61,626.24)	(9,748)
その他の手数料および報酬(注2)	(58,412.26)	(9,240)
現金および当座借越に係る利息	(3,896.79)	(616)
費用合計	(2,642,909.14)	(418,055)
投資純(損)益	(224,832.06)	(35,564)
実現(損)益(注1)		
無オプション市場価格証券に係る実現(損)益	30,785,816.25	4,869,700
オプションに係る実現(損)益	1,215,710.83	192,301
利回り評価有価証券および短期金融商品に係る実現(損)益	654,788.75	103,574
先渡為替契約に係る実現(損)益	410,366.64	64,912
スワップに係る実現(損)益	(661,531.30)	(104,641)
為替差(損)益	(982,225.48)	(155,368)
実現(損)益合計	31,422,925.69	4,970,478
当期実現純(損)益	31,198,093.63	4,934,914
未実現評価(損)益の変動(注1)		
無オプション市場価格証券に係る未実現評価(損)益	(5,326,007.63)	(842,468)
オプションに係る未実現評価(損)益	(86,789.72)	(13,728)
利回り評価有価証券および短期金融商品に係る未実現評価(損)益	(21,690.83)	(3,431)
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	1,644,820.53	260,178
スワップに係る未実現評価(損)益	706,121.70	111,694
未実現評価(損)益の変動合計	(3,083,545.95)	(487,755)
運用の結果による純資産の純増(減)	28,114,547.68	4,447,159

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ - インカム・サステナブル(米ドル)

運用計算書

	自2024年 6 月 1 日 至2024年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	14,432.59	2,283
配当金	21,879.33	3,461
貸付証券に係る純収益(注12)	151.83	24
その他の収益(注4)	3,913.34	619
収益合計	40,377.09	6,387
費 用		
定率報酬(注2)	(439,567.60)	(69,531)
年次税(注3)	(6,198.42)	(980)
その他の手数料および報酬(注2)	(10,790.24)	(1,707)
現金および当座借越に係る利息	(1,515.44)	(240)
費用合計	(458,071.70)	(72,458)
投資純(損)益	(417,694.61)	(66,071)
実現(損)益(注1)		
無オプション市場価格証券に係る実現(損)益	135,773.19	21,477
オプションに係る実現(損)益	11,591.21	1,833
金融先物に係る実現損失	16,711.37	2,643
先渡為替契約に係る実現(損)益	182,019.51	28,792
為替差(損)益	(278,095.12)	(43,989)
実現(損)益合計	68,000.16	10,756
当期実現純(損)益	(349,694.45)	(55,315)
未実現評価(損)益の変動(注1)		
無オプション市場価格証券に係る未実現評価(損)益	3,059,883.44	484,012
オプションに係る実現(損)益	5,797.00	917
金融先物に係る未実現評価(損)益	15,656.28	2,477
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	429,869.71	67,997
未実現評価(損)益の変動合計	3,511,206.43	555,403
運用の結果による純資産の純増(減)	3,161,511.98	500,088

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

運用計算書

	自2024年6月1日 至2024年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	151,970.75	24,039
配当金	204,695.53	32,379
貸付証券に係る純収益(注12)	3,542.79	560
その他の収益(注4)	40,202.39	6,359
収益合計	400,411.46	63,337
費 用		
定率報酬(注2)	(2,275,557.42)	(359,948)
年次税(注3)	(34,607.34)	(5,474)
その他の手数料および報酬(注2)	(50,683.84)	(8,017)
現金および当座借越に係る利息	(801.88)	(127)
費用合計	(2,361,650.48)	(373,566)
投資純(損)益	(1,961,239.02)	(310,229)
実現(損)益(注1)		
無オプション市場価格証券に係る実現(損)益	9,559,683.31	1,512,151
利回り評価有価証券および短期金融商品に係る実現(損)益	318,610.42	50,398
金融先物に係る実現(損)益	(421,551.18)	(66,681)
先渡為替契約に係る実現(損)益	(798,866.51)	(126,365)
スワップに係る実現(損)益	(593,790.27)	(93,926)
為替差(損)益	(337,472.79)	(53,381)
実現(損)益合計	7,726,612.98	1,222,196
当期実現純(損)益	5,765,373.96	911,967
未実現評価(損)益の変動(注1)		
無オプション市場価格証券に係る未実現評価(損)益	10,910,204.50	1,725,776
利回り評価有価証券および短期金融商品に係る未実現評価(損)益	(7,814.71)	(1,236)
金融先物に係る未実現評価(損)益	586,306.50	92,742
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	(1,039,454.95)	(164,421)
スワップに係る未実現評価(損)益	(44,050.34)	(6,968)
未実現評価(損)益の変動合計	10,405,191.00	1,645,893
運用の結果による純資産の純増(減)	16,170,564.96	2,557,860

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

運用計算書

	自2024年6月1日 至2024年11月30日	
	（米ドル）	（千円）
収 益		
流動資産に係る利息	138,641.14	21,930
配当金	430,415.06	68,083
貸付証券に係る純収益（注12）	8,718.88	1,379
その他の収益（注4）	16,579.82	2,623
収益合計	594,354.90	94,015
費 用		
定率報酬（注2）	(1,852,774.96)	(293,072)
年次税（注3）	(48,215.36)	(7,627)
その他の手数料および報酬（注2）	(40,748.75)	(6,446)
現金および当座借越に係る利息	(498.08)	(79)
費用合計	(1,942,237.15)	(307,223)
投資純（損）益	(1,347,882.25)	(213,208)
実現（損）益（注1）		
無オプション市場価格証券に係る実現（損）益	8,851,423.92	1,400,118
利回り評価有価証券および短期金融商品に係る実現（損）益	320,800.98	50,744
金融先物に係る実現（損）益	(164,848.40)	(26,076)
先渡為替契約に係る実現（損）益	(188,238.61)	(29,776)
スワップに係る実現（損）益	(372,449.47)	(58,914)
為替差（損）益	(552,958.18)	(87,467)
実現（損）益合計	7,893,730.24	1,248,630
当期実現純（損）益	6,545,847.99	1,035,422
未実現評価（損）益の変動（注1）		
無オプション市場価格証券に係る未実現評価（損）益	11,634,680.33	1,840,374
利回り評価有価証券および短期金融商品に係る未実現評価（損）益	(14,159.21)	(2,240)
金融先物に係る未実現評価（損）益	485,696.45	76,827
先渡為替契約に係る未実現評価（損）益	164,287.05	25,987
スワップに係る未実現評価（損）益	(29,340.48)	(4,641)
未実現評価（損）益の変動合計	12,241,164.14	1,936,307
運用の結果による純資産の純増（減）	18,787,012.13	2,971,730

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

運用計算書

	自2024年6月1日 至2024年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	446,937.90	70,697
配当金	1,004,580.96	158,905
貸付証券に係る純収益(注12)	17,377.99	2,749
その他の収益(注4)	45,658.22	7,222
収益合計	1,514,555.07	239,572
費 用		
定率報酬(注2)	(6,130,867.13)	(969,781)
年次税(注3)	(130,694.97)	(20,673)
その他の手数料および報酬(注2)	(122,550.89)	(19,385)
現金および当座借越に係る利息	(3,835.19)	(607)
費用合計	(6,387,948.18)	(1,010,446)
投資純(損)益	(4,873,393.11)	(770,873)
実現(損)益(注1)		
無オプション市場価格証券に係る実現(損)益	31,895,532.01	5,045,235
利回り評価有価証券および短期金融商品に係る実現(損)益	1,119,303.71	177,051
金融先物に係る実現(損)益	(823,359.56)	(130,239)
先渡為替契約に係る実現(損)益	(1,381,016.64)	(218,449)
スワップに係る実現(損)益	(1,837,644.41)	(290,679)
為替差(損)益	(1,257,182.69)	(198,861)
実現(損)益合計	27,715,632.42	4,384,059
当期実現純(損)益	22,842,239.31	3,613,185
未実現評価(損)益の変動(注1)		
無オプション市場価格証券に係る未実現評価(損)益	29,208,917.39	4,620,267
利回り評価有価証券および短期金融商品に係る未実現評価(損)益	(56,701.70)	(8,969)
金融先物に係る未実現評価(損)益	1,122,597.71	177,573
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	(1,369,269.35)	(216,591)
スワップに係る未実現評価(損)益	(146,239.65)	(23,132)
未実現評価(損)益の変動合計	28,759,304.40	4,549,147
運用の結果による純資産の純増(減)	51,601,543.71	8,162,332

注記は当財務書類と不可分のものである。

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

純資産変動計算書

	自2024年 6 月 1 日 至2024年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	457,800,364.57	72,414,862
発行額	13,944,265.78	2,205,704
買戻額	(40,597,161.69)	(6,421,659)
純発行 (買戻) 合計	(26,652,895.91)	(4,215,955)
支払配当金	(10,328,020.02)	(1,633,686)
投資純 (損) 益	(224,832.06)	(35,564)
実現 (損) 益合計	31,422,925.69	4,970,478
未実現評価 (損) 益の変動合計	(3,083,545.95)	(487,755)
運用の結果による純資産の純増 (減)	28,114,547.68	4,447,159
期末現在純資産	448,933,996.32	71,012,380

発行済投資証券数の変動表

	自2024年 6 月 1 日 至2024年11月30日
クラス P - a c c	(口)
期首現在発行済投資証券数	359,440.7520
期中発行投資証券数	26,656.4530
期中買戻投資証券数	(20,440.5710)
期末現在発行済投資証券数	365,656.6340
クラス P - m d i s t	(口)
期首現在発行済投資証券数	2,316,269.7790
期中発行投資証券数	79,340.8850
期中買戻投資証券数	(127,449.5300)
期末現在発行済投資証券数	2,268,161.1340

月次分配金¹

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ - ダイナミック・インカム (米ドル)	分配落ち日	支払日	通貨	1 口当たり金額
P - m d i s t	2024年 6 月17日	2024年 6 月20日	米ドル	0.41
P - m d i s t	2024年 7 月15日	2024年 7 月18日	米ドル	0.41
P - m d i s t	2024年 8 月16日	2024年 8 月21日	米ドル	0.4285
P - m d i s t	2024年 9 月19日	2024年 9 月24日	米ドル	0.4285
P - m d i s t	2024年10月15日	2024年10月18日	米ドル	0.4285
P - m d i s t	2024年11月15日	2024年11月20日	米ドル	0.4285

¹ 注記 5 を参照

注記は当財務書類と不可分のものである。

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

最重要数値

	ISIN	2024年11月30日	2024年 5 月31日	2023年 5 月31日
純資産額 (米ドル)		448 933 996.32	457 800 364.57	467 641 801.58
クラス P - a c c	LU1917362490			
発行済投資証券数 (口)		365 656.6340	359 440.7520	393 581.1040
1 口当たり純資産価格 (米ドル)		129.17	121.52	109.16
1 口当たり発行・買戻価格 (米ドル) ²		129.17	121.52	109.16
クラス P - m d i s t	LU1917361179			
発行済投資証券数 (口)		2 268 161.1340	2 316 269.7790	2 509 889.5820
1 口当たり純資産価格 (米ドル)		93.27	90.18	85.71
1 口当たり発行・買戻価格 (米ドル) ²		93.27	90.18	85.71

² 注記 1 を参照

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

組入証券の構造

地域別分布表	(純資産に対する 百分率 %)	業種別分布表	(純資産に対する 百分率 %)
ルクセンブルグ	46.94	投資信託	55.03
アメリカ合衆国	29.93	国債・中央政府債	8.05
アイルランド	6.40	インターネット・ソフトウェア・ITサービス	3.70
日本	3.22	医薬品・化粧品・医療品	3.02
イギリス	2.32	金融・持株会社	2.78
シンガポール	2.23	電子機器・半導体	2.60
オーストラリア	1.94	銀行・金融機関	2.39
フランス	1.36	コンピュータハードウェア・ネットワーク装置供給業	1.90
ドイツ	1.12	小売り・百貨店	1.85
スイス	0.83	石油	1.84
オランダ	0.55	食品・清涼飲料	1.32
スペイン	0.33	エネルギー・水道	1.28
イタリア	0.23	保険	1.09
カナダ	0.21	自動車	1.02
フィンランド	0.12	通信	0.79
スウェーデン	0.10	機械工学・産業機器	0.79
香港	0.08	その他の消費財	0.74
ベルギー	0.07	たばこ・アルコール	0.72
デンマーク	0.03	交通・運輸	0.65
ウルグアイ	0.03	その他のサービス業	0.61
イスラエル	0.03	不動産	0.57
オーストリア	0.02	航空宇宙産業	0.56
ニュージーランド	0.02	建築業・資材	0.53
バミューダ	0.02	電子部品・デバイス	0.53
ポルトガル	0.02	宿泊・仕出し・レジャー	0.52
ノルウェー	0.02	バイオテクノロジー	0.51
合計	98.17	グラフィックデザイン・出版・メディア	0.51
		化学	0.38
		鉱業・石炭・鉄鋼	0.36
		ヘルスケア・社会福祉	0.29
		各種貿易会社	0.26
		非鉄金属	0.24
		繊維・衣服・革製品	0.18
		貴金属・宝石	0.13
		林業・紙・パルプ製品	0.10
		環境サービス・リサイクル	0.07
		包装業	0.07
		ゴム・タイヤ	0.06
		時計・宝飾品	0.05
		農業・漁業	0.03
		その他の非分類会社	0.03
		写真・光学	0.01
		モーゲージ・資金調達機関	0.01
		合計	98.17

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ - インカム・サステナブル (米ドル)

純資産変動計算書

	自2024年6月1日 至2024年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	73,400,443.11	11,610,482
発行額	893,757.98	141,375
買戻額	(4,875,805.54)	(771,255)
純発行(買戻)合計	(3,982,047.56)	(629,880)
支払配当金	(94,818.12)	(14,998)
投資純(損)益	(417,694.61)	(66,071)
実現(損)益合計	68,000.16	10,756
未実現評価(損)益の変動合計	3,511,206.43	555,403
運用の結果による純資産の純増(減)	3,161,511.98	500,088
期末現在純資産	72,485,089.41	11,465,691

発行済投資証券数の変動表

クラスP - a c c	自2024年6月1日 至2024年11月30日
	(口)
期首現在発行済投資証券数	460,623.7230
期中発行投資証券数	2,402.4420
期中買戻投資証券数	(13,209.2440)
期末現在発行済投資証券数	449,816.9210

注記は当財務書類と不可分のものである。

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

最重要数値

	ISIN	2024年11月30日	2024年 5 月31日	2023年 5 月31日
純資産額 (米ドル)		72 485 089.41	73 400 443.11	92 024 987.25
クラス P - a c c	LU0994951548			
発行済投資証券数 (口)		449 816.9210	460 623.7230	492 951.8190
1 口当たり純資産価格 (米ドル)		126.48	121.10	114.88
1 口当たり発行・買戻価格 (米ドル) ¹		126.48	121.10	114.88

¹ 注記 1 を参照

組入証券の構造

地域別分布表	(純資産に対する 百分率 %)	業種別分布表	(純資産に対する 百分率 %)
ルクセンブルグ	83.92	投資信託	98.53
アイルランド	14.61	合計	98.53
合計	98.53		

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

純資産変動計算書

	自2024年6月1日 至2024年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	405,059,242.07	64,072,271
発行額	1,953,875.45	309,064
買戻額	(48,640,256.17)	(7,693,916)
純発行(買戻)合計	(46,686,380.72)	(7,384,852)
支払配当金	(773,542.33)	(122,359)
投資純(損)益	(1,961,239.02)	(310,229)
実現(損)益合計	7,726,612.98	1,222,196
未実現評価(損)益の変動合計	10,405,191.00	1,645,893
運用の結果による純資産の純増(減)	16,170,564.96	2,557,860
期末現在純資産	373,769,883.98	59,122,920

発行済投資証券数の変動表

クラスP - a c c	自2024年6月1日 至2024年11月30日	
	(口)	
期首現在発行済投資証券数	917,515.8660	
期中発行投資証券数	4,783.3080	
期中買戻投資証券数	(113,211.6450)	
期末現在発行済投資証券数	809,087.5290	

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ
- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ（米ドル）

最重要数値

	ISIN	2024年11月30日	2024年 5 月31日	2023年 5 月31日
純資産額（米ドル）		373 769 883.98	405 059 242.07	516 321 326.56
クラス P - a c c	LU1599185649			
発行済投資証券数（口）		809 087.5290	917 515.8660	1 335 171.0590
1 口当たり純資産価格（米ドル）		118.34	113.00	103.61
1 口当たり発行・買戻価格（米ドル） ¹		118.34	112.84	103.61

¹ 注記 1 を参照

組入証券の構造

（純資産に対する		（純資産に対する	
地域別分布表	百分率 %）	地域別分布表	百分率 %）
ルクセンブルグ	64.18	デンマーク	0.14
アイルランド	25.42	スペイン	0.11
アメリカ合衆国	2.93	イタリア	0.09
イギリス	1.03	香港	0.08
日本	0.99	シンガポール	0.07
カナダ	0.58	フィンランド	0.04
フランス	0.46	イスラエル	0.03
スイス	0.44	ベルギー	0.03
ドイツ	0.39	ノルウェー	0.03
オーストラリア	0.33	ニュージーランド	0.01
オランダ	0.22	オーストリア	0.01
スウェーデン	0.15	ボルトガル	0.01
		合計	97.77

業種別分布表	(純資産に対する 百分率 　%)	業種別分布表	(純資産に対する 百分率 　%)
投資信託	82.08	鉱業・石炭・鉄鋼	0.09
金融・持株会社	7.94	たばこ・アルコール	0.09
国債・中央政府債	2.93	グラフィックデザイン・出版・メディア	0.09
銀行・金融機関	1.03	不動産	0.08
医薬品・化粧品・医療品	0.47	各種貿易会社	0.06
電子機器・半導体	0.31	非鉄金属	0.04
インターネット・ソフトウェア・ＩＴサービス	0.25	バイオテクノロジー	0.04
保険	0.23	繊維・衣服・革製品	0.04
石油	0.21	貴金属・宝石	0.04
エネルギー・水道	0.19	宿泊・仕出し・レジャー	0.04
自動車	0.16	その他の消費財	0.02
食品・清涼飲料	0.15	時計・宝飾品	0.02
電子部品・デバイス	0.14	コンピュータハードウェア・ネットワーク装置供給業	0.02
機械工学・産業機器	0.14	ヘルスケア・社会福祉	0.02
化学	0.14	林業・紙・パルプ製品	0.02
通信	0.13	ゴム・タイヤ	0.01
交通・運輸	0.12	包装業	0.01
建築業・資材	0.10	その他の非分類会社	0.01
その他のサービス業	0.10	写真・光学	0.01
小売り・百貨店	0.10	合計	97.77
航空宇宙産業	0.10		

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

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

純資産変動計算書

	自2024年6月1日 至2024年11月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	270,857,808.66	42,844,288
発行額	4,930,057.24	779,836
買戻額	(24,086,045.00)	(3,809,931)
純発行 (買戻) 合計	(19,155,987.76)	(3,030,094)
支払配当金	(263,469.17)	(41,676)
投資純 (損) 益	(1,347,882.25)	(213,208)
実現 (損) 益合計	7,893,730.24	1,248,630
未実現評価 (損) 益の変動合計	12,241,164.14	1,936,307
運用の結果による純資産の純増 (減)	18,787,012.13	2,971,730
期末現在純資産	270,225,363.86	42,744,248

発行済投資証券数の変動表

クラスP - a c c	自2024年6月1日 至2024年11月30日	
	(口)	
期首現在発行済投資証券数	681,202.9790	
期中発行投資証券数	2,289.9370	
期中買戻投資証券数	(44,536.7530)	
期末現在発行済投資証券数	638,956.1630	

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (Lux) ストラテジー・シキャブ
- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック (米ドル)

最重要数値

	ISIN	2024年11月30日	2024年 5 月31日	2023年 5 月31日
純資産額 (米ドル)		270 225 363.86	270 857 808.66	293 356 127.44
クラス P - a c c	LU1599187934			
発行済投資証券数 (口)		638 956.1630	681 202.9790	830 170.8430
1 口当たり純資産価格 (米ドル)		139.32	129.67	111.21
1 口当たり発行・買戻価格 (米ドル) ¹		139.32	129.67	111.21

¹ 注記 1 を参照

組入証券の構造

(純資産に対する		(純資産に対する	
地域別分布表	百分率 %)	地域別分布表	百分率 %)
アイルランド	45.93	スペイン	0.33
ルクセンブルグ	29.01	イタリア	0.27
アメリカ合衆国	6.82	香港	0.24
日本	2.87	シンガポール	0.21
イギリス	2.49	フィンランド	0.12
カナダ	1.69	イスラエル	0.12
フランス	1.33	ベルギー	0.10
スイス	1.29	ノルウェー	0.08
ドイツ	1.14	ニュージーランド	0.04
オーストラリア	0.96	オーストリア	0.02
オランダ	0.65	ボルトガル	0.02
スウェーデン	0.45	バミューダ	0.01
デンマーク	0.42	合計	96.61

業種別分布表	(純資産に対する	業種別分布表	(純資産に対する
	百分率 　%)		百分率 　%)
投資信託	71.14	たばこ・アルコール	0.26
国債・中央政府債	6.82	グラフィックデザイン・出版・メディア	0.26
金融・持株会社	5.05	不動産	0.24
銀行・金融機関	2.48	各種貿易会社	0.17
医薬品・化粧品・医療品	1.39	非鉄金属	0.13
電子機器・半導体	0.91	繊維・衣服・革製品	0.12
インターネット・ソフトウェア・ＩＴサービス	0.74	バイオテクノロジー	0.12
保険	0.68	貴金属・宝石	0.11
石油	0.61	宿泊・仕出し・レジャー	0.11
エネルギー・水道	0.55	その他の消費財	0.07
自動車	0.47	時計・宝飾品	0.06
食品・清涼飲料	0.43	コンピュータハードウェア・ネットワーク装置供給業	0.06
電子部品・デバイス	0.42	ヘルスケア・社会福祉	0.05
化学	0.41	林業・紙・パルプ製品	0.05
機械工学・産業機器	0.38	ゴム・タイヤ	0.04
通信	0.38	包装業	0.02
交通・運輸	0.35	その他の非分類会社	0.02
建築業・資材	0.31	写真・光学	0.01
その他のサービス業	0.31	農業・漁業	0.01
航空宇宙産業	0.30	環境サービス・リサイクル	0.01
小売り・百貨店	0.29	合計	96.61
鉱業・石炭・鉄鋼	0.27		

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

純資産変動計算書

自2024年6月1日 至2024年11月30日

	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	957,497,503.57	151,456,955
発行額	21,053,384.26	3,330,224
買戻額	(108,817,393.19)	(17,212,735)
純発行(買戻)合計	(87,764,008.93)	(13,882,511)
支払配当金	(1,759,228.61)	(278,275)
投資純(損)益	(4,873,393.11)	(770,873)
実現(損)益合計	27,715,632.42	4,384,059
未実現評価(損)益の変動合計	28,759,304.40	4,549,147
運用の結果による純資産の純増(減)	51,601,543.71	8,162,332
期末現在純資産	919,575,809.74	145,458,502

発行済投資証券数の変動表

自2024年6月1日 至2024年11月30日

クラスP - a c c	(口)
期首現在発行済投資証券数	2,004,160.4580
期中発行投資証券数	72,108.0150
期中買戻投資証券数	(181,939.8030)
期末現在発行済投資証券数	1,894,328.6700

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (Lux) ストラテジー・シキャブ
- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム (米ドル)

最重要数値

	ISIN	2024年11月30日	2024年 5 月31日	2023年 5 月31日
純資産額 (米ドル)		919 575 809.74	957 497 503.57	1 035 849 484.36
クラス P - a c c	LU1599186969			
発行済投資証券数 (口)		1 894 328.6700	2 004 160.4580	2 526 594.0710
1 口当たり純資産価格 (米ドル)		129.89	122.45	107.68
1 口当たり発行・買戻価格 (米ドル) ¹		129.89	122.45	107.68

¹ 注記 1 を参照

組入証券の構造

(純資産に対する 百分率 %)		(純資産に対する 百分率 %)	
地域別分布表		地域別分布表	
ルクセンブルグ	44.35	スペイン	0.22
アイルランド	36.31	イタリア	0.18
アメリカ合衆国	6.46	香港	0.16
日本	1.92	シンガポール	0.14
イギリス	1.83	フィンランド	0.08
カナダ	1.14	イスラエル	0.08
フランス	0.89	ベルギー	0.07
スイス	0.86	ノルウェー	0.05
ドイツ	0.76	ニュージーランド	0.03
オーストラリア	0.64	オーストリア	0.02
オランダ	0.43	ポルトガル	0.01
スウェーデン	0.30	合計	97.21
デンマーク	0.28		

業種別分布表	(純資産に対する 百分率　％)	業種別分布表	(純資産に対する 百分率　％)
投資信託	74.37	たばこ・アルコール	0.18
金融・持株会社	7.14	グラフィックデザイン・出版・メディア	0.17
国債・中央政府債	6.45	不動産	0.16
銀行・金融機関	1.82	各種貿易会社	0.12
医薬品・化粧品・医療品	0.93	非鉄金属	0.09
電子機器・半導体	0.61	バイオテクノロジー	0.08
インターネット・ソフトウェア・ＩＴサービス	0.49	繊維・衣服・革製品	0.08
保険	0.46	貴金属・宝石	0.07
石油	0.41	宿泊・仕出し・レジャー	0.07
エネルギー・水道	0.37	その他の消費財	0.05
自動車	0.31	時計・宝飾品	0.04
食品・清涼飲料	0.28	コンピュータハードウェア・ネットワーク装置供給業	0.04
電子部品・デバイス	0.28	ヘルスケア・社会福祉	0.03
化学	0.27	林業・紙・パルプ製品	0.03
機械工学・産業機器	0.26	ゴム・タイヤ	0.03
通信	0.26	包装業	0.01
交通・運輸	0.23	その他の非分類会社	0.01
その他のサービス業	0.20	写真・光学	0.01
建築業・資材	0.20	農業・漁業	0.01
小売り・百貨店	0.20	環境サービス・リサイクル	0.01
航空宇宙産業	0.20	合計	97.21
鉱業・石炭・鉄鋼	0.18		

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

財務書類に対する注記

2024年11月30日現在

注1 - 重要な会計方針の要約

財務書類は、ルクセンブルグにおける投資信託に関する一般に公正妥当と認められる会計原則に従って、継続企業を前提として作成されている。

重要な会計方針は、以下のように要約される。

a) 純資産額の計算

各サブ・ファンドまたは投資証券クラスの投資証券1口当たりの純資産価格、発行価格、買戻価格および転換価格は、当該サブ・ファンドまたは投資証券クラスの計算通貨で表示され、各投資証券クラスに帰属するサブ・ファンドの純資産総額を当該サブ・ファンドの投資証券クラスの投資証券数で除することにより営業日毎に計算される。

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

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

b) 評価原則

- 流動資産は、（現金、銀行預金、為替手形および要求払約束手形および売掛金、前払費用、配当金ならびに宣言済または発生済で未受領の利息という形態にかかわらず）いずれも総額として評価されるが、かかる価額が全額支払われるか受領される可能性が低い場合はこの限りではなく、かかる場合、その評価額は、その真正価値を表すために適切とみなされる減額分を考慮して決定される。
- 証券取引所に上場されている有価証券、派生商品およびその他の投資対象は最新の市場価格で評価される。当該有価証券、派生商品またはその他の投資対象が複数の証券取引所に上場されている場合は、当該投資対象の主要市場である証券取引所の最新価格を適用する。

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

- その他の譲渡性証券集合投資事業(UCITS)および/または集合投資事業(UCI)の受益証券は最新の純資産価額で評価する。その他のUCITSおよび/またはUCIの一部の受益証券または投資証券は、投資運用会社または投資顧問会社から独立した信頼できるサービス提供会社により提供されたかかる証券の価値の見積り(価値見積り)に基づいて評価することができる。
- 証券取引所または公開されている他の規制された市場で取引されていない短期金融商品は、関連するカーブに基づいて評価される。カーブに基づく評価は、金利および信用スプレッドの要素を参照する。このプロセスには次の原則が適用される。各短期金融商品には、残余期間に応じた金利が加えられる。このように計算された金利は、裏付けとなる借主の信用力を反映する信用スプレッドを加えることによって市場価格に転換される。この信用スプレッドは、借主の信用格付けに重大な変更がある場合、調整される。

該当する注文日と該当する評価日の間にサブ・ファンドが得た受取利息は、該当するサブ・ファンドの資産の評価に含まれる。したがって、評価日における投資証券1口当たりの資産価額は、予定される受取利息を含む。
- 関係するサブ・ファンドの参照通貨以外の通貨で表示され、外国為替取引によるヘッジを行わない有価証券、短期金融商品、派生商品およびその他の資産は、当該通貨のルクセンブルグにおける取引の公示された仲値(買呼値と売呼値の仲値)またはこれが提供されない場合には当該通貨を最も代表する市場における公示された仲値で評価する。
- 定期預金および信託投資はその名目価値に累積利息を加えて評価する。
- スワップの価値は、外部のサービス提供会社が計算し、別の外部サービス提供会社が第二の独立した評価を提供する。計算はすべての現金流入額と正味現在価値を基準とする。特別な場合に、内部計算(ブルームバーグから提供されたモデルと市場データに基づく。)および/またはブローカーの報告書の評価を利用することができる。評価方法は、それぞれの証券に依拠し、UBSの評価方針に基づき決定される。

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

特別な状況の場合、当日のうちに追加の評価を行うことができる。その後、かかる新評価が投資証券の事後の発行および買戻しについて正式なものとなる。

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

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

主(買戻しの場合)が損害を被る可能性がある場合、希薄化調整を行うことができる。希薄化調整は、以下の場合に行われることがある。

(a) サブ・ファンドが一定の下落(すなわち買戻しによる純流出)を記録した場合。

(b) サブ・ファンドがその規模に比べて大量の正味申込みを記録した場合。

(c) サブ・ファンドが特定の評価日において正味申込ポジションまたは正味買戻ポジションを示した場合。または、

(d) 投資主の利益のために希薄化の調整が必要であると取締役会が確信するその他のあらゆる場合。

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

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

スイング・プライシングの技法は、すべてのサブ・ファンドに適用される。

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

c) 先渡為替契約の評価

未決済の先渡為替契約の未実現(損)益は、評価日の実勢先渡為替レートに基づいて評価される。

d) 金融先物契約の評価

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

e) オプションの評価

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

オプションは投資有価証券に含まれる。

f) 証券の売却に係る実現純(損)益

証券の売却に係る実現損益は、売却証券の平均原価に基づいて計算される。

g) 外貨換算

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

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

h) 組入証券取引の会計処理

組入証券取引は、取引日の翌銀行営業日に会計処理される。

i) モーゲージ担保証券

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。

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

j) 連結財務書類

連結財務書類は、ユーロで表示される。本投資法人の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の各種科目は、各サブ・ファンドの財務書類の対応する科目を決算日現在の実勢為替レートでユーロに換算した金額の合計に等しい。

以下の為替レートが、2024年11月30日現在の連結財務書類の換算に用いられた。

為替レート

1 ユーロ	=	0.930512	スイス・フラン
1 ユーロ	=	1.056200	米ドル

清算または合併されたサブ・ファンドについて、連結財務書類の換算に用いられた為替レートは、清算日または合併日現在のものである。

k) 有価証券売却未収金、有価証券購入未払金

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

外国為替取引による未収金および未払金は相殺される。

l) 収益の認識

源泉税控除後の配当金は、当該証券が「配当落ち」として最初に記載される日に収益として認識される。受取利息は、日々ベースで発生する。

m) スワップ

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

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

特別な場合に、内部計算（ブルームバーグから提供されたモデルと市場データに基づく。）および/またはブローカーの報告書の評価を利用することができる。

評価方法は、それぞれの証券に依拠し、UBSの評価方針に基づき決定される。

かかる評価方法は、本投資法人によって認められている。

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

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

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

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

上限定率報酬 (年率) 上限定率報酬 (年率)

名称に「ヘッジ」が付く

投資証券クラス

名称に「P」が付く投資証券クラス	1.340%	1.390%
------------------	--------	--------

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ - インカム・サステナブル (米ドル)

上限定率報酬 (年率) 上限定率報酬 (年率)

名称に「ヘッジ」が付く

投資証券クラス

名称に「P」が付く投資証券クラス	1.300%	1.350%
------------------	--------	--------

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

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

上限定率報酬(年率) 上限定率報酬(年率)

名称に「ヘッジ」が付く

投資証券クラス

名称に「P」が付く投資証券クラス	1.320%	1.370%
------------------	--------	--------

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

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

上限定率報酬(年率) 上限定率報酬(年率)

名称に「ヘッジ」が付く

投資証券クラス

名称に「P」が付く投資証券クラス	1.680%	1.730%
------------------	--------	--------

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

上限定率報酬(年率) 上限定率報酬(年率)

名称に「ヘッジ」が付く

投資証券クラス

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

本投資法人は、投資証券クラス「P」「K-1」「F」「Q」「QL」「I-A1」「I-A2」「I-A3」および「I-A4」について、サブ・ファンドの平均純資産価額で計算される月次上限定率報酬を支払う。これは以下のとおり用いられる。

- 以下の規定に従い、本投資法人の純資産価額に基づく上限定率管理報酬は、本投資法人の運用、管理事務、ポートフォリオの管理、投資助言および販売(該当する場合)、ならびに保管受託銀行のすべての職務(本投資法人の資産の保管および監督、支払取引の手続きならびに販売目論見書の「保管受託銀行および主たる支払代理人」の項に記載されているその他一切の職務等)に関して、本投資法人の資産から支払われる。当該報酬は、純資産の計算毎に比例按分ベースで本投資法人の資産に対し請求され、毎月支払われる(上限定率管理報酬)。関連する上限定率管理報酬は対応する投資証券クラスが発行されるまで請求されない。上限定率管理報酬の概要は、販売目論見書の「サブ・ファンドおよび特別投資方針」の項にて参照することができる。定率管理報酬に適用される実際の最大料率は、年次報告書および半期報告書で参照することができる。

この報酬は「定率報酬」として運用計算書に表示される。

- 上限定率管理報酬は、以下の報酬および本投資法人の資産にも請求される追加費用を含まない。

- 資産の売買のための本投資法人の資産の管理に関する一切の追加の費用(市場、手数料、報酬等に合致する買呼値/売呼値スプレッド、仲介手数料)。かかる費用は、通常、各資産の売買時点で計算される。本書の記載にかかわらず、投資証券の発行および買戻しの決済に関する資産の売買によって生じるかかる追加の費用は、販売目論見書の「純資産価額、発行、買戻しおよび転換価格」の項に基づくスイング・プライシングの原理の適用により賄われる。

- b) 本投資法人の設立、変更、清算および合併に関する監督官庁への費用ならびに監督官庁およびサブ・ファンドが上場されている証券取引所に支払う一切の手数料。
- c) 本投資法人の設立、変更、清算および合併に関する年次監査および認可に関する監査報酬ならびにファンドの事務管理に関して監査人が提供するサービスに関して監査法人に支払われ、かつ法律によって許可される一切のその他の報酬。
- d) 本投資法人の設立、販売国における登録、変更、清算および合併に関する法律顧問、税務顧問および公証人に対する報酬ならびに法律で明白に禁止されない限り、本投資法人およびその投資者の利益の全般的な保護に関する手数料。
- e) 本投資法人の純資産価額の公表に関するコストおよび投資者に対する通知に関する一切のコスト(翻訳コストを含む)。
- f) 本投資法人の法的文書に関するコスト(目論見書、K I D、年次報告書および半期報告書ならびに居住国および販売が行われる国で法的に要求されるその他の一切の文書)。
- g) 外国の監督官庁への本投資法人の登録に関するコスト(該当する場合、外国の監督官庁に支払われる手数料ならびに翻訳コストおよび外国の代表者または支払代理人に対する報酬を含む)。
- h) 本投資法人による議決権または債権者の権利により生じた費用(外部顧問報酬を含む)。
- i) 本投資法人の名義で登録された知的財産または本投資法人の使用権に関するコストおよび手数料。
- j) 管理会社、投資運用会社または保管受託銀行が投資者の利益の保護のために講じた特別措置に関して生じた一切の費用。
- k) 管理会社が投資者の利益につき集団訴訟に関与する場合、管理会社は、第三者に関して生じる費用(例えば、法律コストおよび保管受託銀行に関するコスト)を本投資法人の資産に対して請求できる。さらに、管理会社は、すべての管理事務コストを請求することができる。ただし、当該コストは、証明可能かつ公表されており、および/または本投資法人の総費用比率(T E R)の開示において考慮される。
- l) パフォーマンス報酬(該当する場合)

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

これらの手数料および報酬は、「その他の手数料および報酬」として運用計算書に表示される。

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

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

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

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

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

資産運用目的で投資証券クラス「K - B」に対して実施された業務に関連するコストは、投資者との個別契約に基づきUBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジーまたはその承認された販売会社の一社が受け取る資格を有する報酬によって賄われる。

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

個々の投資証券クラスに割当てられる費用は、当該投資証券クラスに請求される。費用が複数またはすべてのサブ・ファンド/投資証券クラスに関連して発生した場合には、これらの費用について当該サブ・ファンド/投資証券がその純資産額に比例して負担する。

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

サブ・ファンドが、管理会社により、または共同経営もしくは支配を通じて、または実質的な直接保有もしくは間接保有を通じて、管理会社と関係する別の会社により直接もしくは委託によって運用されるファンドの受益証券への投資を行う場合、ターゲット・ファンドの受益証券に関して、投資を行うサブ・ファンドに発行または買戻手数料は請求されない。

本投資法人の現在発生中の費用（または発生中の手数料）の詳細は、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準拠している。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、純資産総額から年率0.05%の年次税(投資証券クラス「F」「I-A1」「I-A2」「I-A3」「I-A4」「I-B」「I-X」および「U-X」については年率0.01%の軽減された年次税)をルクセンブルグ大公国に各四半期末までに支払わなければならない。この税金は、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。年率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、投資証券クラス「F」「I-A1」「I-A2」「I-A3」「I-A4」「I-B」「I-X」および「U-X」の投資証券に年率0.05%が課されることがある。

サブ・ファンドは、2020年6月18日付EU規則2020/852第3条に定義された環境的に持続可能な経済活動に投資される純資産部分について、年率0.01%から0.04%の範囲で年次税の軽減税率の恩恵を受けることができる。

注4 - その他の収益

その他の収益は、主にスイング・プライシングから生じた収益で構成される。

注5 - 分配

当該サブ・ファンドの投資主総会は、取締役会の提案によりサブ・ファンドの年次決算の終了後に、各サブ・ファンドおよび/または投資証券クラスから分配を行うかおよび支払われる分配金の程度を決定する。

本投資法人の純資産額が法律に規定されている最低額を下回る場合には、分配の支払は行われない。分配が行われる場合、支払は年度末後4ヶ月以内に行われる。

取締役会は、中間分配金を支払い、また分配金支払を停止する権限を有している。

注6 - ソフト・コミッション契約

2024年6月1日から2024年11月30日までの期間中に、UBS (Lux) ストラテジー・シキャブのために締結された「ソフト・コミッション契約」はなく、「ソフト・コミッション契約」の金額は零である。

注7 - 金融先物、オプションおよびスワップ契約

2024年11月30日現在、サブ・ファンドごとの金融先物、オプションおよびスワップ契約ならびに関連する通貨は、以下のように要約される。

a) 金融先物

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ	債券に係る金融先物	
	(購入)	(売却)
- インカム・サステナブル(米ドル)	4 304 062.52 米ドル	381 562.50 米ドル
- システムティック・アロケーション		
・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)	20 792 093.75 米ドル	58 848 820.59 米ドル
- システムティック・アロケーション		
・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)	- 米ドル	53 907 093.91米ドル
- システムティック・アロケーション		
・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)	- 米ドル	138 562 352.05 米ドル

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ	指数に係る金融先物	
	(購入)	(売却)
- システムティック・アロケーション		
・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)	44 947 662.13 米ドル	- 米ドル
- システムティック・アロケーション		
・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)	72 342 260.45 米ドル	- 米ドル
- システムティック・アロケーション		
・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)	183 083 340.90 米ドル	- 米ドル

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

b) オプション

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ	指数に係るオプション、従来型(売却)
- ダイナミック・インカム(米ドル)	27 609 555.77 米ドル
- インカム・サステナブル(米ドル)	15 684.19 米ドル

c) スワップ

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ	指数に係るスワップおよび先渡スワップ	
	(購入)	(売却)
- ダイナミック・インカム(米ドル)	- 米ドル	16 854 709.95 米ドル
- システムティック・アロケーション		
・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)	- 米ドル	9 667 216.35 米ドル
- システムティック・アロケーション		
・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)	- 米ドル	6 232 583.69 米ドル
- システムティック・アロケーション		
・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)	- 米ドル	30 896 916.05 米ドル

注8 - 総費用比率(TER)

この比率は、スイス・アセット・マネジメント協会(AMAS)の「TERの計算ならびに開示に関するガイドライン」現行版に従って計算された。比率はまた、純資産の百分率として遡及的に計算され、純資産(運用費用)に対し継続ベースで請求されるすべての費用および手数料の合計を表す。

過去12ヶ月のT E Rは、以下のとおりである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ	総費用比率 (T E R)
- ダイナミック・インカム (米ドル) P - a c c	1.47%
- ダイナミック・インカム (米ドル) P - m d i s t	1.47%
- インカム・サステナブル (米ドル) P - a c c	1.43%
- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ ・ディフェンシブ (米ドル) P - a c c	1.63%
- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ ・ダイナミック (米ドル) P - a c c	1.88%
- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ ・ミディアム (米ドル) P - a c c	1.77%

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

運用が12ヶ月未満の投資証券クラスのT E Rは、年率換算されている。

注9 - 合併

以下の合併が生じた。

サブ・ファンド	合併先	最終計算日	合併の 効力発生日
UBS (Lux) ストラテジー・シ キャブ - フィクスト・インカム・サステナ ブル(ユーロ)	UBS (Lux) ストラテジー・ファ ンド - フィクスト・インカム・サステナ ブル(ユーロ)	2024年10月10日	2024年10月11日
UBS (Lux) ストラテジー・シ キャブ - フィクスト・インカム・サステナ ブル(米ドル)	UBS (Lux) ストラテジー・ファ ンド - フィクスト・インカム・サステナ ブル(米ドル)	2024年10月10日	2024年10月11日

注10 - 後発事象

期末日より後に財務書類の修正または開示を必要とする事象は発生していない。

注11 - 適用法、業務地および公認言語

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

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

注12 - 貸付証券

本投資法人は、第三者に組入証券の一部分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を通して、それらの機関が設定した方法に従ってのみ行われる。担保は、貸付証券に関連して受領される。担保は、一般的に借入れられた証券の少なくとも時価に相当する金額の高格付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貸付証券機関として行為する。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ	2024年11月30日現在の貸付証券による 取引相手方エクスポージャー*		2024年11月30日現在の 担保内訳(%)		
	貸付証券の時価	担保(ユービーエス・ スイス・エイ・ジー)	株式	債券	現金
- ダイナミック・インカム(米ドル)	30 337 923.17 米ドル	33 419 949.48 米ドル	47.77	52.23	0.00
- システマティック・アロケーション ・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)	5 885 738.07 米ドル	6 183 936.13 米ドル	47.77	52.23	0.00
- システマティック・アロケーション ・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)	11 959 584.93 米ドル	12 589 893.12 米ドル	47.77	52.23	0.00
- システマティック・アロケーション ・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)	27 728 274.19 米ドル	29 192 618.18 米ドル	47.77	52.23	0.00

* 取引相手方エクスポージャーの価格および為替レートの情報は、2024年11月30日に貸付証券機関から直接入手したものであるため、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ことがある。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ		
	- ダイナミック・インカム(米ドル)	- インカム・サステナブル(米ドル)
貸付証券収益	19 477.48	253.05
貸付証券コスト*		
ユービーエス・スイス・エイ・ジー	5 843.24 米ドル	75.92 米ドル
UBSヨーロッパSE ルクセンブルグ支店	1 947.75 米ドル	25.30 米ドル
純貸付証券収益	11 686.49 米ドル	151.83 米ドル

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ			
	- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)	- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)	- システマティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)
貸付証券収益	5 904.65	14 531.47	28 963.32
貸付証券コスト*			
ユービーエス・スイス・エイ・ジー	1 771.40 米ドル	4 359.44 米ドル	8 689.00 米ドル
UBSヨーロッパSE ルクセンブルグ支店	590.46 米ドル	1 453.15 米ドル	2 896.33 米ドル
純貸付証券収益	3 542.79 米ドル	8 718.88 米ドル	17 377.99 米ドル

* 総収入の30%を貸付証券取引を執行するサービス提供者であるユービーエス・スイス・エイ・ジーが費用または手数料として留保し、10%は貸付証券機関であるUBSヨーロッパSE ルクセンブルグ支店が留保する。

[次へ](#)

(2) 投資有価証券明細表等

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

2024年11月30日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある証券および短期金融商品

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注 1)	純資産 比率 (%)
株式			
オーストラリア			
AUD ANZ GROUP HLDGS LI NPV	18 767.00	381 077.01	0.08
AUD APA GROUP NPV	7 704.00	36 235.53	0.01
AUD ARISTOCRAT LEISURE NPV	3 391.00	149 664.29	0.03
AUD ASX LTD NPV	1 332.00	57 322.34	0.01
AUD BHP GROUP LTD NPV	31 710.00	838 073.94	0.19
AUD BLUESCOPE STEEL NPV	3 676.00	52 995.38	0.01
AUD BRAMBLES LTD NPV	13 239.00	164 125.12	0.04
AUD CAR GROUP LTD NPV	2 030.00	54 881.41	0.01
AUD CMNWLTH BK OF AUST NPV	10 468.00	1 081 417.06	0.24
AUD COCHLEAR LTD NPV	381.00	75 513.11	0.02
AUD COLES GROUP LTD NPV	11 795.00	142 842.82	0.03
AUD COMPUTERSHARE LTD NPV(POST REC)	4 604.00	95 646.91	0.02
AUD CSL NPV	3 020.00	555 233.70	0.12
AUD ENDEAVOUR GROUP LI NPV	16 971.00	48 313.66	0.01
AUD FORTESCUE LTD NPV	15 378.00	190 241.78	0.04
AUD GOODMAN GROUP (STAPLED SECURITY)	10 658.00	263 214.97	0.06
AUD GPT GROUP NPV (STAPLED SECURITIES)	13 656.00	42 345.92	0.01
AUD INSURANCE AUST GRP NPV	15 793.00	87 759.62	0.02
AUD MACQUARIE GP LTD NPV	2 276.00	342 666.85	0.08
AUD MEDIBANK PRIVATE L NPV	26 556.00	66 085.64	0.01
AUD MINERAL RESS LTD NPV	1 262.00	27 648.23	0.01
AUD MIRVAC GROUP STAPLED SECURITIES	25 485.00	35 860.76	0.01
AUD NATL AUSTRALIA BK NPV	19 344.00	492 724.47	0.11
AUD NTHN STAR RES LTD NPV	10 395.00	118 574.62	0.03
AUD ORICA LIMITED NPV	2 456.00	28 975.30	0.01
AUD ORIGIN ENERGY NPV	11 318.00	80 145.72	0.02
AUD PRO MEDICUS NPV	314.00	51 525.43	0.01
AUD QANTAS AIRWAYS NPV	4 669.00	26 675.01	0.01
AUD QBE INS GROUP NPV	13 984.00	182 197.54	0.04
AUD RAMSAY HEALTH CARE NPV	943.00	24 320.82	0.01
AUD REA GROUP LIMITED NPV	320.00	52 434.95	0.01
AUD REECE AUSTRALIA NPV	1 264.00	21 195.16	0.00
AUD RIO TINTO LIMITED NPV	3 405.00	262 278.46	0.06
AUD SANTOS LIMITED NPV	31 815.00	136 998.08	0.03
AUD SCENTRE GROUP NPV STAPLED UNIT	32 923.00	78 927.49	0.02
AUD SEEK LIMITED NPV	2 152.00	36 618.16	0.01
AUD SGH LTD NPV	1 139.00	36 736.50	0.01
AUD SONIC HEALTHCARE NPV	4 298.00	79 994.06	0.02
AUD SOUL PATTINSON(WH) NPV	2 308.00	52 323.42	0.01
AUD SOUTH32 LTD NPV	28 212.00	68 368.79	0.02
AUD STOCKLAND NPV (STAPLED)	16 810.00	57 163.56	0.01
AUD SUNCORP GROUP LTD NPV	11 458.00	147 046.99	0.03
AUD TELSTRA GROUP LTD NPV	40 183.00	103 138.23	0.02
AUD THE LOTTERY CORPORA NPV	20 592.00	69 487.93	0.02
AUD TRANSURBAN GROUP STAPLED UNITS NPV	18 704.00	155 964.43	0.03
AUD TREASURY WINE ESTA NPV	7 792.00	57 512.19	0.01
AUD VICINITY LTD NPV (STAPLED SECURITY)	26 367.00	37 101.85	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
AUD WESFARMERS LTD NPV	10 378.00	485 624.54	0.11
AUD WESTPAC BKG CORP NPV	21 632.00	470 114.67	0.10
AUD WISETECH GLOBAL LT NPV	1 056.00	88 123.98	0.02
AUD WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	17 152.00	273 866.66	0.06
AUD WOOLWORTHS GRP LTD NPV	7 344.00	144 388.63	0.03
オーストラリア合計		8 709 713.69	1.94
オーストリア			
EUR ERSTE GROUP BK AG NPV	943.00	51 692.22	0.01
EUR OMV AG NPV(VAR)	757.00	30 318.69	0.01
EUR VERBUND AG CLASS'A'NPV	324.00	25 836.76	0.00
オーストリア合計		107 847.67	0.02
ベルギー			
EUR AGEAS NPV	794.00	40 052.62	0.01
EUR ANHEUSER-BUSCH IN NPV	2 182.00	117 397.77	0.03
EUR D'ITEREN GROUP NPV	39.00	8 312.51	0.00
EUR ELIA GROUP NPV	68.00	6 366.98	0.00
EUR GPE BRUXELLES LAM NPV	195.00	13 480.02	0.00
EUR KBC GROUP NV NPV	580.00	41 803.55	0.01
EUR SOFINA NPV	31.00	7 190.19	0.00
EUR SYENSQO SA NPV	176.00	13 060.72	0.00
EUR UCB NPV	306.00	59 904.60	0.02
EUR WAREHOUSES DE PAUW NPV (POST SPLIT)	628.00	13 876.10	0.00
ベルギー合計		321 445.06	0.07
バミューダ			
EUR AEGON LIMITED EURO.12	2 592.00	16 705.26	0.00
USD ARCH CAPITAL GROUP COM USD0.01	496.00	49 957.12	0.01
USD EVEREST GROUP LTD COM USD0.01	87.00	33 717.72	0.01
バミューダ合計		100 380.10	0.02
カナダ			
CAD AGNICO EAGLE MINES LTD COM	1 466.00	123 612.44	0.03
CAD ARC RESOURCES COM NPV	1 861.00	34 305.19	0.01
CAD BARRICK GOLD CORP COM NPV	4 895.00	85 723.24	0.02
CAD BCE INC COM NEW	204.00	5 521.98	0.00
CAD CANADIAN TIRE LTD CL A	192.00	21 168.47	0.00
CAD FORTIS INC COM NPV	1 416.00	63 298.53	0.01
CAD GREAT WEST LIFE CO INC COM	833.00	29 990.74	0.01
CAD HYDRO ONE INC COM NPV	1 007.00	32 932.56	0.01
CAD IA FINANCIAL CORP COM NPV	286.00	27 336.63	0.01
CAD IGM FINANCIAL INC COM	223.00	7 535.00	0.00
CAD IMPERIAL OIL LTD COM NEW	538.00	39 842.32	0.01
CAD LUNDIN MINING CORP COM	1 943.00	19 067.11	0.00
CAD MAGNA INTL INC COM NPV	807.00	36 674.22	0.01
CAD MANULIFE FINL CORP COM	5 109.00	164 455.69	0.04
CAD NUTRIEN LTD NPV	1 501.00	70 110.63	0.02
CAD OPEN TEXT CO COM NPV	781.00	23 784.48	0.01
CAD POWER CORP CDA COM	1 579.00	53 184.04	0.01
CAD SAPUTO INC COM	877.00	16 348.03	0.00
CAD SUN LIFE FINL INC COM	1 672.00	102 900.57	0.02
CAD SUNCOR ENERGY INC COM NPV 'NEW'	3 698.00	147 138.22	0.03
CAD TELUS CORPORATION NPV	1 282.00	19 960.43	0.00
CAD TOURMALINE OIL CP COM NPV	943.00	44 504.83	0.01
カナダ合計		1 169 395.35	0.26

注記は当財務書類と不可分のものである。

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注 1)	純資産 比率 (%)
中国			
SGD YANGZIJIAN SHIPBU NPV	5 300.00	9 527.47	0.00
中国合計		9 527.47	0.00
デンマーク			
DKK A.P. MOELLER-MAERSK SER'B'DKK1000	13.00	22 047.16	0.00
DKK A.P. MOLLER-MAERSK 'A'DKK1000	8.00	13 108.62	0.00
DKK CARLSBERG SER'B'DKK20	269.00	27 688.60	0.01
DKK COLOPLAST DKK1 B	371.00	46 730.97	0.01
DKK TRYG A/S DKK5	1 024.00	23 580.57	0.01
デンマーク合計		133 155.92	0.03
フィンランド			
EUR ELISA OYJ NPV	711.00	32 201.09	0.01
EUR FORTUM OYJ EUR3.40	1 739.00	26 200.98	0.01
EUR KESKO OYJ EUR2 SER'B'	1 788.00	35 531.86	0.01
EUR KONE CORPORATION NPV ORD 'B'	1 752.00	90 783.69	0.02
EUR METSO CORPORATION RG	3 429.00	30 154.35	0.01
EUR NESTE OIL OYJ NPV	1 008.00	15 336.28	0.00
EUR NOKIA OYJ NPV	13 538.00	56 902.22	0.01
EUR NORDEA HOLDING ABP NPV	7 841.00	88 655.22	0.02
EUR ORION CORP SER'B'NPV	520.00	24 561.30	0.00
EUR SAMPO PLC NPV A	1 017.00	43 546.26	0.01
EUR STORA ENSO OYJ NPV SER'R'	1 213.00	11 776.52	0.00
EUR UPM-KYMMENE CORP NPV	2 815.00	74 032.75	0.02
EUR WARTSILA OYJ ABP SER'B'EUR3.50	909.00	16 518.28	0.00
フィンランド合計		546 200.80	0.12
フランス			
EUR ACCOR EUR3	324.00	14 947.68	0.00
EUR ADP EUR3	80.00	9 252.31	0.00
EUR AIR LIQUIDE(L') EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)	1 366.00	226 918.74	0.05
EUR AIRBUS EUR1	1 323.00	206 193.35	0.05
EUR ALSTOM EUR7.00	888.00	19 968.01	0.01
EUR AMUNDI EUR2.5 (AIW)	388.00	25 264.52	0.01
EUR ARKEMA EUR10	254.00	20 120.61	0.01
EUR AXA EUR2.29	9 517.00	331 510.19	0.07
EUR BIOMERIEUX NPV (POST SPLIT)	70.00	7 308.38	0.00
EUR BNP PARIBAS EUR2	2 374.00	142 020.20	0.03
EUR BOLLORE EURO.16	2 108.00	12 991.45	0.00
EUR BOUYGUES EUR1	1 007.00	29 950.79	0.01
EUR BUREAU VERITAS EURO.12	1 777.00	54 053.78	0.01
EUR CAPGEMINI EUR8	359.00	57 596.80	0.01
EUR CARREFOUR EUR2.50	1 457.00	22 159.92	0.01
EUR CIE DE ST-GOBAIN EUR4	2 361.00	215 305.04	0.05
EUR COVIVIO EUR3	183.00	10 050.80	0.00
EUR CREDIT AGRICOLE SA EUR3	2 716.00	36 345.66	0.01
EUR DANONE EURO.25	3 236.00	220 999.03	0.05
EUR DASSAULT AVIATION EURO.80 (POST SUBDIVISION)	29.00	5 770.65	0.00
EUR DASSAULT SYSTEMES EURO.10	1 348.00	46 485.69	0.01
EUR EDENRED EUR2	565.00	18 678.37	0.00
EUR EIFFAGE EUR4	137.00	12 357.33	0.00
EUR ENGIE EUR1	4 536.00	72 271.08	0.02
EUR ESSILORLUXOTTICA EURO.18	703.00	170 628.47	0.04
EUR EURAZEO NPV	99.00	7 272.41	0.00
EUR GECINA EUR7.50	154.00	15 509.14	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注 1)	純資産 比率 (%)
EUR GETLINK SE EURO.40	662.00	10 813.20	0.00
EUR HERMES INTL NPV	75.00	163 578.98	0.04
EUR IPSEN EUR1	79.00	9 128.31	0.00
EUR KERING EUR4	178.00	41 501.79	0.01
EUR KLEPIERRE EUR1.40	348.00	10 519.50	0.00
EUR L'OREAL EURO.20	574.00	199 246.95	0.05
EUR LA FRANCAISE DES EURO.40 (PROMESSES)	469.00	18 526.38	0.00
EUR LEGRAND SA EUR4	529.00	53 012.28	0.01
EUR LVMH MOET HENNESSY EURO.30	1 458.00	912 414.21	0.20
EUR MICHELIN (CGDE) EURO.50 (POST SUBDIVISION)	3 517.00	114 225.65	0.03
EUR ORANGE EUR4	3 661.00	38 996.16	0.01
EUR PERNOD RICARD EUR1.55	1 102.00	123 260.44	0.03
EUR PUBLICIS GROUPE SA EURO.40	1 214.00	131 684.69	0.03
EUR RENAULT SA EUR3.81	416.00	17 808.04	0.00
EUR REXEL EUR5	448.00	11 564.46	0.00
EUR SAFRAN EURO.20	773.00	180 025.59	0.04
EUR SANOFI EUR2	6 043.00	587 775.16	0.13
EUR SARTORIUS STEDIM B EURO.20 (POST SUBD)	70.00	13 334.00	0.00
EUR SCHNEIDER ELECTRIC EUR8	1 294.00	332 797.00	0.07
EUR SEB SA EUR1	144.00	13 657.93	0.00
EUR SOC GENERALE EUR1.25	1 447.00	38 353.23	0.01
EUR SODEXO EUR4	250.00	20 754.33	0.01
EUR TELEPERFORMANCE EUR2.50	180.00	16 924.12	0.00
EUR THALES EUR3	216.00	32 281.70	0.01
EUR TOTALENERGIES SE EUR2.5	11 201.00	650 322.38	0.15
EUR UNIBAIL-RODAMCO-WE NPV(1 ORD UNIBAIL-R & 1CLS)	250.00	20 479.72	0.01
EUR VEOLIA ENVIRONNEME EUR5	1 560.00	45 426.32	0.01
EUR VINCI EUR2.50	2 684.00	283 087.20	0.06
EUR VIVENDI SA EUR5.50	1 249.00	11 463.79	0.00
フランス合計		6 114 893.91	1.36

ドイツ

EUR ADIDAS AG NPV (REGD)	377.00	88 835.61	0.02
EUR ALLIANZ SE NPV(REGD)(VINKULIERT)	2 046.00	631 439.88	0.14
EUR BASF SE NPV	2 197.00	98 434.40	0.02
EUR BAYER AG NPV (REGD)	2 390.00	48 941.48	0.01
EUR BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG EUR1	1 603.00	118 550.06	0.03
EUR BAYERISCHE MOTORENWERKE AG EUR1	309.00	21 050.59	0.01
EUR BECHTLE AG NPV	232.00	7 620.69	0.00
EUR BEIERSDORF AG NPV	211.00	27 333.56	0.01
EUR BRENNTAG AG	682.00	43 940.03	0.01
EUR CARL ZEISS MEDITEC NPV	44.00	2 628.04	0.00
EUR COMMERZBANK AG NPV	2 141.00	32 845.74	0.01
EUR CONTINENTAL AG ORD NPV	383.00	25 096.71	0.01
EUR COVESTRO AG NPV	451.00	27 494.70	0.01
EUR CTS EVENTIM NPV	133.00	11 736.65	0.00
EUR DAIMLER TRUCK HOLD NPV (YOUNG SHARE)	1 297.00	49 042.11	0.01
EUR DELIVERY HERO SE NPV	397.00	16 244.12	0.00
EUR DEUTSCHE BANK AG NPV(REGD)	4 757.00	80 761.30	0.02
EUR DEUTSCHE BOERSE AG NPV(REGD)	432.00	101 065.67	0.02
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA ORD NPV (REGD)(VINK)	2 249.00	15 050.49	0.00
EUR DEUTSCHE POST AG NPV(REGD)	5 402.00	198 383.45	0.05
EUR DEUTSCHE TELEKOM NPV(REGD)	8 330.00	266 407.86	0.06
EUR DR.ING. F.PORSCHE NON-VTG PRF NPV	731.00	45 614.61	0.01
EUR E.ON SE NPV	5 741.00	73 885.51	0.02
EUR EVONIK INDUSTRIES NPV	736.00	13 498.91	0.00
EUR FRESENIUS MED CARE NPV	1 085.00	47 672.64	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注 1)	純資産 比率 (%)
EUR FRESENIUS SE & CO. KGAA NPV	884.00	31 063.56	0.01
EUR GEA GROUP AG NPV	953.00	47 630.35	0.01
EUR HANNOVER RUECKVERS ORD NPV(REGD)	324.00	84 559.79	0.02
EUR HEIDELBERG MATER NPV	709.00	89 412.19	0.02
EUR HENKEL AG & CO KGAA	629.00	47 733.53	0.01
EUR HENKEL AG&CO. KGAA NON-VTG PRF NPV	943.00	80 436.69	0.02
EUR INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)	2 866.00	93 279.14	0.02
EUR KNORR BREMSE AG NPV	103.00	7 849.10	0.00
EUR LEG IMMOBILIEN SE NPV	141.00	13 066.61	0.00
EUR MERCEDES-BENZ ORD NPV(REGD)	1 822.00	101 916.03	0.02
EUR MERCK KGAA NPV	268.00	40 081.52	0.01
EUR MTU AERO ENGINES H NPV (REGD)	109.00	37 093.53	0.01
EUR MUENCHENER RUECKVE NPV(REGD)	689.00	359 712.89	0.08
EUR NEMETSCHEK SE ORD NPV	97.00	10 060.73	0.00
EUR PORSCHE AUTO HL SE NON VTG PRF NPV	805.00	29 435.34	0.01
EUR PUMA SE NPV	336.00	15 721.33	0.00
EUR RATIONAL AG NPV	16.00	14 955.79	0.00
EUR RHEINMETALL AG NPV	109.00	71 654.30	0.02
EUR RWE AG (NEU) NPV	1 671.00	56 247.69	0.01
EUR SAP AG ORD NPV	2 507.00	595 511.23	0.13
EUR SARTORIUS AG NON VTG PRF NPV	59.00	13 572.38	0.00
EUR SCOUT24 SE NPV	139.00	12 486.34	0.00
EUR SIEMENS AG NPV(REGD)	4 030.00	779 617.98	0.17
EUR SIEMENS ENERGY AG NPV	1 512.00	81 477.63	0.02
EUR SIEMENS HEALTHINEE NPV	707.00	38 322.36	0.01
EUR SYMRISE AG NPV (BR)	308.00	33 994.85	0.01
EUR TALANX AG NPV	329.00	27 868.68	0.01
EUR VOLKSWAGEN AG NON VTG PRF NPV	579.00	49 363.49	0.01
EUR VONOVIA SE NPV	1 805.00	59 862.25	0.01
EUR ZALANDO SE NPV	467.00	14 511.28	0.00
ドイツ合計		5 032 073.39	1.12
香港			
HKD CK ASSET HOLDINGS HKD1	6 500.00	26 562.83	0.01
HKD CK INFRASTRUCTURE HKD1	2 000.00	13 776.18	0.00
HKD CLP HOLDINGS HKD5	5 000.00	41 958.22	0.01
HKD HENDERSON LAND DEV HKD2	5 000.00	15 678.11	0.00
HKD HKT TRUST AND HKT SHARE STAPLED UNIT	12 000.00	14 912.20	0.00
HKD HONG KONG EXCHANGE HKD1	3 500.00	130 346.78	0.03
HKD HONGKONG&CHINA GAS HKD0.25	37 400.00	28 356.82	0.01
HKD POWER ASSETS HOLDINGS LTD HKD1	4 500.00	29 492.84	0.01
HKD SINO LAND CO HKD1	15 203.00	14 887.38	0.00
HKD SITC INTERNATIONAL HKD0.10	5 000.00	13 011.55	0.00
HKD WH GROUP LTD USD0.0001	22 000.00	17 443.83	0.01
香港合計		346 426.74	0.08
アイルランド			
USD ACCENTURE PLC SHS CL A 'NEW'	856.00	310 188.72	0.07
EUR AIB GROUP PLC ORD EURO.625	2 061.00	11 210.67	0.00
USD ALLEGION PLC CIM USD0.01	100.00	14 084.00	0.00
USD APTIV PLC COM USD0.01	296.00	16 436.88	0.00
EUR BANK OF IRELAND GR EUR1	2 211.00	19 354.62	0.00
USD CRH ORD EURO.32	900.00	92 043.00	0.02
GBP DCC ORD EURO.25	732.00	53 265.89	0.01
USD EATON CORP PLC COM USD0.01	560.00	210 235.20	0.05
GBP EXPERIAN ORD USD0.10	2 791.00	133 066.75	0.03

注記は当財務書類と不可分のものである。

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注 1)	純資産 比率 (%)
GBP FLUTTER ENTERTAINM ORD EURO.09	234.00	64 273.69	0.02
AUD JAMES HARDIE ID PLC CUFS EURO.5	2 824.00	103 409.24	0.02
EUR KERRY GROUP 'A'ORD EURO.125(DUBLIN LIST)	359.00	34 675.63	0.01
EUR KINGSPAN GROUP ORD EURO.13(DUBLIN LISTING)	408.00	30 682.19	0.01
USD MEDTRONIC PLC USD0.0001	5 422.00	469 219.88	0.11
USD PENTAIR PLC COM USD0.01	176.00	19 182.24	0.00
USD SMURFIT WESTROCK L COM USD0.001	1 077.00	59 256.54	0.01
GBP SMURFIT WESTROCK L COM USD0.001	1 104.00	60 676.06	0.01
USD STERIS PLC ORD USD0.001	172.00	37 678.32	0.01
USD TE CONNECTIVITY COM USD0.01	436.00	65 888.32	0.02
USD TRANE TECHNOLOGIES COM USD1	315.00	131 109.30	0.03
アイルランド合計		1 935 937.14	0.43
マン島			
GBP ENTAIN PLC ORD EURO.01	1 952.00	19 987.66	0.01
マン島合計		19 987.66	0.01
イスラエル			
ILS AZRIELI GROUP ILS0.01	114.00	9 124.64	0.00
ILS BANK HAPOLIM B.M. ILS1	3 616.00	41 444.78	0.01
ILS BK LEUMI LE ISRAEL ILS1	4 346.00	49 369.38	0.01
ILS MIZRAHI TEFAHOT BK ILS0.01	552.00	23 791.73	0.01
イスラエル合計		123 730.53	0.03
イタリア			
EUR AMPLIFON EURO.02	337.00	8 553.22	0.00
EUR BANCO BPM NPV	3 716.00	28 274.54	0.01
EUR DAVIDE CAMPARI MIL EURO.01	850.00	5 097.54	0.00
EUR ENEL EUR1	17 916.00	128 864.81	0.03
EUR ENI SPA EUR1	4 963.00	70 273.19	0.02
EUR FINECOBANK SPA EURO.33	3 338.00	53 553.80	0.01
EUR GENERALI SPA NPV EUR1	4 997.00	142 923.67	0.03
EUR INFRASTRUTTURE WIR NPV	619.00	6 374.43	0.00
EUR INTESA SANPAOLO NPV	36 801.00	140 978.65	0.03
EUR LEONARDO SPA EUR4.40	1 064.00	28 623.10	0.01
EUR MEDIOBANCA SPA EURO.5	970.00	14 143.42	0.00
EUR MONCLER SPA NPV	1 127.00	55 172.14	0.01
EUR NEXI SPA NPV	1 879.00	11 121.70	0.00
EUR POSTE ITALIANE SPA NPV	733.00	10 285.18	0.00
EUR PRYSMIAN SPA EURO.10	625.00	41 205.00	0.01
EUR RECORDATI EURO.125	599.00	32 613.82	0.01
EUR SNAM EUR1	10 846.00	50 541.86	0.01
EUR TELECOM ITALIA SPA EURO.55	18 139.00	4 354.70	0.00
EUR TERNA SPA ORD EURO.22	7 744.00	65 499.13	0.02
EUR UNICREDIT SPA NPV (POST REV SPLIT)	3 429.00	131 775.92	0.03
EUR UNIPOL GRUPPO FIN NPV PRIV (POST CONSOLID)	795.00	9 589.13	0.00
イタリア合計		1 039 818.95	0.23
日本			
JPY アドバンテスト	2 200.00	120 704.46	0.03
JPY イオン	2 000.00	47 860.97	0.01
JPY A G C	1 300.00	40 596.60	0.01
JPY アイシン	2 700.00	28 369.01	0.01
JPY 味の素	1 500.00	62 742.62	0.01
JPY A N Aホールディングス	800.00	15 389.02	0.00
JPY アサヒグループホールディングス	8 600.00	93 309.59	0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注 1)	純資産 比率 (%)
JPY 旭化成	3 400.00	24 178.18	0.01
JPY アシックス	2 000.00	39 990.68	0.01
JPY アステラス製薬	5 300.00	55 105.04	0.01
JPY バンダイナムコホールディングス	1 500.00	31 561.07	0.01
JPY ブリヂストン	3 400.00	121 094.65	0.03
JPY ブラザー工業	1 800.00	31 581.05	0.01
JPY キヤノン	5 700.00	184 756.13	0.04
JPY カブコン	1 000.00	23 344.54	0.01
JPY 東海旅客鉄道	2 000.00	41 109.30	0.01
JPY 千葉銀行	1 500.00	12 489.60	0.00
JPY 中部電力	2 000.00	21 080.67	0.00
JPY 中外製薬	2 000.00	87 864.97	0.02
JPY コンコルディア・フィナンシャルグループ	2 600.00	15 540.97	0.00
JPY 大日本印刷	1 200.00	18 257.48	0.00
JPY 第一生命ホールディングス	2 500.00	67 433.50	0.02
JPY ダイフク	1 100.00	22 829.84	0.01
JPY 第一三共	5 600.00	177 077.61	0.04
JPY ダイキン工業	800.00	96 387.79	0.02
JPY 大東建託	300.00	33 408.80	0.01
JPY 大和ハウス工業	3 300.00	103 382.50	0.02
JPY 大和証券グループ	4 200.00	28 119.32	0.01
JPY デンソー	10 800.00	153 099.18	0.03
JPY 電通グループ	600.00	15 277.16	0.00
JPY ディスコ	300.00	81 099.98	0.02
JPY 東日本旅客鉄道	2 400.00	46 662.45	0.01
JPY エーザイ	700.00	21 766.49	0.01
JPY E N E O S ホールディングス	9 400.00	50 622.37	0.01
JPY ファナック	5 500.00	142 347.77	0.03
JPY ファーストリテイリング	600.00	204 188.17	0.05
JPY 富士電機	300.00	16 825.25	0.00
JPY 富士フイルムホールディングス	3 600.00	80 876.25	0.02
JPY フジクラ	300.00	10 630.89	0.00
JPY 富士通	5 000.00	95 415.65	0.02
JPY 阪急阪神ホールディングス	800.00	21 871.69	0.01
JPY 光通信	100.00	21 826.41	0.01
JPY 日立建機	400.00	8 996.90	0.00
JPY 日立製作所	13 600.00	339 671.74	0.08
JPY 本田技研工業	26 800.00	230 463.76	0.05
JPY ホシザキ	200.00	8 063.39	0.00
JPY H O Y A	1 100.00	141 066.02	0.03
JPY ヒューリック	2 000.00	17 964.51	0.00
JPY 出光興産	3 000.00	19 969.37	0.00
JPY I N P E X	3 100.00	40 745.75	0.01
JPY いすゞ自動車	3 600.00	47 868.96	0.01
JPY 伊藤忠商事	7 100.00	349 078.80	0.08
JPY 日本航空	500.00	8 308.09	0.00
JPY 日本取引所グループ	5 300.00	63 645.17	0.01
JPY ゆうちょ銀行	4 100.00	38 656.32	0.01
JPY 日本郵政	5 700.00	56 910.81	0.01
JPY かんぽ生命保険	800.00	16 720.71	0.00
JPY ジャパンリアルエステイト投資法人	4.00	14 755.14	0.00
JPY 日本たばこ産業	7 500.00	210 690.15	0.05
JPY J F E ホールディングス	2 100.00	23 896.53	0.01
JPY 鹿島建設	2 200.00	40 034.62	0.01
JPY 関西電力	2 200.00	28 205.88	0.01
JPY 花王	2 800.00	121 444.89	0.03

注記は当財務書類と不可分のものである。

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注 1)	純資産 比率 (%)
JPY 川崎汽船	1 500.00	19 900.46	0.00
JPY K D D I	9 200.00	303 226.02	0.07
JPY キーエンス	600.00	258 561.11	0.06
JPY キッコーマン	2 000.00	21 859.71	0.01
JPY キリンホールディングス	5 000.00	69 564.20	0.02
JPY 神戸物産	400.00	10 048.94	0.00
JPY K O K U S A I E L E C T R I C	400.00	6 605.19	0.00
JPY 小松製作所	5 400.00	144 757.46	0.03
JPY コナミグループ	300.00	29 513.60	0.01
JPY クボタ	5 200.00	64 850.68	0.01
JPY 京セラ	7 600.00	74 565.37	0.02
JPY 協和キリン	1 100.00	18 208.21	0.00
JPY レーザーテック	200.00	21 893.00	0.01
JPY L I N E ヤフー	9 300.00	25 506.34	0.01
JPY エムスリー	1 500.00	14 482.14	0.00
JPY マキタ	500.00	15 594.10	0.00
JPY 丸紅	3 700.00	55 530.18	0.01
JPY マツキヨココカラ&カンパニー	1 200.00	16 771.32	0.00
JPY 日本マクドナルドホールディングス	200.00	8 243.17	0.00
JPY 明治ホールディングス	1 400.00	29 829.88	0.01
JPY ミネベアミツミ	900.00	14 675.90	0.00
JPY 三菱ケミカルグループ	3 900.00	20 382.26	0.00
JPY 三菱商事	10 100.00	169 840.86	0.04
JPY 三菱電機	5 200.00	88 187.24	0.02
JPY 三菱地所	3 100.00	43 749.04	0.01
JPY 三菱H C キャピタル	3 200.00	21 520.13	0.01
JPY 三菱重工業	9 700.00	141 929.95	0.03
JPY 三菱U F J フィナンシャル・グループ	32 500.00	387 788.40	0.09
JPY 三井物産	15 300.00	319 477.98	0.07
JPY 三井化学	900.00	20 788.36	0.00
JPY 三井不動産	8 000.00	66 797.62	0.02
JPY 商船三井	2 000.00	68 302.43	0.02
JPY みずほフィナンシャルグループ	6 930.00	174 605.45	0.04
JPY M o n o t a R O	400.00	7 107.23	0.00
JPY M S & A D インシュアランス グループ ホールディングス	7 700.00	171 293.41	0.04
JPY 村田製作所	5 200.00	86 906.15	0.02
JPY 日本電気	700.00	59 403.40	0.01
JPY ネクソン	1 000.00	13 706.43	0.00
JPY ニデック	2 600.00	47 694.51	0.01
JPY 任天堂	6 300.00	369 564.21	0.08
JPY 日本ビルファンド投資法人	30.00	25 069.08	0.01
JPY 日本ペイントホールディングス	2 600.00	17 718.81	0.00
JPY 日本酸素ホールディングス	400.00	11 630.99	0.00
JPY 日本製鉄	2 500.00	50 920.53	0.01
JPY 日本電信電話	177 300.00	181 095.45	0.04
JPY 日本郵船	2 500.00	79 834.87	0.02
JPY 日産自動車	6 200.00	14 816.26	0.00
JPY 日清食品ホールディングス	600.00	15 892.40	0.00
JPY ニトリホールディングス	200.00	25 601.76	0.01
JPY 日東電工	4 200.00	66 781.64	0.02
JPY 野村ホールディングス	9 400.00	56 418.15	0.01
JPY 野村総合研究所	1 200.00	36 602.86	0.01
JPY N T T データグループ	1 700.00	32 803.54	0.01
JPY 大林組	3 700.00	52 598.46	0.01
JPY オービック	1 000.00	32 659.72	0.01
JPY オリンパス	3 500.00	54 998.83	0.01
JPY オムロン	500.00	15 867.10	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注 1)	純資産 比率 (%)
JPY 小野薬品工業	2 000.00	23 064.89	0.01
JPY 日本オラクル	100.00	10 200.75	0.00
JPY オリエンタルランド	3 100.00	73 028.60	0.02
JPY オリックス	3 500.00	78 466.56	0.02
JPY 大阪ガス	2 400.00	52 479.28	0.01
JPY 大塚商会	1 200.00	29 819.22	0.01
JPY 大塚ホールディングス	1 200.00	69 394.41	0.02
JPY バン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	1 200.00	30 418.48	0.01
JPY パナソニック	14 100.00	137 587.31	0.03
JPY 楽天グループ	3 600.00	20 576.22	0.00
JPY リクルートホールディングス	4 300.00	297 336.62	0.07
JPY ルネサスエレクトロニクス	4 700.00	61 447.22	0.01
JPY リソナホールディングス	6 200.00	51 603.02	0.01
JPY リコー	1 800.00	20 398.84	0.00
JPY S B I ホールディングス	600.00	15 101.38	0.00
JPY S C R E E N ホールディングス	400.00	25 041.12	0.01
JPY S C S K	600.00	12 097.08	0.00
JPY セコム	1 300.00	45 210.24	0.01
JPY セイコーエプソン	1 700.00	30 103.87	0.01
JPY 積水化学工業	1 700.00	27 381.56	0.01
JPY 積水ハウス	3 700.00	87 212.44	0.02
JPY セブン&アイ・ホールディングス	7 000.00	121 370.31	0.03
JPY S G ホールディングス	1 800.00	17 630.26	0.00
JPY 島津製作所	700.00	19 636.45	0.00
JPY シマノ	200.00	27 898.92	0.01
JPY 信越化学工業	5 400.00	199 697.71	0.04
JPY 塩野義製薬	4 000.00	56 437.06	0.01
JPY 資生堂	1 000.00	19 013.22	0.00
JPY しずおかフィナンシャルグループ	900.00	7 982.16	0.00
JPY S M C	100.00	42 307.82	0.01
JPY ソフトバンク	169 400.00	217 805.64	0.05
JPY ソフトバンクグループ	3 100.00	184 449.85	0.04
JPY S O M P O ホールディングス	5 500.00	144 508.44	0.03
JPY ソニーグループ	18 200.00	364 399.91	0.08
JPY S U B A R U	1 800.00	28 842.43	0.01
JPY 住友商事	2 800.00	59 808.90	0.01
JPY 住友電気工業	4 100.00	78 786.83	0.02
JPY 住友金属鉱山	800.00	19 687.72	0.00
JPY 三井住友フィナンシャルグループ	11 300.00	277 336.62	0.06
JPY 三井住友トラストグループ	2 000.00	49 885.14	0.01
JPY 住友不動産	800.00	24 705.53	0.01
JPY サントリー食品インターナショナル	400.00	13 564.60	0.00
JPY スズキ	4 500.00	47 536.37	0.01
JPY シスメックス	1 200.00	25 280.82	0.01
JPY T & D ホールディングス	1 400.00	26 408.76	0.01
JPY 大成建設	900.00	39 017.88	0.01
JPY 武田薬品工業	4 700.00	127 776.41	0.03
JPY T D K	5 500.00	70 642.87	0.02
JPY テルモ	4 000.00	81 259.78	0.02
JPY T I S	700.00	17 077.60	0.00
JPY 東宝	300.00	13 069.88	0.00
JPY 東京海上ホールディングス	10 900.00	403 819.29	0.09
JPY 東京電力ホールディングス	4 600.00	16 423.21	0.00
JPY 東京エレクトロン	1 300.00	201 771.15	0.05
JPY 東京ガス	1 000.00	30 029.63	0.01
JPY 東急	1 300.00	15 147.98	0.00
JPY T O P P A N ホールディングス	800.00	21 344.34	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
JPY 東レ	4 500.00	28 593.73	0.01
JPY T O T O	900.00	24 156.21	0.01
JPY 豊田自動織機	800.00	59 393.42	0.01
JPY トヨタ自動車	60 400.00	1 026 138.43	0.23
JPY 豊田通商	3 900.00	66 244.30	0.01
JPY トレンドマイクロ	300.00	16 437.73	0.00
JPY ユニ・チャーム	1 100.00	28 498.85	0.01
JPY 西日本旅客鉄道	1 600.00	29 995.01	0.01
JPY ヤクルト本社	900.00	18 307.42	0.00
JPY ヤマハ発動機	5 500.00	47 626.26	0.01
JPY 安川電機	600.00	15 656.69	0.00
JPY 横河電機	400.00	8 877.05	0.00
JPY ゼンショーホールディングス	300.00	18 019.78	0.00
JPY Z O Z O	838.00	26 297.53	0.01
日本合計		14 434 348.68	3.22
ルクセンブルグ			
EUR ARCELORMITTAL NPV(POST STOCK SPLIT)	1 509.00	37 996.33	0.01
EUR EUROFINS SCIENTIFI EURO.01	295.00	14 578.79	0.00
EUR TENARIS S.A. USD1	1 186.00	22 748.18	0.01
ルクセンブルグ合計		75 323.30	0.02
オランダ			
EUR ABN AMRO BANK N.V. DR EACH REP SHS	1 470.00	22 846.72	0.01
EUR ADYEN NV EURO.01	50.00	72 793.30	0.02
USD AERCAP HOLDINGS EURO.01	495.00	49 183.20	0.01
EUR AKZO NOBEL NV EURO.50(POST REV SPLIT)	811.00	47 368.77	0.01
EUR ARGEN X NV EURO.10	151.00	93 522.71	0.02
EUR ASM INTL NV EURO.04	117.00	63 196.46	0.01
EUR ASML HOLDING NV EURO.09	958.00	666 195.19	0.15
EUR ASR NEDERLAND N.V. EURO.16	862.00	41 243.13	0.01
EUR BE SEMICONDUCTOR EURO.01	213.00	25 421.68	0.01
USD CNH INDUSTRIAL NV COM EURO.01	1 674.00	21 025.44	0.00
EUR EURONEXT EUR1.60	424.00	47 335.50	0.01
EUR EXOR NV EURO.01	155.00	15 331.54	0.00
EUR FERRARI NV EURO.01(NEW)	290.00	126 102.89	0.03
EUR FERROVIAL SE EURO.01	1 052.00	43 356.00	0.01
EUR HEINEKEN HOLDING EUR1.6	323.00	20 469.16	0.00
EUR HEINEKEN NV EUR1.60	695.00	51 428.17	0.01
EUR IMCD NV EURO.16	150.00	22 512.90	0.01
EUR ING GROEP N.V. EURO.01	7 908.00	122 429.91	0.03
EUR JDE PEETS N.V. EURO.01	609.00	12 137.67	0.00
EUR KON KPN NV EURO.04	21 750.00	84 331.50	0.02
EUR KONINKLIJKE AHOLD EURO.01	4 911.00	169 355.49	0.04
EUR KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20	1 991.00	54 233.64	0.01
EUR NN GROUP N.V. EURO.12	1 310.00	60 837.86	0.01
USD NXP SEMICONDUCTORS EURO.20	345.00	79 132.65	0.02
EUR PROSUS N.V. EURO.05	3 240.00	131 921.49	0.03
EUR QIAGEN NV ORD EURO.01 (POST REV SPLT)	378.00	16 522.70	0.00
EUR RANDSTAD N.V. EURO.10	584.00	25 665.91	0.01
EUR STELLANTIS N V COM EURO.01	10 406.00	137 780.89	0.03
EUR UNIVERSAL MUSIC GR EUR10.00	1 692.00	40 763.53	0.01
EUR WOLTERS KLUWER EURO.12	580.00	96 759.54	0.02
オランダ合計		2 461 205.54	0.55

注記は当財務書類と不可分のものである。

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注 1)	純資産 比率 (%)
ニュージーランド			
NZD MERCURY NZ LTD NPV	1 129.00	4 421.23	0.00
AUD XERO LIMITED NPV	908.00	102 835.16	0.02
ニュージーランド合計		107 256.39	0.02
ノルウェー			
NOK AKER BP ASA NOK1	1 092.00	22 364.03	0.01
NOK GJENSIDIGE FORSIKR NOK2	521.00	9 256.15	0.00
NOK MOWI ASA NOK7.50	1 263.00	22 895.61	0.01
NOK ORKLA ASA NOK1.25	2 272.00	20 942.74	0.00
ノルウェー合計		75 458.53	0.02
ポーランド			
EUR INPOST S.A. EURO.01	627.00	10 979.90	0.00
ポーランド合計		10 979.90	0.00
ポルトガル			
EUR EDP ENERGIAS PORTU EUR1(REGD)	9 102.00	32 897.50	0.01
EUR GALP ENERGIA EUR1-B	906.00	14 865.71	0.00
EUR JERONIMO MARTINS EUR5	1 464.00	28 513.34	0.01
ポルトガル合計		76 276.55	0.02
シンガポール			
SGD DBS GROUP HLDGS SGD1	5 800.00	183 563.20	0.04
SGD GENTING SING LTD NPV	13 800.00	7 874.54	0.00
SGD OVERSEA-CHINESE BK NPV	9 903.00	120 255.73	0.03
SGD SEMBCORP INDUSTRIE SGDO.25 (POST REORG)	2 600.00	10 123.45	0.00
SGD SINGAPORE EXCHANGE SGDO.01	2 900.00	27 515.01	0.01
SGD SINGAPORE TECH ENG NPV	5 400.00	18 125.54	0.01
SGD UTD O/S BANK SGD1	3 700.00	100 348.34	0.02
SGD WILMAR INTERNATIONAL LTD	5 900.00	13 554.62	0.00
シンガポール合計		481 360.43	0.11
スペイン			
EUR ACCIONA SA EUR1	27.00	3 430.64	0.00
EUR ACS ACTIVIDADES CO EURO.5	490.00	22 750.97	0.00
EUR AENA SME S.A. EUR10	195.00	42 180.40	0.01
EUR AMADEUS IT GROUP EURO.01	991.00	69 521.43	0.02
EUR BANCO SANTANDER SA EURO.50(REGD)	36 495.00	168 658.10	0.04
EUR BBVA(BILB-VIZ-ARG) EURO.49	12 774.00	120 563.60	0.03
EUR BCO DE SABADELL EURO.125	12 613.00	23 786.16	0.00
EUR CAIXABANK SA EUR1	8 107.00	44 063.21	0.01
EUR CELLNEX TELECOM SA EURO.25	958.00	34 382.31	0.01
EUR EDP RENOVAVEIS SA EUR5	555.00	6 495.00	0.00
EUR ENDESA SA EUR1.2	914.00	20 021.71	0.00
EUR GRIFOLS SA EURO.25 (CLASS A) POST SUBD	706.00	6 424.76	0.00
EUR IBERDROLA SA EURO.75 (POST SUBDIVISION)	31 243.00	445 154.58	0.10
EUR INDITEX EURO.03 (POST SUBD)	5 551.00	305 929.58	0.07
EUR REDEIA CORP SA EURO.5	2 373.00	42 357.53	0.01
EUR REPSOL SA EUR1	5 993.00	74 849.97	0.02
EUR TELEFONICA SA EUR1	9 731.00	44 051.01	0.01
スペイン合計		1 474 620.96	0.33
スウェーデン			
SEK BOLIDEN AB NPV (POST SPLIT)	853.00	25 420.83	0.01
SEK ERICSSON SER'B' NPV	7 587.00	61 619.60	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注 1)	純資産 比率 (%)
SEK ESSITY AB SER'B'NPV	1 678.00	46 134.49	0.01
SEK EVOLUTION AB NPV	508.00	44 291.84	0.01
SEK GETINGE AB SER'B'NPV	806.00	12 582.16	0.00
SEK HOLMEN AB SER'B'NPV (POST SPLIT)	258.00	9 706.74	0.00
SEK SANDVIK AB NPV (POST SPLIT)	2 884.00	53 275.10	0.01
SEK SKANSKA AB SER'B'NPV	1 083.00	22 564.88	0.01
SEK SKF AB SER'B'NPV	1 181.00	22 659.85	0.01
SEK TELE2 AB SHS	1 596.00	16 729.07	0.00
SEK VOLVO AB SER'A'NPV (POST SPLIT)	671.00	16 776.77	0.00
SEK VOLVO AB SER'B'NPV (POST SPLIT)	4 697.00	116 835.12	0.03
スウェーデン合計		448 596.45	0.10
スイス			
CHF ADECCO GROUP AG CHF0.1 (REGD)	532.00	14 190.69	0.00
CHF BALOISE-HLDGS CHF0.1(REGD)	135.00	25 651.53	0.01
CHF BKW AG CHF2.5	53.00	9 108.06	0.00
USD BUNGE GLOBAL SA COM USD0.01	590.00	52 946.60	0.01
USD CHUBB LIMITED ORD CHF24.15	560.00	161 688.80	0.04
CHF CLARIANT CHF1.76 (REGD)	362.00	4 359.61	0.00
GBP COCA-COLA HBC AG ORD CHF6.70	1 418.00	50 537.86	0.01
EUR DSM FIRMENICH AG EURO.01	418.00	45 893.05	0.01
USD GARMIN LTD COM CHF10.00	245.00	52 087.00	0.01
CHF GEBERIT CHF0.10(REGD)	102.00	61 408.40	0.01
GBP GLENCORE PLC ORD USD0.01	65 775.00	317 650.79	0.07
CHF HELVETIA HOLDING CHF0.02 (REGD) POST SUBD	109.00	19 102.84	0.00
CHF HOLCIM LTD CHF2 (REGD)	1 528.00	155 644.40	0.03
CHF KUEHNE&NAGEL INTL CHF1(REGD)(POST-SUBD)	146.00	34 900.79	0.01
CHF NESTLE SA CHF0.10(REGD)	7 692.00	667 745.93	0.15
CHF NOVARTIS AG CHF0.49 (REGD)	5 734.00	607 049.01	0.14
CHF PARTNERS GROUP HLG CHF0.01 (REGD)	67.00	97 343.93	0.02
CHF RICHEMONT(CIE FIN) CHF1.00 (REG) SER 'A'	1 543.00	214 899.09	0.05
CHF ROCHE HLDGS AG CHF1(BR)	98.00	30 123.04	0.01
CHF ROCHE HLDGS AG GENUSSCHEINE NPV	2 046.00	593 363.22	0.13
CHF SGS SA CHF0.04 (REGD)	437.00	43 392.46	0.01
EUR STMICROELECTRONICS EUR1.04	1 504.00	38 553.50	0.01
CHF SWISS RE AG CHF0.10	888.00	131 184.11	0.03
CHF SWISSCOM AG CHF1(REGD)	77.00	44 443.25	0.01
CHF ZURICH INSURANCE GRP CHF0.10	429.00	272 008.40	0.06
スイス合計		3 745 276.36	0.83
イギリス			
GBP 3I GROUP ORD GBPO.738636	5 873.00	276 872.27	0.06
GBP ADMIRAL GROUP ORD GBPO.001	816.00	26 582.84	0.01
USD AMCOR PLC ORD USD0.01	5 932.00	63 116.48	0.01
GBP ANGLO AMERICAN USD0.54945	7 901.00	253 122.88	0.06
GBP ANTOFAGASTA ORD GBPO.05	1 376.00	29 776.13	0.01
GBP ASHTEAD GROUP ORD GBPO.10	1 367.00	109 290.34	0.02
GBP ASSOCD BRIT FOODS ORD GBPO.0568	1 988.00	55 540.11	0.01
GBP ASTRAZENECA ORD USD0.25	9 527.00	1 285 038.21	0.29
GBP AUTO TRADER GROUP ORD GBPO.01	3 013.00	32 130.96	0.01
GBP AVIVA ORD GBPO.33	8 086.00	49 713.28	0.01
GBP BAE SYSTEMS ORD GBPO.025	18 332.00	285 901.90	0.06
GBP BARCLAYS ORD GBPO.25	45 554.00	152 743.92	0.03
GBP BARRATT REDROW PLC GBPO.10	7 990.00	43 435.88	0.01
GBP BERKELEY GP HLDGS ORD GBPO.05611047	349.00	18 400.38	0.00
GBP BP ORD USD0.25	55 313.00	270 430.44	0.06

注記は当財務書類と不可分のものである。

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注 1)	純資産 比率 (%)
GBP BRIT AMER TOBACCO ORD GBP0.25	12 076.00	458 634.09	0.10
GBP BT GROUP ORD GBP0.05	20 879.00	42 275.44	0.01
GBP BUNZL ORD GBP0.32142857	1 005.00	45 450.08	0.01
GBP CENTRICA ORD GBP0.061728395	16 788.00	27 185.10	0.01
USD COCA-COLA EUROPACI COM EURO.01	1 100.00	85 338.00	0.02
GBP COMPASS GROUP ORD GBP0.1105	5 457.00	186 650.99	0.04
GBP CRODA INTL ORD GBP0.10609756	649.00	28 459.45	0.01
GBP DIAGEO ORD GBP0.28 101/108	13 725.00	410 397.42	0.09
GBP ENDEAVOUR MINING P ORD USD0.01	481.00	9 439.63	0.00
GBP GSK PLC ORD GBP0.3125	12 827.00	217 655.17	0.05
GBP HALEON PLC ORD GBP1.25	25 788.00	122 687.44	0.03
GBP HALMA ORD GBP0.10	1 105.00	38 034.14	0.01
GBP HARGREAVES LANSDOW ORD GBP0.004 (WI)	2 505.00	34 816.83	0.01
GBP HIKMA PHARMACEUTIC ORD GBP0.10	1 069.00	26 142.40	0.01
GBP HSBC HLDGS ORD USD0.50(UK REG)	58 936.00	548 869.98	0.12
GBP IMPERIAL BRANDS PL GBP0.10	5 042.00	164 637.81	0.04
GBP INFORMA PLC (GB) ORD GBP0.001	7 757.00	84 456.77	0.02
GBP INTERCONTL HOTELS ORD GBP0.208521303	503.00	62 655.14	0.01
GBP INTERTEK GROUP ORD GBP0.01	925.00	55 447.01	0.01
GBP JD SPORTS FASHION ORD GBP0.0005	5 720.00	7 401.27	0.00
GBP KINGFISHER ORD GBP0.157142857	10 789.00	33 940.57	0.01
GBP LAND SECURITIES GP ORD GBP0.106666666	1 779.00	13 635.02	0.00
GBP LEGAL & GENERAL GP ORD GBP0.025	19 571.00	55 049.96	0.01
GBP LLOYDS BANKING GP ORD GBP0.1	207 211.00	139 747.07	0.03
GBP LONDON STOCK EXCH ORD GBP0.06918604	1 503.00	215 300.74	0.05
GBP M&G PLC ORD GBP0.05	7 615.00	19 183.87	0.00
GBP MARKS & SPENCER GP ORD GBP0.25	4 369.00	21 252.16	0.01
GBP MELROSE INDUST PLC ORD GBP0.001	3 767.00	27 502.54	0.01
GBP MONDI PLC ORD EURO.22(POST CONS)	2 385.00	36 089.47	0.01
GBP NATIONAL GRID ORD GBP0.12431289	29 701.00	374 720.96	0.08
GBP NATWEST GROUP PLC ORD GBP1.0769	22 136.00	113 303.52	0.03
GBP NEXT ORD GBP0.10	699.00	89 557.17	0.02
GBP PEARSON ORD GBP0.25	3 958.00	62 029.96	0.01
GBP PERSIMMON ORD GBP0.10	930.00	14 870.52	0.00
GBP PHOENIX GP HLDGS ORD GBP0.10	1 553.00	10 146.05	0.00
GBP PRUDENTIAL ORD GBP0.05	9 230.00	75 294.64	0.02
GBP RECKITT BENCK GRP ORD GBP0.10	4 321.00	266 921.26	0.06
GBP RELX PLC GBP0.1444	6 137.00	289 006.07	0.06
GBP RENTOKIL INITIAL ORD GBP0.01	14 557.00	72 863.54	0.02
GBP RIO TINTO ORD GBP0.10	6 875.00	431 374.52	0.10
GBP ROLLS-ROYCE HLDGS ORD GBP0.20	27 037.00	191 965.00	0.04
GBP SAGE GROUP GBP0.01051948	3 006.00	50 128.59	0.01
GBP SAINSBURY(J) ORD GBP0.28571428	5 420.00	17 994.31	0.00
GBP SCHROEDERS PLC ORD GBP0.20	4 379.00	17 543.81	0.00
GBP SEVERN TRENT ORD GBP0.9789	787.00	26 978.53	0.01
GBP SHELL PLC ORD EURO.07	20 074.00	645 913.69	0.14
GBP SMITH & NEPHEW ORD USD0.20	5 146.00	65 212.01	0.01
GBP SMITHS GROUP ORD GBP0.375	1 986.00	44 705.45	0.01
GBP SPIRAX GROUP PLC ORD GBP0.269230769	419.00	38 185.27	0.01
GBP SSE PLC ORD GBP0.50	3 330.00	74 980.45	0.02
GBP STANDARD CHARTERED ORD USD0.50	6 947.00	85 862.77	0.02
GBP TAYLOR WIMPEY ORD GBP0.01	23 231.00	38 681.37	0.01
GBP TESCO ORD GBP0.0633333	42 441.00	197 653.13	0.04
GBP UNILEVER PLC ORD GBP0.031111	15 217.00	909 247.10	0.20
GBP UNITED UTILITIES G ORD GBP0.05	2 288.00	32 556.88	0.01
GBP VODAFONE GROUP ORD USD0.2095238(POST CONS)	67 956.00	61 222.93	0.01
GBP WHITBREAD ORD GBP0.76797385	714.00	25 864.60	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注 1)	純資産 比率 (%)
USD WILLIS TOWERS WATS COM USD0.000304635	139.00	44 758.00	0.01
GBP WISE PLC CLS A ORD GBPO.01	2 322.00	26 031.15	0.01
GBP WPP PLC ORD GBPO.10	7 084.00	77 363.39	0.02
イギリス合計		10 643 368.22	2.37
アメリカ合衆国			
USD 3M CO COM	2 347.00	313 394.91	0.07
USD ABBOTT LABS COM	2 351.00	279 228.27	0.06
USD ABBVIE INC COM USD0.01	7 590.00	1 388 438.70	0.31
USD ADOBE INC COM USD0.0001	603.00	311 105.79	0.07
USD ADVANCED MICRO DEV COM USD0.01	2 213.00	303 568.28	0.07
USD AECOM TECHNOLOGY C COM STK USD0.01	172.00	20 118.84	0.00
USD AES CORP COM	1 271.00	16 573.84	0.00
USD AFLAC INC COM USD0.10	2 212.00	252 168.00	0.06
USD AGILENT TECHNOLOGIES INC COM	399.00	55 050.03	0.01
USD AIR PRODS & CHEMS COM USD1	955.00	319 285.15	0.07
USD AIRBNB INC USD0.0001 A	641.00	87 246.51	0.02
USD AKAMAI TECHNOLOGIES INC COM	136.00	12 786.72	0.00
USD ALBEMARLE CORP COM USD0.01	173.00	18 632.10	0.00
USD ALBERTSONS COS INC COM USD0.01 CLASS A	600.00	11 910.00	0.00
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQ INC COM	237.00	26 124.51	0.01
USD ALIGN TECHNOLOGY INC COM	125.00	29 096.25	0.01
USD ALLIANT ENERGY CORP COM	1 121.00	70 847.20	0.02
USD ALLSTATE CORP COM	375.00	77 771.25	0.02
USD ALLY FINANCIAL INC COM USD0.01	1 244.00	49 735.12	0.01
USD ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC COM	165.00	41 756.55	0.01
USD ALPHABET INC CAP STK USD0.001 CL C	6 988.00	1 191 384.12	0.27
USD ALPHABET INC CAP STK USD0.001 CL A	8 122.00	1 372 211.90	0.31
USD ALTRIA GROUP INC COM USD0.333333	7 189.00	415 092.86	0.09
USD AMAZON COM INC COM USD0.01	12 969.00	2 696 125.41	0.60
USD AMER ELEC PWR INC COM USD6.50	2 239.00	223 586.54	0.05
USD AMER EXPRESS CO COM USD0.20	789.00	240 392.52	0.05
USD AMER FINL GP OHIO COM NPV	182.00	26 728.52	0.01
USD AMER INTL GRP COM USD2.50	845.00	64 963.60	0.01
USD AMER TOWER CORP COM NEW USD0.01	668.00	139 612.00	0.03
USD AMEREN CORP COM	1 093.00	103 168.27	0.02
USD AMERICAN HOMES 4 R COM USD0.01	245.00	9 381.05	0.00
USD AMERICAN WATER WOR COM STK USD0.01	334.00	45 737.96	0.01
USD AMERIPRISE FINL INC COM	150.00	86 095.50	0.02
USD AMETEK INC COM USD0.01	281.00	54 620.78	0.01
USD AMGEN INC COM USD0.0001	2 316.00	655 126.92	0.15
USD AMPHENOL CORP NEW CL A	1 552.00	112 752.80	0.03
USD ANALOG DEVICES INC COM	682.00	148 710.10	0.03
USD ANNALY CAPITAL MGT COM USD0.01(POST REV SPLT)	681.00	13 572.33	0.00
USD ANSYS INC COM	140.00	49 154.00	0.01
USD AON PLC COM USD0.01 CL A	277.00	108 456.58	0.02
USD APA CORPORATION COM USD0.625	429.00	9 716.85	0.00
USD APOLLO GLOBAL MANA COM USD0.00001	531.00	92 940.93	0.02
USD APPLE INC COM NPV	20 519.00	4 869 774.27	1.08
USD APPLIED MATLS INC COM	1 116.00	194 976.36	0.04
USD APPLOVIN CORP COM USD0.00003 CL A	279.00	93 953.25	0.02
USD ARCHER DANIELS MIDLAND CO COM	2 048.00	111 820.80	0.02
USD ARES MANAGEMNT COR COM USD0.01 CLASS A	277.00	48 954.21	0.01
USD ARISTA NETWORKS IN COM USD0.0001	367.00	148 935.94	0.03
USD ASPEN TECHNOLOGY COM USD0.10	67.00	16 750.00	0.00
USD ASSURANT INC COM	98.00	22 255.80	0.01
USD AT&T INC COM USD1	10 214.00	236 556.24	0.05

注記は当財務書類と不可分のものである。

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注 1)	純資産 比率 (%)
USD ATLISSIAN CORP COM USD0.1 CL A	187.00	49 289.46	0.01
USD ATMOS ENERGY CORP COM	696.00	105 318.72	0.02
USD AUTO DATA PROCESS COM USD0.10	561.00	172 187.73	0.04
USD AUTODESK INC COM USD0.01	301.00	87 861.90	0.02
USD AUTOZONE INC COM USD0.01	25.00	79 238.50	0.02
USD AVALONBAY COMMUNI COM USD0.01	221.00	52 012.35	0.01
USD AVANTOR INC COM USD0.01	791.00	16 658.46	0.00
USD AVERY DENNISON CORP COM	146.00	30 068.70	0.01
USD AXON ENTERPRISE I COM USD0.00001	88.00	56 932.48	0.01
USD BAKER HUGHES COMPA COM USD0.0001 CL A	1 361.00	59 815.95	0.01
USD BALL CORP COM NPV	475.00	29 526.00	0.01
USD BAXTER INTL INC COM USD1	821.00	27 675.91	0.01
USD BECTON DICKINSON COM USD1	394.00	87 428.60	0.02
USD BENTLEY SYSTEMS IN COM USD0.01 CLASS B	117.00	5 791.50	0.00
USD BERKLEY(WR)CORP COM USD0.20	390.00	25 174.50	0.01
USD BERKSHIRE HATHAWAY CLASS'B'COM USD0.0033	1 814.00	876 198.28	0.20
USD BEST BUY CO INC COM USD0.10	848.00	76 320.00	0.02
USD BIO RAD LABS INC CL A	37.00	12 599.61	0.00
USD BIO-TECHNE CORP COM USD0.01	178.00	13 414.08	0.00
USD BIOGEN INC COM STK USD0.0005	168.00	26 985.84	0.01
USD BIOMARIN PHARMA COM USD0.001	199.00	13 139.97	0.00
USD BK OF AMERICA CORP COM USD0.01	9 598.00	456 000.98	0.10
USD BK OF NY MELLON CP COM STK USD0.01	3 090.00	252 978.30	0.06
USD BLACKROCK INC COM USD0.01	693.00	708 800.40	0.16
USD BLACKSTONE INC COM USD0.00001	3 122.00	596 582.98	0.13
USD BLOCK INC COM USD0.0000001 CL A	740.00	65 527.00	0.01
USD BOEING CO COM USD5	1 011.00	157 149.84	0.04
USD BOOKING HLDGS INC COM USD0.008	49.00	254 897.02	0.06
USD BOOZ ALLEN HAMILTO COM USD0.01 CLASS 'A'	219.00	32 451.42	0.01
USD BOSTON SCIENTIFIC COM USD0.01	2 059.00	186 668.94	0.04
USD BRISTOL-MYRS SQUIB COM STK USD0.10	2 764.00	163 684.08	0.04
USD BROADCOM CORP COM USD1.00	6 130.00	993 550.40	0.22
USD BROADRIDGE FIN SOL COM STK USD0.01	183.00	43 191.66	0.01
USD BROWN & BROWN INC COM	283.00	32 007.30	0.01
USD BROWN FORMAN CORP CL B	147.00	6 185.76	0.00
USD BUILDERS 1ST SRCE COM USD0.01	144.00	26 851.68	0.01
USD BURLINGTON STORES COM USD0.0001	92.00	25 932.96	0.01
USD BXP INC USD0.01	154.00	12 626.46	0.00
USD CADENCE DESIGN SYS COM USD0.01	378.00	115 974.18	0.03
USD CAMDEN PROP TST SBI USD0.01	89.00	11 196.20	0.00
USD CAPITAL ONE FINL COM USD0.01	550.00	105 605.50	0.02
USD CARDINAL HEALTH INC COM	289.00	35 327.36	0.01
USD CARLISLE COS INC COM	75.00	34 252.50	0.01
USD CARLYLE GROUP INC COM USD0.01	217.00	11 550.91	0.00
USD CARMAX INC COM USD0.50	129.00	10 832.13	0.00
USD CARNIVAL CORP COM USD0.01(PAIRE STOCK)	1 482.00	37 687.26	0.01
USD CARRIER GLOBAL COR COM USD0.01	1 035.00	80 077.95	0.02
USD CARVANA CO COM USD0.001 CL A	134.00	34 896.28	0.01
USD CATALENT INC COM USD0.01	273.00	16 683.03	0.00
USD CATERPILLAR INC DEL COM	653.00	265 189.83	0.06
USD CBOE GLOBAL MARKET COM USD0.01	181.00	39 068.85	0.01
USD CBRE GROUP INC CLASS 'A' USD0.01	416.00	58 235.84	0.01
USD CDW CORP COM USD0.01	209.00	36 769.37	0.01
USD CELANESE CORP COM SERIES 'A' USD0.0001	184.00	13 470.64	0.00
USD CENCORA INC RG	234.00	58 862.70	0.01
USD CENTENE CORP DEL COM	669.00	40 140.00	0.01
USD CENTERPOINT ENERGY INC COM	746.00	24 334.52	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD CF INDS HLDGS INC COM	852.00	76 390.32	0.02
USD CH ROBINSON WORLDW COM USD0.1	553.00	58 385.74	0.01
USD CHARLES RIV LABS INTL INC COM	108.00	21 498.48	0.00
USD CHARTER COMMUN INC COM USD0.001 CLASS 'A'	133.00	52 796.35	0.01
USD CHENIERE ENERGY INC COM NEW	338.00	75 715.38	0.02
USD CHEVRON CORP COM USD0.75	7 475.00	1 210 426.75	0.27
USD CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC CL A	1 822.00	112 089.44	0.03
USD CHURCH & DWIGHT INC COM	283.00	31 166.79	0.01
USD CIGNA GROUP/THE USD0.25	388.00	131 066.40	0.03
USD CINCINNATI FINL CORP COM	209.00	33 404.47	0.01
USD CINTAS CORP COM	482.00	108 830.78	0.02
USD CISCO SYSTEMS COM USD0.001	17 192.00	1 017 938.32	0.23
USD CITIGROUP INC COM USD0.01	2 619.00	185 608.53	0.04
USD CITIZENS FINL GP COM USD0.01	487.00	23 444.18	0.01
USD CLOROX CO DEL COM	512.00	85 591.04	0.02
USD CLOUDFLARE INC COM USD0.001 CL A	427.00	42 627.41	0.01
USD CME GROUP INC COM STK USD0.01 CLASS'A'	1 557.00	370 566.00	0.08
USD CMS ENERGY CORP COM	1 341.00	93 481.11	0.02
USD COCA-COLA CO COM USD0.25	17 687.00	1 133 382.96	0.25
USD COGNIZANT TECHNOLO COM CL'A'USD0.01	652.00	52 479.48	0.01
USD COINBASE GLOBAL IN COM USD0.00001 CL A	278.00	82 343.60	0.02
USD COLGATE-PALMOLIVE COM USD1	3 307.00	319 555.41	0.07
USD COMCAST CORP COM CLS'A' USD0.01	16 811.00	726 067.09	0.16
USD CONAGRA BRANDS IN COM USD5	1 797.00	49 507.35	0.01
USD CONOCOPHILLIPS COM USD0.01	5 561.05	602 484.16	0.13
USD CONSOLIDATED EDISON INC COM	1 425.00	143 340.75	0.03
USD CONSTELLATION BRDS CLASS'A'COM USD0.01	240.00	57 828.00	0.01
USD CONSTELLATION ENE. COM NPV	437.00	112 116.72	0.03
USD COOPER COS INC COM USD0.10 (P/S)	274.00	28 622.04	0.01
USD COPART INC COM	1 184.00	75 053.76	0.02
USD COREBRIDGE FIN INC COM USD0.01	400.00	12 948.00	0.00
USD CORNING INC COM USD0.50	3 586.00	174 530.62	0.04
USD CORPAY INC COM USD0.001	100.00	38 118.00	0.01
USD CORTEVA INC COM USD0.01	958.00	59 625.92	0.01
USD COSTAR GROUP INC COM	538.00	43 760.92	0.01
USD COSTCO WHSL CORP NEW COM	608.00	590 903.04	0.13
USD COTERRA ENERGY INC COM USD0.10	3 299.00	88 149.28	0.02
USD CROWDSTRIKE HOLDIN COM USD0.0005 CL A	306.00	105 866.82	0.02
USD CROWN CASTLE INC COM USD0.01	602.00	63 962.50	0.01
USD CROWN HOLDINGS INC COM USD5	223.00	20 536.07	0.00
USD CSX CORP COM USD1	2 604.00	95 176.20	0.02
USD CUMMINS INC COM	611.00	229 149.44	0.05
USD CVS HEALTH CORP COM STK USD0.01	5 411.00	323 848.35	0.07
USD D R HORTON INC COM	421.00	71 056.38	0.02
USD DANAHER CORP COM USD0.01	910.00	218 117.90	0.05
USD DARDEN RESTAURANTS INC COM	529.00	93 246.83	0.02
USD DATADOG INC COM USD0.00001 CL A	413.00	63 085.75	0.01
USD DAVITA INC COM USD0.001	49.00	8 142.33	0.00
USD DAYFORCE INC RG	263.00	21 037.37	0.00
USD DECKERS OUTDOOR CORP COM	240.00	47 030.40	0.01
USD DEERE & CO COM USD1	367.00	170 985.30	0.04
USD DELL TECHNOLOGIES COM USD0.01 CL C	353.00	45 039.27	0.01
USD DELTA AIRLINES INC COM USD0.0001	325.00	20 741.50	0.00
USD DEVON ENERGY CORP NEW COM	2 702.00	102 540.90	0.02
USD DEXCOM INC COM	567.00	44 220.33	0.01
USD DIAMONDBACK ENERGY COM USD0.01	284.00	50 435.56	0.01
USD DICKS SPORTING GOO COM USD0.01	290.00	60 099.60	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注 1)	純資産 比率 (%)
USD DIGITAL REALTY TRU COM STK USD0.01	423.00	82 776.87	0.02
USD DISCOVER FINL SVCS COM STK USD0.01	342.00	62 391.06	0.01
USD DOCUSIGN INC COM USD0.0001	304.00	24 225.76	0.01
USD DOLLAR GENERAL CP COM USD0.875	266.00	20 553.82	0.00
USD DOLLAR TREE INC	311.00	22 164.97	0.00
USD DOMINION ENERGY IN COM STK NPV	1 160.00	68 150.00	0.02
USD DOMINOS PIZZA INC COM USD0.01	60.00	28 571.40	0.01
USD DOORDASH INC COM USD0.00001 CLASS A	386.00	69 665.28	0.02
USD DOVER CORP COM	197.00	40 562.30	0.01
USD DOW INC COM USD0.01	887.00	39 214.27	0.01
USD DRAFTKINGS INC NEW COM USD0.0001 CL A	656.00	28 634.40	0.01
USD DTE ENERGY CO COM	891.00	112 069.98	0.03
USD DUKE ENERGY CORP COM USD0.001 (POST REV SPLT)	3 347.00	391 766.35	0.09
USD DUPONT DE NEMOURS COM USD0.01	599.00	50 070.41	0.01
USD DYNATRACE INC COM USD0.001	400.00	22 476.00	0.01
USD EASTMAN CHEM CO COM	511.00	53 511.92	0.01
USD EBAY INC COM USD0.001	697.00	44 113.13	0.01
USD ECOLAB INC COM	385.00	95 776.45	0.02
USD EDISON INTL COM	1 613.00	141 540.75	0.03
USD EDWARDS LIFESCIENCES CORP COM	875.00	62 431.25	0.01
USD ELECTRONIC ARTS INC COM	340.00	55 647.80	0.01
USD ELEVANCE HEALTH INC USD0.01	324.00	131 855.04	0.03
USD ELI LILLY AND CO COM NPV	1 107.00	880 452.45	0.20
USD EMCOR GROUP INC COM	67.00	34 178.04	0.01
USD EMERSON ELEC CO COM	735.00	97 461.00	0.02
USD ENPHASE ENERGY INC COM USD0.00001	193.00	13 770.55	0.00
USD ENTEGRIS INC COM	210.00	22 182.30	0.00
USD ENTERGY CORP NEW COM	315.00	49 193.55	0.01
USD EOG RESOURCES INC COM USD0.01	774.00	103 143.24	0.02
USD EPAM SYS INC COM USD0.001	93.00	22 684.56	0.01
USD EQT CORPORATION	911.00	41 395.84	0.01
USD EQUIFAX INC COM	171.00	44 726.76	0.01
USD EQUINIX INC COM USD0.001 NEW	136.00	133 481.28	0.03
USD EQUITABLE HOLDINGS COM USD0.01	462.00	22 282.26	0.01
USD EQUITY LIFESTYLE PTYS INC	206.00	14 693.98	0.00
USD ERIE INDTY CO CL A	28.00	12 335.68	0.00
USD ESSENTIAL UTILS IN COM USD0.50	1 084.00	43 392.52	0.01
USD ESSEX PROP TRUST COM USD0.0001	108.00	33 529.68	0.01
USD ESTEE LAUDER COS CLASS'A*COM USD0.01	342.00	24 665.04	0.01
USD EVERGY INC COM NPV	960.00	62 044.80	0.01
USD EVERSOURCE ENERGY COM USD5	568.00	36 630.32	0.01
USD EXACT SCIENCES CORP COM	161.00	9 994.88	0.00
USD EXELON CORP COM NPV	1 329.00	52 575.24	0.01
USD EXPAND ENERGY CORP COM USD0.01	822.00	81 345.12	0.02
USD EXPEDIA GROUP INC COM USD0.001	142.00	26 216.04	0.01
USD EXPEDTRS INTL WASH COM USD0.01	230.00	27 977.20	0.01
USD EXTRA SPACE STORAG COM USD0.01	300.00	51 288.00	0.01
USD EXXON MOBIL CORP COM NPV	19 143.00	2 258 108.28	0.50
USD F5 INC COM STK NPV	88.00	22 030.80	0.00
USD FACTSET RESH SYS INC COM	65.00	31 893.55	0.01
USD FAIR ISAAC CORP COM	37.00	87 876.11	0.02
USD FASTENAL COM USD0.01	2 505.00	209 317.80	0.05
USD FEDEX CORP COM USD0.10	309.00	93 525.03	0.02
USD FERGUSON ENTERPRIS USD0.0001	300.00	64 779.00	0.01
USD FIDELITY NATL FINL FNF GROUP COM USD0.0001	1 111.00	70 426.29	0.02
USD FIDELITY NATL INF COM STK USD0.01	797.00	67 984.10	0.02
USD FIFTH THIRD BANCORP COM	2 802.00	134 664.12	0.03

注記は当財務書類と不可分のものである。

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注 1)	純資産 比率 (%)
USD FIRST CTZNS BANCSHARES INC N C CL A	16.00	36 720.00	0.01
USD FIRST SOLAR INC COM STK USD0.001	126.00	25 108.02	0.01
USD FIRSTENERGY CORP COM USD0.10	830.00	35 316.50	0.01
USD FISERV INC COM USD0.01	789.00	174 337.44	0.04
USD FORD MOTOR CO COM STK USD0.01	5 745.00	63 941.85	0.01
USD FORTINET INC COM USD0.001	913.00	86 780.65	0.02
USD FORTIVE CORP COM USD0.01	478.00	37 919.74	0.01
USD FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC RG	140.00	10 962.00	0.00
USD FOX CORP COM USD0.01 CL A	412.00	19 413.44	0.00
USD FOX CORP COM USD0.01 CL B	94.00	4 204.62	0.00
USD FRANKLIN RES INC COM	1 200.00	27 312.00	0.01
USD FREEPORT-MCMORAN COM STK USD0.10	2 072.00	91 582.40	0.02
USD GALLAGHER ARTHUR J & CO COM	320.00	99 916.80	0.02
USD GAMING & LEISURE P COM USD0.01	293.00	15 121.73	0.00
USD GARTNER INC COM	113.00	58 526.09	0.01
USD GE HEALTHCARE TECH COM USD0.01 WI	608.00	50 597.76	0.01
USD GE VERNOVA LLC COM USD0.01 WI	334.00	111 596.08	0.02
USD GEN DIGITAL INC COM USD0.01	858.00	26 469.30	0.01
USD GEN DYNAMICS CORP COM USD1	345.00	97 983.45	0.02
USD GENERAL ELECTRIC CO RG	1 527.00	278 158.32	0.06
USD GENERAL MLS INC COM	2 399.00	158 957.74	0.04
USD GENERAL MOTORS CO COM USD0.01	1 548.00	86 053.32	0.02
USD GENUINE PARTS CO COM STK USD1	620.00	78 572.60	0.02
USD GILEAD SCIENCES COM USD0.001	1 754.00	162 385.32	0.04
USD GLOBAL PAYMENTS COM NPV	322.00	38 305.12	0.01
USD GODADDY INC COM CL A USD0.001	149.00	29 437.93	0.01
USD GOLDMAN SACHS GRP COM USD0.01	442.00	268 987.94	0.06
USD GRACO INC COM	226.00	20 584.08	0.00
USD GRAINGER W W INC COM	67.00	80 757.78	0.02
USD HALLIBURTON COM STK USD2.50	3 606.00	114 887.16	0.03
USD HARTFORD FINL SVCS COM USD0.01	410.00	50 557.10	0.01
USD HCA HEALTHCARE INC COM USD0.01	278.00	90 967.16	0.02
USD HEALTHPEAK PPTYS I COM USD1	1 013.00	22 275.87	0.01
USD HEICO CORP NEW CL A	132.00	27 869.16	0.01
USD HEICO CORP NEW COM	54.00	14 761.98	0.00
USD HENRY JACK & ASSOC COM USD0.01	124.00	21 846.32	0.00
USD HERSHEY COMPANY COM USD1.00	676.00	119 063.88	0.03
USD HESS CORPORATION COM USD1	387.00	56 958.66	0.01
USD HEWLETT PACKARD EN COM USD0.01	5 341.00	113 336.02	0.03
USD HF SINCLAIR CORPOR COM USD0.01	749.00	30 656.57	0.01
USD HILTON WORLDWIDE H COM USD0.01	326.00	82 621.44	0.02
USD HOLOGIC INC COM USD0.01	303.00	24 088.50	0.01
USD HOME DEPOT INC COM USD0.05	4 263.00	1 829 381.19	0.41
USD HONEYWELL INTL INC COM USD1	885.00	206 143.05	0.05
USD HORMEL FOODS CORP COM USD0.0586	1 256.00	40 732.08	0.01
USD HOST HOTELS & RESO COM STK USD0.01	1 113.00	20 501.46	0.00
USD HOWMET AEROSPACE I COM USD1.00	507.00	60 018.66	0.01
USD HP INC COM USD0.01	4 277.00	151 534.11	0.03
USD HUBBELL INC COM USD0.001	72.00	33 126.48	0.01
USD HUBSPOT INC COM USD0.001	65.00	46 868.25	0.01
USD HUMANA INC COM USD0.166	176.00	52 162.88	0.01
USD HUNT J B TRANS SVCS INC COM	134.00	25 340.74	0.01
USD HUNTINGTON BANCSHARES INC COM	6 163.00	110 995.63	0.02
USD HUNTINGTON INGALLS COM USD0.01	173.00	34 240.16	0.01
USD HYATT HOTELS CORP COM USD0.01 CLASS 'A'	74.00	11 687.56	0.00
USD IDEX CORP COM	156.00	35 978.28	0.01
USD IDEXX LABORATORIES COM USD0.10	121.00	51 031.75	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注 1)	純資産 比率 (%)
USD ILLINOIS TOOL WKS COM NPV	421.00	116 835.92	0.03
USD ILLUMINA INC COM USD0.01	196.00	28 253.40	0.01
USD INCYTE CORPORATION COM USD0.001	228.00	17 006.52	0.00
USD INGERSOLL RAND INC COM USD1.00	538.00	56 043.46	0.01
USD INSULET CORP COM STK USD0.001	93.00	24 810.54	0.01
USD INTEL CORP COM USD0.001	5 988.00	144 011.40	0.03
USD INTERCONTINENTAL E COM USD0.01	816.00	131 343.36	0.03
USD INTERNATIONAL FLAVORS&FRAGRANC COM	333.00	30 422.88	0.01
USD INTERPUBLIC GROUP COM USD0.10	1 459.00	44 951.79	0.01
USD INTL BUSINESS MCHN COM USD0.20	3 950.00	898 269.50	0.20
USD INTL PAPER CO COM USD1.00	333.00	19 590.39	0.00
USD INTUIT INC COM USD0.01	375.00	240 648.75	0.05
USD INTUITIVE SURGICAL COM USD0.001	487.00	263 954.00	0.06
USD INVITATION HOMES I COM USD0.01	867.00	29 694.75	0.01
USD IQVIA HOLDINGS INC COM USD0.01	258.00	51 816.72	0.01
USD IRON MTN INC NEW COM NPV	387.00	47 860.29	0.01
USD JABIL INC COM USD0.001	183.00	24 856.89	0.01
USD JACOBS SOLUTIONS COM USD1.00	163.00	23 020.49	0.01
USD JOHNSON & JOHNSON COM USD1	10 388.00	1 610 243.88	0.36
USD JOHNSON CTLS INTL COM USD0.01	2 883.00	241 768.38	0.05
USD JP MORGAN CHASE & COM USD1	3 931.00	981 649.32	0.22
USD JUNIPER NETWORKS COM USD0.00001	1 262.00	45 331.04	0.01
USD KELLANOVA COM USD0.25	1 113.00	90 475.77	0.02
USD KENVUE INC COM USD0.01	8 300.00	199 864.00	0.04
USD KEURIG DR PEPPER COM USD0.01	4 848.00	158 287.20	0.04
USD KEYCORP NEW COM	1 524.00	29 687.52	0.01
USD KEYSIGHT TECHNOLOG COM USD0.01 'WD'	222.00	37 926.48	0.01
USD KIMBERLY-CLARK CP COM USD1.25	1 449.00	201 918.15	0.05
USD KIMCO REALTY COM USD0.01	749.00	19 151.93	0.00
USD KINDER MORGAN INC USD0.01	8 646.00	244 422.42	0.05
USD KKR & CO INC COM NPV CLASS A	847.00	137 950.89	0.03
USD KLA CORPORATION COM USD0.001	201.00	130 053.03	0.03
USD KNIGHT SWIFT TRANS CL A COM STK USD0.01	157.00	9 319.52	0.00
USD KRAFT HEINZ CO COM USD0.01	3 730.00	119 248.10	0.03
USD KROGER CO COM USD1	2 829.00	172 795.32	0.04
USD L3HARRIS TECHNOLOG COM USD1.00	267.00	65 748.75	0.01
USD LABCORP HOLDINGS I COM USD0.1	149.00	35 932.84	0.01
USD LAM RESEARCH CORP COM USD0.001 (P/S)	1 990.00	147 021.20	0.03
USD LAMB WESTON HLDGS COM USD1.00 WI	145.00	11 199.80	0.00
USD LAS VEGAS SANDS CORP COM	382.00	20 268.92	0.00
USD LEIDOS HLDGS INC COM USD0.0001	162.00	26 794.80	0.01
USD LENNAR CORP COM CL'A'USD0.10	332.00	57 897.48	0.01
USD LENNOX INTL INC COM	60.00	40 027.80	0.01
USD LIBERTY MEDIA CORP COM USD0.01 FORMULA ONE C	334.00	29 512.24	0.01
USD LINDE PLC COM EURO.001	676.00	311 629.24	0.07
USD LIVE NATION INC COM	175.00	24 193.75	0.01
USD LKQ CORP COM	1 059.00	41 608.11	0.01
USD LOCKHEED MARTIN CORP COM	936.00	495 527.76	0.11
USD LOEWS CORP COM	198.00	17 172.54	0.00
USD LOWE'S COS INC COM USD0.50	774.00	210 860.82	0.05
USD LPL FINL HLDGS INC COM USD0.001	84.00	27 312.60	0.01
USD LULULEMON ATHLETIC COM STK USD0.01	153.00	49 060.98	0.01
USD LYONDELLBASELL IND COM USD0.01	1 197.00	99 757.98	0.02
USD M & T BANK CORP COM USD0.50	734.00	161 472.66	0.04
USD MANHATTAN ASSOCIAT COM STK USD0.01	68.00	19 409.92	0.00
USD MARATHON PETROLEUM COM USD0.01	449.00	70 111.35	0.02
USD MARKEL GROUP INC COM NPV	19.00	33 875.48	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注 1)	純資産 比率 (%)
USD MARKETAXESS HLDGS INC COM	46.00	11 899.74	0.00
USD MARRIOTT INTL INC COM USD0.01 CLASS 'A'	331.00	95 688.79	0.02
USD MARSH & MCLENNAN COM USD1	669.00	156 030.87	0.03
USD MARTIN MARIETTA M. COM USD0.01	93.00	55 800.00	0.01
USD MARVELL TECHNOLOGY COM USD0.002	1 254.00	116 233.26	0.03
USD MASCO CORP COM	233.00	18 770.48	0.00
USD MASTERCARD INC COM USD0.0001 CLASS 'A'	1 135.00	604 886.90	0.13
USD MATCH GRP INC NEW COM NPV	202.00	6 613.48	0.00
USD MCCORMICK & CO INC COM N/VTG NPV	337.00	26 424.17	0.01
USD MCDONALD'S CORP COM USD0.01	3 089.00	914 374.89	0.20
USD MCKESSON CORP COM USD0.01	186.00	116 901.00	0.03
USD MERCK & CO INC COM USD0.50	10 930.00	1 110 925.20	0.25
USD META PLATFORMS INC	3 032.00	1 741 338.24	0.39
USD METLIFE INC COM USD0.01	2 480.00	218 810.40	0.05
USD METTLER TOLEDO INTERNATIONAL COM	35.00	43 792.00	0.01
USD MGM RESORTS INTL COM STK USD0.01	316.00	12 115.44	0.00
USD MICROCHIP TECHNLY COM USD0.001	2 242.00	152 837.14	0.03
USD MICRON TECHNOLOGY COM USD0.10	1 517.00	148 590.15	0.03
USD MICROSOFT CORP COM USD0.0000125	9 779.00	4 141 015.34	0.92
USD MICROSTRATEGY COM CL'A' USD0.001	200.00	77 494.00	0.02
USD MID-AMER APARTMENT COM STK USD0.01	201.00	32 996.16	0.01
USD MODERNA INC COM USD0.0001	399.00	17 180.94	0.00
USD MOLINA HEALTHCARE INC COM	78.00	23 236.20	0.01
USD MOLSON COORS BEVER COM USD0.01 CLASS B	839.00	52 068.34	0.01
USD MONDELEZ INTL INC COM USD0.01	5 672.00	368 396.40	0.08
USD MONGODB INC COM USD0.001 CL A	120.00	38 698.80	0.01
USD MONOLITHIC PWR SYS INC COM	68.00	38 599.52	0.01
USD MONSTER BEV CORP USD0.005(NEW)	1 047.00	57 721.11	0.01
USD MOODYS CORP COM USD0.01	229.00	114 495.42	0.03
USD MORGAN STANLEY COM STK USD0.01	1 636.00	215 313.96	0.05
USD MOSAIC CO COM USD0.01	1 105.00	29 238.30	0.01
USD MOTOROLA SOLUTIONS COM USD0.01	252.00	125 924.40	0.03
USD MSCI INC COM STK USS0.01	116.00	70 717.08	0.02
USD NASDAQ INC COM STK USD0.01	514.00	42 656.86	0.01
USD NETAPP INC COM USD0.001	277.00	33 971.28	0.01
USD NETFLIX INC COM USD0.001	592.00	524 991.52	0.12
USD NEUROCRINE BIOSCIENCES INC COM	148.00	18 759.00	0.00
AUD NEWMONT CORPORATIO CDI 1:1	1 521.00	64 494.78	0.01
USD NEWS CORP NEW COM USD0.01 CL'A'	628.00	18 431.80	0.00
USD NEXTERA ENERGY INC COM USD0.01	8 822.00	694 026.74	0.15
USD NIKE INC CLASS'B'COM NPV	1 678.00	132 176.06	0.03
USD NISOURCE INC COM NPV	613.00	23 349.17	0.01
USD NORDSON CORP COM	112.00	29 230.88	0.01
USD NORFOLK STHN CORP COM USD1	1 001.00	276 125.85	0.06
USD NORTHERN TRUST CP COM USD1.666	944.00	104 935.04	0.02
USD NORTHROP GRUMMAN COM USD1	194.00	94 992.10	0.02
USD NRG ENERGY INC COM USD0.01	242.00	24 589.62	0.01
USD NUCOR CORP COM	288.00	44 550.72	0.01
USD NVIDIA CORP COM USD0.001	33 922.00	4 689 716.50	1.04
USD NVR INC COM STK USD0.01	5.00	46 177.90	0.01
USD OCCIDENTAL PETRLM COM USD0.20	894.00	45 218.52	0.01
USD OKTA INC COM USD0.0001 CL A	254.00	19 700.24	0.00
USD OLD DOMINION FGHT LINES INC COM	268.00	60 337.52	0.01
USD OMNICOM GROUP INC COM USD0.15	817.00	85 637.94	0.02
USD ON SEMICONDUCTOR COM USD0.01	554.00	39 400.48	0.01
USD ONEOK INC	2 510.00	285 136.00	0.06
USD ORACLE CORP COM USD0.01	2 261.00	417 923.24	0.09

注記は当財務書類と不可分のものである。

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注 1)	純資産 比率 (%)
USD OREILLY AUTO NEW COM USD0.01	83.00	103 187.26	0.02
USD OTIS WORLDWIDE COR COM USD0.01	558.00	57 462.84	0.01
USD OVINTIV INC COM USD0.01	388.00	17 622.96	0.00
USD OWENS CORNING COM STK USD0.01	160.00	32 899.20	0.01
USD PACCAR INC COM STK USD1	2 236.00	261 612.00	0.06
USD PACKAGING CORP AMER COM	378.00	94 065.30	0.02
USD PALANTIR TECH INC COM USD0.001 CLASS A	2 780.00	186 482.40	0.04
USD PALO ALTO NETWORKS COM USD0.0001	449.00	174 131.18	0.04
USD PARKER-HANNIFIN COM STK USD0.50	178.00	125 116.20	0.03
USD PAYCHEX INC COM	1 380.00	201 852.60	0.05
USD PAYCOM SOFTWARE IN COM USD0.01	64.00	14 842.88	0.00
USD PAYPAL HOLDINGS IN COM USD0.0001	1 369.00	118 788.13	0.03
USD PEPSICO INC CAP USD0.016666	5 938.00	970 566.10	0.22
USD PFIZER INC COM USD0.05	24 536.00	643 088.56	0.14
USD PG&E CORP COM	2 740.00	59 266.20	0.01
USD PHILIP MORRIS INTL COM STK NPV 'WI'	6 705.00	892 167.30	0.20
USD PHILLIPS 66 COM USD0.01	1 824.00	244 379.52	0.05
USD PINTEREST INC COM USD0.00001 CL A	950.00	28 804.00	0.01
USD PNC FINANCIAL SVCS COM USD5	1 716.00	368 459.52	0.08
USD POOL CORPORATION COM USD0.001	69.00	26 019.21	0.01
USD PPG INDS INC COM	296.00	36 813.52	0.01
USD PPL CORP COM USD0.01	986.00	34 440.98	0.01
USD PRINCIPAL FINL GP COM USD0.01	995.00	86 654.55	0.02
USD PROCTER & GAMBLE COM NPV	10 182.00	1 825 225.32	0.41
USD PROGRESSIVE CP(OH) COM USD1	819.00	220 212.72	0.05
USD PROLOGIS INC COM USD0.01	1 268.00	148 077.04	0.03
USD PRUDENTIAL FINL COM USD0.01	479.00	61 987.39	0.01
USD PTC INC COM USD0.01	200.00	40 012.00	0.01
USD PUBLIC STORAGE COM USD0.10	224.00	77 963.20	0.02
USD PUBLIC SVC ENTERPRISE GROUP COM	2 103.00	198 312.90	0.04
USD PULTE GROUP INC COM USD0.01	240.00	32 464.80	0.01
USD PURE STORAGE INC COM USD0.0001 CL A	502.00	26 600.98	0.01
USD QORVO INC COM USD 0.0001	199.00	13 740.95	0.00
USD QUALCOMM INC COM USD0.0001	1 516.00	240 331.48	0.05
USD QUANTA SVCS INC COM	204.00	70 282.08	0.02
USD QUEST DIAGNOSTICS INC COM	205.00	33 345.30	0.01
USD RAYMOND JAMES FINANCIAL INC COM	301.00	50 953.28	0.01
USD REALTY INCOME CORP	1 294.00	74 909.66	0.02
USD REGENCY CENTERS COM USD0.01	258.00	19 502.22	0.00
USD REGENERON PHARMACE COM USD0.001	159.00	119 284.98	0.03
USD REGIONS FINANCIAL CORP NEW COM	3 970.00	108 222.20	0.02
USD RELIANCE INC RG	90.00	28 911.60	0.01
USD REPUBLIC SERVICES COM USD0.01	307.00	67 018.10	0.01
USD RESMED INC COM USD0.004	205.00	51 049.10	0.01
USD REVVITY INC COM USD1.00	157.00	18 233.98	0.00
USD RIVIAN AUTOMOTIVE COM USD0.001 CL A	1 178.00	14 406.94	0.00
USD ROBINHOOD MARKETS COM USD0.0001 CL A	900.00	33 786.00	0.01
USD ROBLOX CORPORATION COM USD0.0001 CL A	697.00	34 940.61	0.01
USD ROCKWELL AUTOMATIO COM USD1	190.00	56 076.60	0.01
USD ROKU INC COM USD0.0001 CLASS A	222.00	15 324.66	0.00
USD ROLLINS INC COM	455.00	22 900.15	0.01
USD ROPER TECHNOLOGIES COM USD0.01	164.00	92 896.16	0.02
USD ROSS STORES INC COM USD0.01	478.00	74 027.86	0.02
USD ROYAL CARIBBEAN GR COM USD0.01	381.00	92 986.86	0.02
USD ROYALTY PHARMA PLC COM USD0.0001 CLASS A	1 499.00	39 963.34	0.01
USD RPM INTERNATIONAL COM USD0.01	143.00	19 845.54	0.00
USD RTX CORPORATION COM USD1.00	1 835.00	223 558.05	0.05

注記は当財務書類と不可分のものである。

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注 1)	純資産 比率 (%)
USD S&P GLOBAL INC COM USD1	441.00	230 426.91	0.05
USD SALESFORCE, INC.	1 322.00	436 246.78	0.10
USD SAMSARA INC COM USD0.0001 CL A	316.00	16 902.84	0.00
USD SBA COMMUNICATIONS COM USD0.01 CL A	140.00	31 675.00	0.01
USD SCHEIN HENRY INC COM	185.00	14 254.25	0.00
USD SCHLUMBERGER COM USD0.01	2 122.00	93 240.68	0.02
USD SCHWAB(CHARLES)CP COM USD0.01	2 030.00	168 002.80	0.04
USD SEAGATE TECHNOLOGY COM USD0.00001	313.00	31 716.29	0.01
USD SEI INVESTMENT COM USD0.01	129.00	10 659.27	0.00
USD SEMPRA COM NPV	2 754.00	257 967.18	0.06
USD SERVICENOW INC COM USD0.001	281.00	294 892.64	0.07
USD SHERWIN-WILLIAMS COM USD1	338.00	134 321.20	0.03
USD SIMON PROP GROUP COM USD0.0001	451.00	82 803.60	0.02
USD SKYWORKS SOLUTIONS INC COM	716.00	62 714.44	0.01
USD SMITH A O COM	124.00	9 236.76	0.00
USD SMUCKER(JM)CO COM NPV	516.00	60 779.64	0.01
USD SNAP INC COM USD0.00001 CL A	1 245.00	14 703.45	0.00
USD SNAP-ON INC COM USD1	259.00	95 749.71	0.02
USD SNOWFLAKE INC COM USD0.0001 CLASS A	463.00	80 932.40	0.02
USD SOLVENTUM CORP COM USD0.01 WI	203.00	14 516.53	0.00
USD SOUTHERN CO COM	1 523.00	135 744.99	0.03
USD SOUTHWEST AIRLINES COM USD1	33.00	1 067.88	0.00
USD SS&C TECH HLDGS COM USD0.01	311.00	24 052.74	0.01
USD STANLEY BLACK & DE COM USD2.50	242.00	21 646.90	0.00
USD STARBUCKS CORP COM USD0.001	4 862.00	498 160.52	0.11
USD STATE STREET CORP COM STK USD1	1 219.00	120 083.69	0.03
USD STEEL DYNAMICS INC COM	179.00	26 003.33	0.01
USD STRYKER CORP COM USD0.10	476.00	186 663.40	0.04
USD SUN COMMUNITIES COM USD0.01	162.00	20 465.46	0.00
USD SUPER MICRO COMPUT COM USD0.001 (POST REV SPT)	780.00	25 459.20	0.01
USD SYNCHRONY FINANCIA COM USD0.001	514.00	34 705.28	0.01
USD SYNOPSYS INC COM USD0.01	215.00	120 075.35	0.03
USD SYSCO CORP COM USD1	2 042.00	157 458.62	0.04
USD T ROWE PRICE GROUP COM USD0.20	936.00	115 914.24	0.03
USD T-MOBILE US INC COM USD0.0001	737.00	181 994.78	0.04
USD TAKE TWO INTERACTI COM USD0.01	261.00	49 167.18	0.01
USD TARGA RESOURCES CO COM USD0.001	292.00	59 655.60	0.01
USD TARGET CORP COM STK USD0.0833	1 982.00	262 238.42	0.06
USD TELEDYNE TECHNOLOGIES INC COM	81.00	39 306.06	0.01
USD TELEFLEX INC COM	105.00	20 249.25	0.00
USD TERADYNE INC COM USD0.125	209.00	22 990.00	0.01
USD TESLA INC COM USD0.001	3 974.00	1 371 665.84	0.31
USD TEXAS INSTRUMENTS COM USD1	3 918.00	787 635.54	0.18
USD TEXAS PACIFIC LD COM USD0.01	30.00	48 002.70	0.01
USD TEXTRON INC COM STK USD0.125	247.00	21 150.61	0.00
USD THE CAMPBELLS COM CAP USD0.0375	790.00	36 498.00	0.01
USD THE TRADE DESK INC COM USD0.000001 CL A	629.00	80 857.95	0.02
USD THERMO FISHER SCIE COM USD1	525.00	278 055.75	0.06
USD TJX COS INC COM USD1	1 545.00	194 191.05	0.04
USD TOAST INC COM USD0.000001 CLASS A	600.00	26 124.00	0.01
USD TORO CO COM	137.00	11 929.96	0.00
USD TRACTOR SUPPLY CO COM USD0.008	143.00	40 564.81	0.01
USD TRADEWEB MARKETS I COM USD0.00001 CL A	211.00	28 590.50	0.01
USD TRANSDIGM GROUP INC COM	81.00	101 490.57	0.02
USD TRANSUNION COM USD0.01	277.00	28 115.50	0.01
USD TRAVELERS CO INC COM NPV	333.00	88 591.32	0.02
USD TRIMBLE INC COM NPV	304.00	22 182.88	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注 1)	純資産 比率 (%)
USD TRUIST FINL CORP COM USD5	1 899.00	90 544.32	0.02
USD TWILIO INC COM USD0.001 CL A	271.00	28 330.34	0.01
USD TYLER TECHNOLOGIES INC COM	64.00	40 266.88	0.01
USD TYSON FOODS INC CL A	329.00	21 220.50	0.00
USD UBER TECHNOLOGIES COM USD0.00001	2 615.00	188 175.40	0.04
USD UDR INC	449.00	20 591.14	0.00
USD ULTA BEAUTY INC COM STK USD0.01	56.00	21 651.84	0.00
USD UNION PACIFIC CORP COM USD2.50	2 596.00	635 137.36	0.14
USD UNITED PARCEL SERVICE INC CL B	3 119.00	423 310.68	0.09
USD UNITED RENTALS INC COM	99.00	85 734.00	0.02
USD UNITEDHEALTH GRP COM USD0.01	1 275.00	778 005.00	0.17
USD UNIVERSAL HEALTH S CLASS'B'COM USD0.01	106.00	21 730.00	0.00
USD US BANCORP COM USD0.01	6 636.00	353 632.44	0.08
USD UTD THERAPEUTIC COM USD0.01	66.00	24 452.34	0.01
USD VALERO ENERGY CORP NEW COM	429.00	59 665.32	0.01
USD VEEVA SYSTEMS INC COM USD0.00001 CL 'A'	233.00	53 089.05	0.01
USD VERALTO CORPORATIO COM USD0.01 WI	351.00	37 974.69	0.01
USD VERISIGN INC COM	143.00	26 766.74	0.01
USD VERISK ANALYTICS I CL A USD0.001	202.00	59 430.42	0.01
USD VERIZON COMMUN COM USD0.10	18 034.00	799 627.56	0.18
USD VERTEX PHARMACEUTI COM USD0.01	358.00	167 590.54	0.04
USD VERTIV HOLDINGS CO COM USD0.0001	497.00	63 417.20	0.01
USD VIATRIS INC COM USD0.01	1 574.00	20 603.66	0.00
USD VICI PPTYS INC COM USD0.01	1 494.00	48 719.34	0.01
USD VISA INC COM STK USD0.0001	2 185.00	688 449.80	0.15
USD VISTRA CORP COM USD0.01	479.00	76 563.36	0.02
USD VULCAN MATERIALS COM STK USD1	211.00	60 795.43	0.01
USD WABTEC CORP COM USD0.01	230.00	46 142.60	0.01
USD WALGREENS BOOTS AL COM USD0.01	1 167.00	10 526.34	0.00
USD WALMART INC COM USD0.10	6 030.00	557 775.00	0.12
USD WALT DISNEY CO/THE	2 571.00	302 015.37	0.07
USD WARNER BROS DISCOV COM USD0.01 SER A WI	3 749.00	39 289.52	0.01
USD WASTE CONNECTIONS COM NPV (POST REV SPLT)	364.00	70 059.08	0.02
USD WASTE MGMT INC DEL COM	571.00	130 313.62	0.03
USD WATERS CORP COM	113.00	43 473.36	0.01
USD WATSCO INC COM	133.00	73 362.80	0.02
USD WEC ENERGY GROUP COM USD0.01	1 389.00	140 358.45	0.03
USD WELLS FARGO & CO COM USD1 2/3	4 887.00	372 242.79	0.08
USD WELLTOWER INC COM USD1	834.00	115 242.12	0.03
USD WEST PHARMACEUTICA COM USD0.25	127.00	41 361.36	0.01
USD WESTERN DIGITAL CORP COM	520.00	37 954.80	0.01
USD WEYERHAEUSER CO COM USD1.25	1 037.00	33 453.62	0.01
USD WILLIAMS COS INC COM USD1	1 740.00	101 824.80	0.02
USD WILLIAMS-SONOMA IN COM USD0.01	176.00	30 275.52	0.01
USD WORKDAY INC COM USD0.001 CL A	297.00	74 247.03	0.02
USD WP CAREY INC COM USD0.001	368.00	20 998.08	0.00
USD WYNN RESORTS LTD COM	165.00	15 572.70	0.00
USD XCEL ENERGY INC COM	2 349.00	170 443.44	0.04
USD XYLEM INC COM USD0.01 WI	315.00	39 926.25	0.01
USD YUM BRANDS INC COM	383.00	53 214.02	0.01
USD ZEBRA TECHNOLOGIES CORP CL A	89.00	36 223.00	0.01
USD ZILLOW GROUP INC COM USD0.0001 CLASS C WI	254.00	21 516.34	0.00
USD ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC COM USD0.01	336.00	37 665.60	0.01
USD ZOETIS INC COM USD0.01 CL 'A'	657.00	115 139.25	0.03
USD ZOOM COMMUNICATIONS INC USD0.001 CL A	352.00	29 106.88	0.01
USD ZSCALER INC COM USD0.001	145.00	29 955.55	0.01
アメリカ合衆国合計		98 132 709.57	21.86

注記は当財務書類と不可分のものである。

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注 1)	純資産 比率 (%)
ウルグアイ			
USD MERCADOLIBRE INC COM STK USD0.001	65.00	129 036.05	0.03
ウルグアイ合計		129 036.05	0.03
株式合計		158 006 351.31	35.20

投資信託、クローズド・エンド型

イギリス			
GBP SEGRO PLC REIT	4 049.00	40 142.56	0.01
イギリス合計		40 142.56	0.01

アメリカ合衆国			
USD EQUITY RESIDENTIAL SBI USD0.01	398.00	30 510.68	0.01
USD VENTAS INC REIT	462.00	29 600.34	0.00
アメリカ合衆国合計		60 111.02	0.01
投資信託、クローズド・エンド型合計		100 253.58	0.02

財務省証券 (T-note)、ゼロ・クーポン

米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 5.37500% 01-15.02.31	3 750 000.00	4 013 671.88	0.89
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.87500% 23-15.08.33	2 250 000.00	2 199 111.32	0.49
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.62500% 23-30.09.30	2 250 000.00	2 307 919.93	0.52
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.00000% 24-15.02.34	2 250 000.00	2 216 074.23	0.49
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.12500% 22-15.11.32	2 700 000.00	2 696 203.13	0.60
米ドル合計		13 432 980.49	2.99
財務省証券 (T-note)、ゼロ・クーポン合計		13 432 980.49	2.99
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある証券および短期金融商品合計		171 539 585.38	38.21

他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券および短期金融商品

財務省証券 (T-bill)、ゼロ・クーポン

米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 22.02.24-20.02.25	4 500 000.00	4 456 077.48	0.99
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 21.03.24-20.03.25	4 500 000.00	4 441 440.38	0.99
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 18.04.24-17.04.25	4 500 000.00	4 426 678.98	0.99
USD UNITED STATES TB 0.00000% 20.06.24-19.12.24	4 770 000.00	4 759 748.89	1.06
USD UNITED STATES TB 0.00000% 18.07.24-16.01.25	4 670 000.00	4 643 811.53	1.03
米ドル合計		22 727 757.26	5.06
財務省証券 (T-bill)、ゼロ・クーポン合計		22 727 757.26	5.06
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券および短期金融商品合計		22 727 757.26	5.06

他の譲渡性のある証券

新株引受権

アメリカ合衆国			
USD ABIOMED INC RIGHTS 22-PRP	127.00	222.25	0.00
アメリカ合衆国合計		222.25	0.00
新株引受権合計		222.25	0.00
他の譲渡性のある証券合計		222.25	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
ルクセンブルグ2010年12月17日法(改訂済)の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs			
投資信託、オープン・エンド型			
アイルランド			
USD NEUBERGER BERMAN STRATEGIC INCOME FUND/IRELAND-SHS-I-USD	2 661 250.00	26 798 787.50	5.97
アイルランド合計		26 798 787.50	5.97
ルクセンブルグ			
USD UBS (LUX) BD SICAV - SHT DURAT H Y SUS (USD) U-X-DIST	3 763.00	37 980 335.30	8.46
USD UBS (LUX) BD SICAV-ASIAN INVEST GR BDS SUST (USD) U-X-DIST	678.00	6 822 198.72	1.52
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD-U-X DIST	2 657.00	26 876 033.26	5.99
USD UBS (LUX) BOND SICAV - ASIAN HIGH YIELD (USD) I-X-DIST	32 261.00	1 851 136.18	0.41
USD UBS (LUX) BOND SICAV - EMERGING ECONOMIES CORP (USD)-I-X-DIS	162 004.00	15 529 703.44	3.46
USD UBS (LUX) BOND SICAV - FLOATING RATE INCOME (USD) I-X-MDIST	215 116.00	22 062 296.96	4.92
USD UBS (LUX) EMERGING ECONOMIES FUND-GLOBAL BONDS (USD) I-X-DIS	248 512.00	15 544 425.60	3.46
USD UBS (LUX) INST SICAV - EMG MKTS EQTY PASS (USD) U-X-ACC	1 575.71	23 538 904.68	5.24
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD U-X-ACC	738.00	9 334 652.04	2.08
EUR UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - EUR U-X-ACC	386.00	4 413 580.58	0.98
USD UBS (LUX) SICAV 1-MEDIUM TERM USD CORPORATE (USD) U-X-DIST	880.00	8 837 285.60	1.97
USD UBS (LUX) SICAV-USD INVES GRA CORPOR SUSTAI (USD) U-X-DIST	3 763.00	37 852 280.41	8.43
ルクセンブルグ合計		210 642 832.77	46.92
シンガポール			
USD ISHARES USD ASIA HIGH YIELD BOND INDEX ETF- SHS EXCHANGE TRD	1 411 673.00	9 514 676.02	2.12
シンガポール合計		9 514 676.02	2.12
投資信託、オープン・エンド型合計		246 956 296.29	55.01
ルクセンブルグ2010年12月17日法(改訂済)の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs合計		246 956 296.29	55.01
公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引されていない派生商品			
指数に係るオプション、従来型			
豪ドル			
AUD TDB/S&P/ASX 200 INDEX CALL 8428.56170 11.12.24	-720.00	-33 604.31	-0.01
AUD UBS/S&P/ASX 200 INDEX CALL 8661.29060 08.01.25	-740.00	-17 532.85	0.00
豪ドル合計		-51 137.16	-0.01
ユーロ			
EUR TDB/EURO STOXX 50 PUT 4704.61740 04.12.24	-180.00	-1 118.21	0.00
EUR RBC/EURO STOXX 50 CALL 4901.51160 11.12.24	-1 150.00	-15 620.08	-0.01
EUR UBS/EURO STOXX 50 PUT 4645.53320 11.12.24	-180.00	-1 805.46	0.00
EUR GS/EURO STOXX 50 PUT 4635.11580 18.12.24	-180.00	-3 297.88	0.00
EUR TDB/EURO STOXX 50 CALL 4898.81030 08.01.25	-1 190.00	-54 657.95	-0.01
EUR TDB/EURO STOXX 50 PUT 4638.48700 08.01.25	-180.00	-6 023.57	0.00
ユーロ合計		-82 523.15	-0.02
英ポンド			
GBP GS/FTSE 100 INDEX CALL 8239.11860 11.12.24	-360.00	-43 558.63	-0.01
GBP RBC/FTSE 100 INDEX CALL 8514.71780 08.01.25	-380.00	-14 737.80	0.00
英ポンド合計		-58 296.43	-0.01
日本円			
JPY UBS/TOPIX INDEX (TOKYO) CALL 2833.55160 11.12.24	-307 020.00	-2 778.64	0.00
JPY MORGAN STANLEY/TOPIX INDEX (TOKYO) CALL 2778.17570 08.01.25	-310 660.00	-47 828.15	-0.01
日本円合計		-50 606.79	-0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注 1)	純資産 比率 (%)
米ドル			
USD GS/S&P 500 INDEX CALL 6089.12410 04.12.24	-2 660.00	-6 293.32	0.00
USD HSBC/S&P 500 INDEX PUT 5810.45920 04.12.24	-360.00	-107.26	0.00
USD GS/S&P 500 INDEX CALL 6146.98530 11.12.24	-2 940.00	-15 999.60	-0.01
USD GS/S&P 500 INDEX PUT 5865.67240 11.12.24	-360.00	-2 440.26	0.00
USD MORGAN STANLEY/MSCI EMERGING MARKE CALL 1141.21960 11.12.24	-10 910.00	-1 779.64	0.00
USD GS/S&P 500 INDEX CALL 6097.58190 18.12.24	-2 970.00	-86 595.79	-0.02
USD GS/S&P 500 INDEX PUT 5798.76780 18.12.24	-360.00	-3 824.83	0.00
USD MORGAN STANLEY/MSCI EMERGING MARKE CALL 1127.27840 08.01.25	-10 570.00	-40 649.26	-0.01
USD TDB/S&P 500 INDEX CALL 6172.70350 08.01.25	-3 330.00	-102 427.50	-0.02
USD UBS/S&P 500 INDEX PUT 5878.76520 08.01.25	-360.00	-12 228.97	0.00
米ドル合計		-272 346.43	-0.06
指数に係るオプション、従来型合計		-514 909.96	-0.11
公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引され ていない派生商品合計		-514 909.96	-0.11
投資有価証券合計		440 708 951.22	98.17

派生商品

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

指数に係るスワップおよび先渡しスワップ

USD UBS/FTSE EEPRA NAREIT DVLDP TR EQS REC PERF 24-25.11.25	16 461 751.50	392 958.45	0.09
USD UBS/FTSE EEPRA NAREIT DVLDP TR EQS PAYER 3ML 24-25.11.25			
指数に係るスワップおよび先渡しスワップ合計		392 958.45	0.09
公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引され ていない派生商品合計		392 958.45	0.09
派生商品合計		392 958.45	0.09

注記は当財務書類と不可分のものである。

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 （注１）	純資産 比率 （％）		
先渡為替契約					
購入通貨 / 購入額 / 売却通貨 / 売却額 / 満期日（日-月-年）					
USD	1 148 554.72	SEK 12 250 000.00	19.12.2024	25 387.80	0.01
USD	273 558.22	NOK 3 000 000.00	19.12.2024	2 166.30	0.00
USD	12 276 202.81	AUD 18 544 561.22	19.12.2024	193 339.28	0.04
USD	2 520 431.46	SGD 3 315 000.00	19.12.2024	45 702.78	0.01
USD	106 731.96	ILS 400 000.00	19.12.2024	-3 328.57	0.00
USD	263 414.80	DKK 1 800 000.00	19.12.2024	8 237.45	0.00
USD	1 893 754.31	HKD 14 707 627.54	19.12.2024	3 260.58	0.00
USD	12 818 450.88	GBP 9 873 496.81	19.12.2024	268 928.64	0.06
USD	2 729 951.94	CAD 3 784 991.00	19.12.2024	24 825.44	0.01
USD	7 692 754.04	JPY 1 164 464 411.00	19.12.2024	-81 522.42	-0.02
USD	25 586 977.98	EUR 23 451 980.07	19.12.2024	797 275.90	0.18
USD	3 899 763.62	CHF 3 349 000.00	19.12.2024	90 137.03	0.02
USD	234 041.34	NZD 390 000.00	19.12.2024	3 276.13	0.00
SGD	70 499 800.00	USD 52 798 832.88	13.1.2025	-113 954.60	-0.03
USD	216 403.25	SGD 289 200.00	13.1.2025	282.54	0.00
USD	398 289.02	EUR 380 000.00	19.12.2024	-3 386.52	0.00
USD	714 656.88	GBP 570 000.00	19.12.2024	-9 830.89	0.00
USD	246 026.26	SGD 330 900.00	13.1.2025	-1 257.08	0.00
AUD	900 000.00	USD 583 933.23	19.12.2024	2 469.28	0.00
JPY	45 000 000.00	USD 297 812.67	19.12.2024	2 619.39	0.00
USD	879 579.00	AUD 1 350 000.00	19.12.2024	-24.76	0.00
EUR	660 000.00	USD 697 538.82	19.12.2024	108.17	0.00
先渡為替契約合計				1 254 711.87	0.28
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産				4 857 855.42	1.08
その他の資産および負債				1 719 519.36	0.38
純資産総額				448 933 996.32	100.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

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

2024年11月30日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
投資信託、オープン・エンド型			
アイルランド			
USD FEDERATED HERMES SDG ENGAGEMENT HIGH-M- USD	781 604.00	1 809 960.38	2.50
USD ISHARES MSCI WORLD INFO TECH SEC ESG UCITS ETF-SHS USD	50 383.00	711 251.77	0.98
USD NEUBERGER BERMAN GLOBAL HIGH YIELD SDG ENGAGEMENT FU-14-USD	153 209.00	1 787 949.03	2.47
USD RECORD UCITS ICAV-RECORD EM SUSTAINABLE FINANCE FUND-A-USD	19 007.00	2 101 123.11	2.90
USD UBS IRL ETF PIC-MSCI ACWI ESG UNIVERSAL UCITS ETF A-DIST	133 657.00	2 469 714.05	3.41
USD UBS IRL ETF PLC-MSCI ACWI SOCIALLY RES UCITS ETF-A-DIST-USD	12 163.00	264 849.33	0.36
USD UBS IRL ETF PLC-MSCI USA SOC RES UCITS ETF AC SHS-A-USD CUM	69 163.00	1 444 123.44	1.99
アイルランド合計		10 588 971.11	14.61
ルクセンブルグ			
USD FOCUSED FUND - CORPORATE BOND SUSTAINABLE USD U-X-ACC	174.00	1 790 505.24	2.47
USD FOCUSED SICAV - US CORPORATE BOND SUSTAINABLE USD U-X-ACC	178.00	1 816 831.76	2.51
USD FOCUSED SICAV - WORLD BANK LONG TERM BOND USD U-X-ACC	576.00	5 353 637.76	7.39
USD FOCUSED SICAV - WORLD BANK BOND USD U-X-ACC	350.00	3 567 504.50	4.92
USD SUSTAINABLE DEVELOPMNT BK BD 1-5 IDX FD-SHS-(USD)U-X-ACC-CAP	489 695.00	5 324 845.49	7.35
USD SUSTNABLE DEVELOPMNT BK BD 5-10 IDX FD-SHS-(USD) U-X-ACC-CAP	770 722.00	8 177 822.85	11.28
USD UBS (LUX) BD SICAV-USD INVES GRA CORPOR SUSTAI (USD) U-X-ACC	1 036.00	13 066 301.36	18.03
EUR UBS (LUX) BOND SICAV-GREEN SOC SUSTAINABLE BDS(EUR)I-X-ACC	3 000.00	330 421.61	0.45
EUR UBS (LUX) BOND SICAV - GREEN SOC SUSTAINABLE BD(EUR)U-X-ACC	1 089.50	10 686 759.54	14.74
USD UBS (LUX) EQUITY FUND-GLBAL SUSTAINABLE IMPRO (USD) U-X-ACC	110.00	1 262 800.00	1.74
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - GL HI DIV (USD)-I-X-ACC	2 889.00	976 886.46	1.35
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - GLOBAL OPPORTUNITY (USD) U-X-ACC	88.00	1 248 540.48	1.72
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - ACTIVE CLIMATE AWARE (USD) I-X-ACC	5 775.00	981 057.00	1.35
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - LONG TERM THEMES (USD) U-X-ACC	91.00	1 021 956.39	1.41
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - ENGAGE FOR IMPACT (USD) U-X-ACC	360.00	3 754 548.00	5.18
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD U-X-ACC	74.50	942 319.21	1.30
USD UBS(LUX)KEY SELECTION SICAV-DIGTL TRANSFR THEMES USD U-X-ACC	48.00	527 037.60	0.73
ルクセンブルグ合計		60 829 775.25	83.92
投資信託、オープン・エンド型合計		71 418 746.36	98.53
ルクセンブルグ2010年12月17日法(改訂済)の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs合計			
		71 418 746.36	98.53

公認の証券取引所に上場されている派生商品

指数に係るオプション、従来型

米ドル			
USD S&P 500 INDEX PUT 5050.00000 20.12.24	-2.00	-450.00	0.00
USD S&P 500 INDEX PUT 5815.00000 20.12.24	2.00	2 712.00	0.00
米ドル合計		2 262.00	0.00
指数に係るオプション、従来型合計		2 262.00	0.00
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		2 262.00	0.00
投資有価証券合計		71 421 008.36	98.53

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ - インカム・サステナブル (米ドル)

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注 1)	純資産 比率 (%)
派生商品			
公認の証券取引所に上場されている派生商品			
債券に係る金融先物			
USD US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 20.03.25	-3.00	-6 093.75	-0.01
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.25	40.00	17 500.04	0.03
債券に係る金融先物合計		11 406.29	0.02
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		11 406.29	0.02
派生商品合計		11 406.29	0.02

先渡為替契約

購入通貨 / 購入額 / 売却通貨 / 売却額 / 満期日 (日-月-年)

USD	1 466 809.72	CNY	10 390 000.00	12.12.2024	19 655.64	0.03
AUD	55 000.00	USD	36 323.35	19.12.2024	-487.64	0.00
USD	124 259.04	SEK	1 325 294.43	19.12.2024	2 746.64	0.00
USD	84 993.80	NOK	932 091.86	19.12.2024	673.07	0.00
AUD	649 643.45	USD	430 053.57	19.12.2024	-6 772.96	-0.01
USD	60 824.89	SGD	80 000.00	19.12.2024	1 102.93	0.00
USD	68 783.60	HKD	534 200.00	19.12.2024	118.43	0.00
USD	267 225.48	CAD	370 499.58	19.12.2024	2 430.07	0.00
USD	66 585.41	DKK	455 000.00	19.12.2024	2 082.25	0.00
USD	628 542.23	JPY	95 143 437.00	19.12.2024	-6 660.85	-0.01
USD	175 082.13	GBP	134 858.17	19.12.2024	3 673.19	0.01
USD	11 919 349.25	EUR	10 924 789.21	19.12.2024	371 400.25	0.52
CHF	775 762.23	USD	903 341.09	19.12.2024	-20 879.33	-0.03
USD	25 204.45	NZD	42 000.00	19.12.2024	352.81	0.00
USD	1 243 120.85	CHF	1 103 000.00	19.12.2024	-11 587.46	-0.02
USD	528 929.40	EUR	508 000.00	19.12.2024	-8 047.38	-0.01
USD	528 879.69	GBP	423 000.00	19.12.2024	-8 766.50	-0.01
USD	532 888.48	AUD	820 000.00	19.12.2024	-1 389.36	0.00
USD	167 964.16	EUR	160 000.00	19.12.2024	-1 162.38	0.00
先渡為替契約合計					338 481.42	0.47
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産					741 495.78	1.02
その他の資産および負債					-27 302.44	-0.04
純資産総額					72 485 089.41	100.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

2024年5月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある証券および短期金融商品

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
株式			
オーストラリア			
AUD ANZ GROUP HLDGS LI NPV	2 910.00	59 089.58	0.02
AUD APA GROUP NPV	1 446.00	6 801.22	0.00
AUD ARISTOCRAT LEISURE NPV	534.00	23 568.48	0.01
AUD ASX LTD NPV	201.00	8 649.99	0.00
AUD BHP GROUP LTD NPV	4 948.00	130 772.31	0.04
AUD BLUESCOPE STEEL NPV	444.00	6 400.97	0.00
AUD BRAMBLES LTD NPV	1 350.00	16 736.08	0.01
AUD CAR GROUP LTD NPV	331.00	8 948.64	0.00
AUD CMNWLTH BK OF AUST NPV	1 630.00	168 390.31	0.05
AUD COCHLEAR LTD NPV	62.00	12 288.22	0.00
AUD COLES GROUP LTD NPV	1 360.00	16 470.22	0.01
AUD COMPUTERSHARE LTD NPV(POST REC)	513.00	10 657.44	0.00
AUD CSL NPV	470.00	86 410.54	0.02
AUD ENDEAVOUR GROUP LI NPV	1 638.00	4 663.12	0.00
AUD FORTESCUE LTD NPV	1 563.00	19 335.93	0.01
AUD GOODMAN GROUP (STAPLED SECURITY)	1 694.00	41 835.82	0.01
AUD GPT GROUP NPV (STAPLED SECURITIES)	2 092.00	6 487.09	0.00
AUD INSURANCE AUST GRP NPV	2 395.00	13 308.70	0.00
AUD MACQUARIE GP LTD NPV	348.00	52 393.70	0.02
AUD MEDIBANK PRIVATE L NPV	3 253.00	8 095.22	0.00
AUD MINERAL RESS LTD NPV	186.00	4 074.94	0.00
AUD MIRVAC GROUP STAPLED SECURITIES	4 434.00	6 239.22	0.00
AUD NATL AUSTRALIA BK NPV	2 991.00	76 185.84	0.02
AUD NTHN STAR RES LTD NPV	1 138.00	12 981.04	0.00
AUD ORICA LIMITED NPV	450.00	5 308.99	0.00
AUD ORIGIN ENERGY NPV	1 814.00	12 845.41	0.00
AUD PRO MEDICUS NPV	62.00	10 173.81	0.00
AUD QANTAS AIRWAYS NPV	847.00	4 839.09	0.00
AUD QBE INS GROUP NPV	1 466.00	19 100.51	0.01
AUD RAMSAY HEALTH CARE NPV	152.00	3 920.22	0.00
AUD REA GROUP LIMITED NPV	48.00	7 865.24	0.00
AUD REECE AUSTRALIA NPV	169.00	2 833.85	0.00
AUD RIO TINTO LIMITED NPV	363.00	27 960.96	0.01
AUD SANTOS LIMITED NPV	3 301.00	14 214.38	0.01
AUD SCENTRE GROUP NPV STAPLED UNIT	4 607.00	11 044.53	0.00
AUD SEEK LIMITED NPV	358.00	6 091.68	0.00
AUD SGH LTD NPV	178.00	5 741.09	0.00
AUD SONIC HEALTHCARE NPV	436.00	8 114.80	0.00
AUD SOUL PATTINSON(WH) NPV	168.00	3 808.64	0.00
AUD SOUTH32 LTD NPV	4 801.00	11 634.71	0.00
AUD STOCKLAND NPV (STAPLED)	2 702.00	9 188.34	0.00
AUD SUNCORP GROUP LTD NPV	1 140.00	14 630.26	0.01
AUD TELSTRA GROUP LTD NPV	4 793.00	12 302.26	0.00
AUD THE LOTTERY CORPORA NPV	2 418.00	8 159.57	0.00
AUD TRANSURBAN GROUP STAPLED UNITS NPV	2 879.00	24 006.71	0.01
AUD TREASURY WINE ESTA NPV	723.00	5 336.41	0.00
AUD VICINITY LTD NPV (STAPLED SECURITY)	4 501.00	6 333.50	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
AUD WESFARMERS LTD NPV	1 095.00	51 239.05	0.01
AUD WESTPAC BKG CORP NPV	3 366.00	73 151.16	0.02
AUD WISETECH GLOBAL LT NPV	170.00	14 186.63	0.01
AUD WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	1 788.00	28 549.07	0.01
AUD WOOLWORTHS GRP LTD NPV	1 195.00	23 494.61	0.01
オーストラリア合計		1 226 860.10	0.33
オーストリア			
EUR ERSTE GROUP BK AG NPV	312.00	17 102.84	0.01
EUR OMV AG NPV(VAR)	161.00	6 448.23	0.00
EUR VERBUND AG CLASS'A'NPV	69.00	5 502.27	0.00
オーストリア合計		29 053.34	0.01
ベルギー			
EUR AGEAS NPV	150.00	7 566.62	0.00
EUR ANHEUSER-BUSCH IN NPV	844.00	45 409.59	0.01
EUR D'IETEREN GROUP NPV	19.00	4 049.68	0.00
EUR ELIA GROUP NPV	29.00	2 715.33	0.00
EUR GPE BRUXELLES LAM NPV	86.00	5 945.03	0.00
EUR KBC GROUP NV NPV	233.00	16 793.50	0.01
EUR SOFINA NPV	20.00	4 638.83	0.00
EUR SYENSQO SA NPV	62.00	4 600.93	0.00
EUR UCB NPV	125.00	24 470.83	0.01
EUR WAREHOUSES DE PAUW NPV (POST SPLIT)	204.00	4 507.52	0.00
ベルギー合計		120 697.86	0.03
バミューダ			
EUR AEGON LIMITED EURO.12	1 206.00	7 772.59	0.00
バミューダ合計		7 772.59	0.00
カナダ			
CAD 1ST QUANTUM MINLS COM NPV	670.00	9 154.09	0.00
CAD AGNICO EAGLE MINES LTD COM	479.00	40 389.06	0.01
CAD AIR CANADA VAR VTG SHS NPV	125.00	2 228.33	0.00
CAD ALIMENTATION COUCH COM NPV	747.00	43 700.15	0.01
CAD ALTAGAS LTD COM NPV	325.00	7 947.72	0.00
CAD ARC RESOURCES COM NPV	552.00	10 175.42	0.00
CAD BANK NOVA SCOTIA HALIFAX COM	1 196.00	68 207.41	0.02
CAD BANK OF MONTREAL COM NPV	714.00	68 077.71	0.02
CAD BARRICK GOLD CORP COM NPV	1 745.00	30 559.15	0.01
CAD BCE INC COM NEW	51.00	1 380.49	0.00
CAD BROOKFIELD ASSET.M CLASS A LTD VOTING SHS	387.00	22 197.60	0.01
CAD BROOKFIELD CORP CLASS A LID VOTING SHS	1 336.00	82 097.95	0.02
CAD CAE INC COM NPV	309.00	7 262.93	0.00
CAD CAMECO CORP COM	433.00	25 930.83	0.01
CAD CANADIAN NAT RES LTD COM	2 043.00	69 337.83	0.02
CAD CANADIAN NATL RY CO COM	527.00	58 844.54	0.02
CAD CANADIAN PAC KANS COM NPV	915.00	69 996.54	0.02
CAD CANADIAN TIRE LTD CL A	53.00	5 843.38	0.00
CAD CANADIAN UTILS LTD CL A	159.00	4 081.32	0.00
CAD CCL INDUSTRIES INC 'B'NON-VTG COM NPV	146.00	8 092.75	0.00
CAD CDN IMPERIAL BK OF COMMERCE COM	918.00	59 584.93	0.02
CAD CENOVUS ENERGY INC COM NPV	1 349.00	21 369.72	0.01
CAD CGI INC COM NPV SUB VOTING SHARES C	207.00	23 429.89	0.01
CAD CONSTELLATION SOFT COM STK NPV	20.00	67 623.61	0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
CAD DESCARTES SYSTEMS COM NPV	98.00	11 555.76	0.00
CAD DOLLARAMA INC COM NPV	284.00	29 581.52	0.01
CAD ELEMENT FLEET MGMT COM NPV	415.00	8 802.99	0.00
CAD EMERA INC COM	266.00	10 148.72	0.00
CAD EMPIRE LTD CL A	129.00	3 867.74	0.00
CAD ENBRIDGE INC COM NPV	2 128.00	92 056.54	0.02
CAD FAIRFAX FINL HLDGS SUB-VTG COM NPV	22.00	31 209.94	0.01
CAD FIRSTSERVICE CORP COM NPV	43.00	8 387.79	0.00
CAD FORTIS INC COM NPV	451.00	20 160.76	0.01
CAD FRANCO NEVADA CORP COM NPV	191.00	23 386.81	0.01
CAD GFL ENVIRON INC COM NPV SUB VTG SHS	200.00	9 486.13	0.00
CAD GILDAN ACTIVEWEAR INC COM	130.00	6 462.16	0.00
CAD GREAT WEST LIFECO INC COM	273.00	9 828.90	0.00
CAD HYDRO ONE INC COM NPV	297.00	9 712.98	0.00
CAD IA FINANCIAL CORP COM NPV	86.00	8 220.10	0.00
CAD IGM FINANCIAL INC COM	64.00	2 162.51	0.00
CAD IMPERIAL OIL LTD COM NEW	174.00	12 885.81	0.00
CAD INTACT FINL CORP COM NPV	179.00	34 092.01	0.01
CAD IVANHOE MINES LTD COM NPV CL'A'	607.00	8 171.95	0.00
CAD KEYERA CORPORATION COM NPV	230.00	7 584.26	0.00
CAD KINROSS GOLD CORP COM NPV	1 185.00	11 603.29	0.00
CAD LOBLAW COS LTD COM	155.00	20 114.63	0.01
CAD LUNDIN MINING CORP COM	741.00	7 271.61	0.00
CAD MAGNA INTL INC COM NPV	269.00	12 224.74	0.00
CAD MANULIFE FINL CORP COM	1 772.00	57 039.63	0.02
CAD MEG ENERGY CORP COM NPV	274.00	4 931.47	0.00
CAD METRO INC CL A SUB	232.00	15 116.49	0.00
CAD NATL BK OF CANADA COM NPV	331.00	32 791.49	0.01
CAD NUTRIEN LTD NPV	470.00	21 953.36	0.01
CAD ONEX CORP SUB VTG	79.00	6 425.96	0.00
CAD OPEN TEXT CO COM NPV	260.00	7 918.01	0.00
CAD PAN AMER SILVER COM NPV	376.00	8 340.93	0.00
CAD PARKLAND CORP. COM NPV	100.00	2 581.87	0.00
CAD PEMBINA PIPELINE C COM NPV	574.00	23 646.27	0.01
CAD POWER CORP CDA COM	548.00	18 457.79	0.01
CAD QUEBECOR INC CL B	184.00	4 344.56	0.00
CAD RB GLOBAL INC COM NPV	178.00	17 587.06	0.01
CAD RESTAURANT BRANDS COM NPV	297.00	20 683.83	0.01
CAD ROGERS COMMUNICATIONS INC	358.00	12 784.34	0.00
CAD ROYAL BK OF CANADA COM NPV	1 385.00	174 253.90	0.05
CAD SAPUTO INC COM	228.00	4 250.12	0.00
CAD SHOPIFY INC COM NPV CL A	1 187.00	137 202.50	0.04
CAD STANTEC INC COM NPV	115.00	9 960.40	0.00
CAD SUN LIFE FINL INC COM	548.00	33 725.79	0.01
CAD SUNCOR ENERGY INC COM NPV 'NEW'	1 235.00	49 138.91	0.01
CAD TC ENERGY CORPORAT COM NPV	1 004.00	48 946.93	0.01
CAD TECK RESOURCES LTD CLASS'B'SUB-VTG COM NPV	464.00	21 663.16	0.01
CAD TELUS CORPORATION NPV	416.00	6 477.02	0.00
CAD TFI INTERNATIONAL COM NPV	87.00	13 245.57	0.00
CAD THOMSON-REUTERS CP NPV POST REV SPLIT	152.00	24 799.40	0.01
CAD TMX GROUP LTD COM NPV	285.00	9 011.14	0.00
CAD TOROMONT INDS LTD COM	100.00	8 213.41	0.00
CAD TORONTO-DOMINION COM NPV	1 710.00	96 763.42	0.03
CAD TOURMALINE OIL CP COM NPV	358.00	16 895.79	0.00
CAD WEST FRASER TIMBER COM NPV	52.00	5 107.34	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
CAD WESTON GEORGE LTD COM	56.00	9 001.04	0.00
CAD WHEATON PRECIOUS M COM NPV	436.00	27 128.75	0.01
CAD WSP GLOBAL INC COM NPV	118.00	20 982.37	0.01
カナダ合計		2 177 863.02	0.58
中国			
USD FUTU HOLDINGS LIM1 SPON ADS EA REP 8 ORD SHS	100.00	8 723.00	0.00
SGD YANGZIJANG SHIPBU NPV	1 000.00	1 797.64	0.00
中国合計		10 520.64	0.00
デンマーク			
DKK A.P. MOELLER-MAERSK SER'B'DKK1000	4.00	6 783.74	0.00
DKK A.P. MOLLER-MAERSK 'A'DKK1000	3.00	4 915.73	0.00
DKK CARLSBERG SER'B'DKK20	88.00	9 057.98	0.00
DKK COLOPLAST DKK1 B	114.00	14 359.38	0.01
DKK DANSKE BANK A/S DKK10	688.00	19 750.40	0.01
DKK DEMANT A/S DKK0.20	111.00	4 231.87	0.00
DKK DSV A/S DKK1	192.00	40 977.77	0.01
DKK GENMAB AS DKK1	59.00	12 750.89	0.00
DKK NOVO NORDISK A/S DKK0.1 B	3 157.00	338 591.71	0.09
DKK NOVONIS B SER'B'DKK2	330.29	19 351.62	0.01
DKK ORSTED A/S DKK10	167.00	9 266.48	0.00
DKK PANDORA A/S DKK1	80.00	12 876.36	0.00
DKK ROCKWOOL A/S SER'B'DKK10	12.00	4 374.45	0.00
DKK TRYG A/S DKK5	366.00	8 428.21	0.00
DKK VESTAS WIND SYSTEM DKK0.20 (POST SPLIT)	1 038.00	16 126.41	0.01
DKK ZEALAND PHARMA AS DKK1	54.00	5 582.78	0.00
デンマーク合計		527 425.78	0.14
フィンランド			
EUR ELISA OYJ NPV	138.00	6 250.00	0.00
EUR FORTUM OYJ EUR3.40	440.00	6 629.34	0.00
EUR KESKO OYJ EUR2 SER'B'	249.00	4 948.23	0.00
EUR KONE CORPORATION NPV ORD 'B'	352.00	18 239.64	0.01
EUR METSO CORPORATION RG	604.00	5 311.52	0.00
EUR NESTE OIL OYJ NPV	413.00	6 283.62	0.00
EUR NOKIA OYJ NPV	5 125.00	21 541.14	0.01
SEK NORDEA HOLDING ABP NPV	3 153.00	35 619.37	0.01
EUR ORION CORP SER'B'NPV	91.00	4 298.23	0.00
EUR SAMPO PLC NPV A	466.00	19 953.35	0.01
EUR STORA ENSO OYJ NPV SER'R'	643.00	6 242.63	0.00
EUR UPM-KYMMENE CORP NPV	490.00	12 886.70	0.00
EUR WARTSILA OYJ ABP SER'B'EUR3.50	543.00	9 867.36	0.00
フィンランド合計		158 071.13	0.04
フランス			
EUR ACCOR EUR3	169.00	7 796.78	0.00
EUR ADP EUR3	34.00	3 932.23	0.00
EUR AIR LIQUIDE(L') EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)	564.00	93 691.19	0.03
EUR AIRBUS EUR1	557.00	86 810.05	0.02
EUR ALSTOM EUR7.00	352.00	7 915.25	0.00
EUR AMUNDI EUR2.5 (AIW)	71.00	4 623.15	0.00
EUR ARKEMA EUR10	62.00	4 911.33	0.00
EUR AXA EUR2.29	1 729.00	60 227.08	0.02
EUR BIOMERIEUX NPV (POST SPLIT)	38.00	3 967.40	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR BNP PARIBAS EUR2	983.00	58 806.17	0.02
EUR BOLLORE EURO.16	658.00	4 055.21	0.00
EUR BOUYGUES EUR1	190.00	5 651.09	0.00
EUR BUREAU VERITAS EURO.12	342.00	10 403.15	0.00
EUR CAPGEMINI EUR8	158.00	25 349.01	0.01
EUR CARREFOUR EUR2.50	502.00	7 635.06	0.00
EUR CIE DE ST-GOBAIN EUR4	442.00	40 307.00	0.01
EUR COVIVIO EUR3	32.00	1 757.52	0.00
EUR CREDIT AGRICOLE SA EUR3	1 057.00	14 144.83	0.00
EUR DANONE EURO.25	603.00	41 181.22	0.01
EUR DASSAULT AVIATION EURO.80 (POST SUBDIVISION)	20.00	3 979.76	0.00
EUR DASSAULT SYSTEMES EURO.10	641.00	22 104.84	0.01
EUR EDENRED EUR2	257.00	8 496.18	0.00
EUR EIFFAGE EUR4	79.00	7 125.76	0.00
EUR ENGIE EUR1	1 815.00	28 918.00	0.01
EUR ESSILORLUXOTTICA EURO.18	292.00	70 872.71	0.02
EUR EURAZEO NPV	33.00	2 424.14	0.00
EUR GECINA EUR7.50	34.00	3 424.09	0.00
EUR GETLINK SE EURO.40	265.00	4 328.55	0.00
EUR HERMES INTL NPV	31.00	67 612.64	0.02
EUR IPSEN EUR1	47.00	5 430.77	0.00
EUR KERING EUR4	71.00	16 554.09	0.00
EUR KLEPIERRE EUR1.40	199.00	6 015.46	0.00
EUR L'OREAL EURO.20	230.00	79 837.63	0.02
EUR LA FRANCAISE DES EURO.40 (PROMESSES)	87.00	3 436.66	0.00
EUR LEGRAND SA EUR4	265.00	26 556.25	0.01
EUR LVMH MOET HENNESSY EURO.30	269.00	168 339.80	0.05
EUR MICHELIN (CGDE) EURO.50 (POST SUBDIVISION)	641.00	20 818.49	0.01
EUR ORANGE EUR4	1 888.00	20 110.55	0.01
EUR PERNOD RICARD EUR1.55	189.00	21 139.95	0.01
EUR PUBLICIS GROUPE SA EURO.40	221.00	23 972.25	0.01
EUR RENAULT SA EUR3.81	170.00	7 277.32	0.00
EUR REXEL EUR5	207.00	5 343.40	0.00
EUR SAFRAN EURO.20	347.00	80 813.56	0.02
EUR SANOFI EUR2	1 116.00	108 548.25	0.03
EUR SARTORIUS STEDIM B EURO.20 (POST SUBD)	34.00	6 476.51	0.00
EUR SCHNEIDER ELECTRIC EUR8	536.00	137 851.00	0.04
EUR SEB SA EUR1	30.00	2 845.40	0.00
EUR SOC GENERALE EUR1.25	709.00	18 792.29	0.01
EUR SODEXO EUR4	88.00	7 305.52	0.00
EUR TELEPERFORMANCE EUR2.50	47.00	4 419.08	0.00
EUR THALES EUR3	95.00	14 197.97	0.00
EUR TOTALENERGIES SE EUR2.5	2 117.00	122 911.57	0.03
EUR UNIBAIL-RODAMCO-WE NPV(1 ORD UNIBAIL-R & 1CLS)	115.00	9 420.67	0.00
EUR VEOLIA ENVIRONNEME EUR5	694.00	20 208.89	0.01
EUR VINCI EUR2.50	489.00	51 575.87	0.01
EUR VIVENDI SA EUR5.50	663.00	6 085.26	0.00
フランス合計		1 698 735.85	0.45

ドイツ

EUR ADIDAS AG NPV (REGD)	159.00	37 466.48	0.01
EUR ALLIANZ SE NPV(REGD)(VINKULIERT)	383.00	118 202.09	0.03
EUR BASF SE NPV	889.00	39 830.76	0.01
EUR BAYER AG NPV (REGD)	939.00	19 228.47	0.01
EUR BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG EUR1	284.00	21 003.26	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR BAYERISCHE MOTORENWERKE AG EUR1	72.00	4 904.99	0.00
EUR BECHTLE AG NPV	114.00	3 744.65	0.00
EUR BEIERSDORF AG NPV	87.00	11 270.23	0.00
EUR BRENNTAG AG	139.00	8 955.52	0.00
EUR CARL ZEISS MEDITEC NPV	47.00	2 807.22	0.00
EUR COMMERZBANK AG NPV	987.00	15 141.87	0.00
EUR CONTINENTAL AG ORD NPV	103.00	6 749.24	0.00
EUR COVESTRO AG NPV	186.00	11 339.28	0.00
EUR CTS EVENTIM NPV	46.00	4 059.29	0.00
EUR DAIMLER TRUCK HOLD NPV (YOUNG SHARE)	473.00	17 885.06	0.01
EUR DELIVERY HERO SE NPV	187.00	7 651.51	0.00
EUR DEUTSCHE BANK AG NPV(REGD)	1 821.00	30 915.77	0.01
EUR DEUTSCHE BOERSE AG NPV(REGD)	191.00	44 684.13	0.01
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA ORD NPV (REGD)(VINK)	644.00	4 309.70	0.00
EUR DEUTSCHE POST AG NPV(REGD)	1 014.00	37 238.21	0.01
EUR DEUTSCHE TELEKOM NPV(REGD)	3 414.00	109 185.65	0.03
EUR DR.ING. F.PORSCHE NON-VTG PRF NPV	90.00	5 616.03	0.00
EUR E.ON SE NPV	2 095.00	26 962.23	0.01
EUR EVONIK INDUSTRIES NPV	255.00	4 676.94	0.00
EUR FRESENIUS MED CARE NPV	191.00	8 392.14	0.00
EUR FRESENIUS SE & CO. KGAA NPV	431.00	15 145.24	0.00
EUR GEA GROUP AG NPV	152.00	7 596.87	0.00
EUR HANNOVER RUECKVERS ORD NPV(REGD)	61.00	15 920.21	0.01
EUR HEIDELBERG MATER NPV	139.00	17 529.33	0.01
EUR HENKEL AG & CO KGAA	96.00	7 285.25	0.00
EUR HENKEL AG&CO. KGAA NON-VTG PRF NPV	159.00	13 562.50	0.00
EUR INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)	1 256.00	40 878.78	0.01
EUR KNORR BREMSE AG NPV	75.00	5 715.36	0.00
EUR LEG IMMOBILIEN SE NPV	82.00	7 599.02	0.00
EUR MERCEDES-BENZ ORD NPV(REGD)	688.00	38 484.21	0.01
EUR MERCK KGAA NPV	129.00	19 292.97	0.01
EUR MTU AERO ENGINES H NPV (REGD)	49.00	16 675.07	0.01
EUR MUENCHENER RUECKVE NPV(REGD)	131.00	68 392.44	0.02
EUR NEMETSCHEK SE ORD NPV	69.00	7 156.60	0.00
EUR PORSCHE AUTO HL SE NON VTG PRF NPV	152.00	5 557.98	0.00
EUR PUMA SE NPV	100.00	4 678.97	0.00
EUR RATIONAL AG NPV	6.00	5 608.42	0.00
EUR RHEINMETALL AG NPV	43.00	28 267.29	0.01
EUR RWE AG (NEU) NPV	614.00	20 667.91	0.01
EUR SAP AG ORD NPV	1 024.00	243 240.33	0.07
EUR SARTORIUS AG NON VTG PRF NPV	26.00	5 981.05	0.00
EUR SCOUT24 SE NPV	68.00	6 108.43	0.00
EUR SIEMENS AG NPV(REGD)	716.00	138 512.77	0.04
EUR SIEMENS ENERGY AG NPV	615.00	33 140.70	0.01
EUR SIEMENS HEALTHINEE NPV	287.00	15 556.60	0.00
EUR SYMRISE AG NPV (BR)	127.00	14 017.36	0.00
EUR TALANX AG NPV	67.00	5 675.39	0.00
EUR VOLKSWAGEN AG NON VTG PRF NPV	188.00	16 028.22	0.01
EUR VONOVIA SE NPV	693.00	22 983.12	0.01
EUR ZALANDO SE NPV	205.00	6 370.05	0.00
ドイツ合計		1 455 849.16	0.39
香港			
HKD AIA GROUP LTD NPV	10 600.00	79 211.73	0.02
HKD BOC HONG KONG HLDG HKD5	3 500.00	10 749.79	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
HKD CK ASSET HOLDINGS HKD1	2 000.00	8 173.18	0.00
HKD CK HUTCHISON HLDGS HKD1.0	2 500.00	13 011.55	0.01
HKD CK INFRASTRUCTURE HKD1	500.00	3 444.04	0.00
HKD CLP HOLDINGS HKD5	1 500.00	12 587.47	0.01
HKD GALAXY ENTERTAINME HKD0.10	2 000.00	8 879.98	0.00
HKD HANG SENG BANK HKD5	800.00	9 504.53	0.00
HKD HENDERSON LAND DEV HKD2	1 000.00	3 135.62	0.00
HKD HKT TRUST AND HKT SHARE STAPLED UNIT	5 000.00	6 213.42	0.00
HKD HONG KONG EXCHANGE HKD1	1 200.00	44 690.33	0.01
USD HONGKONG LAND HLD ORD USD0.10(SINGAPORE REG)	1 300.00	5 915.00	0.00
HKD HONGKONG&CHINA GAS HKD0.25	11 750.00	8 908.89	0.00
USD JARDINE MATHESON COM USD0.25(BERMUDA REG)	100.00	4 366.00	0.00
HKD MTR CORP HKD1	2 000.00	7 003.75	0.00
HKD POWER ASSETS HOLDINGS LTD HKD1	1 500.00	9 830.95	0.00
HKD SINO LAND CO HKD1	4 781.00	4 681.74	0.00
HKD SITC INTERNATIONAL HKD0.10	1 000.00	2 602.31	0.00
HKD SUN HUNG KAI PROP NPV	1 500.00	14 890.99	0.01
HKD SWIRE PACIFIC 'A'HKD0.60	500.00	4 115.50	0.00
HKD TECHTRONIC INDUSTR NPV	1 000.00	14 084.60	0.01
HKD THE LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2 706.00	11 771.19	0.01
HKD WH GROUP LTD USD0.0001	8 858.00	7 023.52	0.00
HKD WHARF REAL ESTATE HKD0.1	2 000.00	5 358.83	0.00
HKD WHARF(HLDGS) HKD1	1 000.00	2 743.67	0.00
香港合計		302 898.58	0.08
アイルランド			
EUR AIB GROUP PLC ORD EURO0.625	1 216.00	6 614.35	0.00
EUR BANK OF IRELAND GR EUR1	1 032.00	9 033.91	0.00
GBP DCC ORD EURO.25	95.00	6 912.92	0.00
GBP EXPERIAN ORD USD0.10	911.00	43 433.82	0.01
AUD JAMES HARDIE ID PLC CUFS EURO.5	428.00	15 672.51	0.01
EUR KERRY GROUP 'A'ORD EURO.125(DUBLIN LIST)	155.00	14 971.37	0.01
EUR KINGSPAN GROUP ORD EURO.13(DUBLIN LISTING)	156.00	11 731.42	0.00
アイルランド合計		108 370.30	0.03
マン島			
GBP ENTAIN PLC ORD EURO0.01	563.00	5 764.89	0.00
マン島合計		5 764.89	0.00
イスラエル			
ILS AZRIELI GROUP ILS0.01	30.00	2 401.22	0.00
ILS BANK HAPOLIM B.M. ILS1	1 286.00	14 739.49	0.00
ILS BK LEUMI LE ISRAEL ILS1	1 538.00	17 471.26	0.01
USD CHECK POINT SFTWRE ORD ILS0.01	94.00	17 108.00	0.01
ILS ELBIT SYSTEMS LTD ILS1	27.00	6 550.14	0.00
USD GLOBAL-E ONLINE LT COM NPV	100.00	5 228.00	0.00
ILS ICL GROUP LTD ILS1	627.00	2 828.33	0.00
ILS ISRAEL DISCOUNT BK ILS0.10 SER'A'	1 234.00	8 098.48	0.00
ILS MIZRAHI TEFAHOT BK ILS0.01	168.00	7 240.96	0.00
ILS NICE LTD ILS1	66.00	11 865.17	0.00
USD TEVA PHARMA IND ADR(CNV 1 ORD ILS0.10)	1 100.00	18 458.00	0.01
USD WIX.COM LTD COM ILS0.01	53.00	11 858.22	0.00
イスラエル合計		123 847.27	0.03

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
イタリア			
EUR AMPLIFON EURO.02	145.00	3 680.17	0.00
EUR BANCO BPM NPV	1 148.00	8 734.97	0.00
EUR BPER BANCA EUR3	685.00	4 180.37	0.00
EUR DAVIDE CAMPARI MIL EURO.01	509.00	3 052.52	0.00
EUR DIASORIN SPA EUR1	31.00	3 464.12	0.00
EUR ENEL EUR1	7 953.00	57 203.72	0.02
EUR ENI SPA EUR1	2 244.00	31 773.73	0.01
EUR FINECOBANK SPA EURO.33	624.00	10 011.26	0.00
EUR GENERALI SPA NPV EUR1	973.00	27 829.64	0.01
EUR INFRASTRUTTURE WIR NPV	316.00	3 254.15	0.00
EUR INTESA SANPAOLO NPV	14 391.00	55 129.58	0.02
EUR LEONARDO SPA EUR4.40	425.00	11 433.10	0.00
EUR MEDIOBANCA SPA EURO.5	491.00	7 159.20	0.00
EUR MONCLER SPA NPV	206.00	10 084.70	0.00
EUR NEXI SPA NPV	513.00	3 036.42	0.00
EUR POSTE ITALIANE SPA NPV	447.00	6 272.14	0.00
EUR PRYSMIAN SPA EURO.10	261.00	17 207.21	0.01
EUR RECORDATI EURO.125	99.00	5 390.26	0.00
EUR SNAM EUR1	1 805.00	8 411.22	0.00
EUR TELECOM ITALIA SPA EURO.55	7 438.00	1 785.68	0.00
EUR TERNA SPA ORD EURO.22	1 264.00	10 690.97	0.00
EUR UNICREDIT SPA NPV (POST REV SPLIT)	1 457.00	55 992.28	0.02
EUR UNIPOL GRUPPO FIN NPV PRIV (POST CONSOLID)	239.00	2 882.77	0.00
イタリア合計		348 660.18	0.09

日本			
JPY アドバンテスト	700.00	38 405.97	0.01
JPY イオン	600.00	14 358.29	0.00
JPY A G C	200.00	6 245.63	0.00
JPY アイシン	600.00	6 304.22	0.00
JPY 味の素	500.00	20 914.21	0.01
JPY A N A ホールディングス	100.00	1 923.63	0.00
JPY アサヒグループホールディングス	1 500.00	16 274.93	0.01
JPY 旭化成	1 400.00	9 955.72	0.00
JPY アシックス	700.00	13 996.74	0.00
JPY アステラス製薬	1 700.00	17 675.20	0.01
JPY バンダイナムコホールディングス	600.00	12 624.43	0.00
JPY ブリヂストン	500.00	17 808.04	0.01
JPY ブラザー工業	200.00	3 509.01	0.00
JPY キヤノン	900.00	29 172.02	0.01
JPY カプコン	400.00	9 337.82	0.00
JPY 東海旅客鉄道	800.00	16 443.72	0.01
JPY 千葉銀行	400.00	3 330.56	0.00
JPY 中部電力	600.00	6 324.20	0.00
JPY 中外製薬	600.00	26 359.49	0.01
JPY コンコルディア・フィナンシャルグループ	1 000.00	5 977.29	0.00
JPY 大日本印刷	400.00	6 085.83	0.00
JPY 第一生命ホールディングス	900.00	24 276.06	0.01
JPY ダイフク	300.00	6 226.32	0.00
JPY 第一三共	1 700.00	53 755.70	0.02
JPY ダイキン工業	300.00	36 145.42	0.01
JPY 大東建託	100.00	11 136.27	0.00
JPY 大和ハウス工業	500.00	15 664.01	0.01
JPY 大和証券グループ	1 400.00	9 373.11	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
JPY デンソー	1 900.00	26 934.11	0.01
JPY 電通グループ	200.00	5 092.39	0.00
JPY ディスコ	100.00	27 033.33	0.01
JPY 東日本旅客鉄道	900.00	17 498.42	0.01
JPY エーザイ	200.00	6 219.00	0.00
JPY E N E O S ホールディングス	2 700.00	14 540.47	0.01
JPY ファナック	900.00	23 293.27	0.01
JPY ファーストリテイリング	200.00	68 062.72	0.02
JPY 富士電機	100.00	5 608.42	0.00
JPY 富士フイルムホールディングス	1 100.00	24 712.19	0.01
JPY フジクラ	200.00	7 087.26	0.00
JPY 富士通	1 600.00	30 533.01	0.01
JPY 阪急阪神ホールディングス	200.00	5 467.92	0.00
JPY 日立建機	100.00	2 249.23	0.00
JPY 日立製作所	4 500.00	112 391.38	0.03
JPY 本田技研工業	4 400.00	37 837.33	0.01
JPY ホシザキ	100.00	4 031.69	0.00
JPY H O Y A	300.00	38 472.55	0.01
JPY ヒューリック	300.00	2 694.68	0.00
JPY 出光興産	1 100.00	7 322.10	0.00
JPY I N P E X	900.00	11 829.41	0.00
JPY いすゞ自動車	600.00	7 978.16	0.00
JPY 伊藤忠商事	1 100.00	54 082.63	0.02
JPY 日本航空	100.00	1 661.62	0.00
JPY 日本取引所グループ	1 000.00	12 008.52	0.00
JPY ゆうちょ銀行	1 539.00	14 510.26	0.01
JPY 日本郵政	1 900.00	18 970.27	0.01
JPY かんぽ生命保険	200.00	4 180.18	0.00
JPY ジャパンリアルエステイト投資法人	1.00	3 688.78	0.00
JPY 日本たばこ産業	1 200.00	33 710.42	0.01
JPY J F E ホールディングス	600.00	6 827.58	0.00
JPY 鹿島建設	400.00	7 279.02	0.00
JPY 関西電力	700.00	8 974.60	0.00
JPY 花王	500.00	21 686.59	0.01
JPY 川崎汽船	400.00	5 306.79	0.00
JPY K D D I	1 500.00	49 439.03	0.01
JPY キーエンス	200.00	86 187.04	0.02
JPY キッコーマン	600.00	6 557.91	0.00
JPY キリンホールディングス	800.00	11 130.27	0.00
JPY 神戸物産	100.00	2 512.23	0.00
JPY K O K U S A I E L E C T R I C	100.00	1 651.30	0.00
JPY 小松製作所	900.00	24 126.24	0.01
JPY コナミグループ	100.00	9 837.87	0.00
JPY クボタ	1 000.00	12 471.29	0.00
JPY 京セラ	1 200.00	11 773.48	0.00
JPY 協和キリン	200.00	3 310.58	0.00
JPY レーザーテック	100.00	10 946.50	0.00
JPY L I N E ヤフー	2 800.00	7 679.33	0.00
JPY エムスリー	400.00	3 861.90	0.00
JPY マキタ	200.00	6 237.64	0.00
JPY 丸紅	1 400.00	21 011.42	0.01
JPY マツキヨココカラ&カンパニー	400.00	5 590.44	0.00
JPY 日本マクドナルドホールディングス	100.00	4 121.58	0.00
JPY 明治ホールディングス	200.00	4 261.41	0.00
JPY ミネベアミツミ	400.00	6 522.62	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
JPY 三菱ケミカルグループ	1 500.00	7 839.33	0.00
JPY 三菱商事	3 300.00	55 492.56	0.02
JPY 三菱電機	1 900.00	32 222.26	0.01
JPY 三菱地所	1 100.00	15 523.85	0.01
JPY 三菱H C キャピタル	700.00	4 707.53	0.00
JPY 三菱重工業	3 200.00	46 822.25	0.01
JPY 三菱U F J フィナンシャル・グループ	10 900.00	130 058.26	0.04
JPY 三井物産	2 500.00	52 202.28	0.02
JPY 三井化学	200.00	4 619.64	0.00
JPY 三井不動産	2 700.00	22 544.20	0.01
JPY 商船三井	300.00	10 245.36	0.00
JPY みずほフィナンシャルグループ	2 400.00	60 469.42	0.02
JPY M o n o t a R O	300.00	5 330.43	0.00
JPY M S & A D インシュアランス グループ ホールディングス	1 300.00	28 919.67	0.01
JPY 村田製作所	1 700.00	28 411.63	0.01
JPY 日本電気	200.00	16 972.40	0.01
JPY ネクソン	300.00	4 111.93	0.00
JPY ニデック	800.00	14 675.23	0.00
JPY 任天堂	1 000.00	58 660.99	0.02
JPY 日本ビルファンド投資法人	8.00	6 685.09	0.00
JPY 日本ペイントホールディングス	900.00	6 133.44	0.00
JPY 日本酸素ホールディングス	200.00	5 815.49	0.00
JPY 日本製鉄	900.00	18 331.39	0.01
JPY 日本電信電話	28 700.00	29 314.38	0.01
JPY 日本郵船	400.00	12 773.58	0.00
JPY 日産自動車	2 100.00	5 018.41	0.00
JPY 日清食品ホールディングス	200.00	5 297.47	0.00
JPY ニトリホールディングス	100.00	12 800.88	0.00
JPY 日東電工	700.00	11 130.27	0.00
JPY 野村ホールディングス	3 100.00	18 605.99	0.01
JPY 野村総合研究所	400.00	12 200.95	0.00
JPY N T T データグループ	600.00	11 577.72	0.00
JPY 大林組	700.00	9 951.06	0.00
JPY オービック	300.00	9 797.92	0.00
JPY オリンパス	1 200.00	18 856.74	0.01
JPY オムロン	200.00	6 346.84	0.00
JPY 小野薬品工業	400.00	4 612.98	0.00
JPY オリエンタルランド	1 100.00	25 913.37	0.01
JPY オリックス	1 000.00	22 419.02	0.01
JPY 大阪ガス	400.00	8 746.55	0.00
JPY 大塚商会	200.00	4 969.87	0.00
JPY 大塚ホールディングス	400.00	23 131.47	0.01
JPY バン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	400.00	10 139.49	0.00
JPY パナソニック	2 300.00	22 443.32	0.01
JPY 楽天グループ	1 600.00	9 144.99	0.00
JPY リクルートホールディングス	1 300.00	89 892.47	0.03
JPY ルネサスエレクトロニクス	1 700.00	22 225.59	0.01
JPY リソナホールディングス	2 100.00	17 478.44	0.01
JPY リコー	500.00	5 666.34	0.00
JPY S B I ホールディングス	300.00	7 550.69	0.00
JPY S C R E E N ホールディングス	100.00	6 260.28	0.00
JPY S C S K	200.00	4 032.36	0.00
JPY セコム	400.00	13 910.84	0.00
JPY セイコーエプソン	300.00	5 312.45	0.00
JPY 積水化学工業	400.00	6 442.72	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
JPY 積水ハウス	600.00	14 142.56	0.00
JPY セブン&アイ・ホールディングス	2 200.00	38 144.95	0.01
JPY S Gホールディングス	300.00	2 938.38	0.00
JPY 島津製作所	200.00	5 610.41	0.00
JPY シマノ	100.00	13 949.46	0.00
JPY 信越化学工業	1 700.00	62 867.80	0.02
JPY 塩野義製薬	800.00	11 287.41	0.00
JPY 資生堂	400.00	7 605.29	0.00
JPY しずおかフィナンシャルグループ	500.00	4 434.53	0.00
JPY S M C	100.00	42 307.82	0.01
JPY ソフトバンク	28 500.00	36 643.81	0.01
JPY ソフトバンクグループ	900.00	53 549.96	0.02
JPY S O M P Oホールディングス	900.00	23 646.84	0.01
JPY ソニーグループ	6 100.00	122 134.04	0.03
JPY S U B A R U	600.00	9 614.14	0.00
JPY 住友商事	1 000.00	21 360.32	0.01
JPY 住友電気工業	700.00	13 451.41	0.00
JPY 住友金属鉱山	200.00	4 921.93	0.00
JPY 三井住友フィナンシャルグループ	3 700.00	90 809.34	0.03
JPY 三井住友トラストグループ	700.00	17 459.80	0.01
JPY 住友不動産	300.00	9 264.57	0.00
JPY サントリー食品インターナショナル	100.00	3 391.15	0.00
JPY スズキ	1 600.00	16 901.82	0.01
JPY シスメックス	500.00	10 533.68	0.00
JPY T & Dホールディングス	500.00	9 431.70	0.00
JPY 大成建設	100.00	4 335.32	0.00
JPY 武田薬品工業	1 600.00	43 498.35	0.01
JPY T D K	2 000.00	25 688.32	0.01
JPY テルモ	1 300.00	26 409.43	0.01
JPY T I S	200.00	4 879.32	0.00
JPY 東宝	100.00	4 356.63	0.00
JPY 東京海上ホールディングス	1 800.00	66 685.75	0.02
JPY 東京電力ホールディングス	1 500.00	5 355.40	0.00
JPY 東京エレクトロン	400.00	62 083.43	0.02
JPY 東京ガス	300.00	9 008.89	0.00
JPY 東急	500.00	5 826.15	0.00
JPY T O P P A Nホールディングス	200.00	5 336.09	0.00
JPY 東レ	1 400.00	8 895.83	0.00
JPY T O T O	100.00	2 684.02	0.00
JPY 豊田自動織機	100.00	7 424.18	0.00
JPY トヨタ自動車	10 100.00	171 589.37	0.05
JPY 豊田通商	600.00	10 191.43	0.00
JPY トレンドマイクロ	100.00	5 479.24	0.00
JPY ユニ・チャーム	400.00	10 363.22	0.00
JPY 西日本旅客鉄道	400.00	7 498.75	0.00
JPY ヤクルト本社	300.00	6 102.47	0.00
JPY ヤマハ発動機	800.00	6 927.46	0.00
JPY 安川電機	200.00	5 218.90	0.00
JPY 横河電機	200.00	4 438.53	0.00
JPY ゼンショーホールディングス	100.00	6 006.59	0.00
JPY Z O Z O	100.00	3 138.13	0.00
日本合計		3 685 194.62	0.99

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
ルクセンブルグ			
EUR ARCELORMITTAL NPV(POST STOCK SPLIT)	475.00	11 960.41	0.01
EUR CVC CAPITAL PARTNE ORD NPV	128.00	3 132.44	0.00
EUR EUROFINS SCIENTIFI EURO.01	131.00	6 473.97	0.00
EUR TENARIS S.A. USD1	443.00	8 497.00	0.00
ルクセンブルグ合計		30 063.82	0.01
マカオ			
HKD SANDS CHINA LTD USD0.01 REG'S'	2 000.00	5 099.24	0.00
マカオ合計		5 099.24	0.00
オランダ			
EUR ABN AMRO BANK N.V. DR EACH REP SHS	414.00	6 434.38	0.00
EUR ADYEN NV EURO.01	21.00	30 573.19	0.01
USD AERCAP HOLDINGS EURO.01	191.00	18 977.76	0.01
EUR AKZO NOBEL NV EURO.50(POST REV SPLIT)	168.00	9 812.52	0.00
EUR ARGEN X NV EURO.10	60.00	37 161.34	0.01
EUR ASM INTL NV EURO.04	48.00	25 926.75	0.01
EUR ASML HOLDING NV EURO.09	392.00	272 597.62	0.07
EUR ASR NEDERLAND N.V. EURO.16	152.00	7 272.57	0.00
EUR BE SEMICONDUCTOR EURO.01	83.00	9 906.10	0.00
EUR EURONEXT EUR1.60	94.00	10 494.19	0.00
EUR EXOR NV EURO.01	84.00	8 308.70	0.00
EUR FERRARI NV EURO.01(NEW)	120.00	52 180.50	0.01
EUR FERROVIAL SE EURO.01	502.00	20 688.89	0.01
EUR HEINEKEN HOLDING EUR1.6	140.00	8 872.08	0.00
EUR HEINEKEN NV EUR1.60	278.00	20 571.27	0.01
EUR IMCD NV EURO.16	56.00	8 404.82	0.00
EUR ING GROEP N.V. EURO.01	3 094.00	47 900.62	0.01
EUR JDE PEETS N.V. EURO.01	130.00	2 590.96	0.00
EUR KON KPN NV EURO.04	3 595.00	13 938.94	0.00
EUR KONINKLIJKE AHOLD EURO.01	918.00	31 657.17	0.01
EUR KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20	782.00	21 301.21	0.01
EUR NN GROUP N.V. EURO.12	249.00	11 563.84	0.00
EUR PROSUS N.V. EURO.05	1 335.00	54 356.54	0.02
EUR QIAGEN NV ORD EURO.01 (POST REV SPLT)	198.00	8 654.75	0.00
EUR RANDSTAD N.V. EURO.10	81.00	3 559.83	0.00
EUR STELLANTIS N V COM EURO.01	1 929.00	25 540.97	0.01
EUR UNIVERSAL MUSIC GR EUR10.00	815.00	19 634.92	0.01
EUR WOLTERS KLUWER EURO.12	236.00	39 371.12	0.01
オランダ合計		828 253.55	0.22
ニュージーランド			
NZD AUCKLAND INTL NPV	1 495.00	6 862.69	0.00
NZD FISHER & PAYKEL HE NPV	603.00	13 572.61	0.00
NZD INFRATIL LTD NPV	652.00	4 956.12	0.00
NZD MERCURY NZ LTD NPV	818.00	3 203.34	0.00
NZD MERIDIAN ENERGY LT NPV	1 494.00	5 488.25	0.00
AUD XERO LIMITED NPV	138.00	15 629.13	0.01
ニュージーランド合計		49 712.14	0.01
ノルウェー			
NOK AKER BP ASA NOK1	296.00	6 062.05	0.00
NOK DNB BANK ASA NOK12.50	823.00	17 175.07	0.01
NOK EQUINOR ASA NOK2.50	809.00	19 554.02	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
NOK GJENSIDIGE FORSIKR NOK2	196.00	3 482.16	0.00
NOK KONGSBERG GRUPPEN NOK5	88.00	10 340.53	0.01
NOK MOWI ASA NOK7.50	399.00	7 233.05	0.00
NOK NORSK HYDRO ASA NOK3.6666	1 405.00	8 680.57	0.00
NOK ORKLA ASA NOK1.25	651.00	6 000.76	0.00
NOK SALMAR ASA NOK0.25	75.00	3 894.25	0.00
NOK TELENOR ASA ORD NOK6	612.00	7 196.91	0.00
NOK YARA INTERNATIONAL NOK1.7	138.00	3 877.32	0.00
ノルウェー合計		93 496.69	0.03
ポーランド			
EUR INPOST S.A. EURO.01	212.00	3 712.50	0.00
ポーランド合計		3 712.50	0.00
ポルトガル			
EUR EDP ENERGIAS PORTU EUR1(REGD)	2 731.00	9 870.70	0.01
EUR GALP ENERGIA EUR1-B	420.00	6 891.39	0.00
EUR JERONIMO MARTINS EUR5	282.00	5 492.32	0.00
ポルトガル合計		22 254.41	0.01
シンガポール			
SGD CAPITALAND INVESTM NPV	1 700.00	3 461.75	0.00
SGD DBS GROUP HLDGS SGD1	1 920.00	60 765.75	0.02
SGD GENTING SING LTD NPV	8 500.00	4 850.26	0.00
USD GRAB HLDGS LTD COM USD0.000001 CL A	2 300.00	11 500.00	0.01
SGD KEPPEL LTD	1 200.00	6 023.94	0.00
SGD OVERSEA-CHINESE BK NPV	3 261.00	39 599.51	0.01
USD SEA LTD ADS EACH REP ONE CL A SHS	400.00	45 520.00	0.01
SGD SEMBCORP INDUSTRIE SGDO.25 (POST REORG)	1 000.00	3 893.63	0.00
SGD SINGAPORE AIRLINES NPV	1 500.00	7 060.01	0.00
SGD SINGAPORE EXCHANGE SGDO.01	700.00	6 641.55	0.00
SGD SINGAPORE TECH ENG NPV	1 500.00	5 034.87	0.00
SGD SINGAPORE TELECOMM NPV	7 900.00	18 267.26	0.01
SGD UTD O/S BANK SGD1	1 200.00	32 545.41	0.01
SGD WILMAR INTERNATIONAL LTD	2 200.00	5 054.26	0.00
シンガポール合計		250 218.20	0.07
スペイン			
EUR ACCIONA SA EUR1	28.00	3 557.70	0.00
EUR ACS ACTIVIDADES CO EURO.5	191.00	8 868.24	0.00
EUR AENA SME S.A. EUR10	74.00	16 006.92	0.00
EUR AMADEUS IT GROUP EURO.01	450.00	31 568.76	0.01
EUR BANCO SANTANDER SA EURO.50(REGD)	15 047.00	69 538.25	0.02
EUR BBVA(BILB-VIZ-ARG) EURO.49	5 680.00	53 608.99	0.01
EUR BCO DE SABADELL EURO.125	5 181.00	9 770.57	0.00
EUR CAIXABANK SA EUR1	3 750.00	20 382.02	0.01
EUR CELLNEX TELECOM SA EURO.25	522.00	18 734.41	0.01
EUR EDP RENOVAVEIS SA EUR5	285.00	3 335.27	0.00
EUR ENDESA SA EUR1.2	284.00	6 221.19	0.00
EUR GRIFOLS SA EURO.25 (CLASS A) POST SUBD	241.00	2 193.16	0.00
EUR IBERDROLA SA EURO.75 (POST SUBDIVISION)	5 969.00	85 047.14	0.02
EUR INDITEX EURO.03 (POST SUBD)	1 065.00	58 694.83	0.02
EUR REDEIA CORP SA EURO.5	397.00	7 086.36	0.00
EUR REPSOL SA EUR1	1 082.00	13 513.71	0.00
EUR TELEFONICA SA EUR1	3 803.00	17 215.70	0.01
スペイン合計		425 343.22	0.11

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
スウェーデン			
SEK ADDTECH AB SER'B'NPV (POST SPLIT)	208.00	5 714.89	0.00
SEK ALFA LAVAL AB NPV	280.00	11 906.38	0.00
SEK ASSA ABLOY SER'B'NPV (POST SPLIT)	970.00	29 751.58	0.01
SEK ATLAS COPCO AB SER'A'NPV (POST SPLIT)	2 534.00	40 415.99	0.01
SEK ATLAS COPCO AB SER'B'NPV (POST SPLIT)	1 529.00	21 579.09	0.01
SEK BEIJER REF AB SER'B'NPV (POST SPLIT)	414.00	6 521.57	0.00
SEK BOLIDEN AB NPV (POST SPLIT)	222.00	6 615.97	0.00
SEK EPIROC AB SER'A'NPV (POST SPLIT)	657.00	11 959.02	0.00
SEK EPIROC AB SER'B'NPV	381.00	6 277.39	0.00
SEK EQT AB NPV	353.00	10 684.87	0.00
SEK ERICSSON SER'B' NPV	2 590.00	21 035.29	0.01
SEK ESSITY AB SER'B'NPV	562.00	15 451.48	0.01
SEK EVOLUTION AB NPV	147.00	12 816.73	0.01
SEK FASTIGHETS AB BALD SER'B'NPV (POST SPLIT)	643.00	4 941.96	0.00
SEK GETINGE AB SER'B'NPV	188.00	2 934.80	0.00
SEK HENNES & MAURITZ SER'B'NPV	622.00	8 616.06	0.00
SEK HEXAGON AB SER'B'NPV (POST SPLIT)	1 845.00	15 704.43	0.01
SEK HOLMEN AB SER'B'NPV (POST SPLIT)	104.00	3 912.79	0.00
SEK INDUSTRIVARDEN AB SER'C'NPV	164.00	5 369.61	0.00
SEK INDUSTRIVARDEN AB SER'A'NPV	99.00	3 247.76	0.00
SEK INDUTRADE AB NPV	260.00	6 629.27	0.00
SEK INVESTOR AB SER'B'NPV (POST SPLIT)	1 614.00	44 234.47	0.01
SEK LATOUR INVESTMENT SER'B'NPV (POST SPLIT)	131.00	3 323.34	0.00
SEK LIFCO AB SER'B'NPV (POST SPLIT)	224.00	6 790.46	0.00
SEK LUNDBERGFÖRETAGEN SER'B'NPV	79.00	3 827.42	0.00
SEK NIBE INDUSTRIER AB SER'B'NPV (POST SPLIT)	1 608.00	6 806.74	0.00
SEK SAAB AB NPV B	295.00	6 453.13	0.00
SEK SAGAX AB NPV B	247.00	5 465.34	0.00
SEK SANDVIK AB NPV (POST SPLIT)	1 032.00	19 063.77	0.01
SEK SECURITAS SER'B'NPV	539.00	6 809.79	0.00
SEK SKAND ENSKILDA BKN SER'A'NPV	1 512.00	20 979.13	0.01
SEK SKANSKA AB SER'B'NPV	292.00	6 083.97	0.00
SEK SKF AB SER'B'NPV	299.00	5 736.91	0.00
USD SPOTIFY TECHNOLOGY COM EURO.000625	146.00	69 636.16	0.02
SEK SVENSKA CELLULOSA SER'B'NPV	555.00	7 202.54	0.00
SEK SVENSKA HANDELSBKN SER'A'NPV (P/S)	1 392.00	14 469.66	0.01
SEK SWEDBANK AB SER'A'NPV	828.00	16 212.92	0.01
SEK SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB NPV	191.00	5 289.79	0.00
SEK TELE2 AB SHS	513.00	5 377.20	0.00
SEK TELIA COMPANY AB NPV	2 182.00	6 384.82	0.00
SEK TRELLEBORG AB SER'B'NPV	187.00	6 175.76	0.00
SEK VOLVO AB SER'A'NPV (POST SPLIT)	194.00	4 850.51	0.00
SEK VOLVO AB SER'B'NPV (POST SPLIT)	1 576.00	39 202.08	0.01
スウェーデン合計		562 462.84	0.15
スイス			
CHF ABB LTD CHF0.12 (REGD)	1 543.00	88 061.34	0.03
CHF ADECCO GROUP AG CHF0.1 (REGD)	183.00	4 881.38	0.00
CHF ALCON AG CHF0.04	481.00	42 793.17	0.01
CHF AVOLTA AG CHF5 (REGD)	71.00	2 624.02	0.00
CHF BACHEM HOLDING AG CHF0.01 (REGD) (SUBD)	49.00	3 787.63	0.00
CHF BALOISE-HLDGS CHF0.1(REGD)	47.00	8 930.53	0.00
CHF BARRY CALLEBAUT AG CHF0.02 (REGD)	4.00	6 102.16	0.00
CHF BKW AG CHF2.5	19.00	3 265.15	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
CHF BQE CANT VAUDOISE CHF1	23.00	2 283.03	0.00
CHF CLARIANT CHF1.76 (REGD)	209.00	2 517.01	0.00
GBP COCA-COLA HBC AG ORD CHF6.70	225.00	8 019.05	0.00
EUR DSM FIRMENICH AG EURO.01	176.00	19 323.39	0.01
CHF EMS-CHEMIE HLDG AG CHFO.01(REGD)(POST RECON)	7.00	4 977.87	0.00
CHF GALDERMA GROUP AG CHFO.01	63.00	6 453.75	0.00
CHF GEBERIT CHFO.10(REGD)	33.00	19 867.42	0.01
CHF GIVAUDAN AG CHF10	9.00	39 646.99	0.01
GBP GLENCORE PLC ORD USD0.01	10 057.00	48 568.82	0.01
CHF HELVETIA HOLDING CHFO.02 (REGD) POST SUBD	34.00	5 958.68	0.00
CHF HOLCIM LTD CHF2 (REGD)	497.00	50 625.18	0.01
CHF JULIUS BAER GRUPPE CHFO.02 (REGD)	204.00	13 499.66	0.00
CHF KUEHNE&NAGEL INTL CHF1(REGD)(POST-SUBD)	45.00	10 757.09	0.00
CHF LINDT & SPRUENGLI PTG CERT CHF10	2.00	23 110.10	0.01
CHF LOGITECH INTL CHFO.25(REGD) (POST-SUBD)	147.00	11 930.19	0.00
CHF LONZA GROUP AG CHF1(REGD)	70.00	41 825.20	0.01
CHF NESTLE SA CHFO.10(REGD)	2 561.00	222 321.54	0.06
CHF NOVARTIS AG CHFO.49 (REGD)	1 856.00	196 491.62	0.05
CHF PARTNERS GROUP HLG CHFO.01 (REGD)	21.00	30 510.78	0.01
CHF RICHEMONT(CIE FIN) CHF1.00 (REG) SER 'A'	522.00	72 700.79	0.02
CHF ROCHE HLDGS AG CHF1(BR)	35.00	10 758.23	0.00
CHF ROCHE HLDGS AG GENUSSSCHEINE NPV	662.00	191 987.51	0.05
CHF SANDOZ GROUP AG CHFO.05	413.00	18 817.05	0.01
CHF SCHINDLER-HLDG AG CHFO.1(REGD)(POST-SUBD)	29.00	8 212.83	0.00
CHF SCHINDLER-HLDG AG PTG CERT CHFO.10(POST-SUBD)	39.00	11 261.75	0.00
CHF SGS SA CHFO.04 (REGD)	140.00	13 901.48	0.01
CHF SIG GROUP AG CHFO.01	344.00	6 801.91	0.00
CHF SIKA AG CHFO.01 (REG)	141.00	36 506.36	0.01
CHF SONOVA HOLDING AG CHFO.05 (REGD)	49.00	16 730.08	0.01
EUR STMICROELECTRONICS EUR1.04	692.00	17 738.71	0.01
CHF STRAUMANN HLDG CHFO.01 (REGD) (POST SPLIT)	103.00	13 404.03	0.00
CHF SWATCH GROUP CHF2.25(BR)	22.00	3 994.21	0.00
CHF SWISS LIFE HLDG CHF5.1(REGD)	26.00	21 301.70	0.01
CHF SWISS PRIME SITE CHF15.3 (REGD)	65.00	7 182.46	0.00
CHF SWISS RE AG CHFO.10	289.00	42 693.93	0.01
CHF SWISSCOM AG CHF1(REGD)	27.00	15 584.00	0.01
CHF TEMENOS AG CHF5 (REGD)	50.00	3 283.20	0.00
CHF UBS GROUP CHFO.10 (REGD)	3 102.00	100 278.05	0.03
CHF VAT GROUP AG CHFO.10	26.00	10 370.49	0.00
CHF ZURICH INSURANCE GRP CHFO.10	143.00	90 669.47	0.03
スイス合計		1 633 310.99	0.44

イギリス

GBP 3I GROUP ORD GBPO.738636	945.00	44 550.37	0.01
GBP ADMIRAL GROUP ORD GBPO.001	237.00	7 720.75	0.00
GBP ANGLO AMERICAN USD0.54945	1 232.00	39 469.36	0.01
GBP ANTOFAGASTA ORD GBPO.05	404.00	8 742.41	0.00
GBP ASHTEAD GROUP ORD GBPO.10	421.00	33 658.55	0.01
GBP ASSOCD BRIT FOODS ORD GBPO.0568	341.00	9 526.75	0.00
GBP ASTRAZENECA ORD USD0.25	1 460.00	196 930.39	0.05
GBP AUTO TRADER GROUP ORD GBPO.01	920.00	9 810.98	0.00
GBP AVIVA ORD GBPO.33	2 410.00	14 816.85	0.01
GBP BAE SYSTEMS ORD GBPO.025	2 934.00	45 758.03	0.01
GBP BARCLAYS ORD GBPO.25	13 743.00	46 080.68	0.01
GBP BARRATT REDROW PLC GBPO.10	1 137.00	6 181.05	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
GBP BERKELEY GP HLDGS ORD GBP0.05611047	109.00	5 746.82	0.00
GBP BP ORD USDO.25	15 798.00	77 237.91	0.02
GBP BRIT AMER TOBACCO ORD GBP0.25	1 960.00	74 438.79	0.02
GBP BT GROUP ORD GBP0.05	6 078.00	12 306.62	0.00
GBP BUNZL ORD GBP0.32142857	337.00	15 240.47	0.01
GBP CENTRICA ORD GBP0.061728395	5 372.00	8 698.98	0.00
USD COCA-COLA EUROPACI COM EURO.01	186.00	14 429.88	0.01
GBP COMPASS GROUP ORD GBP0.1105	1 590.00	54 384.29	0.02
GBP CRODA INTL ORD GBP0.10609756	112.00	4 911.34	0.00
GBP DIAGEO ORD GBP0.28 101/108	2 148.00	64 228.32	0.02
GBP ENDEAVOUR MINING P ORD USDO.01	228.00	4 474.50	0.00
GBP GSK PLC ORD GBP0.3125	4 029.00	68 366.16	0.02
GBP HALEON PLC ORD GBP1.25	7 464.00	35 510.28	0.01
GBP HALMA ORD GBP0.10	367.00	12 632.15	0.00
GBP HARGREAVES LANSDOW ORD GBP0.004 (WI)	330.00	4 586.65	0.00
GBP HIKMA PHARMACEUTIC ORD GBP0.10	184.00	4 499.72	0.00
GBP HSBC HLDGS ORD USDO.50(UK REG)	17 878.00	166 497.52	0.05
GBP IMPERIAL BRANDS PL GBP0.10	804.00	26 253.23	0.01
GBP INFORMA PLC (GB) ORD GBP0.001	1 246.00	13 566.22	0.00
GBP INTERCONTL HOTELS ORD GBP0.208521303	164.00	20 428.32	0.01
GBP INTERTEK GROUP ORD GBP0.01	161.00	9 650.78	0.00
GBP JD SPORTS FASHION ORD GBP0.0005	2 686.00	3 475.50	0.00
GBP KINGFISHER ORD GBP0.157142857	1 590.00	5 001.90	0.00
GBP LAND SECURITIES GP ORD GBP0.106666666	605.00	4 636.98	0.00
GBP LEGAL & GENERAL GP ORD GBP0.025	6 143.00	17 279.24	0.01
GBP LLOYDS BANKING GP ORD GBP0.1	62 771.00	42 333.96	0.01
GBP LONDON STOCK EXCH ORD GBP0.06918604	468.00	67 039.75	0.02
GBP M&G PLC ORD GBP0.05	1 908.00	4 806.68	0.00
GBP MARKS & SPENCER GP ORD GBP0.25	1 623.00	7 894.77	0.00
GBP MELROSE INDUST PLC ORD GBP0.001	1 180.00	8 615.08	0.00
GBP MONDI PLC ORD EURO.22(POST CONS)	482.00	7 293.55	0.00
GBP NATIONAL GRID ORD GBP0.12431289	4 575.00	57 720.22	0.02
GBP NATWEST GROUP PLC ORD GBP1.0769	6 416.00	32 840.41	0.01
GBP NEXT ORD GBP0.10	120.00	15 374.62	0.01
GBP PEARSON ORD GBP0.25	543.00	8 509.92	0.00
GBP PERSIMMON ORD GBP0.10	289.00	4 621.05	0.00
GBP PHOENIX GP HLDGS ORD GBP0.10	713.00	4 658.17	0.00
GBP PRUDENTIAL ORD GBP0.05	2 608.00	21 275.01	0.01
GBP RECKITT BENCK GRP ORD GBP0.10	665.00	41 079.06	0.01
GBP RELX PLC GBP0.1444	1 820.00	85 708.17	0.02
GBP RENTOKIL INITIAL ORD GBP0.01	2 629.00	13 159.18	0.00
GBP RIO TINTO ORD GBP0.10	1 057.00	66 321.88	0.02
GBP ROLLS-ROYCE HLDGS ORD GBP0.20	8 037.00	57 063.38	0.02
GBP SAGE GROUP GBP0.01051948	966.00	16 109.19	0.01
GBP SAINSBURY(J) ORD GBP0.28571428	1 662.00	5 517.81	0.00
GBP SCHROEDERS PLC ORD GBP0.20	834.00	3 341.30	0.00
GBP SEVERN TRENT ORD GBP0.9789	290.00	9 941.26	0.00
GBP SHELL PLC ORD EURO.07	5 843.00	188 008.06	0.05
GBP SMITH & NEPHEW ORD USDO.20	799.00	10 125.22	0.00
GBP SMITHS GROUP ORD GBP0.375	343.00	7 721.03	0.00
GBP SPIRAX GROUP PLC ORD GBP0.269230769	77.00	7 017.34	0.00
GBP SSE PLC ORD GBP0.50	1 032.00	23 237.18	0.01
GBP STANDARD CHARTERED ORD USDO.50	1 963.00	24 262.07	0.01
GBP TAYLOR WIMPEY ORD GBP0.01	3 545.00	5 902.69	0.00
GBP TESCO ORD GBP0.0633333	6 917.00	32 213.35	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
GBP UNILEVER PLC ORD GBP0.031111	2 440.00	145 795.03	0.04
GBP UNITED UTILITIES G ORD GBP0.05	651.00	9 263.35	0.00
GBP VODAFONE GROUP ORD USD0.2095238(POST CONS)	21 458.00	19 331.95	0.01
GBP WHITBREAD ORD GBP0.76797385	182.00	6 592.94	0.00
GBP WISE PLC CLS A ORD GBP0.01	610.00	6 838.50	0.00
GBP WPP PLC ORD GBP0.10	1 061.00	11 587.03	0.00
イギリス合計		2 270 848.90	0.61
アメリカ合衆国			
CAD BROOKFIELD RENEWA. CLASS A SUB VOTING SHARES	100.00	3 186.80	0.01
アメリカ合衆国合計		3 186.80	0.01
株式合計		18 165 548.61	4.86
投資信託証券			
アイルランド			
USD STAR COMPASS PLC/UBS DYNMC DIVERSIFIED LTD NOTE DUE 30.09.25	14 855 000.00	27 974 936.00	7.48
アイルランド合計		27 974 936.00	7.48
投資信託証券合計		27 974 936.00	7.48
コモディティ証券			
イギリス			
USD UBS AG/LONDON/UBS ETC CMC I COMPOSITE USD 16-PRP	10 247.00	1 559 542.17	0.42
イギリス合計		1 559 542.17	0.42
コモディティ証券合計		1 559 542.17	0.42
投資信託、クローズド・エンド型			
シンガポール			
SGD CAPITALAND ASCENDAS REIT- UNITS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4 700.00	9 185.10	0.00
SGD CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST REAL ESTATE INV TRUST	6 172.00	9 023.32	0.00
シンガポール合計		18 208.42	0.00
イギリス			
GBP SEGRO PLC REIT	1 172.00	11 619.43	0.01
イギリス合計		11 619.43	0.01
投資信託、クローズド・エンド型合計		29 827.85	0.01
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある証券および短期金融商品 合計		47 729 854.63	12.77
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券および短期金融商品			
財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 22.02.24-20.02.25	1 700 000.00	1 683 407.05	0.45
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 21.03.24-20.03.25	2 530 000.00	2 497 076.48	0.67
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 18.04.24-17.04.25	1 950 000.00	1 918 227.56	0.51
USD UNITED STATES TB 0.00000% 20.06.24-19.12.24	2 260 000.00	2 255 143.08	0.61
USD UNITED STATES TB 0.00000% 18.07.24-16.01.25	2 600 000.00	2 585 419.69	0.69
米ドル合計		10 939 273.86	2.93
財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン合計		10 939 273.86	2.93
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券および短期金融商品 合計		10 939 273.86	2.93

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
ルクセンブルグ2010年12月17日法(改訂済)の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs			
投資信託、オープン・エンド型			
アイルランド			
USD AMBIENTA X ALPHA FUND-ACCUM SHS -U2- HEDGED USD	1 680.56	1 681 210.38	0.45
USD AMUNDI TIEDEMANN ARBITRAGE STRATEGY FUND-PTG.SHS -I- USD	5 682.45	900 859.16	0.24
USD JUPITER MERIAN GLBL EQUITY ABSOLUTE RETURN-ACCUM SHS -I- USD	356 035.34	824 221.81	0.22
USD KEPLER LIQUID STRAT ICAV KLS ARETE MACRO-ACCUM SHS-SI-USD	8 866.33	1 351 193.53	0.36
USD LAZARD RATHMORE ALT FUND-ACCUM SHS-Z-USD	14 950.44	1 683 255.31	0.45
USD MAN FUNDS VI PLC-MAN AHL TARGETRISK-INU-USD-CAP	40 154.13	6 610 573.60	1.77
USD TAGES INTERNATIONAL FUND ICAV-KG-ACCUM SHS INSTITUTIONAL USD	19 705.17	2 117 085.49	0.57
EUR TAGES INTERNATIONAL FUNDS ICAV ACCUM SHS INSTIT. FD EUR	31.73	3 575.00	0.00
USD UBS(IRE)FUND SOLUTION PLC-MSCI USA SF UCITS SHS-A-ETF-ACC	299 519.00	51 744 902.44	13.84
アイルランド合計		66 916 876.72	17.90

ルクセンブルグ			
USD AQR UCITS FUNDS - GLOBAL RISK PARITY UCITS FUND-A2-CAP	38 433.65	5 110 138.10	1.37
USD FOCUSED SICAV - HIGH GRADE BOND USD U-X-ACC	6 194.00	63 926 044.16	17.10
USD FOCUSED SICAV - HIGH GRADE LONG TERM BOND USD U-X-ACC	5 199.00	49 253 662.32	13.18
USD INVESCO FDS SICAV-INVS BLNCD-RISK ALLC 12%-SHS(USD HDG)-CAP	326 340.00	3 583 213.20	0.96
USD LUMYNA - MW TOP ENVIRONMENTAL FOCUS MKT NEUTRAL UCITS FD-CAP	6 659.54	937 144.17	0.25
USD LUMYNA-MARSHALL WACE UCITS SIC ESG MKT NTRL TOPS B CAP-EQUAL	1 300.10	1 300.10	0.00
USD LUMYNA-PSAM GLOBAL EVENT UCITS FUND-SHS B-CAPITALISATION	9 368.46	1 203 565.80	0.32
USD SCHRODER GAIA EGERTON EQUITY-C USD HEDGED	2 739.00	865 880.07	0.23
USD SCHRODER GAIA SICAV - GAIA TWO SIGMA DIVERSIFIED-C-CAPITAL	16 767.51	2 500 538.77	0.67
USD SCHRODER GAIA SICAV - SCHRDR GAIA WELGTON PAGA-SHS-C USD-CAP	13 075.64	1 686 103.78	0.45
USD UBS (LUX) BD SICAV-USD INVES GRA CORPOR SUSTAI (USD) F-ACC	474.08	56 369 376.26	15.08
USD UBS (LUX) BOND FUND-EURO HIGH YIELD (EUR)(USD HEDGED) F-ACC	60 371.00	9 116 624.71	2.44
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD (USD) F-ACC	34 885.00	13 685 385.50	3.66
USD UBS (LUX) BOND SICAV - EMERG ECON CORPORATES (USD) F-ACC	92 612.00	12 123 836.92	3.24
USD UBS (LUX) EMERGING ECONOMIES FUND - GLOBAL BONDS (USD) F-ACC	8 316.00	18 037 237.68	4.83
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD U-X-ACC	10.00	126 485.80	0.03
USD WINTON ALMA DIVERSIFIED MACRO FUND-SHS -I1C-U-CAPITALISATIO	7 593.80	1 333 775.21	0.36
ルクセンブルグ合計		239 860 312.55	64.17
投資信託、オープン・エンド型合計		306 777 189.27	82.07
ルクセンブルグ2010年12月17日法(改訂済)の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs合計			
		306 777 189.27	82.07

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

株式に係るワラント債

カナダ

CAD CONSTELLATION SOFTWARE INC/CANADA CALL WARRANT 31.03.40	32.00	0.00	0.00
カナダ合計		0.00	0.00
株式に係るワラント債合計		0.00	0.00
公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引されていない派生商品合計			
		0.00	0.00
投資有価証券合計		365 446 317.76	97.77

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
派生商品			
公認の証券取引所に上場されている派生商品			
債券に係る金融先物			
USD US LONG BOND FUTURE 20.03.25	8.00	11 187.50	0.00
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 20.03.25	74.00	65 328.16	0.02
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 20.03.25	102.00	63 750.00	0.02
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.25	-214.00	-75 234.70	-0.02
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.25	-137.00	-58 867.26	-0.02
債券に係る金融先物合計		6 163.70	0.00
指数に係る金融先物			
EUR EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 20.12.24	51.00	-46 594.26	-0.01
CHF SWISS MARKET INDEX FUTURE 20.12.24	6.00	-23 359.82	-0.01
GBP FTSE 100 INDEX FUTURE 20.12.24	11.00	-13 212.56	0.00
SEK OMX 30 INDEX FUTURE 20.12.24	12.00	-4 418.05	0.00
HKD HANG SENG INDEX FUTURE 30.12.24	1.00	2 268.19	0.00
USD S&P500 EMINI FUTURE 20.12.24	83.00	1 455 352.50	0.39
CAD S&P/TSX 60 IX FUT FUTURE 19.12.24	5.00	83 855.30	0.02
USD MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 20.12.24	204.00	-157 080.00	-0.04
JPY TOPIX INDEX FUTURE 12.12.24	11.00	81 472.85	0.02
AUD SPI 200 INDEX FUTURES 19.12.24	5.00	21 823.57	0.01
指数に係る金融先物合計		1 400 107.72	0.38
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		1 406 271.42	0.38

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

指数に係るスワップおよび先渡スワップ

USD UBS/CMCI EXCESS RETURN INDEX TRS EQS REC PERF 24-02.04.25	9 731 268.20	-64 051.85	-0.02
USD UBS/CMCI EXCESS RETURN INDEX TRS EQS PAY 0.3800% 24-02.04.25			
指数に係るスワップおよび先渡スワップ合計		-64 051.85	-0.02
公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引されていない派生商品合計		-64 051.85	-0.02
派生商品合計		1 342 219.57	0.36

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 （注１）	純資産 比率 （％）
先渡為替契約			
購入通貨 / 購入額 / 売却通貨 / 売却額 / 満期日（日-月-年）			
USD 80 146.63	NOK 878 935.00	19.12.2024 634.68	0.00
USD 722 052.61	SEK 7 701 108.48	19.12.2024 15 960.34	0.00
USD 119 954.18	ILS 449 553.00	19.12.2024 -3 740.92	0.00
USD 272 898.48	SGD 358 930.00	19.12.2024 4 948.44	0.00
USD 1 575 521.92	AUD 2 380 000.00	19.12.2024 24 813.07	0.01
USD 607 215.17	HKD 4 715 867.54	19.12.2024 1 045.48	0.00
USD 583 157.35	DKK 3 984 906.00	19.12.2024 18 236.37	0.00
USD 2 287 106.52	CAD 3 171 000.00	19.12.2024 20 798.33	0.01
USD 4 377 357.25	JPY 662 607 527.00	19.12.2024 -46 388.17	-0.01
USD 2 841 884.90	GBP 2 188 980.69	19.12.2024 59 622.20	0.02
USD 6 776 561.98	EUR 6 211 120.23	19.12.2024 211 153.87	0.06
USD 1 948 135.12	CHF 1 673 000.00	19.12.2024 45 028.14	0.01
USD 149 656.23	NZD 249 383.00	19.12.2024 2 094.89	0.00
SGD 10 188 100.00	USD 7 630 089.58	13.1.2025 -16 467.86	-0.01
CHF 72 834 000.00	USD 83 145 819.35	13.1.2025 -65 961.87	-0.02
GBP 6 058 400.00	USD 7 767 742.42	13.1.2025 -67 674.79	-0.02
EUR 69 668 600.00	USD 74 217 283.79	13.1.2025 -495 851.64	-0.13
USD 241 298.43	CHF 211 500.00	13.1.2025 45.86	0.00
USD 720 195.17	EUR 679 700.00	13.1.2025 954.98	0.00
USD 27 611.62	SGD 36 900.00	13.1.2025 36.05	0.00
USD 516 293.35	EUR 486 600.00	13.1.2025 1 386.36	0.00
USD 374 121.21	CHF 329 600.00	13.1.2025 -1 844.97	0.00
CHF 322 300.00	USD 366 306.44	2.12.2024 -472.16	0.00
EUR 223 000.00	USD 235 872.01	2.12.2024 -339.41	0.00
USD 368 109.83	CHF 322 300.00	13.1.2025 470.57	0.00
USD 236 316.00	EUR 223 000.00	13.1.2025 343.42	0.00
EUR 420 000.00	USD 443 888.34	19.12.2024 68.84	0.00
先渡為替契約合計		-291 099.90	-0.08
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産		7 407 133.72	1.98
その他の資産および負債		-134 687.17	-0.03
純資産総額		373 769 883.98	100.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

2024年11月30日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある証券および短期金融商品

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
株式			
オーストラリア			
AUD ANZ GROUP HLDGS LI NPV	6 053.00	122 910.38	0.05
AUD APA GROUP NPV	2 537.00	11 932.70	0.00
AUD ARISTOCRAT LEISURE NPV	1 208.00	53 315.97	0.02
AUD ASX LTD NPV	408.00	17 558.19	0.01
AUD BHP GROUP LTD NPV	10 404.00	274 970.71	0.10
AUD BLUESCOPE STEEL NPV	749.00	10 798.02	0.00
AUD BRAMBLES LTD NPV	2 927.00	36 286.29	0.02
AUD CAR GROUP LTD NPV	781.00	21 114.47	0.01
AUD CMNWLTH BK OF AUST NPV	3 450.00	356 408.95	0.13
AUD COCHLEAR LTD NPV	124.00	24 576.45	0.01
AUD COLES GROUP LTD NPV	2 786.00	33 739.73	0.01
AUD COMPUTERSHARE LTD NPV(POST REC)	1 094.00	22 727.57	0.01
AUD CSL NPV	999.00	183 668.37	0.07
AUD ENDEAVOUR GROUP LI NPV	4 138.00	11 780.21	0.00
AUD FORTESCUE LTD NPV	3 470.00	42 927.49	0.02
AUD GOODMAN GROUP (STAPLED SECURITY)	3 599.00	88 882.59	0.03
AUD GPT GROUP NPV (STAPLED SECURITIES)	4 260.00	13 209.84	0.00
AUD INSURANCE AUST GRP NPV	5 013.00	27 856.58	0.01
AUD MACQUARIE GP LTD NPV	743.00	111 863.56	0.04
AUD MEDIBANK PRIVATE L NPV	6 292.00	15 657.89	0.01
AUD MINERAL RESS LTD NPV	422.00	9 245.29	0.00
AUD MIRVAC GROUP STAPLED SECURITIES	8 244.00	11 600.40	0.00
AUD NATL AUSTRALIA BK NPV	6 314.00	160 828.28	0.06
AUD NTHN STAR RES LTD NPV	2 225.00	25 380.33	0.01
AUD ORICA LIMITED NPV	985.00	11 620.79	0.00
AUD ORIGIN ENERGY NPV	3 371.00	23 870.93	0.01
AUD PRO MEDICUS NPV	119.00	19 527.16	0.01
AUD QANTAS AIRWAYS NPV	1 569.00	8 964.04	0.00
AUD QBE INS GROUP NPV	2 989.00	38 943.68	0.02
AUD RAMSAY HEALTH CARE NPV	342.00	8 820.49	0.00
AUD REA GROUP LIMITED NPV	114.00	18 679.95	0.01
AUD REECE AUSTRALIA NPV	535.00	8 971.05	0.00
AUD RIO TINTO LIMITED NPV	748.00	57 616.53	0.02
AUD SANTOS LIMITED NPV	6 434.00	27 705.35	0.01
AUD SCENTRE GROUP NPV STAPLED UNIT	11 808.00	28 307.74	0.01
AUD SEEK LIMITED NPV	834.00	14 191.23	0.01
AUD SGH LTD NPV	464.00	14 965.53	0.01
AUD SONIC HEALTHCARE NPV	890.00	16 564.61	0.01
AUD SOUL PATTINSON(WH) NPV	502.00	11 380.57	0.00
AUD SOUTH32 LTD NPV	10 587.00	25 656.47	0.01
AUD STOCKLAND NPV (STAPLED)	4 896.00	16 649.19	0.01
AUD SUNCORP GROUP LTD NPV	2 536.00	32 545.92	0.01
AUD TELSTRA GROUP LTD NPV	9 473.00	24 314.47	0.01
AUD THE LOTTERY CORPORA NPV	4 888.00	16 494.61	0.01
AUD TRANSURBAN GROUP STAPLED UNITS NPV	6 455.00	53 825.40	0.02
AUD TREASURY WINE ESTA NPV	1 668.00	12 311.39	0.00
AUD VICINITY LTD NPV (STAPLED SECURITY)	8 602.00	12 104.15	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
AUD WESFARMERS LTD NPV	2 327.00	108 888.83	0.04
AUD WESTPAC BKG CORP NPV	7 215.00	156 799.06	0.06
AUD WISETECH GLOBAL LT NPV	352.00	29 374.66	0.01
AUD WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	3 823.00	61 041.99	0.02
AUD WOOLWORTHS GRP LTD NPV	2 572.00	50 567.48	0.02
オーストラリア合計		2 599 943.53	0.96
オーストリア			
EUR ERSTE GROUP BK AG NPV	678.00	37 165.78	0.01
EUR OMV AG NPV(VAR)	364.00	14 578.60	0.01
EUR VERBUND AG CLASS'A'NPV	156.00	12 439.92	0.00
オーストリア合計		64 184.30	0.02
ベルギー			
EUR AGEAS NPV	354.00	17 857.22	0.01
EUR ANHEUSER-BUSCH IN NPV	1 844.00	99 212.41	0.04
EUR D'ETEREN GROUP NPV	42.00	8 951.93	0.00
EUR ELIA GROUP NPV	46.00	4 307.08	0.00
EUR GPE BRUXELLES LAM NPV	177.00	12 235.71	0.01
EUR KBC GROUP NV NPV	445.00	32 073.41	0.02
EUR LOTUS BAKERIES NPV	1.00	12 019.56	0.00
EUR SOFINA NPV	39.00	9 045.72	0.00
EUR SYENSQO SA NPV	141.00	10 463.41	0.00
EUR UCB NPV	267.00	52 269.70	0.02
EUR WAREHOUSES DE PAUW NPV (POST SPLIT)	308.00	6 805.48	0.00
ベルギー合計		265 241.63	0.10
バミューダ			
EUR AEGON LIMITED EURO.12	2 705.00	17 433.54	0.01
バミューダ合計		17 433.54	0.01
カナダ			
CAD 1ST QUANTUM MINLS COM NPV	1 554.00	21 232.03	0.01
CAD AGNICO EAGLE MINES LTD COM	997.00	84 066.58	0.03
CAD AIR CANADA VAR VTG SHS NPV	249.00	4 438.84	0.00
CAD ALIMENTATION COUCH COM NPV	1 588.00	92 899.39	0.03
CAD ALTAGAS LTD COM NPV	707.00	17 289.35	0.01
CAD ARC RESOURCES COM NPV	1 313.00	24 203.50	0.01
CAD BANK NOVA SCOTIA HALIFAX COM	2 479.00	141 376.39	0.05
CAD BANK OF MONTREAL COM NPV	1 502.00	143 211.08	0.05
CAD BARRICK GOLD CORP COM NPV	3 648.00	63 885.27	0.02
CAD BCE INC COM NEW	93.00	2 517.37	0.00
CAD BROOKFIELD ASSET.M CLASS A LTD VOTING SHS	738.00	42 330.31	0.02
CAD BROOKFIELD CORP CLASS A LID VOTING SHS	2 807.00	172 491.72	0.06
CAD CAE INC COM NPV	611.00	14 361.33	0.00
CAD CAMECO CORP COM	940.00	56 293.25	0.02
CAD CANADIAN NAT RES LTD COM	4 345.00	147 465.91	0.05
CAD CANADIAN NATL RY CO COM	1 115.00	124 500.30	0.05
CAD CANADIAN PAC KANS COM NPV	1 894.00	144 889.00	0.05
CAD CANADIAN TIRE LTD CL A	107.00	11 797.01	0.00
CAD CANADIAN UTILS LTD CL A	340.00	8 727.35	0.00
CAD CCL INDUSTRIES INC 'B'NON-VTG COM NPV	307.00	17 016.94	0.01
CAD CDN IMPERIAL BK OF COMMERCE COM	1 962.00	127 348.18	0.05
CAD CENOVUS ENERGY INC COM NPV	2 805.00	44 434.45	0.02
CAD CGI INC COM NPV SUB VOTING SHARES C	415.00	46 972.97	0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
CAD CONSTELLATION SOFT COM STK NPV	42.00	142 009.58	0.05
CAD DESCARTES SYSTEMS COM NPV	161.00	18 984.47	0.01
CAD DOLLARAMA INC COM NPV	573.00	59 683.83	0.02
CAD ELEMENT FLEET MGMT COM NPV	843.00	17 881.73	0.01
CAD EMERA INC COM	567.00	21 632.78	0.01
CAD EMPIRE LTD CL A	210.00	6 296.33	0.00
CAD ENBRIDGE INC COM NPV	4 453.00	192 635.22	0.07
CAD FAIRFAX FINL HLDGS SUB-VTG COM NPV	42.00	59 582.62	0.02
CAD FIRSTSERVICE CORP COM NPV	100.00	19 506.48	0.01
CAD FORTIS INC COM NPV	948.00	42 377.83	0.02
CAD FRANCO NEVADA CORP COM NPV	418.00	51 181.60	0.02
CAD GFL ENVIRON INC COM NPV SUB VTG SHS	400.00	18 972.25	0.01
CAD GILDAN ACTIVEWEAR INC COM	266.00	13 222.58	0.00
CAD GREAT WEST LIFE CO INC COM	534.00	19 225.75	0.01
CAD HYDRO ONE INC COM NPV	633.00	20 701.40	0.01
CAD IA FINANCIAL CORP COM NPV	197.00	18 829.78	0.01
CAD IGM FINANCIAL INC COM	183.00	6 183.43	0.00
CAD IMPERIAL OIL LTD COM NEW	415.00	30 733.39	0.01
CAD INTACT FINL CORP COM NPV	380.00	72 374.10	0.03
CAD IVANHOE MINES LTD COM NPV CL'A'	1 377.00	18 538.34	0.01
CAD KEYERA CORPORATION COM NPV	428.00	14 113.32	0.00
CAD KINROSS GOLD CORP COM NPV	2 773.00	27 152.68	0.01
CAD LOBLAW COS LTD COM	312.00	40 488.80	0.01
CAD LUNDIN MINING CORP COM	1 393.00	13 669.84	0.00
CAD MAGNA INTL INC COM NPV	498.00	22 631.68	0.01
CAD MANULIFE FINL CORP COM	3 641.00	117 201.64	0.04
CAD MEG ENERGY CORP COM NPV	571.00	10 276.90	0.00
CAD METRO INC CL A SUB	459.00	29 907.20	0.01
CAD NATL BK OF CANADA COM NPV	713.00	70 635.45	0.03
CAD NUTRIEN LTD NPV	975.00	45 541.55	0.02
CAD ONEX CORP SUB VTG	136.00	11 062.41	0.00
CAD OPEN TEXT CO COM NPV	554.00	16 871.45	0.01
CAD PAN AMER SILVER COM NPV	691.00	15 328.68	0.01
CAD PARKLAND CORP. COM NPV	300.00	7 745.60	0.00
CAD PEMBINA PIPELINE C COM NPV	1 212.00	49 929.05	0.02
CAD POWER CORP CDA COM	1 189.00	40 048.02	0.01
CAD QUEBECOR INC CL B	372.00	8 783.57	0.00
CAD RB GLOBAL INC COM NPV	396.00	39 126.27	0.01
CAD RESTAURANT BRANDS COM NPV	647.00	45 058.72	0.02
CAD ROGERS COMMUNICATIONS INC	769.00	27 461.34	0.01
CAD ROYAL BK OF CANADA COM NPV	2 914.00	366 625.18	0.14
CAD SAPUTO INC COM	517.00	9 637.32	0.00
CAD SHOPIFY INC COM NPV CL A	2 506.00	289 662.56	0.11
CAD STANTEC INC COM NPV	238.00	20 613.69	0.01
CAD SUN LIFE FINL INC COM	1 142.00	70 282.57	0.03
CAD SUNCOR ENERGY INC COM NPV 'NEW'	2 630.00	104 644.00	0.04
CAD TC ENERGY CORPORAT COM NPV	2 120.00	103 354.07	0.04
CAD TECK RESOURCES LTD CLASS'B'SUB-VTG COM NPV	939.00	43 839.90	0.02
CAD TELUS CORPORATION NPV	1 055.00	16 426.10	0.01
CAD TFI INTERNATIONAL COM NPV	184.00	28 013.63	0.01
CAD THOMSON-REUTERS CP NPV POST REV SPLIT	321.00	52 372.42	0.02
CAD TMX GROUP LTD COM NPV	535.00	16 915.65	0.01
CAD TOROMONT INDS LTD COM	200.00	16 426.81	0.01
CAD TORONTO-DOMINION COM NPV	3 604.00	203 938.81	0.07
CAD TOURMALINE OIL CP COM NPV	674.00	31 809.40	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
CAD WEST FRASER TIMBER COM NPV	106.00	10 411.11	0.00
CAD WESTON GEORGE LTD COM	131.00	21 055.99	0.01
CAD WHEATON PRECIOUS M COM NPV	960.00	59 733.03	0.02
CAD WSP GLOBAL INC COM NPV	258.00	45 876.70	0.02
カナダ合計		4 568 975.12	1.69
中国			
USD FUTU HOLDINGS LIM1 SPON ADS EA REP 8 ORD SHS	100.00	8 723.00	0.00
SGD YANGZIJANG SHIPBU NPV	2 100.00	3 775.03	0.00
中国合計		12 498.03	0.00
デンマーク			
DKK A.P. MOELLER-MAERSK SER'B'DKK1000	10.00	16 959.35	0.01
DKK A.P. MOLLER-MAERSK 'A'DKK1000	6.00	9 831.47	0.00
DKK CARLSBERG SER'B'DKK20	187.00	19 248.21	0.01
DKK COLOPLAST DKK1 B	271.00	34 135.02	0.01
DKK DANSKE BANK A/S DKK10	1 480.00	42 486.33	0.02
DKK DEMANT A/S DKK0.20	201.00	7 663.11	0.00
DKK DSV A/S DKK1	413.00	88 144.88	0.03
DKK GENMAB AS DKK1	138.00	29 824.10	0.01
DKK NOVO NORDISK A/S DKK0.1 B	6 644.00	712 576.29	0.27
DKK NOVONESIS B SER'B'DKK2	746.54	43 739.36	0.02
DKK ORSTED A/S DKK10	349.00	19 365.27	0.01
DKK PANDORA A/S DKK1	166.00	26 718.45	0.01
DKK ROCKWOOL A/S SER'B'DKK10	18.00	6 561.68	0.00
DKK TRYG A/S DKK5	797.00	18 353.24	0.01
DKK VESTAS WIND SYSTEM DKK0.20 (POST SPLIT)	2 152.00	33 433.56	0.01
DKK ZEALAND PHARMA AS DKK1	110.00	11 372.33	0.00
デンマーク合計		1 120 412.65	0.42
フィンランド			
EUR ELISA OYJ NPV	285.00	12 907.61	0.00
EUR FORTUM OYJ EUR3.40	857.00	12 912.16	0.00
EUR KESKO OYJ EUR2 SER'B'	653.00	12 976.68	0.00
EUR KONE CORPORATION NPV ORD 'B'	694.00	35 961.12	0.02
EUR METSO CORPORATION RG	1 207.00	10 614.26	0.00
EUR NESTE OIL OYJ NPV	954.00	14 514.69	0.01
EUR NOKIA OYJ NPV	11 191.00	47 037.42	0.02
SEK NORDEA HOLDING ABP NPV	6 646.00	75 079.71	0.03
EUR ORION CORP SER'B'NPV	199.00	9 399.42	0.00
EUR SAMPO PLC NPV A	963.00	41 234.07	0.02
EUR STORA ENSO OYJ NPV SER'R'	1 273.00	12 359.04	0.00
EUR UPM-KYMMENE CORP NPV	1 057.00	27 798.44	0.01
EUR WARTSILA OYJ ABP SER'B'EUR3.50	949.00	17 245.16	0.01
フィンランド合計		330 039.78	0.12
フランス			
EUR ACCOR EUR3	383.00	17 669.63	0.01
EUR ADP EUR3	68.00	7 864.47	0.00
EUR AIR LIQUIDE(L') EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)	1 180.00	196 020.58	0.07
EUR AIRBUS EUR1	1 199.00	186 867.59	0.07
EUR ALSTOM EUR7.00	657.00	14 773.63	0.01
EUR AMUNDI EUR2.5 (AIW)	123.00	8 009.11	0.00
EUR ARKEMA EUR10	143.00	11 327.75	0.00
EUR AXA EUR2.29	3 633.00	126 550.02	0.05

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR BIOMERIEUX NPV (POST SPLIT)	104.00	10 858.16	0.00
EUR BNP PARIBAS EUR2	2 076.00	124 192.90	0.05
EUR BOLLORE EURO.16	1 847.00	11 382.93	0.00
EUR BOUYGUES EUR1	413.00	12 283.69	0.00
EUR BUREAU VERITAS EURO.12	657.00	19 984.99	0.01
EUR CAPGEMINI EUR8	324.00	51 981.52	0.02
EUR CARREFOUR EUR2.50	1 123.00	17 080.02	0.01
EUR CIE DE ST-GOBAIN EUR4	936.00	85 356.00	0.03
EUR COVIVIO EUR3	104.00	5 711.93	0.00
EUR CREDIT AGRICOLE SA EUR3	2 081.00	27 848.05	0.01
EUR DANONE EURO.25	1 328.00	90 694.29	0.03
EUR DASSAULT AVIATION EURO.80 (POST SUBDIVISION)	42.00	8 357.50	0.00
EUR DASSAULT SYSTEMES EURO.10	1 329.00	45 830.47	0.02
EUR EDENRED EUR2	567.00	18 744.49	0.01
EUR EIFFAGE EUR4	164.00	14 792.71	0.01
EUR ENGIE EUR1	3 842.00	61 213.73	0.02
EUR ESSILORLUXOTTICA EURO.18	622.00	150 968.58	0.06
EUR EURAZEO NPV	80.00	5 876.70	0.00
EUR GECINA EUR7.50	84.00	8 459.53	0.00
EUR GETLINK SE EURO.40	588.00	9 604.47	0.00
EUR HERMES INTL NPV	65.00	141 768.45	0.05
EUR IPSEN EUR1	83.00	9 590.51	0.00
EUR KERING EUR4	142.00	33 108.17	0.01
EUR KLEPIERRE EUR1.40	465.00	14 056.23	0.01
EUR L'OREAL EURO.20	493.00	171 130.22	0.06
EUR LA FRANCAISE DES EURO.40 (PROMESSES)	174.00	6 873.33	0.00
EUR LEGRAND SA EUR4	552.00	55 317.17	0.02
EUR LVMH MOET HENNESSY EURO.30	568.00	355 453.55	0.13
EUR MICHELIN (CGDE) EURO.50 (POST SUBDIVISION)	1 385.00	44 982.24	0.02
EUR ORANGE EUR4	4 105.00	43 725.55	0.02
EUR PERNOD RICARD EUR1.55	430.00	48 096.18	0.02
EUR PUBLICIS GROUPE SA EURO.40	489.00	53 042.68	0.02
EUR RENAULT SA EUR3.81	391.00	16 737.84	0.01
EUR REXEL EUR5	387.00	9 989.84	0.00
EUR SAFRAN EURO.20	732.00	170 477.02	0.06
EUR SANOFI EUR2	2 340.00	227 601.17	0.09
EUR SARTORIUS STEDIM B EURO.20 (POST SUBD)	67.00	12 762.54	0.00
EUR SCHNEIDER ELECTRIC EUR8	1 124.00	289 075.60	0.11
EUR SEB SA EUR1	70.00	6 639.27	0.00
EUR SOC GENERALE EUR1.25	1 441.00	38 194.20	0.01
EUR SODEXO EUR4	179.00	14 860.10	0.01
EUR TELEPERFORMANCE EUR2.50	102.00	9 590.34	0.00
EUR THALES EUR3	192.00	28 694.84	0.01
EUR TOTALENERGIES SE EUR2.5	4 450.00	258 363.95	0.10
EUR UNIBAIL-RODAMCO-WE NPV(1 ORD UNIBAIL-R & 1CLS)	216.00	17 694.48	0.01
EUR VEOLIA ENVIRONNEME EUR5	1 391.00	40 505.13	0.02
EUR VINCI EUR2.50	1 045.00	110 218.38	0.04
EUR VIVENDI SA EUR5.50	1 508.00	13 840.99	0.01
フランス合計		3 592 695.41	1.33

ドイツ

EUR ADIDAS AG NPV (REGD)	335.00	78 938.80	0.03
EUR ALLIANZ SE NPV(REGD)(VINKULIERT)	804.00	248 131.80	0.09
EUR BASF SE NPV	1 834.00	82 170.54	0.03
EUR BAYER AG NPV (REGD)	2 043.00	41 835.74	0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG EUR1	582.00	43 041.88	0.02
EUR BAYERISCHE MOTORENWERKE AG EUR1	118.00	8 038.74	0.00
EUR BECHTLE AG NPV	220.00	7 226.52	0.00
EUR BEIERSDORF AG NPV	198.00	25 649.50	0.01
EUR BRENNTAG AG	277.00	17 846.61	0.01
EUR CARL ZEISS MEDITEC NPV	111.00	6 629.82	0.00
EUR COMMERZBANK AG NPV	2 047.00	31 403.66	0.01
EUR CONTINENTAL AG ORD NPV	246.00	16 119.56	0.01
EUR COVESTRO AG NPV	359.00	21 886.03	0.01
EUR CTS EVENTIM NPV	131.00	11 560.16	0.00
EUR DAIMLER TRUCK HOLD NPV (YOUNG SHARE)	969.00	36 639.79	0.01
EUR DELIVERY HERO SE NPV	361.00	14 771.10	0.01
EUR DEUTSCHE BANK AG NPV(REGD)	3 826.00	64 955.37	0.03
EUR DEUTSCHE BOERSE AG NPV(REGD)	402.00	94 047.22	0.04
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA ORD NPV (REGD)(VINK)	1 115.00	7 461.67	0.00
EUR DEUTSCHE POST AG NPV(REGD)	2 135.00	78 405.90	0.03
EUR DEUTSCHE TELEKOM NPV(REGD)	7 172.00	229 373.01	0.09
EUR DR.ING. F.PORSCHE NON-VTG PRF NPV	256.00	15 974.48	0.01
EUR E.ON SE NPV	4 685.00	60 295.00	0.02
EUR EVONIK INDUSTRIES NPV	595.00	10 912.85	0.00
EUR FRESENIUS MED CARE NPV	395.00	17 355.48	0.01
EUR FRESENIUS SE & CO. KGAA NPV	922.00	32 398.87	0.01
EUR GEA GROUP AG NPV	328.00	16 393.24	0.01
EUR HANNOVER RUECKVERS ORD NPV(REGD)	130.00	33 928.31	0.01
EUR HEIDELBERG MATER NPV	278.00	35 058.66	0.01
EUR HENKEL AG & CO KGAA	224.00	16 998.91	0.01
EUR HENKEL AG&CO. KGAA NON-VTG PRF NPV	360.00	30 707.54	0.01
EUR INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)	2 750.00	89 503.71	0.03
EUR KNORR BREMSE AG NPV	149.00	11 354.52	0.00
EUR LEG IMMOBILIEN SE NPV	135.00	12 510.58	0.00
EUR MERCEDES-BENZ ORD NPV(REGD)	1 465.00	81 946.76	0.03
EUR MERCK KGAA NPV	275.00	41 128.43	0.02
EUR MTU AERO ENGINES H NPV (REGD)	114.00	38 795.07	0.02
EUR MUENCHENER RUECKVE NPV(REGD)	273.00	142 527.75	0.05
EUR NEMETSCHEK SE ORD NPV	119.00	12 342.54	0.00
EUR PORSCHE AUTO HL SE NON VTG PRF NPV	277.00	10 128.68	0.00
EUR PUMA SE NPV	191.00	8 936.83	0.00
EUR RATIONAL AG NPV	11.00	10 282.11	0.00
EUR RHEINMETALL AG NPV	90.00	59 164.10	0.02
EUR RWE AG (NEU) NPV	1 330.00	44 769.26	0.02
EUR SAP AG ORD NPV	2 148.00	510 234.59	0.19
EUR SARTORIUS AG NON VTG PRF NPV	55.00	12 652.22	0.00
EUR SCOUT24 SE NPV	150.00	13 474.47	0.00
EUR SIEMENS AG NPV(REGD)	1 543.00	298 498.89	0.11
EUR SIEMENS ENERGY AG NPV	1 324.00	71 346.82	0.03
EUR SIEMENS HEALTHINEE NPV	549.00	29 758.10	0.01
EUR SYMRISE AG NPV (BR)	271.00	29 911.06	0.01
EUR TALANX AG NPV	164.00	13 891.99	0.01
EUR VOLKSWAGEN AG NON VTG PRF NPV	428.00	36 489.77	0.01
EUR VONOVIA SE NPV	1 502.00	49 813.35	0.02
EUR ZALANDO SE NPV	461.00	14 324.84	0.01
ドイツ合計		3 079 943.20	1.14

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
香港			
HKD AIA GROUP LTD NPV	22 600.00	168 885.38	0.07
HKD BOC HONG KONG HLDG HKD5	7 500.00	23 035.26	0.01
HKD CK ASSET HOLDINGS HKD1	4 500.00	18 389.65	0.01
HKD CK HUTCHISON HLDGS HKD1.0	6 000.00	31 227.71	0.01
HKD CK INFRASTRUCTURE HKD1	1 500.00	10 332.13	0.00
HKD CLP HOLDINGS HKD5	3 000.00	25 174.93	0.01
HKD GALAXY ENTERTAINME HKD0.10	4 000.00	17 759.96	0.01
HKD HANG SENG BANK HKD5	1 700.00	20 197.13	0.01
HKD HENDERSON LAND DEV HKD2	3 000.00	9 406.87	0.00
HKD HKT TRUST AND HKT SHARE STAPLED UNIT	9 000.00	11 184.15	0.00
HKD HONG KONG EXCHANGE HKD1	2 400.00	89 380.65	0.04
USD HONGKONG LAND HLD ORD USD0.10(SINGAPORE REG)	2 300.00	10 465.00	0.00
HKD HONGKONG&CHINA GAS HKD0.25	26 350.00	19 978.67	0.01
USD JARDINE MATHESON COM USD0.25(BERMUDA REG)	300.00	13 098.00	0.00
HKD MTR CORP HKD1	3 500.00	12 256.56	0.00
HKD POWER ASSETS HOLDINGS LTD HKD1	3 000.00	19 661.89	0.01
HKD SINO LAND CO HKD1	8 974.00	8 787.69	0.00
HKD SITC INTERNATIONAL HKD0.10	2 000.00	5 204.62	0.00
HKD SUN HUNG KAI PROP NPV	3 000.00	29 781.98	0.01
HKD SWIRE PACIFIC 'A'HKD0.60	1 000.00	8 231.01	0.00
HKD TECHTRONIC INDUSTR NPV	3 000.00	42 253.79	0.02
HKD THE LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5 679.00	24 703.84	0.01
HKD WH GROUP LTD USD0.0001	17 326.00	13 737.81	0.01
HKD WHARF REAL ESTATE HKD0.1	4 000.00	10 717.66	0.00
HKD WHARF(HLDGS) HKD1	3 000.00	8 231.01	0.00
香港合計		652 083.35	0.24
アイルランド			
EUR AIB GROUP PLC ORD EURO0.625	3 062.00	16 655.53	0.01
EUR BANK OF IRELAND GR EUR1	2 374.00	20 781.48	0.01
GBP DCC ORD EURO.25	216.00	15 717.80	0.01
GBP EXPERIAN ORD USD0.10	1 873.00	89 299.18	0.03
AUD JAMES HARDIE ID PLC CUFS EURO.5	910.00	33 322.38	0.01
EUR KERRY GROUP 'A'ORD EURO.125(DUBLIN LIST)	334.00	32 260.89	0.01
EUR KINGSPAN GROUP ORD EURO.13(DUBLIN LISTING)	346.00	26 019.70	0.01
アイルランド合計		234 056.96	0.09
マン島			
GBP ENTAIN PLC ORD EURO.01	1 100.00	11 263.54	0.00
マン島合計		11 263.54	0.00
イスラエル			
ILS AZRIELI GROUP ILS0.01	67.00	5 362.73	0.00
ILS BANK HAPOALIM B.M. ILS1	2 684.00	30 762.66	0.01
ILS BK LEUMI LE ISRAEL ILS1	3 253.00	36 953.20	0.02
USD CHECK POINT SFTWRE ORD ILS0.01	179.00	32 578.00	0.01
USD CYBER-ARK SOFTWARE COM ILS0.01	100.00	32 351.00	0.01
ILS ELBIT SYSTEMS LTD ILS1	51.00	12 372.48	0.00
USD GLOBAL-E ONLINE LT COM NPV	200.00	10 456.00	0.00
ILS ICL GROUP LTD ILS1	962.00	4 339.47	0.00
ILS ISRAEL DISCOUNT BK ILS0.10 SER'A'	2 447.00	16 059.14	0.01
ILS MIZRAHI TEFAHOT BK ILS0.01	355.00	15 300.84	0.01
USD MONDAY COM LTD COM NPV	100.00	28 536.00	0.01
ILS NICE LTD ILS1	141.00	25 348.31	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD TEVA PHARMA IND ADR(CNV 1 ORD ILS0.10)	2 300.00	38 594.00	0.02
USD WIX.COM LTD COM ILS0.01	105.00	23 492.70	0.01
イスラエル合計		312 506.53	0.12
イタリア			
EUR AMPLIFON EURO.02	234.00	5 939.03	0.00
EUR BANCO BPM NPV	2 435.00	18 527.59	0.01
EUR BPER BANCA EUR3	1 444.00	8 812.33	0.00
EUR DAVIDE CAMPARI MIL EURO.01	1 187.00	7 118.57	0.00
EUR DIASORIN SPA EUR1	40.00	4 469.84	0.00
EUR ENEL EUR1	16 542.00	118 982.01	0.05
EUR ENI SPA EUR1	4 552.00	64 453.66	0.03
EUR FINECOBANK SPA EURO.33	1 181.00	18 947.58	0.01
EUR GENERALI SPA NPV EUR1	1 989.00	56 889.17	0.02
EUR INFRASTRUTTURE WIR NPV	656.00	6 755.46	0.00
EUR INTESA SANPAOLO NPV	30 285.00	116 016.92	0.04
EUR LEONARDO SPA EUR4.40	785.00	21 117.61	0.01
EUR MEDIOBANCA SPA EURO.5	1 059.00	15 441.12	0.01
EUR MONCLER SPA NPV	490.00	23 987.89	0.01
EUR NEXI SPA NPV	953.00	5 640.75	0.00
EUR POSTE ITALIANE SPA NPV	929.00	13 035.38	0.00
EUR PRYSMIAN SPA EURO.10	536.00	35 337.41	0.01
EUR RECORDATI EURO.125	243.00	13 230.65	0.00
EUR SNAM EUR1	3 951.00	18 411.48	0.01
EUR TELECOM ITALIA SPA EURO.55	22 963.00	5 512.83	0.00
EUR TERNA SPA ORD EURO.22	3 034.00	25 661.72	0.01
EUR UNICREDIT SPA NPV (POST REV SPLIT)	3 085.00	118 556.05	0.05
EUR UNIPOL GRUPPO FIN NPV PRIV (POST CONSOLID)	505.00	6 091.21	0.00
イタリア合計		728 936.26	0.27
日本			
JPY アドバンテスト	1 600.00	87 785.07	0.03
JPY イオン	1 400.00	33 502.68	0.01
JPY A G C	400.00	12 491.26	0.00
JPY アイシン	1 200.00	12 608.45	0.00
JPY 味の素	1 000.00	41 828.41	0.02
JPY A N A ホールディングス	300.00	5 770.88	0.00
JPY アサヒグループホールディングス	3 000.00	32 549.86	0.01
JPY 旭化成	2 900.00	20 622.57	0.01
JPY アシックス	1 500.00	29 993.01	0.01
JPY アステラス製薬	3 600.00	37 429.84	0.02
JPY バンダイナムコホールディングス	1 200.00	25 248.86	0.01
JPY ブリヂストン	1 200.00	42 739.29	0.02
JPY ブラザー工業	500.00	8 772.51	0.00
JPY キヤノン	1 900.00	61 585.38	0.02
JPY カプコン	800.00	18 675.63	0.01
JPY 東海旅客鉄道	1 600.00	32 887.44	0.01
JPY 千葉銀行	1 200.00	9 991.68	0.00
JPY 中部電力	1 500.00	15 810.50	0.01
JPY 中外製薬	1 400.00	61 505.48	0.02
JPY コンコルディア・フィナンシャルグループ	2 400.00	14 345.51	0.01
JPY 大日本印刷	800.00	12 171.66	0.00
JPY 第一生命ホールディングス	1 800.00	48 552.12	0.02
JPY ダイフク	700.00	14 528.08	0.01
JPY 第一三共	3 600.00	113 835.60	0.04

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
JPY ダイキン工業	500.00	60 242.37	0.02
JPY 大東建託	100.00	11 136.27	0.00
JPY 大和ハウス工業	1 200.00	37 593.63	0.02
JPY 大和証券グループ	3 100.00	20 754.74	0.01
JPY デンソー	4 000.00	56 703.40	0.02
JPY 電通グループ	400.00	10 184.77	0.00
JPY ディスコ	200.00	54 066.65	0.02
JPY 東日本旅客鉄道	1 900.00	36 941.11	0.01
JPY エーザイ	500.00	15 547.49	0.01
JPY E N E O S ホールディングス	6 100.00	32 850.68	0.01
JPY ファナック	2 000.00	51 762.83	0.02
JPY ファーストリテイリング	400.00	136 125.45	0.05
JPY 富士電機	300.00	16 825.25	0.01
JPY 富士フイルムホールディングス	2 300.00	51 670.94	0.02
JPY フジクラ	500.00	17 718.15	0.01
JPY 富士通	3 400.00	64 882.65	0.03
JPY 阪急阪神ホールディングス	500.00	13 669.81	0.01
JPY 日立建機	300.00	6 747.68	0.00
JPY 日立製作所	9 600.00	239 768.29	0.09
JPY 本田技研工業	9 400.00	80 834.30	0.03
JPY ホシザキ	200.00	8 063.39	0.00
JPY H O Y A	700.00	89 769.28	0.03
JPY ヒューリック	700.00	6 287.58	0.00
JPY 出光興産	1 860.00	12 381.01	0.00
JPY I N P E X	1 800.00	23 658.82	0.01
JPY いすゞ自動車	1 100.00	14 626.63	0.01
JPY 伊藤忠商事	2 400.00	117 998.47	0.04
JPY 日本航空	400.00	6 646.47	0.00
JPY 日本取引所グループ	2 000.00	24 017.05	0.01
JPY ゆうちょ銀行	3 029.00	28 558.54	0.01
JPY 日本郵政	4 100.00	40 935.85	0.02
JPY かんぽ生命保険	500.00	10 450.44	0.00
JPY ジャパンリアルエステイト投資法人	3.00	11 066.35	0.00
JPY 日本たばこ産業	2 500.00	70 230.05	0.03
JPY J F E ホールディングス	1 200.00	13 655.16	0.01
JPY 鹿島建設	900.00	16 377.80	0.01
JPY 関西電力	1 500.00	19 231.28	0.01
JPY 花王	1 000.00	43 373.17	0.02
JPY 川崎汽船	900.00	11 940.27	0.00
JPY K D D I	3 200.00	105 469.92	0.04
JPY キーエンス	400.00	172 374.07	0.06
JPY キッコーマン	1 500.00	16 394.78	0.01
JPY キリンホールディングス	1 700.00	23 651.83	0.01
JPY 神戸物産	300.00	7 536.70	0.00
JPY K O K U S A I E L E C T R I C	300.00	4 953.89	0.00
JPY 小松製作所	1 900.00	50 933.18	0.02
JPY コナミグループ	200.00	19 675.73	0.01
JPY クボタ	1 800.00	22 448.31	0.01
JPY 京セラ	2 600.00	25 509.21	0.01
JPY 協和キリン	500.00	8 276.46	0.00
JPY レーザーテック	200.00	21 893.00	0.01
JPY L I N E ヤフー	5 100.00	13 987.35	0.01
JPY エムスリー	1 000.00	9 654.76	0.00
JPY マキタ	500.00	15 594.10	0.01
JPY 丸紅	3 000.00	45 024.47	0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
JPY マツキヨココカラ&カンパニー	600.00	8 385.66	0.00
JPY 日本マクドナルドホールディングス	200.00	8 243.16	0.00
JPY 明治ホールディングス	400.00	8 522.82	0.00
JPY ミネベアミツミ	700.00	11 414.59	0.00
JPY 三菱ケミカルグループ	2 900.00	15 156.04	0.01
JPY 三菱商事	6 900.00	116 029.90	0.04
JPY 三菱電機	4 000.00	67 836.34	0.03
JPY 三菱地所	2 200.00	31 047.71	0.01
JPY 三菱H C キャピタル	1 400.00	9 415.05	0.00
JPY 三菱重工業	6 500.00	95 107.70	0.04
JPY 三菱U F J フィナンシャル・グループ	22 900.00	273 241.67	0.10
JPY 三井物産	5 200.00	108 580.75	0.04
JPY 三井化学	400.00	9 239.27	0.00
JPY 三井不動産	5 500.00	45 923.36	0.02
JPY 商船三井	700.00	23 905.85	0.01
JPY みずほフィナンシャルグループ	5 040.00	126 985.78	0.05
JPY M o n o t a R O	600.00	10 660.85	0.00
JPY M S & A D インシュアランス グループ ホールディングス	2 700.00	60 063.92	0.02
JPY 村田製作所	3 600.00	60 165.80	0.02
JPY 日本電気	500.00	42 431.00	0.02
JPY ネクソン	800.00	10 965.14	0.00
JPY ニデック	1 800.00	33 019.28	0.01
JPY 任天堂	2 100.00	123 188.07	0.05
JPY 日本ビルファンド投資法人	15.00	12 534.54	0.00
JPY 日本ペイントホールディングス	1 900.00	12 948.36	0.00
JPY 日本酸素ホールディングス	400.00	11 630.99	0.00
JPY 日本製鉄	1 900.00	38 699.60	0.02
JPY 日本電信電話	63 200.00	64 552.92	0.03
JPY 日本郵船	900.00	28 740.55	0.01
JPY 日産自動車	5 200.00	12 426.54	0.00
JPY 日清食品ホールディングス	400.00	10 594.93	0.00
JPY ニトリホールディングス	200.00	25 601.76	0.01
JPY 日東電工	1 500.00	23 850.58	0.01
JPY 野村ホールディングス	6 400.00	38 412.36	0.02
JPY 野村総合研究所	800.00	24 401.90	0.01
JPY N T T データグループ	1 300.00	25 085.06	0.01
JPY 大林組	1 400.00	19 902.12	0.01
JPY オービック	500.00	16 329.86	0.01
JPY オリンパス	2 400.00	37 713.49	0.02
JPY オムロン	400.00	12 693.68	0.00
JPY 小野薬品工業	600.00	6 919.47	0.00
JPY 日本オラクル	100.00	10 200.75	0.00
JPY オリエンタルランド	2 200.00	51 826.75	0.02
JPY オリックス	2 400.00	53 805.64	0.02
JPY 大阪ガス	800.00	17 493.09	0.01
JPY 大塚商会	400.00	9 939.74	0.00
JPY 大塚ホールディングス	800.00	46 262.94	0.02
JPY パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	800.00	20 278.99	0.01
JPY パナソニック	4 700.00	45 862.44	0.02
JPY 楽天グループ	3 500.00	20 004.66	0.01
JPY リクルートホールディングス	2 900.00	200 529.35	0.08
JPY ルネサスエレクトロニクス	3 400.00	44 451.18	0.02
JPY りそなホールディングス	4 100.00	34 124.58	0.01
JPY リコー	1 000.00	11 332.69	0.00
JPY S B I ホールディングス	600.00	15 101.38	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
JPY S C R E E Nホールディングス	100.00	6 260.28	0.00
JPY S C S K	300.00	6 048.54	0.00
JPY セコム	800.00	27 821.69	0.01
JPY セイコーエプソン	600.00	10 624.90	0.00
JPY 積水化学工業	600.00	9 664.08	0.00
JPY 積水ハウス	1 300.00	30 642.21	0.01
JPY セブン&アイ・ホールディングス	4 500.00	78 023.77	0.03
JPY S Gホールディングス	700.00	6 856.21	0.00
JPY 島津製作所	500.00	14 026.03	0.01
JPY シマノ	200.00	27 898.92	0.01
JPY 信越化学工業	3 700.00	136 829.91	0.05
JPY 塩野義製薬	1 500.00	21 163.90	0.01
JPY 資生堂	900.00	17 111.90	0.01
JPY しずおかフィナンシャルグループ	800.00	7 095.25	0.00
JPY S M C	100.00	42 307.82	0.02
JPY ソフトバンク	58 900.00	75 730.53	0.03
JPY ソフトバンクグループ	2 000.00	118 999.90	0.05
JPY S O M P Oホールディングス	1 900.00	49 921.10	0.02
JPY ソニーグループ	12 800.00	256 281.25	0.10
JPY S U B A R U	1 300.00	20 830.64	0.01
JPY 住友商事	2 100.00	44 856.68	0.02
JPY 住友電気工業	1 600.00	30 746.08	0.01
JPY 住友金属鉱山	500.00	12 304.82	0.00
JPY 三井住友フィナンシャルグループ	7 700.00	188 981.59	0.07
JPY 三井住友トラストグループ	1 400.00	34 919.60	0.01
JPY 住友不動産	600.00	18 529.15	0.01
JPY サントリー食品インターナショナル	300.00	10 173.45	0.00
JPY スズキ	3 200.00	33 803.64	0.01
JPY シスメックス	1 000.00	21 067.35	0.01
JPY T & Dホールディングス	900.00	16 977.06	0.01
JPY 大成建設	300.00	13 005.96	0.00
JPY 武田薬品工業	3 309.00	89 960.03	0.03
JPY T D K	4 000.00	51 376.64	0.02
JPY テルモ	2 700.00	54 850.35	0.02
JPY T I S	400.00	9 758.63	0.00
JPY 東宝	200.00	8 713.25	0.00
JPY 東京海上ホールディングス	3 900.00	144 485.80	0.05
JPY 東京電力ホールディングス	3 000.00	10 710.79	0.00
JPY 東京エレクトロン	900.00	139 687.72	0.05
JPY 東京ガス	700.00	21 020.74	0.01
JPY 東急	900.00	10 487.07	0.00
JPY T O P P A Nホールディングス	500.00	13 340.21	0.00
JPY 東レ	2 500.00	15 885.41	0.01
JPY T O T O	300.00	8 052.07	0.00
JPY 豊田自動織機	300.00	22 272.53	0.01
JPY トヨタ自動車	21 200.00	360 167.79	0.13
JPY 豊田通商	1 300.00	22 081.43	0.01
JPY トレンドマイクロ	300.00	16 437.73	0.01
JPY ユニ・チャーム	700.00	18 135.63	0.01
JPY 西日本旅客鉄道	1 000.00	18 746.88	0.01
JPY ヤクルト本社	600.00	12 204.95	0.00
JPY ヤマハ発動機	1 700.00	14 720.84	0.01
JPY 安川電機	500.00	13 047.24	0.00
JPY 横河電機	500.00	11 096.31	0.00
JPY ゼンショーホールディングス	200.00	12 013.18	0.00
JPY Z O Z O	240.00	7 531.51	0.00
日本合計		7 743 975.14	2.87

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
ルクセンブルグ			
EUR ARCELORMITTAL NPV(POST STOCK SPLIT)	957.00	24 097.08	0.01
EUR CVC CAPITAL PARTNE ORD NPV	269.00	6 583.01	0.00
EUR EUROFINS SCIENTIFI EURO.01	313.00	15 468.33	0.00
EUR TENARIS S.A. USD1	906.00	17 377.62	0.01
ルクセンブルグ合計		63 526.04	0.02
マカオ			
HKD SANDS CHINA LTD USD0.01 REG'S'	5 200.00	13 258.03	0.00
マカオ合計		13 258.03	0.00
オランダ			
EUR ABN AMRO BANK N.V. DR EACH REP SHS	863.00	13 412.74	0.00
EUR ADYEN NV EURO.01	45.00	65 513.97	0.02
USD AERCAP HOLDINGS EURO.01	399.00	39 644.64	0.01
EUR AKZO NOBEL NV EURO.50(POST REV SPLIT)	346.00	20 209.12	0.01
EUR ARGEN X NV EURO.10	120.00	74 322.68	0.03
EUR ASM INTL NV EURO.04	95.00	51 313.36	0.02
EUR ASML HOLDING NV EURO.09	827.00	575 097.52	0.21
EUR ASR NEDERLAND N.V. EURO.16	364.00	17 415.89	0.01
EUR BE SEMICONDUCTOR EURO.01	163.00	19 454.15	0.01
EUR EURONEXT EUR1.60	185.00	20 653.46	0.01
EUR EXOR NV EURO.01	205.00	20 277.19	0.01
EUR FERRARI NV EURO.01(NEW)	258.00	112 188.09	0.04
EUR FERROVIAL SE EURO.01	1 053.00	43 397.21	0.02
EUR HEINEKEN HOLDING EUR1.6	279.00	17 680.79	0.01
EUR HEINEKEN NV EUR1.60	566.00	41 882.51	0.02
EUR IMCD NV EURO.16	123.00	18 460.58	0.01
EUR ING GROEP N.V. EURO.01	6 632.00	102 675.17	0.04
EUR JDE PEETS N.V. EURO.01	153.00	3 049.37	0.00
EUR KON KPN NV EURO.04	8 195.00	31 774.56	0.01
EUR KONINKLIJKE AHOLD EURO.01	1 859.00	64 107.48	0.02
EUR KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20	1 712.00	46 633.85	0.02
EUR NN GROUP N.V. EURO.12	542.00	25 171.08	0.01
EUR PROSUS N.V. EURO.05	2 868.00	116 774.95	0.04
EUR QIAGEN NV ORD EURO.01 (POST REV SPLT)	476.00	20 806.36	0.01
EUR RANDSTAD N.V. EURO.10	199.00	8 745.75	0.00
EUR STELLANTIS N V COM EURO.01	4 080.00	54 021.33	0.02
EUR UNIVERSAL MUSIC GR EUR10.00	1 635.00	39 390.29	0.01
EUR WOLTERS KLUWER EURO.12	508.00	84 748.01	0.03
オランダ合計		1 748 822.10	0.65
ニュージーランド			
NZD AUCKLAND INTL NPV	3 315.00	15 217.27	0.01
NZD FISHER & PAYKEL HE NPV	1 299.00	29 238.51	0.01
NZD INFRATIL LTD NPV	1 375.00	10 451.95	0.00
NZD MERCURY NZ LTD NPV	1 857.00	7 272.13	0.00
NZD MERIDIAN ENERGY LT NPV	2 183.00	8 019.31	0.00
AUD XERO LIMITED NPV	282.00	31 937.79	0.02
ニュージーランド合計		102 136.96	0.04
ノルウェー			
NOK AKER BP ASA NOK1	647.00	13 250.49	0.00
NOK DNB BANK ASA NOK12.50	1 782.00	37 188.30	0.01
NOK EQUINOR ASA NOK2.50	1 805.00	43 627.94	0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
NOK GJENSIDIGE FORSIKR NOK2	441.00	7 834.86	0.00
NOK KONGSBERG GRUPPEN NOK5	175.00	20 563.56	0.01
NOK MOWI ASA NOK7.50	857.00	15 535.66	0.01
NOK NORSK HYDRO ASA NOK3.6666	2 827.00	17 466.17	0.01
NOK ORKLA ASA NOK1.25	1 670.00	15 393.65	0.01
NOK SALMAR ASA NOK0.25	127.00	6 594.27	0.00
NOK TELENOR ASA ORD NOK6	1 238.00	14 558.45	0.01
NOK YARA INTERNATIONAL NOK1.7	383.00	10 760.97	0.00
ノルウェー合計		202 774.32	0.08
ポーランド			
EUR INPOST S.A. EURO.01	412.00	7 214.86	0.00
ポーランド合計		7 214.86	0.00
ポルトガル			
EUR EDP ENERGIAS PORTU EUR1(REGD)	6 168.00	22 293.11	0.01
EUR GALP ENERGIA EUR1-B	880.00	14 439.10	0.01
EUR JERONIMO MARTINS EUR5	534.00	10 400.36	0.00
ポルトガル合計		47 132.57	0.02
シンガポール			
SGD CAPITALAND INVESTM NPV	3 100.00	6 312.61	0.00
SGD DBS GROUP HLDGS SGD1	4 120.00	130 393.17	0.05
SGD GENTING SING LTD NPV	15 400.00	8 787.53	0.00
USD GRAB HLDGS LTD COM USD0.000001 CL A	4 100.00	20 500.00	0.01
SGD KEPPEL LTD	3 300.00	16 565.84	0.01
SGD OVERSEA-CHINESE BK NPV	6 914.00	83 959.21	0.03
USD SEA LTD ADS EACH REP ONE CL A SHS	800.00	91 040.00	0.03
SGD SEMBCORP INDUSTRIE SGDO.25 (POST REORG)	1 600.00	6 229.81	0.00
SGD SINGAPORE AIRLINES NPV	3 100.00	14 590.68	0.01
SGD SINGAPORE EXCHANGE SGDO.01	1 500.00	14 231.90	0.01
SGD SINGAPORE TECH ENG NPV	4 100.00	13 761.98	0.00
SGD SINGAPORE TELECOMM NPV	14 300.00	33 066.05	0.01
SGD UTD O/S BANK SGD1	2 600.00	70 515.05	0.03
SGD WILMAR INTERNATIONAL LTD	4 100.00	9 419.31	0.00
シンガポール合計		519 373.14	0.19
スペイン			
EUR ACCIONA SA EUR1	72.00	9 148.38	0.00
EUR ACS ACTIVIDADES CO EURO.5	398.00	18 479.36	0.01
EUR AENA SME S.A. EUR10	160.00	34 609.56	0.01
EUR AMADEUS IT GROUP EURO.01	943.00	66 154.09	0.02
EUR BANCO SANTANDER SA EURO.50(REGD)	31 750.00	146 729.55	0.05
EUR BBVA(BILB-VIZ-ARG) EURO.49	11 970.00	112 975.29	0.04
EUR BCO DE SABADELL EURO.125	10 483.00	19 769.32	0.01
EUR CAIXABANK SA EUR1	7 550.00	41 035.80	0.02
EUR CELLNEX TELECOM SA EURO.25	999.00	35 853.79	0.01
EUR EDP RENOVAVEIS SA EUR5	596.00	6 974.81	0.00
EUR ENDESA SA EUR1.2	688.00	15 071.04	0.01
EUR GRIFOLS SA EURO.25 (CLASS A) POST SUBD	671.00	6 106.25	0.00
EUR IBERDROLA SA EURO.75 (POST SUBDIVISION)	12 576.00	179 184.58	0.07
EUR INDITEX EURO.03 (POST SUBD)	2 243.00	123 617.37	0.05
EUR REDEIA CORP SA EURO.5	808.00	14 422.62	0.01
EUR REPSOL SA EUR1	2 460.00	30 724.33	0.01
EUR TELEFONICA SA EUR1	8 040.00	36 396.06	0.01
スペイン合計		897 252.20	0.33

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
スウェーデン			
SEK ADDTECH AB SER'B'NPV (POST SPLIT)	429.00	11 786.96	0.00
SEK ALFA LAVAL AB NPV	605.00	25 726.29	0.01
SEK ASSA ABLOY SER'B'NPV (POST SPLIT)	1 995.00	61 190.10	0.03
SEK ATLAS COPCO AB SER'A'NPV (POST SPLIT)	5 436.00	86 701.38	0.04
SEK ATLAS COPCO AB SER'B'NPV (POST SPLIT)	3 247.00	45 825.59	0.02
SEK BEIJER REF AB SER'B'NPV (POST SPLIT)	678.00	10 680.25	0.00
SEK BOLIDEN AB NPV (POST SPLIT)	546.00	16 271.71	0.01
SEK EPIROC AB SER'A'NPV (POST SPLIT)	1 407.00	25 610.87	0.01
SEK EPIROC AB SER'B'NPV	816.00	13 444.49	0.00
SEK EQT AB NPV	831.00	25 153.34	0.01
SEK ERICSSON SER'B' NPV	5 792.00	47 041.09	0.02
SEK ESSITY AB SER'B'NPV	1 209.00	33 239.93	0.02
SEK EVOLUTION AB NPV	347.00	30 254.47	0.01
SEK FASTIGHETS AB BALD SER'B'NPV (POST SPLIT)	1 459.00	11 213.57	0.00
SEK GETINGE AB SER'B'NPV	532.00	8 304.85	0.00
SEK HENNES & MAURITZ SER'B'NPV	1 272.00	17 619.99	0.01
SEK HEXAGON AB SER'B'NPV (POST SPLIT)	4 554.00	38 763.13	0.02
SEK HOLMEN AB SER'B'NPV (POST SPLIT)	129.00	4 853.37	0.00
SEK INDUSTRIVARDEN AB SER'C'NPV	325.00	10 641.00	0.00
SEK INDUSTRIVARDEN AB SER'A'NPV	219.00	7 184.44	0.00
SEK INDUTRADE AB NPV	521.00	13 284.04	0.00
SEK INVESTOR AB SER'B'NPV (POST SPLIT)	3 473.00	95 183.58	0.04
SEK LATOUR INVESTMENT SER'B'NPV (POST SPLIT)	261.00	6 621.30	0.00
SEK LIFCO AB SER'B'NPV (POST SPLIT)	543.00	16 460.80	0.01
SEK LUNDBERGFÖRETAGEN SER'B'NPV	194.00	9 398.98	0.00
SEK NIBE INDUSTRIER AB SER'B'NPV (POST SPLIT)	2 808.00	11 886.39	0.00
SEK SAAB AB NPV B	656.00	14 350.01	0.01
SEK SAGAX AB NPV B	543.00	12 014.89	0.00
SEK SANDVIK AB NPV (POST SPLIT)	2 278.00	42 080.68	0.02
SEK SECURITAS SER'B'NPV	1 069.00	13 505.87	0.00
SEK SKAND ENSKILDA BKN SER'A'NPV	3 364.00	46 675.79	0.02
SEK SKANSKA AB SER'B'NPV	623.00	12 980.53	0.00
SEK SKF AB SER'B'NPV	666.00	12 778.54	0.00
USD SPOTIFY TECHNOLOGY COM EURO.000625	308.00	146 903.68	0.06
SEK SVENSKA CELLULOSA SER'B'NPV	1 247.00	16 183.01	0.01
SEK SVENSKA HANDELSBKN SER'A'NPV (P/S)	2 974.00	30 914.34	0.01
SEK SWEDBANK AB SER'A'NPV	1 825.00	35 734.99	0.02
SEK SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB NPV	382.00	10 579.58	0.00
SEK TELE2 AB SHS	1 176.00	12 326.68	0.00
SEK TELIA COMPANY AB NPV	4 470.00	13 079.81	0.00
SEK TRELLEBORG AB SER'B'NPV	437.00	14 432.12	0.01
SEK VOLVO AB SER'A'NPV (POST SPLIT)	369.00	9 225.97	0.00
SEK VOLVO AB SER'B'NPV (POST SPLIT)	3 368.00	83 777.03	0.03
スウェーデン合計		1 211 885.43	0.45
スイス			
CHF ABB LTD CHF0.12 (REGD)	3 262.00	186 167.26	0.07
CHF ADECCO GROUP AG CHF0.1 (REGD)	383.00	10 216.23	0.00
CHF ALCON AG CHF0.04	1 008.00	89 678.82	0.03
CHF AVOLTA AG CHF5 (REGD)	147.00	5 432.83	0.00
CHF BACHEM HOLDING AG CHF0.01 (REGD) (SUBD)	63.00	4 869.81	0.00
CHF BALOISE-HLDGS CHF0.1(REGD)	106.00	20 141.20	0.01
CHF BARRY CALLEBAUT AG CHF0.02 (REGD)	7.00	10 678.77	0.00
CHF BKW AG CHF2.5	53.00	9 108.06	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
CHF BQE CANT VAUDOISE CHF1	73.00	7 246.14	0.00
CHF CLARIANT CHF1.76 (REGD)	342.00	4 118.75	0.00
GBP COCA-COLA HBC AG ORD CHF6.70	421.00	15 004.54	0.01
EUR DSM FIRMENICH AG EURO.01	375.00	41 172.00	0.02
CHF EMS-CHEMIE HLDG AG CHFO.01(REGD)(POST RECON)	16.00	11 377.98	0.00
CHF GALDERMA GROUP AG CHFO.01	132.00	13 522.13	0.01
CHF GEBERIT CHFO.10(REGD)	70.00	42 143.02	0.02
CHF GIVAUDAN AG CHF10	19.00	83 699.21	0.03
GBP GLENCORE PLC ORD USD0.01	21 215.00	102 454.75	0.04
CHF HELVETIA HOLDING CHFO.02 (REGD) POST SUBD	72.00	12 618.39	0.00
CHF HOLCIM LTD CHF2 (REGD)	1 055.00	107 463.90	0.04
CHF JULIUS BAER GRUPPE CHFO.02 (REGD)	399.00	26 403.75	0.01
CHF KUEHNE&NAGEL INTL CHF1(REGD)(POST-SUBD)	102.00	24 382.75	0.01
CHF LINDT & SPRUENGLI PTG CERT CHF10	4.00	46 220.20	0.02
CHF LOGITECH INTL CHFO.25(REGD) (POST-SUBD)	299.00	24 266.17	0.01
CHF LONZA GROUP AG CHF1(REGD)	149.00	89 027.92	0.03
CHF NESTLE SA CHFO.10(REGD)	5 401.00	468 863.20	0.17
CHF NOVARTIS AG CHFO.49 (REGD)	4 011.00	424 637.88	0.16
CHF PARTNERS GROUP HLG CHFO.01 (REGD)	45.00	65 380.25	0.03
CHF RICHEMONT(CIE FIN) CHF1.00 (REG) SER 'A'	1 097.00	152 783.09	0.06
CHF ROCHE HLDGS AG CHF1(BR)	73.00	22 438.59	0.01
CHF ROCHE HLDGS AG GENUSSSCHEINE NPV	1 434.00	415 876.28	0.15
CHF SANDOZ GROUP AG CHFO.05	874.00	39 821.07	0.02
CHF SCHINDLER-HLDG AG CHFO.1(REGD)(POST-SUBD)	56.00	15 859.25	0.01
CHF SCHINDLER-HLDG AG PTG CERT CHFO.10(POST-SUBD)	93.00	26 854.94	0.01
CHF SGS SA CHFO.04 (REGD)	313.00	31 079.73	0.01
CHF SIG GROUP AG CHFO.01	722.00	14 276.10	0.01
CHF SIKA AG CHFO.01 (REG)	312.00	80 780.02	0.03
CHF SONOVA HOLDING AG CHFO.05 (REGD)	100.00	34 143.02	0.01
EUR STMICROELECTRONICS EUR1.04	1 351.00	34 631.50	0.01
CHF STRAUMANN HLDG CHFO.01 (REGD) (POST SPLIT)	226.00	29 410.78	0.01
CHF SWATCH GROUP CHF2.25(BR)	59.00	10 711.75	0.00
CHF SWISS LIFE HLDG CHF5.1(REGD)	59.00	48 338.48	0.02
CHF SWISS PRIME SITE CHF15.3 (REGD)	152.00	16 795.91	0.01
CHF SWISS RE AG CHFO.10	621.00	91 740.24	0.03
CHF SWISSCOM AG CHF1(REGD)	54.00	31 167.99	0.01
CHF TEMENOS AG CHF5 (REGD)	118.00	7 748.35	0.00
CHF UBS GROUP CHFO.10 (REGD)	6 727.00	217 463.06	0.08
CHF VAT GROUP AG CHFO.10	59.00	23 533.03	0.01
CHF ZURICH INSURANCE GRP CHFO.10	300.00	190 215.66	0.07
スイス合計		3 481 964.75	1.29

イギリス

GBP 3I GROUP ORD GBPO.738636	2 025.00	95 465.07	0.03
GBP ADMIRAL GROUP ORD GBPO.001	548.00	17 852.20	0.01
GBP ANGLO AMERICAN USD0.54945	2 648.00	84 833.49	0.03
GBP ANTOFAGASTA ORD GBPO.05	854.00	18 480.24	0.01
GBP ASHTREAD GROUP ORD GBPO.10	910.00	72 753.63	0.03
GBP ASSOCD BRIT FOODS ORD GBPO.0568	685.00	19 137.31	0.01
GBP ASTRAZENECA ORD USD0.25	3 161.00	426 367.77	0.16
GBP AUTO TRADER GROUP ORD GBPO.01	1 851.00	19 739.27	0.01
GBP AVIVA ORD GBPO.33	5 317.00	32 689.28	0.01
GBP BAE SYSTEMS ORD GBPO.025	6 345.00	98 955.25	0.04
GBP BARCLAYS ORD GBPO.25	29 525.00	98 998.21	0.04
GBP BARRATT REDROW PLC GBPO.10	3 061.00	16 640.46	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
GBP BERKELEY GP HLDGS ORD GBP0.05611047	235.00	12 389.94	0.00
GBP BP ORD USD0.25	32 782.00	160 274.27	0.06
GBP BRIT AMER TOBACCO ORD GBP0.25	4 088.00	155 258.05	0.06
GBP BT GROUP ORD GBP0.05	13 696.00	27 731.43	0.01
GBP BUNZL ORD GBP0.32142857	731.00	33 058.71	0.01
GBP CENTRICA ORD GBP0.061728395	11 025.00	17 852.98	0.01
USD COCA-COLA EUROPACI COM EURO.01	432.00	33 514.56	0.01
GBP COMPASS GROUP ORD GBP0.1105	3 461.00	118 379.89	0.04
GBP CRODA INTL ORD GBP0.10609756	320.00	14 032.39	0.00
GBP DIAGEO ORD GBP0.28 101/108	4 621.00	138 174.61	0.05
GBP ENDEAVOUR MINING P ORD USD0.01	404.00	7 928.50	0.00
GBP GSK PLC ORD GBP0.3125	8 603.00	145 980.16	0.05
GBP HALEON PLC ORD GBP1.25	15 166.00	72 152.86	0.03
GBP HALMA ORD GBP0.10	848.00	29 188.19	0.01
GBP HARGREAVES LANSDOW ORD GBP0.004 (WI)	641.00	8 909.22	0.00
GBP HIKMA PHARMACEUTIC ORD GBP0.10	404.00	9 879.82	0.00
GBP HSBC HLDGS ORD USD0.50(UK REG)	37 716.00	351 248.48	0.13
GBP IMPERIAL BRANDS PL GBP0.10	1 670.00	54 530.97	0.02
GBP INFORMA PLC (GB) ORD GBP0.001	2 655.00	28 907.15	0.01
GBP INTERCONTL HOTELS ORD GBP0.208521303	328.00	40 856.63	0.01
GBP INTERTEK GROUP ORD GBP0.01	367.00	21 998.98	0.01
GBP JD SPORTS FASHION ORD GBP0.0005	4 809.00	6 222.50	0.00
GBP KINGFISHER ORD GBP0.157142857	3 662.00	11 520.10	0.00
GBP LAND SECURITIES GP ORD GBP0.106666666	1 407.00	10 783.86	0.00
GBP LEGAL & GENERAL GP ORD GBP0.025	12 442.00	34 997.28	0.01
GBP LLOYDS BANKING GP ORD GBP0.1	126 529.00	85 333.58	0.03
GBP LONDON STOCK EXCH ORD GBP0.06918604	1 004.00	143 820.32	0.05
GBP M&G PLC ORD GBP0.05	5 391.00	13 581.12	0.00
GBP MARKS & SPENCER GP ORD GBP0.25	3 421.00	16 640.80	0.01
GBP MELROSE INDUST PLC ORD GBP0.001	2 455.00	17 923.74	0.01
GBP MONDI PLC ORD EURO.22(POST CONS)	961.00	14 541.71	0.01
GBP NATIONAL GRID ORD GBP0.12431289	9 783.00	123 426.66	0.05
GBP NATWEST GROUP PLC ORD GBP1.0769	13 778.00	70 522.95	0.03
GBP NEXT ORD GBP0.10	231.00	29 596.15	0.01
GBP PEARSON ORD GBP0.25	1 215.00	19 041.54	0.01
GBP PERSIMMON ORD GBP0.10	684.00	10 937.03	0.00
GBP PHOENIX GP HLDGS ORD GBP0.10	1 281.00	8 369.03	0.00
GBP PRUDENTIAL ORD GBP0.05	5 562.00	45 372.57	0.02
GBP RECKITT BENCK GRP ORD GBP0.10	1 433.00	88 520.75	0.03
GBP RELX PLC GBP0.1444	3 841.00	180 881.92	0.07
GBP RENTOKIL INITIAL ORD GBP0.01	4 807.00	24 060.94	0.01
GBP RIO TINTO ORD GBP0.10	2 289.00	143 624.19	0.05
GBP ROLLS-ROYCE HLDGS ORD GBP0.20	17 517.00	124 372.19	0.05
GBP SAGE GROUP GBP0.01051948	2 101.00	35 036.65	0.01
GBP SAINSBURY(J) ORD GBP0.28571428	3 317.00	11 012.38	0.00
GBP SCHROEDERS PLC ORD GBP0.20	1 667.00	6 678.58	0.00
GBP SEVERN TRENT ORD GBP0.9789	537.00	18 408.48	0.01
GBP SHELL PLC ORD EURO.07	12 638.00	406 648.26	0.15
GBP SMITH & NEPHEW ORD USD0.20	1 862.00	23 595.95	0.01
GBP SMITHS GROUP ORD GBP0.375	688.00	15 487.08	0.01
GBP SPIRAX GROUP PLC ORD GBP0.269230769	160.00	14 581.49	0.01
GBP SSE PLC ORD GBP0.50	2 255.00	50 775.05	0.02
GBP STANDARD CHARTERED ORD USD0.50	4 187.00	51 750.03	0.02
GBP TAYLOR WIMPEY ORD GBP0.01	7 955.00	13 245.68	0.00
GBP TESCO ORD GBP0.0633333	13 704.00	63 821.28	0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
GBP UNILEVER PLC ORD GBP0.031111	778.00	46 487.10	0.02
EUR UNILEVER PLC ORD GBP0.031111	4 337.00	259 178.24	0.10
GBP UNITED UTILITIES G ORD GBP0.05	1 490.00	21 201.81	0.01
GBP VODAFONE GROUP ORD USD0.2095238(POST CONS)	47 156.00	42 483.79	0.02
GBP WHITBREAD ORD GBP0.76797385	364.00	13 185.87	0.00
GBP WISE PLC CLS A ORD GBP0.01	1 307.00	14 652.33	0.01
GBP WPP PLC ORD GBP0.10	2 126.00	23 217.75	0.01
イギリス合計		4 839 698.70	1.79
アメリカ合衆国			
CAD BROOKFIELD RENEWA. CLASS A SUB VOTING SHARES	250.00	7 967.00	0.00
アメリカ合衆国合計		7 967.00	0.00
株式合計		38 477 195.07	14.24
投資信託証券			
アイルランド			
USD STAR COMPASS PLC/UBS DYNMC DIVERSIFIED LTD NOTE DUE 30.09.25	5 335 000.00	10 046 872.00	3.71
アイルランド合計		10 046 872.00	3.71
投資信託証券合計		10 046 872.00	3.71
コモディティ証券			
イギリス			
USD UBS AG/LONDON/UBS ETC CMCI COMPOSITE USD 16-PRP	12 281.00	1 869 106.80	0.69
イギリス合計		1 869 106.80	0.69
コモディティ証券合計		1 869 106.80	0.69
投資信託、クローズド・エンド型			
カナダ			
CAD CANADIAN APARTMENT PROP. REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	100.00	3 274.65	0.00
カナダ合計		3 274.65	0.00
シンガポール			
SGD CAPITALAND ASCENDAS REIT- UNITS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9 200.00	17 979.34	0.01
SGD CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST REAL ESTATE INV TRUST	12 521.00	18 305.42	0.01
シンガポール合計		36 284.76	0.02
イギリス			
GBP SEGRO PLC REIT	2 446.00	24 250.11	0.01
イギリス合計		24 250.11	0.01
投資信託、クローズド・エンド型合計		63 809.52	0.03
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある証券および短期金融商 品合計		50 456 983.39	18.67

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

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

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

他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券および短期金融商品

財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン

米ドル

USD	AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 22.02.24-20.02.25	4 145 000.00	4 104 542.48	1.52
USD	AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 21.03.24-20.03.25	3 670 000.00	3 622 241.37	1.34
USD	AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 18.04.24-17.04.25	1 615 000.00	1 588 685.90	0.59
USD	UNITED STATES TB 0.00000% 20.06.24-19.12.24	4 500 000.00	4 490 329.14	1.66
USD	UNITED STATES TB 0.00000% 18.07.24-16.01.25	4 650 000.00	4 623 923.68	1.71
米ドル合計			18 429 722.57	6.82
財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン合計			18 429 722.57	6.82
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券および短期金融商品合計			18 429 722.57	6.82

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

投資信託、オープン・エンド型

アイルランド

USD	AMBIENTA X ALPHA FUND-ACCUM SHS -U2- HEDGED USD	658.51	658 763.84	0.24
USD	AMUNDI TIEDEMANN ARBITRAGE STRATEGY FUND-PTG.SHS -I- USD	1 965.65	311 622.01	0.12
USD	INVECO MSCI USA UCITS ETF-ACCUM SHS USD	87 367.00	15 281 798.81	5.65
USD	JUPITER MERIAN GBL EQUITY ABSOLUTE RETURN-ACCUM SHS -I- USD	124 584.28	288 412.60	0.11
USD	KEPLER LIQUID STRAT ICAV KLS ARETE MACRO-ACCUM SHS-SI-USD	3 185.39	485 440.54	0.18
USD	LAZARD RATHMORE ALT FUND-ACCUM SHS-Z-USD	5 490.66	618 187.81	0.23
USD	MAN FUNDS VI PLC-MAN AHL TARGETRISK-INU-USD-CAP	21 249.45	3 498 297.12	1.29
USD	TAGES INTERNATIONAL FUND ICAV-KG-ACCUM SHS INSTITUTIONAL USD	6 796.36	730 187.90	0.27
EUR	TAGES INTERNATIONAL FUNDS ICAV ACCUM SHS INSTIT. FD EUR	9.71	1 094.54	0.00
USD	UBS IRL FND SOLUTIONS PLC-MSCI USA SF INDEX-SHS-A-USD-ACC	228 214.00	40 955 330.08	15.16
USD	UBS(IRL)FUND SOLUTION PLC-MSCI USA SF UCITS SHS-A-ETF-ACC	295 291.00	51 014 473.16	18.88
アイルランド合計			113 843 608.41	42.13

ルクセンブルグ

USD	AQR UCITS FUNDS - GLOBAL RISK PARITY UCITS FUND-A2-CAP	20 793.48	2 764 701.10	1.02
USD	FOCUSED SICAV - HIGH GRADE BOND USD U-X-ACC	2 603.00	26 864 625.92	9.94
USD	FOCUSED SICAV - HIGH GRADE LONG TERM BOND USD U-X-ACC	2 833.00	26 838 935.44	9.93
USD	INVECO FDS SICAV-INVS BLNCD-RISK ALLC 12%-SHS(USD HDG)-CAP	174 311.00	1 913 934.78	0.71
USD	LUMYNA - MW TOP ENVIRONMENTAL FOCUS MKT NEUTRAL UCITS FD-CAP	2 472.77	347 972.82	0.13
USD	LUMYNA-PSAM GLOBAL EVENT UCITS FUND-SHS B-CAPITALISATION	3 607.63	463 471.58	0.17
USD	SCHRODER GAIA EGERTON EQUITY-C USD HEDGED	1 032.00	326 246.16	0.12
USD	SCHRODER GAIA SICAV - GAIA TWO SIGMA DIVERSIFIED-C-CAPITAL	6 133.69	914 717.19	0.34
USD	SCHRODER GAIA SICAV - SCHRDR GAIA WELGTON PAGA-SHS-C USD-CAP	5 002.69	645 096.88	0.24
USD	UBS (LUX) BOND FUND-EURO HIGH YIELD (EUR)(USD HEDGED) F-ACC	15 296.00	2 309 848.96	0.86
USD	UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD (USD) F-ACC	8 559.00	3 357 695.70	1.24
USD	UBS (LUX) BOND SICAV - EMERG ECON CORPORATES (USD) F-ACC	34 902.00	4 569 020.82	1.69
USD	UBS (LUX) EMERGING ECONOMIES FUND - GLOBAL BONDS (USD) F-ACC	3 009.00	6 526 460.82	2.42
USD	UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD U-X-ACC	2.00	25 297.16	0.01
USD	WINTON ALMA DIVERSIFIED MACRO FUND-SHS -I1C-U-CAPITALISATIO	2 584.95	454 020.27	0.17
ルクセンブルグ合計			78 322 045.60	28.99
投資信託、オープン・エンド型合計			192 165 654.01	71.12
ルクセンブルグ2010年12月17日法(改訂済)の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs合計			192 165 654.01	71.12

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引されていない派生商品			
株式に係るワラント債			
カナダ			
CAD CONSTELLATION SOFTWARE INC/CANADA CALL WARRANT 31.03.40	57.00	0.01	0.00
カナダ合計		0.01	0.00
株式に係るワラント債合計		0.01	0.00
公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引され ていない派生商品合計		0.01	0.00
投資有価証券合計		261 052 359.98	96.61

派生商品

公認の証券取引所に上場されている派生商品

債券に係る金融先物			
USD US LONG BOND FUTURE 20.03.25	-9.00	-12 656.25	0.00
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 20.03.25	-75.00	-66 796.88	-0.03
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 20.03.25	-105.00	-66 445.37	-0.03
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.25	-89.00	-31 289.20	-0.01
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.25	-132.00	-56 718.82	-0.02
債券に係る金融先物合計		-233 906.52	-0.09
指数に係る金融先物			
EUR EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 20.12.24	73.00	-69 545.49	-0.03
CHF SWISS MARKET INDEX FUTURE 20.12.24	9.00	-35 039.73	0.00
GBP FTSE 100 INDEX FUTURE 20.12.24	17.00	-20 419.42	-0.01
SEK OMX 30 INDEX FUTURE 20.12.24	16.00	-5 890.73	0.00
HKD HANG SENG INDEX FUTURE 30.12.24	2.00	4 536.37	0.00
USD S&P500 EMINI FUTURE 20.12.24	128.00	1 862 455.00	0.69
CAD S&P/TSX 60 IX FUT FUTURE 19.12.24	7.00	117 398.85	0.05
USD MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 20.12.24	387.00	-315 150.00	-0.12
JPY TOPIX INDEX FUTURE 12.12.24	15.00	110 570.30	0.04
AUD SPI 200 INDEX FUTURES 19.12.24	7.00	30 553.00	0.01
指数に係る金融先物合計		1 679 468.15	0.63
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		1 445 561.63	0.54

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

指数に係るスワップおよび先渡スワップ			
USD UBS/CMCI EXCESS RETURN INDEX TRS EQS REC PERF 24-02.04.25	6 273 878.77	-41 295.08	-0.02
USD UBS/CMCI EXCESS RETURN INDEX TRS EQS PAY 0.3800% 24-02.04.25			
指数に係るスワップおよび先渡スワップ合計		-41 295.08	-0.02
公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引され ていない派生商品合計		-41 295.08	-0.02
派生商品合計		1 404 266.55	0.52

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 （注１）	純資産 比率 （％）
先渡為替契約			
購入通貨 / 購入額 / 売却通貨 / 売却額 / 満期日（日-月-年）			
USD 1 292 650.67	SEK 13 786 866.53	19.12.2024	28 572.93 0.01
USD 415 723.69	SGD 546 781.00	19.12.2024	7 538.28 0.00
USD 216 931.76	NOK 2 379 001.00	19.12.2024	1 717.87 0.00
USD 2 844 421.53	AUD 4 296 813.11	19.12.2024	44 797.11 0.02
USD 229 606.06	ILS 860 496.00	19.12.2024	-7 160.55 0.00
USD 638 649.66	HKD 4 960 000.00	19.12.2024	1 099.60 0.00
USD 8 787 187.85	JPY 1 330 130 597.00	19.12.2024	-93 120.46 -0.03
USD 4 676 718.44	CAD 6 484 120.46	19.12.2024	42 528.81 0.01
USD 5 639 868.18	GBP 4 344 145.87	19.12.2024	118 323.36 0.04
USD 1 440 774.56	DKK 9 845 286.57	19.12.2024	45 055.58 0.02
USD 12 438 957.93	EUR 11 401 041.33	19.12.2024	387 590.96 0.14
USD 3 867 896.05	CHF 3 321 633.09	19.12.2024	89 400.46 0.03
USD 171 512.10	NZD 285 803.00	19.12.2024	2 400.84 0.00
CHF 35 721 900.00	USD 40 779 397.59	13.1.2025	-32 351.42 -0.01
EUR 33 733 600.00	USD 35 936 076.86	13.1.2025	-240 091.82 -0.09
SGD 2 911 000.00	USD 2 181 117.41	13.1.2025	-5 711.51 0.00
GBP 2 654 600.00	USD 3 404 849.69	13.1.2025	-30 922.66 -0.01
USD 441 799.25	GBP 346 900.00	13.1.2025	898.44 0.00
USD 117 092.69	CHF 102 900.00	13.1.2025	-282.68 0.00
USD 169 638.44	EUR 160 100.00	13.1.2025	224.94 0.00
USD 125 393.38	CHF 110 200.00	13.1.2025	-308.91 0.00
USD 153 379.79	CHF 135 500.00	13.1.2025	-1 181.55 0.00
EUR 167 400.00	USD 176 659.15	3.12.2024	148.73 0.00
CHF 168 800.00	USD 192 445.64	13.1.2025	100.15 0.00
USD 191 533.58	CHF 168 800.00	4.12.2024	-114.08 0.00
USD 428 766.21	CAD 600 000.00	19.12.2024	-52.75 0.00
EUR 280 000.00	USD 295 925.56	19.12.2024	45.89 0.00
先渡為替契約合計			359 145.56 0.13
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産			6 866 421.93 2.54
その他の資産および負債			543 169.84 0.20
純資産総額			270 225 363.86 100.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

2024年11月30日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある証券および短期金融商品

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
株式			
オーストラリア			
AUD ANZ GROUP HLDGS LI NPV	13 689.00	277 964.68	0.03
AUD APA GROUP NPV	6 105.00	28 714.68	0.00
AUD ARISTOCRAT LEISURE NPV	2 626.00	115 900.45	0.01
AUD ASX LTD NPV	928.00	39 936.28	0.00
AUD BHP GROUP LTD NPV	23 559.00	622 648.50	0.07
AUD BLUESCOPE STEEL NPV	1 780.00	25 661.53	0.00
AUD BRAMBLES LTD NPV	6 755.00	83 742.37	0.01
AUD CAR GROUP LTD NPV	1 766.00	47 744.12	0.01
AUD CMNWLTH BK OF AUST NPV	7 814.00	807 240.44	0.09
AUD COCHLEAR LTD NPV	323.00	64 017.68	0.01
AUD COLES GROUP LTD NPV	5 967.00	72 263.09	0.01
AUD COMPUTERSHARE LTD NPV(POST REC)	2 457.00	51 043.54	0.01
AUD CSL NPV	2 261.00	415 689.87	0.05
AUD ENDEAVOUR GROUP LI NPV	8 700.00	24 767.48	0.00
AUD FORTESCUE LTD NPV	7 884.00	97 533.24	0.01
AUD GOODMAN GROUP (STAPLED SECURITY)	7 910.00	195 349.07	0.02
AUD GPT GROUP NPV (STAPLED SECURITIES)	9 662.00	29 960.92	0.00
AUD INSURANCE AUST GRP NPV	10 986.00	61 047.76	0.01
AUD MACQUARIE GP LTD NPV	1 677.00	252 483.43	0.03
AUD MEDIBANK PRIVATE L NPV	15 901.00	39 570.26	0.00
AUD MINERAL RESS LTD NPV	846.00	18 534.39	0.00
AUD MIRVAC GROUP STAPLED SECURITIES	24 008.00	33 782.43	0.00
AUD NATL AUSTRALIA BK NPV	14 359.00	365 748.07	0.04
AUD NTHN STAR RES LTD NPV	5 490.00	62 623.82	0.01
AUD ORICA LIMITED NPV	2 317.00	27 335.41	0.00
AUD ORIGIN ENERGY NPV	8 751.00	61 968.12	0.01
AUD PRO MEDICUS NPV	240.00	39 382.50	0.00
AUD QANTAS AIRWAYS NPV	4 706.00	26 886.40	0.00
AUD QBE INS GROUP NPV	7 243.00	94 369.05	0.01
AUD RAMSAY HEALTH CARE NPV	795.00	20 503.77	0.00
AUD REA GROUP LIMITED NPV	239.00	39 162.35	0.00
AUD REECE AUSTRALIA NPV	1 020.00	17 103.69	0.00
AUD RIO TINTO LIMITED NPV	1 652.00	127 249.34	0.02
AUD SANTOS LIMITED NPV	14 286.00	61 516.72	0.01
AUD SCENTRE GROUP NPV STAPLED UNIT	29 937.00	71 769.05	0.01
AUD SEEK LIMITED NPV	1 637.00	27 854.99	0.00
AUD SGH LTD NPV	806.00	25 996.15	0.00
AUD SONIC HEALTHCARE NPV	2 103.00	39 140.88	0.00
AUD SOUL PATTINSON(WH) NPV	913.00	20 698.13	0.00
AUD SOUTH32 LTD NPV	24 245.00	58 755.19	0.01
AUD STOCKLAND NPV (STAPLED)	12 483.00	42 449.30	0.00
AUD SUNCORP GROUP LTD NPV	6 001.00	77 014.22	0.01
AUD TELSTRA GROUP LTD NPV	22 028.00	56 539.55	0.01
AUD THE LOTTERY CORPORA NPV	13 094.00	44 185.85	0.00
AUD TRANSURBAN GROUP STAPLED UNITS NPV	14 470.00	120 658.96	0.02
AUD TREASURY WINE ESTA NPV	4 387.00	32 380.13	0.00
AUD VICINITY LTD NPV (STAPLED SECURITY)	21 519.00	30 280.07	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
AUD WESFARMERS LTD NPV	5 251.00	245 713.47	0.03
AUD WESTPAC BKG CORP NPV	16 014.00	348 022.21	0.04
AUD WISETECH GLOBAL LT NPV	765.00	63 839.82	0.01
AUD WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	8 860.00	141 467.97	0.02
AUD WOOLWORTHS GRP LTD NPV	5 427.00	106 698.95	0.01
オーストラリア合計		5 902 910.34	0.64
オーストリア			
EUR ERSTE GROUP BK AG NPV	1 575.00	86 336.43	0.02
EUR OMV AG NPV(VAR)	699.00	27 995.72	0.00
EUR VERBUND AG CLASS'A'NPV	309.00	24 640.62	0.00
オーストリア合計		138 972.77	0.02
ベルギー			
EUR AGEAS NPV	749.00	37 782.64	0.00
EUR ANHEUSER-BUSCH IN NPV	4 206.00	226 294.69	0.03
EUR D'IETEREN GROUP NPV	107.00	22 806.10	0.00
EUR ELIA GROUP NPV	89.00	8 333.26	0.00
EUR GPE BRUXELLES LAM NPV	390.00	26 960.03	0.00
EUR KBC GROUP NV NPV	1 036.00	74 669.79	0.01
EUR LOTUS BAKERIES NPV	2.00	24 039.11	0.00
EUR SOFINA NPV	96.00	22 266.39	0.00
EUR SYENSQO SA NPV	402.00	29 831.86	0.01
EUR UCB NPV	586.00	114 719.27	0.02
EUR WAREHOUSES DE PAUW NPV (POST SPLIT)	789.00	17 433.51	0.00
ベルギー合計		605 136.65	0.07
バミューダ			
EUR AEGON LIMITED EURO.12	5 810.00	37 445.06	0.00
バミューダ合計		37 445.06	0.00
カナダ			
CAD 1ST QUANTUM MINLS COM NPV	3 534.00	48 284.41	0.01
CAD AGNICO EAGLE MINES LTD COM	2 271.00	191 489.67	0.02
CAD AIR CANADA VAR VTG SHS NPV	557.00	9 929.45	0.00
CAD ALIMENTATION COUCH COM NPV	3 601.00	210 661.65	0.02
CAD ALTAGAS LTD COM NPV	1 411.00	34 505.33	0.00
CAD ARC RESOURCES COM NPV	2 522.00	46 489.89	0.01
CAD BANK NOVA SCOTIA HALIFAX COM	5 773.00	329 231.90	0.04
CAD BANK OF MONTREAL COM NPV	3 419.00	325 991.14	0.04
CAD BARRICK GOLD CORP COM NPV	8 158.00	142 866.24	0.02
CAD BCE INC COM NEW	149.00	4 033.21	0.00
CAD BROOKFIELD ASSET.M CLASS A LTD VOTING SHS	1 752.00	100 491.46	0.01
CAD BROOKFIELD CORP CLASS A LID VOTING SHS	6 433.00	395 311.45	0.04
CAD CAE INC COM NPV	1 320.00	31 026.10	0.00
CAD CAMECO CORP COM	2 092.00	125 282.43	0.02
CAD CANADIAN NAT RES LTD COM	9 855.00	334 471.02	0.04
CAD CANADIAN NATL RY CO COM	2 519.00	281 270.19	0.03
CAD CANADIAN PAC KANS COM NPV	4 306.00	329 404.46	0.04
CAD CANADIAN TIRE LTD CL A	278.00	30 650.19	0.00
CAD CANADIAN UTILS LTD CL A	504.00	12 937.01	0.00
CAD CCL INDUSTRIES INC 'B'NON-VTG COM NPV	656.00	36 361.93	0.00
CAD CDN IMPERIAL BK OF COMMERCE COM	4 475.00	290 460.31	0.03
CAD CENOVUS ENERGY INC COM NPV	6 638.00	105 153.62	0.01
CAD CGI INC COM NPV SUB VOTING SHARES C	935.00	105 830.66	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
CAD CONSTELLATION SOFT COM STK NPV	99.00	334 736.88	0.04
CAD DESCARTES SYSTEMS COM NPV	420.00	49 524.69	0.01
CAD DOLLARAMA INC COM NPV	1 319.00	137 387.39	0.02
CAD ELEMENT FLEET MGMT COM NPV	2 004.00	42 508.87	0.00
CAD EMERA INC COM	1 445.00	55 131.16	0.01
CAD EMPIRE LTD CL A	689.00	20 657.94	0.00
CAD ENBRIDGE INC COM NPV	10 203.00	441 378.22	0.05
CAD FAIRFAX FINL HLDGS SUB-VTG COM NPV	104.00	147 537.91	0.02
CAD FIRSTSERVICE CORP COM NPV	189.00	36 867.25	0.00
CAD FORTIS INC COM NPV	2 202.00	98 434.58	0.01
CAD FRANCO NEVADA CORP COM NPV	917.00	112 281.17	0.01
CAD GFL ENVIRON INC COM NPV SUB VTG SHS	1 100.00	52 173.70	0.01
CAD GILDAN ACTIVEWEAR INC COM	633.00	31 465.77	0.00
CAD GREAT WEST LIFE CO INC COM	1 158.00	41 691.80	0.00
CAD HYDRO ONE INC COM NPV	1 440.00	47 093.24	0.01
CAD IA FINANCIAL CORP COM NPV	415.00	39 666.79	0.00
CAD IGM FINANCIAL INC COM	310.00	10 474.66	0.00
CAD IMPERIAL OIL LTD COM NEW	903.00	66 872.89	0.01
CAD INTACT FINL CORP COM NPV	869.00	165 508.15	0.02
CAD IVANHOE MINES LTD COM NPV CL'A'	3 196.00	43 027.25	0.00
CAD KEYERA CORPORATION COM NPV	1 137.00	37 492.62	0.00
CAD KINROSS GOLD CORP COM NPV	5 815.00	56 939.36	0.01
CAD LOBLAW COS LTD COM	728.00	94 473.88	0.01
CAD LUNDIN MINING CORP COM	3 520.00	34 542.58	0.00
CAD MAGNA INTL INC COM NPV	1 306.00	59 351.34	0.01
CAD MANULIFE FINL CORP COM	8 319.00	267 783.69	0.03
CAD MEG ENERGY CORP COM NPV	1 281.00	23 055.53	0.00
CAD METRO INC CL A SUB	992.00	64 636.05	0.01
CAD NATL BK OF CANADA COM NPV	1 607.00	159 202.20	0.02
CAD NUTRIEN LTD NPV	2 247.00	104 955.75	0.01
CAD ONEX CORP SUB VTG	391.00	31 804.44	0.00
CAD OPEN TEXT CO COM NPV	1 160.00	35 326.50	0.00
CAD PAN AMER SILVER COM NPV	1 694.00	37 578.57	0.00
CAD PARKLAND CORP. COM NPV	800.00	20 654.93	0.00
CAD PEMBINA PIPELINE C COM NPV	2 702.00	111 310.47	0.01
CAD POWER CORP CDA COM	2 652.00	89 324.94	0.01
CAD QUEBECOR INC CL B	581.00	13 718.43	0.00
CAD RB GLOBAL INC COM NPV	875.00	86 453.24	0.01
CAD RESTAURANT BRANDS COM NPV	1 465.00	102 026.32	0.01
CAD ROGERS COMMUNICATIONS INC	1 727.00	61 671.96	0.01
CAD ROYAL BK OF CANADA COM NPV	6 598.00	830 127.97	0.09
CAD SAPUTO INC COM	897.00	16 720.85	0.00
CAD SHOPIFY INC COM NPV CL A	5 694.00	658 155.88	0.07
CAD STANTEC INC COM NPV	581.00	50 321.66	0.01
CAD SUN LIFE FINL INC COM	2 685.00	165 244.05	0.02
CAD SUNCOR ENERGY INC COM NPV 'NEW'	5 919.00	235 508.69	0.03
CAD TC ENERGY CORPORAT COM NPV	4 773.00	232 692.91	0.03
CAD TECK RESOURCES LTD CLASS'B'SUB-VTG COM NPV	2 199.00	102 666.59	0.01
CAD TELUS CORPORATION NPV	1 974.00	30 734.71	0.00
CAD TFI INTERNATIONAL COM NPV	420.00	63 944.15	0.01
CAD THOMSON-REUTERS CP NPV POST REV SPLIT	724.00	118 123.46	0.01
CAD TMX GROUP LTD COM NPV	1 240.00	39 206.37	0.00
CAD TOROMONT INDS LTD COM	400.00	32 853.62	0.00
CAD TORONTO-DOMINION COM NPV	8 169.00	462 257.52	0.05
CAD TOURMALINE OIL CP COM NPV	1 723.00	81 316.89	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・メディアム(米ドル)

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
CAD WEST FRASER TIMBER COM NPV	269.00	26 420.65	0.00
CAD WESTON GEORGE LTD COM	280.00	45 005.18	0.00
CAD WHEATON PRECIOUS M COM NPV	2 153.00	133 963.76	0.02
CAD WSP GLOBAL INC COM NPV	613.00	109 001.61	0.01
カナダ合計		10 423 123.35	1.13
中国			
USD FUTU HOLDINGS LIM1 SPON ADS EA REP 8 ORD SHS	200.00	17 446.00	0.00
SGD YANGZIJANG SHIPBU NPV	4 800.00	8 628.65	0.00
中国合計		26 074.65	0.00
デンマーク			
DKK A.P. MOELLER-MAERSK SER'B'DKK1000	20.00	33 918.71	0.00
DKK A.P. MOLLER-MAERSK 'A'DKK1000	13.00	21 301.52	0.00
DKK CARLSBERG SER'B'DKK20	460.00	47 348.53	0.01
DKK COLOPLAST DKK1 B	561.00	70 663.28	0.01
DKK DANSKE BANK A/S DKK10	3 222.00	92 493.90	0.01
DKK DEMANT A/S DKK0.20	562.00	21 426.20	0.00
DKK DSV A/S DKK1	939.00	200 406.88	0.02
DKK GENMAB AS DKK1	312.00	67 428.41	0.01
DKK NOVO NORDISK A/S DKK0.1 B	15 123.00	1 621 958.35	0.18
DKK NOVONESIS B SER'B'DKK2	1 580.09	92 576.64	0.01
DKK ORSTED A/S DKK10	849.00	47 109.22	0.01
DKK PANDORA A/S DKK1	386.00	62 128.45	0.01
DKK ROCKWOOL A/S SER'B'DKK10	44.00	16 039.65	0.00
DKK TRYG A/S DKK5	1 833.00	42 210.14	0.00
DKK VESTAS WIND SYSTEM DKK0.20 (POST SPLIT)	4 749.00	73 780.67	0.01
DKK ZEALAND PHARMA AS DKK1	256.00	26 466.51	0.00
デンマーク合計		2 537 257.06	0.28
フィンランド			
EUR ELISA OYJ NPV	675.00	30 570.65	0.00
EUR FORTUM OYJ EUR3.40	2 321.00	34 969.80	0.00
EUR KESKO OYJ EUR2 SER'B'	1 369.00	27 205.32	0.00
EUR KONE CORPORATION NPV ORD 'B'	1 516.00	78 554.83	0.01
EUR METSO CORPORATION RG	2 321.00	20 410.70	0.00
EUR NESTE OIL OYJ NPV	1 981.00	30 140.05	0.00
EUR NOKIA OYJ NPV	24 762.00	104 078.35	0.02
EUR NORDEA HOLDING ABP NPV	970.00	10 967.42	0.00
SEK NORDEA HOLDING ABP NPV	14 023.00	158 417.51	0.02
EUR ORION CORP SER'B'NPV	559.00	26 403.39	0.00
EUR SAMPO PLC NPV A	2 169.00	92 873.00	0.01
EUR STORA ENSO OYJ NPV SER'R'	2 763.00	26 824.84	0.00
EUR UPM-KYMMENE CORP NPV	2 490.00	65 485.46	0.01
EUR WARTSILA OYJ ABP SER'B'EUR3.50	2 538.00	46 120.34	0.01
フィンランド合計		753 021.66	0.08
フランス			
EUR ACCOR EUR3	838.00	38 660.98	0.00
EUR ADP EUR3	181.00	20 933.36	0.00
EUR AIR LIQUIDE(L') EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)	2 708.00	449 850.62	0.05
EUR AIRBUS EUR1	2 732.00	425 790.05	0.05
EUR ALSTOM EUR7.00	1 755.00	39 463.80	0.00
EUR AMUNDI EUR2.5 (AIW)	398.00	25 915.66	0.00
EUR ARKEMA EUR10	229.00	18 140.24	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・メディアム(米ドル)

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR AXA EUR2.29	8 381.00	291 939.36	0.03
EUR BIOMERIEUX NPV (POST SPLIT)	199.00	20 776.67	0.00
EUR BNP PARIBAS EUR2	4 821.00	288 407.49	0.03
EUR BOLLORE EUR0.16	3 002.00	18 501.11	0.00
EUR BOUYGUES EUR1	787.00	23 407.42	0.00
EUR BUREAU VERITAS EUR0.12	1 529.00	46 509.98	0.01
EUR CAPGEMINI EUR8	753.00	120 808.90	0.02
EUR CARREFOUR EUR2.50	2 278.00	34 646.74	0.00
EUR CIE DE ST-GOBAIN EUR4	2 101.00	191 595.04	0.02
EUR COVIVIO EUR3	302.00	16 586.56	0.00
EUR CREDIT AGRICOLE SA EUR3	4 950.00	66 241.17	0.01
EUR DANONE EURO.25	2 922.00	199 554.75	0.02
EUR DASSAULT AVIATION EURO.80 (POST SUBDIVISION)	102.00	20 296.78	0.00
EUR DASSAULT SYSTEMES EURO.10	3 270.00	112 765.72	0.02
EUR EDENRED EUR2	1 086.00	35 902.14	0.00
EUR EIFFAGE EUR4	357.00	32 201.21	0.00
EUR ENGIE EUR1	8 663.00	138 025.65	0.02
EUR ESSILORLUXOTTICA EURO.18	1 415.00	343 441.39	0.04
EUR EURAZEO NPV	242.00	17 777.01	0.00
EUR GECINA EUR7.50	203.00	20 443.86	0.00
EUR GETLINK SE EURO.40	1 349.00	22 034.75	0.00
EUR HERMES INTL NPV	151.00	329 339.00	0.04
EUR IPSEN EUR1	225.00	25 998.36	0.00
EUR KERING EUR4	345.00	80 438.87	0.01
EUR KLEPIERRE EUR1.40	922.00	27 870.63	0.00
EUR L'OREAL EURO.20	1 121.00	389 121.67	0.05
EUR LA FRANCAISE DES EURO.40 (PROMESSES)	510.00	20 145.96	0.00
EUR LEGRAND SA EUR4	1 180.00	118 250.46	0.02
EUR LVMH MOET HENNESSY EURO.30	1 286.00	804 776.87	0.09
EUR MICHELIN (CGDE) EURO.50 (POST SUBDIVISION)	3 027.00	98 311.36	0.01
EUR ORANGE EUR4	8 328.00	88 708.00	0.01
EUR PERNOD RICARD EUR1.55	936.00	104 693.08	0.01
EUR PUBLICIS GROUPE SA EURO.40	1 086.00	117 800.31	0.02
EUR RENAULT SA EUR3.81	960.00	41 095.47	0.00
EUR REXEL EUR5	886.00	22 870.79	0.00
EUR SAFRAN EURO.20	1 679.00	391 025.84	0.05
EUR SANOFI EUR2	5 356.00	520 953.79	0.06
EUR SARTORIUS STEDIM B EURO.20 (POST SUBD)	152.00	28 953.82	0.00
EUR SCHNEIDER ELECTRIC EUR8	2 576.00	662 507.79	0.07
EUR SEB SA EUR1	120.00	11 381.61	0.00
EUR SOC GENERALE EUR1.25	3 346.00	88 686.86	0.01
EUR SODEXO EUR4	400.00	33 206.93	0.00
EUR TELEPERFORMANCE EUR2.50	243.00	22 847.57	0.00
EUR THALES EUR3	461.00	68 897.51	0.01
EUR TOTALENERGIES SE EUR2.5	10 159.00	589 824.57	0.07
EUR UNIBAIL-RODAMCO-WE NPV(1 ORD UNIBAIL-R & 1CLS)	542.00	44 400.03	0.00
EUR VEOLIA ENVIRONNEME EUR5	3 404.00	99 122.55	0.01
EUR VINCI EUR2.50	2 350.00	247 859.51	0.03
EUR VIVENDI SA EUR5.50	3 045.00	27 948.16	0.00
フランス合計		8 187 655.78	0.89
ドイツ			
EUR ADIDAS AG NPV (REGD)	768.00	180 970.15	0.02
EUR ALLIANZ SE NPV(REGD)(VINKULIERT)	1 827.00	563 851.74	0.06
EUR BASF SE NPV	4 245.00	190 193.00	0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・メディアム(米ドル)

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR BAYER AG NPV (REGD)	4 374.00	89 569.04	0.01
EUR BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG EUR1	1 382.00	102 205.98	0.01
EUR BAYERISCHE MOTORENWERKE AG EUR1	348.00	23 707.47	0.00
EUR BECHTLE AG NPV	471.00	15 471.32	0.00
EUR BEIERSDORF AG NPV	478.00	61 921.52	0.01
EUR BRENNTAG AG	648.00	41 749.47	0.00
EUR CARL ZEISS MEDITEC NPV	195.00	11 646.98	0.00
EUR COMMERZBANK AG NPV	5 038.00	77 289.49	0.01
EUR CONTINENTAL AG ORD NPV	544.00	35 646.50	0.00
EUR COVESTRO AG NPV	781.00	47 612.78	0.01
EUR CTS EVENTIM NPV	220.00	19 414.01	0.00
EUR DAIMLER TRUCK HOLD NPV (YOUNG SHARE)	2 382.00	90 068.09	0.01
EUR DELIVERY HERO SE NPV	822.00	33 633.93	0.00
EUR DEUTSCHE BANK AG NPV(REGD)	8 708.00	147 838.84	0.02
EUR DEUTSCHE BOERSE AG NPV(REGD)	892.00	208 681.88	0.03
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA ORD NPV (REGD)(VINK)	3 151.00	21 086.76	0.00
EUR DEUTSCHE POST AG NPV(REGD)	4 690.00	172 235.91	0.02
EUR DEUTSCHE TELEKOM NPV(REGD)	16 367.00	523 445.07	0.06
EUR DR.ING. F.PORSCHE NON-VTG PRF NPV	488.00	30 451.34	0.00
EUR E.ON SE NPV	10 597.00	136 381.24	0.02
EUR EVONIK INDUSTRIES NPV	893.00	16 378.44	0.00
EUR FRESENIUS MED CARE NPV	924.00	40 598.64	0.00
EUR FRESENIUS SE & CO. KGAA NPV	1 872.00	65 781.66	0.01
EUR GEA GROUP AG NPV	695.00	34 735.67	0.00
EUR HANNOVER RUECKVERS ORD NPV(REGD)	285.00	74 381.30	0.01
EUR HEIDELBERG MATER NPV	665.00	83 863.34	0.01
EUR HENKEL AG & CO KGAA	491.00	37 260.99	0.00
EUR HENKEL AG&CO. KGAA NON-VTG PRF NPV	781.00	66 618.29	0.01
EUR INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)	6 234.00	202 896.77	0.02
EUR KNORR BREMSE AG NPV	320.00	24 385.55	0.00
EUR LEG IMMOBILIEN SE NPV	349.00	32 342.17	0.00
EUR MERCEDES-BENZ ORD NPV(REGD)	3 455.00	193 260.10	0.02
EUR MERCK KGAA NPV	578.00	86 444.48	0.01
EUR MTU AERO ENGINES H NPV (REGD)	238.00	80 993.22	0.01
EUR MUENCHENER RUECKVE NPV(REGD)	619.00	323 167.31	0.04
EUR NEMETSCHEK SE ORD NPV	254.00	26 344.59	0.00
EUR PORSCHE AUTO HL SE NON VTG PRF NPV	730.00	26 692.92	0.00
EUR PUMA SE NPV	417.00	19 511.29	0.00
EUR RATIONAL AG NPV	25.00	23 368.43	0.00
EUR RHEINMETALL AG NPV	207.00	136 077.43	0.02
EUR RWE AG (NEU) NPV	3 013.00	101 420.88	0.01
EUR SAP AG ORD NPV	4 896.00	1 162 992.80	0.13
EUR SARTORIUS AG NON VTG PRF NPV	112.00	25 764.52	0.00
EUR SCOUT24 SE NPV	372.00	33 416.69	0.00
EUR SIEMENS AG NPV(REGD)	3 499.00	676 894.12	0.08
EUR SIEMENS ENERGY AG NPV	2 976.00	160 368.68	0.02
EUR SIEMENS HEALTHINEE NPV	1 395.00	75 614.84	0.01
EUR SYMRISE AG NPV (BR)	659.00	72 735.74	0.01
EUR TALANX AG NPV	277.00	23 463.91	0.00
EUR VOLKSWAGEN AG NON VTG PRF NPV	991.00	84 489.16	0.01
EUR VONOVIA SE NPV	3 355.00	111 267.50	0.02
EUR ZALANDO SE NPV	1 009.00	31 353.06	0.00
ドイツ合計		6 979 957.00	0.76

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・メディアム(米ドル)

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
香港			
HKD AIA GROUP LTD NPV	51 600.00	385 596.70	0.05
HKD BOC HONG KONG HLDG HKD5	18 500.00	56 820.30	0.01
HKD CK ASSET HOLDINGS HKD1	10 500.00	42 909.18	0.00
HKD CK HUTCHISON HLDGS HKD1.0	12 500.00	65 057.73	0.01
HKD CK INFRASTRUCTURE HKD1	3 000.00	20 664.26	0.00
HKD CLP HOLDINGS HKD5	8 000.00	67 133.15	0.01
HKD GALAXY ENTERTAINME HKD0.10	10 000.00	44 399.89	0.00
HKD HANG SENG BANK HKD5	3 300.00	39 206.20	0.00
HKD HENDERSON LAND DEV HKD2	7 000.00	21 949.35	0.00
HKD HKT TRUST AND HKT SHARE STAPLED UNIT	20 000.00	24 853.66	0.00
HKD HONG KONG EXCHANGE HKD1	5 500.00	204 830.66	0.03
USD HONGKONG LAND HLD ORD USD0.10(SINGAPORE REG)	4 700.00	21 385.00	0.00
HKD HONGKONG&CHINA GAS HKD0.25	59 300.00	44 961.48	0.00
USD JARDINE MATHESON COM USD0.25(BERMUDA REG)	600.00	26 196.00	0.00
HKD MTR CORP HKD1	7 500.00	26 264.05	0.00
HKD POWER ASSETS HOLDINGS LTD HKD1	7 500.00	49 154.73	0.01
HKD SINO LAND CO HKD1	21 086.00	20 648.24	0.00
HKD SITC INTERNATIONAL HKD0.10	8 000.00	20 818.47	0.00
HKD SUN HUNG KAI PROP NPV	7 000.00	69 491.30	0.01
HKD SWIRE PACIFIC 'A'HKD0.60	2 500.00	20 577.52	0.00
HKD TECHTRONIC INDUSTR NPV	6 500.00	91 549.88	0.02
HKD THE LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	11 735.00	51 047.64	0.01
HKD WH GROUP LTD USD0.0001	45 103.00	35 762.22	0.00
HKD WHARF REAL ESTATE HKD0.1	8 000.00	21 435.32	0.00
HKD WHARF(HLDGS) HKD1	7 000.00	19 205.69	0.00
香港合計		1 491 918.62	0.16
アイルランド			
EUR AIB GROUP PLC ORD EURO0.625	7 095.00	38 592.76	0.00
EUR BANK OF IRELAND GR EUR1	4 384.00	38 376.59	0.00
GBP DCC ORD EURO.25	422.00	30 707.93	0.00
GBP EXPERIAN ORD USD0.10	4 324.00	206 155.72	0.03
AUD JAMES HARDIE ID PLC CUFS EURO0.5	1 884.00	68 988.32	0.01
EUR KERRY GROUP 'A'ORD EURO.125(DUBLIN LIST)	776.00	74 953.44	0.01
EUR KINGSPAN GROUP ORD EURO.13(DUBLIN LISTING)	778.00	58 506.72	0.01
アイルランド合計		516 281.48	0.06
マン島			
GBP ENTAIN PLC ORD EURO.01	2 517.00	25 773.02	0.00
マン島合計		25 773.02	0.00
イスラエル			
ILS AZRIELI GROUP ILS0.01	209.00	16 728.51	0.00
ILS BANK HAPOALIM B.M. ILS1	6 739.00	77 239.04	0.01
ILS BK LEUMI LE ISRAEL ILS1	7 278.00	82 676.11	0.01
USD CHECK POINT SFTWRE ORD ILS0.01	411.00	74 802.00	0.01
USD CYBER-ARK SOFTWARE COM ILS0.01	200.00	64 702.00	0.01
ILS ELBIT SYSTEMS LTD ILS1	115.00	27 898.73	0.00
USD GLOBAL-E ONLINE LT COM NPV	500.00	26 140.00	0.00
ILS ICL GROUP LTD ILS1	3 000.00	13 532.66	0.00
ILS ISRAEL DISCOUNT BK ILS0.10 SER'A'	5 797.00	38 044.48	0.00
ILS MIZRAHI TEFAHOT BK ILS0.01	596.00	25 688.17	0.00
USD MONDAY COM LTD COM NPV	200.00	57 072.00	0.01
ILS NICE LTD ILS1	299.00	53 752.81	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・メディアム(米ドル)

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD TEVA PHARMA IND ADR(CNV 1 ORD ILS0.10)	5 500.00	92 290.00	0.01
USD WIX.COM LTD COM ILS0.01	253.00	56 606.22	0.01
イスラエル合計		707 172.73	0.08
イタリア			
EUR AMPLIFON EURO.02	476.00	12 081.11	0.00
EUR BANCO BPM NPV	5 815.00	44 245.55	0.00
EUR BPER BANCA EUR3	3 310.00	20 200.02	0.00
EUR DAVIDE CAMPARI MIL EURO.01	3 004.00	18 015.30	0.00
EUR DIASORIN SPA EUR1	124.00	13 856.50	0.00
EUR ENEL EUR1	37 805.00	271 920.86	0.03
EUR ENI SPA EUR1	10 352.00	146 578.28	0.02
EUR FINECOBANK SPA EURO.33	3 111.00	49 911.88	0.01
EUR GENERALI SPA NPV EUR1	4 725.00	135 143.96	0.02
EUR INFRASTRUTTURE WIR NPV	1 793.00	18 464.22	0.00
EUR INTESA SANPAOLO NPV	69 094.00	264 687.88	0.03
EUR LEONARDO SPA EUR4.40	1 921.00	51 677.62	0.01
EUR MEDIOBANCA SPA EURO.5	2 254.00	32 865.22	0.00
EUR MONCLER SPA NPV	1 065.00	52 136.94	0.01
EUR NEXI SPA NPV	3 107.00	18 390.16	0.00
EUR POSTE ITALIANE SPA NPV	2 212.00	31 037.94	0.00
EUR PRYSMIAN SPA EURO.10	1 255.00	82 739.65	0.01
EUR RECORDATI EURO.125	519.00	28 258.05	0.00
EUR SNAM EUR1	7 949.00	37 041.98	0.00
EUR TELECOM ITALIA SPA EURO.55	62 158.00	14 922.53	0.00
EUR TERNA SPA ORD EURO.22	6 549.00	55 391.76	0.01
EUR UNICREDIT SPA NPV (POST REV SPLIT)	6 984.00	268 393.98	0.03
EUR UNIPOL GRUPPO FIN NPV PRIV (POST CONSOLID)	1 157.00	13 955.51	0.00
イタリア合計		1 681 916.90	0.18
日本			
JPY アドバンテスト	3 600.00	197 516.40	0.02
JPY イオン	3 200.00	76 577.55	0.01
JPY A G C	1 000.00	31 228.15	0.00
JPY アイシン	2 200.00	23 115.49	0.00
JPY 味の素	2 200.00	92 022.51	0.01
JPY A N Aホールディングス	700.00	13 465.39	0.00
JPY アサヒグループホールディングス	6 700.00	72 694.68	0.01
JPY 旭化成	5 600.00	39 822.89	0.00
JPY アシックス	3 200.00	63 985.09	0.01
JPY アステラス製薬	8 900.00	92 534.87	0.01
JPY バンダイナムコホールディングス	2 900.00	61 018.08	0.01
JPY ブリヂストン	2 700.00	96 163.40	0.01
JPY ブラザー工業	1 200.00	21 054.03	0.00
JPY キヤノン	4 400.00	142 618.77	0.02
JPY カプコン	1 500.00	35 016.81	0.00
JPY 東海旅客鉄道	3 700.00	76 052.20	0.01
JPY 千葉銀行	2 400.00	19 983.35	0.00
JPY 中部電力	3 000.00	31 621.00	0.00
JPY 中外製薬	3 200.00	140 583.95	0.02
JPY コンコルディア・フィナンシャルグループ	5 300.00	31 679.66	0.00
JPY 大日本印刷	2 000.00	30 429.14	0.00
JPY 第一生命ホールディングス	4 200.00	113 288.28	0.02
JPY ダイフク	1 600.00	33 207.04	0.00
JPY 第一三共	8 300.00	262 454.31	0.03

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
JPY ダイキン工業	1 200.00	144 581.68	0.02
JPY 大東建託	300.00	33 408.80	0.00
JPY 大和ハウス工業	2 700.00	84 585.68	0.01
JPY 大和証券グループ	6 100.00	40 839.96	0.00
JPY デンソー	9 000.00	127 582.65	0.02
JPY 電通グループ	900.00	22 915.74	0.00
JPY ディスコ	400.00	108 133.30	0.01
JPY 東日本旅客鉄道	4 100.00	79 715.02	0.01
JPY エーザイ	1 200.00	37 313.98	0.00
JPY E N E O S ホールディングス	13 400.00	72 163.80	0.01
JPY ファナック	4 300.00	111 290.08	0.01
JPY ファーストリテイリング	900.00	306 282.25	0.04
JPY 富士電機	700.00	39 258.91	0.00
JPY 富士フイルムホールディングス	5 500.00	123 560.94	0.02
JPY フジクラ	1 100.00	38 979.92	0.00
JPY 富士通	7 800.00	148 848.42	0.02
JPY 阪急阪神ホールディングス	900.00	24 605.65	0.00
JPY 光通信	100.00	21 826.41	0.00
JPY 日立建機	500.00	11 246.13	0.00
JPY 日立製作所	21 900.00	546 971.40	0.06
JPY 本田技研工業	21 500.00	184 886.97	0.02
JPY ホシザキ	500.00	20 158.47	0.00
JPY H O Y A	1 600.00	205 186.94	0.02
JPY ヒューリック	1 000.00	8 982.26	0.00
JPY 出光興産	4 790.00	31 884.43	0.00
JPY I N P E X	3 800.00	49 946.40	0.01
JPY いすゞ自動車	2 500.00	33 242.33	0.00
JPY 伊藤忠商事	5 600.00	275 329.76	0.03
JPY 日本航空	500.00	8 308.09	0.00
JPY 日本取引所グループ	4 600.00	55 239.21	0.01
JPY ゆうちょ銀行	6 526.00	61 529.55	0.01
JPY 日本郵政	9 200.00	91 856.04	0.01
JPY かんぽ生命保険	900.00	18 810.80	0.00
JPY ジャパンリアルエステイト投資法人	7.00	25 821.49	0.00
JPY 日本たばこ産業	5 700.00	160 124.51	0.02
JPY J F E ホールディングス	3 000.00	34 137.90	0.00
JPY 鹿島建設	1 600.00	29 116.09	0.00
JPY 関西電力	3 300.00	42 308.82	0.00
JPY 花王	2 200.00	95 420.98	0.01
JPY 川崎汽船	2 100.00	27 860.64	0.00
JPY K D D I	7 200.00	237 307.32	0.03
JPY キーエンス	900.00	387 841.66	0.04
JPY キッコーマン	3 500.00	38 254.49	0.00
JPY キリンホールディングス	3 700.00	51 477.51	0.01
JPY 神戸物産	700.00	17 585.64	0.00
JPY K O K U S A I E L E C T R I C	600.00	9 907.78	0.00
JPY 小松製作所	4 100.00	109 908.45	0.01
JPY コナミグループ	500.00	49 189.33	0.01
JPY クボタ	4 100.00	51 132.27	0.01
JPY 京セラ	5 500.00	53 961.78	0.01
JPY 協和キリン	1 300.00	21 518.79	0.00
JPY レーザーテック	400.00	43 786.00	0.00
JPY L I N E ヤフー	11 600.00	31 814.36	0.00
JPY エムスリー	1 900.00	18 344.04	0.00
JPY マキタ	1 000.00	31 188.20	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
JPY 丸紅	6 600.00	99 053.83	0.01
JPY マツキヨココカラ&カンパニー	1 800.00	25 156.97	0.00
JPY 日本マクドナルドホールディングス	500.00	20 607.92	0.00
JPY 明治ホールディングス	1 200.00	25 568.47	0.00
JPY ミネベアミツミ	2 000.00	32 613.11	0.00
JPY 三菱ケミカルグループ	5 800.00	30 312.08	0.00
JPY 三菱商事	15 800.00	265 691.65	0.03
JPY 三菱電機	8 900.00	150 935.85	0.02
JPY 三菱地所	5 300.00	74 796.75	0.01
JPY 三菱H C キャピタル	3 700.00	24 882.64	0.00
JPY 三菱重工業	15 500.00	226 795.29	0.03
JPY 三菱U F J フィナンシャル・グループ	52 500.00	626 427.41	0.07
JPY 三井物産	11 900.00	248 482.87	0.03
JPY 三井化学	900.00	20 788.36	0.00
JPY 三井不動産	12 500.00	104 371.28	0.01
JPY 商船三井	1 700.00	58 057.06	0.01
JPY みずほフィナンシャルグループ	11 630.00	293 024.74	0.03
JPY M o n o t a R O	900.00	15 991.28	0.00
JPY M S & A D インシュアランス グループ ホールディングス	6 100.00	135 699.97	0.02
JPY 村田製作所	7 900.00	132 030.50	0.02
JPY 日本電気	1 200.00	101 834.40	0.01
JPY ネクソン	1 400.00	19 189.00	0.00
JPY ニデック	3 700.00	67 872.96	0.01
JPY 任天堂	4 900.00	287 438.83	0.03
JPY 日本ビルファンド投資法人	40.00	33 425.44	0.00
JPY 日本ペイントホールディングス	4 800.00	32 711.66	0.00
JPY 日本酸素ホールディングス	900.00	26 169.72	0.00
JPY 日本製鉄	4 300.00	87 583.31	0.01
JPY 日本電信電話	142 300.00	145 346.21	0.02
JPY 日本郵船	2 000.00	63 867.90	0.01
JPY 日産自動車	9 700.00	23 180.28	0.00
JPY 日清食品ホールディングス	800.00	21 189.87	0.00
JPY ニトリホールディングス	400.00	51 203.52	0.01
JPY 日東電工	3 500.00	55 651.36	0.01
JPY 野村ホールディングス	13 900.00	83 426.84	0.01
JPY 野村総合研究所	1 900.00	57 954.52	0.01
JPY N T T データグループ	2 700.00	52 099.74	0.01
JPY 大林組	3 300.00	46 912.14	0.01
JPY オービック	1 500.00	48 989.58	0.01
JPY オリンパス	5 300.00	83 283.95	0.01
JPY オムロン	800.00	25 387.36	0.00
JPY 小野薬品工業	1 000.00	11 532.44	0.00
JPY 日本オラクル	200.00	20 401.50	0.00
JPY オリエンタルランド	5 200.00	122 499.58	0.02
JPY オリックス	5 300.00	118 820.79	0.02
JPY 大阪ガス	1 600.00	34 986.18	0.00
JPY 大塚商会	900.00	22 364.42	0.00
JPY 大塚ホールディングス	2 000.00	115 657.36	0.02
JPY パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	1 900.00	48 162.60	0.01
JPY パナソニック	10 600.00	103 434.43	0.01
JPY 楽天グループ	7 800.00	44 581.82	0.00
JPY リクルートホールディングス	6 600.00	456 377.14	0.05
JPY ルネサスエレクトロニクス	8 000.00	104 591.00	0.01
JPY りそなホールディングス	10 500.00	87 392.22	0.01
JPY リコー	2 400.00	27 198.46	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
JPY S B Iホールディングス	1 400.00	35 236.54	0.00
JPY S C R E E Nホールディングス	400.00	25 041.12	0.00
JPY S C S K	700.00	14 113.26	0.00
JPY セコム	1 900.00	66 076.51	0.01
JPY セイコーエプソン	1 300.00	23 020.61	0.00
JPY 積水化学工業	1 600.00	25 770.88	0.00
JPY 積水ハウス	2 800.00	65 998.60	0.01
JPY セブン&アイ・ホールディングス	10 500.00	182 055.47	0.02
JPY S Gホールディングス	1 600.00	15 671.34	0.00
JPY 島津製作所	1 100.00	30 857.28	0.00
JPY シマノ	300.00	41 848.39	0.00
JPY 信越化学工業	8 400.00	310 640.88	0.04
JPY 塩野義製薬	3 300.00	46 560.58	0.01
JPY 資生堂	2 000.00	38 026.43	0.00
JPY しずおかフィナンシャルグループ	2 600.00	23 059.56	0.00
JPY S M C	300.00	126 923.46	0.02
JPY ソフトバンク	134 800.00	173 318.77	0.02
JPY ソフトバンクグループ	4 500.00	267 749.78	0.03
JPY S O M P Oホールディングス	4 400.00	115 606.75	0.02
JPY ソニーグループ	29 400.00	588 646.01	0.07
JPY S U B A R U	2 900.00	46 468.36	0.01
JPY 住友商事	5 000.00	106 801.61	0.01
JPY 住友電気工業	3 400.00	65 335.42	0.01
JPY 住友金属鉱山	1 100.00	27 070.61	0.00
JPY 三井住友フィナンシャルグループ	17 600.00	431 957.92	0.05
JPY 三井住友トラストグループ	2 900.00	72 333.46	0.01
JPY 住友不動産	1 400.00	43 234.68	0.00
JPY サントリー食品インターナショナル	700.00	23 738.06	0.00
JPY スズキ	7 100.00	75 001.83	0.01
JPY シスメックス	2 400.00	50 561.64	0.01
JPY T & Dホールディングス	2 100.00	39 613.14	0.00
JPY 大成建設	700.00	30 347.24	0.00
JPY 武田薬品工業	7 449.00	202 512.02	0.02
JPY T D K	9 300.00	119 450.68	0.02
JPY テルモ	6 500.00	132 047.14	0.02
JPY T I S	1 000.00	24 396.58	0.00
JPY 東宝	600.00	26 139.76	0.00
JPY 東京海上ホールディングス	8 900.00	329 724.01	0.04
JPY 東京電力ホールディングス	7 900.00	28 205.08	0.00
JPY 東京エレクトロン	2 100.00	325 938.01	0.04
JPY 東京ガス	1 600.00	48 047.41	0.01
JPY 東急	2 000.00	23 304.59	0.00
JPY T O P P A Nホールディングス	1 200.00	32 016.51	0.00
JPY 東レ	5 500.00	34 947.90	0.00
JPY T O T O	600.00	16 104.14	0.00
JPY 豊田自動織機	700.00	51 969.24	0.01
JPY トヨタ自動車	48 100.00	817 173.16	0.09
JPY 豊田通商	2 800.00	47 560.01	0.01
JPY トレンドマイクロ	600.00	32 875.45	0.00
JPY ユニ・チャーム	1 800.00	46 634.48	0.01
JPY 西日本旅客鉄道	1 900.00	35 619.07	0.00
JPY ヤクルト本社	1 100.00	22 375.74	0.00
JPY ヤマハ発動機	3 700.00	32 039.48	0.00
JPY 安川電機	1 100.00	28 703.93	0.00
JPY 横河電機	1 100.00	24 411.89	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
JPY ゼンショーホールディングス	500.00	30 032.96	0.00
JPY Z O Z O	520.00	16 318.27	0.00
日本合計		17 636 853.32	1.92
ルクセンブルグ			
EUR ARCELORMITTAL NPV(POST STOCK SPLIT)	2 189.00	55 118.60	0.02
EUR CVC CAPITAL PARTNE ORD NPV	617.00	15 099.32	0.00
EUR EUROFINS SCIENTIFI EURO.01	622.00	30 738.99	0.00
EUR TENARIS S.A. USD1	2 096.00	40 202.52	0.00
ルクセンブルグ合計		141 159.43	0.02
マカオ			
HKD SANDS CHINA LTD USD0.01 REG'S'	10 000.00	25 496.21	0.00
マカオ合計		25 496.21	0.00
オランダ			
EUR ABN AMRO BANK N.V. DR EACH REP SHS	2 342.00	36 399.32	0.00
EUR ADYEN NV EURO.01	104.00	151 410.07	0.02
USD AERCAP HOLDINGS EURO.01	895.00	88 927.20	0.01
EUR AKZO NOBEL NV EURO.50(POST REV SPLIT)	785.00	45 850.17	0.00
EUR ARGEN X NV EURO.10	284.00	175 897.01	0.02
EUR ASM INTL NV EURO.04	231.00	124 772.50	0.02
EUR ASML HOLDING NV EURO.09	1 873.00	1 302 488.10	0.14
EUR ASR NEDERLAND N.V. EURO.16	640.00	30 621.35	0.00
EUR BE SEMICONDUCTOR EURO.01	335.00	39 982.45	0.00
EUR EURONEXT EUR1.60	415.00	46 330.74	0.01
EUR EXOR NV EURO.01	424.00	41 939.17	0.00
EUR FERRARI NV EURO.01(NEW)	572.00	248 727.07	0.03
EUR FERROVIAL SE EURO.01	2 238.00	92 234.52	0.01
EUR HEINEKEN HOLDING EUR1.6	545.00	34 537.74	0.00
EUR HEINEKEN NV EUR1.60	1 407.00	104 114.30	0.01
EUR IMCD NV EURO.16	285.00	42 774.52	0.00
EUR ING GROEP N.V. EURO.01	15 467.00	239 456.69	0.03
EUR JDE PEETS N.V. EURO.01	430.00	8 570.11	0.00
EUR KON KPN NV EURO.04	16 821.00	65 220.23	0.01
EUR KONINKLIJKE AHOLD EURO.01	4 538.00	156 492.61	0.02
EUR KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20	3 625.00	98 742.82	0.01
EUR NN GROUP N.V. EURO.12	1 168.00	54 243.22	0.01
EUR PROSUS N.V. EURO.05	6 408.00	260 911.40	0.03
EUR QIAGEN NV ORD EURO.01 (POST REV SPLT)	1 037.00	45 328.14	0.00
EUR RANDSTAD N.V. EURO.10	410.00	18 018.88	0.00
EUR STELLANTIS N V COM EURO.01	9 152.00	121 177.26	0.02
EUR UNIVERSAL MUSIC GR EUR10.00	4 014.00	96 704.97	0.01
EUR WOLTERS KLUWER EURO.12	1 121.00	187 012.83	0.02
オランダ合計		3 958 885.39	0.43
ニュージーランド			
NZD AUCKLAND INTL NPV	7 451.00	34 203.28	0.00
NZD FISHER & PAYKEL HE NPV	2 888.00	65 004.48	0.02
NZD INFRATIL LTD NPV	3 153.00	23 967.27	0.00
NZD MERCURY NZ LTD NPV	5 494.00	21 514.84	0.00
NZD MERIDIAN ENERGY LT NPV	5 064.00	18 602.73	0.00
AUD XERO LIMITED NPV	658.00	74 521.52	0.01
ニュージーランド合計		237 814.12	0.03

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・メディアム(米ドル)

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
ノルウェー			
NOK AKER BP ASA NOK1	1 583.00	32 419.66	0.00
NOK DNB BANK ASA NOK12.50	4 046.00	84 435.40	0.02
NOK EQUINOR ASA NOK2.50	3 809.00	92 065.84	0.02
NOK GJENSIDIGE FORSIKR NOK2	1 163.00	20 662.00	0.00
NOK KONGSBERG GRUPPEN NOK5	384.00	45 122.32	0.01
NOK MOWI ASA NOK7.50	1 885.00	34 171.19	0.00
NOK NORSK HYDRO ASA NOK3.6666	6 536.00	40 381.63	0.00
NOK ORKLA ASA NOK1.25	3 624.00	33 405.15	0.00
NOK SALMAR ASA NOK0.25	297.00	15 421.24	0.00
NOK TELENOR ASA ORD NOK6	3 036.00	35 702.30	0.00
NOK YARA INTERNATIONAL NOK1.7	869.00	24 415.88	0.00
ノルウェー合計		458 202.61	0.05
ポーランド			
EUR INPOST S.A. EURO.01	1 002.00	17 546.82	0.00
ポーランド合計		17 546.82	0.00
ポルトガル			
EUR EDP ENERGIAS PORTU EUR1(REGD)	14 289.00	51 644.97	0.01
EUR GALP ENERGIA EUR1-B	2 398.00	39 346.54	0.00
EUR JERONIMO MARTINS EUR5	1 179.00	22 962.59	0.00
ポルトガル合計		113 954.10	0.01
シンガポール			
SGD CAPITALAND INVESTM NPV	16 400.00	33 395.74	0.00
SGD DBS GROUP HLDGS SGD1	9 260.00	293 068.14	0.04
SGD GENTING SING LTD NPV	45 000.00	25 677.84	0.00
USD GRAB HLDGS LTD COM USDO.000001 CL A	10 300.00	51 500.00	0.01
SGD KEPPEL LTD	6 600.00	33 131.69	0.00
SGD OVERSEA-CHINESE BK NPV	15 687.00	190 492.94	0.02
USD SEA LTD ADS EACH REP ONE CL A SHS	1 700.00	193 460.00	0.03
SGD SEMBCORP INDUSTRIE SGDO.25 (POST REORG)	3 300.00	12 848.99	0.00
SGD SINGAPORE AIRLINES NPV	6 000.00	28 240.03	0.00
SGD SINGAPORE EXCHANGE SGDO.01	3 100.00	29 412.60	0.00
SGD SINGAPORE TECH ENG NPV	8 100.00	27 188.30	0.00
SGD SINGAPORE TELECOMM NPV	39 100.00	90 411.37	0.01
SGD UTD O/S BANK SGD1	5 700.00	154 590.68	0.02
SGD WILMAR INTERNATIONAL LTD	9 600.00	22 054.97	0.00
シンガポール合計		1 185 473.29	0.13
スペイン			
EUR ACCIONA SA EUR1	107.00	13 595.51	0.00
EUR ACS ACTIVIDADES CO EURO.5	853.00	39 605.26	0.00
EUR AENA SME S.A. EUR10	376.00	81 332.47	0.01
EUR AMADEUS IT GROUP EURO.01	2 066.00	144 935.69	0.02
EUR BANCO SANTANDER SA EURO.50(REGD)	73 775.00	340 944.01	0.04
EUR BBVA(BILB-VIZ-ARG) EURO.49	27 121.00	255 973.51	0.03
EUR BCO DE SABADELL EURO.125	24 698.00	46 576.60	0.01
EUR CAIXABANK SA EUR1	17 639.00	95 871.58	0.01
EUR CELLNEX TELECOM SA EURO.25	2 558.00	91 805.79	0.01
EUR EDP RENOVAVEIS SA EUR5	1 491.00	17 448.72	0.00
EUR ENDESA SA EUR1.2	1 307.00	28 630.60	0.00
EUR GRIFOLS SA EURO.25 (CLASS A) POST SUBD	1 705.00	15 515.87	0.00
EUR IBERDROLA SA EURO.75 (POST SUBDIVISION)	28 448.00	405 331.03	0.04

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR INDITEX EURO.03 (POST SUBD)	5 188.00	285 923.73	0.03
EUR REDEIA CORP SA EURO.5	2 180.00	38 912.52	0.00
EUR REPSOL SA EUR1	5 389.00	67 306.27	0.01
EUR TELEFONICA SA EUR1	18 173.00	82 266.87	0.01
スペイン合計		2 051 976.03	0.22
スウェーデン			
SEK ADDTECH AB SER'B'NPV (POST SPLIT)	996.00	27 365.52	0.00
SEK ALFA LAVAL AB NPV	1 384.00	58 851.55	0.01
SEK ASSA ABLOY SER'B'NPV (POST SPLIT)	4 790.00	146 917.58	0.02
SEK ATLAS COPCO AB SER'A'NPV (POST SPLIT)	12 645.00	201 681.20	0.03
SEK ATLAS COPCO AB SER'B'NPV (POST SPLIT)	7 204.00	101 671.55	0.02
SEK BEIJER REF AB SER'B'NPV (POST SPLIT)	1 574.00	24 794.55	0.00
SEK BOLIDEN AB NPV (POST SPLIT)	1 235.00	36 805.07	0.00
SEK EPIROC AB SER'A'NPV (POST SPLIT)	3 363.00	61 214.89	0.01
SEK EPIROC AB SER'B'NPV	1 881.00	30 991.53	0.00
SEK EQT AB NPV	1 705.00	51 608.23	0.01
SEK ERICSSON SER'B' NPV	13 332.00	108 278.96	0.02
SEK ESSITY AB SER'B'NPV	3 024.00	83 141.06	0.01
SEK EVOLUTION AB NPV	770.00	67 135.28	0.01
SEK FASTIGHETS AB BALD SER'B'NPV (POST SPLIT)	2 559.00	19 667.94	0.00
SEK GETINGE AB SER'B'NPV	1 179.00	18 404.92	0.00
SEK HENNES & MAURITZ SER'B'NPV	2 411.00	33 397.63	0.00
SEK HEXAGON AB SER'B'NPV (POST SPLIT)	10 031.00	85 382.72	0.01
SEK HOLMEN AB SER'B'NPV (POST SPLIT)	493.00	18 548.14	0.00
SEK INDUSTRIVARDEN AB SER'C'NPV	608.00	19 906.86	0.00
SEK INDUSTRIVARDEN AB SER'A'NPV	504.00	16 534.05	0.00
SEK INDUTRADE AB NPV	1 463.00	37 302.39	0.00
SEK INVESTOR AB SER'B'NPV (POST SPLIT)	7 987.00	218 897.57	0.03
SEK LATOUR INVESTMENT SER'B'NPV (POST SPLIT)	633.00	16 058.56	0.00
SEK LIFCO AB SER'B'NPV (POST SPLIT)	1 160.00	35 164.88	0.00
SEK LUNDBERGFORETAGEN SER'B'NPV	369.00	17 877.43	0.00
SEK NIBE INDUSTRIER AB SER'B'NPV (POST SPLIT)	6 464.00	27 362.41	0.00
SEK SAAB AB NPV B	1 592.00	34 825.02	0.00
SEK SAGAX AB NPV B	1 059.00	23 432.36	0.00
SEK SANDVIK AB NPV (POST SPLIT)	5 198.00	96 020.79	0.02
SEK SECURITAS SER'B'NPV	2 600.00	32 848.70	0.00
SEK SKAND ENSKILDA BKN SER'A'NPV	7 386.00	102 481.40	0.02
SEK SKANSKA AB SER'B'NPV	1 781.00	37 108.07	0.00
SEK SKF AB SER'B'NPV	1 676.00	32 157.42	0.00
USD SPOTIFY TECHNOLOGY COM EURO.000625	706.00	336 733.76	0.04
SEK SVENSKA CELLULOSA SER'B'NPV	2 822.00	36 622.67	0.00
SEK SVENSKA HANDELSBKN SER'A'NPV (P/S)	7 053.00	73 315.00	0.01
SEK SWEDBANK AB SER'A'NPV	4 092.00	80 124.70	0.01
SEK SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB NPV	894.00	24 759.53	0.00
SEK TELE2 AB SHS	2 412.00	25 282.28	0.00
SEK TELIA COMPANY AB NPV	11 740.00	34 352.79	0.00
SEK TRELLEBORG AB SER'B'NPV	890.00	29 392.66	0.00
SEK VOLVO AB SER'A'NPV (POST SPLIT)	1 148.00	28 703.02	0.00
SEK VOLVO AB SER'B'NPV (POST SPLIT)	7 494.00	186 408.86	0.02
スウェーデン合計		2 779 531.50	0.30
スイス			
CHF ABB LTD CHF0.12 (REGD)	7 405.00	422 614.53	0.05
CHF ADECCO GROUP AG CHF0.1 (REGD)	837.00	22 326.33	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・メディアム(米ドル)

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
CHF ALCON AG CHF0.04	2 377.00	211 474.76	0.02
CHF AVOLTA AG CHF5 (REGD)	556.00	20 548.65	0.00
CHF BACHEM HOLDING AG CHF0.01 (REGD) (SUBD)	179.00	13 836.44	0.00
CHF BALOISE-HLDGS CHF0.1(REGD)	196.00	37 242.22	0.00
CHF BARRY CALLEBAUT AG CHF0.02 (REGD)	17.00	25 934.17	0.00
CHF BKW AG CHF2.5	129.00	22 168.67	0.00
CHF BQE CANT VAUDOISE CHF1	97.00	9 628.43	0.00
CHF CLARIANT CHF1.76 (REGD)	1 120.00	13 488.31	0.00
GBP COCA-COLA HBC AG ORD CHF6.70	1 079.00	38 455.82	0.00
EUR DSM FIRMENICH AG EURO.01	878.00	96 397.37	0.01
CHF EMS-CHEMIE HLDG AG CHF0.01(REGD)(POST RECON)	37.00	26 311.58	0.00
CHF GALDERMA GROUP AG CHF0.01	303.00	31 039.44	0.00
CHF GEBERIT CHF0.10(REGD)	156.00	93 918.73	0.01
CHF GIVAUDAN AG CHF10	43.00	189 424.52	0.02
GBP GLENCORE PLC ORD USD0.01	48 169.00	232 625.18	0.03
CHF HELVETIA HOLDING CHF0.02 (REGD) POST SUBD	177.00	31 020.20	0.00
CHF HOLCIM LTD CHF2 (REGD)	2 389.00	243 347.17	0.03
CHF JULIUS BAER GRUPPE CHF0.02 (REGD)	920.00	60 880.82	0.01
CHF KUEHNE&NAGEL INTL CHF1(REGD)(POST-SUBD)	236.00	56 414.98	0.01
CHF LINDT & SPRUENGLI CHF100(REGD)	1.00	113 507.38	0.01
CHF LOGITECH INTL CHF0.25(REGD) (POST-SUBD)	710.00	57 622.02	0.01
CHF LONZA GROUP AG CHF1(REGD)	347.00	207 333.48	0.02
CHF NESTLE SA CHF0.10(REGD)	12 272.00	1 065 337.75	0.12
CHF NOVARTIS AG CHF0.49 (REGD)	9 128.00	966 366.13	0.11
CHF PARTNERS GROUP HLG CHF0.01 (REGD)	105.00	152 553.92	0.02
CHF RICHEMONT(CIE FIN) CHF1.00 (REG) SER 'A'	2 503.00	348 601.70	0.04
CHF ROCHE HLDGS AG CHF1(BR)	145.00	44 569.81	0.00
CHF ROCHE HLDGS AG GENUSSCHEINE NPV	3 257.00	944 566.97	0.10
CHF SANDOZ GROUP AG CHF0.05	1 841.00	83 879.39	0.01
CHF SCHINDLER-HLDG AG CHF0.1(REGD)(POST-SUBD)	118.00	33 417.71	0.00
CHF SCHINDLER-HLDG AG PTG CERT CHF0.10(POST-SUBD)	208.00	60 062.66	0.01
CHF SGS SA CHF0.04 (REGD)	694.00	68 911.60	0.01
CHF SIG GROUP AG CHF0.01	1 324.00	26 179.43	0.00
CHF SIKA AG CHF0.01 (REG)	693.00	179 424.86	0.02
CHF SONOVA HOLDING AG CHF0.05 (REGD)	226.00	77 163.22	0.01
EUR STMICROELECTRONICS EUR1.04	3 111.00	79 747.29	0.01
CHF STRAUMANN HLDG CHF0.01 (REGD) (POST SPLIT)	499.00	64 937.97	0.01
CHF SWATCH GROUP CHF2.25(BR)	150.00	27 233.26	0.00
CHF SWISS LIFE HLDG CHF5.1(REGD)	131.00	107 327.81	0.01
CHF SWISS PRIME SITE CHF15.3 (REGD)	338.00	37 348.81	0.00
CHF SWISS RE AG CHF0.10	1 437.00	212 287.80	0.02
CHF SWISSCOM AG CHF1(REGD)	132.00	76 188.42	0.01
CHF TEMENOS AG CHF5 (REGD)	328.00	21 537.80	0.00
CHF UBS GROUP CHF0.10 (REGD)	15 253.00	493 082.22	0.06
CHF VAT GROUP AG CHF0.10	126.00	50 256.98	0.01
CHF ZURICH INSURANCE GRP CHF0.10	683.00	433 057.66	0.05
スイス合計		7 931 602.37	0.86

イギリス

GBP 3I GROUP ORD GBPO.738636	4 591.00	216 434.64	0.03
GBP ADMIRAL GROUP ORD GBPO.001	1 230.00	40 069.72	0.00
GBP ANGLO AMERICAN USD0.54945	6 155.00	197 186.60	0.02
GBP ANTOFAGASTA ORD GBPO.05	1 821.00	39 405.77	0.00
GBP ASHTEAD GROUP ORD GBPO.10	2 090.00	167 093.50	0.02
GBP ASSOCD BRIT FOODS ORD GBPO.0568	1 703.00	47 577.87	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
GBP ASTRAZENECA ORD USD0.25	7 189.00	969 679.83	0.11
GBP AUTO TRADER GROUP ORD GBP0.01	3 709.00	39 553.18	0.00
GBP AVIVA ORD GBP0.33	13 076.00	80 392.15	0.01
GBP BAE SYSTEMS ORD GBP0.025	13 940.00	217 405.22	0.03
GBP BARCLAYS ORD GBP0.25	68 149.00	228 505.63	0.03
GBP BARRATT REDROW PLC GBP0.10	5 315.00	28 893.84	0.00
GBP BERKELEY GP HLDGS ORD GBP0.05611047	420.00	22 143.72	0.00
GBP BP ORD USD0.25	76 066.00	371 893.81	0.04
GBP BRIT AMER TOBACCO ORD GBP0.25	9 357.00	355 369.26	0.04
GBP BT GROUP ORD GBP0.05	32 248.00	65 295.19	0.01
GBP BUNZL ORD GBP0.32142857	1 678.00	75 885.80	0.01
GBP CENTRICA ORD GBP0.061728395	26 522.00	42 947.55	0.00
USD COCA-COLA EUROPACI COM EURO.01	884.00	68 580.72	0.01
GBP COMPASS GROUP ORD GBP0.1105	7 861.00	268 877.29	0.03
GBP CRODA INTL ORD GBP0.10609756	689.00	30 213.49	0.00
GBP DIAGEO ORD GBP0.28 101/108	10 520.00	314 563.27	0.04
GBP ENDEAVOUR MINING P ORD USD0.01	920.00	18 055.01	0.00
GBP GSK PLC ORD GBP0.3125	19 737.00	334 907.63	0.04
GBP HALEON PLC ORD GBP1.25	35 672.00	169 710.98	0.02
GBP HALMA ORD GBP0.10	1 718.00	59 133.62	0.01
GBP HARGREAVES LANSDOW ORD GBP0.004 (WI)	1 665.00	23 141.73	0.00
GBP HIKMA PHARMACEUTIC ORD GBP0.10	838.00	20 493.29	0.00
GBP HSBC HLDGS ORD USD0.50(UK REG)	85 442.00	795 719.92	0.09
GBP IMPERIAL BRANDS PL GBP0.10	3 741.00	122 155.90	0.01
GBP INFORMA PLC (GB) ORD GBP0.001	6 449.00	70 215.51	0.01
GBP INTERCONTL HOTELS ORD GBP0.208521303	750.00	93 422.18	0.01
GBP INTERTEK GROUP ORD GBP0.01	736.00	44 117.84	0.00
GBP JD SPORTS FASHION ORD GBP0.0005	11 209.00	14 503.65	0.00
GBP KINGFISHER ORD GBP0.157142857	9 451.00	29 731.42	0.00
GBP LAND SECURITIES GP ORD GBP0.106666666	2 595.00	19 889.20	0.00
GBP LEGAL & GENERAL GP ORD GBP0.025	29 307.00	82 435.71	0.01
GBP LLOYDS BANKING GP ORD GBP0.1	297 899.00	200 908.79	0.02
GBP LONDON STOCK EXCH ORD GBP0.06918604	2 274.00	325 744.44	0.04
GBP M&G PLC ORD GBP0.05	10 440.00	26 300.67	0.00
GBP MARKS & SPENCER GP ORD GBP0.25	7 843.00	38 150.77	0.00
GBP MELROSE INDUST PLC ORD GBP0.001	6 210.00	45 338.66	0.00
GBP MONDI PLC ORD EURO.22(POST CONS)	2 121.00	32 094.66	0.00
GBP NATIONAL GRID ORD GBP0.12431289	22 458.00	283 340.06	0.03
GBP NATWEST GROUP PLC ORD GBP1.0769	32 279.00	165 220.65	0.02
GBP NEXT ORD GBP0.10	552.00	70 723.26	0.01
GBP PEARSON ORD GBP0.25	2 990.00	46 859.42	0.01
GBP PERSIMMON ORD GBP0.10	1 390.00	22 225.83	0.00
GBP PHOENIX GP HLDGS ORD GBP0.10	3 691.00	24 114.03	0.00
GBP PRUDENTIAL ORD GBP0.05	11 968.00	97 630.14	0.01
GBP RECKITT BENCK GRP ORD GBP0.10	3 244.00	200 391.71	0.02
GBP RELX PLC GBP0.1444	8 728.00	411 022.49	0.05
GBP RENTOKIL INITIAL ORD GBP0.01	10 993.00	55 024.30	0.01
GBP RIO TINTO ORD GBP0.10	5 160.00	323 766.18	0.04
GBP ROLLS-ROYCE HLDGS ORD GBP0.20	39 216.00	278 436.95	0.03
GBP SAGE GROUP GBP0.01051948	4 679.00	78 027.83	0.01
GBP SAINSBURY(J) ORD GBP0.28571428	9 360.00	31 075.04	0.00
GBP SCHROEDERS PLC ORD GBP0.20	4 644.00	18 605.49	0.00
GBP SEVERN TRENT ORD GBP0.9789	1 192.00	40 862.02	0.00
GBP SHELL PLC ORD EURO.07	28 714.00	923 919.78	0.10
GBP SMITH & NEPHEW ORD USD0.20	4 244.00	53 781.53	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
GBP SMITHS GROUP ORD GBP0.375	1 524.00	34 305.69	0.00
GBP SPIRAX GROUP PLC ORD GBP0.269230769	333.00	30 347.72	0.00
GBP SSE PLC ORD GBP0.50	5 154.00	116 050.82	0.01
GBP STANDARD CHARTERED ORD USD0.50	10 124.00	125 129.51	0.02
GBP TAYLOR WIMPEY ORD GBP0.01	18 744.00	31 210.18	0.00
GBP TESCO ORD GBP0.0633333	32 886.00	153 154.28	0.02
GBP UNILEVER PLC ORD GBP0.031111	5 930.00	354 329.72	0.04
EUR UNILEVER PLC ORD GBP0.031111	5 681.00	339 495.40	0.04
GBP UNITED UTILITIES G ORD GBP0.05	3 070.00	43 684.27	0.00
GBP VODAFONE GROUP ORD USD0.2095238(POST CONS)	103 158.00	92 937.13	0.01
GBP WHITBREAD ORD GBP0.76797385	809.00	29 305.96	0.00
GBP WISE PLC CLS A ORD GBP0.01	3 303.00	37 028.81	0.00
GBP WPP PLC ORD GBP0.10	4 791.00	52 321.85	0.01
イギリス合計		11 018 467.68	1.20
アメリカ合衆国			
CAD BROOKFIELD RENEWA. CLASS A SUB VOTING SHARES	500.00	15 934.01	0.00
アメリカ合衆国合計		15 934.01	0.00
株式合計		87 587 513.95	9.52
投資信託証券			
アイルランド			
USD STAR COMPASS PLC/UBS DYNMC DIVERSIFIED LTD NOTE DUE 30.09.25	30 470 000.00	57 381 104.00	6.24
アイルランド合計		57 381 104.00	6.24
投資信託証券合計		57 381 104.00	6.24
コモディティ証券			
イギリス			
USD UBS AG/LONDON/UBS ETC CMC1 COMPOSITE USD 16-PRP	37 611.00	5 724 206.15	0.63
イギリス合計		5 724 206.15	0.63
コモディティ証券合計		5 724 206.15	0.63
投資信託、クローズド・エンド型			
カナダ			
CAD CANADIAN APARTMENT PROP. REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	400.00	13 098.60	0.00
カナダ合計		13 098.60	0.00
シンガポール			
SGD CAPITALAND ASCENDAS REIT- UNITS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21 700.00	42 407.79	0.00
SGD CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST REAL ESTATE INV TRUST	33 407.00	48 840.28	0.01
シンガポール合計		91 248.07	0.01
イギリス			
GBP SEGRO PLC REIT	5 157.00	51 127.48	0.01
イギリス合計		51 127.48	0.01
投資信託、クローズド・エンド型合計		155 474.15	0.02
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある証券および短期金融商品合計		150 848 298.25	16.41

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・メディアム(米ドル)

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券および短期金融商品			
財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 22.02.24-20.02.25	11 880 000.00	11 764 044.55	1.28
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 21.03.24-20.03.25	13 880 000.00	13 699 376.09	1.49
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 18.04.24-17.04.25	5 480 000.00	5 390 711.29	0.58
USD UNITED STATES TB 0.00000% 20.06.24-19.12.24	18 980 000.00	18 939 210.47	2.06
USD UNITED STATES TB 0.00000% 18.07.24-16.01.25	9 600 000.00	9 546 165.02	1.04
米ドル合計		59 339 507.42	6.45
財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン合計		59 339 507.42	6.45
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券および短期金融商品合計		59 339 507.42	6.45

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

投資信託、オープン・エンド型

アイルランド

USD AMBIENTA X ALPHA FUND-ACCUM SHS -U2- HEDGED USD	3 634.15	3 635 560.42	0.39
USD AMUNDI TIEDEMANN ARBITRAGE STRATEGY FUND-PTG.SHS -I- USD	11 460.11	1 816 811.19	0.20
USD INVESCO MSCI USA UCITS ETF-ACCUM SHS USD	259 061.00	45 313 654.82	4.93
USD JUPITER MERIAN GLBL EQUITY ABSOLUTE RETURN-ACCUM SHS -I- USD	719 702.51	1 666 111.30	0.18
USD KEPLER LIQUID STRAT ICAV KLS ARETE MACRO-ACCUM SHS-SI-USD	18 191.75	2 772 349.93	0.30
USD LAZARD RATHMORE ALT FUND-ACCUM SHS-Z-USD	31 083.09	3 499 614.02	0.38
USD MAN FUNDS VI PLC-MAN AHL TARGETRISK-INU-USD-CAP	98 135.63	16 156 068.93	1.76
USD TAGES INTERNATIONAL FUND ICAV-KG-ACCUM SHS INSTITUTIONAL USD	40 222.04	4 321 379.77	0.47
EUR TAGES INTERNATIONAL FUNDS ICAV ACCUM SHS INSTIT. FD EUR	50.85	5 729.38	0.00
USD UBS IRL FND SOLUTIONS PLC-MSCI USA SF INDEX-SHS-A-USD-ACC	676 286.00	121 366 420.82	13.20
USD UBS(IRL)FUND SOLUTION PLC-MSCI USA SF UCITS SHS-A-ETF-ACC	436 630.00	75 432 198.80	8.20
アイルランド合計		275 985 899.38	30.01

ルクセンブルグ

USD AQR UCITS FUNDS - GLOBAL RISK PARITY UCITS FUND-A2-CAP	93 753.70	12 465 491.95	1.36
USD FOCUSED SICAV - HIGH GRADE BOND USD U-X-ACC	8 941.50	92 282 002.56	10.04
USD FOCUSED SICAV - HIGH GRADE LONG TERM BOND USD U-X-ACC	8 729.00	82 695 752.72	8.99
USD INVESCO FDS SICAV-INVS BLNCD-RISK ALLC 12%-SHS(USD HDG)-CAP	797 079.00	8 751 927.42	0.95
USD LUMYNA - MW TOP ENVIRONMENTAL FOCUS MKT NEUTRAL UCITS FD-CAP	11 706.47	1 647 359.46	0.18
USD LUMYNA-MARSHALL WACE UCITS SIC ESG MKT NTRL TOPS B CAP-EQUAL	1 300.10	1 300.10	0.00
USD LUMYNA-PSAM GLOBAL EVENT UCITS FUND-SHS B-CAPITALISATION	18 741.30	2 407 694.81	0.26
USD SCHRODER GAIA EGERTON EQUITY-C USD HEDGED	5 571.00	1 761 160.23	0.19
USD SCHRODER GAIA SICAV - GAIA TWO SIGMA DIVERSIFIED-C-CAPITAL	33 999.32	5 070 318.59	0.55
USD SCHRODER GAIA SICAV - SCHRDR GAIA WELGTON PAGA-SHS-C USD-CAP	27 186.51	3 505 700.46	0.38
USD UBS (LUX) BD SICAV-USD INVES GRA CORPOR SUSTAI (USD) F-ACC	544.09	64 693 822.20	7.04
USD UBS (LUX) BOND FUND-EURO HIGH YIELD (EUR)(USD HEDGED) F-ACC	146 745.00	22 159 962.45	2.41
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD (USD) F-ACC	85 348.00	33 482 020.40	3.64
USD UBS (LUX) BOND SICAV - EMERG ECON CORPORATES (USD) F-ACC	226 339.00	29 630 038.49	3.22
USD UBS (LUX) EMERGING ECONOMIES FUND - GLOBAL BONDS (USD) F-ACC	20 498.00	44 459 752.04	4.84
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD U-X-ACC	2.00	25 297.16	0.00
USD WINTON ALMA DIVERSIFIED MACRO FUND-SHS -I1C-U-CAPITALISATION	15 299.04	2 687 124.09	0.29
ルクセンブルグ合計		407 726 725.13	44.34

投資信託、オープン・エンド型合計	683	712	624.51	74.35
ルクセンブルグ2010年12月17日法(改訂済)の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs合計	683	712	624.51	74.35

注記は当財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・シキャブ

- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・メディアム(米ドル)

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引されていない派生商品			
株式に係るワラント債			
カナダ			
CAD CONSTELLATION SOFTWARE INC/CANADA CALL WARRANT 31.03.40	135.00	0.01	0.00
カナダ合計		0.01	0.00
株式に係るワラント債合計		0.01	0.00
公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引され ていない派生商品合計		0.01	0.00
投資有価証券合計		893 900 430.19	97.21

派生商品

公認の証券取引所に上場されている派生商品

債券に係る金融先物			
USD US LONG BOND FUTURE 20.03.25	-16.00	-22 500.00	0.00
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 20.03.25	-129.00	-114 890.63	-0.02
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 20.03.25	-181.00	-114 539.15	-0.01
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.25	-304.00	-106 875.46	-0.01
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.25	-363.00	-155 976.74	-0.02
債券に係る金融先物合計		-514 781.98	-0.06
指数に係る金融先物			
EUR EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 20.12.24	189.00	-175 323.92	-0.02
CHF SWISS MARKET INDEX FUTURE 20.12.24	22.00	-85 652.67	-0.01
GBP FTSE 100 INDEX FUTURE 20.12.24	43.00	-51 649.12	-0.01
SEK OMX 30 INDEX FUTURE 20.12.24	41.00	-15 095.00	0.00
HKD HANG SENG INDEX FUTURE 30.12.24	4.00	9 072.74	0.00
USD S&P500 EMINI FUTURE 20.12.24	335.00	4 790 860.00	0.52
CAD S&P/TSX 60 IX FUT FUTURE 19.12.24	18.00	301 883.37	0.04
USD MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 20.12.24	913.00	-703 010.00	-0.08
JPY TOPIX INDEX FUTURE 12.12.24	39.00	275 839.80	0.03
AUD SPI 200 INDEX FUTURES 19.12.24	18.00	78 564.87	0.01
指数に係る金融先物合計		4 425 490.07	0.48
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		3 910 708.09	0.42

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

指数に係るスワップおよび先渡スワップ

USD UBS/CMCI EXCESS RETURN INDEX TRS EQS REC PERF 24-02.04.25	31 101 629.03	-204 712.98	-0.02
USD UBS/CMCI EXCESS RETURN INDEX TRS EQS PAY 0.3800% 24- 02.04.25			
指数に係るスワップおよび先渡スワップ合計		-204 712.98	-0.02
公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引され ていない派生商品合計		-204 712.98	-0.02
派生商品合計		3 705 995.11	0.40

注記は当財務書類と不可分のものである。

U B S (L u x) ストラテジー・シキャブ

- システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム（米ドル）

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 （注１）	純資産 比率 （％）		
先渡為替契約					
購入通貨 / 購入額 / 売却通貨 / 売却額 / 満期日（日-月-年）					
USD	1 194 477.71	SGD 1 571 038.00	19.12.2024	21 659.37	0.00
USD	395 456.40	NOK 4 336 807.00	19.12.2024	3 131.60	0.00
USD	5 944 616.32	AUD 8 980 000.00	19.12.2024	93 622.43	0.01
USD	365 925.83	ILS 1 371 382.42	19.12.2024	-11 411.85	0.00
USD	2 452 910.21	SEK 26 161 705.13	19.12.2024	54 219.46	0.01
USD	2 916 587.22	DKK 19 930 000.00	19.12.2024	91 206.86	0.01
USD	2 423 491.37	HKD 18 821 770.14	19.12.2024	4 172.67	0.00
USD	10 821 969.11	CAD 15 004 313.87	19.12.2024	98 412.04	0.01
USD	13 320 348.75	GBP 10 260 086.97	19.12.2024	279 458.37	0.03
USD	19 553 178.97	JPY 2 959 795 790.00	19.12.2024	-207 210.89	-0.01
USD	30 261 237.45	EUR 27 736 215.59	19.12.2024	942 923.21	0.10
USD	8 565 927.34	CHF 7 356 161.42	19.12.2024	197 988.21	0.02
USD	460 882.73	NZD 768 002.21	19.12.2024	6 451.46	0.00
CAD	24 556 300.00	USD 17 623 057.76	13.1.2025	-56 542.46	-0.01
SGD	33 613 800.00	USD 25 174 105.58	13.1.2025	-54 332.73	-0.01
AUD	53 406 700.00	USD 34 961 660.07	13.1.2025	-158 998.53	-0.02
CHF	125 528 200.00	USD 143 300 450.89	13.1.2025	-113 684.20	-0.01
GBP	22 602 000.00	USD 28 979 023.21	13.1.2025	-252 473.54	-0.03
EUR	110 049 100.00	USD 117 234 238.75	13.1.2025	-783 251.38	-0.09
SEK	33 928 000.00	USD 3 130 124.06	13.1.2025	-14 852.44	0.00
USD	71 446.92	GBP 56 100.00	13.1.2025	145.29	0.00
USD	469 435.23	CHF 414 000.00	13.1.2025	-2 803.85	0.00
USD	296 218.44	EUR 280 000.00	13.1.2025	-70.00	0.00
USD	197 713.71	CAD 276 800.00	13.1.2025	-297.04	0.00
USD	53 081.40	EUR 50 000.00	13.1.2025	172.75	0.00
USD	109 275.11	CAD 152 500.00	13.1.2025	183.20	0.00
USD	437 628.83	EUR 417 100.00	13.1.2025	-3 735.13	0.00
USD	644 187.24	CHF 568 800.00	13.1.2025	-4 628.19	0.00
USD	405 680.11	CHF 358 200.00	13.1.2025	-2 909.35	0.00
CHF	354 700.00	USD 402 676.67	2.12.2024	-66.00	0.00
AUD	2 840 700.00	USD 1 845 304.52	2.12.2024	5 269.49	0.00
USD	942 842.39	AUD 1 451 000.00	13.1.2025	-2 706.80	0.00
CAD	2 279 600.00	USD 1 625 226.23	2.12.2024	2 885.04	0.00
USD	404 658.58	CHF 354 700.00	13.1.2025	61.48	0.00
USD	1 228 797.02	CAD 1 720 900.00	13.1.2025	-2 260.43	0.00
EUR	337 700.00	USD 356 375.32	3.12.2024	303.42	0.00
EUR	1 530 000.00	USD 1 617 021.81	19.12.2024	250.76	0.00
先渡為替契約合計				130 282.30	0.01
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産				22 224 629.06*	2.42
当座借越およびその他の短期負債				-752.95	0.00
その他の資産および負債				-384 773.97	-0.04
純資産総額				919 575 809.74	100.00

* 2024年11月30日現在、20,000.00米ドルの現金額が取引相手方であるユービーエス・エイ・ジーの担保として使用される。

注記は当財務書類と不可分のものである。

[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
ダイナミック・インカム(米ドル)	クラスP - m d i s t 投資証券	222,917.489 (102,321.936)	290,842.057 (85,488.221)	2,253,377.829 (1,157,410.416)
	クラスP - a c c 投資証券	485,390.033 (0.000)	62,671.649 (8,525.472)	787,526.452 (121,789.617)
インカム・サステナブル(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	8,181.446 (0.000)	49,513.371 (5,380.000)	444,391.436 (3,610.000)
システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	6,576.644 (0.000)	277,030.359 (0.000)	790,982.946 (51,404.999) (注2)
システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ミディアム(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	163,889.903 (14,401.204)	417,037.925 (26,632.961)	1,868,058.365 (209,669.045)
システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ダイナミック(米ドル)	クラスP - a c c 投資証券	7,002.934 (0.000)	108,615.060 (1,795.009)	640,259.432 (27,850.824)

(注1) ()内の数字は本邦内における販売、買戻しおよび発行済口数であり、受渡し日を基準として算出している。一方、()の上段の数字は約定日を基準として算出している。

(注2) システムティック・アロケーション・ポートフォリオ・ディフェンシブ(米ドル)クラスP - a c c投資証券の2024年12月末日現在の本邦内の発行済口数には、海外の口座から移管された8,738.371口が含まれている。

[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

3 投資主・外国投資法人債権者の権利等

< 訂正前 >

(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 弁護士 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
-----------------	---

< 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 弁護士 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
---------------	---

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

(3) 本邦における代理人

< 訂正前 >

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

弁護士 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

< 訂正後 >

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

弁護士 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