

記載内容の一部訂正について

第33期～第34期交付運用報告書および全体版運用報告書におきまして、記載内容の一部に誤りがございました。受益者のみなさまに深くお詫び申し上げますとともに、下記の内容に訂正させていただくことをご報告いたします。

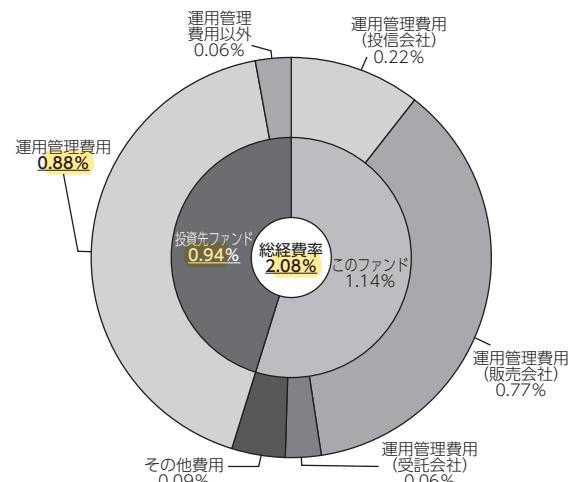
第33期～第34期

〔訂正箇所〕 交付運用報告書3ページ/全体版運用報告書10ページ

(参考情報) 総経費率

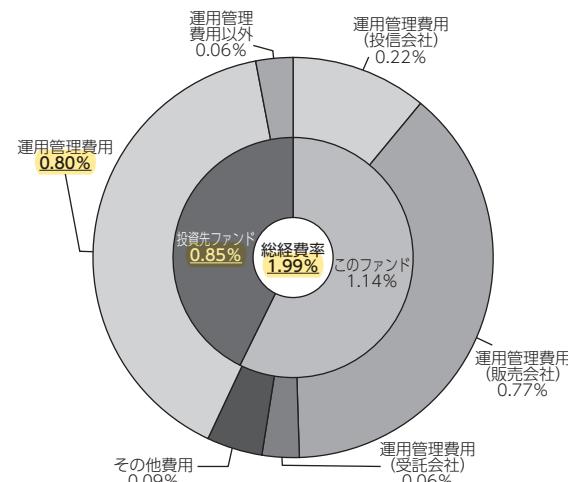
正（訂正後）

(参考情報) 総経費率



誤（訂正前）

(参考情報) 総経費率



(注1) ①の費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) ②・③の費用は、当該投資先ファンドの期中の平均純資産総額で除して算出した概算値です。

(注3) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注4) 各比率は、年率換算した値です。

(注5) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注6) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は**2.08%**です。

(注1) ①の費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) ②・③の費用は、当該投資先ファンドの期中の平均純資産総額で除して算出した概算値です。

(注3) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注4) 各比率は、年率換算した値です。

(注5) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注6) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は**1.99%**です。

*当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／その他資産（転換社債）	
信託期間	2014年9月22日から2024年9月17日まで	
運用方針	主として、外国籍投資信託であるUBS（CAY）グローバルCBファンド（円ヘッジクラス）への投資を通じて、世界各国の転換社債等*に投資を行い、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。投資先外国籍投資信託において、原則として対円での為替ヘッジを行います。 ※「転換社債等」とは、一定の条件で株式に転換できる権利のついた社債や、これと同様の性質を有する証券、証書などの有価証券をいいます。（有価証券の種類にかかわらず、委託会社（外国籍投資信託の投資運用会社を含む）が同様の投資効果を得られると判断するものを含みます。以下同じ。）	
主要運用対象	UBS（CAY） グローバルCB ファンド（円 ヘッジクラス）	世界各国の転換社債等を主要投資対象とし、信託財産の成長を目指して運用を行います。
	UBS短期円金利 ファンド (適格機関 投資家向け)	わが国のコマーシャル・ペーパーを含む短期金融商品および内外の円建ての公社債を主たる投資対象とし、円短期金利を上回る信託財産の安定的な成長を目指して運用を行います。
組入制限	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②同一銘柄の投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ③株式への直接投資は行いません。 ④外貨建資産への直接投資は行いません。 ⑤デリバティブの直接利用は行いません。	
分配方針	P.6~7の「分配方針」をご覧ください。	

UBS グローバルCBオープン (年4回決算型・為替ヘッジあり)

運用報告書（全体版）（第17作成期）

第33期 決算日 2022年12月19日

第34期 決算日 2023年 3月17日

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、「UBSグローバルCBオープン（年4回決算型・為替ヘッジあり）」は、去る3月17日に第34期の決算を行いましたので、第33期～第34期（第17作成期）の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申し上げます。

UBSアセット・マネジメント株式会社

東京都千代田区大手町一丁目2番1号

Otemachi Oneタワー

<お問い合わせ先>

投信営業部

03-5293-3700

<受付時間>

営業日の午前9時～午後5時、土、日、祝日除く

<http://www.ubs.com/japanfunds>

© UBS 2023. キーンズボル及びUBSの各標章は、UBSの登録又は未登録商標です。UBSは全ての権利を留保します。

最近5作成期の運用実績

作成期	決算期（決算日）	基準価額 (分配落)	税分	込配 み金	期騰 落	中率	投資信託 証券組入比率	純総 資産額
第13 作成期	25期（2020年12月17日）	円 10,103		円 50		% 4.3	% 98.8	百万円 24
	26期（2021年3月17日）	10,356		250		5.0	99.0	25
第14 作成期	27期（2021年6月17日）	10,272		200		1.1	98.6	25
	28期（2021年9月17日）	10,156		150		0.3	98.7	25
第15 作成期	29期（2021年12月17日）	9,920		0		△2.3	98.1	21
	30期（2022年3月17日）	9,367		0		△5.6	98.2	20
第16 作成期	31期（2022年6月17日）	8,884		0		△5.2	97.3	19
	32期（2022年9月20日）	8,963		0		0.9	98.8	17
第17 作成期	33期（2022年12月19日）	8,690		0		△3.0	98.8	17
	34期（2023年3月17日）	8,840		0		1.7	99.2	17

(注1) 基準価額は1万口当たり。基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 当ファンドは、ベンチマーク対比の運用ではなく、アクティブ度の高い運用を行う方針であることから、運用の目標となるベンチマークや投資対象資産の市場動向を説明する代表的な指数（参考指数）はありません。

当成期中の基準価額等の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率	額	
第33期	(期 首) 2022年 9月20日	円 8,963	% —	% 98.8
	9月末	8,694	△3.0	98.8
	10月末	8,706	△2.9	98.9
	11月末	8,692	△3.0	98.7
	(期 末) 2022年12月19日	8,690	△3.0	98.8
第34期	(期 首) 2022年12月19日	8,690	—	98.8
	12月末	8,664	△0.3	98.8
	2023年 1月末	8,966	3.2	98.9
	2月末	9,031	3.9	99.1
	(期 末) 2023年 3月17日	8,840	1.7	99.2

(注1) 基準価額は1万口当たり。

(注2) 謄落率は期首比です。

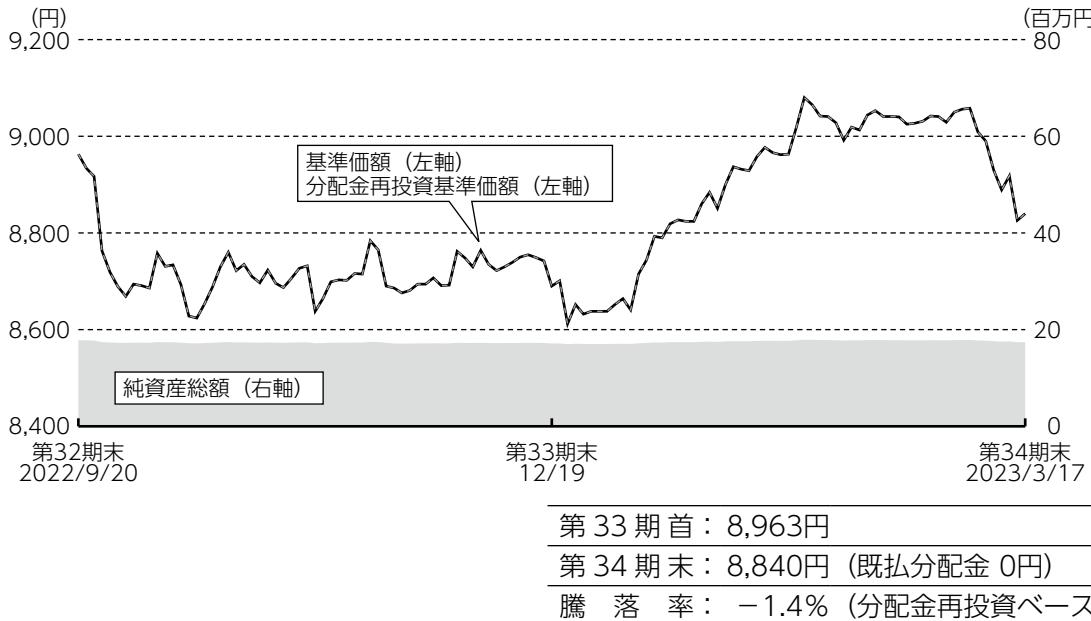
(注3) 当ファンドは、ベンチマーク対比の運用ではなく、アクティブ度の高い運用を行う方針であることから、運用の目標となるベンチマークや投資対象資産の市場動向を説明する代表的な指数（参考指数）はありません。

(注4) 投資信託証券組入比率は、当ファンドの追加・解約と有価証券売買の計上タイミングがずれること等により、一時的に100%超の数値となる場合があります。

運用経過

基準価額等の推移について

(2022年9月20日～2023年3月17日)



- (注1) 分配金再投資基準価額は、収益分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、期首の値を基準価額と同一となるように指数化しています。

当成期の基準価額は123円値下がりしました。なお、基準価額の騰落率は-1.4%となりました。

基準価額の主な変動要因

- ・実質的に投資を行っている世界各国の転換社債等からのインカム・ゲイン（利子収入）
- ・実質的に投資を行っている世界各国の転換社債等からのキャピタル・ゲインまたはロス（価格変動に伴う損益）
- ・為替ヘッジ等に伴うコスト等（円と世界各国の転換社債等に係る通貨の短期金利差相当分の損益）

当成期の基準価額は、為替ヘッジ等に伴うコストや、信託報酬などのマイナス要因が、実質的に組入を行っている転換社債等からのインカム・ゲインなどのプラス要因を上回ったため、値下がりしました。

投資環境について

グローバル転換社債（以下「CB」）市場

当成期のCB市場は、前作成期末比で小幅に上昇しました。

2022年の後半、米連邦準備制度理事会（FRB）をはじめ先進国の中銀がインフレ抑制を重視しタカ派的な姿勢を維持する中で、急速な金融引き締めによる経済と企業業績への悪影響が懸念され、CB市場は値を下げる局面もありました。しかし11月に入ると、米国のインフレのピークアウト観測を受けて長期金利が低下し、CB市場は緩やかな上昇基調で推移しました。2023年に入っても、FRBによる利上げ幅の縮小などが下支えとなり、CB市場は上値を追う展開となりました。作成期の終盤、米国での根強いインフレ圧力などを背景に利上げ長期化観測が再燃したこと、また、一部の米銀が経営破綻に陥ったことに端を発し、世界的に金融システム不安が広がったことなどから、作成期末にかけてCB市場はそれまでの上昇幅の多くを失いました。

ポートフォリオについて

当ファンドのポートフォリオについて

UBS（CAY）グローバルCBファンド（円ヘッジクラス）およびUBS短期円金利ファンド（適格機関投資家向け）を投資対象とし、主としてUBS（CAY）グローバルCBファンド（円ヘッジクラス）への投資を通じて、世界各国のCB等に実質的に投資を行いました。なお、UBS（CAY）グローバルCBファンド（円ヘッジクラス）への投資比率は概ね90%以上を維持しました。

UBS（CAY）グローバルCBファンド（円ヘッジクラス）のポートフォリオについて

CB等の利回り、発行体リスク、流動性などを考慮して、銘柄選択を行いました。また、外貨建資産については、対円で為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図りました。

(2023年3月17日現在)

UBS (CAY) グローバルCBファンドの組入資産の内容

ポートフォリオの特性

平均直接利回り	2.07%
平均最終利回り	7.37%
株価連動率（デルタ*）	15.01%
デュレーション**	1.83
平均格付	BBB-
銘柄数	96

* デルタ：

CBが、原資産である株式の値動きにどの程度連動するかを表したもので、高いほど株式の値動きに連動しやすい。

** デュレーション：

金利変動に伴う債券価格の変動性を示す指標で、長いほど金利変動の影響を受けやすい。

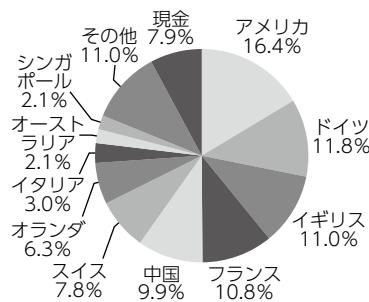
※利回りは、計算日時点の評価に基づくものであり、売却や償還による差損益等を考慮した後のUBS (CAY) グローバルCBファンドの「期待利回り」を示すものではありません。

※平均格付とは、評価基準日時点でUBS (CAY) グローバルCBファンドが保有している有価証券にかかる信用格付を加重平均したものであり、UBS (CAY) グローバルCBファンドに係る信用格付ではありません。

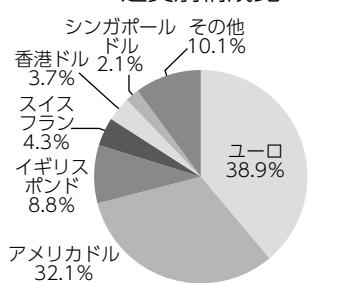
組入上位10銘柄（銘柄数合計：96銘柄）

銘柄名	利率	償還日	国	構成比
アブダビ国営石油	0.700%	2024/ 6/ 4	U A E	1.7%
ELM	3.250%	2024/ 6/13	スイス	1.5%
イドルシア	2.125%	2028/ 8/ 4	スイス	1.4%
ウェルズ・ファーゴ（永久債）	7.500%	—	アメリカ	1.3%
チャイナ・コンク・ベンチャー	0.000%	2023/ 9/ 5	中国	1.3%
セイル・バンテージ	0.000%	2027/ 1/13	中国	1.3%
ファーマロン・ベイジン	0.000%	2026/ 6/18	中国	1.3%
レッドフィン	0.000%	2025/10/15	アメリカ	1.2%
シリウス・ミネラルズ・ファイナンスNo.2	5.000%	2027/ 5/23	イギリス	1.2%
ケップルREIT	1.900%	2024/ 4/10	シンガポール	1.2%

国別構成比

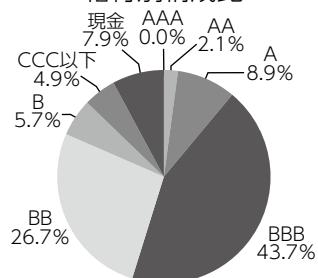


通貨別構成比



※外貨建資産については、原則として
対円で為替ヘッジをしております。

格付別構成比



※各構成比は、「UBS (CAY) グローバルCBファンド」の評価額合計（キャッシュ、先物等含む）に占める割合です。なお、各比率の合計は端数処理の関係上100%とならない場合があります。

※格付については、S&P、ムーディーズの2社の格付機関による格付けのうち、低い格付けを採用しています。上記2社の格付けが付与されていない銘柄については、UBSの独自の判断とします。キャッシュはAAAに分類しています。

※国は、CB等の転換対象とする株式の情報に基づいて分類しています。

※「UBS (CAY) グローバルCBファンド」の投資運用会社から入手した情報を元に作成しております。

UBS短期円金利ファンド（適格機関投資家向け）のポートフォリオについて

わが国のコマーシャル・ペーパーを含む短期金融商品および内外の円建ての公社債に投資を行い、利息等収入の確保を目指して運用を行いました。当座成期におきましては、利回りの優位性を勘案しつつ、コール・ローン等での運用を行いました。

ベンチマークとの差異について

当ファンダは、ベンチマーク対比の運用ではなく、アクティブ度の高い運用を行う方針であることから、運用の目標となるベンチマークや投資対象資産の市場動向を説明する代表的な指数（参考指数）はありません。

分配金について

当座成期は、基準価額の水準や市況動向等を勘案し、分配は行いませんでした。

なお、収益の分配にあてなかった利益につきましては、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

分配方針

年4回の毎決算時（毎年3月、6月、9月および12月の17日、休業日の場合には翌営業日）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

- 分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- 収益分配金額は、上記の分配対象額の範囲内で、下記1. および2. に基づき決定します。ただし、市況動向等を勘案して、委託会社の判断で下記と異なる金額の分配を行うこと（分配を行わない場合を含みます。）があります。

- 計算期末の前営業日の基準価額（1万口当たり。既払分配金を加算しません。以下同じ。）が10,500円未満の場合には、基準価額水準等を勘案して委託会社が決定します。
- 計算期末の前営業日の基準価額が10,500円以上の場合には、原則として、当該基準価額の水準に応じて、下記の金額（1万口当たり）を分配することを目指します。

＜各計算期末の前営業日の基準価額＞ ＜目標分配金額（1万口当たり、税引前）＞

10,500円未満	基準価額水準等を勘案して決定します。
-----------	--------------------

10,500円以上11,000円未満	250円
--------------------	------

11,000円以上11,500円未満	500円
--------------------	------

11,500円以上12,000円未満	750円
--------------------	------

12,000円以上	1,000円
-----------	--------

・収益の分配にあてなかった利益については、運用の基本方針に基づいて元本部分と同一の運用を行います。

※目標分配金額は、毎計算期末の前営業日の基準価額水準に応じて上記表に基づき決定されますので、それ以前の基準価額水準は考慮されません。したがって、基準価額が上記表の一定の水準に一度でも到達すればその水準に応じた分配金をお支払いする、または、その水準に応じた分配を継続するというものではありません。また、分配金の支払いにより純資産総額は減少することになり、基準価額が下落する要因となります。上記表に記載された基準価額および目標分配金額は、将来の分配金の支払いを保証または示唆するものではなく、また、あらかじめ一定の分配金額を保証するものではありません。

※計算期末の前営業日の基準価額水準に応じて上記表に基づく分配金額を支払うことを目指しますが、計算期末の前営業日から当該計算期末までの間に基準価額が急激に変動した場合には、委託会社の判断で上記表と異なる金額の分配を行うこと（分配を行わない場合を含みます。）があります。

分配原資の内訳

(1万口当たり・税引前)

項目	第33期	第34期
	2022年 9月21日～ 2022年12月19日	2022年12月20日～ 2023年 3月17日
当期分配金 (対基準価額比率)	一円 (- %)	一円 (- %)
当期の収益	一円	一円
当期の収益以外	一円	一円
翌期繰越分配対象額	1,858円	2,003円

(注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は、「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注2) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注3) 「当期の収益」、「当期の収益以外」は小数点以下切捨てで算出しているため、合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。

今後の運用方針

投資環境の見通し

CB市場のバリュエーションは、概ね適正水準にあると見てています。最近まで起債は低迷していたものの、企業による借換え需要の増加などを背景に回復基調にあります。CBへの需要が引き続き市場を支えると思われます。

CBは株価下落局面で下値抵抗力を維持しつつ、株価上昇局面ではそのメリットが期待できることから、引き続き投資魅力度は高いと考えています。こうした環境下で、今後もファンドの特色に沿った運用を行ってまいります。

当ファンドの今後の運用方針

UBS (CAY) グローバルCBファンド（円ヘッジクラス）の投資比率を高位に維持する方針です。

UBS (CAY) グローバルCBファンド（円ヘッジクラス）の今後の運用方針

世界各国のCB等を投資対象とし、利回り、発行体リスク、流動性などを踏まえ組入銘柄および組入比率を決定します。なお、外貨建資産については、対円で為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。

UBS短期円金利ファンド（適格機関投資家向け）の今後の運用方針

短期金融市場の状況を注視しつつ、コール・ローン等で運用する予定です。

1万口当たりの費用明細

項目	第33期～第34期 2022/9/21～2023/3/17		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	45円	0.510%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 ※期中の平均基準価額（月末値の平均）は8,792円です。
（投信会社）	(9)	(0.107)	委託した資金の運用の対価
（販売会社）	(33)	(0.376)	運用報告書等各種書類の交付、口座内でのファンドに係る管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(2)	(0.027)	運用財産の管理、運用指図実行等の対価
その他費用	4	0.043	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（監査費用）	(1)	(0.013)	監査法人等に支払うファンド監査に係る費用
（印刷費用等）	(2)	(0.028)	法定開示書類作成の際に業者に支払う作成・印刷・交付等に係る費用（EDINET含む）等
（その他）	(0)	(0.001)	受益権の管理事務に関連する費用等
合計	49	0.553	

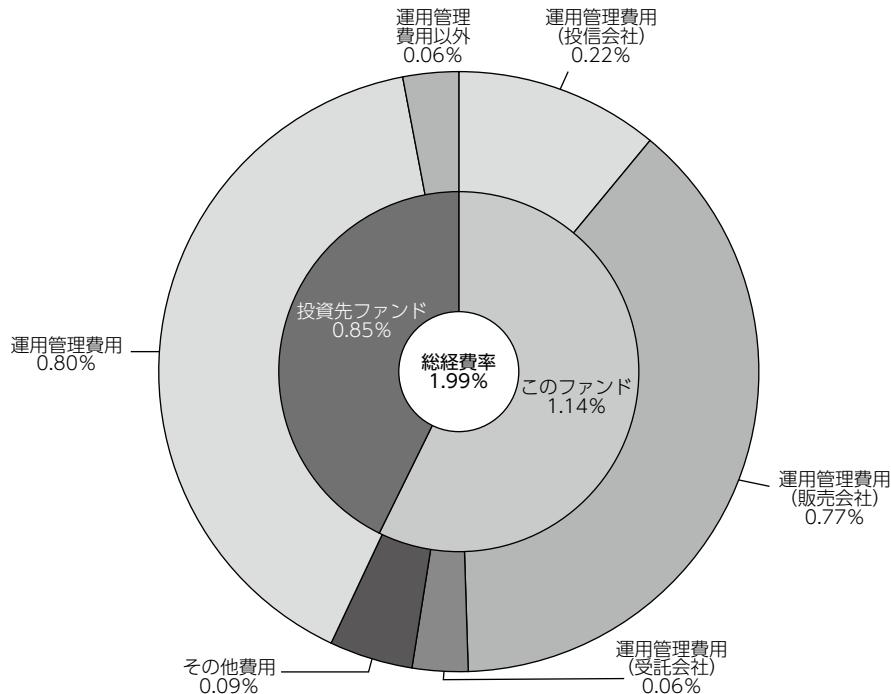
(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は、追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

(注4) 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

(参考情報) 総経費率



総経費率 (①+②+③)	1.99%
①このファンドの費用の比率	1.14%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.80%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.06%

(注1) ①の費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) ②・③の費用は、当該投資先ファンドの期中の平均純資産総額で除して算出した概算値です。

(注3) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注4) 各比率は、年率換算した値です。

(注5) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注6) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

当座成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.99%です。

期中の売買及び取引の状況（自 2022年9月21日 至 2023年3月17日）

投資信託証券

		第33期～第34期			
		買付		売付	
		□数	金額	□数	金額
外国	UBS (CAY) グローバルCBファンド (円ヘッジクラス)	□ — (734,818)	千円 — (555)	□ — 269,541	千円 — 199

(注1) 金額は受け渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切り捨て。

(注3) () 内は再投資による増加分で、上段の数字には含まれておりません。

利害関係人等との取引状況等（自 2022年9月21日 至 2023年3月17日）

担当成期中の利害関係人等との取引はありません。

(注) 利害関係人等とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人等です。

組入資産明細表（2023年3月17日現在）

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	第16作成期末		第17作成期末（第34期末）		
	□数	□数	評価額	比率	
UBS短期円金利ファンド（適格機関投資家向け）	□ 1,000,000	□ 1,000,000	千円 989	% 5.7	
UBS (CAY) グローバルCBファンド（円ヘッジクラス）	21,430,454	21,895,731	16,286	93.5	
合計	22,430,454	22,895,731	17,275	99.2	

(注) 単位未満は切り捨て。

投資信託財産の構成

（2023年3月17日現在）

項目	第17作成期末（第34期末）	
	評価額	比率
投資信託受益証券	千円 17,275	% 98.9
コール・ローン等、その他	194	1.1
投資信託財産総額	17,469	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨て。

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年12月19日) (2023年3月17日)

項目	第33期末	第34期末
(A) 資産	17,190,739円	17,469,147円
コール・ローン等	259,081	193,303
投資信託受益証券(評価額)	16,931,658	17,275,844
(B) 負債	48,696	47,977
未払解約金	435	84
未払信託報酬	44,571	44,167
その他未払費用	3,690	3,726
(C) 純資産総額(A-B)	17,142,043	17,421,170
元本	19,725,599	19,706,545
次期繰越損益金	△ 2,583,556	△ 2,285,375
(D) 受益権総口数	19,725,599口	19,706,545口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,690円	8,840円

- (注1) 当ファンドの第33期首元本額は19,899,891円、第33～34期中追加設定元本額は3,914円、第33～34期中一部解約元本額は197,260円です。
- (注2) 1口当たり純資産額は、第33期0.8690円、第34期0.8840円です。
- (注3) 第34期末において純資産総額が元本を下回っており、その差額は2,285,375円です。

損益の状況

第33期 (自2022年9月21日 至2022年12月19日)
第34期 (自2022年12月20日 至2023年3月17日)

項目	第33期	第34期
(A) 配当等収益	222,522円	331,465円
受取配当金	222,538	331,478
支払利息	△ 16	△ 13
(B) 有価証券売買損益	△ 713,474	11,985
売買益	5,319	12,810
売買損	△ 718,793	△ 825
(C) 信託報酬等	△ 48,261	△ 47,893
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 539,213	295,557
(E) 前期繰越損益金	△ 2,178,852	△ 2,715,074
(F) 追加信託差損益金	134,509	134,142
(配当等相当額)	(694,583)	(694,240)
(売買損益相当額)	(△ 560,074)	(△ 560,098)
(G) 計(D+E+F)	△ 2,583,556	△ 2,285,375
(H) 収益分配金	0	0
次期繰越損益金(G+H)	△ 2,583,556	△ 2,285,375
追加信託差損益金	134,509	134,142
(配当等相当額)	(694,583)	(694,240)
(売買損益相当額)	(△ 560,074)	(△ 560,098)
分配準備積立金	2,972,157	3,254,290
繰越損益金	△ 5,690,222	△ 5,673,807

- (注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。
- (注2) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
- (注3) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
- (注4) 第33期計算期間末における費用控除後の配当等収益(174,261円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(694,583円)および分配準備積立金(2,797,896円)より分配対象収益は3,666,740円(10,000口当たり1,858円)ですが、当計算期間に分配した金額はありません。
- (注5) 第34期計算期間末における費用控除後の配当等収益(285,243円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(694,240円)および分配準備積立金(2,969,047円)より分配対象収益は3,948,530円(10,000口当たり2,003円)ですが、当計算期間に分配した金額はありません。

ケイマン籍外国投資信託 UBS（CAY）グローバルCBファンドの運用状況

<参考情報>

当ファンドは、「UBSグローバルCBオープン（年4回決算型・為替ヘッジあり）」が投資対象とする外国投資信託証券です。

ご参考として、掲載されている当ファンドの損益計算書及び投資資産の明細は、2021年11月30日現在の現地Annual Reportからの抜粋であり、現地の会計基準に基づき作成され、監査を受けたものです。

損益計算書

2021年11月30日終了年度
円

収益

受取利息	251,990,691
配当収入	4,944,768
その他収益	1,227,344
損益を通じて公正価値で測定する金融資産（デリバティブを除く）に係る実現利益（損失）	520,979,598
デリバティブ金融資産・負債に係る実現利益（損失）	(220,739,881)
外国為替取引に係る実現利益（損失）	20,368,816
損益を通じて公正価値で測定する金融資産（デリバティブを除く）に係る未実現評価益（評価損）の変動額	277,230,001
デリバティブ金融資産・負債に係る未実現評価益（評価損）の変動額	42,696,008
外国為替取引に係る未実現評価益（評価損）の変動額	(1,795,333)
収益（損失）合計	896,902,012

費用

投資管理費用	40,781,411
専門家費用	8,300,851
保管費用	7,474,450
管理費用	5,709,402
名義書換事務代行費用	1,434,321
支払利息	1,136,738
信託費用	815,613
登録費用	495,115
取引手数料	7,881
その他費用	9,857
費用合計	66,165,639
営業利益（損失）	830,736,373

金融費用

解約可能受益者への分配金	(703,555,237)
分配後税引前利益（損失）	127,181,136
源泉徴収税	(4,594,198)
解約可能受益者に属する純資産の増減額	122,586,938

2021年11月30日現在の投資資産

通貨	額面	銘柄	対純資産比率 (%)	評価額
		固定利付証券 (91.6%)		
		オーストラリア (2.2%)		
		転換社債 (2.2%)		
		DEXUS Finance Pty Ltd.		
AUD	1,000,000	2.30% due 06/19/26	1.1	¥ 80,844,798
		Seven Group Holdings, Ltd.		
AUD	900,000	2.20% due 03/05/25	1.1	78,560,515
		転換社債合計		159,405,313
		オーストラリア合計		159,405,313
		オーストリア (0.9%)		
		転換社債 (0.9%)		
		ams AG		
EUR	600,000	0.00% due 03/05/25	0.9	68,205,593
		転換社債合計		68,205,593
		オーストリア合計		68,205,593
		ベルギー (2.9%)		
		転換社債 (2.9%)		
		BNP Paribas Fortis SA		
EUR	500,000	1.46% due 12/29/49	0.8	60,885,531
		Greenyard Fresh NV		
EUR	600,000	3.75% due 12/22/21	1.0	76,493,573
		Mithra Pharmaceuticals S.A.		
EUR	600,000	4.25% due 12/17/25	1.1	77,045,696
		転換社債合計		214,424,800
		ベルギー合計		214,424,800
		バミューダ (1.0%)		
		転換社債 (1.0%)		
		SFL Corp. Ltd.		
USD	650,000	4.88% due 05/01/23	1.0	73,988,759
		転換社債合計		73,988,759
		バミューダ合計		73,988,759
		ヴァージン諸島 (1.2%)		
		転換社債 (1.2%)		
		Universe Trek Ltd.		
USD	800,000	0.00% due 06/15/26	1.2	85,522,093
		転換社債合計		85,522,093
		ヴァージン諸島合計		85,522,093

通貨	額面	銘柄	対純資産比率 (%)	評価額
		ケイマン諸島 (4.8%)		
		転換社債 (4.8%)		
HKD	4,000,000	Cathay Pacific Finance III Ltd. 2.75% due 02/05/26	0.8	¥ 56,190,999
USD	800,000	Hansoh Pharmaceutical Group Co. Ltd. 0.00% due 01/22/26	1.1	80,571,531
USD	600,000	Meituan 0.00% due 04/27/28	0.9	64,414,077
USD	800,000	Microport Scientific Corp. 0.00% due 06/11/26	1.0	75,348,461
USD	800,000	Tequ Mayflower Ltd. 0.00% due 03/02/26	1.0	74,349,265
		転換社債合計		<u>350,874,333</u>
		ケイマン諸島合計		<u>350,874,333</u>
		中国 (2.8%)		
		転換社債 (2.8%)		
HKD	4,000,000	China Conch Venture Holdings International, Ltd. 0.00% due 09/05/23	0.9	68,075,876
USD	400,000	Poseidon Finance 1, Ltd. 0.00% due 02/01/25	0.7	49,006,021
HKD	6,000,000	Zhou Hei Ya International Holdings Co. Ltd. 1.00% due 11/05/25	1.2	86,515,787
		転換社債合計		<u>203,597,684</u>
		中国合計		<u>203,597,684</u>
		キプロス (1.1%)		
		転換社債 (1.1%)		
USD	800,000	Ozon Holdings PLC 1.88% due 02/24/26	1.1	78,904,690
		転換社債合計		<u>78,904,690</u>
		キプロス合計		<u>78,904,690</u>
		フランス (9.3%)		
		転換社債 (9.3%)		
EUR	700,000	Bigben Interactive 1.13% due 02/19/26	1.0	75,991,038
EUR	942,000	Edenred 0.00% due 06/14/28	1.1	76,932,641
EUR	720,000	Fnac Darty S.A. 0.25% due 03/23/27	1.0	76,869,323
EUR	1,128,700	Korian S.A. 0.88% due 03/06/27	1.1	82,079,602
EUR	1,350,400	Maisons du Monde S.A. 1.88% due 12/29/49	1.0	71,951,305
EUR	1,350,000	Neopost SA 0.13% due 12/06/23	1.1	80,026,392
EUR	850,900	Nexity S.A. 3.38% due 12/29/49	0.9	63,956,889
EUR	875,000	Orpea 0.25% due 03/02/25	1.0	73,833,829
EUR	434,400	0.38% due 05/17/27 転換社債合計	1.1	76,962,706
		フランス合計		<u>678,603,725</u>

通貨	額面	銘柄	対純資産比率 (%)	評価額
		ドイツ (9.1%)		
		転換社債 (9.1%)		
		Consus Real Estate AG		
EUR	200,000	4.00% due 11/29/22	0.3	¥ 21,782,153
		Delivery Hero SE		
EUR	600,000	1.50% due 01/15/28	1.1	80,565,480
EUR	600,000	2.13% due 03/10/29	1.0	73,192,337
		Deutsche Lufthansa AG		
EUR	300,000	2.00% due 11/17/25	0.5	38,709,956
		LEG Immobilien AG		
EUR	600,000	0.40% due 06/30/28	1.1	80,067,035
		MBT Systems GmbH		
EUR	600,000	3.50% due 07/08/27	1.1	77,778,025
		MorphoSys AG		
EUR	600,000	0.63% due 10/16/25	0.8	59,067,191
		RAG-Stiftung		
EUR	600,000	0.00% due 03/16/23	1.1	77,697,508
		TAG Immobilien AG		
EUR	600,000	0.63% due 08/27/26	1.1	78,225,092
		Zalando SE		
EUR	500,000	0.63% due 08/06/27	1.0	74,787,743
		転換社債合計		661,872,520
		ドイツ合計		661,872,520
		香港 (2.1%)		
		転換社債 (2.1%)		
		China Overseas Finance Investment Cayman V, Ltd.		
USD	600,000	0.00% due 01/05/23	1.1	80,049,224
		Sino Biopharmaceutical Ltd.		
EUR	600,000	0.00% due 02/17/25	1.0	72,323,510
		転換社債合計		152,372,734
		香港合計		152,372,734
		イタリア (2.6%)		
		転換社債 (2.6%)		
		Nexi SpA		
EUR	600,000	0.00% due 02/24/28	1.0	71,628,478
		Prysmian SpA		
EUR	300,000	0.00% due 01/17/22	0.5	38,616,402
		Telecom Italia SpA		
EUR	600,000	1.13% due 03/26/22	1.1	76,769,634
		転換社債合計		187,014,514
		イタリア合計		187,014,514
		ジャージー、チャンネル諸島 (1.1%)		
		転換社債 (1.1%)		
		Cornwall Jersey Ltd.		
GBP	600,000	0.75% due 04/16/26	1.1	79,527,984
		転換社債合計		79,527,984
		ジャージー、チャンネル諸島合計		79,527,984
		ルクセンブルク (6.1%)		
		転換社債 (6.1%)		
		Corestate Capital Holding SA		
EUR	600,000	1.38% due 11/28/22	0.9	64,882,646
		Elliott Capital Sarl		
EUR	600,000	0.00% due 12/30/22	1.1	76,640,039

UBSグローバルCBオープン (年4回決算型・為替ヘッジあり)

通貨	額面	銘柄	対純資産比率 (%)	評価額
EUR	400,000	European TopSoho S. a. r. l. ± 4.00% due 09/21/21	0.6	¥ 45,008,248
EUR	700,000	Global Fashion Group S.A. 1.25% due 03/15/28	1.0	73,960,197
GBP	500,000	IWG International Holdings 0.50% due 12/09/27	0.9	69,037,368
EUR	600,000	Klockner & Co. Financial Services SA 2.00% due 09/08/23	1.1	79,450,498
EUR	300,000	VIC Properties S.A. 3.00% due 05/28/25	0.5	36,616,490
		転換社債合計		<u>445,595,486</u>
		ルクセンブルク合計		<u>445,595,486</u>
		マレーシア (1.1%)		
		転換社債 (1.1%)		
		Cerah Capital Ltd.		
USD	700,000	0.00% due 08/08/24	1.1	80,802,481
		転換社債合計		<u>80,802,481</u>
		マレーシア合計		<u>80,802,481</u>
		マルタ (0.7%)		
		転換社債 (0.7%)		
		Brait PLC		
GBP	400,000	6.50% due 12/04/2024 REXLot Holdings, Ltd. ±	0.7	53,137,029
HKD	2,902,118	4.50% due 04/17/19	0.0	2,113,439
		転換社債合計		<u>55,250,468</u>
		マルタ合計		<u>55,250,468</u>
		モーリシャス (1.0%)		
		転換社債 (1.0%)		
		HTA Group Ltd.		
USD	600,000	2.88% due 03/18/27	1.0	70,000,491
		転換社債合計		<u>70,000,491</u>
		モーリシャス合計		<u>70,000,491</u>
		オランダ (9.1%)		
		転換社債 (9.1%)		
		Basic-Fit NV		
EUR	600,000	1.50% due 06/17/28 COSMO Pharmaceuticals NV	1.1	79,670,244
EUR	600,000	2.50% due 12/05/23 Dufry One BV	1.0	72,550,494
CHF	600,000	0.75% due 03/30/26 ELM BV for Swiss Re, Ltd.	0.9	69,104,657
USD	800,000	3.25% due 06/13/24 Encavis Finance BV	1.3	97,775,869
EUR	600,000	1.88% due 12/29/2049 Just Eat Takeaway.com NV	1.1	77,429,848
EUR	700,000	0.63% due 02/09/28	1.1	77,229,225
EUR	600,000	1.25% due 04/30/26 Pharming Group NV	1.0	72,457,707
EUR	600,000	3.00% due 01/21/25 Shop Apotheke Europe NV	0.9	65,983,298
EUR	400,000	0.00% due 01/21/28	0.7	51,920,010
		転換社債合計		<u>664,121,352</u>
		オランダ合計		<u>664,121,352</u>

通貨	額面	銘柄	対純資産比率 (%)	評価額
		ニュージーランド (0.9%)		
		転換社債 (0.9%)		
		Xero Investments Ltd.		
USD	600,000	0.00% due 12/02/25	0.9	¥ 67,275,411
		転換社債合計		67,275,411
		ニュージーランド合計		67,275,411
		ノルウェー (0.5%)		
		転換社債 (0.5%)		
		BW Offshore Ltd.		
USD	400,000	2.50% due 11/12/24	0.5	39,381,947
		転換社債合計		39,381,947
		ノルウェー合計		39,381,947
		ロシア (1.2%)		
		事業債 (1.2%)		
		Mail.ru Group, Ltd.		
USD	800,000	1.63% due 10/01/25	1.2	85,244,134
		事業債合計		85,244,134
		ロシア合計		85,244,134
		シンガポール (1.1%)		
		転換社債 (1.1%)		
		Keppel REIT		
SGD	1,000,000	1.90% due 04/10/24	1.1	82,877,950
		転換社債合計		82,877,950
		シンガポール合計		82,877,950
		スペイン (4.2%)		
		転換社債 (4.2%)		
		Celinx Telecom S.A.		
EUR	700,000	0.75% due 11/20/31	1.2	88,136,722
		Corp. Economica Delta S.A.		
EUR	600,000	1.00% due 12/01/23	1.1	76,307,998
		Ence Energia y Celulosa S.A.		
EUR	600,000	1.25% due 03/05/23	1.0	75,182,281
		Sacyr S.A.		
EUR	500,000	3.75% due 04/25/24	0.9	67,296,379
		転換社債合計		306,923,380
		スペイン合計		306,923,380
		スイス (3.0%)		
		転換社債 (3.0%)		
		Idorsia Ltd.		
CHF	1,000,000	2.13% due 08/04/28	1.5	107,545,049
		Implenia AG		
CHF	625,000	0.50% due 06/30/22	1.0	75,536,133
		Santhera Pharmaceuticals Holding AG		
CHF	459,000	7.50% due 08/17/24	0.5	39,560,550
		転換社債合計		222,641,732
		スイス合計		222,641,732
		タイ (1.0%)		
		転換社債 (1.0%)		
		CP Foods Capital Ltd.		
USD	600,000	0.50% due 06/18/25	1.0	69,535,184
		転換社債合計		69,535,184
		タイ合計		69,535,184

通貨	額面	銘柄	対純資産比率 (%)	評価額
		アラブ首長国連邦 (2.4%)		
		転換社債 (2.4%)		
USD	1,000,000	Abu Dhabi National Oil Co. 0.70% due 06/04/24	1.5	¥ 111,989,432
USD	600,000	Borr Drilling, Ltd. 3.88% due 05/23/23	0.5	33,382,229
USD	1,000,000	NMC Health Jersey, Ltd. ± 1.88% due 04/30/25	0.4	<u>30,657,149</u> <u>176,028,810</u> <u>176,028,810</u>
		転換社債合計		
		アラブ首長国連邦合計		
		イギリス (7.6%)		
		転換社債 (7.6%)		
USD	1,200,000	African Minerals, Ltd. ± 8.50% due 02/10/17	0.0	1,362,540
GBP	500,000	Capital & Counties Properties PLC 2.00% due 03/30/26	1.1	78,354,593
GBP	500,000	Derwent London Capital No 3 Jersey Ltd. 1.50% due 06/12/25	1.0	75,566,617
USD	411,000	Golar LNG, Ltd. 2.75% due 02/15/22	0.7	46,583,544
GBP	900,000	Intu Jersey 2, Ltd. 2.88% due 11/01/22	0.5	33,117,795
GBP	500,000	JET2 PLC 1.63% due 06/10/26	1.0	70,620,836
GBP	400,000	PHP Finance Jersey NO 2 Ltd. 2.88% due 07/15/25	0.9	68,412,603
USD	400,000	Sirius Minerals Finance NO 2 Ltd. 5.00% due 05/23/27	0.9	67,229,692
GBP	346,000	Stobart Finance PLC 2.75% due 05/08/24	0.5	39,087,089
GBP	600,000	Trainline PLC 1.00% due 01/14/26	1.0	<u>77,291,349</u> <u>557,626,658</u> <u>557,626,658</u>
		転換社債合計		
		イギリス合計		
		アメリカ (10.6%)		
		転換社債 (10.6%)		
USD	523,000	Ares Capital Corp. 4.63% due 03/01/24	0.9	65,957,555
USD	700,000	Blackstone Mortgage Trust, Inc. 4.75% due 03/15/23	1.1	80,560,340
USD	656,000	DISH Network Corp. 3.38% due 08/15/26	0.9	68,657,178
USD	600,000	Glencore Funding LLC 0.00% due 03/27/25	1.0	69,548,809
USD	605,000	Goldman Sachs BDC, Inc. 4.50% due 04/01/22	0.9	69,381,042
USD	322,000	Intercept Pharmaceuticals, Inc. 3.25% due 07/01/23	0.5	34,757,170
USD	813,000	Liberty Interactive LLC 4.00% due 11/15/29	1.0	70,157,183
USD	573,000	Liberty Media Corp. 2.13% due 03/31/48	0.9	66,850,469

UBSグローバルCBオープン (年4回決算型・為替ヘッジあり)

通貨	額面	銘柄	対純資産比率 (%)	評価額
USD	500,000	Ligand Pharmaceuticals, Inc. 0.75% due 05/15/23	0.8	¥ 57,907,949
USD	678,000	Prospect Capital Corp. 6.38% due 03/01/25	1.1	84,033,824
USD	650,000	Spirit Airlines, Inc. 1.00% due 05/15/26	0.9	65,169,152
USD	400,000	Western Digital Corp. 1.50% due 02/01/24	0.6	45,417,999
		転換社債合計		<u>778,398,670</u>
		アメリカ合計		<u>778,398,670</u>
		固定利付証券合計 (Cost ¥7,039,233,303)		<u>¥ 6,696,018,896</u>
		優先株式 (1.4%)		
		アメリカ (1.4%)		
		銀行 (1.4%)		
USD	400,000	Wells Fargo & Co. 7.50%	1.4	99,878,418
		アメリカ合計 (Cost ¥81,222,821)		<u>99,878,418</u>
		優先株式合計 (Cost ¥81,222,821)		<u>¥ 99,878,418</u>
		短期投資 (1.7%)		
		ヴァージン諸島 (1.7%)		
		転換社債 (1.7%)		
HKD	5,000,000	Best Path Global Ltd. 0.00% due 06/01/22	1.0	70,712,105
HKD	4,000,000	Crystal Idea Group Ltd. 2.25% due 10/31/22	0.7	51,326,356
		転換社債合計		<u>122,038,461</u>
		ヴァージン諸島合計		<u>122,038,461</u>
		短期投資合計 (Cost ¥129,999,916)		<u>¥ 122,038,461</u>

2021年11月30日時点の未決済為替予約取引 (対純資産比率0.4%)

買	相手方	約定金額	予約期日	売	約定金額	未実現評価益	未実現評価損	未実現純益(純損)
CHF	Citibank NA	69,500	12/22/2021	JPY	8,570,879	¥ —	¥ (39,084)	¥ (39,084)
EUR	Bank of America NA	76,700	12/22/2021	JPY	9,906,492	—	¥ (99,562)	¥ (99,562)
JPY	Barclays Bank Plc	14,261,387	12/22/2021	EUR	111,300	30,470	—	30,470
JPY	Citibank NA	1,113,145,343	12/22/2021	EUR	8,600,100	13,528,926	—	13,528,926
JPY	HSBC Bank Plc	31,936,454	12/22/2021	SGD	380,000	484,708	—	484,708
JPY	JPMorgan Chase Bank	12,910,602	12/22/2021	USD	113,500	28,977	—	28,977
JPY	Morgan Stanley	893,288,300	12/22/2021	USD	7,824,000	5,307,367	—	5,307,367
JPY	Morgan Stanley	259,987,406	12/22/2021	GBP	1,687,900	6,434,755	—	6,434,755
JPY	Morgan Stanley	61,944,150	12/22/2021	AUD	745,000	1,974,738	—	1,974,738
JPY	Morgan Stanley	115,166,420	12/22/2021	CHF	934,200	484,367	—	484,367
JPY	UBS AG	125,379,463	12/22/2021	HKD	8,553,500	852,617	—	852,617
JPY	UBS AG	8,840,613	12/22/2021	EUR	68,100	133,287	—	133,287
USD	Citibank NA	77,400	12/22/2021	JPY	8,927,132	—	¥ (142,658)	¥ (142,658)
					¥ 29,260,212	¥ (281,304)	¥ 28,978,908	

UBS短期円金利ファンド（適格機関投資家向け）

参考情報

当ファンドは、UBSグローバルCBオープン（年4回決算型・為替ヘッジあり）が投資対象とする国内投資信託証券です。

ご参考として第8期決算日（2022年9月20日）の運用状況をご報告申し上げます。

UBS短期円金利ファンド（適格機関投資家向け）

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	税込分配金	期中騰落率	債券組入率	債券先物率	純資産額
4期（2018年9月18日）	円 9,962	円 0	% △0.1	% -	% -	百万円 11
5期（2019年9月17日）	9,948	0	△0.1	-	-	11
6期（2020年9月17日）	9,932	0	△0.2	-	-	6
7期（2021年9月17日）	9,918	0	△0.1	-	-	4
8期（2022年9月20日）	9,904	0	△0.1	-	-	1

（注1）基準価額は1万口当たり。

（注2）債券先物比率は買建比率－売建比率。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	債券組入率	債券先物率
			比	率
（期首） 2021年 9月17日	円 9,918	% -	% -	% -
9月末	9,918	0.0	-	-
10月末	9,917	△0.0	-	-
11月末	9,915	△0.0	-	-
12月末	9,914	△0.0	-	-
2022年 1月末	9,913	△0.1	-	-
2月末	9,911	△0.1	-	-
3月末	9,910	△0.1	-	-
4月末	9,909	△0.1	-	-
5月末	9,908	△0.1	-	-
6月末	9,907	△0.1	-	-
7月末	9,906	△0.1	-	-
8月末	9,905	△0.1	-	-
（期末） 2022年 9月20日	9,904	△0.1	-	-

（注1）基準価額は1万口当たり。

（注2）騰落率は期首比です。

（注3）債券先物比率は買建比率－売建比率。

分配原資の内訳

(1万口当たり・税引前)

項目	第8期
	2021年9月18日～2022年9月20日
当期分配金	一円
(対基準価額比率)	(- %)
当期の収益	一円
当期の収益以外	一円
翌期繰越分配対象額	116円

(注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は、「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注2) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注3) 「当期の収益」、「当期の収益以外」は小数点以下切捨てで算出しているため、合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。

1万口当たりの費用明細

項目	当期 2021/9/18～2022/9/20		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	4円	0.044%	信託報酬=期中の平均基準価額×信託報酬率 ※期中の平均基準価額（月末値の平均）は9,911円です。
(投信会社)	(1)	(0.011)	委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(0)	(0.001)	運用報告書等各種書類の交付、口座内でのファンドに係る管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(3)	(0.032)	運用財産の管理、運用指図実行等の対価
その他費用	0	0.002	その他費用=期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(その他)	(0)	(0.002)	受益権の管理事務に関連する費用等
合計	4	0.046	

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は、追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

期中の売買及び取引の状況 (自 2021年9月18日 至 2022年9月20日)

該当事項はありません。

主要な売買銘柄 (自 2021年9月18日 至 2022年9月20日)

該当事項はありません。

利害関係人等との取引状況等 (自 2021年9月18日 至 2022年9月20日)

期中の利害関係人等との取引はありません。

(注) 利害関係人等とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人等です。

組入資産明細表 (2022年9月20日現在)

期中における有価証券等の組入れはありません。

投資信託財産の構成

(2022年9月20日現在)

項	目	当 期 末	
		評 価 額	比 率
コール・ローン等、その他		千円 1,723	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額		1,723	100.0

(注) 金額の単位未満は切り捨て。

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年9月20日現在)

項	目	当 期 末
(A) 資 産	1,723,506円	
コール・ローン等	1,723,506	
(B) 負 債	390	
未 払 信 託 報 酬	374	
未 払 利 息	4	
そ の 他 未 払 費 用	12	
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,723,116	
元 本	1,739,837	
次 期 繰 越 損 益 金	△ 16,721	
(D) 受 益 権 総 口 数	1,739,837口	
1万口当たり基準価額(C/D)	9,904円	

(注記事項)

期首元本額	4,776,226円
期中追加設定元本額	0円
期中一部解約元本額	3,036,389円
1口当たり純資産額	0.9904円

純資産総額が元本を下回っており、その差額は16,721円です。

損益の状況

(自2021年9月18日 至2022年9月20日)

項	目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 1,651円	
支 払 利 息	△ 1,651	
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	418	
売 買	418	
(C) 信 託 報 酬 等	△ 1,247	
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△ 2,480	
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 9,337	
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 4,904	
(配 当 等 相 当 額)	(10,519)	
(売 買 損 益 相 当 額)	(△15,423)	
(G) 計 (D+E+F)	△16,721	
(H) 収 益 分 配 金	0	
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	△16,721	
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 4,904	
(配 当 等 相 当 額)	(10,519)	
(売 買 損 益 相 当 額)	(△15,423)	
分 配 準 備 積 立 金	9,731	
繰 越 損 益 金	△21,548	

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換算によるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(10,519円)および分配準備積立金(9,731円)より分配対象収益は20,250円(10,000口当たり116円)ですが、分配を行っておりません。