

*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（ノンヘッジクラス）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。原則として対円での為替ヘッジを行いません。 ※「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（ノンヘッジクラス）	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デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）の直接利用は行いません。ただし、指定外国投資信託およびUBS短期円金利ファンド（適格機関投資家向け）においてはデリバティブ取引を行う場合があります。その場合は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。	
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・為替ヘッジなし)

運用報告書（全体版）（第19作成期）
第37期 決算日 2023年12月18日
第38期 決算日 2024年 3月18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・為替ヘッジなし）」は、去る3月18日に第38期の決算を行いましたので、第37期～第38期（第19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 2024. キーシMBOL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。

お知らせ

当ファンドは、2024年9月17日に信託期間が満了し、償還を迎える予定です。

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)	騰落率			投資信託 証券組入比率	純資産額	
			税分	込配	み金			期騰
第15 作成期	29期（2021年12月17日）	円 10,152		円 50		% △0.7	% 97.3	百万円 123
	30期（2022年 3月17日）	9,872		0		△2.8	97.3	116
第16 作成期	31期（2022年 6月17日）	10,015		100		2.5	94.7	118
	32期（2022年 9月20日）	10,201		250		4.4	98.7	120
第17 作成期	33期（2022年12月19日）	9,928		0		△2.7	98.5	112
	34期（2023年 3月17日）	9,944		0		0.2	97.7	112
第18 作成期	35期（2023年 6月19日）	10,573		250		8.8	98.7	117
	36期（2023年 9月19日）	10,568		250		2.3	98.7	116
第19 作成期	37期（2023年12月18日）	10,199		150		△2.1	97.7	106
	38期（2024年 3月18日）	10,354		250		4.0	98.7	98

(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。

当作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		
第37期	(期 首)	円		%	%
	2023年 9月19日	10,568		—	98.7
	9月末	10,543		△0.2	98.3
	10月末	10,378		△1.8	98.4
	11月末	10,557		△0.1	99.0
	(期 末)				
	2023年12月18日	10,349		△2.1	97.7
第38期	(期 首)				
	2023年12月18日	10,199		—	97.7
	12月末	10,248		0.5	99.5
	2024年 1月末	10,459		2.5	98.8
	2月末	10,649		4.4	99.0
	(期 末)				
	2024年 3月18日	10,604		4.0	98.7

(注1) 基準価額は1万口当たり。

(注2) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

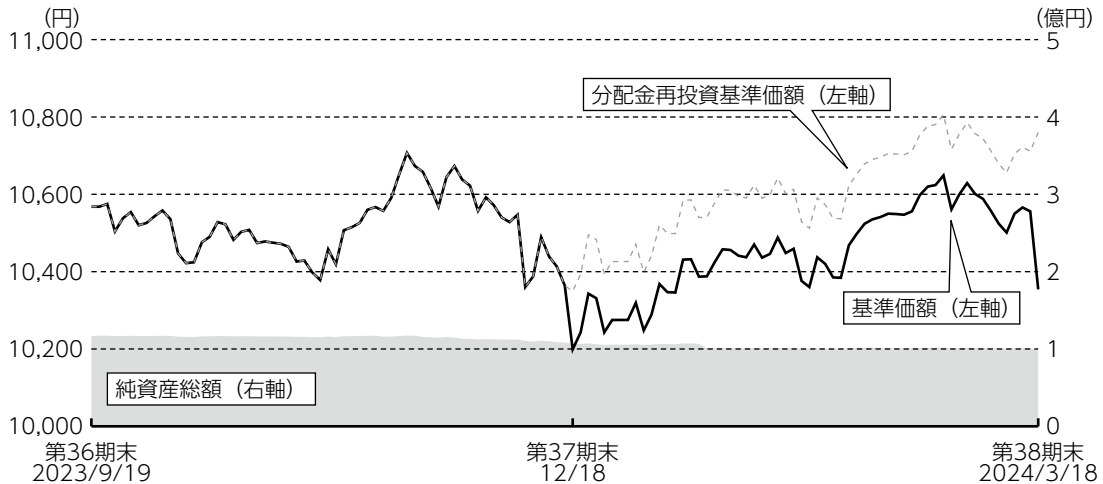
(注3) 当ファンドは、ベンチマーク対比の運用ではなく、アクティブ度の高い運用を行う方針であることから、運用の目標となるベンチマークや投資対象資産の市場動向を説明する代表的な指数（参考指数）はありません。

(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

(2023年9月19日～2024年3月18日)



第37期首：10,568円

第38期末：10,354円（既払分配金 400円）

騰落率：1.8%（分配金再投資ベース）

(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。

当作成期の基準価額は、既払分配金400円（税引前）込みで186円値上がりしました。なお、基準価額の騰落率は+1.8%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）
- ・実質的に投資を行っている世界各国の転換社債等における為替変動による収益または損失（円と世界各国の転換社債等に係る通貨との間の為替変動に伴う損益）

当作成期の基準価額は、実質的に組入を行っている転換社債等からのインカム・ゲインや、為替変動に伴う収益（主に対円でのユーロ高や米ドル高）などのプラス要因が、信託報酬などのマイナス要因を上回ったため、値上がりしました。

投資環境について

グローバル転換社債（以下「CB」）市場

当作成期のCB市場は、前作成期末比で上昇しました。

作成期の序盤、金融引き締め長期化観測を背景とした欧米長期金利の上昇や、中東情勢の緊迫化への懸念などからリスク回避の動きが強まり、CB市場は下落基調で推移しました。しかし2023年11月に入ると、米国のインフレ鈍化と金利の低下を受けて、CB市場は反発に転じ、さらに12月にはパウエル米連邦準備制度理事会（FRB）議長のハト派的な発言などを追い風に一段と値を上げました。2024年1月以降は、米大手ハイテク企業の好決算が相次いだことなどが支援材料となった一方で、FRB高官から早期利下げに対して慎重な発言が続いたことや、底堅い米国経済などを背景に早期利下げ観測が後退するなど、CB市場は方向感に乏しい動きで推移しました。このような環境下、CB市場は前作成期末比で上昇して作成期を終えました。

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（ノンヘッジクラス）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（ノンヘッジクラス）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（ノンヘッジクラス）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（ノンヘッジクラス）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。

UBS（CAY）グローバルCBファンドの組入資産の内容

（2024年2月29日現在）

ポートフォリオの特性

平均直接利回り	2.16%
平均最終利回り	6.80%
株価連動率（デルタ*）	11.80%
デュレーション**	1.97
平均格付	BBB
銘柄数	100

*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。

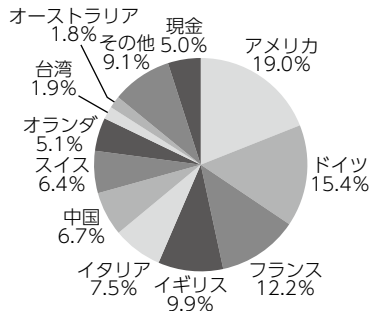
*利回りは、計算日時点の評価に基づくものであり、売却や償還による差損益等を考慮した後のUBS（CAY）グローバルCBファンドの「期待利回り」を示すものではありません。

*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。

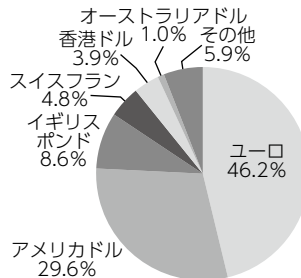
組入上位10銘柄（銘柄数合計：100銘柄）

銘柄名	利率	償還日	国	構成比
ウェルズ・ファーゴ（永久債）	7.500%	—	アメリカ	1.4%
アブダビ国営石油	0.700%	2024/6/ 4	U A E	1.4%
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	1.3%
美团【メイトゥアン】	0.000%	2028/4/27	中国	1.2%
サイペン	2.875%	2029/9/11	イタリア	1.2%
アイオニス・ファーマシューティカルズ	0.000%	2026/4/ 1	アメリカ	1.2%
ジャスト・イート・テイクアウェー・ドットコム	0.625%	2028/2/ 9	オランダ	1.2%
PHPファイナンス（ジャージーNO2）	2.875%	2025/7/15	イギリス	1.2%
BNPパリバ・フォルティス（永久債）	5.920%	—	ベルギー	1.2%
ダーヴェント・ロンドン・キャピタルNO.3	1.500%	2025/6/12	イギリス	1.1%

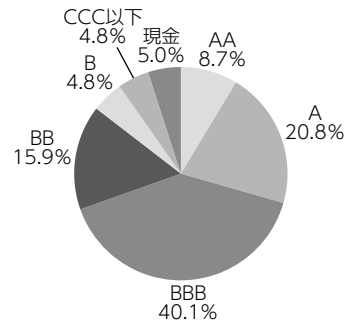
国別構成比



通貨別構成比



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。当作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。

分配金について

当作成期の収益分配金につきましては、基準価額の水準や市況動向等を勘案し、第37期は150円とし、第38期は250円（いずれも1万口当たり、税引前）といたしました。

なお、収益の分配にあてなかつ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。
1. 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。
 2. 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37期	第38期
	2023年 9月20日～ 2023年12月18日	2023年12月19日～ 2024年 3月18日
当期分配金	150円	250円
（対基準価額比率）	(1.449%)	(2.358%)
当期の収益	150円	10円
当期の収益以外	-円	239円
翌期繰越分配対象額	1,314円	1,076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魅力的な水準にあると捉えています。足元のCBの新発債市場は、新たに資金調達を実施する企業や借換え需要の増加などを背景に活発な状況にあります。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（ノンヘッジクラス）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（ノンヘッジクラス）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。

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37期～第38期 2023/9/20～2024/3/18		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	54円	0.517%	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10,472円です。
（投信会社）	（11）	（0.109）	委託した資金の運用の対価
（販売会社）	（40）	（0.381）	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）	（0.027）	運用財産の管理、運用指図実行等の対価
その他費用	4	0.040	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）	（0.010）	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）	（ 3）	（0.029）	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	58	0.557	

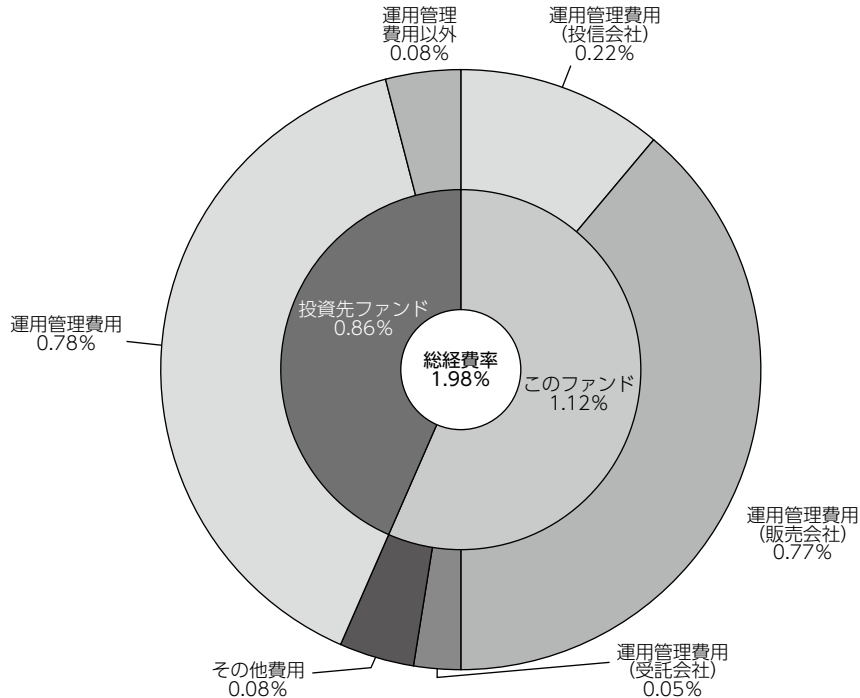
(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は、追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(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あります。

(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)	1.98%
①このファンドの費用の比率	1.12%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.78%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.08%

- (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) 投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券です。
- (注7) ①の費用は、投資先ファンドが支払った費用を含みません。
- (注8) 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1.98%です。

期中の売買及び取引の状況（自 2023年9月20日 至 2024年3月18日）

投資信託証券

		第 37 期 ~ 第 38 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 (ノンヘッジクラス)	□ — (2,718,481)	千円 — (3,009)	□ — 18,027,112	千円 — 19,939

(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 2023年9月20日 至 2024年3月18日）

当作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（2024年3月18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18作成期末	第19作成期末（第38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）	□ 729,781	□ 729,781	千円 721	% 0.7
UBS (CAY) グローバルCBファンド (ノンヘッジクラス)	101,009,123	85,700,492	96,841	98.0
合 計	101,738,904	86,430,273	97,562	98.7

(注) 単位未満は切り捨て。

投資信託財産の構成

(2024年3月18日現在)

項 目	第19作成期末（第38期末）	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 97,562	% 96.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,964	3.9
投 資 信 託 財 産 総 額	101,526	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

(2023年12月18日) (2024年3月18日)

項 目	第 37 期 末	第 38 期 末
(A) 資 産	109,504,189円	101,526,121円
コール・ローン等	5,367,328	3,963,251
投資信託受益証券(評価額)	104,136,861	97,562,870
(B) 負 債	2,927,002	2,673,498
未払収益分配金	1,567,515	2,386,851
未払解約金	1,040,800	-
未払信託報酬	295,678	266,215
未払利息	15	11
その他未払費用	22,994	20,421
(C) 純資産総額(A-B)	106,577,187	98,852,623
元 本	104,501,021	95,474,061
次期繰越損益金	2,076,166	3,378,562
(D) 受益権総口数	104,501,021口	95,474,061口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,199円	10,354円

(注1) 当ファンドの第37期首元本額は110,441,426円、第37～38期中追加設定元本額は799,113円、第37～38期中一部解約元本額は15,766,478円です。

(注2) 1口当たり純資産額は、第37期1.0199円、第38期1.0354円です。

損益の状況

第37期 (自2023年 9月20日 至2023年12月18日)
第38期 (自2023年12月19日 至2024年 3月18日)

項 目	第 37 期	第 38 期
(A) 配 当 等 収 益	2,790,266円	104,205円
受 取 配 当 金	2,790,743	104,570
支 払 利 息	△ 477	△ 365
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 4,778,535	4,026,665
売 買 益	87,444	4,399,440
売 買 損	△ 4,865,979	△ 372,775
(C) 信 託 報 酬 等	△ 318,672	△ 286,636
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 2,306,941	3,844,234
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	4,459,806	557,210
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,490,816	1,363,969
(配当等相当額)	(1,547,490)	(1,445,705)
(売買損益相当額)	(△ 56,674)	(△ 81,736)
(G) 計 (D + E + F)	3,643,681	5,765,413
(H) 収 益 分 配 金	△ 1,567,515	△ 2,386,851
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	2,076,166	3,378,562
追 加 信 託 差 損 益 金	1,490,816	1,363,969
(配当等相当額)	(1,547,490)	(1,445,705)
(売買損益相当額)	(△ 56,674)	(△ 81,736)
分 配 準 備 積 立 金	12,187,244	8,836,639
繰 越 損 益 金	△ 11,601,894	△ 6,822,046

(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37期計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,471,594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(1,547,490円)および分配準備積立金(11,283,165円)より分配対象収益は15,302,249円(10,000口当たり1,464円)であり、うち1,567,515円(10,000口当たり150円)を分配金額としております。

(注5) 第38期計算期間末における費用控除後の配当等収益(96,982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(1,445,705円)および分配準備積立金(11,126,508円)より分配対象収益は12,669,195円(10,000口当たり1,326円)であり、うち2,386,851円(10,000口当たり250円)を分配金額としております。

分配金のお知らせ

	1万口当たり分配金
第 37 期	150円
第 38 期	250円

- ◇分配金をお支払いする場合
分配金のお支払いは決算日から起算して5営業日までに開始いたします。
- ◇分配金を再投資する場合
お手持り分配金は、決算日の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。
- ◇分配金の区分について
 - ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
 - ・分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、全額が普通分配金となります。
 - ・分配後の基準価額が個別元本を下回る場合は、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、残りの額が普通分配金となります。
- ◇元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ◇税金について
分配金は普通分配金に課税され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率が適用されます。
- ◇2020年1月1日以降の分配時において、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

<約款変更のお知らせ>

デリバティブ取引の利用目的をより明確にする変更を行いました。（約款変更実施日：2023年12月20日）

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・為替ヘッジなし）」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、2022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

2022年11月30日終了年度
円

収益

受取利息	221,489,094
配当収入	5,329,744
その他収益	283,471
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）	18,963,233
デリバティブ金融資産・負債に係る実現利益（損失）	(326,008,829)
外国為替取引に係る実現利益（損失）	31,387,751
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	(12,259,353)
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	(37,545,934)
外国為替取引に係る未実現評価益（評価損）の変動額	1,480,041
収益（損失）合計	<u>(96,880,782)</u>

費用

投資管理費用	32,378,448
専門家費用	8,905,635
保管費用	7,474,470
管理費用	4,532,986
名義書換事務代行費用	1,266,248
支払利息	1,020,248
信託費用	647,573
登録費用	494,940
取引手数料	558
その他費用	9,855
費用合計	<u>56,730,961</u>
営業利益（損失）	<u>(153,611,743)</u>

金融費用

解約可能受益者への分配金	<u>(322,386,210)</u>
解約可能受益者に属する税引前純資産の増減額	<u>(475,997,953)</u>
配当金に係る源泉徴収税	<u>(5,680,395)</u>
解約可能受益者に属する純資産の増減額	<u>(481,678,348)</u>

2022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 (94.2%)		
		オーストラリア (2.1%)		
		転換社債 (2.1%)		
		DEXUS Finance Pty Ltd.		
AUD	600,000	3.50% due 11/24/27	1.0	¥ 57,555,808
		Seven Group Holdings, Ltd.		
AUD	700,000	2.20% due 03/05/25	1.1	66,174,727
		転換社債合計		<u>123,730,535</u>
		オーストラリア合計		<u>123,730,535</u>
		オーストラリア (1.1%)		
		転換社債 (1.1%)		
		ams AG		
EUR	600,000	0.00% due 03/05/25	1.1	63,437,960
		転換社債合計		<u>63,437,960</u>
		オーストリア合計		<u>63,437,960</u>
		ベルギー (1.9%)		
		転換社債 (1.9%)		
		BNP Paribas Fortis SA [^]		
EUR	500,000	3.03%	0.9	56,393,361
		Mithra Pharmaceuticals S. A.		
EUR	600,000	4.25% due 12/17/25	1.0	56,936,748
		転換社債合計		<u>113,330,109</u>
		ベルギー合計		<u>113,330,109</u>
		バミューダ (0.8%)		
		転換社債 (0.8%)		
		SFL Corp. Ltd.		
USD	350,000	4.88% due 05/01/23	0.8	47,911,058
		転換社債合計		<u>47,911,058</u>
		バミューダ合計		<u>47,911,058</u>
		ヴァージン諸島 (2.0%)		
		転換社債 (2.0%)		
		Sail Vantage Ltd.		
HKD	5,000,000	0.00% due 01/13/27	1.2	74,324,199
		Universe Trek Ltd.		
USD	400,000	0.00% due 06/15/26	0.8	46,522,635
		転換社債合計		<u>120,846,834</u>
		ヴァージン諸島合計		<u>120,846,834</u>
		ケイマン諸島 (5.1%)		
		転換社債 (5.1%)		
		FarFetch Ltd.		
USD	500,000	3.75% due 05/01/27	1.1	66,609,341
		Hansoh Pharmaceutical Group Co. Ltd.		
USD	400,000	0.00% due 01/22/26	0.9	50,932,099
		Meituan		
USD	600,000	0.00% due 04/27/28	1.1	66,100,097
		Microport Scientific Corp.		
USD	600,000	0.00% due 06/11/26	1.0	58,732,385

UBSグローバルCBオープン (年4回決算型・為替ヘッジなし)

通貨	額面	銘柄	対純資産比率 (%)	評価額
USD	460,000	Pinduoduo, Inc. 0.00% due 12/01/25	1.0	¥ 60,337,095
		転換社債合計		<u>302,711,017</u>
		ケイマン諸島合計		<u>302,711,017</u>
		中国 (3.6%) 転換社債 (3.6%)		
HKD	4,000,000	China Conch Venture Holdings International, Ltd. 0.00% due 09/05/23	1.3	76,013,589
CNH	4,000,000	Pharmaron Beijing Co. Ltd. 0.00% due 06/18/26	1.2	71,310,965
HKD	4,000,000	Zhou Hei Ya International Holdings Co. Ltd. 1.00% due 11/05/25	1.1	66,869,075
		転換社債合計		<u>214,193,629</u>
		中国合計		<u>214,193,629</u>
		キプロス (0.8%) 転換社債 (0.8%)		
USD	600,000	Ozon Holdings PLC 1.88% due 02/24/26	0.8	48,225,023
		転換社債合計		<u>48,225,023</u>
		キプロス合計		<u>48,225,023</u>
		フランス (11.2%) 転換社債 (11.2%)		
EUR	400,000	Air France-KLM [^] 6.50%	1.0	57,625,098
EUR	600,000	Bigben Interactive 1.13% due 02/19/26	1.1	62,525,510
EUR	700,000	Edenred 0.00% due 06/14/28	1.1	67,046,385
EUR	700,000	Fnac Darty S.A. 0.25% due 03/23/27	1.1	63,814,296
EUR	872,000	Korian S.A. 0.88% due 03/06/27	0.9	53,251,860
EUR	1,330,000	1.88% [^] Maisons du Monde S.A.	1.0	60,193,627
EUR	1,070,000	0.13% due 12/06/23 Neoen S.A.	1.2	70,728,178
EUR	300,000	2.88% due 09/14/27 Nexity S.A.	0.7	44,448,576
EUR	750,000	0.25% due 03/02/25 Ubisoft Entertainment S.A.	1.0	62,036,289
EUR	400,000	2.38% due 11/15/28 Volitalia S.A.	1.0	59,890,114
EUR	1,560,000	1.00% due 01/13/25 転換社債合計	1.1	62,544,970
		フランス合計		<u>664,104,903</u>
		ドイツ (9.1%) 転換社債 (9.1%)		<u>664,104,903</u>
EUR	600,000	Delivery Hero SE 1.50% due 01/15/28	1.0	57,121,492
EUR	600,000	2.13% due 03/10/29 Deutsche Lufthansa AG	0.9	54,367,740
EUR	200,000	2.00% due 11/17/25	0.5	30,318,641

UBSグローバルCBオープン (年4回決算型・為替ヘッジなし)

通貨	額面	銘柄	対純資産比率 (%)	評価額
EUR	400,000	Duerr AG 0.75% due 01/15/26	1.1	¥ 62,919,703
EUR	500,000	LEG Immobilien AG 0.40% due 06/30/28	0.9	54,828,556
EUR	400,000	MBT Systems GmbH 3.50% due 07/08/27	1.1	66,810,543
EUR	500,000	MorphoSys AG 0.63% due 10/16/25	0.6	34,849,854
EUR	500,000	RAG-Stiftung 0.00% due 06/17/26	1.1	65,836,912
EUR	500,000	TAG Immobilien AG 0.63% due 08/27/26	0.9	50,718,105
EUR	500,000	Zalando SE 0.63% due 08/06/27	1.0	58,068,712
		転換社債合計		535,840,258
		ドイツ合計		535,840,258
		香港 (3.2%)		
		転換社債 (3.2%)		
USD	400,000	China Overseas Finance Investment Cayman V, Ltd. 0.00% due 01/05/23	1.1	67,062,923
USD	400,000	Lenovo Group Ltd. 2.50% due 08/26/29	0.9	53,332,187
EUR	500,000	Sino Biopharmaceutical Ltd. 0.00% due 02/17/25	1.2	70,432,793
		転換社債合計		190,827,903
		香港合計		190,827,903
		アイルランド (1.1%)		
		転換社債 (1.1%)		
EUR	500,000	Glanbia Co.-operative Society Ltd. 1.88% due 01/27/27	1.1	64,116,018
		転換社債合計		64,116,018
		アイルランド合計		64,116,018
		イタリア (3.1%)		
		転換社債 (3.1%)		
EUR	500,000	DiaSorin SpA 0.00% due 05/05/28	1.0	62,019,154
EUR	600,000	Nexi SpA 0.00% due 02/24/28	1.1	62,748,387
EUR	400,000	Prysmian SpA 0.00% due 02/02/26	1.0	58,664,358
		転換社債合計		183,431,899
		イタリア合計		183,431,899
		ジャージー、チャンネル諸島 (0.9%)		
		転換社債 (0.9%)		
GBP	500,000	Cornwall Jersey Ltd. 0.75% due 04/16/26	0.9	52,553,847
		転換社債合計		52,553,847
		ジャージー、チャンネル諸島合計		52,553,847
		ルクセンブルク (4.9%)		
		転換社債 (4.9%)		
EUR	400,000	Elliott Capital Sarl 0.00% due 12/30/22	1.0	57,234,411

UBSグローバルCBオープン (年4回決算型・為替ヘッジなし)

通貨	額面	銘柄	対純資産比率 (%)	評価額
EUR	400,000	European TopSoho S.a.r.l. 土 4.00% due 09/21/21	0.8	¥ 48,850,300
EUR	600,000	Global Fashion Group S.A. 1.25% due 03/15/28	1.1	63,628,952
GBP	500,000	IWG International Holdings 0.50% due 12/09/27	1.0	61,211,730
EUR	400,000	Klockner & Co. Financial Services SA 2.00% due 09/08/23	1.0	56,881,344
		転換社債合計		287,806,737
		ルクセンブルク合計		287,806,737
		マルタ (0.8%) 転換社債 (0.8%) Brait PLC		
GBP	300,000	6.50% due 12/04/24	0.8	45,522,184
HKD	10,000,000	REXLot Holdings, Ltd. 土 4.50% due 04/17/19	0.0	2,594,078
		転換社債合計		48,116,262
		マルタ合計		48,116,262
		モーリシャス (1.1%) 転換社債 (1.1%) HTA Group Ltd.		
USD	600,000	2.88% due 03/18/27	1.1	65,262,857
		転換社債合計		65,262,857
		モーリシャス合計		65,262,857
		オランダ (10.0%) 転換社債 (10.0%) Basic-Fit NV		
EUR	500,000	1.50% due 06/17/28	1.0	56,897,162
EUR	400,000	COSMO Pharmaceuticals NV 2.50% due 12/05/23	0.9	54,349,694
CHF	400,000	Dufry One BV 0.75% due 03/30/26	0.8	48,059,463
USD	600,000	ELM BV for Swiss Re, Ltd. 3.25% due 06/13/24	1.4	85,113,817
EUR	400,000	Encavis Finance BV [^] 1.88%	1.0	59,762,833
EUR	700,000	Just Eat Takeaway.com NV 0.63% due 02/09/28	1.2	67,341,489
EUR	600,000	1.25% due 04/30/26	1.1	66,781,727
EUR	500,000	Pharming Group NV 3.00% due 01/21/25	1.1	66,512,557
EUR	400,000	Shop Apotheke Europe NV 0.00% due 01/21/28	0.7	38,011,280
CHF	389,000	ZUR Rose Finance BV 6.88% due 09/15/26	0.8	45,578,427
		転換社債合計		588,408,449
		オランダ合計		588,408,449
		ニュージーランド (1.1%) 転換社債 (1.1%) Xero Investments Ltd.		
USD	600,000	0.00% due 12/02/25	1.1	65,011,685
		転換社債合計		65,011,685
		ニュージーランド合計		65,011,685

UBSグローバルCBオープン (年4回決算型・為替ヘッジなし)

通貨	額面	銘柄	対純資産比率 (%)	評価額
		ノルウェー (0.8%)		
		転換社債 (0.8%)		
		BW Offshore Ltd.		
USD	400,000	2.50% due 11/12/24	0.8	¥ 48,320,468
		転換社債合計		48,320,468
		ノルウェー合計		48,320,468
		シンガポール (1.7%)		
		転換社債 (1.7%)		
		Keppel REIT		
SGD	750,000	1.90% due 04/10/24	1.2	72,555,094
		Singapore Airlines Ltd.		
SGD	250,000	1.63% due 12/03/25	0.5	26,310,768
		転換社債合計		98,865,862
		シンガポール合計		98,865,862
		スペイン (3.0%)		
		転換社債 (3.0%)		
		Cellnex Telecom S.A.		
EUR	600,000	0.75% due 11/20/31	1.1	64,645,886
		Corp. Economica Delta S.A.		
EUR	400,000	1.00% due 12/01/23	0.9	55,436,469
		Ence Energia y Celulosa S.A.		
EUR	400,000	1.25% due 03/05/23	1.0	57,103,699
		転換社債合計		177,186,054
		スペイン合計		177,186,054
		スイス (2.5%)		
		転換社債 (2.5%)		
		Basilea Pharmaceutica AG		
CHF	120,000	3.25% due 07/28/27	0.3	17,645,530
		Idorsia Ltd.		
CHF	800,000	2.13% due 08/04/28	1.4	81,068,094
		Santhera Pharmaceuticals Holding AG		
CHF	459,000	7.50% due 08/17/24	0.8	47,214,332
		転換社債合計		145,927,956
		スイス合計		145,927,956
		アラブ首長国連邦 (2.8%)		
		転換社債 (2.8%)		
		Abu Dhabi National Oil Co.		
USD	600,000	0.70% due 06/04/24	1.3	78,114,490
		Borr Drilling, Ltd.		
USD	400,000	3.88% due 05/23/23	0.9	53,862,439
		NMC Health Jersey, Ltd. ±		
USD	1,000,000	1.88% due 04/30/25	0.6	34,884,999
		転換社債合計		166,861,928
		アラブ首長国連邦合計		166,861,928
		イギリス (7.0%)		
		転換社債 (7.0%)		
		African Minerals, Ltd. ±		
USD	1,200,000	8.50% due 02/10/17	0.0	1,674,480
		Capital & Counties Properties PLC		
GBP	500,000	2.00% due 03/30/26	1.1	67,011,349
		Derwent London Capital No 3 Jersey Ltd.		
GBP	400,000	1.50% due 06/12/25	1.0	59,208,133

UBSグローバルCBオープン (年4回決算型・為替ヘッジなし)

通貨	額面	銘柄	対純資産比率 (%)	評価額
		JET2 PLC		
GBP	400,000	1.63% due 06/10/26	1.0	¥ 57,538,458
		PHP Finance Jersey NO 2 Ltd.		
GBP	400,000	2.88% due 07/15/25	1.1	62,120,060
		Sirius Minerals Finance NO 2 Ltd.		
USD	400,000	5.00% due 05/23/27	1.2	72,980,129
		Stobart Finance PLC		
GBP	346,000	2.75% due 05/08/24	0.7	39,673,377
		Trainline PLC		
GBP	400,000	1.00% due 01/14/26	0.9	54,853,679
		転換社債合計		415,059,665
		イギリス合計		415,059,665
		アメリカ (12.5%)		
		転換社債 (12.5%)		
		Ares Capital Corp.		
USD	400,000	4.63% due 03/01/24	1.0	60,839,439
		Blackstone Mortgage Trust, Inc.		
USD	522,000	5.50% due 03/15/27	1.1	64,099,093
		Coupa Software, Inc.		
USD	482,000	0.38% due 06/15/26	1.0	58,985,510
		DISH Network Corp.		
USD	645,000	3.38% due 08/15/26	1.0	58,277,136
		Guardant Health, Inc.		
USD	618,000	0.00% due 11/15/27	1.1	62,317,163
		Intercept Pharmaceuticals, Inc.		
USD	200,000	3.25% due 07/01/23	0.5	26,948,235
		John Bean Technologies Corp.		
USD	500,000	0.25% due 05/15/26	1.0	59,688,234
		Liberty Interactive LLC		
USD	813,000	4.00% due 11/15/29	0.6	38,571,646
		Liberty Media Corp.		
USD	400,000	2.13% due 03/31/48	0.9	53,025,199
		Ligand Pharmaceuticals, Inc.		
USD	300,000	0.75% due 05/15/23	0.7	40,344,502
		Prospect Capital Corp.		
USD	388,000	6.38% due 03/01/25	0.9	55,024,026
		Redfin Corp.		
USD	750,000	0.00% due 10/15/25	1.1	62,269,724
		Spirit Airlines, Inc.		
USD	510,000	1.00% due 05/15/26	1.0	58,497,958
		Western Digital Corp.		
USD	280,000	1.50% due 02/01/24	0.6	37,176,246
		転換社債合計		736,064,111
		アメリカ合計		736,064,111
		固定利付証券合計 (Cost ¥5,927,651,245)		¥ 5,568,153,027
		優先株式 (1.4%)		
		アメリカ (1.4%)		
		銀行 (1.4%)		
USD	500	Wells Fargo & Co. 7.50%	1.4	82,677,448
		アメリカ合計 (Cost ¥67,958,848)		82,677,448
		優先株式合計 (Cost ¥67,958,848)		¥ 82,677,448

2022年11月30日時点の未決済為替予約取引 (対純資産比率-0.1%)

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)
	JPMorgan Chase Bank							
JPY	NA	21,494,024	01/06/2023	CNY	1,127,200	¥ -	¥ (478,686)	¥ (478,686)
	JPMorgan Chase Bank							
JPY	NA	85,013,261	01/06/2023	HKD	4,846,200	-	(1,150,596)	(1,150,596)
	JPMorgan Chase Bank							
JPY	NA	590,342,626	01/06/2023	USD	4,307,100	-	(7,616,558)	(7,616,558)
	JPMorgan Chase Bank							
JPY	NA	27,791,991	01/06/2023	SGD	278,500	-	(430,546)	(430,546)
JPY	Morgan Stanley	823,318,429	01/06/2023	EUR	5,730,400	1,520,064	-	1,520,064
	Standard Chartered							
JPY	Bank	168,414,360	01/06/2023	GBP	1,015,200	334,890	-	334,890
JPY	UBS AG	92,027,412	01/06/2023	CHF	629,700	-	(195,787)	(195,787)
JPY	UBS AG	42,340,364	01/06/2023	AUD	460,500	-	(544,717)	(544,717)
	Brown Brothers							
USD	Harriman & Co.	45,300	01/06/2023	JPY	6,294,136	-	(5,090)	(5,090)
						¥	¥	¥
						<u>1,854,954</u>	<u>(10,421,980)</u>	<u>(8,567,026)</u>

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・為替ヘッジなし）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9期決算日（2023年9月19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	み	期	債 券 組 入 率	債 券 先 物 率	純 資 産 額
		分 配	金	騰 落			
	円	円		%	%	%	百万円
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
9期（2023年9月19日）	9,891	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	債 券 組 入 率	債 券 先 物 率
		率		
(期 首)	円	%	%	%
2022年 9月20日	9,904	—	—	—
9月末	9,904	0.0	—	—
10月末	9,902	△0.0	—	—
11月末	9,901	△0.0	—	—
12月末	9,900	△0.0	—	—
2023年 1月末	9,899	△0.1	—	—
2月末	9,898	△0.1	—	—
3月末	9,897	△0.1	—	—
4月末	9,896	△0.1	—	—
5月末	9,895	△0.1	—	—
6月末	9,894	△0.1	—	—
7月末	9,893	△0.1	—	—
8月末	9,892	△0.1	—	—
(期 末)				
2023年 9月19日	9,891	△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9期	
	2022年9月21日～2023年9月19日	
当期分配金	-円	
（対基準価額比率）	（ - %）	
当期の収益	-円	
当期の収益以外	-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却等損益」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 2022/9/21～2023/9/19		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9,897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 2022年9月21日 至 2023年9月19日）

該当事項はありません。

主要な売買銘柄（自 2022年9月21日 至 2023年9月19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 2022年9月21日 至 2023年9月19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（2023年9月19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

(2023年9月19日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,721	100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	1,721	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

(2023年9月19日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	1,721,228円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,721,228
(B) 負 債	382
未 払 信 託 報 酬	366
未 払 利 息	4
そ の 他 未 払 費 用	12
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,720,846
元 本	1,739,837
次 期 繰 越 損 益 金	△ 18,991
(D) 受 益 権 総 口 数	1,739,837口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	9,891円

〈注記事項〉

期首元本額	1,739,837円
期中追加設定元本額	0円
期中一部解約元本額	0円
1口当たり純資産額	0.9891円

純資産総額が元本を下回っており、その差額は18,991円です。

損益の状況

(自2022年9月21日 至2023年9月19日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 1,502円
支 払 利 息	△ 1,502
(B) 信 託 報 酬 等	△ 768
(C) 当 期 損 益 金(A+B)	△ 2,270
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	△11,817
(E) 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)
(F) 計 算 (C+D+E)	△18,991
(G) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(F+G)	△18,991
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	△23,818

(注1) 損益の状況の中で(B)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2) 損益の状況の中で(E)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3) 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。