

【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】 令和2年12月25日

【発行者名】 UBSファンド・マネジメント（ルクセンブルグ）エス・エイ
（UBS Fund Management（Luxembourg）S.A.）

【代表者の役職氏名】 メンバー・オブ・ザ・エグゼクティブ・ボード
ヴァレリー・ベルナル（Valérie Bernard）
メンバー・オブ・ザ・エグゼクティブ・ボード
ジェフリー・ラーン（Geoffrey Lahaye）

【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番
（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

【事務連絡者氏名】 弁護士 三 浦 健
弁護士 大 西 信 治

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所

【電話番号】 03（6212）8316

【届出の対象とした募集（売出）外国投資信託受益証券に係るファンドの名称】
UBS（Lux）ボンド・ファンド
（UBS（Lux）Bond Fund）

【届出の対象とした募集（売出）外国投資信託受益証券の金額】
UBS（Lux）ボンド・ファンド - オーストラリア・ドル
（UBS（Lux）Bond Fund-AUD）
クラスP - d i s t 受益証券
18億7,515万オーストラリア・ドル（約1,385億円）
クラスP - a c c 受益証券
39億7,026万オーストラリア・ドル（約2,933億円）
UBS（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル
（UBS（Lux）Bond Fund-EUR Flexible）
クラスP - d i s t 受益証券
11億2,064万ユーロ（約1,357億円）
クラスP - a c c 受益証券
17億980万ユーロ（約2,070億円）

UBS (Lux) ボンド・ファンド -

フルサイクル・アジア・ボンド(米ドル)

(UBS (Lux) Bond Fund-Full Cycle Asian Bond (USD))

クラスP - a c c 受益証券

7億9,780万アメリカ合衆国ドル(約860億円)

UBS (Lux) ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド(ユーロ)

(UBS (Lux) Bond Fund-Euro High Yield (EUR))

クラスP - a c c 受益証券(米ドル・ヘッジ)

10億3,248万アメリカ合衆国ドル(約1,112億円)

クラスP - m d i s t 受益証券(米ドル・ヘッジ)

6億8,944万アメリカ合衆国ドル(約743億円)

クラスP - a c c 受益証券

16億8万ユーロ(約1,937億円)

クラスP - m d i s t 受益証券

9億6,568万ユーロ(約1,169億円)

(注) オーストラリア・ドル(以下「豪ドル」という。)、ユーロおよびアメリカ合衆国ドル(以下「米ドル」という。)の円貨換算は、便宜上、2020年6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豪ドル=73.88円、1ユーロ=121.08円、1米ドル=107.74円)による。

【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、2020年8月31日付をもって提出した有価証券届出書(以下「原届出書」といいます。)につきまして、「第二部 ファンド情報」中「第1 ファンドの状況」の「1 ファンドの性格」、「5 運用状況」、「第3 ファンドの経理状況」ならびに「第三部 特別情報」中「第1 管理会社の概況」の「1 管理会社の概況」、「2 事業の内容及び営業の概況」および「3 管理会社の経理状況」を新たな情報により訂正および追加するため、本訂正届出書を提出するものです。

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

2【訂正の内容】

原届出書の訂正内容は下記のとおりです。

下線部は訂正部分を示します。ただし、全文修正(更新)の場合は下線を付しておりません。

[次へ](#)

第二部 ファンド情報

第1 ファンドの状況

1 ファンドの性格

(3) ファンドの仕組み

管理会社の概況

(八) 資本金の額

<訂正前>

株主資本の13,000,000ユーロ(約16億円)は、1株2,000ユーロ(242,160円)の株式6,500株によって表章される。2020年6月末日現在、すべての株式は全額払込済みである。

<訂正後>

株式資本の13,000,000ユーロ(約16億円)は、1株2,000ユーロ(244,280円)の株式6,500株によって表章される。2020年10月末日現在、すべての株式は全額払込済みである。

(注)ユーロの円貨換算は、2020年10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=122.14円)による。以下、同じ。

5 運用状況

(1) 投資状況(資産別及び地域別の投資状況)

投資状況については、以下の内容に原届出書が更新されます。

(オーストラリア・ドル)

(2020年10月末日現在)

資産の種類	国・地域名	時価合計 (オーストラリア・ドル)	投資比率 (%)
債券	オーストラリア	295,712,365.85	79.70
	アメリカ合衆国	16,725,793.00	4.51
	ノルウェー	12,214,072.00	3.29
	ドイツ	11,194,115.00	3.02
	イギリス	10,105,704.00	2.72
	カナダ	5,050,140.00	1.36
	国際機関	3,392,452.00	0.91
	フィリピン	2,669,725.00	0.72
	日本	1,973,074.00	0.53
	ニュージーランド	1,026,740.00	0.28
投資有価証券合計		360,064,180.85	97.04
現金・その他の資産(負債控除後)		10,975,400.65	2.96
合計 (純資産総額)		371,039,581.50 (約27,297百万円)	100.00

(注1) 投資比率とは、ファンドの各サブ・ファンドの純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。

(注2) 資産別及び地域別の投資状況は、各サブ・ファンドの資産がどのような商品にどれくらい投資されているかを示している。以下同じ。

(注3) オーストラリア・ドル(以下「豪ドル」という。)、ユーロ、アメリカ合衆国ドル(以下「米ドル」という。)の円貨換算は、2020年10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豪ドル=73.57円、1ユーロ=122.14円、1米ドル=104.60円)による。以下同じ。

(注4) 本書の中で金額および比率を表示する場合、四捨五入してある。従って、合計の数字が一致しない場合がある。また、円貨への換算は、それに対応する数字につき所定の換算率で単純計算のうえ、必要な場合四捨五入して記載してある。従って、本書中の同一の情報につき異なった円貨表示がなされている場合がある。以下同じ。

(注5) 本「5 運用状況」に記載されている各サブ・ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではない。

（ユーロ・フレキシブル）

（2020年10月末日現在）

資産の種類	国・地域名	時価合計 (ユーロ)	投資比率 (%)
債券	イタリア	26,887,099.34	11.75
	ニュージーランド	23,630,140.29	10.33
	フランス	22,922,489.97	10.02
	ドイツ	15,054,065.30	6.58
	アメリカ合衆国	15,041,890.09	6.57
	オランダ	14,702,693.80	6.43
	スペイン	14,161,518.78	6.19
	南アフリカ	7,613,273.18	3.33
	ルクセンブルグ	7,063,323.64	3.09
	スロベニア	4,654,461.20	2.03
	アイルランド	4,641,655.02	2.03
	ベルギー	4,117,370.29	1.80
	ポルトガル	4,077,100.00	1.78
	イギリス	3,712,968.18	1.62
	ギリシャ	3,478,874.94	1.52
	オーストリア	3,413,590.00	1.49
	日本	3,190,468.56	1.39
	メキシコ	3,083,607.98	1.35
	中国	2,312,676.63	1.01
	サウジアラビア	2,198,442.46	0.96
	国際機関	2,130,405.70	0.93
	オーストラリア	1,663,880.16	0.73
	ルーマニア	1,338,500.00	0.59
	コスタリカ	1,127,301.79	0.49
	スイス	1,062,050.00	0.46
	スウェーデン	1,028,779.45	0.45
	ウクライナ	962,066.78	0.42
	ポーランド	939,387.50	0.41
	スロバキア	884,336.00	0.39
	カザフスタン	875,000.00	0.38
	チリ	707,437.50	0.31
	タイ	638,752.07	0.28
	ウルグアイ	611,183.84	0.27
インドネシア	593,541.11	0.26	
ブラジル	564,664.98	0.25	
コロンビア	552,780.40	0.24	
オマーン	532,965.62	0.23	
フィリピン	522,975.06	0.23	

	モロッコ	515,624.33	0.23
	香港	504,062.50	0.22
	モンゴル	489,601.66	0.21
	トルコ	474,524.61	0.21
	ペルー	434,984.38	0.19
	グアテマラ	385,135.43	0.17
	エジプト	382,375.00	0.17
	デンマーク	374,830.37	0.16
	ノルウェー	337,358.40	0.15
	フィンランド	332,357.70	0.15
	アルゼンチン	240,170.88	0.10
	エクアドル	181,264.41	0.08
	マカオ	175,648.37	0.08
	バミューダ	104,811.00	0.05
	ジャージー	99,933.00	0.04
	小計	207,726,399.65	90.80
投資信託	ルクセンブルグ	2,816,997.21	1.23
モーゲージ担保証券 / 資産担保証券 / その他割引債	米国	7,594,685.05	3.32
投資有価証券合計		218,138,081.91	95.35
現金・その他の資産(負債控除後)		10,640,629.14	4.65
合計 (純資産総額)		228,778,711.05 (約27,943百万円)	100.00

(フルサイクル・アジア・ボンド(米ドル))

(2020年10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 (%)
債券	香港	82,245,523.67	17.16
	中国	76,286,902.00	15.92
	フィリピン	41,775,806.94	8.72
	シンガポール	36,223,830.47	7.56
	英領ヴァージン諸島	33,602,069.13	7.01
	ケイマン諸島	33,092,167.07	6.90
	インド	25,362,086.25	5.29
	タイ	18,971,928.50	3.96
	インドネシア	16,112,781.25	3.36
	韓国	12,046,476.28	2.51
	米国	10,473,997.43	2.19
	フランス	9,698,166.07	2.02
	マレーシア	7,359,602.52	1.54
	日本	6,198,897.25	1.29
	イギリス	6,140,775.00	1.28
	モーリシャス	4,230,616.27	0.88
	マカオ	3,782,074.18	0.79
	メキシコ	2,761,687.50	0.58
	カナダ	916,876.73	0.19
	オランダ	823,088.00	0.17
チリ	623,331.54	0.13	
スリランカ	341,307.75	0.07	
	小計	429,069,991.80	89.51
投資信託	ルクセンブルグ	20,204,662.20	4.22
投資有価証券合計		449,274,654.00	93.73
現金・その他の資産(負債控除後)		30,055,440.72	6.27
合計 (純資産総額)		479,330,094.72 (約50,138百万円)	100.00

（ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ））

（2020年10月末日現在）

資産の種類	国・地域名	時価合計 (ユーロ)	投資比率 (%)
債券	オランダ	182,225,842.69	11.09
	アメリカ合衆国	178,076,432.27	10.84
	フランス	172,179,991.44	10.48
	ドイツ	162,083,385.82	9.87
	イタリア	152,388,981.20	9.28
	イギリス	145,607,381.86	8.86
	ルクセンブルグ	136,149,435.18	8.29
	スペイン	52,062,478.30	3.17
	日本	52,043,475.61	3.17
	スウェーデン	47,847,741.06	2.91
	メキシコ	47,427,444.95	2.89
	カナダ	33,543,040.69	2.04
	デンマーク	30,618,606.37	1.86
	アイルランド	24,652,543.36	1.50
	ジャージー	19,646,050.02	1.20
	スロベニア	13,512,691.84	0.82
	ノルウェー	12,049,934.60	0.73
	ケイマン諸島	12,046,463.55	0.73
	英領ヴァージン諸島	7,648,918.75	0.47
	ポルトガル	7,582,801.20	0.46
	チェコ共和国	6,676,017.19	0.41
	シンガポール	6,149,984.78	0.37
	ルーマニア	5,529,937.50	0.34
	パナマ	5,317,983.50	0.32
	多国籍	5,129,420.80	0.31
	モーリシャス	3,910,656.30	0.24
小計	1,522,107,640.83	92.65	
投資信託	ルクセンブルグ	33,440,806.45	2.04
	アイルランド	1,445,004.10	0.09
	小計	34,885,810.55	2.12
投資有価証券合計		1,556,993,451.38	94.78
現金・その他の資産（負債控除後）		85,823,535.21	5.22
合計 （純資産総額）		1,642,816,986.59 (約200,654百万円)	100.00

(3) 運用実績

純資産の推移

純資産の推移については、以下の内容が原届出書に追加・更新されます。

2020年10月末日前1年以内における各月末の純資産の推移は、以下のとおりである。

(オーストラリア・ドル)

	純資産総額		1口当たり純資産価格		
	千豪ドル	百万円	受益証券の クラス	豪ドル	円
2019年11月末日	350,584	25,792	P - d i s t P - a c c	124.10 563.01	9,130 41,421
12月末日	348,812	25,662	P - d i s t P - a c c	121.93 553.17	8,970 40,697
2020年1月末日	346,483	25,491	P - d i s t P - a c c	124.88 566.58	9,187 41,683
2月末日	350,037	25,752	P - d i s t P - a c c	125.87 571.08	9,260 42,014
3月末日	341,436	25,119	P - d i s t P - a c c	124.80 566.20	9,182 41,655
4月末日	344,523	25,347	P - d i s t P - a c c	124.42 564.49	9,154 41,530
5月末日	344,547	25,348	P - d i s t P - a c c	125.01 567.18	9,197 41,727
6月末日	348,307	25,625	P - d i s t P - a c c	122.30 569.37	8,998 41,889
7月末日	355,465	26,152	P - d i s t P - a c c	122.90 572.16	9,042 42,094
8月末日	356,022	26,193	P - d i s t P - a c c	122.30 569.35	8,998 41,887
9月末日	361,605	26,603	P - d i s t P - a c c	123.61 575.46	9,094 42,337
10月末日	371,040	27,297	P - d i s t P - a c c	123.98 577.18	9,121 42,463

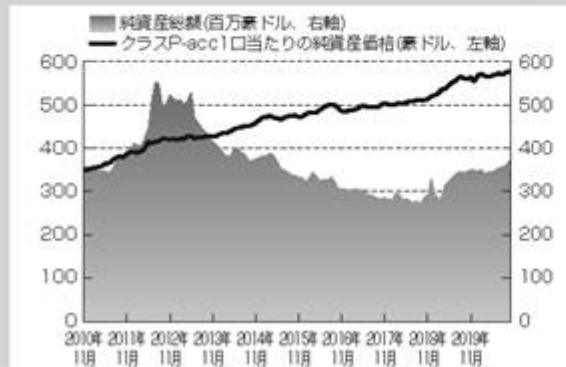
(注1) 1口当たりの純資産価格は、純資産価格の調整の結果、上記および財務書類に記載の価格と異なる場合がある。以下同じ。

(注2) 1口当たりの純資産価格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。

< 参考情報 >

純資産総額および1口当たりの純資産価格の推移

純資産総額 371,040千豪ドル
 クラスP-acc受益証券
 1口当たりの純資産価格 577.18豪ドル



純資産総額 (2020年10月末日現在) 371,040千豪ドル
 クラスP-dist受益証券
 1口当たりの純資産価格 123.98豪ドル



サブ・ファンドの運用実績は、あくまで過去の実績であり将来の運用成果を約束するものではない。

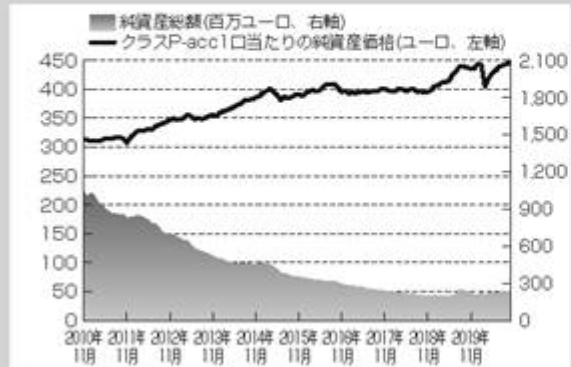
(ユーロ・フレキシブル)

	純資産総額		1口当たり純資産価格		
	千ユーロ	百万円	受益証券の クラス	ユーロ	円
2019年11月末日	215,108	26,273	P - d i s t	142.87	17,450
			P - a c c	435.97	53,249
12月末日	207,036	25,287	P - d i s t	142.58	17,415
			P - a c c	435.09	53,142
2020年1月末日	204,965	25,034	P - d i s t	145.53	17,775
			P - a c c	444.11	54,244
2月末日	222,872	27,222	P - d i s t	144.83	17,690
			P - a c c	441.96	53,981
3月末日	202,291	24,708	P - d i s t	132.57	16,192
			P - a c c	404.54	49,411
4月末日	214,999	26,260	P - d i s t	137.22	16,760
			P - a c c	418.73	51,144
5月末日	225,555	27,549	P - d i s t	140.08	17,109
			P - a c c	427.45	52,209
6月末日	227,181	27,748	P - d i s t	139.15	16,996
			P - a c c	432.08	52,774
7月末日	226,273	27,637	P - d i s t	141.32	17,261
			P - a c c	438.82	53,597
8月末日	230,247	28,122	P - d i s t	142.16	17,363
			P - a c c	441.42	53,915
9月末日	231,052	28,221	P - d i s t	142.80	17,442
			P - a c c	443.41	54,158
10月末日	228,779	27,943	P - d i s t	144.16	17,608
			P - a c c	447.64	54,675

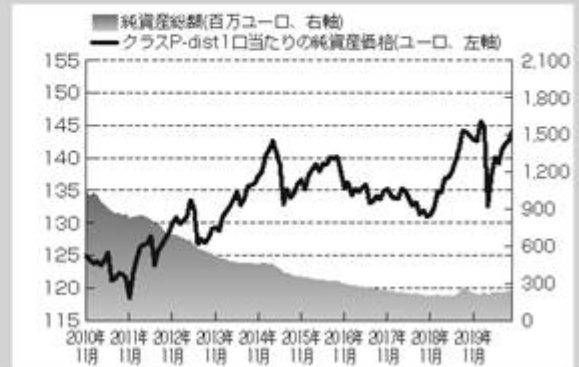
< 参考情報 >

純資産総額および1口当たりの純資産価格の推移

純資産総額 228,779千ユーロ
 クラスP-acc受益証券
 1口当たりの純資産価格 447.64ユーロ



純資産総額 (2020年10月末日現在) 228,779千ユーロ
 クラスP-dist受益証券
 1口当たりの純資産価格 144.16ユーロ



サブ・ファンドの運用実績は、あくまで過去の実績であり将来の運用成果を約束するものではない。

(フルサイクル・アジア・ボンド(米ドル))

	純資産総額		1口当たり純資産価格		
	千米ドル	百万円	受益証券の クラス	米ドル	円
2019年11月末日	240,109	25,115	P - a c c	157.32	16,456
12月末日	254,615	26,633	P - a c c	158.02	16,529
2020年1月末日	256,032	26,781	P - a c c	159.66	16,700
2月末日	279,774	29,264	P - a c c	162.54	17,002
3月末日	239,902	25,094	P - a c c	153.78	16,085
4月末日	246,022	25,734	P - a c c	156.18	16,336
5月末日	272,890	28,544	P - a c c	159.56	16,690
6月末日	286,186	29,935	P - a c c	161.85	16,930
7月末日	304,344	31,834	P - a c c	165.14	17,274
8月末日	309,630	32,387	P - a c c	165.14	17,274
9月末日	321,290	33,607	P - a c c	164.30	17,186
10月末日	479,330	50,138	P - a c c	165.08	17,267

< 参考情報 >

純資産総額および1口当たりの純資産価格の推移



サブ・ファンドの運用実績は、あくまで過去の実績であり将来の運用成果を約束するものではない。

(ユーロ・ハイ・イールド(ユーロ))

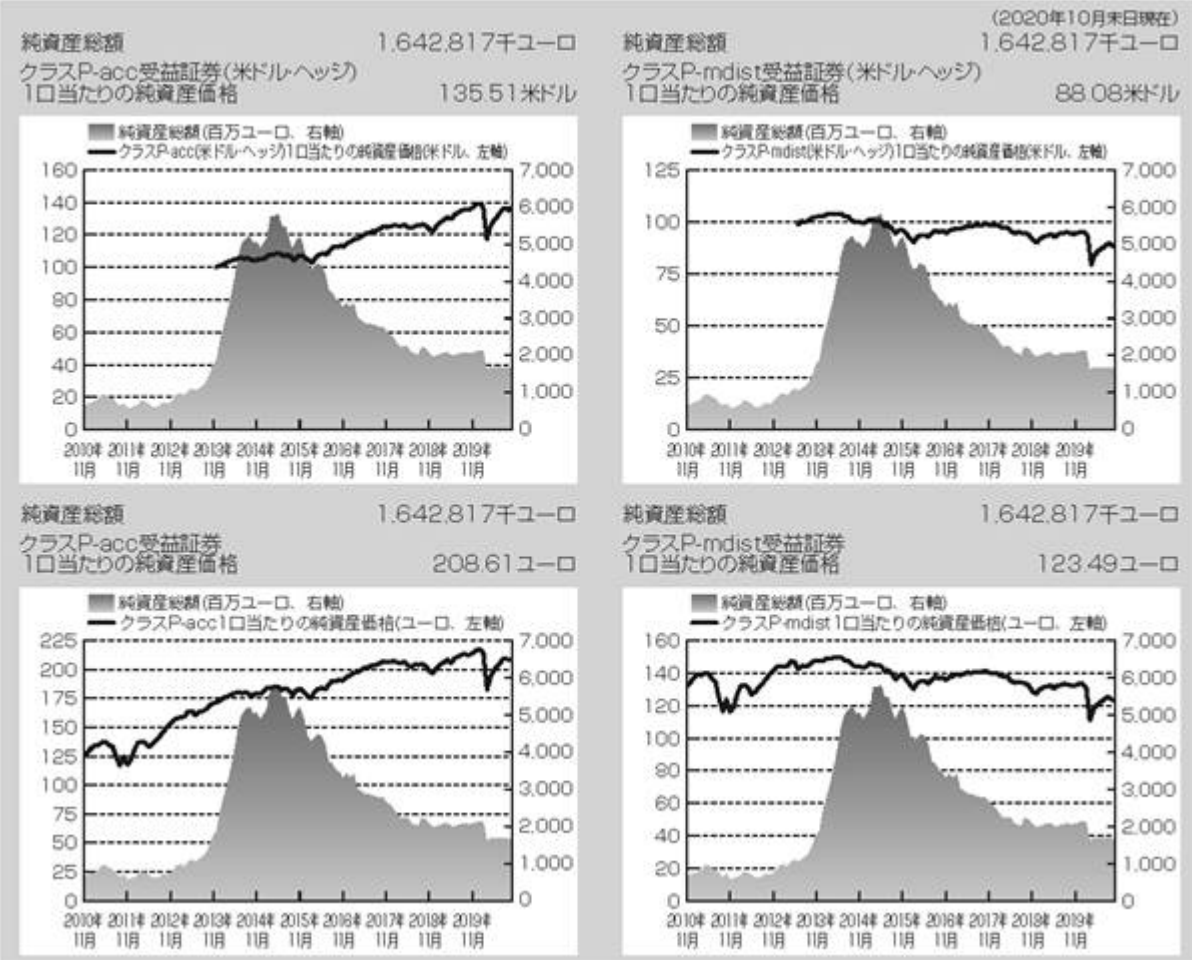
	純資産総額		1口当たり純資産価格		
	千ユーロ	百万円	受益証券の クラス		円
2019年11月末日	2,067,977	252,583	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	136.72米ドル	14,301
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	94.48米ドル	9,883
			P - a c c	214.27ユーロ	26,171
			P - m d i s t	132.55ユーロ	16,190
12月末日	2,094,717	255,849	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	138.57米ドル	14,494
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	95.23米ドル	9,961
			P - a c c	216.56ユーロ	26,451
			P - m d i s t	133.43ユーロ	16,297
2020年1月末日	2,134,796	260,744	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	139.46米ドル	14,588
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	95.31米ドル	9,969
			P - a c c	217.64ユーロ	26,583
			P - m d i s t	133.57ユーロ	16,314
2月末日	2,110,536	257,781	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	137.13米ドル	14,344
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	93.20米ドル	9,749
			P - a c c	213.69ユーロ	26,100
			P - m d i s t	130.62ユーロ	15,954
3月末日	1,597,049	195,064	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	117.54米ドル	12,295
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	79.39米ドル	8,304
			P - a c c	182.68ユーロ	22,313
			P - m d i s t	111.15ユーロ	13,576
4月末日	1,664,597	203,314	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	125.25米ドル	13,101
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	84.14米ドル	8,801
			P - a c c	194.42ユーロ	23,746
			P - m d i s t	117.84ユーロ	14,393
5月末日	1,676,439	204,760	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	129.06米ドル	13,500
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	86.18米ドル	9,014
			P - a c c	200.01ユーロ	24,429
			P - m d i s t	120.71ユーロ	14,744

	純資産総額		1口当たり純資産価格		
	千ユーロ	百万円	受益証券の クラス		円
6月末日	1,683,649	205,641	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	131.34米ドル	13,738
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	87.20米ドル	9,121
			P - a c c	203.29ユーロ	24,830
			P - m d i s t	122.19ユーロ	14,924
7月末日	1,680,302	205,232	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	134.47米ドル	14,066
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	88.81米ドル	9,290
			P - a c c	207.36ユーロ	25,327
			P - m d i s t	124.16ユーロ	15,165
8月末日	1,680,705	205,281	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	136.56米ドル	14,284
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	89.71米ドル	9,384
			P - a c c	210.33ユーロ	25,690
			P - m d i s t	125.46ユーロ	15,324
9月末日	1,662,602	203,070	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	135.16米ドル	14,138
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	88.32米ドル	9,238
			P - a c c	208.18ユーロ	25,427
			P - m d i s t	123.71ユーロ	15,110
10月末日	1,642,817	200,654	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	135.51米ドル	14,174
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	88.08米ドル	9,213
			P - a c c	208.61ユーロ	25,480
			P - m d i s t	123.49ユーロ	15,083

(注) クラスP - a c c受益証券(米ドル・ヘッジ)は2013年11月27日に、クラスP - m d i s t受益証券(米ドル・ヘッジ)は2013年6月11日に、クラスP - m d i s t受益証券は2009年7月2日に、それぞれ運用を開始した。

< 参考情報 >

純資産総額および1口当たりの純資産価格の推移



サブ・ファンドの運用実績は、あくまで過去の実績であり将来の運用成果を約束するものではない。

分配の推移

分配の推移については、以下の内容が原届出書に追加されます。

(オーストラリア・ドル) (クラスP - d i s t 受益証券)

期間	1口当たりの分配金額(豪ドル)
第31会計年度	3.18 (約234円)

(ユーロ・フレキシブル) (クラスP - d i s t 受益証券)

期間	1口当たりの分配金額(ユーロ)
第31会計年度	2.42 (約296円)

(注1) 分配金のデータは、税引前の数値である。以下同じ。

(注2) 上記の分配金は、年次決算の終了時に決定された金額である。

(ユーロ・ハイ・イールド(ユーロ))(クラスP - m d i s t 受益証券(米ドル・ヘッジ))

期間	1口当たりの分配金額(米ドル)
2019年10月	0.53 (約55円)
11月	0.53 (約55円)
12月	0.53 (約55円)
2020年1月	0.53 (約55円)
2月	0.53 (約55円)
3月	0.45 (約47円)
4月	0.50 (約52円)
5月	0.50 (約52円)
6月	0.47 (約49円)
7月	0.47 (約49円)
8月	0.48 (約50円)
9月	0.47 (約49円)
直近1年累計	5.99 (約627円)
設定来累計	46.22 (約4,835円)

(注)上記の分配金は、各月に宣言された金額である。

(ユーロ・ハイ・イールド(ユーロ))(クラスP - m d i s t 受益証券)

期間	1口当たりの分配金額(ユーロ)
2019年10月	0.53 (約65円)
11月	0.53 (約65円)
12月	0.53 (約65円)
2020年1月	0.53 (約65円)
2月	0.53 (約65円)
3月	0.46 (約56円)
4月	0.50 (約61円)
5月	0.50 (約61円)
6月	0.47 (約57円)
7月	0.47 (約57円)
8月	0.48 (約59円)
9月	0.47 (約57円)
直近1年累計	6.00 (約733円)
設定来累計	90.18 (約11,015円)

(注)上記の分配金は、各月に宣言された金額である。

【収益率の推移】

収益率については、以下の内容が原届出書に追加されます。

2020年10月末日前1年間における収益率の推移は、以下のとおりである。

	収益率（％）（注1）	
	クラスP - d i s t 受益証券	クラスP - a c c 受益証券
（オーストラリア・ドル）	3.28	3.33
（ユーロ・フレキシブル）	2.21	2.29
（フルサイクル・アジア・ボンド （米ドル））	-	5.26

（ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ））

収益率（％）			
クラスP - a c c 受益証券 （米ドル・ヘッジ）	クラスP - m d i s t 受益証券 （米ドル・ヘッジ）	クラスP - a c c 受益証券	クラスP - m d i s t 受益証券
0.06	- 0.05	- 1.86	- 1.92

（注1）収益率（％）＝100×（a - b）／b

a = 2020年10月末日の1口当たり純資産価格（当該期間の分配金の合計額を加えた額）

b = 当該期間の直前の日の1口当たり純資産価格（分配額の額）。

（注2）「収益率」は日本で販売しているクラスのみ記載している。

(4) 販売及び買戻しの実績

販売及び買戻しの実績については、以下の内容が原届出書に追加されます。

2020年10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2020年10月末日現在の発行済口数は、以下のとおりである。

(オーストラリア・ドル)

	販売口数	買戻し口数	発行済口数
P - d i s t	146,906.0070 (0)	175,398.1630 (0)	719,178.3800 (3,956)
P - a c c	49,114.2010 (446.6190)	59,038.2970 (0)	292,120.5080 (2,124.6190)

(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。以下同じ。

(注2) 上記の期間中に、UBS(Lux)ボンド・ファンド-オーストラリア・ドルのP - a c c受益証券661口が海外から国内に移管された。

(ユーロ・フレキシブル)

	販売口数	買戻し口数	発行済口数
P - d i s t	15,624.1140 (0)	96,605.3760 (18,850)	317,541.1060 (854)
P - a c c	33,355.9800 (0)	41,449.3340 (0)	286,127.0390 (629.361)

(フルサイクル・アジア・ボンド(米ドル))

	販売口数	買戻し口数	発行済口数
P - a c c	237,298.9390 (0)	359,712.9410 (0)	289,244.8680 (14,958.110)

(ユーロ・ハイ・イールド(ユーロ))

	販売口数	買戻し口数	発行済口数
P - a c c (米ドル・ヘッジ)	419,150.4150 (19,703.4830)	477,134.8980 (1,500)	359,810.4460 (37,631.4830)
P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	736,654.9700 (144,247.7280)	1,185,563.1100 (7,979.0660)	3,205,704.3200 (155,747.7280)
P - a c c	236,362.7280 (20,712.3150)	672,551.5750 (8,202.2340)	977,131.7400 (30,389.8650)
P - m d i s t	228,911.9020 (0)	597,002.3820 (0)	1,006,518.2010 (4,000)

[次へ](#)

第3 ファンドの経理状況

1 財務諸表

以下の中間財務書類が追加されます。

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諸法令および一般に認められた会計原則に準拠して作成された原文の中間財務書類を翻訳したものである。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。

b. ファンドの原文の中間財務書類は、UBS(Lux)ボンド・ファンドおよび全てのサブ・ファンドにつき一括して作成されている。日本語の作成にあたっては関係するサブ・ファンドに関連する部分のみを翻訳している。なお、各サブ・ファンドには下記のクラス受益証券以外のクラス受益証券も存在するが、本書においては下記のクラス受益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。

1) - オーストラリア・ドル	クラスP - a c c 受益証券 クラスP - d i s t 受益証券
2) - ユーロ・フレキシブル	クラスP - a c c 受益証券 クラスP - d i s t 受益証券
3) - フルサイクル・アジア・ボンド(米ドル)	クラスP - a c c 受益証券
4) - ユーロ・ハイ・イールド(ユーロ)	クラスP - a c c 受益証券 クラスP - m d i s t 受益証券 クラスP - a c c (米ドル・ヘッジ) 受益証券 クラスP - m d i s t (米ドル・ヘッジ) 受益証券

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、オーストラリア・ドル、ユーロおよび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、それぞれ株式会社三菱UFJ銀行の2020年10月30日現在における対顧客電信売買相場の仲値(1オーストラリア・ドル=73.57円、1ユーロ=122.14円、1米ドル=104.60円)を使用して換算された円換算額が併記されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

(1) 資産及び負債の状況

UBS (Lux) ボンド・ファンド

純資産計算書

2020年9月30日現在

	UBS (Lux) ボンド・ファンド	
	結 合	
	ユーロ	千 円
資 産		
投資有価証券取得原価	3,279,317,379.28	400,535,825
投資有価証券未実現評価(損)益	(18,264,284.05)	(2,230,800)
投資有価証券合計(注1)	3,261,053,095.23	398,305,025
現金預金、要求払い預金および貯蓄預金	139,087,184.72 *	16,988,109
その他の流動資産(委託証拠金)	25,380,524.61	3,099,977
有価証券売却未収金(注1)	13,729,950.07	1,676,976
発行受益証券未収金	2,594,201.72	316,856
未収有価証券利息	33,600,831.91	4,104,006
流動資産に係る未収利息	67,697.93	8,269
配当金に係る未収金	32,660.64	3,989
その他の未収金	122,196.52	14,925
TBAモーゲージ・バック証券に係る 未実現(損)益(注1)	5,831.88	712
金融先物に係る未実現(損)益(注1)	574,979.16	70,228
為替予約契約に係る未実現(損)益(注1)	3,942,269.27	481,509
資産合計	3,480,191,423.66	425,070,580
負 債		
金融先物に係る未実現(損)益(注1)	(26,262.64)	(3,208)
為替予約契約に係る未実現(損)益(注1)	3,053,170.26	372,914
スワップに係る未実現(損)益(注1)	(13,117,619.30)	(1,602,186)
当座借越	(10,782,387.33)	(1,316,961)
その他の流動負債(委託証拠金)	(1,792,280.75)	(218,909)
当座借越に係る未払利息	(39,049.00)	(4,769)
有価証券購入未払金(注1)	(14,982,262.63)	(1,829,934)
買戻受益証券未払金	(5,108,939.12)	(624,006)
報酬引当金(注2)	(1,102,775.98)	(134,693)
年次税引当金(注3)	(303,331.74)	(37,049)
その他の手数料および報酬に係る引当金(注2)	(513,894.51)	(62,767)
引当金合計	(1,920,002.23)	(234,509)
負債合計	(50,821,973.26)	(6,207,396)
期末現在純資産額	3,429,369,450.40	418,863,185

* 2020年9月30日現在、670,000.00ユーロの現金が取引相手方であるゴールドマン・サックスに対する担保、1,336,000.00ユーロの現金が取引相手方であるJPモルガンに対する担保、530,000.00ユーロの現金が取引相手方であるモルガン・スタンレー・ロンドンに対する担保、770,000.00ユーロの現金が取引相手方であるバンク・オブ・アメリカに対する担保および330,000.00ユーロの現金が取引相手方であるシティバンクに対する担保となっている。

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ボンド・ファンド

純資産計算書

2020年9月30日現在

UBS (Lux) ボンド・ファンド

- オーストラリア・ドル

オーストラリア・ドル 千円

	オーストラリア・ドル	千円
資 産		
投資有価証券取得原価	339,248,991.88	24,958,548
投資有価証券未実現評価(損)益	16,236,686.62	1,194,533
投資有価証券合計(注1)	355,485,678.50	26,153,081
現金預金、要求払い預金および貯蓄預金	3,197,252.19	235,222
その他の流動資産(委託証拠金)	181,863.72	13,380
発行受益証券未収金	378,873.00	27,874
未収有価証券利息	2,502,357.12	184,098
流動資産に係る未収利息	95,853.46	7,052
金融先物に係る未実現(損)益(注1)	323,398.88	23,792
資産合計	362,165,276.87	26,644,499
負 債		
買戻受益証券未払金	(411,350.73)	(30,263)
報酬引当金(注2)	(98,249.13)	(7,228)
年次税引当金(注3)	(40,637.06)	(2,990)
その他の手数料および報酬に係る引当金(注2)	(9,565.78)	(704)
引当金合計	(148,451.97)	(10,922)
負債合計	(559,802.70)	(41,185)
期末現在純資産額	361,605,474.17	26,603,315

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS(Lux) ボンド・ファンド

純資産計算書

2020年9月30日現在

UBS(Lux) ボンド・ファンド

- ユーロ・フレキシブル

ユーロ 千円

資産	ユーロ	千円
投資有価証券取得原価	202,964,725.13	24,790,112
投資有価証券未実現評価(損)益	14,080,560.29	1,719,800
投資有価証券合計(注1)	217,045,285.42	26,509,911
現金預金、要求払い預金および貯蓄預金	13,307,578.58 *	1,625,388
その他の流動資産(委託証拠金)	13,509,803.78	1,650,087
有価証券売却未収金(注1)	627.98	77
発行受益証券未収金	140,553.54	17,167
未収有価証券利息	1,610,472.64	196,703
流動資産にかかる未収利息	69.12	8
金融先物に係る未実現(損)益(注1)	28,511.31	3,482
資産合計	245,642,902.37	30,002,824
負債		
為替予約契約に係る未実現(損)益(注1)	(573,312.35)	(70,024)
スワップに係る未実現(損)益(注1)	(6,815,930.46)	(832,498)
当座借越	(4,968,199.04)	(606,816)
その他の短期負債(委託証拠金)	(1,792,280.75)	(218,909)
有価証券購入未払金(注1)	(99,819.49)	(12,192)
買戻受益証券未払金	(236,377.96)	(28,871)
報酬引当金(注2)	(75,634.21)	(9,238)
年次税引当金(注3)	(27,302.42)	(3,335)
その他の手数料および報酬に係る引当金(注2)	(2,180.63)	(266)
引当金合計	(105,117.26)	(12,839)
負債合計	(14,591,037.31)	(1,782,149)
期末現在純資産額	231,051,865.06	28,220,675

* 2020年9月30日現在、956,000.00ユーロの現金が取引相手方であるJPモルガンに対する担保、410,000.00ユーロの現金が取引相手方であるバンク・オブ・アメリカに対する担保および330,000.00ユーロの現金が取引相手方であるシティバンクに対する担保となっている。

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ボンド・ファンド

純資産計算書

2020年9月30日現在

UBS (Lux) ボンド・ファンド
- フルサイクル・アジア・ボンド
(米ドル)

	米ドル	千円
資 産		
投資有価証券取得原価	306,076,640.41	32,015,617
投資有価証券未実現評価(損)益	8,802,182.76	920,708
投資有価証券合計(注1)	314,878,823.17	32,936,325
現金預金、要求払い預金および貯蓄預金	6,619,767.79	692,428
その他の流動資産(委託証拠金)	458,241.61	47,932
有価証券売却未収金(注1)	2,309,724.69	241,597
発行受益証券未収金	1,168,182.35	122,192
未収有価証券利息	2,648,337.95	277,016
その他の未収金	31,717.59	3,318
為替予約契約に係る未実現(損)益(注1)	33,910.49	3,547
資産合計	328,148,705.64	34,324,355
負 債		
金融先物に係る未実現(損)益(注1)	(30,796.88)	(3,221)
当座借越に係る未払利息	(24.34)	(3)
有価証券購入未払金(注1)	(4,964,600.00)	(519,297)
買戻受益証券未払金	(1,706,673.45)	(178,518)
報酬引当金(注2)	(107,013.33)	(11,194)
年次税引当金(注3)	(22,963.23)	(2,402)
その他の手数料および報酬に係る引当金(注2)	(26,995.98)	(2,824)
引当金合計	(156,972.54)	(16,419)
負債合計	(6,859,067.21)	(717,458)
期末現在純資産額	321,289,638.43	33,606,896

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS(Lux)ボンド・ファンド

純資産計算書

2020年9月30日現在

	UBS(Lux)ボンド・ファンド	
	- ユーロ・ハイ・イールド(ユーロ)	
	ユーロ	千円
資 産		
投資有価証券取得原価	1,584,360,697.33	193,513,816
投資有価証券未実現評価(損)益	(24,846,752.93)	(3,034,782)
投資有価証券合計(注1)	1,559,513,944.40	190,479,033
現金預金、要求払い預金および貯蓄預金	67,649,322.61 *	8,262,688
その他の流動資産(委託証拠金)	310,776.71	37,958
有価証券売却未収金(注1)	10,824,667.55	1,322,125
発行受益証券未収金	924,367.83	112,902
未収有価証券利息	23,479,924.42	2,867,838
流動資産にかかる未収利息	3,781.44	462
配当金に係る未収金	32,660.64	3,989
金融先物に係る未実現(損)益(注1)	296,996.64	36,275
為替予約契約に係る未実現(損)益(注1)	3,913,351.44	477,977
資産合計	1,666,949,793.68	203,601,248
負 債		
スワップに係る未実現(損)益(注1)	(896,256.00)	(109,469)
当座借越	(32.26)	(4)
当座借越に係る未払利息	(34,014.87)	(4,155)
買戻受益証券未払金	(2,300,243.30)	(280,952)
報酬引当金(注2)	(620,118.60)	(75,741)
年次税引当金(注3)	(156,594.57)	(19,126)
その他の手数料および報酬に係る引当金(注2)	(340,747.88)	(41,619)
引当金合計	(1,117,461.05)	(136,487)
負債合計	(4,348,007.48)	(531,066)
期末現在純資産額	1,662,601,786.20	203,070,182

* 2020年9月30日現在、670,000.00ユーロの現金が取引相手方であるゴールドマン・サックスに対する担保および530,000.00ユーロの現金が取引相手方であるモルガン・スタンレー・ロンドンに対する担保となっている。

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ボンド・ファンド
運 用 計 算 書
自2020年4月1日 至2020年9月30日

	UBS (Lux) ボンド・ファンド	
	結 合	
	ユーロ	千 円
収 益		
流動資産に係る利息	231,033.56	28,218
有価証券に係る利息	52,126,491.22	6,366,730
配当金	288.84	35
スワップに係る受取利息(注1)	5,123,441.26	625,777
貸付有価証券に係る収益(注10)	153,260.95	18,719
その他の収益	3,296,571.84	402,643
収益合計	60,931,087.67	7,442,123
費 用		
スワップに係る支払利息(注1)	(3,493,422.41)	(426,687)
貸付有価証券に係るコスト(注10)	(61,304.38)	(7,488)
報酬(注2)	(13,373,602.47)	(1,633,452)
年次税(注3)	(604,162.30)	(73,792)
その他の手数料および報酬(注2)	(311,847.81)	(38,089)
現金および当座借越に係る利息	(387,734.40)	(47,358)
費用合計	(18,232,073.77)	(2,226,865)
投資に係る純(損)益	42,699,013.90	5,215,258
実現(損)益(注1)		
オプション無し時価評価		
有価証券に係る実現(損)益	(43,669,979.14)	(5,333,851)
オプションに係る実現(損)益	(1,430,000.00)	(174,660)
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	(1,001,400.54)	(122,311)
金融先物に係る実現(損)益	1,077,304.39	131,582
為替予約契約に係る実現(損)益	477,392.61	58,309
スワップに係る実現(損)益	7,795,233.15	952,110
外国為替に係る実現(損)益	(5,543,023.90)	(677,025)
実現(損)益合計	(42,294,473.43)	(5,165,847)
当期実現純(損)益	404,540.47	49,411
未実現評価(損)益の変動(注1)		
オプション無し時価評価		
有価証券に係る未実現評価(損)益	327,140,990.47	39,957,001
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	771,234.36	94,199
TBAモーゲージ・バック証券に係る		
未実現評価(損)益	(22,204.56)	(2,712)
金融先物に係る未実現評価(損)益	(1,392,311.69)	(170,057)
為替予約契約に係る未実現評価(損)益	(7,912,875.64)	(966,479)
スワップに係る未実現評価(損)益	(4,242,864.08)	(518,223)
未実現評価(損)益の変動合計	314,341,968.86	38,393,728
運用の結果による純資産の純増(減)	314,746,509.33	38,443,139

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ボンド・ファンド
運用計算書
自2020年4月1日 至2020年9月30日

UBS (Lux) ボンド・ファンド
- オーストラリア・ドル
オーストラリア・ドル 千 円

収 益		
流動資産に係る利息	95,853.46	7,052
有価証券に係る利息	4,865,770.87	357,975
貸付有価証券に係る収益(注10)	7,259.87	534
その他の収益	51,434.51	3,784
収益合計	5,020,318.71	369,345
費 用		
貸付有価証券に係るコスト(注10)	(2,903.95)	(214)
報酬(注2)	(1,204,169.86)	(88,591)
年次税(注3)	(78,347.62)	(5,764)
その他の手数料および報酬(注2)	(32,354.59)	(2,380)
費用合計	(1,317,776.02)	(96,949)
投資に係る純(損)益	3,702,542.69	272,396
実現(損)益(注1)		
オプション無し時価評価		
有価証券に係る実現(損)益	1,694,142.18	124,638
金融先物に係る実現(損)益	(626,127.30)	(46,064)
外国為替に係る実現損益	2,516.02	185
実現(損)益合計	1,070,530.90	78,759
当期実現純(損)益	4,773,073.59	351,155
未実現評価(損)益の変動(注1)		
オプション無し時価評価		
有価証券に係る未実現評価(損)益	873,401.97	64,256
金融先物に係る未実現評価(損)益	369,722.63	27,200
未実現評価(損)益の変動合計	1,243,124.60	91,457
運用の結果による純資産の純増(減)	6,016,198.19	442,612

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ボンド・ファンド
運用計算書
自2020年4月1日 至2020年9月30日

UBS (Lux) ボンド・ファンド
- ユーロ・フレキシブル
ユーロ 千円

収 益		
流動資産に係る利息	149,137.01	18,216
有価証券に係る利息	2,497,832.88	305,085
スワップに係る受取利息(注1)	1,918,742.83	234,355
貸付有価証券に係る収益(注10)	52,770.20	6,445
その他の収益	67,860.38	8,288
収益合計	4,686,343.30	572,390
費 用		
スワップに係る支払利息(注1)	(1,458,024.53)	(178,083)
貸付有価証券に係るコスト(注10)	(21,108.08)	(2,578)
報酬(注2)	(894,750.89)	(109,285)
年次税(注3)	(54,086.96)	(6,606)
その他の手数料および報酬(注2)	(20,696.08)	(2,528)
現金および当座借越に係る利息	(190,213.18)	(23,233)
費用合計	(2,638,879.72)	(322,313)
投資に係る純(損)益	2,047,463.58	250,077
実現(損)益(注1)		
オプション無し時価評価		
有価証券に係る実現(損)益	93,679.36	11,442
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	(8,158.17)	(996)
金融先物に係る実現(損)益	(670,630.32)	(81,911)
為替予約契約に係る実現(損)益	1,033,958.65	126,288
スワップに係る実現(損)益	5,139,486.55	627,737
外国為替に係る実現(損)益	1,428,356.67	174,459
実現(損)益合計	7,016,692.74	857,019
当期実現純(損)益	9,064,156.32	1,107,096
未実現評価(損)益の変動(注1)		
オプション無し時価評価		
有価証券に係る未実現評価(損)益	15,641,615.91	1,910,467
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	(19,095.87)	(2,332)
金融先物に係る未実現評価(損)益	504,976.54	61,678
為替予約契約に係る未実現評価(損)益	(1,201,768.90)	(146,784)
スワップに係る未実現評価(損)益	(3,677,967.98)	(449,227)
未実現評価(損)益の変動合計	11,247,759.70	1,373,801
運用の結果による純資産の純増(減)	20,311,916.02	2,480,897

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S (Lux) ボンド・ファンド
運 用 計 算 書
自2020年4月1日 至2020年9月30日

U B S (Lux) ボンド・ファンド
- フルサイクル・アジア・ボンド
(米ドル)

	米ドル	千 円
収 益		
流動資産に係る利息	802.57	84
有価証券に係る利息	5,278,879.75	552,171
貸付有価証券に係る収益(注10)	22,988.75	2,405
その他の収益	272,948.90	28,550
収益合計	5,575,619.97	583,210
費 用		
貸付有価証券に係るコスト(注10)	(9,195.50)	(962)
報酬(注2)	(1,187,907.18)	(124,255)
年次税(注3)	(43,828.22)	(4,584)
その他の手数料および報酬(注2)	(26,165.68)	(2,737)
現金および当座借越に係る利息	(1,399.50)	(146)
費用合計	(1,268,496.08)	(132,685)
投資に係る純(損)益	4,307,123.89	450,525
実現(損)益(注1)		
オプション無し時価評価		
有価証券に係る実現(損)益	(499,209.03)	(52,217)
金融先物に係る実現(損)益	(680,868.04)	(71,219)
為替予約契約に係る実現(損)益	2,213,630.26	231,546
外国為替に係る実現(損)益	(642,091.63)	(67,163)
実現(損)益合計	391,461.56	40,947
当期実現純(損)益	4,698,585.45	491,472
未実現評価(損)益の変動(注1)		
オプション無し時価評価		
有価証券に係る未実現評価(損)益	17,069,768.12	1,785,498
金融先物に係る未実現評価(損)益	4,239.06	443
為替予約契約に係る未実現評価(損)益	271,713.76	28,421
未実現評価(損)益の変動合計	17,345,720.94	1,814,362
運用の結果による純資産の純増(減)	22,044,306.39	2,305,834

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ボンド・ファンド
運 用 計 算 書
自2020年4月1日 至2020年9月30日

	UBS (Lux) ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド(ユーロ)	
	ユーロ	千 円
収 益		
流動資産に係る利息	6,309.90	771
有価証券に係る利息	34,311,286.30	4,190,781
スワップに係る受取利息(注1)	588,620.84	71,894
その他の収益	1,909,454.33	233,221
収益合計	36,815,671.37	4,496,666
費 用		
スワップに係る支払利息(注1)	(65,060.96)	(7,947)
報酬(注2)	(7,605,838.45)	(928,977)
年次税(注3)	(315,398.37)	(38,523)
その他の手数料および報酬(注2)	(155,486.65)	(18,991)
現金および当座借越に係る利息	(92,739.28)	(11,327)
費用合計	(8,234,523.71)	(1,005,765)
投資に係る純(損)益	28,581,147.66	3,490,901
実現(損)益(注1)		
オプション無し時価評価		
有価証券に係る実現(損)益	(45,818,324.10)	(5,596,250)
オプションに係る実現(損)益	(1,430,000.00)	(174,660)
金融先物に係る実現(損)益	3,326,833.33	406,339
為替予約契約に係る実現(損)益	(7,707,316.32)	(941,372)
スワップに係る実現(損)益	(2,661,269.73)	(325,047)
外国為替に係る実現(損)益	(8,310,292.76)	(1,015,019)
実現(損)益合計	(62,600,369.58)	(7,646,009)
当期実現純(損)益	(34,019,221.92)	(4,155,108)
未実現評価(損)益の変動(注1)		
オプション無し時価評価		
有価証券に係る未実現評価(損)益	232,398,824.26	28,385,192
金融先物に係る未実現(損)益	(2,775,649.25)	(339,018)
為替予約契約に係る未実現評価(損)益	(4,398,591.17)	(537,244)
スワップに係る未実現評価(損)益	3,421,377.51	417,887
未実現評価(損)益の変動合計	228,645,961.35	27,926,818
運用の結果による純資産の純増(減)	194,626,739.43	23,771,710

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ボンド・ファンド
純資産変動計算書
自2020年4月1日至2020年9月30日

	UBS (Lux) ボンド・ファンド	
	結 合	
	ユーロ	千 円
期首現在純資産額	3,209,816,541.06 *	392,046,992
受益証券発行	477,483,627.76	58,319,850
受益証券買戻し	(539,963,114.50)	(65,951,095)
受益証券発行(買戻し)純額合計	(62,479,486.74)	(7,631,245)
支払分配金	(32,714,113.25)	(3,995,702)
純投資(損)益	42,699,013.90	5,215,258
実現(損)益合計	(42,294,473.43)	(5,165,847)
未実現評価(損)益の変動合計	314,341,968.86	38,393,728
運用の結果による純資産の純増(減)	314,746,509.33	38,443,139
期末現在純資産額	3,429,369,450.40	418,863,185

* 2020年9月30日の為替レートを使用して計算された。2020年3月31日の為替レートを使用して計算された当期の期首現在純資産額は、3,214,017,655.08ユーロであった。

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ボンド・ファンド
純資産変動計算書
自2020年4月1日至2020年9月30日

	UBS (Lux) ボンド・ファンド - オーストラリア・ドル	
	オーストラリア・ドル	千円
期首現在純資産額	341,435,681.63	25,119,423
受益証券発行	87,395,630.16	6,429,697
受益証券買戻し	(70,722,188.28)	(5,203,031)
受益証券発行(買戻し)純額合計	16,673,441.88	1,226,665
支払分配金	(2,519,847.53)	(185,385)
純投資(損)益	3,702,542.69	272,396
実現(損)益合計	1,070,530.90	78,759
未実現評価(損)益の変動合計	1,243,124.60	91,457
運用の結果による純資産の純増(減)	6,016,198.19	442,612
期末現在純資産額	361,605,474.17	26,603,315

発行済受益証券数の変動

自2020年4月1日至2020年9月30日

クラス	P-acc	P-dist
期首現在発行済受益証券数	287,487.7960	764,457.5380
発行受益証券数	34,813.0250	64,444.8490
買戻受益証券数	(29,867.5460)	(98,459.9340)
期末現在発行済受益証券数	292,433.2750	730,442.4530

年次分配金¹

UBS (Lux) ボンド・ファンド - オーストラリア・ドル

	権利落ち日	支払日	通貨	1口当たり金額
P-dist	2020年6月2日	2020年6月5日	オーストラリア・ドル	3.18

¹ 注記4を参照のこと。

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ボンド・ファンド
純資産変動計算書
自2020年4月1日 至2020年9月30日

	UBS (Lux) ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル	
	ユーロ	千 円
期首現在純資産額	202,290,809.89	24,707,800
受益証券発行	28,454,456.56	3,475,427
受益証券買戻し	(19,158,291.53)	(2,339,994)
受益証券発行(買戻し)純額合計	9,296,165.03	1,135,434
支払分配金	(847,025.88)	(103,456)
純投資(損)益	2,047,463.58	250,077
実現(損)益合計	7,016,692.74	857,019
未実現評価(損)益の変動合計	11,247,759.70	1,373,801
運用の結果による純資産の純増(減)	20,311,916.02	2,480,897
期末現在純資産額	231,051,865.06	28,220,675

発行済受益証券数の変動

自2020年4月1日 至2020年9月30日

クラス	P-acc	P-dist
期首現在発行済受益証券数	287,108.4080	329,176.9000
発行受益証券数	13,236.0030	6,094.7900
買戻受益証券数	(14,768.3710)	(15,510.7140)
期末現在発行済受益証券数	285,576.0400	319,760.9760

年次分配金¹

UBS (Lux) ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル

	権利落ち日	支払日	通貨	1口当たり金額
P-dist	2020年6月2日	2020年6月5日	ユーロ	2.42

四半期毎分配金¹

UBS (Lux) ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル

	権利落ち日	支払日	通貨	1口当たり金額
--	-------	-----	----	---------

該当なし。

¹ 注記4を参照のこと。

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS（Lux）ボンド・ファンド
純資産変動計算書
自2020年4月1日至2020年9月30日

	UBS（Lux）ボンド・ファンド - フルサイクル・アジア・ボンド (米ドル)	
	米ドル	千円
期首現在純資産額	239,902,499.64	25,093,801
受益証券発行	122,855,825.82	12,850,719
受益証券買戻し	(61,960,531.28)	(6,481,072)
受益証券発行（買戻し）純額合計	60,895,294.54	6,369,648
支払分配金	(1,552,462.14)	(162,388)
純投資（損）益	4,307,123.89	450,525
実現（損）益合計	391,461.56	40,947
未実現評価（損）益の変動合計	17,345,720.94	1,814,362
運用の結果による純資産の純増（減）	22,044,306.39	2,305,834
期末現在純資産額	321,289,638.43	33,606,896

発行済受益証券数の変動
自2020年4月1日至2020年9月30日

クラス	P-acc
期首現在発行済受益証券数	308,150.1680
発行受益証券数	88,737.0020
買戻受益証券数	(112,631.7370)
期末現在発行済受益証券数	284,255.4330

年次分配金¹

UBS（Lux）ボンド・ファンド - フルサイクル・アジア・ボンド（米ドル）			
権利落ち日	支払日	通貨	1口当たり金額
該当なし。			

月次分配金¹

UBS（Lux）ボンド・ファンド - フルサイクル・アジア・ボンド（米ドル）			
権利落ち日	支払日	通貨	1口当たり金額
該当なし。			

¹ 注記4を参照のこと。

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ボンド・ファンド
純資産変動計算書
自2020年4月1日 至2020年9月30日

	UBS (Lux) ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド(ユーロ)	
	ユーロ	千円
期首現在純資産額	1,597,048,818.93	195,063,543
受益証券発行	175,048,336.08	21,380,404
受益証券買戻し	(280,027,693.00)	(34,202,582)
受益証券発行(買戻し)純額合計	(104,979,356.92)	(12,822,179)
支払分配金	(24,094,415.24)	(2,942,892)
純投資(損)益	28,581,147.66	3,490,901
実現(損)益合計	(62,600,369.58)	(7,646,009)
未実現評価(損)益の変動合計	228,645,961.35	27,926,818
運用の結果による純資産の純増(減)	194,626,739.43	23,771,710
期末現在純資産額	1,662,601,786.20	203,070,182

発行済受益証券数の変動
自2020年4月1日 至2020年9月30日

クラス	(米ドル・ヘッジ)		(米ドル・ヘッジ)	
	P-acc	P-acc	P-mdist	P-mdist
期首現在発行済受益証券数	1,089,353.0640	345,389.5480	1,081,839.6340	3,282,339.2430
発行受益証券数	60,806.2020	144,478.6100	80,156.3090	220,880.2850
買戻受益証券数	(147,999.9120)	(129,164.0030)	(141,219.9860)	(261,345.7180)
期末現在発行済受益証券数	1,002,159.3540	360,704.1550	1,020,775.9570	3,241,873.8100

年次分配金¹

UBS (Lux) ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド(ユーロ)

	権利落ち日	支払日	通貨	1口当たり金額
該当なし。				

月次分配金¹

UBS (Lux) ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド(ユーロ)

	権利落ち日	支払日	通貨	1口当たり金額
P-mdist	2020年4月15日	2020年4月20日	ユーロ	0.46
P-mdist	2020年5月15日	2020年5月20日	ユーロ	0.50
P-mdist	2020年6月15日	2020年6月18日	ユーロ	0.50
P-mdist	2020年7月15日	2020年7月20日	ユーロ	0.47
P-mdist	2020年8月17日	2020年8月20日	ユーロ	0.47
P-mdist	2020年9月15日	2020年9月18日	ユーロ	0.48
(米ドル・ヘッジ)P-mdist	2020年4月15日	2020年4月20日	米ドル	0.45
(米ドル・ヘッジ)P-mdist	2020年5月15日	2020年5月20日	米ドル	0.50
(米ドル・ヘッジ)P-mdist	2020年6月15日	2020年6月18日	米ドル	0.50
(米ドル・ヘッジ)P-mdist	2020年7月15日	2020年7月20日	米ドル	0.47
(米ドル・ヘッジ)P-mdist	2020年8月17日	2020年8月20日	米ドル	0.47
(米ドル・ヘッジ)P-mdist	2020年9月15日	2020年9月18日	米ドル	0.48

¹ 注記4を参照のこと。

注記は、財務書類と不可分のものである。

財務書類に対する注記

注1．重要な会計方針の概要

当財務書類は、投資信託としてルクセンブルグで一般に公認されている会計原則に従って作成されている。重要な会計方針の概要は、以下のとおりである。

a) 純資産価格の計算

サブ・ファンドまたはクラス受益証券1口当たりの純資産価格、発行価格および買戻価格は、サブ・ファンドまたは受益証券クラスの勘定通貨で表示され、毎ファンド営業日に、クラス受益証券がそれぞれに帰属する各サブ・ファンドの純資産総額を当該サブ・ファンドの各クラス受益証券の流通している受益証券口数で除することにより決定される。

「営業日」とは、12月24日および31日、ルクセンブルグにおける個々の法定外休日ならびに各サブ・ファンドが投資する主要各国の証券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を除く、ルクセンブルグにおける通常の銀行営業日（即ち、銀行が通常の営業時間に営業を行っている日）である。

各サブ・ファンドのクラス受益証券に帰属する純資産価額の割合は、かかるクラス受益証券に課せられる手数料を考慮して、各クラス受益証券の流通している受益証券とサブ・ファンドの流通している受益証券の総口数との比率により決定され、発行されまたは買い戻される毎に変動する。対象となるクラス受益証券に帰属する純資産価額は、受領額または支払額の分だけ増減することになる。

報酬および手数料、ならびに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かかる実際の費用は、最終利用可能価格または該当する場合には、受益証券1口当たり純資産価格の計算に使用される純資産価額と異なる場合がある。これらの費用は、サブ・ファンドの価値にマイナスの影響を与え、「希薄化」と呼ばれる。取締役会は、希薄化の影響を軽減するため、自らの裁量により、受益証券1口当たり純資産価格を希薄化調整（スウィング・プライシング）することができる。

受益証券は、単一の価格、すなわち受益証券1口当たり純資産価格に基づいて発行され、買い戻される。それにもかかわらず、希薄化の影響を軽減するために、受益証券1口当たり純資産価格は、以下に述べる評価日に調整される。これは、サブ・ファンドが該当する評価日において正味発行または正味買戻しポジションにあるかどうかにかかわらず行われる。特定の評価日にサブ・ファンドまたはサブ・ファンドのクラスで取引が行われていない場合には、未調整の受益証券1口当たり純資産価格が適用される。取締役会は、どのような状況で希薄化調整が行われるべきかを決定する裁量を有している。希薄化調整を行うための要件は、一般的に、関連するサブ・ファンドの受益証券の発行または買戻しの規模に依拠する。取締役会は、その見解において、既存の受益者（発行の場合）または残りの受益者（買戻しの場合）が、そうでなければ不利になる可能性がある場合には、希薄化調整を適用することができる。希薄化調整は、以下の場合に行うことができる：

- (a) サブ・ファンドは、着実な下落（すなわち、買戻しによる純流出）を記録する場合；
- (b) サブ・ファンドは、その規模に比してかなりの量の正味発行を記録する場合；
- (c) サブ・ファンドは、特定の評価日における正味発行ポジションまたは正味買戻しポジションを示す場合；
- (d) その他のすべての場合において、取締役会は、受益者の利益のために希薄化調整が必要であると考える場合。

評価調整が行われる場合、サブ・ファンドが正味発行ポジションまたは正味買戻しポジションにあるかどうかに応じて、受益証券1口当たり純資産価格に増額または減額される。評価調整の範囲は、取締役会の意見により、報酬および手数料ならびに売買スプレッドを適切にカバーするものとする。特に、それぞれのサブ・ファンドの純資産価額は、()見積り税金費用を反映した金額、()サブ・ファンドが負担する可能性のある取引費用、および()サブ・ファンドが投資する資産の見積り買値売値スプレッドを反映した金額が(上方または下方に)調整される。株式市場および国によっては、買い手側と売り手側に異なる報酬体系を示すことがあり、純流入と流出の調整は異なる可能性がある。通常、調整は関連する該当する受益証券1口当たり純資産価格の2%を上限とする。例外的な状況(例:高い市場のボラティリティーおよび/または非流動性、異常な市況、市場の混乱など)の下では、取締役会は各サブ・ファンドおよび/または評価日に関連する該当する受益証券1口当たり純資産価格の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が、これは現行の市況を表わすものであり、受益者にとって最善の利益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。この希薄化調整は、取締役会が定めた手続きに従って計算されるものとする。受益者は、一時的措置が導入された時およびその一時的措置が終了した時はいつでも、通常の経路を通じて通知を受けるものとする。

サブ・ファンドの各クラスの純資産価額は別々に計算される。しかし、希薄化調整は、各クラスの純資産価額にパーセント単位で同程度の影響を与える。

すべてのサブ・ファンドについて、スウィング・プライシング方法が適用されている。

会計年度末時点で純資産額へのスウィング・プライシング調整があった場合は、サブ・ファンドの3年間の比較の純資産額の情報から見る事ができる。受益証券1口当たり発行および買戻価格が、調整後の純資産額を表している。

かかる調整はサブ・ファンドのためであり、「その他の収益」として運用計算書に記載されている。

b) 評価原則

- 流動資産は、現金、預金、為替手形、小切手、約束手形、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、いずれの形においても額面で評価が行なわれる。ただし、かかる評価額が完全には支払われないまたは受領できない可能性のある場合には、その真正価額を表すために適切と思われる金額が控除され、価格が決定される。
- 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資産は、直近の入手可能な市場価格で評価される。これらの有価証券、派生商品およびその他の資産が複数の証券取引所に上場されている場合、当該資産の主要市場である証券取引所の直近の表示価格が適用される。有価証券、派生商品およびその他の資産について、証券取引所における取引が一般的でなく、かつ市場の市価決定方法を使用する流通市場において証券ディーラー間で取引されている場合、管理会社は、かかる価格に基づき、当該有価証券、派生商品およびその他の投資対象を評価することができる。証券取引所に上場されていない有価証券、派生商品および他の投資対象が公認かつ公開で定期的に運営されている他の規制ある市場で取引されている場合、当該市場における直近の入手可能価格で評価される。
- 証券取引所に上場されておらず、また別の規制された市場でも取引されていない、適正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、予想市場価格に基づき誠実に決定される他の原則に従って、管理会社により評価される。
- 証券取引所に上場されていない派生商品(OTC派生商品)の評価は、独立価格決定ソースを参照して行われる。派生商品の独立価格決定ソースが一つしか利用できない場合、入手した評価の妥当性は、当該派生商品の裏付けとなる市場価額に基づき管理会社および監査人に認められた算定方法によって確認される。
- 他の譲渡性のある有価証券を投資対象とする投資信託(UCITS)および/または投資信託(UCI)の受益証券は、それらの直近資産価格で評価される。

- 証券取引所に上場されていないまたは公開されている他の規制ある市場で取引されていない短期金融商品の価額は、関連するカーブを元に評価される。カーブに基づく評価は、金利および信用スプレッドにより計算される。この過程で以下の原則が適用される。各短期金融商品は、満期までの残存期間にもっとも近い金利が補間される。かかる方法により計算された金利は、原借主の信用力を反映する信用スプレッドを加算することで市場価格に転換される。借主の信用格付けが大幅に変更された場合、かかる信用スプレッドは調整が行われる。
- 外国為替取引によりヘッジされない当該サブ・ファンドの勘定通貨以外の通貨建ての証券、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平均為替レート（売買価格の仲値）またはこれが提供されない場合は当該通貨を最も代表する市場におけるレートで評価される。
- 定期預金および信託預金は、これらの額面額に発生利息を付して評価される。
- スワップの価値は、外部サービス・プロバイダーにより計算され、第2次の独立した評価が他の外部サービス・プロバイダーにより提供されている。かかる計算は、イン・フローおよびアウト・フローの両方のすべてのキャッシュ・フローの純現在価値に基づくものである。特定の場合に、内部計算（ブルームバーグにより提供されたモデルおよび市場データに基づく。）および/またはブローカーの報告評価が利用される。評価方法は、該当する有価証券に依拠し、UBS評価方針に従い選別される。

異常事態のため上記規定に基づく評価が実行不可能または不正確になった場合、管理会社は、純資産の適切な評価を実行するため誠実に他の一般に認められ検証可能な評価基準を適用する権限を付与される。

異常事態においては、追加評価は一日を通じて行うことができる。これらの新評価は、受益証券の爾後の発行および買戻しについて適用されるものとする。

c) 為替予約契約の評価

未決済の為替予約契約に係る未実現（損）益は、評価日の実勢先物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入手可能な直近の公表価格に基づいて評価される。実現（損）益および未実現（損）益の変動は運用計算書に計上される。実現（損）益は、（最初に取得された契約が、最初に販売されるものとみなされる）先入れ先出し法に従って計算される。

e) 有価証券売却に係る実現純（損）益

有価証券売却に係る実現純（損）益は、売却有価証券の平均原価に基づいて計算されている。

f) 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の銀行口座、その他の純資産および投資有価証券の評価額は、評価日のスポット・レート終値の仲値で換算されている。個々のサブ・ファンドの通貨以外の通貨建ての収益および費用は支払日のスポット・レート終値の仲値で換算されている。外国為替に係る（損）益は運用計算書に含まれている。

個々のサブ・ファンドの基準通貨以外の通貨建ての有価証券の取得原価は、取得日のスポット・レート終値の仲値で換算されている。

g) 投資有価証券取引の計上

投資有価証券取引は、取引日の翌銀行営業日に計上される。

h) スワップ

ファンドは、当該種類の取引を専門とする一流金融機関との間で取交わされる、金利スワップションおよびクレジット・デフォルト・スワップに係る金利スワップ契約ならびに金利先渡契約を締結することができる。

未実現(損)益の変動は、運用計算書において「スワップに係る未実現評価(損)益」として反映されている。

手仕舞い時または満期時に発生するスワップに係る利益または損失は、運用計算書において「スワップに係る実現(損)益」として記録される。

i) 結合財務書類

ファンドの結合財務書類はユーロで設定されている。ファンドの2020年9月30日現在の結合純資産計算書および結合運用計算書の様々な項目は、決算日のユーロの為替レートに換算された各サブ・ファンドの財務書類中の対応する項目の金額に等しい。

以下の為替レートが外国為替の換算および2020年9月30日現在の結合財務書類に使用された。

為替レート

1ユーロ	=	1.636066	オーストラリア・ドル
1ユーロ	=	1.077372	スイス・フラン
1ユーロ	=	1.172650	米ドル

j) モーゲージ・バック証券

ファンドは、その投資方針に従い、モーゲージ・バック証券に投資することができる。モーゲージ・バック証券は、証券の形態で統合された住居モーゲージの資金プールに対する参加権である。裏付であるモーゲージに関する元本および利息の支払は、元本が証券の原価を減少させるモーゲージ・バック証券の保有者に対して行われる。元本および利息の支払は、アメリカ合衆国の政府機関に類似する機関により保証される。損益は、元本の各支払に関連する各頭金の支払について計算される。この損益は、運用計算書の証券の売却にかかる純実現(損)益に含まれる。さらに、モーゲージへの期前弁済は、証券の存続期間を短縮することがあり、従って、ファンドの予想利回りに影響する。

「モーゲージ・バック証券」に関して、評価日において証券の額面価格に適用される係数が1より大きい場合、財務諸表に表示されている額面価格は当該係数を反映するべく調整される。その他の場合、表示されている額面価格は1に相当する係数で処理されている。

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」の勘定には、外国為替取引からの未収金も含まれることがある。「有価証券購入未払金」の勘定には、外国為替取引からの未払金も含まれることがある。

外国為替取引からの未収金および未払金は相殺される。

l) 利益の認識

源泉徴収税控除後の分配金は、関連する有価証券が最初に「配当落ち」を認定した日に利益として認識される。利息収入は、日次ベースで発生する。

m) 発表予定(「TBA」)モーゲージ・バック証券

TBAポジションは、モーゲージ・プール(ジニー・メイ、ファニー・メイまたはフレディ・マック)からの証券が、将来日において定められた価格で取得される場合のモーゲージ・バック証券市場に

係る一般的な取引慣行のことをいう。かかる証券の正確な構成については購入時点では知ることは出来ないが、その主な特性についてはすでに定義されている。額面価格はまだ明確に設定されていないものの、この時点で価格も設定される。

TBAポジションは、「TBAモーゲージ・バック証券に係る未実現評価(損)益」に含まれている。2020年9月30日現在のUBS(Lux)ボンド・ファンド - グローバル・フレキシブルのTBAポジションの価額は、4,734,722.39スイス・フランである。

注2. 報酬

ファンドは、個々のサブ・ファンド/クラス受益証券に、下記の表に列挙されているサブ・ファンド/クラス受益証券の平均純資産額への一定料率に基づき計算された上限定率報酬を支払う。

UBS(Lux)ボンド・ファンド - オーストラリア・ドル

UBS(Lux)ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル

	上限定率報酬	名称に「ヘッジ」が付く クラス受益証券の 上限定率報酬
名称に「P」が付くクラス受益証券	0.900% ¹	0.950%

¹ UBS(Lux)ボンド・ファンド - オーストラリア・ドルおよびUBS(Lux)ボンド・ファンド - スイス・フランについては、上限：0.900% / 実効：0.810%。

UBS(Lux)ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド(ユーロ)

	上限定率報酬	名称に「ヘッジ」が付く クラス受益証券の 上限定率報酬
名称に「P」が付くクラス受益証券	1.260%	1.310%

UBS(Lux)ボンド・ファンド - フルサイクル・アジア・ボンド(米ドル)

	上限定率報酬	名称に「ヘッジ」が付く クラス受益証券の 上限定率報酬
名称に「P」が付くクラス受益証券	1.500%	1.550%

上述の上限定率報酬には、以下が含まれる。

1. ファンドの運用、管理、ポートフォリオ管理および販売に関して(該当する場合)、また保管受託銀行のすべての職務(ファンド資産の保管および監督、決済取引の取扱いならびに販売目論見書の「保管受託銀行および主たる支払代理人」の項に記載されるその他一切の職務等)に関して、ファンドの純資産価額に基づく上限定率報酬は、以下の規定に従い、ファンドの資産から支払われる。当該報酬は、純資産価額の計算毎に比例按分ベースでファンド資産に対し請求され、毎月支払われる(上限管理報酬)。名称に「ヘッジ」が付くクラス受益証券の上限定率報酬は、通貨リスクをヘッジするための手数料を含むことがある。類似のクラス受益証券が発売されるまでは、関連する上限管理報酬は請求されない。上限管理報酬の概要は、販売目論見書の「サブ・ファンドの投資対象および投資方針」に記載されている。

当該報酬は、運用計算書において「報酬」として表示される。

2. 上限管理報酬は、以下の報酬およびファンドの資産から差引かれる追加の費用を含まない。
- a) 資産の売買のための一切のその他のファンドの資産管理費用(買呼値および売呼値のスプレッド、市場に応じた取次費用、手数料、報酬等)。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、受益証券の発行および買戻しの決済に関する資産の売買を通じて発生する当該追加費用は、販売目論見書の「純資産価額、発行、買戻しおよび転換価格」と称する項に従い、スイング・プライシングの原理の適用によりカバーされる。
 - b) ファンドの設立、変更、清算および合併に関する監督官庁に対する費用ならびに監督官庁およびサブ・ファンドが上場している証券取引所に対して支払われる一切の手数料。
 - c) ファンドの設立、変更、清算および合併に関する年次監査および承認に関する監査報酬ならびにファンドの管理事務に関して提供される業務のために監査法人に支払われるか、または法律により許可される一切のその他の報酬。
 - d) ファンドの設立、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、ファンド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) ファンド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) ファンドの法的文書に関するコスト(目論見書、KIID、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ファンドの登録に関するコスト。該当する場合、前述の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) ファンドによる議決権または債権者の権利の行使により発生する費用(外部顧問に対する報酬を含む。)
 - i) ファンドの名義で登録される知的財産またはファンドの利用者の権利に関するコストおよび手数料。
 - j) 管理会社、ポートフォリオ・マネージャーまたは保管受託銀行が投資者の利益の保護のために講じる特別措置に関して生じる一切の費用。
 - k) 管理会社が投資者の利益について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)をファンドの資産に対して請求することができる。さらに、管理会社は、すべての管理事務コストを請求することができるが、当該管理事務費用が証明可能でありかつ開示され、ファンドの総費用率(TER)の公示において考慮される。

当該手数料および報酬は、運用計算書において「その他の手数料および報酬」として表示される。

3. 管理会社は、ファンドの販売のためにサービス手数料を支払うことができる。

ファンドの収益および資産に課せられるすべての税金、とりわけ「年次税」は、ファンドが負担する。

定率管理報酬制度を用いていない他のファンド・プロバイダーとの報酬規定を全般的に比較するという目的上、「上限管理報酬」は定率管理報酬の80%と定められている。

クラスI-B受益証券については、ファンドの管理事務費用(管理会社、管理事務代行会社および保管受託銀行の費用により構成される。)をカバーする手数料が課せられる。資産運用および販売に係る当該費用については、投資家およびUBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジーまたは授けられた代理人の一人と別個に締結された契約に基づき、ファンド外で直接課せられる。

クラスI-X受益証券、クラスK-X受益証券およびクラスU-X受益証券の資産運用に関して提供されるサービスに係る費用について、ファンドの管理事務費用(管理会社、管理事務代行会社および保

管受託銀行の費用により構成される。)および販売報酬は、投資家と別個に締結された契約に基づき、その権利を有するUBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジーへの補償によりカバーされる。

クラスK-B受益証券に関して提供される資産運用サービスに係る費用は、投資家と別個に締結された契約に基づき、UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジーまたはその権利を有する正規販売会社への補償によりカバーされる。

個々のサブ・ファンドに帰属する一切の費用は、当該サブ・ファンドに請求される。

個々のサブ・ファンドまたはクラス受益証券に配分できる費用は、当該クラス受益証券に請求される。費用が複数またはすべてのサブ・ファンドに関係する場合、それぞれのサブ・ファンド/クラス受益証券の純資産価格に比例して当該サブ・ファンド/クラス受益証券に請求される。

その投資方針の条項に基づき他のUCIまたはUCITSに投資することができるサブ・ファンドに関して、関係する対象ファンドのレベルと当該サブ・ファンドのレベルの両方において、手数料が請求されることがある。サブ・ファンドがその資産に投資する対象ファンドの管理報酬は、トレイル・フィーを考慮に入れ、最大で3%にのぼることがある。

管理会社自らもしくは共同経営または支配または実質的な直接/間接保有を通じて管理会社と関連がある他の会社により直接管理されるかまたは委任により管理されるファンドの受益証券にサブ・ファンドが投資する場合、当該対象ファンドの受益証券に関連する発行手数料または買戻手数料を全く請求されないことがある。

ファンドの現行の手数料については、KIIDで参照することができる。

注3．年次税

現在施行されている法令に従い、ファンドは、各四半期末日におけるファンドの純資産総額に基づき計算され、四半期毎に支払われる年率0.05%の発行税、または、一定のクラス受益証券については、0.01%の軽減年率の年次税の対象となっている。

ルクセンブルグ法の法定条項に従い年次税を既に支払っている他の投資信託の受益証券または株式へ投資された純資産部分に関し、年次税は放棄された。

注4．利益分配

約款第10条に従い、管理会社は、年次決算の終了とともに、各サブ・ファンドが分配金の支払いを行うか否かおよび分配の程度を決定する。分配金の支払いにより、ファンドの純資産が2010年法の定めるファンド資産の最低額を下回ってはならない。分配が行われる場合、支払いは会計年度の終了から4か月以内に行われる。

分配の詳細については、未監査である。

取締役会は、中間配当金を支払う権限および分配の支払いを停止する権限を有する。

分配が実際の収益を受ける権利に対応するよう収益平準化額が計算される。

注5．ソフト・コミッション・アレンジメント

2020年4月1日から2020年9月30日までの会計期間中、いかなる「ソフト・コミッション・アレンジメント」もUBS(Lux)ボンド・ファンドに代わって締結されておらず、「ソフト・コミッション・アレンジメント」の金額もなかった。

注6．金融先物およびスワップに係る契約債務

2020年9月30日現在のサブ・ファンドおよび各通貨当たりの金融先物およびスワップに係る契約債務は、以下のとおり要約される。

a) 金融先物

UBS (Lux) ボンド・ファンド	債券に係る金融先物（買い）	債券に係る金融先物（売り）
- オーストラリア・ドル	28,683,431.04 オーストラリア・ドル	25,338,169.44 オーストラリア・ドル
- ユーロ・フレキシブル	129,428,709.80 ユーロ	38,033,657.89 ユーロ
- ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）	76,946,179.58 ユーロ	- ユーロ
- フルサイクル・アジア・ボンド（米ドル）	- 米ドル	15,681,031.25 米ドル

債券または指数に係る金融先物契約（もしあれば）は、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) スワップ

UBS (Lux) ボンド・ファンド	クレジット・デフォルト・スワップ（買い）	クレジット・デフォルト・スワップ（売り）
- ユーロ・フレキシブル	5,834,062.32 ユーロ	23,994,229.56 ユーロ
- ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）	1,244,583.90 ユーロ	11,059,425.20 ユーロ

UBS (Lux) ボンド・ファンド	金利に係るスワップおよびフォワード・スワップ（買い）	金利に係るスワップおよびフォワード・スワップ（売り）
- ユーロ・フレキシブル	94,826,836.93 ユーロ	123,460,571.61 ユーロ

UBS (Lux) ボンド・ファンド	指数に係るスワップおよびフォワード・スワップ（買い）	指数に係るスワップおよびフォワード・スワップ（売り）
- ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）	- ユーロ	39,436,054.95 ユーロ

注7．総経費率（TER）

当比率は、今期版のスイス・ファンズ・アンド・アセット・マネジメント・アソシエーション（SFA MA）による「TERの計算および公表に係る指針」に従って計算されており、遡及的に把握される、純資産中における、純資産が負担するすべての経常費用および手数料（運営経費）の合計の割合を表示するものである。

過去12か月におけるTER

UBS (Lux) ボンド・ファンド	総経費率（TER）
- オーストラリア・ドル クラスP - a c c 受益証券	0.93%
- オーストラリア・ドル クラスP - d i s t 受益証券	0.93%
- ユーロ・フレキシブル クラスP - a c c 受益証券	0.97%
- ユーロ・フレキシブル クラスP - d i s t 受益証券	0.97%
- ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）クラスP - a c c 受益証券	1.32%
- ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）（米ドル・ヘッジ）クラスP - a c c 受益証券	1.36%
- ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）クラスP - m d i s t 受益証券	1.33%
- ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）（米ドル・ヘッジ）クラスP - m d i s t 受益証券	1.36%

UBS（Lux）ボンド・ファンド	総経費率（TER）
-フルサイクル・アジア・ボンド（米ドル）クラスP - a c c 受益証券	1.56%

運用期間が12か月に満たないクラス受益証券のTERについては、年率換算されている。

取引費用、利息費用、貸付有価証券費用および為替ヘッジに関連して発生したその他の費用は、TERに含まれない。

注8．当報告期間中の重要な事象

2020年3月11日、世界保健機関は新型コロナウイルス感染症（COVID-19）の発生をパンデミックと宣言した。このウイルスが世界経済に及ぼす影響については引き続き懸念があり、この不確実性の結果として、本報告書の資産の評価は、これらの資産の実際の売却時の価値から大幅に乖離する可能性がある。ここ数か月の市場の大幅な修正と金融市場のボラティリティの高まりは、資産の将来的な評価の観点からファンドに大きな影響を与える可能性がある。取締役会と投資運用会社は、ウイルスの拡大を抑制し、ポートフォリオとファンド自体への経済的影響を減らすための各国政府の取り組みを引き続き注視する。

ファンドの財務諸表を作成する際に取締役会が行った継続企業の前提が不適切であるという証拠はない。

注9．準拠法、営業地域および言語

ルクセンブルグ地方裁判所は、受益者、管理会社および保管受託銀行との間のすべての法律上の紛争の管轄地である。ルクセンブルグの法律が適用される。しかし、外国の投資家からの請求に関する事項については、管理会社および/または保管受託会社は、ファンド受益証券が売買された国の管轄に服し、代理人を選定することが出来る。

本財務書類は、ドイツ語版が正式書類である。しかし、ファンドの受益証券が売買されているその他の国の投資者に売却された受益証券の場合、管理会社および保管受託銀行は、両者およびファンドを拘束する関連言語に翻訳された承認済の翻訳を認知することができる（即ち、管理会社および保管受託銀行がこれを承認する。）。

注10．貸付有価証券

ファンドは第三者に組入証券の一部を貸付けることができる。一般的に、貸付はクリアストリーム・インターナショナルもしくはユーロクリアのような公認の決済機関、または同種の業務を専門とする第一級の金融機関の仲介により、それらの機関が設定した方法に従ってのみ行われる。担保は、貸付有価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有価証券の少なくとも時価に相当する金額の高格付け証券から構成される。

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

UBS（Lux）ボンド・ファンド	2020年9月30日現在の貸付有価証券からの取引相手方エクスポージャー		2020年9月30日現在の担保の内訳（%）		
	貸付有価証券の時価	担保 （ユービーエス・スイス・エイ・ジー）	株式	債券	現金
- オーストラリア・ドル	2,526,076.59 オーストラリア・ドル	2,690,813.47 オーストラリア・ドル	30.24	69.76	0.00
- ユーロ・フレキシブル	37,755,779.42 ユーロ	40,218,004.63 ユーロ	30.24	69.76	0.00
- ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）	199,155,096.80 ユーロ	212,142,901.80 ユーロ	30.24	69.76	0.00
- フルサイクル・アジア・ボンド（米ドル）	53,929,925.97 米ドル	57,446,940.46 米ドル	30.24	69.76	0.00

[次へ](#)

(2) 投資有価証券明細表等

UBS(Lux) ボンド・ファンド - オーストラリア・ドル

2020年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	評価額 オーストラリア・ドル 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
固定利付ノート			
AUD			
AUD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.45000% 19-17.01.24	2 500 000.00	2 663 375.00	0.74
AUD AT&T INC 3.45000% 18-19.09.23	3 400 000.00	3 625 930.00	1.00
AUD AT&T INC 4.60000% 18-19.09.28	1 600 000.00	1 892 048.00	0.53
AUD NEW SOUTH WALES TREASURY CORP-REG-S 3.00000% 16-20.02.30	3 200 000.00	3 733 152.00	1.03
AUD NEW SOUTH WALES TREASURY CORP 2.00000% 20-08.03.33	2 600 000.00	2 752 230.00	0.76
AUD TASMANIAN PUBLIC FINANCE CORP 4.25000% 13-08.03.22	1 100 000.00	1 163 074.00	0.32
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 1.50000% 20-20.11.30	2 800 000.00	2 867 984.00	0.79
AUD WESTERN AUSTRALIAN TREASURY-REG-S 5.00000% 13-23.07.25	2 700 000.00	3 287 952.00	0.91
Total AUD		21 985 745.00	6.08
固定利付ノート合計		21 985 745.00	6.08
変動利付ノート			
AUD			
AUD STANDARD CHARTERED PLC-REG-S 2.900%/VAR 19-28.06.25	2 500 000.00	2 567 325.00	0.71
Total AUD		2 567 325.00	0.71
変動利付ノート合計		2 567 325.00	0.71
固定利付ミディアム・ターム・ノート			
AUD			
AUD AURIZON NETWORK PTY LTD-REG-S 4.00000% 17-21.06.24	1 000 000.00	1 079 840.00	0.30
AUD AUSNET SERVICES HOLDINGS PTY LTD 2.60000% 19-31.07.29	500 000.00	526 585.00	0.15
AUD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING-REG-S 2.80000% 16-16.08.21	7 600 000.00	7 769 024.00	2.15
AUD BARCLAYS PLC-REG-S 3.25000% 19-26.06.24	1 500 000.00	1 560 015.00	0.43
AUD FONTERRA CO-OPERATIVE GROUP LTD 4.50000% 14-30.06.21	1 000 000.00	1 028 400.00	0.28
AUD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 3.85000% 19-21.02.23	1 400 000.00	1 440 222.00	0.40
AUD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 3.75000% 12-25.07.22	1 500 000.00	1 594 620.00	0.44
AUD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 3.00000% 16-19.10.26	2 000 000.00	2 270 860.00	0.63
AUD KOMMUNALBANKEN AS 2.70000% 18-05.09.23	3 600 000.00	3 833 172.00	1.06
AUD KOMMUNALBANKEN AS 4.50000% 13-17.04.23	7 600 000.00	8 379 684.00	2.32
AUD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU-REG-S 2.80000% 16-17.02.21	3 600 000.00	3 635 820.00	1.00
AUD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 4.25000% 13-24.01.23	4 400 000.00	4 794 548.00	1.33
AUD LLOYDS BANK PLC-REG-S 1.65000% 19-12.08.22	4 200 000.00	4 261 866.00	1.18
AUD LLOYDS BANKING GROUP 3.65000% 17-20.03.23	1 600 000.00	1 683 104.00	0.46
AUD MACQUARIE BANK LTD 1.75000% 19-07.08.24	3 700 000.00	3 839 231.00	1.06
AUD MACQUARIE GROUP LTD 3.25000% 17-15.12.22	2 600 000.00	2 661 100.00	0.74
AUD MCDONALD ' S CORP 3.00000% 19-08.03.24	3 600 000.00	3 830 328.00	1.06
AUD NATIONAL HOUSING FINANCE AND INV CORP 2.38000% 19-28.03.29	1 500 000.00	1 685 505.00	0.47
AUD NATIONAL HOUSING FINANCE AND INV CORP 1.52000% 19-27.05.30	1 900 000.00	2 008 205.00	0.55
AUD ORIGIN ENERGY FINANCE LTD 2.65000% 19-11.11.27	700 000.00	715 778.00	0.20
AUD PERTH AIRPORT PTY LTD 5.50000% 14-25.03.21	750 000.00	763 792.50	0.21
AUD QUEENSLAND TREASURY CORP-144A-REG-S 3.00000% 17-22.03.24	3 500 000.00	3 822 805.00	1.06
AUD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP-REG-S 2.75000% 16-26.07.21	2 400 000.00	2 438 952.00	0.67

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS(Lux)ボンド・ファンド - オーストラリア・ドル

2020年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	評価額 オーストラリア・ドル 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 2.50000% 19-22.10.29	3 600 000.00	4 044 060.00	1.12
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 1.00000% 20-20.11.23	6 700 000.00	6 852 760.00	1.89
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 1.25000% 20-19.11.27	5 500 000.00	5 669 070.00	1.57
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 4.25000% 13-20.12.32	2 300 000.00	3 027 306.00	0.84
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 1.50000% 20-10.09.31	3 700 000.00	3 744 770.00	1.04
AUD VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.50000% 17-17.02.23	1 100 000.00	1 164 086.00	0.32
AUD WESTERN AUSTRALIAN TREASURY CORP 3.00000% 17-21.10.26	1 900 000.00	2 173 486.00	0.60
AUD WESTPAC BANKING CORP 3.25000% 18-16.11.23	2 000 000.00	2 168 640.00	0.60
AUD WOOLWORTHS GROUP LTD 2.85000% 19-23.04.24	900 000.00	957 591.00	0.26
AUD WOOLWORTHS LTD-REG-S 2.80000% 20-20.05.30	2 000 000.00	2 121 220.00	0.59
Total AUD		97 546 445.50	26.98
固定利付メディアム・ターム・ノート合計		97 546 445.50	26.98
固定利付債券			
AUD AUSTRALIA 1.25000% 20-21.05.32	3 200 000.00	3 316 000.00	0.92
AUD AUSTRALIA 4.25000% 14-21.04.26	8 400 000.00	10 180 884.00	2.81
AUD AUSTRALIA 4.75000% 11-21.04.27	7 800 000.00	9 941 958.00	2.75
AUD AUSTRALIA-REG-S 0.50000% 20-21.09.26	11 600 000.00	11 633 988.00	3.22
AUD AUSTRALIA-REG-S 1.00000% 20-21.12.30	13 100 000.00	13 309 076.00	3.68
AUD AUSTRALIA-REG-S 1.75000% 20-21.06.51	4 600 000.00	4 619 504.00	1.28
AUD AUSTRALIA-REG-S 2.25000% 16-21.05.28	7 700 000.00	8 633 933.00	2.39
AUD AUSTRALIA-REG-S 2.75000% 18-21.05.41	1 900 000.00	2 320 850.00	0.64
AUD AUSTRALIA-REG-S 2.75000% 16-21.11.27	5 200 000.00	5 994 924.00	1.66
AUD AUSTRALIA-REG-S 2.75000% 17-21.11.28	1 900 000.00	2 212 265.00	0.61
AUD AUSTRALIA-REG-S 2.75000% 18-21.11.29	1 000 000.00	1 175 880.00	0.32
AUD AUSTRALIA-REG-S 3.00000% 16-21.03.47	5 500 000.00	7 110 400.00	1.97
AUD AUSTRALIA-REG-S 3.25000% 15-21.06.39	2 400 000.00	3 125 352.00	0.86
AUD AUSTRALIA-REG-S 3.25000% 13-21.04.25	6 100 000.00	6 917 644.00	1.91
AUD AUSTRALIA-REG-S 3.75000% 14-21.04.37	3 600 000.00	4 939 488.00	1.37
AUD AUSTRALIA-REG-S 4.50000% 13-21.04.33	4 900 000.00	6 959 813.00	1.92
AUD AUSTRALIAN CAPITAL TERRITORY 4.25000% 13-11.04.22	1 000 000.00	1 061 530.00	0.29
AUD QUEENSLAND TREASURY CORP-REG-S 6.50000% 08-14.03.33	800 000.00	1 266 128.00	0.35
AUD QUEENSLAND TREASURY CORP-REG-S 4.25000% 12-21.07.23	3 500 000.00	3 889 970.00	1.07
AUD QUEENSLAND TREASURY CORP-144A-REG-S 4.75000% 14-21.07.25	1 900 000.00	2 288 645.00	0.63
AUD QUEENSLAND TREASURY CORP-144A-REG-S 3.25000% 15-21.07.26	2 000 000.00	2 302 800.00	0.64
AUD QUEENSLAND TREASURY CORP-144A-REG-S 2.75000% 16-20.08.27	4 300 000.00	4 878 393.00	1.35
AUD SOUTH AUSTRALIAN GOV FIN AUTHORITY 1.75000% 20-24.05.32	2 000 000.00	2 049 740.00	0.57
AUD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 3.66200% 17-29.03.22	1 900 000.00	1 973 340.00	0.55
AUD WESTERN AUSTRALIAN TREASURY CORP 3.00000% 16-21.10.27	5 100 000.00	5 899 986.00	1.63
AUD WESTPAC BANKING CORP-REG-S 5.25000% 13-21.11.23	3 900 000.00	4 469 985.00	1.24
Total AUD		132 472 476.00	36.63
固定利付債券合計		132 472 476.00	36.63
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		254 571 991.50	70.40

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS(Lux)ボンド・ファンド - オーストラリア・ドル

2020年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	評価額 オーストラリア・ドル 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
----	---------	--	------------------

他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品

固定利付ノート

AUD			
AUD	LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 5.50000% 12-29.03.22	1 000 000.00	1 078 270.00 0.30
AUD	NEW SOUTH WALES TREASURY CORP 3.00000% 16-20.03.28	4 600 000.00	5 315 622.00 1.47
AUD	NEW SOUTH WALES TREASURY CORP-REG-S 3.00000% 17-20.04.29	1 500 000.00	1 745 700.00 0.48
AUD	NEW SOUTH WALES TREASURY CORP-REG-S 3.00000% 18-15.11.28	1 800 000.00	2 097 432.00 0.58
Total AUD			10 237 024.00 2.83

固定利付ノート合計

10 237 024.00 2.83

固定利付メディアム・ターム・ノート

AUD			
AUD	AIRSERVICES AUSTRALIA 4.75000% 13-19.11.20	1 100 000.00	1 106 380.00 0.31
AUD	AURIZON NETWORK PTY LTD 5.75000% 13-28.10.20	1 500 000.00	1 505 730.00 0.42
AUD	AUSGRID FINANCE PTY LTD-REG-S 3.75000% 17-30.10.24	1 900 000.00	2 073 356.00 0.57
AUD	COLES GROUP TREASURY PTY LTD-REG-S 2.65000% 19-06.11.29	1 800 000.00	1 913 346.00 0.53
AUD	DOWNER GROUP FINANCE PTY LTD 4.50000% 15-11.03.22	900 000.00	924 471.00 0.26
AUD	DOWNER GROUP FINANCE PTY 3.70000% 19-29.04.26	2 100 000.00	2 152 479.00 0.60
AUD	EDITH COWAN UNIVERSITY 3.00000% 19-11.04.29	1 800 000.00	1 948 302.00 0.54
AUD	ENERGY PARTNERSHIP GAS PTY LTD 3.64200% 17-11.12.24	1 000 000.00	1 087 190.00 0.30
AUD	EXPORT DEVELOPMENT CANADA 2.70000% 17-24.10.22	3 600 000.00	3 774 456.00 1.04
AUD	INCITEC PIVOT LTD 4.30000% 19-18.03.26	2 300 000.00	2 466 888.00 0.68
AUD	LANDESKREDITBANK B-WUERTT FOERDERBANK 2.70000% 17-19.06.23	2 500 000.00	2 645 175.00 0.73
AUD	MACQUARIE UNIVERSITY-REG-S 3.50000% 18-07.09.28	800 000.00	905 776.00 0.25
AUD	MACQUARIE UNIVERSITY-REG-S 2.25000% 19-22.05.30	2 100 000.00	2 141 748.00 0.59
AUD	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 3.00000% 16-21.10.21	3 000 000.00	3 086 010.00 0.85
AUD	PACCAR FINANCIAL PTY LTD-REG-S 3.00000% 18-13.09.22	600 000.00	624 672.00 0.17
AUD	UNITED ENERGY LTD-REG-S 3.50000% 16-12.09.23	1 100 000.00	1 168 585.00 0.32
AUD	UNIVERSITY OF MELBOURNE 4.25000% 14-30.06.21	1 000 000.00	1 026 140.00 0.28
AUD	UNIVERSITY OF SYDNEY 4.75000% 14-16.04.21	1 500 000.00	1 533 615.00 0.42
AUD	UNIVERSITY OF WOLLONGONG/THE 3.50000% 17-08.12.27	700 000.00	784 749.00 0.22
AUD	VIRGIN AUSTRALIA HOLDINGS LTD 8.07500% 19-05.03.24	500 000.00	45 000.00 0.01
AUD	WSO FINANCE PTY LTD 4.50000% 17-31.03.27	800 000.00	926 160.00 0.26
AUD	WSO FINANCE PTY LTD-REG-S 3.50000% 16-14.07.23	500 000.00	523 625.00 0.15
Total AUD			34 363 853.00 9.50

固定利付メディアム・ターム・ノート合計

34 363 853.00 9.50

固定利付債券

AUD			
AUD	AUSTRALIAN CAPITAL TERRITORY 1.75000% 19-23.10.31	1 300 000.00	1 335 373.00 0.37
AUD	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 2.75000% 16-17.11.21	5 500 000.00	5 654 660.00 1.56
AUD	EXPORT DEVELOPMENT CANADA 2.80000% 18-31.05.23	1 200 000.00	1 276 080.00 0.35
AUD	HSBC BANK AUSTRALIA-REG-S 2.75000% 18-16.08.21	3 100 000.00	3 161 194.00 0.87
AUD	NEW SOUTH WALES TREASURY CORP 2.00000% 19-20.03.31	3 400 000.00	3 634 362.00 1.01
AUD	NORTHERN TERRITORY CORP-REG-S 6.00000% 01-15.03.24	800 000.00	951 768.00 0.26
AUD	NORTHERN TERRITORY CORP 3.50000% 18-21.05.30	800 000.00	945 968.00 0.26
AUD	NSW ELECTRICITY NETWORKS FINANCE PTY 2.54300% 20-23.09.30	1 900 000.00	1 905 092.00 0.53
AUD	SUNCORP-METWAY LTD 3.00000% 18-13.09.23	3 100 000.00	3 310 521.00 0.92

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S (Lux) ボンド・ファンド - オーストラリア・ドル

2020年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	評価額 オーストラリア・ドル 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
AUD SUNCORP-METWAY LTD-REG-S 3.25000% 16-24.08.26	1 000 000.00	1 118 030.00	0.31
AUD TASMANIAN PUBLIC FINANCE CORP 2.00000% 19-24.01.30	2 400 000.00	2 526 888.00	0.70
AUD WESTERN AUSTRALIAN TREASURY CORP-REG-S 2.75000% 19-24.07.29	3 800 000.00	4 357 080.00	1.20
AUD WESTERN AUSTRALIAN TREASURY CORP 2.00000% 19-24.10.34	2 500 000.00	2 601 425.00	0.72
AUD WESTPAC BANKING CORP 2.75000% 17-31.08.22	3 800 000.00	3 975 218.00	1.10
Total AUD		36 753 659.00	10.16
固定利付債券合計		36 753 659.00	10.16
変動利付債券			
AUD			
AUD NEXTDC LTD 3M BBSW+375BP 18-09.06.22	500 000.00	501 505.00	0.15
Total AUD		501 505.00	0.15
変動利付債券合計		501 505.00	0.15
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		81 856 041.00	22.64
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も取引されていない譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
固定利付ミディアム・ターム・ノート			
AUD			
AUD AURIZON NETWORK PTY LTD 2.90000% 20-02.09.30	2 400 000.00	2 409 672.00	0.67
AUD AUSTRALIAN CAPITAL TERRITORY 2.50000% 16-21.05.26	1 000 000.00	1 103 530.00	0.30
AUD GTA FINANCE CO PTY LTD 2.20000% 20-26.08.27	600 000.00	604 470.00	0.17
AUD ING BANK AUSTRALIA LTD-REG-S 3.00000% 18-07.09.23	1 600 000.00	1 707 056.00	0.47
AUD LGFV PROGRAM TRUST-REG-S 4.31000% 14-12.11.21	2 100 000.00	2 165 688.00	0.60
AUD LONSDALE FINANCE PTY LTD-REG-S 2.45000% 19-20.11.26	2 000 000.00	2 051 220.00	0.57
AUD NETWORK FINANCE CO PTY LTD 2.25000% 19-11.11.26	1 200 000.00	1 231 956.00	0.34
AUD QPH FINANCE CO PTY LTD 2.85000% 20-29.01.31	800 000.00	814 512.00	0.22
AUD UNIVERSITY OF TECHNOLOGY SYDNEY 3.75000% 17-20.07.27	1 000 000.00	1 141 690.00	0.32
Total AUD		13 229 794.00	3.66
固定利付ミディアム・ターム・ノート合計		13 229 794.00	3.66
固定利付債券			
AUD			
AUD BENDIGO & ADELAIDE BANK LTD LTD 1.70000% 19-06.09.24	3 500 000.00	3 592 540.00	0.99
AUD NORTHERN TERRITORY TREASURY CORP 3.50000% 17-21.04.28	1 900 000.00	2 235 312.00	0.62
Total AUD		5 827 852.00	1.61
固定利付債券合計		5 827 852.00	1.61
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も取引されていない譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		19 057 646.00	5.27
投資有価証券合計		355 485 678.50	98.31

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS(Lux)ボンド・ファンド - オーストラリア・ドル

2020年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	評価額 オーストラリア・ドル 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
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			
AUD AUSTRALIA 10YR BOND FUTURE 15.12.20	192.00	339 663.36	0.09
AUD AUSTRALIAN 3YR BOND FUTURE 15.12.20	-216.00	-16 264.48	0.00
債券に係る金融先物合計		323 398.88	0.09
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		323 398.88	0.09
派生商品合計		323 398.88	0.09
銀行預金、要求払い預金および貯蓄預金ならびにその他の流動資産		3 379 115.91	0.93
その他の資産および負債		2 417 280.88	0.67
純資産合計		361 605 474.17	100.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S (Lux) ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル

2020年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
----	---------	---	------------------

公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品

固定利付ノート

EUR				
EUR	ABBVIE INC-144A 2.12500% 20-01.06.29	100 000.00	112 013.80	0.05
EUR	ABBVIE INC-144A 2.62500% 20-15.11.28	100 000.00	116 480.20	0.05
EUR	ALTICE FINCO SA-REG-S 4.75000% 17-15.01.28	330 000.00	298 650.00	0.13
EUR	ALTICE FRANCE-REG-S 5.87500% 18-01.02.27	600 000.00	633 446.40	0.28
EUR	AMERICAN EXPRESS CREDIT CORP 0.62500% 16-22.11.21	100 000.00	100 872.00	0.04
EUR	ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-REG-S 2.12500% 19-15.08.26	200 000.00	193 977.65	0.08
EUR	ARGENTINA, REPUBLIC OF 0.12500% 20-09.07.30	679 000.00	268 205.00	0.12
EUR	ARGENTINA, REPUBLIC OF 0.50000% 20-09.07.29	22 046.00	8 950.95	0.00
EUR	AT&T INC 0.80000% 19-04.03.30	200 000.00	197 391.60	0.09
EUR	BACARDI LTD-REG-S 2.75000% 13-03.07.23	100 000.00	104 459.00	0.05
EUR	CHILE, REPUBLIC OF 0.83000% 19-02.07.31	700 000.00	700 218.75	0.30
EUR	CHINA, PEOPLE ' S REPUBLIC OF-REG-S 1.00000% 19-12.11.39	435 000.00	420 862.50	0.18
EUR	FINANCIAL & RISK US HOLDINGS INC-REG-S 6.87500% 18-15.11.26	500 000.00	539 675.00	0.23
EUR	FISERV INC 1.62500% 19-01.07.30	395 000.00	421 195.97	0.18
EUR	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 1.51400% 19-17.02.23	150 000.00	142 233.00	0.06
EUR	GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 3.37500% 20-27.03.25	815 000.00	921 187.98	0.40
EUR	INDONESIA, REPUBLIC OF 1.40000% 19-30.10.31	400 000.00	389 625.00	0.17
EUR	INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC-REG-S 2.37500% 19-15.04.28	160 000.00	140 000.00	0.06
EUR	LA MONDIALE SAM-REG-S-SUB 2.12500% 20-23.06.31	200 000.00	198 822.00	0.09
EUR	LOXAM SAS-REG-S 3.75000% 19-15.07.26	400 000.00	381 000.00	0.17
EUR	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON-REG-S 0.12500% 20-11.02.28	200 000.00	200 027.20	0.09
EUR	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON-REG-S 0.37500% 20-11.02.31	100 000.00	100 229.49	0.04
EUR	NATIONAL GRID ELECTRICITY TRANS-REG-S 0.19000% 20-20.01.25	100 000.00	100 643.00	0.04
EUR	NISSAN MOTOR CO LTD-REG-S 2.65200% 20-17.03.26	400 000.00	403 727.20	0.18
EUR	PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 4.75000% 14-14.01.25	300 000.00	331 500.00	0.14
EUR	SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 0.75000% 19-09.07.27	700 000.00	698 250.00	0.30
EUR	SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 4.50000% 18-20.04.25	300 000.00	314 460.00	0.14
EUR	UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 4.37500% 20-27.01.30	600 000.00	489 000.00	0.21
EUR	UNILABS SUBHOLDING AB-REG-S 5.75000% 17-15.05.25	400 000.00	401 012.80	0.17
EUR	VEB FINANCE PLC-REG-S LPN 4.03200% 13-21.02.23	610 000.00	643 550.00	0.28
Total EUR			9 971 666.49	4.32

USD				
USD	AECOM TECHNOLOGY CORP 5.87500% 15-15.10.24	220 000.00	203 067.33	0.09
USD	AERCAP IRELAND CAP/ GLBL AVIATION TRUST 6.50000% 20-15.07.25	150 000.00	138 093.11	0.06
USD	COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 4.25000% 12-26.01.23	800 000.00	648 104.72	0.28
USD	COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 7.15800% 15-12.03.45	740 000.00	576 424.12	0.25
USD	DXC TECHNOLOGY CO 4.12500% 20-15.04.25	70 000.00	64 498.23	0.03
USD	ECUADOR GOVT INTERNATIONAL BD-REG-S STEP-UP/DOWN 20-31.07.35	198 120.00	94 189.99	0.04
USD	ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S STEP-UP 0.50000% 20-31.07.30	75 600.00	43 678.00	0.02
USD	ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S STEP-UP 20-31.07.40	90 800.00	38 909.31	0.02
USD	ENERGY TRANSFER PARTNERS LP 6.00000% 18-15.06.48	100 000.00	85 770.60	0.04
USD	GENERAL ELECTRIC CO 3.45000% 20-01.05.27	60 000.00	54 174.06	0.02
USD	GENERAL ELECTRIC CO 3.62500% 20-01.05.30	60 000.00	52 988.36	0.02
USD	GENERAL ELECTRIC CO 3.15000% 12-07.09.22	240 000.00	213 751.06	0.09
USD	GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 4.87500% 13-13.02.28	400 000.00	376 391.08	0.16
USD	OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.75000% 18-17.01.48	760 000.00	536 306.66	0.23
USD	PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 2.45700% 20-05.05.30	570 000.00	523 749.63	0.23
USD	PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP 3.80000% 20-15.09.30	135 000.00	111 633.55	0.05

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS(Lux)ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル

2020年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD SANDS CHINA LTD-REG-S 4.37500% 20-18.06.30	200 000.00	179 917.28	0.08
USD SOUTHWEST AIRLINES CO 4.75000% 20-04.05.23	65 000.00	59 244.17	0.03
USD SOUTHWEST AIRLINES CO 5.12500% 20-15.06.27	105 000.00	97 878.46	0.04
USD SPRINT CORP 7.87500% 14-15.09.23	200 000.00	195 923.76	0.09
USD TURKEY, REPUBLIC OF 6.87500% 06-17.03.36	600 000.00	480 322.35	0.21
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.37500% 17-25.09.32	560 000.00	448 599.32	0.19
USD URUGUAY, REPUBLIC OF 4.12500% 12-20.11.45	600 000.00	605 999.23	0.26
USD VALERO ENERGY CORP 2.85000% 20-15.04.25	140 000.00	125 287.57	0.05
USD VALERO ENERGY CORP 4.90000% 15-15.03.45	100 000.00	94 925.14	0.04
Total USD		6 049 827.09	2.62
固定利付ノート合計		16 021 493.58	6.94
ノート、ゼロ・クーポン			
USD			
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 20-31.07.30	16 232.00	6 436.60	0.00
Total USD		6 436.60	0.00
ノート、ゼロ・クーポン合計		6 436.60	0.00
変動利付ノート			
EUR			
EUR AUSTRALIA & NZ BANKING GRP-REG-S-SUB 1.125%/VAR 19-21.11.29	200 000.00	199 806.00	0.09
Total EUR		199 806.00	0.09
変動利付ノート合計		199 806.00	0.09
固定利付ミディアム・ターム・ノート			
EUR			
EUR ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA-REG-S 2.37500% 19-27.09.27	100 000.00	105 001.40	0.05
EUR ABN AMRO BANK NV-REG-S 1.25000% 18-10.01.33	500 000.00	583 998.55	0.25
EUR ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV-REG-S 1.15000% 18-22.01.27	200 000.00	210 071.20	0.09
EUR AROUNDTOWN SA-REG-S 2.00000% 18-02.11.26	100 000.00	105 764.40	0.05
EUR AURIZON NETWORK PTY LTD-REG-S 2.00000% 14-18.09.24	100 000.00	105 779.24	0.05
EUR AUTOSTRADA PER L'ITALIA SPA-REG-S 1.12500% 15-04.11.21	100 000.00	96 964.80	0.04
EUR BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 0.62500% 16-18.03.23	1 000 000.00	1 024 668.00	0.44
EUR BANCO BPM SPA 2.50000% 19-21.06.24	400 000.00	408 437.60	0.18
EUR BANCO SANTANDER SA-REG-S-SUB 3.25000% 16-04.04.26	100 000.00	110 286.00	0.05
EUR BANK OF IRELAND GROUP PLC-REG-S 1.37500% 18-29.08.23	255 000.00	259 535.68	0.11
EUR BANQUE FEDER DU CREDIT MUTUEL-REG-S-SUB 3.00000% 15-11.09.25	200 000.00	222 556.00	0.10
EUR BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC-REG-S 0.87500% 15-13.10.23	200 000.00	203 613.20	0.09
EUR BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC-REG-S 1.25000% 15-13.03.27	300 000.00	306 162.60	0.13
EUR BNP PARIBAS-REG-S-SUB 2.87500% 16-01.10.26	2 400 000.00	2 676 648.00	1.16
EUR BP CAPITAL MARKETS PLC 2.17700% 14-28.09.21	500 000.00	511 595.00	0.22
EUR BPCE SA-REG-S 1.37500% 18-23.03.26	300 000.00	315 162.60	0.14
EUR CANAL DE ISABEL II GESTION SA-REG-S 1.68000% 15-26.02.25	400 000.00	424 316.32	0.18
EUR CITIGROUP INC-REG-S 2.37500% 14-22.05.24	300 000.00	323 892.60	0.14
EUR CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE SA-REG-S 1.87500% 18-19.01.26	305 000.00	314 004.21	0.14
EUR COMMERZBANK AG-REG-S 0.62500% 19-28.08.24	165 000.00	167 955.48	0.07
EUR COVESTRO AG-REG-S 1.37500% 20-12.06.30	150 000.00	152 343.00	0.07
EUR CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S 2.75000% 20-12.05.26	155 000.00	159 860.80	0.07

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS(Lux)ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル

2020年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
EUR CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 1.37500% 18-13.03.25	300 000.00	314 343.00	0.14
EUR DAIMLER AG-REG-S 2.00000% 20-22.08.26	175 000.00	189 332.50	0.08
EUR DANSKE BANK AS-REG-S 1.37500% 19-24.05.22	250 000.00	254 920.62	0.11
EUR DANSKE BANK AS-REG-S-SUB 1.50000% 20-02.09.30	120 000.00	119 018.88	0.05
EUR DEUTSCHE BANK AG-REG-S 1.12500% 18-30.08.23	480 000.00	494 487.36	0.21
EUR DEUTSCHE BANK AG-REG-S 1.62500% 19-12.02.21	200 000.00	200 982.80	0.09
EUR DNB BANK ASA-REG-S 0.05000% 19-14.11.23	335 000.00	336 621.40	0.15
EUR EDP FINANCE BV-REG-S 2.00000% 15-22.04.25	200 000.00	216 692.00	0.09
EUR EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 6.37500% 19-11.04.31	400 000.00	372 125.00	0.16
EUR ELECTRICITE DE FRANCE-REG-S 1.87500% 16-13.10.36	2 600 000.00	2 865 298.80	1.24
EUR ELENIA FINANCE OYJ-REG-S 0.37500% 20-06.02.27	100 000.00	100 227.40	0.04
EUR ELIA TRANSMISSION BELGIUM SA-REG-S 0.87500% 20-28.04.30	100 000.00	104 270.00	0.05
EUR EUROBANK SA-REG-S 2.75000% 17-02.11.20	1 100 000.00	1 102 274.80	0.48
EUR EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FAC-REG-S 1.80000% 17-10.07.48	1 700 000.00	2 403 402.20	1.04
EUR EUROPEAN STABILITY MECHANISM-REG-S 0.50000% 16-02.03.26	1 500 000.00	1 580 100.00	0.68
EUR EUROPEAN UNION-REG-S 2.50000% 12-04.11.27	1 500 000.00	1 813 050.00	0.79
EUR FMS WERTMANAGEMENT 0.37500% 15-29.04.30	1 800 000.00	1 903 986.00	0.82
EUR FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.02100% 19-06.03.24	100 000.00	97 875.00	0.04
EUR GE CAPITAL EUROPEAN FUNDING 4.62500% 07-22.02.27	1 500 000.00	1 765 173.00	0.76
EUR GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC-REG-S 1.69400% 18-26.03.25	500 000.00	502 191.00	0.22
EUR GLENCORE FINANCE EUROPE SA-REG-S 1.75000% 15-17.03.25	200 000.00	208 021.60	0.09
EUR GLOBALWORTH REAL ESTATE INVEST-REG-S 3.00000% 18-29.03.25	100 000.00	100 500.00	0.04
EUR GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 2.00000% 18-01.11.28	410 000.00	454 419.56	0.20
EUR HEIDELBERGCEMENT FIN LUX SA-REG-S 1.12500% 19-01.12.27	80 000.00	80 920.00	0.04
EUR HEINEKEN NV-REG-S 2.25000% 20-30.03.30	100 000.00	115 684.41	0.05
EUR INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALI SPA-REG-S 1.87500% 20-08.07.26	145 000.00	146 918.64	0.06
EUR KAZAKHSTAN, REPUBLIC OF-REG-S 2.37500% 18-09.11.28	800 000.00	864 750.01	0.37
EUR KBC GROUP NV-REG-S 1.12500% 19-25.01.24	200 000.00	206 568.00	0.09
EUR KION GROUP AG-REG-S 1.62500% 20-24.09.25	100 000.00	100 080.00	0.04
EUR KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU-REG-S 0.37500% 15-23.04.30	2 000 000.00	2 136 700.00	0.93
EUR MEXICO, UNITED STATES OF 3.00000% 15-06.03.45	200 000.00	203 312.50	0.09
EUR NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 1.87500% 12-13.01.23	500 000.00	526 048.00	0.23
EUR NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.25000% 20-23.01.27	390 000.00	390 982.52	0.17
EUR PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 3.75000% 17-21.02.24	300 000.00	283 218.75	0.12
EUR PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 2.87500% 14-03.03.26	1 450 000.00	1 649 099.50	0.71
EUR POLAND, REPUBLIC OF-REG-S 2.00000% 19-08.03.49	560 000.00	726 775.00	0.31
EUR RABOBANK INTERNATIONAL 4.00000% 12-11.01.22	2 000 000.00	2 110 124.00	0.91
EUR RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S 1.50000% 18-26.04.38	1 500 000.00	1 889 886.00	0.82
EUR REDEXIS GAS FINANCE BV-REG-S 1.87500% 15-27.04.27	600 000.00	632 943.12	0.27
EUR REN FINANCE B V-REG-S 2.50000% 15-12.02.25	400 000.00	441 768.00	0.19
EUR ROBERT BOSCH GMBH-REG-S 1.75000% 14-08.07.24	1 500 000.00	1 611 591.00	0.70
EUR ROMANIA-REG-S 4.62500% 19-03.04.49	1 000 000.00	1 217 812.50	0.53
EUR SANOFI-REG-S 1.75000% 14-10.09.26	1 500 000.00	1 662 749.40	0.72
EUR SCANIA CV AB-REG-S 0.50000% 20-06.10.23	100 000.00	100 313.80	0.04
EUR SVENSKA HANDELSBANKEN AB-REG-S 1.00000% 20-15.04.25	145 000.00	151 770.74	0.07
EUR TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA-REG-S 1.49100% 20-08.04.27	100 000.00	108 235.60	0.05
EUR TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA-REG-S 1.99400% 20-08.04.32	100 000.00	115 028.20	0.05
EUR UBS GROUP AG-REG-S 1.25000% 16-01.09.26	900 000.00	952 443.00	0.41
EUR UNION FENOSA FINANCE BV-REG-S 1.25000% 20-15.01.26	200 000.00	210 690.00	0.09
EUR VODAFONE GROUP PLC-REG-S 1.60000% 16-29.07.31	300 000.00	325 442.40	0.14
EUR VODAFONE GROUP PLC-REG-S 2.50000% 19-24.05.39	150 000.00	171 673.50	0.07
EUR VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG-REG-S 1.50000% 19-01.10.24	180 000.00	185 085.00	0.08
EUR WESTPAC BANKING CORP-REG-S 0.37500% 19-02.04.26	600 000.00	621 804.00	0.27
Total EUR		46 228 347.19	20.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S (Lux) ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル

2020年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD			
USD MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 8.75000% 17-09.03.24	500 000.00	476 218.39	0.21
USD PERTAMINA PERSERO PT-REG-S 4.70000% 19-30.07.49	215 000.00	197 268.20	0.08
USD SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 2.87500% 19-16.04.24	200 000.00	178 825.73	0.08
USD SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 3.50000% 19-16.04.29	785 000.00	734 483.60	0.32
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 4.00000% 18-17.04.25	600 000.00	567 304.83	0.24
Total USD		2 154 100.75	0.93
固定利付メディアム・ターム・ノート合計		48 382 447.94	20.94
メディアム・ターム・ノート、ゼロ・クーポン			
EUR			
EUR SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCH NV-REG-S 0.00000% 20-20.02.23	400 000.00	401 204.00	0.17
Total EUR		401 204.00	0.17
メディアム・ターム・ノート、ゼロ・クーポン合計		401 204.00	0.17
変動利付メディアム・ターム・ノート			
EUR			
EUR ALLIED IRISH BANKS PLC-REG-S-SUB 7.375%/VAR 15-PRP	400 000.00	401 024.00	0.17
EUR AXA SA-REG-S-SUB 3.250%/VAR 18-28.05.49	100 000.00	111 910.00	0.05
EUR BANK OF AMERICA CORP-REG-S 0.808%/VAR 19-09.05.26	900 000.00	917 346.60	0.40
EUR BANK OF AMERICA CORP-REG-S 3.648%/VAR 20-31.03.29	330 000.00	402 062.10	0.17
EUR BARCLAYS PLC-REG-S 3.375%/VAR 20-02.04.25	170 000.00	184 455.44	0.08
EUR BARCLAYS PLC-REG-S-SUB 2.625%/VAR 15-11.11.25	200 000.00	200 140.80	0.09
EUR BNP PARIBAS SA-REG-S 1.125%/VAR 20-17.04.29	500 000.00	517 550.00	0.22
EUR COMMONWEALTH BK OF AUSTRALIA-REG-S-SUB 1.936%/VAR 17-03.10.29	200 000.00	206 070.00	0.09
EUR CREDIT AGRICOLE SA-REG-S 1.000%/VAR 20-22.04.26	700 000.00	718 690.00	0.31
EUR CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S 3.250%/VAR 20-02.04.26	100 000.00	111 772.00	0.05
EUR IBERDROLA INTERNATIONAL BV-REG-S-SUB 2.625%/VAR 18-PRP	100 000.00	103 620.17	0.04
EUR ING GROEP NV-SUB 3.000%/VAR 17-11.04.28	600 000.00	632 760.24	0.27
EUR LLOYDS BANKING GROUP PLC-REG-S 3.500%/VAR 20-01.04.26	115 000.00	129 131.31	0.06
EUR NATWEST GROUP PLC-REG-S 2.000%/VAR 18-04.03.25	400 000.00	415 552.00	0.18
EUR NORDEA BANK ABP-REG-S-SUB 1.000%/VAR 19-27.06.29	230 000.00	230 232.30	0.10
EUR TOTAL SE-REG-S-SUB 2.625%/VAR 15-PRP	100 000.00	103 862.00	0.05
Total EUR		5 386 178.96	2.33
変動利付メディアム・ターム・ノート合計		5 386 178.96	2.33
固定利付債券			
CNY			
CNY CHINA DEVELOPMENT BANK CORP 3.80000% 16-25.01.36	15 000 000.00	1 836 496.57	0.79
Total CNY		1 836 496.57	0.79
EUR			
EUR ABBOTT IRELAND FINCING DAC-REG-S 0.87500% 18-27.09.23	225 000.00	231 453.45	0.10
EUR ADLER REAL ESTATE AG-REG-S 3.00000% 18-27.04.26	400 000.00	392 000.00	0.17
EUR ADO PROPERTIES SA-REG-S 1.50000% 17-26.07.24	100 000.00	95 673.40	0.04
EUR ALSTRIA OFFICE REIT-AG-REG-S 1.50000% 20-23.06.26	200 000.00	203 796.80	0.09
EUR ALTRIA GROUP INC 2.20000% 19-15.06.27	400 000.00	432 042.40	0.19
EUR APPLE INC 1.37500% 17-24.05.29	500 000.00	553 225.00	0.24

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS(Lux) ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル

2020年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
EUR AROUNDTOWN SA-REG-S 0.37500% 19-23.09.22	100 000.00	99 940.00	0.04
EUR AUSTRIA, REPUBLIC OF 2.40000% 13-23.05.34	2 500 000.00	3 388 475.00	1.47
EUR BANKIA SA-REG-S 1.12500% 15-05.08.22	1 000 000.00	1 027 600.00	0.44
EUR BELGIUM, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.90000% 15-22.06.38	2 700 000.00	3 554 469.00	1.54
EUR BNZ INTERNATIONAL FUND LTD/LONDON 0.50000% 17-03.07.24	900 000.00	928 098.00	0.40
EUR BPCE SA-REG-S 0.25000% 20-15.01.26	200 000.00	201 496.00	0.09
EUR BRISTOL MYERS SQUIBB CO 1.75000% 15-15.05.35	200 000.00	234 935.02	0.10
EUR CHUBB INA HOLDINGS INC 2.50000% 18-15.03.38	200 000.00	240 914.90	0.10
EUR CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 1.75000% 18-14.06.22	500 000.00	504 375.00	0.22
EUR DXC TECHNOLOGY CO 1.75000% 18-15.01.26	265 000.00	265 773.80	0.11
EUR EIRCOM FINANCE DAC-REG-S 3.50000% 19-15.05.26	300 000.00	298 320.00	0.13
EUR EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.00000% 16-14.04.32	2 000 000.00	2 281 604.00	0.99
EUR FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 4.00000% 06-25.10.38	1 910 000.00	3 263 349.60	1.41
EUR FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 4.50000% 09-25.04.41	1 040 000.00	1 954 663.36	0.85
EUR FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 1.50000% 19-25.05.50	700 000.00	917 754.60	0.40
EUR GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 1.25000% 17-15.08.48	1 000 000.00	1 387 044.00	0.60
EUR GREECE, HELLENIC REPUBLIC OF-144A-REG-S 1.87500% 19-23.07.26	2 210 000.00	2 381 129.14	1.03
EUR IMPERIAL BRANDS FINANCE PLC-REG-S 1.37500% 17-27.01.25	300 000.00	308 883.00	0.13
EUR INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 0.37500% 19-31.01.23	300 000.00	303 411.00	0.13
EUR INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 1.25000% 19-29.01.27	200 000.00	213 554.00	0.09
EUR INTRUM JUSTITIA AB-REG-S 3.12500% 17-15.07.24	400 000.00	376 000.00	0.16
EUR IRELAND, REPUBLIC OF-REG-S 1.70000% 17-15.05.37	730 000.00	915 471.10	0.40
EUR ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 3.250% 14-01.09.46	1 800 000.00	2 396 397.60	1.04
EUR ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 1.65000% 15-01.03.32	2 600 000.00	2 796 227.20	1.21
EUR ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 2.70000% 16-01.03.47	1 300 000.00	1 582 620.00	0.68
EUR ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 2.25000% 16-01.09.36	4 283 000.00	4 897 610.50	2.12
EUR ITALY, REPUBLIC OF-BTP 2.05000% 17-01.08.27	7 200 000.00	7 932 240.00	3.43
EUR ITALY, REPUBLIC OF-BTP-REG-S 3.00000% 19-01.08.29	1 000 000.00	1 195 092.00	0.52
EUR MATTERHORN TELECOM SA-REG-S 3.12500% 19-15.09.26	330 000.00	314 325.00	0.14
EUR MPT OPERATING PARTNERSHIP LP/FIN CORP 3.32500% 17-24.03.25	300 000.00	313 360.20	0.14
EUR NETHERLANDS, KINGDOM OF THE 4.00000% 05-15.01.37	1 200 000.00	2 041 454.40	0.88
EUR PERU, REPUBLIC OF 3.75000% 16-01.03.30	350 000.00	430 937.50	0.19
EUR PORTUGAL, REPUBLIC OF-144A-REG-S 2.87500% 15-15.10.25	2 000 000.00	2 313 195.20	1.00
EUR PORTUGAL, REPUBLIC OF-144A-REG-S 2.25000% 18-18.04.34	1 400 000.00	1 720 040.00	0.74
EUR RABOBANK NEDERLAND NV-SUB 3.87500% 13-25.07.23	3 000 000.00	3 302 880.00	1.43
EUR SLOVAKIA, REPUBLIC OF-REG-S 0.75000% 19-09.04.30	800 000.00	879 088.00	0.38
EUR SLOVENIA, REPUBLIC OF-REG-S 1.50000% 15-25.03.35	2 500 000.00	2 949 700.00	1.28
EUR SLOVENIA, REPUBLIC OF-REG-S 3.12500% 15-07.08.45	800 000.00	1 301 606.40	0.56
EUR SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 2.90000% 16-31.10.46	2 000 000.00	2 892 520.00	1.25
EUR SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.50000% 17-30.04.27	700 000.00	774 393.20	0.33
EUR SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 2.70000% 18-31.10.48	3 000 000.00	4 235 244.00	1.83
EUR SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.85000% 19-30.07.35	2 826 000.00	3 342 089.77	1.45
EUR TAURON POLSKA ENERGIA SA-REG-S 2.37500% 17-05.07.27	200 000.00	202 625.00	0.09
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV-REG-S 1.12500% 16-15.10.24	200 000.00	172 687.50	0.07
EUR UMG GROUPE VYV 1.62500% 19-02.07.29	100 000.00	102 992.28	0.04
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 3.12500% 20-15.02.26	335 000.00	314 980.40	0.14
EUR UPC HOLDING BV-REG-S 3.87500% 17-15.06.29	350 000.00	339 005.80	0.15
EUR VIVION INVESTMENTS SARL-REG-S 3.00000% 19-08.08.24	100 000.00	87 250.00	0.04
EUR VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FIN NV-REG-S 1.12500% 17-02.10.23	600 000.00	613 218.00	0.27
EUR VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FIN NV-REG-S 4.12500% 18-16.11.38	200 000.00	268 940.00	0.12
Total EUR		76 668 171.52	33.18
GBP			
GBP ROTHESAY LIFE PLC-REG-S-SUB 3.37500% 19-12.07.26	315 000.00	360 183.80	0.16
Total GBP		360 183.80	0.16

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S (Lux) ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル

2020年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
JPY			
JPY JAPAN 0.50000% 19-20.03.59	318 100 000.00	2 467 278.49	1.07
Total JPY		2 467 278.49	1.07
MXN			
MXN MEXICO, UNITED MEXICAN STATES 7.75000% 11-13.11.42	603 800.00	2 522 060.13	1.09
Total MXN		2 522 060.13	1.09
USD			
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 5.62500% 16-21.02.47	600 000.00	556 591.91	0.24
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 6.12500% 09-18.01.41	500 000.00	549 370.02	0.24
USD MOROCCO, KINGDOM OF THE-REG-S 5.50000% 12-11.12.42	500 000.00	528 317.27	0.23
USD NETFLIX INC 4.37500% 16-15.11.26	100 000.00	92 845.26	0.04
Total USD		1 727 124.46	0.75
ZAR			
ZAR SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 8.75000% 12-28.02.48	190 000 000.00	7 460 589.68	3.23
Total ZAR		7 460 589.68	3.23
固定利付債券合計		93 041 904.65	40.27
ゼロ・クーポン債			
EUR			
EUR FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.00000% 16-25.05.22	750 000.00	758 026.50	0.33
EUR FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.00000% 19-25.11.29	640 000.00	658 816.00	0.28
EUR GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 20-15.02.30	5 500 000.00	5 792 875.00	2.51
Total EUR		7 209 717.50	3.12
ゼロ・クーポン債合計		7 209 717.50	3.12
変動利付債券			
EUR			
EUR BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S 3.250%/VAR 20-PRP	130 000.00	133 492.58	0.06
EUR BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S-SUB 3.625%/VAR 20-PRP	100 000.00	102 932.00	0.04
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 4.000%/VAR 18-PRP	200 000.00	208 749.20	0.09
EUR ENGIE SA-REG-S-SUB 3.250%/VAR 19-PRP	100 000.00	107 000.00	0.05
EUR FRANCE, REPUBLIC OF-144-REG-S 0.100%/INFLAT LNKD 18-25.07.36	570 000.00	692 822.58	0.30
EUR FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 0.100%/INFLATION IDX LKD 19-01.03.29	2 200 000.00	2 441 329.93	1.06
EUR HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA-REG-S-SUB 3.000%/VAR 19-PRP	300 000.00	305 241.60	0.13
EUR ITALY, REPUBLIC OF 2.550%/CPI LINKED 09-15.09.41	1 800 000.00	2 786 943.21	1.20
EUR ITALY, REPUBLIC OF-144A-REG-S 0.400%/CPI LINKED 19-15.05.30	2 000 000.00	2 028 273.86	0.88
EUR UNIBAIL-RODAMCO SE-REG-S-SUB 2.125%/VAR 18-PRP	100 000.00	89 262.00	0.04
EUR UNIBAIL-RODAMCO SE-REG-S-SUB 2.875%/VAR 18-PRP	100 000.00	87 299.00	0.04
EUR VONOVIA FINANCE BV-REG-S-SUB 4.000%/VAR 14-PRP	100 000.00	103 612.60	0.04
Total EUR		9 086 958.56	3.93
GBP			
GBP M&G PLC-REG-S-SUB 5.625%/VAR 18-20.10.51	190 000.00	243 422.12	0.11
Total GBP		243 422.12	0.11
変動利付債券合計		9 330 380.68	4.04

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S (Lux) ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル

2020年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
固定利付米国中期国債			
USD			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.50000% 20-30.06.27	2 000 000.00	1 712 134.23	0.74
Total USD		1 712 134.23	0.74
固定利付米国中期国債合計			
		1 712 134.23	0.74
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計			
		181 691 704.14	78.64
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
変動利付アセット・バック証券			
USD			
USD SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM LLC-144A VAR 17-26.03.40	475 000.00	425 349.22	0.19
Total USD		425 349.22	0.19
変動利付アセット・バック証券合計			
		425 349.22	0.19
固定利付モーゲージ・バック証券			
USD			
USD BENCHMARK MORTGAGE TRUST-SUB 3.97900% 19-01.03.62	750 000.00	742 657.78	0.32
USD HILTON USA TRUST-144A-SUB 5.51909% 16-01.11.35	675 000.00	570 605.28	0.25
USD MSBAM LYNCH TRUST-SUB 3.99400% 16-01.12.49	313 000.00	300 085.48	0.13
Total USD		1 613 348.54	0.70
固定利付モーゲージ・バック証券合計			
		1 613 348.54	0.70
変動利付モーゲージ・バック証券			
USD			
USD AVENTURA MALL TRUST-144A FLR 18-01.07.40	650 000.00	589 790.65	0.25
USD BAML COMMERCIAL MORT SET-144A 1M LIBOR+135BP 18-15.09.34	550 000.00	441 423.72	0.19
USD BANK 2017-BNK9 VAR 17-01.11.54	450 000.00	439 540.62	0.19
USD BANK-SUB FLR 18-01.02.61	505 000.00	430 375.42	0.19
USD BBCMS TRUST CBM-144A 1M LIBOR+119.1098BP 18-15.07.37	550 000.00	433 989.75	0.19
USD BENCHMARK MORTGAGE TRUST VAR 18-01.02.51	250 000.00	244 221.98	0.11
USD BENCHMARK MORTGAGE TRUST-SUB FLR 18-01.10.51	550 000.00	474 870.78	0.21
USD CMB COMM MORTGAGE TRUST-144A-SUB 1M LIBOR+145BP 19-15.12.37	175 000.00	148 484.93	0.06
USD CMB COMM MORTGAGE TRUST-144A-SUB 1M LIBOR+175BP 19-15.12.37	430 000.00	365 786.49	0.16
USD CHT COSMO MORTGAGE TRUST-144A-SUB 1M LIBOR+225BP 17-15.11.36	600 000.00	485 993.71	0.21
USD CORE TRUST CORE-144A 1M LIBOR+110BP 19-15.12.31	230 000.00	193 348.74	0.08
USD JP MORGAN CHASE MORTGAGE SECURITIES-144A-SUB FLR 18-01.01.31	685 000.00	584 703.88	0.25
USD JPMDB COMM MORTGAGE SECURITIES TRUST VAR 17-01.03.50	450 000.00	430 403.74	0.19
USD WORLDWIDE PLAZA TRUST-144A-SUB FLR 17-01.11.36	950 000.00	859 628.11	0.37
Total USD		6 122 562.52	2.65
変動利付モーゲージ・バック証券合計			
		6 122 562.52	2.65

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S (Lux) ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル

2020年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
固定利付ノート			
EUR			
EUR ALTICE FRANCE HOLDING SA-REG-S 8.00000% 19-15.05.27	195 000.00	206 700.00	0.09
Total EUR		206 700.00	0.09
USD			
USD ABBVIE INC-144A 4.75000% 20-15.03.45	140 000.00	144 279.09	0.06
USD BROADCOM INC 3.15000% 20-15.11.25	200 000.00	184 731.80	0.08
USD BROADCOM INC 4.70000% 20-15.04.25	200 000.00	193 802.49	0.08
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP-144A 5.30000% 19-01.10.29	280 000.00	273 851.36	0.12
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP-144A 5.85000% 20-15.07.25	200 000.00	198 727.96	0.09
USD ENLINK MIDSTREAM PARTNERS LP 4.40000% 14-01.04.24	110 000.00	84 424.17	0.04
USD INFOR INC-144A 1.75000% 20-15.07.25	90 000.00	78 958.24	0.03
USD NXP BV / NXP FDNG LLC / NXP USA-144A 2.70000% 20-01.05.25	40 000.00	36 135.69	0.01
USD ONCOR ELECTRIC DELIVERY CO 3.70000% 19-15.11.28	40 000.00	40 116.09	0.02
Total USD		1 235 026.89	0.53
固定利付ノート合計		1 441 726.89	0.62
固定利付債券			
EUR			
EUR PANTHER BF AGGR 2/PANTHER FIN CO-REG-S 4.37500% 19-15.05.26	400 000.00	400 500.00	0.17
Total EUR		400 500.00	0.17
固定利付債券合計		400 500.00	0.17
変動利付債券			
NZD			
NZD NEW ZEALAND 2.500%/CPI LINKED 17-20.09.40	14 000 000.00	12 878 894.35	5.58
NZD NEW ZEALAND 3.000%/CPI LINKED 13-20.09.30	3 000 000.00	2 521 038.72	1.09
NZD NEW ZEALAND-REG-S 2.500%/CPI LINKED 14-20.09.35	8 000 000.00	7 054 214.09	3.05
Total NZD		22 454 147.16	9.72
変動利付債券合計		22 454 147.16	9.72
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		32 457 634.33	14.05
最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
固定利付ノート			
USD			
USD NXP BV / NXP FDNG LLC / NXP USA-144A 3.15000% 20-01.05.27	100 000.00	92 166.79	0.04
Total USD		92 166.79	0.04
固定利付ノート合計		92 166.79	0.04
最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		92 166.79	0.04

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル

2020年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
2010年12月17日のルクセンブルグ投信法（改訂済）第41条(1)e)に準拠した投資信託 / その他の投資信託			
投資信託、オープン・エンド型			
ルクセンブルグ			
USD UBS (LUX) BOND SICAV - MULTI INCOME (USD) U-X-ACC	320.00	2 803 780.16	1.21
ルクセンブルグ合計		2 803 780.16	1.21
投資信託、オープン・エンド型合計		2 803 780.16	1.21
2010年12月17日のルクセンブルグ投信法（改訂済）第41条(1)e)に準拠した投資信託 / その他の投資信託合計			
		2 803 780.16	1.21
投資有価証券合計		217 045 285.42	93.94

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

EUR EURO BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 08.12.20	-60.00	-124 200.00	-0.05
EUR SHORT EURO BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 08.12.20	40.00	14 400.00	0.01
EUR EURO-BUND FUTURE 08.12.20	-42.00	-15 880.00	-0.01
EUR EURO-BOBL FUTURE 08.12.20	135.00	0.00	0.00
EUR EURO-SCHATZ FUTURE 08.12.20	280.00	-4 200.00	0.00
EUR EURO-BUXL FUTURE 08.12.20	8.00	19 200.00	0.01
EUR EURO-OAT FUTURE 08.12.20	125.00	101 250.00	0.04
GBP LONG GILT FUTURE 29.12.20	20.00	23 592.65	0.01
CAD CAN 10YR BOND FUTURE 18.12.20	-69.00	9 582.68	0.00
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 21.12.20	-85.00	-54 364.05	-0.02
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.12.20	-30.00	-10 626.29	-0.01
USD US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 21.12.20	27.00	5 756.19	0.00
JPY JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 14.12.20	36.00	64 000.13	0.03
債券に係る金融先物合計		28 511.31	0.01
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		28 511.31	0.01

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も取引されていない派生商品

金利に係るスワップおよびフォワード・スワップ

GBP LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER 1.63200% 18-15.06.48	-2 000 000.00	-627 750.54	-0.27
GBP LCH/INTEREST RATE SWAP REC 6ML 18-15.06.48			
JPY LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER 0.86375% 18-22.06.48	-400 000 000.00	-482 308.16	-0.21
JPY LCH/INTEREST RATE SWAP REC 6ML 18-22.06.48			
GBP LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER 1.62336% 18-27.06.48	-2 500 000.00	-778 440.67	-0.34
GBP LCH/INTEREST RATE SWAP REC 6ML 18-27.06.48			
GBP LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER 1.62540% 18-29.06.48	-2 750 000.00	-857 973.32	-0.37
GBP LCH/INTEREST RATE SWAP REC 6ML 18-29.06.48			
GBP LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER 1.59000% 18-25.07.48	-2 000 000.00	-603 096.98	-0.26
GBP LCH/INTEREST RATE SWAP REC 6ML 18-25.07.48			
NZD LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER 2.27500% 18-17.10.22	-27 000 000.00	-840 058.34	-0.36

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS(Lux) ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル

2020年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
NZD LCH/INTEREST RATE SWAP REC 3MF 18-17.10.22			
JPY LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER 0.91000% 18-22.11.48	-280 000 000.00	-370 862.02	-0.16
JPY LCH/INTEREST RATE SWAP REC 6ML 18-22.11.48			
JPY LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER 0.71375% 18-27.12.48	-360 000 000.00	-315 672.65	-0.14
JPY LCH/INTEREST RATE SWAP REC 6ML 18-27.12.48			
JPY LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER 0.68000% 19-05.03.49	-630 000 000.00	-499 090.37	-0.22
JPY LCH/INTEREST RATE SWAP REC 6ML 19-05.03.49			
JPY LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER 0.54275% 19-10.04.49	-175 000 000.00	-87 294.83	-0.04
JPY LCH/INTEREST RATE SWAP REC 6ML 19-10.04.49			
NZD LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER 1.58300% 24-24.09.29	-19 000 000.00	-456 435.62	-0.20
NZD LCH/INTEREST RATE SWAP REC 3MF 24-24.09.29			
NZD LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER 1.20750% 19-27.09.29	-11 200 000.00	-436 010.34	-0.19
NZD LCH/INTEREST RATE SWAP REC 3MF 19-27.09.29			
NZD LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER 1.67500% 24-30.10.29	-18 000 000.00	-469 231.03	-0.20
NZD LCH/INTEREST RATE SWAP REC 3MF 24-30.10.29			
GBP LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER 1.14124% 19-13.12.49	-1 700 000.00	-300 435.61	-0.13
GBP LCH/INTEREST RATE SWAP REC 6ML 19-13.12.49			
PLN LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER 2.11600% 20-23.01.30	-24 500 000.00	-681 476.77	-0.30
PLN LCH/INTEREST RATE SWAP REC 6MWIB 20-23.01.30			
PLN LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER 1.91900% 20-10.02.30	-29 000 000.00	-680 582.67	-0.29
PLN LCH/INTEREST RATE SWAP REC 6MWIBR 20-10.02.30			
PLN LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER 1.66500% 20-27.02.30	-22 000 000.00	-393 789.10	-0.17
PLN LCH/INTEREST RATE SWAP REC 6MWIBR 20-27.02.30			
USD LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER 1.29910% 20-03.03.50	-1 000 000.00	-42 525.60	-0.02
USD LCH/INTEREST RATE SWAP REC 3ML 20-03.03.50			
PLN LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER 1.34000% 20-06.03.30	-16 000 000.00	-174 318.14	-0.08
PLN LCH/INTEREST RATE SWAP REC 6MWIBR 20-06.03.30			
PLN LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER 0.88000% 20-07.05.30	-10 000 000.00	1 731.68	0.00
PLN LCH/INTEREST RATE SWAP REC 6MWIB 20-07.05.30			
USD LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER 0.96460% 20-25.08.50	-2 600 000.00	85 785.24	0.04
USD LCH/INTEREST RATE SWAP REC 3ML 20-25.08.50			
MXN CME/INTEREST RATE SWAP REC 8.07000% 18-26.06.28	135 000 000.00	849 097.37	0.37
MXN CME/INTEREST RATE SWAP PAYER MXI 18-26.06.28			
MXN CME/INTEREST RATE SWAP REC 8.13500% 18-12.07.28	120 000 000.00	780 345.57	0.34
MXN CME/INTEREST RATE SWAP PAYER MXI 18-12.07.28			
GBP LCH/INTEREST RATE SWAP REC 1.77500% 18-16.11.48	1 100 000.00	398 502.21	0.17
GBP LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER 6ML 18-16.11.48			
CNY LCH/INTEREST RATE SWAP REC 2.89500% 18-20.11.21	133 000 000.00	99 726.36	0.04
CNY LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER CNRR007 18-20.11.21			
GBP LCH/INTEREST RATE SWAP REC 1.59100% 19-15.01.49	1 100 000.00	337 893.17	0.15
GBP LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER 6ML 19-15.01.49			
GBP LCH/INTEREST RATE SWAP REC 1.22300% 19-07.06.49	1 000 000.00	198 693.04	0.09
GBP LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER 6ML 19-07.06.49			
GBP LCH/INTEREST RATE SWAP REC 1.18689% 19-20.06.49	1 000 000.00	187 768.38	0.08
GBP LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER 6ML 19-20.06.49			
CNY CITI/INTEREST RATE SWAP REC 2.77000% 19-28.08.24	80 000 000.00	68 107.77	0.03
CNY CITI/INTEREST RATE SWAP PAYER CNRR007 19-28.08.24			
CAD LCH/INTEREST RATE SWAP REC 1.83100% 24-19.09.29	16 500 000.00	285 654.94	0.12
CAD LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER 3MC 24-19.09.29			
CNY CITI/INTEREST RATE SWAP REC 2.44500% 20-04.03.25	55 000 000.00	-50 998.25	-0.02
CNY CITI/INTEREST RATE SWAP PAYER CNRR007 20-04.03.25			
CNY JPMORGAN/INTEREST RATE SWAP REC 2.15000% 20-04.06.25	65 000 000.00	-175 410.44	-0.08
CNY JPMORGAN/IRS PAYER CNRR007 20-04.06.25			
CNY JPMORGAN/INTEREST RATE SWAP REC 2.30000% 20-05.06.25	135 000 000.00	-251 980.44	-0.11

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS(Lux) ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル

2020年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
CNY JPMORGAN/INTEREST RATE SWAP PAYER CNRR007 20-05.06.25			
CNY HSBC/INTEREST RATE SWAP REC 2.30500% 20-08.06.25	65 000 000.00	-119 902.93	-0.05
CNY HSBC/INTEREST RATE SWAP PAYER CNRR007 20-08.06.25			
CNY JPMORGAN/INTEREST RATE SWAP REC 2.23500% 20-10.06.25	50 000 000.00	-111 753.61	-0.05
CNY JPMORGAN/INTEREST RATE SWAP PAYER CNRR007 20-10.06.25			
CNY CITI/INTEREST RATE SWAP REC 2.27000% 20-11.06.25	50 000 000.00	-101 844.03	-0.04
CNY CITI/INTEREST RATE SWAP PAYER CNRR007 20-11.06.25			
CNY JPMORGAN/INTEREST RATE SWAP REC 2.19500% 20-12.06.25	48 000 000.00	-117 611.32	-0.05
CNY JPMORGAN/INTEREST RATE SWAP PAYER CNRR007 20-12.06.25			
INR CITI/INTEREST RATE SWAP REC 4.40000% 20-24.08.25	1 140 000 000.00	-10 827.76	0.00
INR CITI/INTEREST RATE SWAP PAYER 6MFBCMP 20-24.08.25			
金利に係るスワップおよびフォワード・スワップ合計		-6 744 375.81	-2.92

クレジット・デフォルト・スワップ *

USD BOA/MEX CREDIT DEFAULT SWAP PAYER 1.00000% 19-20.06.24	-3 200 000.00	11 388.36	0.00
USD CITIBANK/BRAZIL CREDIT DEFAULT SWAP PAYER 1.00000% 19-20.06.24	-1 900 000.00	61 221.27	0.03
USD JPMORGAN/BRAZIL CREDIT DEFAULT SWAP PAYER 1.00000% 19-20.06.24	-1 900 000.00	61 221.27	0.03
EUR ICE/ITRAXX EUROPE 27 JUN22 CDI REC 1.00000% 17-20.06.22	11 300 000.00	148 185.69	0.06
EUR ICE/ITRX EUXOVER 28 CDI REC 5.00000% 17-20.12.22	6 439 930.00	228 996.76	0.10
USD BOA/TURKEY CREDIT DEFAULT SWAP REC 1.00000% 19-20.06.24	3 200 000.00	-381 930.98	-0.17
USD CITIBANK/SOAF CREDIT DEFAULT SWAP REC 1.00000% 19-20.06.24	1 900 000.00	-100 318.51	-0.04
USD JPMORGAN/SOAF CREDIT DEFAULT SWAP REC 1.00000% 19-20.06.24	1 900 000.00	-100 318.51	-0.04
クレジット・デフォルト・スワップ合計		-71 554.65	-0.03

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も取引されていない派生商品合計

-6 815 930.46 -2.95

派生商品合計

-6 787 419.15 -2.94

為替予約契約

購入通貨	購入額	売却通貨	売却額	満期日		
MYR	4 004 000.00	USD	959 133.81	6.10.2020	3 677.08	0.00
USD	1 971 642.86	PHP	95 950 000.00	6.10.2020	-6 416.08	0.00
IDR	14 908 000 000.00	USD	1 014 770.95	6.10.2020	-11 315.74	0.00
KRW	1 134 000 000.00	USD	958 725.76	6.10.2020	9 824.96	0.00
INR	69 990 000.00	USD	951 209.57	6.10.2020	-2 208.00	0.00
RUB	68 572 000.00	USD	919 300.46	6.10.2020	-30 494.36	-0.01
USD	1 960 516.43	TWD	57 400 000.00	6.10.2020	-18 525.32	-0.01
CNY	5 260 000.00	USD	764 812.80	9.10.2020	8 570.19	0.00
CLP	668 200 000.00	USD	853 875.15	6.10.2020	-4 854.88	0.00
BRL	3 540 000.00	USD	643 964.20	6.10.2020	-13 589.13	-0.01
COP	3 775 496 000.00	USD	999 363.67	6.10.2020	-16 962.99	-0.01
EUR	2 879 174.00	CAD	4 465 000.00	6.10.2020	28 687.39	0.01
EUR	529 165.37	AUD	855 000.00	6.10.2020	6 582.20	0.00
EUR	471 458.98	CHF	510 000.00	6.10.2020	-1 919.92	0.00
USD	1 030 000.00	SGD	1 402 623.10	6.10.2020	2 142.10	0.00
GBP	300 000.00	EUR	337 328.43	6.10.2020	-6 596.64	0.00

* 額面がプラスの場合：サブ・ファンドは「受取側」であり、額面がマイナスの場合：サブ・ファンドは「支払側」である。

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS(Lux) ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル

2020年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面		評価額	純資産
			ユーロ	割合
			先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	(%)
為替予約契約(続き)				
購入通貨	購入額	売却通貨	売却額	満期日
EUR	3 824 920.10	JPY	481 900 000.00	6.10.2020
EUR	23 679 100.78	NZD	41 585 000.00	6.10.2020
EUR	4 326 150.69	MXN	112 500 000.00	6.10.2020
NOK	45 340 000.00	EUR	4 355 207.20	6.10.2020
PLN	2 250 000.00	EUR	509 850.40	6.10.2020
EUR	1 711 710.64	SEK	17 630 000.00	6.10.2020
EUR	2 398 257.03	THB	89 140 000.00	6.10.2020
EUR	30 525 770.72	USD	36 255 000.00	6.10.2020
EUR	7 838 592.94	ZAR	156 190 000.00	6.10.2020
TWD	30 168 700.00	USD	1 030 000.00	6.10.2020
EUR	206 959.12	PLN	915 000.00	6.10.2020
EUR	233 482.12	NZD	410 000.00	6.10.2020
HUF	308 086 400.00	EUR	860 000.00	6.10.2020
USD	1 000 000.00	EUR	844 754.41	6.10.2020
JPY	108 842 431.00	EUR	865 000.00	6.10.2020
JPY	109 342 481.00	CAD	1 350 000.00	6.10.2020
CAD	1 336 174.50	NZD	1 525 000.00	6.10.2020
USD	465 000.00	EUR	393 861.39	6.10.2020
JPY	107 939 406.00	AUD	1 405 000.00	6.10.2020
USD	870 618.89	CLP	668 200 000.00	6.10.2020
COP	3 581 567 000.00	USD	962 786.83	6.10.2020
PLN	3 850 000.00	SEK	8 992 483.50	6.10.2020
GBP	149 265.45	MXN	4 050 000.00	6.10.2020
RUB	76 913 437.50	USD	1 025 000.00	6.10.2020
USD	1 025 000.00	NZD	1 518 490.85	6.10.2020
EUR	369 902.34	MXN	9 220 000.00	6.10.2020
NOK	9 444 020.00	NZD	1 525 000.00	6.10.2020
CZK	23 402 575.00	EUR	865 000.00	6.10.2020
PLN	2 500 000.00	EUR	556 767.33	6.10.2020
USD	965 928.45	KRW	1 134 000 000.00	6.10.2020
KRW	1 134 000 000.00	USD	965 936.68	5.11.2020
USD	769 681.01	CNY	5 260 000.00	9.10.2020
CNY	5 260 000.00	USD	767 939.27	5.11.2020
AUD	1 415 000.00	JPY	104 741 696.00	6.10.2020
USD	940 730.53	TWD	27 300 000.00	5.11.2020
TWD	27 231 300.00	USD	932 898.25	6.10.2020
USD	947 731.89	INR	69 990 000.00	6.10.2020
INR	69 990 000.00	USD	944 630.02	5.11.2020
CAD	1 350 000.00	JPY	106 361 100.00	6.10.2020
USD	997 190.64	IDR	14 908 000 000.00	6.10.2020
USD	1 821 641.99	RUB	145 485 437.50	6.10.2020
USD	1 976 883.14	PHP	95 950 000.00	5.11.2020
RUB	145 485 500.00	USD	1 815 856.31	5.11.2020
IDR	14 908 000 000.00	USD	993 866.67	5.11.2020
MYR	4 004 000.00	USD	960 537.36	5.11.2020
USD	960 883.13	MYR	4 004 000.00	6.10.2020
PHP	95 950 000.00	USD	1 979 003.38	6.10.2020
USD	969 645.15	KRW	1 134 000 000.00	6.10.2020
KRW	1 134 000 000.00	USD	969 645.15	6.10.2020
USD	771 589.09	CNY	5 260 000.00	9.10.2020

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル

2020年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面		評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
為替予約契約（続き）				
購入通貨	購入額	売却通貨	売却額	満期日
USD	971 639.11	KRW	1 134 000 000.00	5.11.2020
THB	31 980 000.00	USD	1 011 695.55	6.10.2020
BRL	3 540 000.00	USD	625 331.21	5.11.2020
USD	625 773.38	BRL	3 540 000.00	6.10.2020
USD	1 901 049.87	COP	7 357 063 000.00	6.10.2020
COP	7 357 063 000.00	USD	1 897 862.25	5.11.2020
TWD	57 400 000.00	USD	1 982 044.20	6.10.2020
USD	1 041 736.88	TWD	30 168 700.00	6.10.2020
USD	940 307.32	TWD	27 231 300.00	6.10.2020
MXN	9 090 000.00	EUR	348 194.60	6.10.2020
為替予約契約合計				
			-573 312.35	-0.25
銀行預金、要求払い預金および貯蓄預金ならびにその他の流動資産			26 817 382.36*	11.61
当座借越およびその他の短期負債			-6 760 479.79	-2.93
その他の資産および負債			1 310 408.57	0.57
純資産合計			231 051 865.06	100.00

* 2020年9月30日現在、956,000.00ユーロの現金が取引相手方であるJ Pモルガンに対する担保、410,000.00ユーロの現金が取引相手方であるバンク・オブ・アメリカに対する担保および330,000.00ユーロの現金が取引相手方であるシティバンクに対する担保となっている。

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S (Lux) ボンド・ファンド - フルサイクル・アジア・ボンド (米ドル)

2020年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	評価額 米ドル 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD			
USD BHARTI AIRTEL LTD-REG-S 4.37500% 15-10.06.25	750 000.00	792 187.50	0.25
USD CENTRAL CHINA REAL ESTATE-REG-S 7.25000% 19-24.04.23	425 000.00	425 000.00	0.13
USD CENTRAL CHINA REAL ESTATE-REG-S 7.25000% 20-16.07.24	600 000.00	583 500.00	0.18
USD CENTRAL CHINA REAL ESTATE-REG-S 7.65000% 20-27.08.23	1 200 000.00	1 200 000.00	0.37
USD CHINA HUANENG GP HK TREASURY MGT-REG-S 2.60000% 19-10.12.24	4 000 000.00	4 172 499.99	1.30
USD CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 5.12500% 18-14.03.28	975 000.00	1 113 937.50	0.35
USD CNOOC FINANCE 2015 USA LLC 4.37500% 18-02.05.28	1 250 000.00	1 461 718.75	0.45
USD EASY TACTIC LTD-REG-S 8.12500% 19-11.07.24	2 850 000.00	2 382 421.88	0.74
USD ENN ENERGY HOLDINGS LTD-REG-S 2.62500% 20-17.09.30	3 375 000.00	3 382 837.76	1.05
USD FANTASIA HOLDINGS GROUP CO LTD-REG-S 12.25000% 19-18.10.22	200 000.00	205 500.00	0.06
USD FANTASIA HOLDINGS GROUP CO LTD-REG-S 9.25000% 20-28.07.23	1 375 000.00	1 301 953.13	0.41
USD FORTUNE STAR BVI LTD-REG-S 6.85000% 20-02.07.24	3 400 000.00	3 531 750.00	1.10
USD HARVEST OPERATIONS CORP-REG-S 4.20000% 18-01.06.23	850 000.00	924 375.00	0.29
USD HEJUN SHUNZE INVESTMENT CO LTD-REG-S 11.00000% 20-04.06.22	700 000.00	707 000.00	0.22
USD HUTCHISON WHAMPOA INTL 12 II LTD-REG-S 3.25000% 12-08.11.22	2 000 000.00	2 090 500.00	0.65
USD HYUNDAI CAPITAL AMERICA-REG-S 2.65000% 20-10.02.25	500 000.00	514 899.90	0.16
USD HYUNDAI CAPITAL AMERICA-REG-S 3.00000% 20-10.02.27	2 000 000.00	2 066 542.00	0.64
USD INTERNATIONAL CONT TERM SERV-REG-S 4.75000% 20-17.06.30	1 250 000.00	1 306 250.00	0.41
USD KAISA GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 10.87500% 19-23.07.23	500 000.00	500 000.00	0.16
USD KAISA GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 10.50000% 20-15.01.25	850 000.00	822 375.00	0.26
USD KAISA GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 11.25000% 20-16.04.25	6 675 000.00	6 541 500.00	2.04
USD LLPL CAPITAL PTE LTD-REG-S 6.87500% 19-04.02.39	800 000.00	862 002.00	0.27
USD NEW METRO GLOBAL LTD-REG-S 7.50000% 19-16.12.21	400 000.00	407 500.00	0.13
USD NISSAN MOTOR CO LTD-REG-S 4.34500% 20-17.09.27	4 775 000.00	4 792 476.50	1.49
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 2.45700% 20-05.05.30	3 425 000.00	3 690 437.50	1.15
USD PLDT INC-REG-S 2.50000% 20-23.01.31	1 650 000.00	1 691 250.00	0.53
USD REC LTD-REG-S 3.50000% 19-12.12.24	850 000.00	863 015.63	0.27
USD REC LTD-REG-S 4.75000% 20-19.05.23	875 000.00	923 125.00	0.29
USD REDSUN PROPERTIES GROUP LTD-REG-S 9.70000% 20-16.04.23	225 000.00	229 640.63	0.07
USD RONSHINE CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 7.35000% 20-15.12.23	2 675 000.00	2 606 453.13	0.81
USD SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD-REG-S 4.60000% 20-13.07.30	1 275 000.00	1 348 312.50	0.42
USD SHUI ON DEVELOPMENT HOLDING LTD-REG-S 6.15000% 20-24.08.24	4 125 000.00	4 109 531.25	1.28
USD SRILANKAN AIRLINES LTD-REG-S 7.00000% 19-25.06.24	525 000.00	360 281.25	0.11
USD STUDIO CITY FINANCE LTD-REG-S 6.50000% 20-15.01.28	2 900 000.00	2 972 036.00	0.92
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 7.00000% 20-09.07.25	2 300 000.00	2 219 500.00	0.69
USD TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP 2.00000% 20-03.09.30	1 850 000.00	1 815 097.35	0.56
USD VEDANTA RESOURCES PLC-REG-S 7.12500% 13-31.05.23	500 000.00	380 625.00	0.12
USD VEDANTA RESOURCES PLC-REG-S 6.37500% 17-30.07.22	2 000 000.00	1 602 500.00	0.50
USD WYNN MACAU LTD-REG-S 5.50000% 20-15.01.26	650 000.00	638 943.50	0.20
USD YANGO JUSTICE INTERNATIONAL LTD-REG-S 7.50000% 20-15.04.24	2 075 000.00	2 069 812.50	0.64
USD YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD-REG-S 7.85000% 20-12.08.26	2 225 000.00	2 169 375.00	0.67
USD YUZHOU PROPERTIES CO LTD-REG-S 8.37500% 19-30.10.24	900 000.00	929 531.25	0.29
USD ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD-REG-S 7.35000% 20-05.02.25	1 975 000.00	1 915 750.00	0.60
Total USD		74 623 944.40	23.23
固定利付ノート		74 623 944.40	23.23

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S (Lux) ボンド・ファンド - フルサイクル・アジア・ボンド (米ドル)

2020年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	評価額 米ドル 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
変動利付ノート			
USD			
USD CHINA DEV BANK FIN LEASING-REG-S-SUB 2.875%/VAR 20-28.09.30	5 075 000.00	5 057 083.22	1.57
USD IND & COM BK CHINA MACAU-REG-S-SUB 2.875%/VAR 19-12.09.29	2 100 000.00	2 142 751.17	0.67
Total USD		7 199 834.39	2.24
変動利付ノート合計		7 199 834.39	2.24
固定利付ミディアム・ターム・ノート			
USD			
USD AIRPORT AUTHORITY HONG KONG-REG-S 3.45000% 19-21.02.29	450 000.00	505 186.91	0.16
USD AXIATA SPV5 LABUAN LTD-REG-S 3.06400% 20-19.08.50	3 225 000.00	3 049 054.32	0.95
USD BANK OF CHINA LTD/PARIS 0.95000% 20-21.09.23	9 750 000.00	9 714 128.77	3.02
USD BANK OF CHINA/HONG KONG-REG-S 3.62500% 19-17.04.29	2 000 000.00	2 259 375.00	0.70
USD BDO UNIBANK INC-REG-S 2.12500% 20-13.01.26	5 550 000.00	5 522 250.00	1.72
USD BOC AVIATION LTD-REG-S 3.50000% 19-10.10.24	1 450 000.00	1 530 895.93	0.48
USD BOCOM LEASING MGT HONG KONG-REG-S 4.37500% 19-22.01.24	950 000.00	1 022 734.38	0.32
USD BPRL INTERNATIONAL SINGAPORE PTE-REG-S 4.37500% 17-18.01.27	6 600 000.00	6 921 750.00	2.15
USD CASTLE PEAK POWER FINANCE CO LTD-REG-S 2.20000% 20-22.06.30	1 650 000.00	1 678 786.89	0.52
USD CHINA DEVELOPMENT BANK-REG-S 3.00000% 16-01.06.26	1 000 000.00	1 095 625.00	0.34
USD CHINA EVERGRANDE GROUP-REG-S 9.50000% 17-29.03.24	475 000.00	389 648.43	0.12
USD CHINA OVERSEAS FINAN CAYMAN VIII-REG-S 2.75000% 20-02.03.30	500 000.00	508 750.00	0.16
USD CITIC LTD-REG-S 4.00000% 18-11.01.28	1 200 000.00	1 331 250.00	0.41
USD CLP POWER HONG KONG FINANCING LTD-REG-S 2.12500% 20-30.06.30	4 025 000.00	4 072 331.18	1.27
USD CMB INTERNATIONAL LEASING MGT LTD-REG-S 2.75000% 20-12.08.30	1 150 000.00	1 130 624.57	0.35
USD HUARONG FINANCE-REG-S 3.75000% 19-29.05.24	10 000 000.00	10 446 875.00	3.25
USD ICBCIL FINANCE CO LTD-REG-S 2.75000% 16-19.05.21	200 000.00	201 562.50	0.06
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 4.75000% 17-18.07.47	1 525 000.00	1 852 875.00	0.58
USD INDUSTRIAL COMMERCIAL BANK CHINA-REG-S 1.20000% 20-09.09.25	2 725 000.00	2 692 452.06	0.84
USD LENOVO GROUP LTD-REG-S 5.87500% 20-24.04.25	2 175 000.00	2 336 843.49	0.73
USD MTR CORP LTD-REG-S 1.62500% 20-19.08.30	3 250 000.00	3 204 486.12	1.00
USD NAN FUNG TREASURY LTD-REG-S 3.87500% 17-03.10.27	3 000 000.00	3 105 998.40	0.97
USD NTPC LTD-REG-S 4.50000% 18-19.03.28	2 975 000.00	3 175 812.50	0.99
USD OVERSEA-CHINESE BANKING CORP-REG-S-SUB 4.25000% 14-19.06.24	3 500 000.00	3 818 281.25	1.19
USD PERTAMINA PT-REG-S 6.50000% 18-07.11.48	1 800 000.00	2 403 562.50	0.75
USD PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 3.50000% 20-21.04.30	825 000.00	923 045.80	0.29
USD PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 4.55000% 20-21.04.50	1 300 000.00	1 655 875.00	0.51
USD PSA TREASURY PTE LTD-REG-S 2.12500% 19-05.09.29	2 500 000.00	2 605 679.75	0.81
USD SHINHAN FIN GROUP CO LTD-REG-S 1.35000% 20-10.01.26	4 075 000.00	4 070 519.95	1.27
USD SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD-REG-S 5.10000% 20-16.07.23	500 000.00	459 843.75	0.14
USD SIAM COMMERCIAL BK CAYMAN ISLAND-REG-S 2.75000% 17-16.05.23	2 350 000.00	2 428 578.13	0.76
USD SIAM COMMERCIAL BK CAYMAN ISLAND-REG-S 4.40000% 19-11.02.29	2 625 000.00	3 061 406.25	0.95
USD SINGTEL GROUP TREASURY PTE LTD-REG-S 3.25000% 15-30.06.25	1 000 000.00	1 102 300.00	0.34
USD SP POWERASSETS LTD-REG-S 3.25000% 15-24.11.25	1 000 000.00	1 110 190.00	0.35
USD STATE GRID OVERSEAS INVESTMENT-REG-S 3.50000% 17-04.05.27	2 150 000.00	2 398 593.75	0.75
USD SUN HUNG KAI PROP CAP MRKT LTD-REG-S 2.87500% 20-21.01.30	5 500 000.00	5 829 441.20	1.81
USD TEMASEK FINANCIAL I LTD-REG-S 2.50000% 20-06.10.70	5 000 000.00	4 897 550.00	1.52
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.92500% 18-19.01.38	1 000 000.00	1 140 625.00	0.35
USD THAI OIL TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 3.75000% 20-18.06.50	4 575 000.00	4 397 718.75	1.37
USD YES BANK IFSC BANKING UNIT BR-REG-S 3.75000% 18-06.02.23	1 800 000.00	1 702 125.00	0.53

Total USD

111 754 632.53 34.78

固定利付ミディアム・ターム・ノート合計

111 754 632.53 34.78

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S (Lux) ボンド・ファンド - フルサイクル・アジア・ボンド (米ドル)

2020年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	評価額 米ドル 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
変動利付メディアム・ターム・ノート			
USD			
USD BANGKOK BANK PCL/HONG KONG-REG-S-SUB 5.000%/VAR 20-PRP	6 475 000.00	6 475 000.00	2.02
USD DBS GROUP HOLDINGS LTD-REG-S-SUB 4.520%/VAR 18-11.12.28	1 000 000.00	1 088 090.00	0.34
USD KASIKORNBANK PCL/HONG KONG-REG-S-SUB 3.343%/VAR 19-02.10.31	1 000 000.00	980 312.50	0.31
USD SHINHAN FIN GROUP CO LTD-REG-S-SUB 3.340%/VAR 19-05.02.30	2 675 000.00	2 807 078.13	0.87
USD UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S-SUB 3.750%/VAR 19-15.04.29	2 850 000.00	3 034 281.00	0.94
USD WING LUNG BANK LTD-REG-S-SUB 3.750%/H15T5Y+175BP 17-22.11.27	625 000.00	638 220.63	0.20
Total USD		15 022 982.26	4.68
変動利付メディアム・ターム・ノート合計		15 022 982.26	4.68
固定利付債券			
USD			
USD BANK RAKYAT INDONESIA-REG-S 3.95000% 19-28.03.24	725 000.00	768 953.12	0.24
USD BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO-REG-S-SUB 4.20000% 20-23.01.25	250 000.00	249 296.87	0.08
USD BLUESTAR FINANCE HOLDINGS LTD-REG-S 3.50000% 16-30.09.21	1 000 000.00	1 017 187.50	0.32
USD CHINA CLEAN ENERGY DEVELOPMENT-REG-S 4.00000% 15-05.11.25	2 725 000.00	3 029 007.81	0.94
USD CHINA EVERGRANDE GROUP-REG-S 7.50000% 17-28.06.23	700 000.00	555 537.50	0.17
USD CHINA HUADIAN OVERSEAS DEVP18 LTD-REG-S 3.87500% 18-17.05.23	1 800 000.00	1 909 800.00	0.59
USD CMHI FINANCE BVI CO LTD-REG-S 5.00000% 18-06.08.28	1 750 000.00	2 068 828.13	0.64
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 5.12500% 20-14.01.27	1 450 000.00	1 535 187.50	0.48
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 5.62500% 20-14.01.30	2 600 000.00	2 808 000.00	0.87
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 4.80000% 20-06.08.30	950 000.00	991 562.50	0.31
USD EHI CAR SERVICES LTD-REG-S 5.87500% 17-14.08.22	425 000.00	370 679.69	0.12
USD FPC RESOURCES LTD-REG-S 4.37500% 20-11.09.27	6 675 000.00	6 750 093.75	2.10
USD FUFENG GROUP LTD-REG-S 5.87500% 18-28.08.21	1 500 000.00	1 529 767.35	0.48
USD GOLDEN WHEEL TIANDI HLDGS CO LTD-REG-S 12.95000% 20-14.03.22	2 000 000.00	1 953 993.40	0.61
USD HKT CAPITAL NO 5 LTD-REG-S 3.25000% 19-30.09.29	1 200 000.00	1 292 046.12	0.40
USD HUTCHISON WHAMPOA INTERNATIONAL14-REG-S 3.62500% 14-31.10.24	1 000 000.00	1 093 810.00	0.34
USD JINGRUI HOLDINGS LTD-REG-S 9.45000% 18-23.04.21	200 000.00	195 312.50	0.06
USD JSW STEEL LTD-REG-S 5.95000% 19-18.04.24	500 000.00	511 406.25	0.16
USD LAI FUNG BONDS-REG-S 5.65000% 18-18.01.23	1 815 000.00	1 687 853.71	0.53
USD LODHA DEVELOPERS INTL LTD-REG-S 14.00000% 20-12.03.23	1 000 000.00	890 000.00	0.28
USD LONGFOR PROPERTIES CO LTD-REG-S 4.50000% 18-16.01.28	1 100 000.00	1 206 562.50	0.38
USD MINEJESA CAPITAL BV-REG-S 4.62500% 17-10.08.30	800 000.00	820 250.00	0.25
USD MINERA Y METALURGICA DEL BOLEO-REG-S 3.25000% 19-17.04.24	2 000 000.00	2 126 875.00	0.66
USD NWD MTN LTD-REG-S 4.12500% 19-18.07.29	2 625 000.00	2 667 928.46	0.83
USD OIL INDIA LTD-REG-S 5.12500% 19-04.02.29	2 968 000.00	3 177 615.00	0.99
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 4.15000% 17-29.03.27	1 500 000.00	1 684 687.50	0.52
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 3.80000% 20-23.06.50	2 350 000.00	2 500 546.88	0.78
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 3.70000% 16-01.03.41	7 750 000.00	8 927 031.26	2.78
USD POWER FINANCE CORP LTD-REG-S 4.50000% 19-18.06.29	6 000 000.00	6 060 000.00	1.89
USD POWER FINANCE CORP LTD-REG-S 3.90000% 19-16.09.29	850 000.00	825 296.88	0.26
USD RENEW POWER PVT LTD-REG-S 5.87500% 20-05.03.27	850 000.00	847 875.00	0.26
USD RKPF OVERSEAS 2019 A LTD-REG-S 6.00000% 20-04.09.25	5 000 000.00	4 931 250.00	1.53
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 7.50000% 19-01.02.24	600 000.00	598 572.00	0.19
USD TSINGHUA UNIC LTD-REG-S 5.37500% 18-31.01.23	325 000.00	154 373.90	0.05
USD UPL CORP LTD-REG-S 4.62500% 20-16.06.30	2 475 000.00	2 528 367.19	0.79
USD WANDA PROPERTIES OVERSEAS LTD-REG-S 6.95000% 19-05.12.22	2 000 000.00	2 008 750.00	0.62
USD WEALTH DRIVEN LTD-REG-S 5.50000% 16-17.08.23	1 000 000.00	1 009 687.50	0.31

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS(Lux)ボンド・ファンド-フルサイクル・アジア・ボンド(米ドル)

2020年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	評価額 米ドル 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD WOORI BANK-REG-S-SUB 4.75000% 14-30.04.24	1 000 000.00	1 099 375.00	0.34
USD YUZHOU PROPERTIES CO LTD-REG-S 8.30000% 19-27.05.25	1 275 000.00	1 287 750.00	0.40
Total USD		75 671 117.77	23.55
固定利付債券合計		75 671 117.77	23.55
変動利付債券			
USD			
USD BANK OF EAST ASIA LTD/THE-REG-S-SUB 5.875%/VAR 19-PRP	500 000.00	501 236.40	0.15
USD CHINA CONSTRUCTION BK CORP-REG-S-SUB 2.450%/VAR 20- 24.06.30	3 725 000.00	3 744 573.75	1.16
USD CHINA MINMETALS CORP-REG-S 3.750%/VAR 17-PRP	250 000.00	254 531.25	0.08
USD ESTATE SKY LTD-REG-S 5.750%/VAR 17-PRP	1 800 000.00	1 594 687.50	0.50
USD HUANENG HONG KONG CAPITAL LTD-REG-S 3.600%/VAR 17-PRP	500 000.00	505 156.25	0.16
USD PETRON CORP-REG-S 4.600%/VAR 18-PRP	3 000 000.00	2 793 750.00	0.87
USD SINO OCEAN LAND TREASURE-REG-S-SUB 4.900%/VAR 17-PRP	525 000.00	440 671.87	0.14
USD SMC GLOBAL POWER HOLDINGS CORP-REG-S 5.700%/VAR 20-PRP	675 000.00	644 625.00	0.20
Total USD		10 479 232.02	3.26
変動利付債券合計		10 479 232.02	3.26
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		294 751 743.37	91.74
2010年12月17日のルクセンブルグ投信法(改訂済)第41条(1)e)に準拠した投資信託 / その他の投資信託			
投資信託、オープン・エンド型			
ルクセンブルグ			
USD UBS (LUX) BOND SICAV-ASIAN INVST GRADE BONDS (USD)-U-X- CAP	1 500.00	18 894 135.00	5.88
USD UBS (LUX) BOND SICAV - MULTI INCOME (USD) U-X-ACC	120.00	1 232 944.80	0.38
ルクセンブルグ合計		20 127 079.80	6.26
投資信託、オープン・エンド型合計		20 127 079.80	6.26
2010年12月17日のルクセンブルグ投信法(改訂済)第41条(1)e)に準拠した投資信託 / その他の投資信託合計		20 127 079.80	6.26
投資有価証券合計		314 878 823.17	98.00
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 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.12.20	-79.00	-34 359.38	-0.01
USD US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 21.12.20	-21.00	3 562.50	0.00
債券に係る金融先物合計		-30 796.88	-0.01
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		-30 796.88	-0.01
派生商品合計		-30 796.88	-0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS(Lux)ボンド・ファンド - フルサイクル・アジア・ボンド(米ドル)

2020年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面		評価額 米ドル 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
為替予約契約				
購入通貨	購入額	売却通貨	売却額	満期日
INR	1 375 910 000.00	USD	18 506 597.44	15.12.2020
USD	8 880 310.43	IDR	132 734 000 000.00	15.12.2020
EUR	53 366 700.00	USD	62 674 332.78	26.10.2020
SGD	15 279 100.00	USD	11 205 259.74	26.10.2020
EUR	683 100.00	USD	794 051.15	26.10.2020
EUR	1 231 700.00	USD	1 437 715.00	26.10.2020
USD	910 580.54	EUR	778 000.00	26.10.2020
USD	118 421.49	SGD	162 000.00	26.10.2020
為替予約契約合計				
			46 952.70	0.01
			51 693.61	0.02
			-64 616.66	-0.02
			-12 371.71	0.00
			7 360.54	0.00
			7 313.22	0.00
			-2 167.66	0.00
			-253.55	0.00
			33 910.49	0.01
銀行預金、要求払い預金および貯蓄預金ならびにその他の流動資産			7 078 009.40	2.20
その他の資産および負債			-670 307.75	-0.20
純資産合計			321 289 638.43	100.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS(Lux)ボンド・ファンド-ユーロ・ハイ・イールド(ユーロ)
2020年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
EUR			
EUR	ADIANT GLOBAL HOLDINGS LTD-REG-S 3.50000% 16-15.08.24	5 795 000.00	5 331 400.00 0.32
EUR	ALTICE FINCO SA-REG-S 4.75000% 17-15.01.28	3 960 000.00	3 583 800.00 0.22
EUR	ALTICE FRANCE HOLDING SA-REG-S 4.00000% 20-15.02.28	1 820 000.00	1 651 650.00 0.10
EUR	ALTICE FRANCE-REG-S 5.87500% 18-01.02.27	21 880 000.00	23 099 678.72 1.39
EUR	AMS AG-REG-S 6.00000% 20-31.07.25	4 855 000.00	5 121 054.00 0.31
EUR	ARD FINANCE SA-REG-S (PIK) 5.00000% 19-30.06.27	19 265 000.00	18 765 273.22 1.13
EUR	ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-REG-S 2.12500% 19-15.08.26	420 000.00	407 353.06 0.02
EUR	ASHLAND SERVICES BV-REG-S 2.00000% 20-30.01.28	3 600 000.00	3 420 000.00 0.21
EUR	ASR MEDIA AND SPONSORSHIP SPA-REG-S 5.12500% 19-01.08.24	7 010 000.00	7 055 565.00 0.42
EUR	AVANTOR INC-REG-S 4.75000% 17-01.10.24	2 325 000.00	2 403 375.75 0.14
EUR	BANFF MERGER SUB INC-REG-S 8.37500% 18-01.09.26	5 305 000.00	5 384 575.00 0.32
EUR	BLITZ F18-674 GMBH-REG-S 6.00000% 18-30.07.26	3 505 000.00	3 566 302.45 0.21
EUR	BOXER PARENT CO INC-REG-S 6.50000% 20-02.10.25	2 935 000.00	3 026 337.20 0.18
EUR	CEMEX SAB DE CV-REG-S 2.75000% 17-05.12.24	6 858 000.00	6 765 416.99 0.41
EUR	CHEPLAPHARM ARZNEIMITTEL GMBH-REG-S 3.50000% 20-11.02.27	4 205 000.00	4 047 312.50 0.24
EUR	COGENT COMMUNICATIONS GROUP INC-REG-S 4.37500% 19-30.06.24	11 060 000.00	11 221 523.56 0.68
EUR	CONSUS REAL ESTATE AG-REG-S 9.62500% 19-15.05.24	8 019 000.00	8 524 678.14 0.51
EUR	COTY INC-REG-S 4.00000% 18-15.04.23	3 460 000.00	2 889 100.00 0.17
EUR	COTY INC-REG-S 4.75000% 18-15.04.26	1 640 000.00	1 270 048.80 0.08
EUR	CROWN EUROPEAN HOLDINGS SA-REG-S 2.87500% 18-01.02.26	10 090 000.00	10 467 459.83 0.63
EUR	DKT FINANCE APS-REG-S 7.00000% 18-17.06.23	30 503 000.00	30 729 210.24 1.85
EUR	EG GLOBAL FINANCE PLC-REG-S 4.37500% 19-07.02.25	960 000.00	907 200.00 0.05
EUR	EG GLOBAL FINANCE PLC-REG-S 6.25000% 19-30.10.25	7 500 000.00	7 466 250.00 0.45
EUR	FAURECIA SE-REG-S 3.75000% 20-15.06.28	9 750 000.00	9 691 207.50 0.58
EUR	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV-REG-S 3.87500% 20-05.01.26	8 335 000.00	9 011 751.99 0.54
EUR	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV-REG-S 4.50000% 20-07.07.28	6 315 000.00	7 183 312.50 0.43
EUR	FINANCIAL & RISK US HOLDINGS INC-REG-S 6.87500% 18-15.11.26	9 865 000.00	10 647 787.75 0.64
EUR	FINANCIAL & RISK US HOLDINGS INC-REG-S 4.50000% 18-15.05.26	6 185 000.00	6 464 190.90 0.39
EUR	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 1.51400% 19-17.02.23	8 000 000.00	7 585 760.00 0.46
EUR	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.38600% 19-17.02.26	4 110 000.00	3 821 206.74 0.23
EUR	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.33000% 19-25.11.25	1 500 000.00	1 396 500.00 0.08
EUR	FORTUNE STAR BVI LTD-REG-S 4.35000% 19-06.05.23	7 810 000.00	7 712 375.00 0.46
EUR	INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC-REG-S 3.50000% 19-15.06.26	14 243 000.00	13 494 672.77 0.81
EUR	INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC-REG-S 2.37500% 19-15.04.28	3 320 000.00	2 905 000.00 0.17
EUR	INTRUM AB-REG-S 4.87500% 20-15.08.25	4 665 000.00	4 571 700.00 0.28
EUR	IQVIA INC-REG-S 2.25000% 19-15.01.28	5 675 000.00	5 546 177.50 0.33
EUR	IQVIA INC-REG-S 2.87500% 20-15.06.28	8 880 000.00	8 968 800.00 0.54
EUR	JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-REG-S 6.87500% 19-15.11.26	4 820 000.00	4 386 200.00 0.26
EUR	JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-REG-S 5.87500% 19-15.11.24	6 970 000.00	6 273 000.00 0.38
EUR	KLEOPATRA HOLDGS 1 SCA-REG-S (PIK) STEP UP 17-30.06.23	3 800 000.00	4 051 049.88 0.24
EUR	LHMC FINCO SARL-REG-S 6.25000% 18-20.12.23	4 370 000.00	3 957 454.52 0.24
EUR	LINCOLN FINANCING SARL-REG-S 3.62500% 19-01.04.24	8 910 000.00	8 559 302.40 0.51
EUR	LOXAM SAS-REG-S 3.75000% 19-15.07.26	9 155 000.00	8 720 137.50 0.52
EUR	LOXAM SAS-REG-S-SUB 5.75000% 19-15.07.27	1 480 000.00	1 320 900.00 0.08
EUR	MOTION BONDCO DAC-REG-S 4.50000% 19-15.11.27	884 000.00	740 300.50 0.04
EUR	NETFLIX INC 3.62500% 17-15.05.27	15 240 000.00	16 454 628.00 0.99
EUR	NETFLIX INC-REG-S 3.87500% 19-15.11.29	7 935 000.00	8 748 337.50 0.53
EUR	NETFLIX INC-REG-S 3.62500% 19-15.06.30	4 860 000.00	5 260 950.00 0.32
EUR	NIDDA BONDCO GMBH-REG-S 5.00000% 17-30.09.25	5 275 000.00	5 115 906.00 0.31

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS(Lux)ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド(ユーロ)
2020年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
EUR NIDDA HEALTHCARE HOLDING AG-REG-S 3.50000% 17-30.09.24	13 480 000.00	13 126 824.00	0.79
EUR NIDDA HEALTHCARE HOLDING AG-REG-S 3.50000% 20-30.09.24	4 425 000.00	4 276 762.50	0.26
EUR NISSAN MOTOR CO LTD-REG-S 2.65200% 20-17.03.26	3 155 000.00	3 184 398.29	0.19
EUR PROMONTORIA HOLDING-REG-S 6.75000% 18-15.08.23	6 940 000.00	5 593 251.36	0.34
EUR SAZKA GROUP AS-REG-S 4.12500% 19-20.11.24	4 165 000.00	3 915 100.00	0.24
EUR SAZKA GROUP AS-REG-S 3.87500% 20-15.02.27	3 140 000.00	2 778 900.00	0.17
EUR SCIENTIFIC GAMES INTERNATIONAL-REG-S 3.37500% 18-15.02.26	2 430 000.00	2 308 500.00	0.14
EUR SCIENTIFIC GAMES INTERNATIONAL-REG-S 5.50000% 18-15.02.26	4 290 000.00	3 989 700.00	0.24
EUR SILGAN HOLDINGS INC 2.25000% 20-01.06.28	4 250 000.00	4 133 125.00	0.25
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 4.00000% 17-19.09.29	2 940 000.00	2 938 953.36	0.18
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 5.00000% 18-15.04.28	16 743 000.00	17 721 963.21	1.07
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 4.00000% 18-20.04.23	13 125 000.00	13 567 181.25	0.82
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 4.50000% 18-20.04.25	10 030 000.00	10 513 446.00	0.63
EUR STANDARD INDUSTRIES INC/NJ-REG-S 2.25000% 19-21.11.26	3 555 000.00	3 395 234.50	0.20
EUR SYNTHOMER PLC-REG-S 3.87500% 20-01.07.25	2 480 000.00	2 523 400.00	0.15
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 4.50000% 18-01.03.25	18 585 000.00	18 073 912.50	1.09
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FIN 6.00000% 20-31.01.25	10 210 000.00	10 455 678.12	0.63
EUR UNILABS SUBHOLDING AB-REG-S 5.75000% 17-15.05.25	4 520 000.00	4 531 444.64	0.27
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 4.87500% 17-01.07.24	3 210 000.00	3 242 100.00	0.20
EUR VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-REG-S 4.50000% 15-15.05.23	23 765 000.00	23 543 082.43	1.42
EUR VERTICAL HOLDCO GMBH-REG-S 6.62500% 20-15.07.28	5 660 000.00	5 887 532.00	0.35
EUR VIRGIN MEDIA FINANCE PLC-REG-S 3.75000% 20-15.07.30	2 940 000.00	2 807 153.16	0.17
EUR VIVION INVESTMENTS SARL-REG-S 3.50000% 19-01.11.25	500 000.00	432 970.00	0.03
EUR WMG ACQUISITION CORP-REG-S 3.62500% 18-15.10.26	3 955 000.00	4 034 100.00	0.24
EUR ZF EUROPE FINANCE BV-REG-S 2.00000% 19-23.02.26	5 200 000.00	4 741 963.20	0.29
EUR ZF EUROPE FINANCE BV-REG-S 2.50000% 19-23.10.27	2 700 000.00	2 455 072.20	0.15
EUR ZF EUROPE FINANCE BV-REG-S 1.25000% 19-23.10.23	2 300 000.00	2 182 125.00	0.13
EUR ZIGGO BOND CO BV-REG-S 3.37500% 20-28.02.30	6 980 000.00	6 626 393.20	0.40
Total EUR		522 673 439.33	31.44
GBP			
GBP PINNACLE BIDCO PLC-REG-S 6.37500% 18-15.02.25	5 750 000.00	5 529 003.47	0.33
GBP TALKTALK TELECOM GROUP PLC-REG-S 3.87500% 20-20.02.25	4 855 000.00	5 162 967.94	0.31
Total GBP		10 691 971.41	0.64
USD			
USD DRESDNER FUND TRUST I-REG-S 8.15100% 99-30.06.31	3 000 000.00	3 714 775.93	0.22
USD FORD MOTOR CO 8.50000% 20-21.04.23	1 580 000.00	1 468 639.40	0.09
USD HTA GROUP LTD/MAURITIUS-REG-S 7.00000% 20-18.12.25	4 360 000.00	3 884 458.27	0.23
USD NEPTUNE ENERGY BONDCO PLC-REG-S 6.62500% 18-15.05.25	10 875 000.00	8 271 547.35	0.50
USD ZIGGO BV-144A 5.50000% 16-15.01.27	3 423 000.00	3 057 683.44	0.19
Total USD		20 397 104.39	1.23
固定利付ノート合計		553 762 515.13	33.31
変動利付ノート			
EUR ACCOR SA-REG-S-SUB 2.625%/VAR 19-PRP	7 100 000.00	5 991 036.80	0.36
EUR BANCA MONT DEI PAS DI SIENA-REG-S-SUB 8.000%/VAR 20-22.01.30	7 895 000.00	7 218 477.45	0.44
EUR BORMIOLI PHARMA BIDCO SPA-REG-S 3M EURIBOR+350BP 17-15.11.24	5 150 000.00	4 866 750.00	0.29
EUR DTE POSTBANK FUNDING TRUST I-SUB 10YR EUSA+2.5BP 04-PRP	2 872 000.00	2 495 768.00	0.15
EUR EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA-REG-S-SUB 1.700%/VAR 20-20.07.80	6 600 000.00	6 344 408.40	0.38
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 3.375%/VAR 20-PRP	2 600 000.00	2 535 000.00	0.15

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S (Lux) ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド (ユーロ)
2020年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 2.875%/VAR 20-PRP	5 800 000.00	5 658 190.00	0.34
EUR HEIMSTADEN BOSTAD AB-REG-S-SUB 3.248%/VAR 19-PRP	5 215 000.00	5 215 000.00	0.31
EUR IBERCAJA BANCO SA-REG-S-SUB 2.750%/VAR 20-23.07.30	6 900 000.00	6 287 832.00	0.38
EUR ING GROEP NV INTERPL 10Y DUTCH GOV-SUB BD+10BP 04-PRP	1 980 000.00	1 683 990.00	0.10
EUR ING GROUP NV-SUB VAR 03-PRP	6 697 300.00	5 727 263.07	0.35
EUR KONINKLIJK FRIESLANDCAM-REG-S-SUB 2.850%/VAR 20-PRP	2 430 000.00	2 429 854.20	0.15
EUR REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S-SUB 3.750%/VAR 20-PRP	1 225 000.00	1 231 169.10	0.07
EUR REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV-SUB 4.247%/VAR 20-PRP	1 225 000.00	1 246 437.50	0.07
EUR SYNLAB BONDCO PLC-REG-S 3M EURIBOR+475BP 20-01.07.25	8 565 000.00	8 656 217.25	0.52
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 2.502%/VAR 20-PRP	1 900 000.00	1 797 354.40	0.11
EUR TENNET HOLDING BV-REG-S-SUB 2.374%/VAR 20-PRP	2 385 000.00	2 414 211.49	0.15
EUR UNICREDIT SPA-REG-S-SUB 2.731%/VAR 20-15.01.32	5 365 000.00	5 056 512.50	0.30
Total EUR		76 855 472.16	4.62
GBP			
GBP MILLER HOMES GROUP HOLD PLC-REG-S 3M LIBOR+525BP 17-15.10.23	1 770 000.00	608 858.83	0.04
GBP PREMIER FOODS FINANCE PLC-REG-S 3M LIBOR+500BP 17-15.07.22	3 018 000.00	3 328 715.59	0.20
Total GBP		3 937 574.42	0.24
USD			
USD AEGON NV-SUB VAR/10YR CMS+10BP 04-31.12.PRIP	6 340 000.00	4 100 333.43	0.25
USD SOCIETE GENERAL SA-REG-S-SUB 7.375%/VAR 18-PRP	4 680 000.00	4 105 700.76	0.25
Total USD		8 206 034.19	0.50
変動利付ノート合計		88 999 080.77	5.36
固定利付ミディアム・ターム・ノート			
EUR AUTOSTRADE PER L ' ITALIA SPA-REG-S 1.75000% 15-26.06.26	11 860 000.00	11 189 577.92	0.67
EUR AUTOSTRADE PER L ' ITALIA SPA-REG-S 1.75000% 16-01.02.27	5 655 000.00	5 297 321.25	0.32
EUR AUTOSTRADE PER L ' ITALIA SPA-REG-S 1.87500% 17-26.09.29	4 707 000.00	4 365 478.91	0.26
EUR BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA-REG-S 3.62500% 19-24.09.24	9 555 000.00	9 815 784.62	0.59
EUR BOMBARDIER INC-REG S 6.12500% 10-15.05.21	7 868 000.00	7 750 766.80	0.47
EUR CASINO GUICHARD PERRACHON SA-REG-S 3.31100% 13-25.01.23	3 900 000.00	3 609 606.00	0.22
EUR CASINO GUICHARD PERRACHON SA-REG-S STEP-UP 14-07.03.24	10 700 000.00	8 533 250.00	0.51
EUR CASINO GUICHARD PERRACHON SA-REG-S 2.79800% 14-05.08.26	3 900 000.00	2 917 590.00	0.17
EUR CASINO GUICHARD PERRACHON SA-REG-S 1.86500% 17-13.06.22	5 800 000.00	5 413 952.00	0.33
EUR COMMERZBANK AG-REG-S-SUB 4.00000% 16-23.03.26	2 067 000.00	2 201 230.98	0.13
EUR COTT CORP-REG-S 5.50000% 16-01.07.24	7 400 000.00	7 510 378.40	0.45
EUR DEUTSCHE BANK AG-SUB 4.50000% 16-19.05.26	6 200 000.00	6 580 779.20	0.40
EUR FCE BANK PLC-REG-S 1.61500% 16-11.05.23	2 500 000.00	2 406 250.00	0.14
EUR FORD MOTOR CREDIT CO LLC 1.74400% 20-19.07.24	5 775 000.00	5 372 136.00	0.32
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB 3.92800% 14-15.09.26	1 775 000.00	1 928 672.40	0.12
EUR K+S AG-REG-S 3.00000% 12-20.06.22	5 900 000.00	5 767 250.00	0.35
EUR KION GROUP AG-REG-S 1.62500% 20-24.09.25	2 900 000.00	2 902 320.00	0.17
EUR LEONARDO SPA-REG-S 2.37500% 20-08.01.26	3 875 000.00	3 841 210.00	0.23
EUR NASSA TOPCO AS-REG-S 2.87500% 17-06.04.24	7 514 000.00	7 430 594.60	0.45
EUR ORANO SA-REG-S 2.75000% 20-08.03.28	2 000 000.00	1 973 400.00	0.12
EUR ORANO SA-REG-S 3.37500% 19-23.04.26	9 000 000.00	9 269 244.00	0.56
EUR PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 2.75000% 15-21.04.27	1 750 000.00	1 392 890.62	0.08
EUR PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 5.12500% 16-15.03.23	5 521 000.00	5 529 626.56	0.33
EUR PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 3.75000% 17-21.02.24	4 695 000.00	4 432 373.44	0.27
EUR PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 4.87500% 17-21.02.28	6 320 000.00	5 530 000.00	0.33

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S (Lux) ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド (ユーロ)
2020年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
EUR PPF TELECOM GROUP BV-REG-S 3.50000% 20-20.05.24	4 025 000.00	4 129 650.00	0.25
EUR TELECOM ITALIA FINANCE SA 7.75000% 03-24.01.33	2 782 000.00	3 978 260.00	0.24
EUR TELECOM ITALIA SPA-REG-S 3.00000% 16-30.09.25	830 000.00	862 162.50	0.05
EUR TELECOM ITALIA SPA-REG-S 2.37500% 17-12.10.27	6 290 000.00	6 279 621.50	0.38
EUR TELECOM ITALIA SPA-REG-S 2.87500% 18-28.01.26	7 740 000.00	7 970 977.08	0.48
EUR TELECOM ITALIA SPA-REG-S 2.75000% 19-15.04.25	21 765 000.00	22 382 777.76	1.35
EUR THYSSENKRUPP AG-REG-S 2.87500% 19-22.02.24	11 280 000.00	10 577 820.00	0.64
EUR THYSSENKRUPP AG-REG-S 1.87500% 19-06.03.23	9 990 000.00	9 320 670.00	0.56
EUR UNIPOL GRUPPO FINANZIARIO SPA 3.25000% 20-23.09.30	3 345 000.00	3 379 727.79	0.20
EUR UNIPOL GRUPPO SPA-REG-S 3.50000% 17-29.11.27	3 800 000.00	3 997 303.60	0.24
EUR ZF FINANCE GMBH-REG-S 3.75000% 20-21.09.28	8 800 000.00	8 514 000.00	0.51
Total EUR		214 354 653.93	12.89
GBP			
GBP AA BOND CO LTD-REG-S 2.75000% 17-31.07.23	5 080 000.00	5 455 837.15	0.33
GBP PETROLEOS MEXICANOS 8.25000% 09-02.06.22	7 842 000.00	8 991 302.55	0.54
Total GBP		14 447 139.70	0.87
固定利付メディアム・ターム・ノート合計		228 801 793.63	13.76
変動利付メディアム・ターム・ノート			
EUR AIB GROUP PLC-REG-S-SUB 2.875%/VAR 20-30.05.31	4 075 000.00	4 065 961.65	0.24
EUR BANCO COMERCIAL PORTUGUES-REG-S-SUB 4.500%/VAR 17-07.12.27	1 500 000.00	1 440 492.00	0.09
EUR BANCO COMERCIAL PORTUGUES-REG-S-SUB 3.871%/VAR 19-27.03.30	2 600 000.00	2 318 154.80	0.14
EUR BANCO DE CREDITO SOC CP SA-REG-S-SUB 7.750%/VAR 17-07.06.27	5 900 000.00	5 487 000.00	0.33
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 5.375%/VAR 18-12.12.28	7 600 000.00	7 783 692.00	0.47
EUR BANKIA SA-REG-S-SUB 3.750%/VAR 19-15.02.29	6 200 000.00	6 549 940.40	0.39
EUR DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG-REG-S-SUB 2.875%/VAR 17-28.06.27	3 600 000.00	3 512 296.80	0.21
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 5.000%/VAR 14-PRP	3 100 000.00	3 378 851.20	0.20
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB 6.250%/VAR 17-PRP	2 460 000.00	2 448 024.72	0.15
EUR PERMANENT TSB GROUP HLDG PLC-REG-S 2.125%/VAR 19-26.09.24	3 080 000.00	2 956 430.40	0.18
EUR UNICREDIT SPA-REG-S-SUB 4.875%/VAR 19-20.02.29	7 000 000.00	7 410 844.00	0.45
EUR UNICREDIT SPA-REG-S-SUB 2.000%/VAR 19-23.09.29	3 110 000.00	2 931 175.00	0.18
EUR UNIONE DI BANCHE ITALIANE-REG-S-SUB 4.450%/VAR 17-15.09.27	6 890 000.00	7 165 434.64	0.43
EUR UNIONE DI BANCHE ITALIANE-REG-S-SUB 5.875%/VAR 19-04.03.29	2 030 000.00	2 242 748.06	0.13
EUR UNIPOLSAI SPA-SUB 5.750%/VAR 14-PRP	5 690 000.00	5 895 886.96	0.35
Total EUR		65 586 932.63	3.94
GBP			
GBP HSBC BANK PLC 5.84400%/6M LIBOR+176BP 03-PRP	4 205 000.00	6 601 829.88	0.40
Total GBP		6 601 829.88	0.40
USD			
USD HSBC BANK PLC-SUB 6M LIBOR+25BP 85-PRP	1 920 000.00	1 318 040.34	0.08
Total USD		1 318 040.34	0.08
変動利付メディアム・ターム・ノート合計		73 506 802.85	4.42
固定利付債券			
EUR ADLER REAL ESTATE AG-REG-S 1.87500% 18-27.04.23	3 200 000.00	3 087 744.00	0.19
EUR ADLER REAL ESTATE AG-REG-S 3.00000% 18-27.04.26	2 200 000.00	2 156 000.00	0.13
EUR ADLER REAL ESTATE AG-REG-S 2.12500% 17-06.02.24	2 825 000.00	2 712 000.00	0.16

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS(Lux)ボンド・ファンド-ユーロ・ハイ・イールド(ユーロ)
2020年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)	
EUR	ALTICE FINANCING SA-REG-S 2.25000% 20-15.01.25	2 375 000.00	2 272 637.50	0.14
EUR	ALTICE FINANCING SA-REG-S 3.00000% 20-15.01.28	8 780 000.00	8 137 514.72	0.49
EUR	ALTICE FRANCE-REG-S 3.37500% 19-15.01.28	11 515 000.00	11 084 339.00	0.67
EUR	ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-REG-S 2.12500% 20-15.08.26	4 910 000.00	4 768 704.34	0.29
EUR	CARNIVAL CORP 1.87500% 15-07.11.22	2 780 000.00	2 352 575.00	0.14
EUR	CARNIVAL CORP-REG-S 10.12500% 20-01.02.26	2 905 000.00	3 085 981.50	0.19
EUR	CIRSA FINANCE INTERNATIONAL-REG-S 4.75000% 19-22.05.25	5 540 000.00	4 781 020.00	0.29
EUR	CONSTANTIN INVEST-REG-S 5.37500% 17-15.04.25	2 260 000.00	2 265 650.00	0.14
EUR	CONSTANTIN INVESTISSEMENT 3 SASU-REG-S 5.37500% 18-15.04.25	1 100 000.00	1 102 750.00	0.07
EUR	CROWN EUROPEAN HOLDINGS SA-REG-S 3.37500% 15-15.05.25	640 000.00	675 627.52	0.04
EUR	CRYSTAL ALMOND SARL-REG-S 4.25000% 19-15.10.24	9 400 000.00	9 212 000.00	0.55
EUR	CTC BONDCO GMBH-REG-S 5.25000% 17-15.12.25	7 502 000.00	7 168 911.20	0.43
EUR	EIRCOM FINANCE DAC-REG-S 3.50000% 19-15.05.26	3 695 000.00	3 674 308.00	0.22
EUR	FAURECIA SA-REG-S 3.12500% 19-15.06.26	7 620 000.00	7 562 850.00	0.45
EUR	FAURECIA SE-REG-S 2.37500% 19-15.06.27	175 000.00	164 850.00	0.01
EUR	GARFUNKELUX HOLDCO 3 SA-REG-S 7.50000% 15-01.08.22	4 430 000.00	4 092 744.10	0.25
EUR	GAZPROM PJSC-REG-S 2.95000% 20-15.04.25	3 020 000.00	3 140 800.00	0.19
EUR	GRIFOLS SA-REG-S 2.25000% 19-15.11.27	3 910 000.00	3 879 283.04	0.23
EUR	GRUPO-ANTOLIN IRAUSA SA-REG-S 3.25000% 17-30.04.24	3 760 000.00	3 174 380.00	0.19
EUR	GRUPO-ANTOLIN IRAUSA SA-REG-S 3.37500% 18-30.04.26	1 030 000.00	828 319.82	0.05
EUR	HAYA FINANCE 2017 SA-REG-S 5.25000% 17-15.11.22	3 950 000.00	3 106 517.00	0.19
EUR	HP PELZER HOLDING GMBH-REG-S 4.12500% 17-01.04.24	8 117 000.00	6 292 298.40	0.38
EUR	INTRUM JUSTITIA AB-REG-S 2.75000% 17-15.07.22	535 000.00	53 357.69	0.00
EUR	INTRUM JUSTITIA AB-REG-S 3.12500% 17-15.07.24	11 545 000.00	10 852 300.00	0.65
EUR	ITALY, REPUBLIC OF-BTP-REG-S 1.35000% 19-01.04.30	8 050 000.00	8 464 864.80	0.51
EUR	K+S AG-REG-S 2.62500% 17-06.04.23	2 120 000.00	1 991 714.55	0.12
EUR	KAPLA HOLDING SAS-REG-S 3.37500% 19-15.12.26	4 665 000.00	4 307 194.50	0.26
EUR	LORCA TELECOM BONDCO SAU-REG-S 4.00000% 20-18.09.27	3 760 000.00	3 822 303.20	0.23
EUR	LOXAM SAS-REG-S 6.00000% 17-15.04.25	2 120 000.00	1 976 900.00	0.12
EUR	MATTERHORN TELECOM SA-REG-S 3.12500% 19-15.09.26	8 790 000.00	8 372 475.00	0.50
EUR	MOTION FINCO SARL-REG-S 7.00000% 20-15.05.25	6 235 000.00	6 133 943.12	0.37
EUR	MULHACEN PTE LTD-REG-S (PIK) 7.50000% 18-01.08.23	12 497 175.00	5 707 459.82	0.34
EUR	NETFLIX INC 4.62500% 18-15.05.29	4 085 000.00	4 718 175.00	0.28
EUR	NIDDA BONDCO GMBH-REG-S 7.25000% 18-30.09.25	9 535 000.00	9 678 025.00	0.58
EUR	O1 EUROPEAN GROUP BV-REG-S 2.87500% 19-15.02.25	6 730 000.00	6 614 097.01	0.40
EUR	PAPREC HOLDING-REG-S 4.00000% 18-31.03.25	3 948 000.00	3 760 027.83	0.23
EUR	PARTS EUROPE SA-REG-S 6.50000% 20-16.07.25	3 380 000.00	3 405 350.00	0.20
EUR	PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 5.50000% 05-24.02.25	610 000.00	613 431.25	0.04
EUR	PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 3.75000% 14-16.04.26	2 309 000.00	2 016 767.18	0.12
EUR	PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 4.75000% 18-26.02.29	9 650 000.00	8 217 578.13	0.49
EUR	PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 2.50000% 18-24.11.22	3 420 000.00	3 268 237.50	0.20
EUR	PLT VII FINANCE SARL-REG-S 4.62500% 20-05.01.26	6 340 000.00	6 439 221.00	0.39
EUR	QUINTILES IMS INC-REG-S 3.25000% 17-15.03.25	6 675 000.00	6 713 181.00	0.40
EUR	RCS & RDS SA-REG-S 2.50000% 20-05.02.25	5 800 000.00	5 569 812.50	0.33
EUR	REXEL SA-REG-S 2.75000% 19-15.06.26	6 235 000.00	6 185 120.00	0.37
EUR	ROSSINI SARL-REG-S 6.75000% 18-30.10.25	6 690 000.00	7 027 845.00	0.42
EUR	RUBIS TERMINAL INFRA SAS -REG-S 5.62500% 20-15.05.25	5 905 000.00	6 088 055.00	0.37
EUR	SIGMA HOLDCO BV-REG-S 5.75000% 18-15.05.26	3 870 000.00	3 807 166.67	0.23
EUR	SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 5.25000% 15-30.07.27	5 340 000.00	5 712 678.60	0.34
EUR	STARFRUIT US HOLDCO LLC / FINCO BV-144A 6.50000% 18-01.10.26	3 455 000.00	3 566 423.75	0.21
EUR	SUMMER BIDCO BV-REG-S 9.00000% 19-15.11.25	9 489 000.00	9 989 404.79	0.60
EUR	SUMMER BIDCO BV-REG-S (PIK) STEP-DOWN 20-15.11.25	7 375 000.00	7 601 518.60	0.46
EUR	TECHEM VERWALTUNGSGESELLSCHAFT-REG-S 2.00000% 20-15.07.25	4 200 000.00	4 000 500.00	0.24
EUR	TEREOS FINANCE GROUPE I SA-REG-S 4.12500% 16-16.06.23	4 100 000.00	3 782 250.00	0.23
EUR	TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV-REG-S 1.12500% 16-15.10.24	14 110 000.00	12 183 103.13	0.73
EUR	TRIVIUM PACKAGING FINANCE BV-REG-S 3.75000% 19-15.08.26	15 044 000.00	14 853 241.62	0.89

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS(Lux)ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド(ユーロ)
2020年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 3.12500% 20-15.02.26	10 535 000.00	9 905 428.40	0.60
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 3.62500% 20-15.02.28	6 585 000.00	6 179 364.00	0.37
EUR UPC HOLDING BV-REG-S 3.87500% 17-15.06.29	3 700 000.00	3 583 775.60	0.22
EUR UPCB FINANCE IV LTD-REG-S 4.00000% 15-15.01.27	4 170 000.00	3 790 530.00	0.23
EUR UPCB FINANCE VII LTD-REG-S 3.62500% 17-15.06.29	8 280 000.00	8 280 000.00	0.50
EUR VERISURE MIDHOLDING AB-REG-S 5.75000% 17-01.12.23	23 219 000.00	23 180 549.34	1.39
EUR VERTICAL MIDCO GMBH-REG-S 4.37500% 20-15.07.27	6 560 000.00	6 661 680.00	0.40
EUR VIVION INVESTMENTS SARL-REG-S 3.00000% 19-08.08.24	9 100 000.00	7 939 750.00	0.48
EUR VZ VENDOR FINANCING BV-REG-S 2.50000% 19-31.01.24	4 715 000.00	4 620 700.00	0.28
EUR WEPA HYGIENEPRODUKTE GMBH-REG-S 2.87500% 19-15.12.27	1 100 000.00	1 079 122.86	0.06
EUR ZIGGO BV-REG-S 4.25000% 16-15.01.27	3 140 000.00	2 934 094.50	0.18
Total EUR		376 428 523.08	22.64
GBP			
GBP AA BOND CO LTD-REG-S 5.50000% 15-31.07.22	2 105 000.00	2 111 817.71	0.13
GBP ARQIVA BROADCAST FINANCE PLC-REG-S 6.75000% 18-30.09.23	5 810 000.00	6 605 459.43	0.40
GBP BRACKEN MIDCO1 PLC-REG-S (PIK) 8.87500% 18-15.10.23	5 923 897.00	5 816 593.71	0.35
GBP GALAXY FINCO LTD-REG-S 9.25000% 19-31.07.27	4 260 000.00	4 755 186.63	0.28
GBP GARFUNKELUX HOLDCO 2 SA-REG-S 11.00000% 15-01.11.23	1 300 000.00	1 153 724.64	0.07
GBP GARFUNKELUX HOLDCO 3 SA-REG-S 8.50000% 15-01.11.22	715 000.00	722 841.45	0.04
GBP JERROLD FINCO PLC-REG-S 6.12500% 17-15.01.24	3 150 000.00	3 281 748.52	0.20
GBP JERROLD FINCO PLC-REG-S 4.87500% 20-15.01.26	8 190 000.00	8 112 690.70	0.49
GBP MILLER HOMES GROUP HOLDINGS PLC-REG-S 5.50000% 17-15.10.24	5 275 000.00	5 723 397.00	0.34
GBP VIRGIN MEDIA VENDOR FINANCING-REG-S 4.87500% 20-15.07.28	3 425 000.00	3 803 868.18	0.23
Total GBP		42 087 327.97	2.53
固定利付債券合計		418 515 851.05	25.17
変動利付債券			
EUR			
EUR ABANCA CORP BANCARIA SA-REG-S-SUB 6.125%/VAR 19-18.01.29	3 200 000.00	3 358 976.00	0.20
EUR ABANCA CORP BANCARIA SA-REG-S-SUB 4.625%/VAR 19-07.04.30	2 000 000.00	1 962 220.00	0.12
EUR ACCOR SA-REG-S-SUB 4.375%/VAR 19-PRP	900 000.00	836 793.00	0.05
EUR BANCO BILBALO VIZCAYA ARGENT-REG-S-SUB 8.875%/VAR 16-PRP	1 800 000.00	1 858 320.00	0.11
EUR BANCO BPM SPA-REG-S-SUB 4.375%/VAR 17-21.09.27	2 835 000.00	2 825 746.56	0.17
EUR BANCO BPM SPA-REG-S-SUB 4.250%/VAR 19-01.10.29	7 740 000.00	7 610 494.32	0.46
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 6.500%/VAR 17-PRP	2 600 000.00	2 323 412.00	0.14
EUR CAIXA SABADELL PREFERENTES SAU-SUB 3M EURIBOR+195 BP 06-PRP	3 200 000.00	2 880 000.00	0.17
EUR CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S-SUB 4.375%/VAR 18-PRP	3 850 000.00	3 791 557.00	0.23
EUR DEUTSCHE POSTBANK FUNDING TRUST III-SUB 7.000%/FLR 05-PRP	939 000.00	815 286.75	0.05
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 4.000%/VAR 18-PRP	11 300 000.00	11 794 329.80	0.71
EUR GAS NATURAL FENOSA FINANCE BV-REG-S-SUB 4.125%/VAR 14-PRP	6 000 000.00	6 210 000.00	0.37
EUR GAS NATURAL FENOSA FINANCE-REG-S-SUB 3.375%/VAR 15-PRP	3 100 000.00	3 173 668.40	0.19
EUR IKB DEUTSCHE INDUSTRIEBK AG-REG-S-SUB 4.000%/VAR 18-31.01.28	5 200 000.00	4 877 600.00	0.29
EUR LIBERTY MUTUAL GROUP INC-REG-S-SUB 3.625%/VAR 19-23.05.59	3 460 000.00	3 411 560.00	0.21
EUR PAPREC HOLDING-REG-S 3M EURIBOR+350BP 18-31.03.25	3 290 000.00	3 033 380.00	0.18
EUR PLT VII FINANCE SARL-REG-S 3M LIBOR+462.5BP 20-05.01.26	1 190 000.00	1 193 172.54	0.07
EUR REPSOL INTERNATIONAL FINANC-REG-S-SUB 4.500%/VAR 15-25.03.75	6 710 000.00	7 045 500.00	0.42
EUR ROSSINI SARL-REG-S 3M EURIBOR+387.5BP 19-30.10.25	2 100 000.00	2 058 000.00	0.12
EUR SAMHALLSBYGGNADSBOLAGET I NOR-REG-S-SUB 2.624%/VAR 20-PRP	4 470 000.00	4 245 382.50	0.26
EUR SISAL PAY SPA-REG-S 3M EURIBOR+387.5BP 19-17.12.26	5 215 000.00	5 058 550.00	0.30
EUR SOLVAY FINANCE SA-REG-S-SUB 5.869%/VAR 15-PRP	5 620 000.00	6 248 316.00	0.38
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 5.875%/VAR 14-PRP	2 500 000.00	2 748 765.00	0.17

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS(Lux)ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド(ユーロ)
2020年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 2.625%/VAR 17-PRP	4 000 000.00	3 962 000.00	0.24
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 3.000%/VAR 18-PRP	7 300 000.00	7 272 625.00	0.44
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 3.875%/VAR 18-PRP	4 100 000.00	4 185 296.40	0.25
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 4.375%/VAR 19-PRP	11 100 000.00	11 687 856.00	0.70
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 2.875%/VAR 19-PRP	2 400 000.00	2 257 200.00	0.14
EUR VODAFONE GROUP PLC-REG-S-SUB 3.100%/VAR 18-03.01.79	7 620 000.00	7 743 825.00	0.47
Total EUR		126 469 832.27	7.61
GBP			
GBP CYBG PLC-REG-S-SUB 8.000%/VAR 16-PRP	1 720 000.00	1 721 778.31	0.10
GBP CYBG PLC-REG-S-SUB 8.750%/VAR 16-PRP	4 900 000.00	5 360 934.73	0.32
Total GBP		7 082 713.04	0.42
USD			
USD VODAFONE GROUP PLC-REG-S-SUB 6.250%/VAR 18-03.10.78	4 340 000.00	3 992 474.31	0.24
Total USD		3 992 474.31	0.24
変動利付債券合計		137 545 019.62	8.27
変動利付転換社債			
EUR			
EUR AGEASFINLUX SA-REG-S-SUB 3M EURIBOR+135BP 02-PRP	5 500 000.00	3 379 750.00	0.20
EUR BANK OF IRELAND GROUP PLC-REG-S-SUB COCO 7.500%/VAR 20-PRP	3 980 000.00	4 221 267.60	0.25
EUR ERSTE GROUP BANK AG-REG-S-SUB COCO 3.375%/VAR 20-PRP	3 400 000.00	2 927 502.00	0.18
Total EUR		10 528 519.60	0.63
USD			
USD DEUTSCHE BANK AG-SUB COCO 6.000%/VAR 20-PRP	6 000 000.00	4 411 495.33	0.27
Total USD		4 411 495.33	0.27
変動利付転換社債合計		14 940 014.93	0.90
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		1 516 071 077.98	91.19
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
固定利付ノート			
EUR			
EUR ALTICE FRANCE HOLDING SA-REG-S 8.00000% 19-15.05.27	20 975 000.00	22 233 500.00	1.34
Total EUR		22 233 500.00	1.34
USD			
USD DELTA AIR LINES INC-144A 7.00000% 20-01.05.25	2 994 000.00	2 803 466.81	0.17
USD PANTHER BF AGGR 2/PANTHER FIN CO-144A 8.50000% 19-15.05.27	2 550 000.00	2 245 235.15	0.13
Total USD		5 048 701.96	0.30
固定利付ノート合計		27 282 201.96	1.64

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）
2020年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
固定利付債券			
EUR			
EUR PANTHER BF AGGR 2/PANTHER FIN CO-REG-S 4.37500% 19- 15.05.26	4 160 000.00	4 165 200.00	0.25
Total EUR		4 165 200.00	0.25
固定利付債券合計		4 165 200.00	0.25
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計			
		31 447 401.96	1.89
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も取引されていない譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
固定利付債券			
GBP			
GBP VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC-REG-S 4.12500% 20- 15.08.30	5 885 000.00	6 390 658.83	0.38
Total GBP		6 390 658.83	0.38
固定利付債券合計		6 390 658.83	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も取引されていない譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計			
		6 390 658.83	0.38
最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
固定利付ノート			
USD			
USD TENET HEALTHCARE CORP-144A 6.12500% 20-01.10.28	5 015 000.00	4 159 030.83	0.25
Total USD		4 159 030.83	0.25
固定利付ノート合計		4 159 030.83	0.25
最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		4 159 030.83	0.25
2010年12月17日のルクセンブルグ投信法（改訂済）第41条(1)e)に準拠した投資信託 / その他の投資信託			
投資信託、オープン・エンド型			
アイルランド			
EUR UBS (IRL) SELECT MONEY MARKET FUND-EUR-S-DIST	145.83	1 445 774.80	0.09
アイルランド合計		1 445 774.80	0.09
投資信託、オープン・エンド型合計		1 445 774.80	0.09
2010年12月17日のルクセンブルグ投信法（改訂済）第41条(1)e)に準拠した投資信託 / その他の投資信託合計			
		1 445 774.80	0.09
投資有価証券合計		1 559 513 944.40	93.80

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS(Lux) ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド(ユーロ)
2020年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
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 10YR ULTRA NOTE FUTURE 21.12.20	182.00	190 367.36	0.01
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.12.20	485.00	106 629.28	0.01
債券に係る金融先物合計		296 996.64	0.02
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		296 996.64	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も取引されていない派生商品			
指数に係るスワップおよびフォワード・スワップ			
EUR GOLDMAN SACHS/IBOXX EUR LIQUID HY INDEX SWAP 20-20.03.21	19 999 999.95	-285 176.59	-0.02
EUR GOLDMAN SACHS/IBOXX EUR HY INDEX SWAP PAYER 3ML 20-20.03.21			
EUR GOLDMAN SACHS/IBOXX EUR LIQUID HY EQS REC PERF 20-20.03.21	19 999 999.19	-278 767.60	-0.02
EUR GOLDMAN SACHS/IBOXX EUR HY INDEX SWAP PAYER 3ML 20-20.03.21			
指数に係るスワップおよびフォワード・スワップ合計		-563 944.19	-0.04
クレジット・デフォルト・スワップ *			
EUR CREDIT SUISSE/GFKLDE CREDIT DEFAULT SWAP PAYER 5.00000% 20-20.06.23	-1 500 000.00	253 749.43	0.02
EUR BARCLAYS/ICELTD CREDIT DEFAULT SWAP REC 5.00000% 20-20.12.20	5 000 000.00	31 172.56	0.00
EUR MORGAN STANLEY/ROLLS CREDIT DEFAULT SWAP REC 1.00000% 20-20.06.25	4 000 000.00	-653 542.00	-0.04
EUR BNP/ICELTD CREDIT DEFAULT SWAP REC 5.00000% 20-20.06.21	2 000 000.00	36 308.20	0.00
クレジット・デフォルト・スワップ合計		-332 311.81	-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も取引されていない派生商品合計		-896 256.00	-0.06
派生商品合計		-599 259.36	-0.04

* 額面がプラスの場合：サブ・ファンドは「受取側」であり、額面がマイナスの場合：サブ・ファンドは「支払側」である。

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S (Lux) ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド (ユーロ)
2020年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面		評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)		
為替予約契約						
購入通貨	購入額	売却通貨	売却額	満期日		
AUD	94 177 100.00	EUR	58 130 937.15	19.10.2020	-584 503.25	-0.04
CAD	31 306 100.00	EUR	20 027 905.66	19.10.2020	-46 807.31	0.00
JPY	1 965 394 600.00	EUR	15 740 112.05	19.10.2020	139 494.07	0.01
EUR	97 577 357.53	GBP	89 840 000.00	19.10.2020	-1 443 875.73	-0.09
HKD	150 569 700.00	EUR	16 356 345.93	19.10.2020	205 576.64	0.01
SGD	72 935 100.00	EUR	45 232 780.90	19.10.2020	315 450.73	0.02
GBP	20 218 200.00	EUR	21 959 467.17	19.10.2020	324 939.53	0.02
CHF	36 142 700.00	EUR	33 596 123.89	19.10.2020	-44 977.66	0.00
EUR	60 254 964.69	USD	71 555 000.00	19.10.2020	-745 609.85	-0.04
USD	543 413 400.00	EUR	457 597 026.45	19.10.2020	5 662 418.93	0.34
CNH	105 075 600.00	EUR	13 068 320.05	19.10.2020	116 496.19	0.01
EUR	322 005.55	AUD	520 000.00	19.10.2020	4 262.22	0.00
EUR	63 603.91	JPY	7 900 000.00	19.10.2020	-224.95	0.00
EUR	107 497.87	GBP	98 000.00	19.10.2020	-517.28	0.00
EUR	62 409.65	CNH	500 000.00	19.10.2020	-330.02	0.00
CNH	1 145 200.00	EUR	142 347.82	19.10.2020	1 351.11	0.00
ZAR	15 632 900.00	EUR	787 643.02	19.10.2020	9 835.73	0.00
EUR	1 455 601.89	SGD	2 329 800.00	19.10.2020	633.43	0.00
EUR	140 057.08	CNH	1 117 700.00	19.10.2020	-191.17	0.00
JPY	21 262 300.00	EUR	173 318.52	19.10.2020	-1 527.60	0.00
EUR	273 362.44	JPY	33 640 200.00	19.10.2020	1 563.01	0.00
EUR	218 768.27	CNH	1 744 300.00	19.10.2020	-105.33	0.00
為替予約契約合計					3 913 351.44	0.24
銀行預金、要求払い預金および貯蓄預金ならびにその他の流動資産					67 960 099.32 **	4.09
当座借越およびその他の短期負債					-32.26	0.00
その他の資産および負債					31 813 682.66	1.91
純資産合計					1 662 601 786.20	100.00

** 2020年9月30日現在、670,000.00ユーロの現金が取引相手方であるゴールドマン・サックスに対する担保および530,000.00ユーロの現金が取引相手方であるモルガン・スタンレー・ロンドンに対する担保となっている。

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS(Lux)ボンド・ファンド - オーストラリア・ドル

最も重要な数字

	ISIN	30.9.2020	31.3.2020	31.3.2019
純資産額、オーストラリア・ドル		361 605 474.17	341 435 681.63	289 343 704.85
クラスP - a c c 受益証券	LU0035338325			
発行済受益証券		292 433.2750	287 487.7960	299 572.0360
受益証券1口当たりの純資産価格、オーストラリア・ドル		575.46	566.20	535.72
受益証券1口当たり発行および買戻価格、オーストラリア・ドル ¹		575.46	567.05	535.72
クラスP - d i s t 受益証券	LU0035338242			
発行済受益証券		730 442.4530	764 457.5380	717 388.1950
受益証券1口当たりの純資産価格、オーストラリア・ドル		123.61	124.80	120.95
受益証券1口当たり発行および買戻価格、オーストラリア・ドル ¹		123.61	124.99	120.95

¹ 注記1を参照のこと。

投資有価証券の構成

地域別分類	純資産割合%	業種別分類	純資産割合%
オーストラリア	80.77	国債および中央政府債	28.32
アメリカ合衆国	4.61	公益、非営利団体	19.60
ノルウェー	3.38	銀行およびその他の金融機関	17.12
ドイツ	3.36	金融および持株会社	10.84
イギリス	2.78	地方債	5.78
カナダ	1.40	モーゲージおよび貸付機関	2.92
フィリピン	0.74	その他の非分類会社	2.42
日本	0.55	通信	1.85
国際機関	0.44	国際機関	1.81
ニュージーランド	0.28	交通および運輸	1.38
合計	98.31	宿泊、ケータリングおよび娯楽施設	1.06
		ヘルスケアおよび社会福祉	1.02
		小売業および百貨店	0.85
		エネルギーおよび水道	0.85
		化学	0.68
		石油	0.64
		航空宇宙産業	0.53
		各種消費財	0.28
		市および地方自治体	0.22
		インターネット、ソフトウェアおよびITサービス	0.14
		合計	98.31

UBS (Lux) ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル

最も重要な数字

	ISIN	30.9.2020	31.3.2020	31.3.2019
純資産額、ユーロ		231 051 865.06	202 290 809.89	200 013 092.58
クラス P - a c c 受益証券	LU0033050237			
発行済受益証券		285 576.0400	287 108.4080	302 129.1910
受益証券1口当たりの純資産価格、ユーロ		443.41	404.54	411.77
受益証券1口当たり発行および買戻価格、ユーロ ²		443.41	401.71	411.77
クラス P - d i s t 受益証券	LU0033049577			
発行済受益証券		319 760.9760	329 176.9000	432 022.1910
受益証券1口当たりの純資産価格、ユーロ		142.80	132.57	136.81
受益証券1口当たり発行および買戻価格、ユーロ ²		142.80	131.64	136.81

² 注記1を参照のこと。

投資有価証券の構成

地域別分類	純資産割合%	業種別分類	純資産割合%
イタリア	11.37	国債および中央政府債	54.81
ニュージーランド	10.12	銀行およびその他の金融機関	12.26
アメリカ合衆国	10.02	金融および持株会社	6.72
フランス	9.84	国際機関	3.50
ドイツ	6.46	モーゲージおよび貸付機関	3.12
オランダ	6.34	エネルギーおよび水道	1.53
スペイン	6.03	投資信託	1.26
ルクセンブルグ	4.23	医薬品、化粧品および医療製品	1.16
南アフリカ	3.23	通信	1.09
アイルランド	2.00	タバコおよびアルコール飲料	1.04
スロベニア	1.98	石油	0.94
ベルギー	1.76	電気機器および部品	0.83
ポルトガル	1.74	公益、非営利団体	0.82
イギリス	1.60	コンピューター・ハードウェアおよびネットワーク設備プロバイダー	0.71
ギリシャ	1.51	不動産	0.62
国際機関	1.47	インターネット、ソフトウェアおよびITサービス	0.60
オーストリア	1.47	その他の非分類会社	0.55
日本	1.38	保険	0.54
メキシコ	1.30	自動車	0.47
中国	0.98	各種サービス	0.42
サウジアラビア	0.94	化学	0.28
オーストラリア	0.72	交通および運輸	0.20
ルーマニア	0.57	ヘルスケアおよび社会福祉	0.14
コスタリカ	0.53	繊維、衣類および革製品	0.13
スイス	0.46	包装業	0.08
スウェーデン	0.44	宿泊、ケータリングおよび娯楽施設	0.08
ウクライナ	0.41	機械工学および産業機器	0.04
ポーランド	0.40	合計	93.94
スロバキア	0.38		
カザフスタン	0.37		
チリ	0.30		
ウルグアイ	0.26		
インドネシア	0.25		
ブラジル	0.24		
コロンビア	0.24		
オマーン	0.23		
モロッコ	0.23		
フィリピン	0.23		
香港	0.22		
トルコ	0.21		
モンゴル国	0.21		
ペルー	0.19		
グアテマラ	0.16		
デンマーク	0.16		
エジプト	0.16		
ノルウェー	0.14		
フィンランド	0.14		
アルゼンチン	0.12		
エクアドル	0.08		
マカオ	0.08		
バミューダ	0.04		
合計	93.94		

UBS(Lux)ボンド・ファンド - フルサイクル・アジア・ボンド(米ドル)

最も重要な数字

	ISIN	30.9.2020	31.3.2020	31.3.2019
純資産額、米ドル		321 289 638.43	239 902 499.64	226 461 853.07
クラスP - a c c 受益証券	LU0464244333			
発行済受益証券		284 255.4330	308 150.1680	518 976.3510
受益証券1口当たりの純資産価格、米ドル		164.30	153.78	149.70
受益証券1口当たり発行および買戻価格、米ドル ¹		164.30	152.63	149.70

¹ 注記1を参照のこと。

投資有価証券の構成

地域別分類	純資産割合%	業種別分類	純資産割合%
香港	17.81	金融および持株会社	26.86
中国	16.86	銀行およびその他の金融機関	15.75
英領ヴァージン諸島	9.25	不動産	11.28
シンガポール	9.23	投資信託	7.08
フィリピン	7.65	石油	6.87
ケイマン諸島	6.66	エネルギーおよび水道	4.96
ルクセンブルグ	6.27	国債および中央政府債	4.50
インド	6.02	建築業および資材	3.47
フランス	3.02	各種サービス	2.65
インドネシア	2.95	交通および運輸	1.63
韓国	2.48	鉱業、石炭採掘および鉄鋼業	1.52
マレーシア	1.75	自動車	1.49
日本	1.49	モーゲージおよび貸付機関	1.30
タイ	1.37	その他の非分類会社	1.30
アメリカ合衆国	1.26	通信	1.17
モリシャス	1.06	化学	1.13
マカオ	0.87	宿泊、ケータリングおよび娯楽施設	1.12
メキシコ	0.66	電気機器および部品	0.99
イギリス	0.62	グラフィック・デザイン、出版およびメディア	0.92
カナダ	0.29	コンピューター・ハードウェアおよびネットワーク設備 ロバイダー	0.73
オランダ	0.26	電子および半導体	0.64
スリランカ	0.11	バイオテクノロジー	0.48
チリ	0.06	市および地方自治体	0.16
合計	98.00	合計	98.00

U B S (Lux) ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド (ユーロ)

最も重要な数字

	ISIN	30.9.2020	31.3.2020	31.3.2019
純資産額、ユーロ		1 662 601 786.20	1 597 048 818.93	2 074 758 338.54
クラス P - a c c 受益証券	LU0086177085			
発行済受益証券		1 002 159.3540	1 089 353.0640	1 541 307.2290
受益証券 1口当たりの純資産価格、ユーロ		208.18	182.68	206.22
受益証券 1口当たり発行および買戻価格、ユーロ ¹		208.18	183.90	206.22
クラス (米ドル・ヘッジ) P - a c c 受益証券	LU0994471687			
発行済受益証券		360 704.1550	345 389.5480	629 372.3290
受益証券 1口当たりの純資産価格、米ドル		135.16	117.54	129.17
受益証券 1口当たり発行および買戻価格、米ドル ¹		135.16	118.33	129.17
クラス P - m d i s t 受益証券	LU0417441200			
発行済受益証券		1 020 775.9570	1 081 839.6340	1 335 381.7070
受益証券 1口当たりの純資産価格、ユーロ		123.71	111.15	131.73
受益証券 1口当たり発行および買戻価格、ユーロ ¹		123.71	111.89	131.73
クラス (米ドル・ヘッジ) P - m d i s t 受益証券	LU0937166394			
発行済受益証券		3 241 873.8100	3 282 339.2430	4 015 414.5300
受益証券 1口当たりの純資産価格、米ドル		88.32	79.39	93.38
受益証券 1口当たり発行および買戻価格、米ドル ¹		88.32	79.92	93.38

¹ 注記 1 を参照のこと。

投資有価証券の構成

地域別分類	純資産割合%	業種別分類	純資産割合%
オランダ	11.99	金融および持株会社	35.11
フランス	10.88	通信	10.15
アメリカ合衆国	10.75	銀行およびその他の金融機関	9.20
イタリア	9.48	インターネット、ソフトウェアおよびITサービス	6.52
ドイツ	9.13	各種サービス	3.59
ルクセンブルグ	8.43	自動車	3.57
イギリス	8.33	医薬品、化粧品および医療製品	2.65
日本	3.23	石油	2.56
スペイン	3.21	エネルギーおよび水道	2.46
スウェーデン	3.17	不動産	2.29
メキシコ	2.81	ヘルスケアおよび社会福祉	2.17
カナダ	2.47	交通および運輸	1.82
デンマーク	1.85	保険	1.25
アイルランド	1.57	小売業および百貨店	1.23
ジャージー島	1.17	包装業	1.23
スロベニア	0.97	鉱業、石炭採掘および鉄鋼業	1.20
ケイマン諸島	0.73	宿泊、ケータリングおよび娯楽施設	1.16
ポルトガル	0.61	機械工学および産業機器	0.87
オーストリア	0.48	化学	0.76
英領ヴァージン諸島	0.46	国債および中央政府債	0.51
ノルウェー	0.45	建築業および資材	0.41
チェコ共和国	0.40	モーゲージおよび貸付機関	0.39
シンガポール	0.34	農業および漁業	0.37
ルーマニア	0.33	電気機器および部品	0.37
パナマ	0.33	投資信託	0.31
モーリシャス	0.23	電子および半導体	0.31
合計	93.80	各種消費財	0.24
		バイオテクノロジー	0.23
		航空宇宙産業	0.23
		食品および清涼飲料	0.23
		各種貿易会社	0.21
		繊維、衣類および革製品	0.20
		合計	93.80

[次へ](#)

第三部 特別情報

第1 管理会社の概況

1 管理会社の概況

(1) 資本金の額

<訂正前>

株主資本の13,000,000ユーロ(約16億円)は、1株2,000ユーロ(242,160円)の株式6,500株によって表章される。2020年6月末日現在、すべての株式は全額払込済みである。

(後略)

<訂正後>

株式資本の13,000,000ユーロ(約16億円)は、1株2,000ユーロ(244,280円)の株式6,500株によって表章される。2020年10月末日現在、すべての株式は全額払込済みである。

(後略)

2 事業の内容及び営業の概況

<訂正前>

(前略)

管理会社は、2020年6月末日現在、以下のとおり、414本の投資信託/投資法人のサブ・ファンドの管理・運用を行っている。

国別(設立国)	種類別(基本的性格)	本数	純資産額の合計(通貨別)
ルクセンブルグ	オープン・エンド型 投資信託/投資法人	374	529,207,900.47オーストラリア・ドル
			1,538,965,496.61カナダ・ドル
			10,822,521,273.98スイス・フラン
			3,838,865,323.70中国元
			924,531,072.56デンマーク・クローネ
			44,279,310,216.54ユーロ
			1,881,609,169.68英ポンド
			241,487,575.88香港ドル
			291,496,399,479.27日本円
			80,737,848.24シンガポール・ドル
			124,385,183,451.46米ドル
アイルランド	オープン・エンド型 投資信託/投資法人	40	281,742,771.44オーストラリア・ドル
			530,619,580.25スイス・フラン
			2,906,115,389.74ユーロ
			1,875,874,909.00英ポンド
			15,455,615,766.67米ドル

<訂正後>

(前略)

管理会社は、2020年10月末日現在、以下のとおり、407本の投資信託/投資法人のサブ・ファンドの管理・運用を行っている。

国別(設立国)	種類別(基本的性格)	本数	純資産額の合計(通貨別)
ルクセンブルグ	オープン・エンド型 投資信託/投資法人	368	538,900,417.88オーストラリア・ドル
			2,732,826,505.11カナダ・ドル
			10,702,158,679.99スイス・フラン
			5,510,362,689.21中国元
			827,096,452.87デンマーク・クローネ
			45,272,781,812.17ユーロ
			1,849,867,539.15英ポンド
			222,652,641.06香港ドル
			311,239,735,887.54日本円
			72,933,918.34シンガポール・ドル
			130,156,409,870.73米ドル
アイルランド	オープン・エンド型 投資信託/投資法人	39	409,064,736.32オーストラリア・ドル
			449,285,352.62スイス・フラン
			2,573,459,589.55ユーロ
			2,031,385,772.40英ポンド
			18,687,528,222.02米ドル

[次へ](#)

3 管理会社の経理状況

以下の中間財務書類が追加されます。

- a . 管理会社の日本文の中間財務書類は、管理会社によって作成された原文の中間財務書類を翻訳したものである。これは、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定に準拠して作成されている。
- b . 管理会社の中間財務書類は、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。
- c . 管理会社の原文の財務書類はユーロで表示されている。日本文の財務書類には、2020年10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ユーロ=122.14円)で換算された円換算額が併記されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

UBSファンド・マネジメント(ルクセンブルグ)エス・エイ

貸借対照表

2020年6月30日現在

	2020年6月30日		2019年12月31日	
	ユーロ	千円	ユーロ	千円
資産				
A. 未払込資本	0.00	0	0.00	0
. 払込請求されていない資本	0.00	0	0.00	0
. 払込請求されたが未払込の資本	0.00	0	0.00	0
B. 創業費	0.00	0	0.00	0
C. 固定資産	1,464,488.32	178,873	5,619,778.73	686,400
. 無形資産	1,464,488.32	178,873	5,619,778.73	686,400
1. 開発費	0.00	0	0.00	0
3. 有価約因として取得された 範囲内ののれん	1,464,488.32	178,873	5,619,778.73	686,400
4. 事前支払額および無形資産仮勘定	0.00	0	0.00	0
. 有形資産	0.00	0	0.00	0
1. 土地および建物	0.00	0	0.00	0
2. 工場および機械	0.00	0	0.00	0
3. その他の什器・備品、器具 および機器	0.00	0	0.00	0
4. 事前支払額および建設仮勘定	0.00	0	0.00	0
D. 流動資産	170,729,421.32	20,852,892	216,211,012.66	26,408,013
. 棚卸資産	0.00	0	0.00	0
. 債権	27,508,341.57	3,359,869	57,189,419.87	6,985,116
1. 売掛金	22,814,573.32	2,786,572	53,584,938.90	6,544,864
a) 1年以内に期限到来	22,814,573.32	2,786,572	53,584,938.90	6,544,864
b) 1年を超えて期限到来	0.00	0	0.00	0
2. 関連会社に対する債権	4,693,768.25	573,297	3,604,480.97	440,251
a) 1年以内に期限到来	4,693,768.25	573,297	3,604,480.97	440,251
b) 1年を超えて期限到来	0.00	0	0.00	0
3. 参加持分に連動する 関連会社に対する債権	0.00	0	0.00	0
4. その他の債権	0.00	0	0.00	0
. 投資	122,781.82	14,997	122,758.33	14,994
1. 関連会社持分	0.00	0	0.00	0
2. 自己株式	0.00	0	0.00	0
3. その他の投資	122,781.82	14,997	122,758.33	14,994
. 銀行預金および手元現金	143,098,297.93	17,478,026	158,898,834.46	19,407,904
E. 前払金	1,106,624.11	135,163	534,849.89	65,327
資産合計	173,300,533.75	21,166,927	222,365,641.28	27,159,739

	2020年6月30日		2019年12月31日	
	ユーロ	千円	ユーロ	千円
資本金および負債				
A. 資本金および準備金	33,482,445.26	4,089,546	44,120,076.96	5,388,826
・払込資本金	13,000,000.00	1,587,820	13,000,000.00	1,587,820
・資本剰余金	0.00	0	0.00	0
・再評価積立金	0.00	0	0.00	0
・準備金	8,132,000.00	993,242	8,413,300.00	1,027,600
1. 法定準備金	1,300,000.00	158,782	1,300,000.00	158,782
2. 自己株式に対する準備金	0.00	0	0.00	0
3. 定款に規定された準備金	0.00	0	0.00	0
4. 公正価値準備金を含む その他の準備金	6,832,000.00	834,460	7,113,300.00	868,818
a) その他の分配可能準備金	150,000.00	18,321	150,000.00	18,321
b) その他の分配不能準備金	6,682,000.00	816,139	6,963,300.00	850,497
・繰越損益	88,076.96	10,758	73,804.81	9,015
・当期損益	12,262,368.30	1,497,726	22,632,972.15	2,764,391
・中間配当金	0.00	0	0.00	0
・資本投資助成金	0.00	0	0.00	0
B. 引当金	2,954,341.82	360,843	2,577,912.46	314,866
1. 年金および類似の債務に対する 引当金	0.00	0	0.00	0
2. 納税引当金	2,954,341.82	360,843	2,577,912.46	314,866
3. その他の引当金	0.00	0	0.00	0
C. 債務	136,863,746.67	16,716,538	175,667,651.86	21,456,047
1. 社債	0.00	0	0.00	0
2. 金融機関に対する債務	0.00	0	0.00	0
3. 棚卸資産からの控除として 区分表示される範囲の注文前受金	0.00	0	0.00	0
4. 買掛金	0.00	0	0.00	0
5. 未払為替手形	0.00	0	0.00	0
6. 関連会社に対する債務	114,412,633.47	13,974,359	138,913,599.31	16,966,907
a) 1年以内に期限到来	114,412,633.47	13,974,359	138,913,599.31	16,966,907
b) 1年を超えて期限到来	0.00	0	0.00	0
7. 参加持分に連動する 関連会社に対する債務	0.00	0	0.00	0
8. その他の債務	22,451,113.20	2,742,179	36,754,052.55	4,489,140
a) 税金債務	110,865.98	13,541	100,815.46	12,314
b) 社会保障債務	206,653.85	25,241	334,020.67	40,797
c) その他の債務	22,133,593.37	2,703,397	36,319,216.42	4,436,029
) 1年以内に期限到来	22,133,593.37	2,703,397	36,319,216.42	4,436,029
) 1年を超えて期限到来	0.00	0	0.00	0
D. 繰延収益	0.00	0	0.00	0
資本金、準備金および負債合計	173,300,533.75	21,166,927	222,365,641.28	27,159,739

UBSファンド・マネジメント（ルクセンブルグ）エス・エイ

損益計算書

2020年6月30日に終了した期間および2019年12月31日に終了した年度

	2020年1月1日から 2020年6月30日まで		2019年1月1日から 2019年12月31日まで	
	ユーロ	千円	ユーロ	千円
1. 純取引高	403,628,044.54	49,299,129	806,953,402.76	98,561,289
4. その他の営業収益	606,104.18	74,030	595,747.27	72,765
5. 原材料ならびに消耗品および その他の外部費用	371,486,392.27	45,373,348	743,333,142.48	90,790,710
a) 原材料および消耗品	0.00	0	0.00	0
b) その他の外部費用	371,486,392.27	45,373,348	743,333,142.48	90,790,710
6. 人件費	4,695,110.58	573,461	7,018,605.23	857,252
a) 賃金および給与	3,991,694.61	487,546	6,031,940.09	736,741
b) 社会保障費	525,038.85	64,128	929,095.57	113,480
) 年金に関連するもの	381,119.14	46,550	614,122.80	75,009
) その他の社会保障費	143,919.71	17,578	314,972.77	38,471
c) その他の人件費	178,377.12	21,787	57,569.57	7,032
7. 評価額調整	4,187,420.40	511,452	13,388,634.80	1,635,288
a) 創業費ならびに有形固定資産および 無形固定資産に関連するもの	4,187,420.40	511,452	13,388,634.80	1,635,288
b) 流動資産に関連するもの	0.00	0	0.00	0
8. その他の営業費用	1,346,041.06	164,405	4,188,235.52	511,551
11. 受取利息および類似収益	31,879.07	3,894	199,709.59	24,393
a) 関連会社に関連するもの	31,879.07	3,894	199,709.59	24,393
b) その他の受取利息および類似収益	0.00	0	0.00	0
14. 支払利息および類似費用	7,014,003.80	856,690	11,390,890.83	1,391,283
a) 関連会社に関連するもの	6,628,618.53	809,619	11,054,281.39	1,350,170
b) その他の支払利息および類似費用	385,385.27	47,071	336,609.44	41,113
15. 損益にかかる税金	3,274,691.38	399,971	5,796,378.61	707,970
16. 税引後損益	12,262,368.30	1,497,726	22,632,972.15	2,764,391
17. 前科目に含まれないその他の税金	0.00	0	0.00	0
18. 当期損益	12,262,368.30	1,497,726	22,632,972.15	2,764,391