

【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】 2023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
アンドレア・パパゾーニ（Andrea Papazzoni）
メンバー・オブ・ザ・エグゼクティブ・ボード
フェデリカ・ガーランディーニ（Federica Ghirlandini）

【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
15億9,375万オーストラリア・ドル（約1,526億円）
クラスP - a c c 受益証券
35億8,680万オーストラリア・ドル（約3,435億円）
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
8億9,192万ユーロ（約1,406億円）
クラスP - a c c 受益証券
14億3,244万ユーロ（約2,258億円）
UBS（Lux）ボンド・ファンド - アジア・フレキシブル（米ドル）
（UBS（Lux）Bond Fund-Asia Flexible（USD））
クラスP - a c c 受益証券
6億7,535万アメリカ合衆国ドル（約979億円）

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)

11億5,240万アメリカ合衆国ドル (約1,671億円)

クラス P - m d i s t 受益証券 (米ドル・ヘッジ)

6億4,240万アメリカ合衆国ドル (約931億円)

クラス P - a c c 受益証券

17億672万ユーロ (約2,690億円)

クラス P - m d i s t 受益証券

8億9,560万ユーロ (約1,411億円)

(注1) 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、2023年6月30日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売相場(1豪ドル=95.77円、1ユーロ=157.60円、1米ドル=144.99円)による。

(注2) 2022年9月30日付で、サブ・ファンドの名称である「フルサイクル・アジア・ボンド(米ドル)(Full Cycle Asian Bond (USD))」が「アジア・フレキシブル(米ドル)(Asia Flexible (USD))」に変更された。

【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、2023年8月31日付をもって提出した有価証券届出書(2023年10月2日付の有価証券届出書の訂正届出書により訂正済)(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いません。

[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20億円)は、1株2,000ユーロ(315,200円)の株式6,500株によって表章される。2023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21億円)は、1株2,000ユーロ(317,320円)の株式6,500株によって表章される。2023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、2023年10月31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=158.66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)

(2023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	224,666,019.70	77.02
	国際機関	17,240,671.00	5.91
	米国	12,367,149.00	4.24
	イギリス	6,949,088.00	2.38
	カナダ	6,267,437.00	2.15
	韓国	6,161,465.00	2.11
	スウェーデン	4,432,612.00	1.52
	スイス	2,516,444.00	0.86
	ノルウェー	2,499,336.00	0.86
	シンガポール	1,856,832.00	0.64
	ニュージーランド	784,880.00	0.27
	小計	285,741,933.70	97.96
モーゲージ担保証券/ 資産担保証券/ その他割引債	オーストラリア	1,436,046.70	0.49
投資有価証券合計		287,177,980.40	98.45
現金・その他の資産(負債控除後)		4,529,076.48	1.55
合計 (純資産総額)		291,707,056.88 (約27,768百万円)	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、2023年10月31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=95.19円、1ユーロ=158.66円、1米ドル=149.51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）

（2023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	米国	11,148,188.09	10.57
	フランス	9,141,509.05	8.67
	ニュージーランド	8,997,128.89	8.53
	ドイツ	7,575,530.26	7.19
	スペイン	7,050,822.56	6.69
	オランダ	6,753,281.46	6.41
	イタリア	5,684,118.53	5.39
	イギリス	4,595,005.31	4.36
	国際機関	4,151,231.42	3.94
	ベルギー	3,164,328.30	3.00
	ルクセンブルグ	2,597,705.76	2.46
	スロベニア	1,982,809.60	1.88
	オーストラリア	1,922,738.47	1.82
	オーストリア	1,738,060.80	1.65
	ポルトガル	1,434,370.00	1.36
	スイス	1,430,852.98	1.36
	ギリシャ	1,056,946.00	1.00
	スロバキア	991,819.60	0.94
	トルコ	807,594.13	0.77
	ルーマニア	738,125.00	0.70
	カザフスタン	713,816.00	0.68
	ブラジル	688,940.79	0.65
	日本	679,114.56	0.64
	ケイマン諸島	668,411.59	0.63
	ペルー	619,020.00	0.59
	ノルウェー	603,454.16	0.57
	アイルランド	594,754.60	0.56
	チリ	541,072.00	0.51
	ポーランド	524,560.00	0.50
	フィリピン	442,730.00	0.42
	エジプト	389,995.13	0.37
	フィンランド	372,808.25	0.35
	インドネシア	310,536.00	0.29
中国	283,624.35	0.27	
アルゼンチン	168,817.69	0.16	
バミューダ	148,002.00	0.14	
コロンビア	143,803.21	0.14	
エクアドル	140,552.75	0.13	

	ロシア連邦	136,489.41	0.13
	メキシコ	136,354.00	0.13
	スウェーデン	124,887.92	0.12
	デンマーク	111,617.76	0.11
	小計	91,505,528.38	86.79
投資信託	ルクセンブルグ	1,661,398.74	1.58
モーゲージ担保証券 / 資産担保証券 / その他割引債	米国	3,034,479.09	2.88
投資有価証券合計		96,201,406.21	91.24
現金・その他の資産(負債控除後)		9,230,594.34	8.76
合計 (純資産総額)		105,432,000.55 (約16,728百万円)	100.00

(アジア・フレキシブル(米ドル))

(2023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	韓国	49,755,304.75	13.59
	香港	38,516,756.31	10.52
	英領ヴァージン諸島	35,291,126.84	9.64
	シンガポール	30,768,767.59	8.40
	インドネシア	27,994,410.28	7.64
	インド	21,542,016.56	5.88
	ケイマン諸島	20,920,116.92	5.71
	中国	18,410,247.84	5.03
	イギリス	13,757,568.25	3.76
	フィリピン	13,150,135.95	3.59
	オーストラリア	11,230,430.96	3.07
	マレーシア	10,082,072.25	2.75
	タイ	10,037,968.95	2.74
	日本	6,393,715.13	1.75
	米国	5,275,834.42	1.44
	オランダ	2,182,327.38	0.60
	スリランカ	2,168,019.50	0.59
	モーリシャス	1,899,451.59	0.52
	マカオ	1,793,815.56	0.49
	ベトナム	1,667,494.00	0.46
	パキスタン	1,435,950.50	0.39
	カナダ	975,460.00	0.27
	モンゴル	585,186.00	0.16
	ジャージー	476,791.00	0.13
	チリ	378,864.00	0.10
バミューダ	224,997.50	0.06	
小計		326,914,830.03	89.27
投資信託	ルクセンブルグ	19,209,820.00	5.25
	香港	11,133,437.58	3.04
	小計	30,343,257.58	8.29
短期金融商品	米国	3,499,489.28	0.96
投資有価証券合計		360,757,576.89	98.51
現金・その他の資産(負債控除後)		5,443,985.26	1.49
合計 (純資産総額)		366,201,562.15 (約54,751百万円)	100.00

(ユーロ・ハイ・イールド(ユーロ))

(2023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	フランス	197,849,577.14	14.57
	イギリス	155,467,328.91	11.45
	ルクセンブルグ	154,775,216.75	11.40
	オランダ	150,430,252.43	11.08
	ドイツ	146,483,821.30	10.79
	イタリア	128,119,315.92	9.44
	スペイン	95,108,860.83	7.00
	米国	46,162,023.05	3.40
	スウェーデン	31,205,165.41	2.30
	ギリシャ	24,684,223.02	1.82
	ポルトガル	22,998,619.00	1.69
	日本	18,034,704.85	1.33
	アイルランド	16,187,084.01	1.19
	イスラエル	15,733,965.12	1.16
	ベルギー	14,623,089.83	1.08
	チェコ共和国	9,668,286.10	0.71
	ジャージー	8,124,494.33	0.60
	ジブラルタル	8,118,700.00	0.60
	多国籍	8,018,850.58	0.59
	ノルウー	5,668,840.80	0.42
	パナマ	3,898,648.95	0.29
	フィンランド	3,685,586.76	0.27
	キプロス	3,301,754.75	0.24
小計	1,268,348,409.84	93.41	
投資信託	ルクセンブルグ	13,933,906.00	1.03
	アイルランド	108,500.00	0.01
	小計	14,042,406.00	1.03
投資有価証券合計		1,282,390,815.84	94.44
現金・その他の資産(負債控除後)		75,501,129.50	5.56
合計 (純資産総額)		1,357,891,945.34 (約215,443百万円)	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。

2023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。

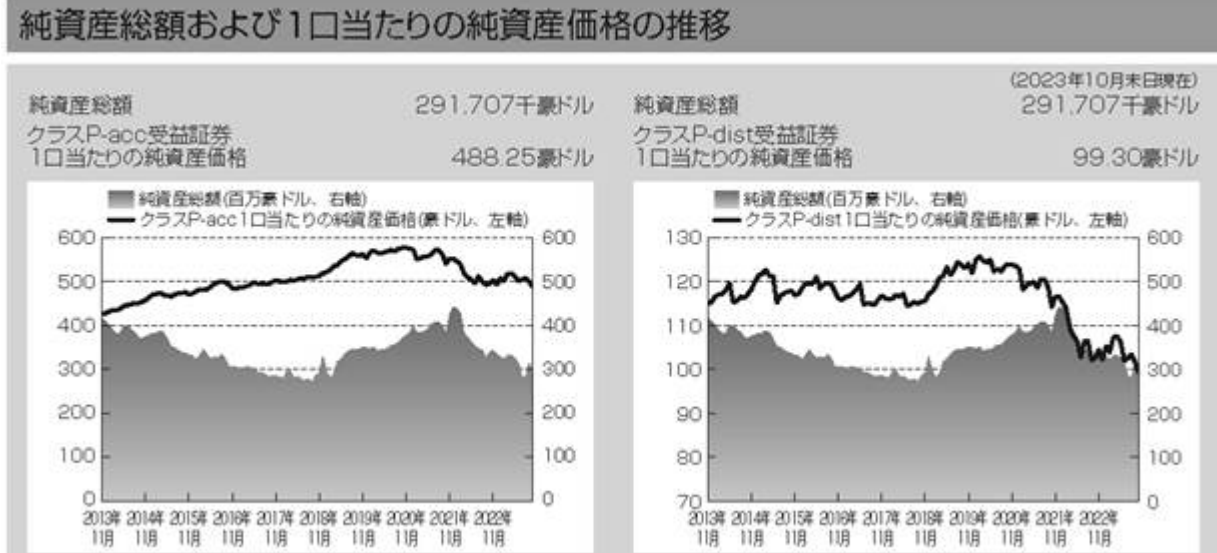
(オーストラリア・ドル)

	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
2022年11月末日	342,716	32,623	P - d i s t	104.49	45,154
			P - a c c	503.88	47,964
12月末日	334,706	31,861	P - d i s t	102.19	9,727
			P - a c c	492.80	46,910
2023年1月末日	328,322	31,253	P - d i s t	105.30	10,024
			P - a c c	507.79	48,337
2月末日	322,213	30,671	P - d i s t	103.87	9,887
			P - a c c	500.90	47,681
3月末日	330,530	31,463	P - d i s t	107.32	10,216
			P - a c c	517.55	49,266
4月末日	332,055	31,608	P - d i s t	107.60	10,242
			P - a c c	518.89	49,393
5月末日	324,978	30,935	P - d i s t	106.25	10,114
			P - a c c	512.40	48,775
6月末日	313,889	29,879	P - d i s t	102.00	9,709
			P - a c c	501.52	47,740
7月末日	284,098	27,043	P - d i s t	102.54	9,761
			P - a c c	504.20	47,995
8月末日	281,762	26,821	P - d i s t	103.47	9,849
			P - a c c	508.74	48,427
9月末日	313,393	29,832	P - d i s t	101.58	9,669
			P - a c c	499.44	47,542
10月末日	291,707	27,768	P - d i s t	99.30	9,452
			P - a c c	488.25	46,477

(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 >



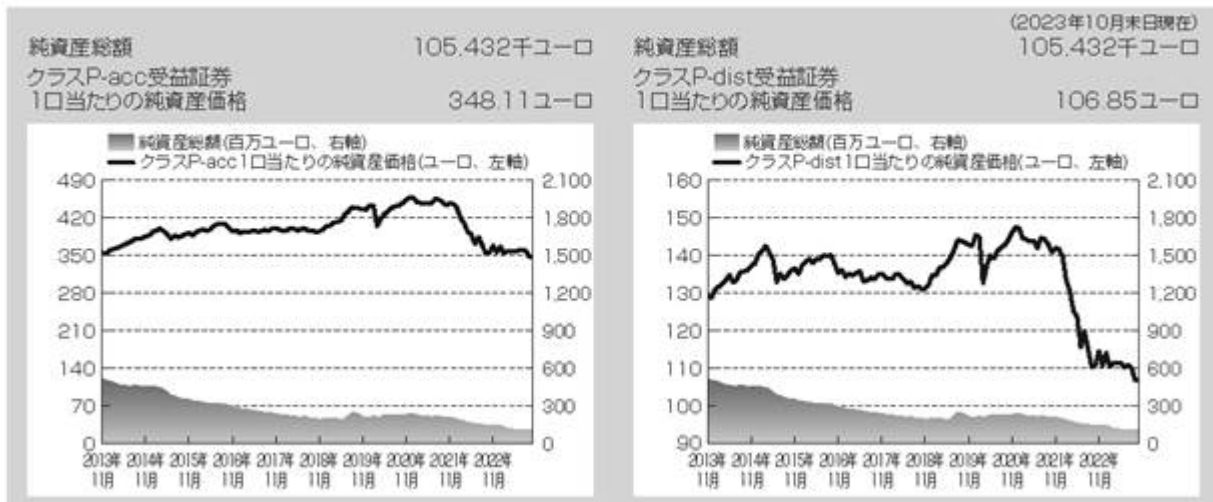
サブ・ファンドの運用実績は、あくまで過去の実績であり将来の運用成果を約束するものではない。

(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
2022年11月末日	146,204	23,197	P - d i s t	114.55	18,175
			P - a c c	367.95	58,379
12月末日	140,426	22,280	P - d i s t	110.69	17,562
			P - a c c	355.56	56,413
2023年1月末日	143,936	22,837	P - d i s t	114.14	18,109
			P - a c c	366.64	58,171
2月末日	132,508	21,024	P - d i s t	110.43	17,521
			P - a c c	354.72	56,280
3月末日	117,400	18,627	P - d i s t	111.34	17,665
			P - a c c	357.65	56,745
4月末日	116,849	18,539	P - d i s t	111.38	17,672
			P - a c c	357.76	56,762
5月末日	112,504	17,850	P - d i s t	111.49	17,689
			P - a c c	358.11	56,818
6月末日	112,258	17,811	P - d i s t	110.21	17,486
			P - a c c	359.05	56,967
7月末日	111,852	17,746	P - d i s t	110.80	17,580
			P - a c c	360.98	57,273
8月末日	109,756	17,414	P - d i s t	110.20	17,484
			P - a c c	359.01	56,961
9月末日	105,861	16,796	P - d i s t	106.75	16,937
			P - a c c	347.77	55,177
10月末日	105,432	16,728	P - d i s t	106.85	16,953
			P - a c c	348.11	55,231

< 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



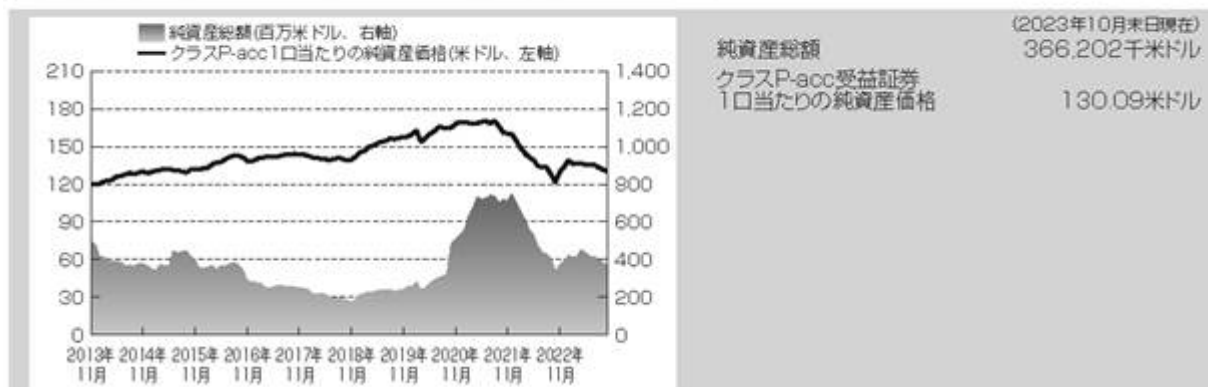
サブ・ファンドの運用実績は、あくまで過去の実績であり将来の運用成果を約束するものではない。

(アジア・フレキシブル(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
2022年11月末日	368,161	55,044	P - a c c	129.49	19,360
12月末日	389,630	58,254	P - a c c	133.48	19,957
2023年1月末日	419,137	62,665	P - a c c	138.94	20,773
2月末日	411,705	61,554	P - a c c	135.90	20,318
3月末日	412,455	61,666	P - a c c	136.44	20,399
4月末日	451,494	67,503	P - a c c	136.84	20,459
5月末日	432,946	64,730	P - a c c	135.07	20,194
6月末日	416,120	62,214	P - a c c	135.22	20,217
7月末日	412,056	61,606	P - a c c	135.38	20,241
8月末日	400,633	59,899	P - a c c	133.21	19,916
9月末日	383,944	57,403	P - a c c	131.55	19,668
10月末日	366,202	54,751	P - a c c	130.09	19,450

< 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。

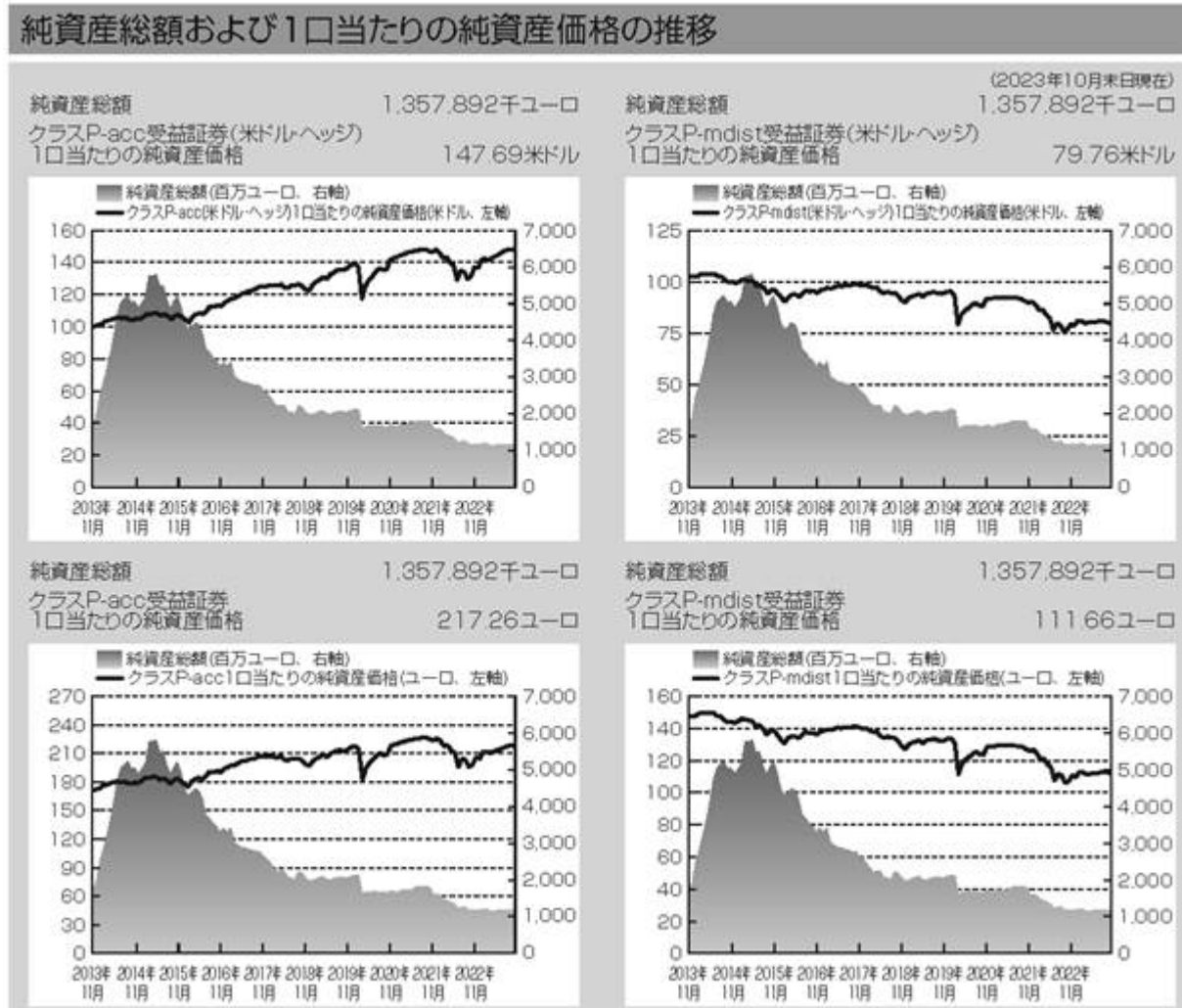
(ユーロ・ハイ・イールド(ユーロ))

	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
2022年11月末日	1,188,573	188,579	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	137.15米ドル	20,505
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	79.41米ドル	11,873
			P - a c c	205.75ユーロ	32,644
			P - m d i s t	110.70ユーロ	17,564
12月末日	1,164,358	184,737	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	136.66米ドル	20,432
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	78.63米ドル	11,756
			P - a c c	204.30ユーロ	32,414
			P - m d i s t	109.46ユーロ	17,367
2023年1月末日	1,201,884	190,691	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	141.91米ドル	21,217
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	81.15米ドル	12,133
			P - a c c	211.60ユーロ	33,572
			P - m d i s t	112.91ユーロ	17,914
2月末日	1,201,252	190,591	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	142.24米ドル	21,266
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	80.82米ドル	12,083
			P - a c c	211.83ユーロ	33,609
			P - m d i s t	112.57ユーロ	17,860
3月末日	1,148,200	182,173	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	141.59米ドル	21,169
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	79.93米ドル	11,950
			P - a c c	210.32ユーロ	33,369
			P - m d i s t	111.29ユーロ	17,657
4月末日	1,147,470	182,058	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	142.91米ドル	21,366
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	80.17米ドル	11,986
			P - a c c	211.96ユーロ	33,630
			P - m d i s t	111.70ユーロ	17,722
5月末日	1,175,946	186,576	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	144.05米ドル	21,537
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	80.30米ドル	12,006
			P - a c c	213.34ユーロ	33,849
			P - m d i s t	111.95ユーロ	17,762

	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	1,249,730	198,282	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	145.15米ドル	21,701
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	80.40米ドル	12,021
			P - a c c	214.54ユーロ	34,039
			P - m d i s t	112.12ユーロ	17,789
7月末日	1,293,553	205,235	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	146.65米ドル	21,926
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	80.71米ドル	12,067
			P - a c c	216.41ユーロ	34,336
			P - m d i s t	112.62ユーロ	17,868
8月末日	1,300,778	206,381	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	147.67米ドル	22,078
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	80.77米ドル	12,076
			P - a c c	217.68ユーロ	34,537
			P - m d i s t	112.81ユーロ	17,898
9月末日	1,326,384	210,444	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	148.25米ドル	22,165
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	80.57米ドル	12,046
			P - a c c	218.34ユーロ	34,642
			P - m d i s t	112.68ユーロ	17,878
10月末日	1,357,892	215,443	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	147.69米ドル	22,081
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	79.76米ドル	11,925
			P - a c c	217.26ユーロ	34,470
			P - m d i s t	111.66ユーロ	17,716

(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 >



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-dist受益証券)

期間	1口当たりの分配金額(豪ドル)
第34会計年度	2.04(約194円)

(ユーロ・フレキシブル)(クラスP-dist受益証券)

期間	1口当たりの分配金額(ユーロ)
第34会計年度	1.5651(約248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)
2022年10月	0.49 (約73円)
11月	0.50 (約75円)
12月	0.50 (約75円)
2023年1月	0.52 (約78円)
2月	0.51 (約76円)
3月	0.51 (約76円)
4月	0.51 (約76円)
5月	0.51 (約76円)
6月	0.51 (約76円)
7月	0.5125 (約77円)
8月	0.5129 (約77円)
9月	0.5116 (約76円)
直近1年累計	6.0970 (約912円)
設定来累計	61.9170 (約9,257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)
2022年10月	0.45 (約71円)
11月	0.46 (約73円)
12月	0.46 (約73円)
2023年1月	0.47 (約75円)
2月	0.47 (約75円)
3月	0.46 (約73円)
4月	0.47 (約75円)
5月	0.47 (約75円)
6月	0.47 (約75円)
7月	0.4693 (約74円)
8月	0.47 (約75円)
9月	0.4695 (約74円)
直近1年累計	5.5888 (約887円)
設定来累計	107.0388 (約16,983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。

2023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)	- 1.36	- 1.46
(ユーロ・フレキシブル)	- 2.15	- 2.19
(アジア・フレキシブル(米ドル))	-	6.85

(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
12.05	11.81	9.51	9.39

（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。

2023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2023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	13,028.6860 (0)	85,283.2480 (2,223)	497,138.8370 (1,733)
P - a c c	16,389.2400 (0)	109,446.8440 (0)	201,588.9790 (1,411)

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

一方、（ ）の上段の数字は約定日を基準として算出している。以下同じ。

（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	14,007.3560 (0)	23,135.1600 (0)	270,781.0470 (854)
P - a c c	3,257.4940 (0)	29,254.1570 (0)	207,529.5540 (913.3610)

（注）2023年10月末日前1年間に、UBS（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブルのP - a c c受益証券350口が海外から国内に移管された。

（アジア・フレキシブル（米ドル））

	販売口数	買戻し口数	発行済口数
P - a c c	23,599.3580 (0)	49,731.6410 (2,718.9850)	198,874.0550 (12,128.6130)

（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)	187,673.3060 (0)	271,601.6500 (2,864.9190)	179,630.2390 (20,963.2970)
P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	153,041.3180 (0)	350,566.1750 (13,212.6180)	1,890,706.7960 (32,415.3120)
P - a c c	188,475.0610 (6,693.1690)	155,743.0510 (0)	728,601.6080 (26,827.9880)
P - m d i s t	91,529.3570 (0)	107,920.7000 (0)	682,931.2740 (6,236.4340)

[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) - アジア・フレキシブル(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2023年10月31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=95.19円、1ユーロ=158.66円、1米ドル=149.51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
2023年9月30日現在

	UBS（Lux）ボンド・ファンド	
	ユーロ	千円
資 産		
投資有価証券取得原価	2,954,920,203.09	468,827,639
投資有価証券未実現評価（損）益	(270,091,413.13)	(42,852,704)
投資有価証券合計（注１）	2,684,828,789.96	425,974,936
現金預金、要求払い預金および貯蓄預金	94,428,448.62 *	14,982,018
その他の流動資産（委託証拠金）	12,723,149.44	2,018,655
定期預金および信託預金	3,376,081.04	535,649
有価証券売却未収金（注１）	6,424,674.64	1,019,339
発行受益証券未収金	1,776,627.57	281,880
未収有価証券利息	34,677,731.79	5,501,969
流動資産に係る未収利息	1,805.51	286
前払費用	462,202.62	73,333
その他の未収金	82,258.01	13,051
金融先物に係る未実現利益（注１）	273,949.03	43,465
為替予約契約に係る未実現利益（注１）	2,796,038.72	443,620
スワップに係る未実現利益（注１）	1,353,386.61	214,728
資産合計	2,843,205,143.56	451,102,928
負 債		
TBAモーゲージ・バック証券に係る 未実現損失（注１）	(15,649.30)	(2,483)
金融先物に係る未実現損失（注１）	(1,449,525.16)	(229,982)
為替予約契約に係る未実現損失（注１）	(6,204,672.46)	(984,433)
スワップに係る未実現損失（注１）	(749,186.14)	(118,866)
当座借越	(7,708,135.61)	(1,222,973)
当座借越に係る未払利息	(47,337.48)	(7,511)
有価証券購入未払金（注１）	(39,171,520.85)	(6,214,953)
買戻受益証券未払金	(4,767,866.32)	(756,470)
その他の未払金	(4,900.44)	(778)
報酬引当金（注２）	(1,591,607.19)	(252,524)
年次税引当金（注３）	(219,424.85)	(34,814)
その他の手数料および報酬に係る引当金（注２）	(411,105.58)	(65,226)
引当金合計	(2,222,137.62)	(352,564)
負債合計	(62,340,931.38)	(9,891,012)
期末現在純資産額	2,780,864,212.18	441,211,916

* 2023年9月30日現在、48,902.00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610,970.45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

2023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

資産	オーストラリア・ドル	千円
投資有価証券取得原価	338,897,988.52	32,259,700
投資有価証券未実現評価(損)益	(32,545,651.36)	(3,098,021)
投資有価証券合計(注1)	306,352,337.16	29,161,679
現金預金、要求払い預金および貯蓄預金	41,471.62	3,948
その他の流動資産(委託証拠金)	1,471,882.32	140,108
定期預金および信託預金	5,538,312.40	527,192
有価証券売却未収金(注1)	1,332,666.19	126,856
発行受益証券未収金	378,354.68	36,016
未収有価証券利息	2,379,141.25	226,470
前払費用	57,311.17	5,455
資産合計	317,551,476.79	30,227,725
負債		
金融先物に係る未実現損失(注1)	(677,232.56)	(64,466)
当座借越	(190,617.72)	(18,145)
当座借越に係る未払利息	(846.12)	(81)
有価証券購入未払金(注1)	(1,398,586.00)	(133,131)
買戻受益証券未払金	(1,666,590.14)	(158,643)
報酬引当金(注2)	(143,370.85)	(13,647)
年次税引当金(注3)	(33,776.55)	(3,215)
その他の手数料および報酬に係る引当金(注2)	(46,961.19)	(4,470)
引当金合計	(224,108.59)	(21,333)
負債合計	(4,157,981.13)	(395,798)
期末現在純資産額	313,393,495.66	29,831,927

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

2023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	123,353,534.48	19,571,272
投資有価証券未実現評価(損)益	(25,398,235.58)	(4,029,684)
投資有価証券合計(注1)	97,955,298.90	15,541,588
現金預金、要求払い預金および貯蓄預金	6,331,167.81 *	1,004,503
その他の流動資産(委託証拠金)	3,183,518.00	505,097
発行受益証券未収金	1,072.49	170
未収有価証券利息	1,076,384.68	170,779
流動資産に係る未収利息	176.85	28
前払費用	23,891.66	3,791
その他の未収金	12,200.00	1,936
スワップに係る未実現利益(注1)	729,966.11	115,816
資産合計	109,313,676.50	17,343,708
負債		
金融先物に係る未実現損失(注1)	(102,912.44)	(16,328)
為替予約契約に係る未実現損失(注1)	(569,600.73)	(90,373)
当座借越	(2,342,414.90)	(371,648)
有価証券購入未払金(注1)	(306,213.13)	(48,584)
買戻受益証券未払金	(26,162.46)	(4,151)
報酬引当金(注2)	(75,361.86)	(11,957)
年次税引当金(注3)	(12,870.01)	(2,042)
その他の手数料および報酬に係る引当金(注2)	(16,883.13)	(2,679)
引当金合計	(105,115.00)	(16,678)
負債合計	(3,452,418.66)	(547,761)
期末現在純資産額	105,861,257.84	16,795,947

* 2023年9月30日現在、20,000.00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76,000.00ユーロの現金が取引相手方であるJPMorgan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

2023年9月30日現在

	UBS(Lux)ボンド・ファンド - アジア・フレキシブル(米ドル)	
	米ドル	千円
資 産		
投資有価証券取得原価	436,914,637.33	65,323,107
投資有価証券未実現評価(損)益	(60,641,811.79)	(9,066,557)
投資有価証券合計(注1)	376,272,825.54	56,256,550
現金預金、要求払い預金および貯蓄預金	17,402,920.60	2,601,911
その他の流動資産(委託証拠金)	2,237,976.28	334,600
有価証券売却未収金(注1)	3,405,443.23	509,148
発行受益証券未収金	208,298.86	31,143
未収有価証券利息	3,845,836.68	574,991
前払費用	77,899.63	11,647
資産合計	403,451,200.82	60,319,989
負 債		
金融先物に係る未実現損失(注1)	(988,640.45)	(147,812)
為替予約契約に係る未実現損失(注1)	(3,354,046.50)	(501,463)
有価証券購入未払金(注1)	(13,862,037.58)	(2,072,513)
買戻受益証券未払金	(1,044,074.91)	(156,100)
報酬引当金(注2)	(179,235.23)	(26,797)
年次税引当金(注3)	(18,116.31)	(2,709)
その他の手数料および報酬に係る引当金(注2)	(60,652.33)	(9,068)
引当金合計	(258,003.87)	(38,574)
負債合計	(19,506,803.31)	(2,916,462)
期末現在純資産額	383,944,397.51	57,403,527

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

2023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	1,319,554,153.98	209,360,462
投資有価証券未実現評価(損)益	(46,518,620.79)	(7,380,644)
投資有価証券合計(注1)	1,273,035,533.19	201,979,818
現金預金、要求払い預金および貯蓄預金	49,278,813.72 *	7,818,577
有価証券売却未収金(注1)	360,862.50	57,254
発行受益証券未収金	1,251,785.88	198,608
未収有価証券利息	23,042,716.26	3,655,957
流動資産に係る未収利息	701.13	111
前払費用	183,926.45	29,182
為替予約契約に係る未実現利益(注1)	2,791,134.97	442,841
スワップに係る未実現利益(注1)	623,420.50	98,912
資産合計	1,350,568,894.60	214,281,261
負 債		
当座借越	(7.67)	(1)
当座借越に係る未払利息	(43,912.27)	(6,967)
有価証券購入未払金(注1)	(20,651,626.65)	(3,276,587)
買戻受益証券未払金	(2,310,591.71)	(366,598)
報酬引当金(注2)	(882,939.96)	(140,087)
年次税引当金(注3)	(111,506.52)	(17,692)
その他の手数料および報酬に係る引当金(注2)	(184,508.61)	(29,274)
引当金合計	(1,178,955.09)	(187,053)
負債合計	(24,185,093.39)	(3,837,207)
期末現在純資産額	1,326,383,801.21	210,444,054

* 2023年9月30日現在、130,000.00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2023年4月1日 至2023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	1,353,779.55	214,791
有価証券に係る利息	51,734,139.72	8,208,139
配当金	282,139.62	44,764
スワップに係る受取利息(注1)	8,316,855.00	1,319,552
貸付有価証券に係る純収益(注10)	828,184.14	131,400
その他の収益	1,087,655.48	172,567
収益合計	63,602,753.51	10,091,213
費 用		
スワップに係る支払利息(注1)	(10,144,927.20)	(1,609,594)
報酬(注2)	(10,192,964.11)	(1,617,216)
年次税(注3)	(447,167.79)	(70,948)
その他の手数料および報酬(注2)	(410,765.92)	(65,172)
現金および当座借越に係る利息	(326,679.75)	(51,831)
費用合計	(21,522,504.77)	(3,414,761)
投資に係る純(損)益	42,080,248.74	6,676,452
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	(41,964,059.61)	(6,658,018)
オプションに係る実現(損)益	(4,281.59)	(679)
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	223,934.10	35,529
金融先物に係る実現(損)益	(1,077,003.36)	(170,877)
為替予約契約に係る実現(損)益	7,788,061.18	1,235,654
スワップに係る実現(損)益	2,193,377.94	348,001
外国為替に係る実現(損)益	(7,187,558.41)	(1,140,378)
実現(損)益合計	(40,027,529.75)	(6,350,768)
当期実現純(損)益	2,052,718.99	325,684
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	26,531,663.00	4,209,514
オプションに係る未実現評価(損)益	(16,085.53)	(2,552)
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	(120,139.98)	(19,061)
T B A モーゲージ・バック証券に係る		
未実現評価(損)益	(33,465.78)	(5,310)
金融先物に係る未実現評価(損)益	(1,864,175.00)	(295,770)
為替予約契約に係る未実現評価(損)益	(4,086,855.49)	(648,420)
スワップに係る未実現評価(損)益	356,302.08	56,531
未実現評価(損)益の変動合計	20,767,243.30	3,294,931
運用の結果による純資産の純増(減)	22,819,962.29	3,620,615

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2023年4月1日 至2023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	125,376.39	11,935
有価証券に係る利息	4,771,188.84	454,169
貸付有価証券に係る純収益(注10)	399.51	38
その他の収益	60,477.80	5,757
収益合計	4,957,442.54	471,899
費 用		
報酬(注2)	(942,191.09)	(89,687)
年次税(注3)	(68,218.59)	(6,494)
その他の手数料および報酬(注2)	(46,859.87)	(4,461)
現金および当座借越に係る利息	(1,700.11)	(162)
費用合計	(1,058,969.66)	(100,803)
投資に係る純(損)益	3,898,472.88	371,096
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	(6,020,760.85)	(573,116)
金融先物に係る実現(損)益	(1,221,633.88)	(116,287)
外国為替に係る実現(損)益	446.44	42
実現(損)益合計	(7,241,948.29)	(689,361)
当期実現純(損)益	(3,343,475.41)	(318,265)
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	(6,975,682.10)	(664,015)
金融先物に係る未実現評価(損)益	(1,169,697.31)	(111,343)
未実現評価(損)益の変動合計	(8,145,379.41)	(775,359)
運用の結果による純資産の純増(減)	(11,488,854.82)	(1,093,624)

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2023年4月1日 至2023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	122,952.18	19,508
有価証券に係る利息	1,418,288.34	225,026
配当金	96,726.66	15,347
スワップに係る受取利息(注1)	2,658,357.61	421,775
貸付有価証券に係る純収益(注10)	26,950.40	4,276
その他の収益	5,012.97	795
収益合計	4,328,288.16	686,726
費 用		
スワップに係る支払利息(注1)	(3,487,761.96)	(553,368)
報酬(注2)	(492,523.66)	(78,144)
年次税(注3)	(26,477.07)	(4,201)
その他の手数料および報酬(注2)	(16,752.35)	(2,658)
現金および当座借越に係る利息	(73,217.24)	(11,617)
費用合計	(4,096,732.28)	(649,988)
投資に係る純(損)益	231,555.88	36,739
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	(3,187,559.93)	(505,738)
オプションに係る実現(損)益	(1,500.00)	(238)
金融先物に係る実現(損)益	675,272.85	107,139
為替予約契約に係る実現(損)益	122,832.27	19,489
スワップに係る実現(損)益	923,239.23	146,481
外国為替に係る実現(損)益	226,595.09	35,952
実現(損)益合計	(1,241,120.49)	(196,916)
当期実現純(損)益	(1,009,564.61)	(160,178)
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	(490,322.78)	(77,795)
オプションに係る未実現評価(損)益	(5,660.00)	(898)
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	89,100.38	14,137
金融先物に係る未実現評価(損)益	(74,665.24)	(11,846)
為替予約契約に係る未実現評価(損)益	(981,509.60)	(155,726)
スワップに係る未実現評価(損)益	(540,705.44)	(85,788)
未実現評価(損)益の変動合計	(2,003,762.68)	(317,917)
運用の結果による純資産の純増(減)	(3,013,327.29)	(478,095)

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2023年4月1日 至2023年9月30日

	UBS (Lux) ボンド・ファンド - アジア・フレキシブル(米ドル)	
	米ドル	千円
収 益		
流動資産に係る利息	236,089.85	35,298
有価証券に係る利息	8,025,762.44	1,199,932
貸付有価証券に係る純収益(注10)	278,020.85	41,567
その他の収益	191,848.21	28,683
収益合計	8,731,721.35	1,305,480
費 用		
報酬(注2)	(1,189,467.93)	(177,837)
年次税(注3)	(39,304.09)	(5,876)
その他の手数料および報酬(注2)	(62,201.84)	(9,300)
現金および当座借越に係る利息	(24,372.15)	(3,644)
費用合計	(1,315,346.01)	(196,657)
投資に係る純(損)益	7,416,375.34	1,108,822
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	(8,489,755.68)	(1,269,303)
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	47,561.54	7,111
金融先物に係る実現(損)益	(1,131,365.15)	(169,150)
為替予約契約に係る実現(損)益	3,882,686.06	580,500
外国為替に係る実現(損)益	613,843.63	91,776
実現(損)益合計	(5,077,029.60)	(759,067)
当期実現純(損)益	2,339,345.74	349,756
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	(9,531,122.64)	(1,424,998)
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	2,023.19	302
金融先物に係る未実現評価(損)益	(1,620,531.05)	(242,286)
為替予約契約に係る未実現評価(損)益	(8,344,014.09)	(1,247,514)
未実現評価(損)益の変動合計	(19,493,644.59)	(2,914,495)
運用の結果による純資産の純増(減)	(17,154,298.85)	(2,564,739)

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2023年4月1日至2023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	463,521.49	73,542
有価証券に係る利息	32,103,461.06	5,093,535
配当金	46,045.97	7,306
スワップに係る受取利息(注1)	578,383.10	91,766
貸付有価証券に係る純収益(注10)	502,768.60	79,769
その他の収益	560,264.94	88,892
収益合計	34,254,445.16	5,434,810
費 用		
スワップに係る支払利息(注1)	(118,063.11)	(18,732)
報酬(注2)	(5,565,292.89)	(882,989)
年次税(注3)	(226,444.52)	(35,928)
その他の手数料および報酬(注2)	(184,496.66)	(29,272)
現金および当座借越に係る利息	(96,345.03)	(15,286)
費用合計	(6,190,642.21)	(982,207)
投資に係る純(損)益	28,063,802.95	4,452,603
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	(10,877,938.43)	(1,725,894)
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	8,739.16	1,387
為替予約契約に係る実現(損)益	2,324,849.52	368,861
スワップに係る実現(損)益	(226,563.16)	(35,947)
外国為替に係る実現(損)益	(7,713,541.28)	(1,223,830)
実現(損)益合計	(16,484,454.19)	(2,615,424)
当期実現純(損)益	11,579,348.76	1,837,179
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	32,822,313.12	5,207,588
為替予約契約に係る未実現評価(損)益	8,021,692.91	1,272,722
スワップに係る未実現評価(損)益	1,253,360.66	198,858
未実現評価(損)益の変動合計	42,097,366.69	6,679,168
運用の結果による純資産の純増(減)	53,676,715.45	8,516,348

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2023年4月1日 至2023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	2,695,309,248.94 *	427,637,765
受益証券発行	520,628,945.05	82,602,988
受益証券買戻し	(431,061,167.44)	(68,392,165)
受益証券発行(買戻し)純額合計	89,567,777.61	14,210,824
支払分配金	(26,832,776.66)	(4,257,288)
純投資(損)益	42,080,248.74	6,676,452
実現(損)益合計	(40,027,529.75)	(6,350,768)
未実現評価(損)益の変動合計	20,767,243.30	3,294,931
運用の結果による純資産の純増(減)	22,819,962.29	3,620,615
期末現在純資産額	2,780,864,212.18	441,211,916

* 2023年9月30日の為替レートを使用して計算された。2023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の結合純資産は、2,675,740,859.04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2023年4月1日 至2023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	330,529,881.20	31,463,139
受益証券発行	54,009,706.32	5,141,184
受益証券買戻し	(56,949,520.92)	(5,421,025)
受益証券発行(買戻し)純額合計	(2,939,814.60)	(279,841)
支払分配金	(2,707,716.12)	(257,747)
純投資(損)益	3,898,472.88	371,096
実現(損)益合計	(7,241,948.29)	(689,361)
未実現評価(損)益の変動合計	(8,145,379.41)	(775,359)
運用の結果による純資産の純増(減)	(11,488,854.82)	(1,093,624)
期末現在純資産額	313,393,495.66	29,831,927

発行済受益証券数の変動

自2023年4月1日 至2023年9月30日

クラス	P-acc	P-dist
期首現在発行済受益証券数	290,447.5070	537,911.5800
発行受益証券数	7,681.5960	4,437.0520
買戻受益証券数	(85,655.6350)	(40,127.2130)
期末現在発行済受益証券数	212,473.4680	502,221.4190

年次分配金¹

UBS (Lux) ボンド・ファンド - オーストラリア・ドル

	権利落日	支払日	通貨	1口当たり金額
P-dist	2023年6月1日	2023年6月6日	オーストラリア・ドル	2.04

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2023年4月1日 至2023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	117,400,339.60	18,626,738
受益証券発行	2,458,857.74	390,122
受益証券買戻し	(10,536,094.96)	(1,671,657)
受益証券発行(買戻し)純額合計	(8,077,237.22)	(1,281,534)
支払分配金	(448,517.25)	(71,162)
純投資(損)益	231,555.88	36,739
実現(損)益合計	(1,241,120.49)	(196,916)
未実現評価(損)益の変動合計	(2,003,762.68)	(317,917)
運用の結果による純資産の純増(減)	(3,013,327.29)	(478,095)
期末現在純資産額	105,861,257.84	16,795,947

発行済受益証券数の変動

自2023年4月1日 至2023年9月30日

クラス	P-acc	P-dist
期首現在発行済受益証券数	225,679.4660	275,962.6880
発行受益証券数	1,682.5800	10,592.4400
買戻受益証券数	(18,425.6430)	(16,090.1910)
期末現在発行済受益証券数	208,936.4030	270,464.9370

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	2023年6月1日	2023年6月6日	ユーロ	1.5651

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2023年4月1日 至2023年9月30日

	UBS (Lux) ボンド・ファンド - アジア・フレキシブル(米ドル)	
	米ドル	千円
期首現在純資産額	412,455,055.75	61,666,155
受益証券発行	72,410,323.20	10,826,067
受益証券買戻し	(79,558,027.20)	(11,894,721)
受益証券発行(買戻し)純額合計	(7,147,704.00)	(1,068,653)
支払分配金	(4,208,655.39)	(629,236)
純投資(損)益	7,416,375.34	1,108,822
実現(損)益合計	(5,077,029.60)	(759,067)
未実現評価(損)益の変動合計	(19,493,644.59)	(2,914,495)
運用の結果による純資産の純増(減)	(17,154,298.85)	(2,564,739)
期末現在純資産額	383,944,397.51	57,403,527

発行済受益証券数の変動
自2023年4月1日 至2023年9月30日

クラス	P-acc
期首現在発行済受益証券数	221,542.4260
発行受益証券数	2,017.8110
買戻受益証券数	(23,135.2780)
期末現在発行済受益証券数	200,424.9590

年次分配金¹

UBS (Lux) ボンド・ファンド - アジア・フレキシブル(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 - アジア・フレキシブル(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2023年4月1日 至2023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	1,148,200,385.80	182,173,473
受益証券発行	385,718,838.42	61,198,151
受益証券買戻し	(243,958,370.99)	(38,706,435)
受益証券発行(買戻し)純額合計	141,760,467.43	22,491,716
支払分配金	(17,253,767.47)	(2,737,483)
純投資(損)益	28,063,802.95	4,452,603
実現(損)益合計	(16,484,454.19)	(2,615,424)
未実現評価(損)益の変動合計	42,097,366.69	6,679,168
運用の結果による純資産の純増(減)	53,676,715.45	8,516,348
期末現在純資産額	1,326,383,801.21	210,444,054

発行済受益証券数の変動
自2023年4月1日 至2023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	691,314.2040	173,109.9180	674,816.5100	1,981,242.5690
発行受益証券数	114,401.8600	170,629.7420	56,369.1460	85,914.5880
買戻受益証券数	(83,908.2930)	(96,755.2580)	(48,836.6210)	(167,867.2810)
期末現在発行済受益証券数	721,807.7710	246,984.4020	682,349.0350	1,899,289.8760

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	2023年4月17日	2023年4月20日	ユーロ	0.46
P-mdist	2023年5月15日	2023年5月18日	ユーロ	0.47	
P-mdist	2023年6月15日	2023年6月20日	ユーロ	0.47	
P-mdist	2023年7月17日	2023年7月20日	ユーロ	0.47	
P-mdist	2023年8月16日	2023年8月21日	ユーロ	0.4693	
P-mdist	2023年9月15日	2023年9月20日	ユーロ	0.47	
(米ドル・ヘッジ)P-mdist	2023年4月17日	2023年4月20日	米ドル	0.51	
(米ドル・ヘッジ)P-mdist	2023年5月15日	2023年5月18日	米ドル	0.51	
(米ドル・ヘッジ)P-mdist	2023年6月15日	2023年6月20日	米ドル	0.51	
(米ドル・ヘッジ)P-mdist	2023年7月17日	2023年7月20日	米ドル	0.51	
(米ドル・ヘッジ)P-mdist	2023年8月16日	2023年8月21日	米ドル	0.5125	
(米ドル・ヘッジ)P-mdist	2023年9月15日	2023年9月20日	米ドル	0.5129	

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みで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。

会計期間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・ファンドの最も重要な数字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

結合財務書類はユーロで表示されている。投資会社の2023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、以下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2023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	=	1.640456	オーストラリア・ドル
1ユーロ	=	0.968545	スイス・フラン
1ユーロ	=	1.058750	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・バック証券の所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。

n) クロス・サブ・ファンド投資

2023年9月30日現在、UBS(Lux) ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブルおよびUBS(Lux) ボンド・ファンド - グローバル・フレキシブルは、UBS(Lux) ボンド・ファンドのその他のサブ・ファンドに以下の投資を行った。

UBS(Lux) ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル	金額(ユーロ)
UBS(Lux) ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド(ユーロ) クラスI - X - Acc 受益証券	14,249.00
合計	14,249.00

UBS(Lux) ボンド・ファンド - グローバル・フレキシブル	金額(スイス・フラン)
UBS(Lux) ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド(ユーロ) クラスI - X - Acc 受益証券	20,701.19
合計	20,701.19

クロス・サブ・ファンド投資の総額は35,622.49ユーロにのぼる。したがって、報告期間末の調整後の結合純資産は2,780,828,589.69ユーロである。

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 - アジア・フレキシブル (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	1.300%	1.350%

UBS (Lux) ボンド・ファンド - オーストラリア・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	0.900% ¹	0.950%

¹ 上限：0.900% / 実効：0.810%。

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%	0.950%

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%

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、K I D、年次報告書および半期報告書ならびに居住国および販売が行われる国で法的に要求されるその他の一切の文書)。
 - g) 外国の監督官庁への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(T E R)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。

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・ジーまたは授權さ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（パフォーマンス報酬を除く）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。

ファンドの現行の費用（または現行の手数料）については、KIDで参照することができる。

注3．年次税

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

2023年4月1日から2023年9月30日までの期間中、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

2023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)
- アジア・フレキシブル(米ドル)	50,790,117.24 米ドル	- 米ドル
- オーストラリア・ドル	41,053,220.31 オーストラリア・ドル	- オーストラリア・ドル
- ユーロ・フレキシブル	59,653,490.92 ユーロ	42,735,537.86 ユーロ

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	3,037,162.84 ユーロ	3,024,646.95 ユーロ
- ユーロ・ハイ・イールド(ユーロ)	- ユーロ	15,238,531.50 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	51,741,212.26 ユーロ	118,065,384.50 ユーロ

注7．総経費率（TER）

当比率は、今期版のスイス・アセット・マネジメント協会（AMAS）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）
- アジア・フレキシブル（米ドル） クラスP - a c c 受益証券	1.38%
- オーストラリア・ドル クラスP - a c c 受益証券	0.89%
- オーストラリア・ドル クラスP - d i s t 受益証券	0.89%
- ユーロ・フレキシブル クラスP - a c c 受益証券	0.98%
- ユーロ・フレキシブル クラスP - d i s t 受益証券	0.98%
- ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ） クラスP - a c c 受益証券	1.31%
- 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	1.31%
- 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%

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．後発事象

期末以降、財務書類の修正または開示を必要とする事象は無かった。

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、英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。

	2023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*		2023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
UBS (Lux) ボンド・ファンド					
- アジア・フレキシブル(米ドル)	80,359,535.96 米ドル	81,823,807.53 米ドル	38.97	61.03	0.00
- オーストラリア・ドル	838,461.47 オーストラリア・ドル	885,097.19 オーストラリア・ドル	38.97	61.03	0.00
- ユーロ・フレキシブル	19,257,618.63 ユーロ	19,843,394.56 ユーロ	38.97	61.03	0.00
- ユーロ・ハイ・イールド(ユーロ)	197,866,486.73 ユーロ	214,672,081.17 ユーロ	38.97	61.03	0.00

* 取引相手方エクスポージャーの価格および為替レートの情報は、2023年9月30日に証券貸付業者から直接入手されるため、2023年9月30日現在の財務書類の作成に使用された終値および為替レートとは異なる場合がある。

	UBS (Lux) ボンド・ ファンド - アジア・フレキシブル (米ドル)	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
貸付証券収益	463,368.08 米ドル	665.85 オーストラリア・ドル	44,917.33 ユーロ
貸付証券コスト*			
ユービーエス・スイス・ エイ・ジー	139,010.42 米ドル	199.76 オーストラリア・ドル	13,475.20 ユーロ
UBSヨーロッパSE ルクセンブルグ支店	46,336.81 米ドル	66.58 オーストラリア・ドル	4,491.73 ユーロ
純貸付証券収益	278,020.85 米ドル	399.51 オーストラリア・ドル	26,950.40 ユーロ

	UBS (Lux) ボンド・ ファンド - ユーロ・ハイ・ イールド(ユーロ)
貸付証券収益	837,947.67 ユーロ
貸付証券コスト*	
ユービーエス・スイス・ エイ・ジー	251,384.30 ユーロ
UBSヨーロッパSE ルクセンブルグ支店	83,794.77 ユーロ
純貸付証券収益	502,768.60 ユーロ

* 2022年6月1日より、総収益の30%は証券貸付サービス提供者を務めるユービーエス・スイス・エイ・ジーが費用/報酬として受領し、10%は証券貸付業者を務めるUBSヨーロッパSE ルクセンブルグ支店が受領する。

(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
 2023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

変動利付モーゲージ・バック証券

AUD			
AUD	TRITON BOND TRUST 21 IN RESPECT 1M BBSW+85BP 21-22.10.52	1 000 000.00	331 273.16 0.10
Total AUD			331 273.16 0.10

変動利付モーゲージ・バック証券合計			331 273.16 0.10
-------------------	--	--	-----------------

固定利付ノート

AUD			
AUD	NEW SOUTH WALES TREASURY CORP-REG-S 3.00000% 17-20.04.29	1 500 000.00	1 391 295.00 0.44
AUD	NEW SOUTH WALES TREASURY CORP-REG-S 3.50000% 17-20.11.37	2 700 000.00	2 207 385.00 0.71
AUD	NEW SOUTH WALES TREASURY CORP 2.00000% 20-08.03.33	10 200 000.00	7 886 232.00 2.52
AUD	NEW SOUTH WALES TREASURY CORP-REG-S 1.75000% 21-20.03.34	4 400 000.00	3 200 472.00 1.02
AUD	NEW SOUTH WALES TREASURY CORP-REG-S 4.75000% 22-20.02.35	4 500 000.00	4 323 465.00 1.38
AUD	QUEENSLAND TREASURY CORP-144A-REG-S 3.25000% 18-21.08.29	3 800 000.00	3 556 952.00 1.13
Total AUD			22 565 801.00 7.20

固定利付ノート合計			22 565 801.00 7.20
-----------	--	--	--------------------

変動利付ノート

AUD			
AUD	SHINHAN BANK CO LTD 3M BBSW+195BP 22-16.11.25	2 900 000.00	2 955 361.00 0.94
AUD	STANDARD CHARTERED PLC-REG-S 2.900%/VAR 19-28.06.25	3 500 000.00	3 424 820.00 1.09
Total AUD			6 380 181.00 2.03

変動利付ノート合計			6 380 181.00 2.03
-----------	--	--	-------------------

固定利付ミディアム・ターム・ノート

AUD			
AUD	ASIAN DEVELOPMENT BANK 0.50000% 20-05.05.26	3 400 000.00	3 064 352.00 0.98
AUD	AURIZON NETWORK PTY LTD-REG-S 4.00000% 17-21.06.24	1 000 000.00	990 750.00 0.32
AUD	AURIZON NETWORK PTY LTD-REG-S 2.90000% 20-02.09.30	2 700 000.00	2 052 324.00 0.65
AUD	AUSGRID FINANCE PTY LTD-REG-S 3.75000% 17-30.10.24	2 400 000.00	2 366 232.00 0.76
AUD	AUSNET SERVICES HOLDINGS PTY LTD 2.60000% 19-31.07.29	500 000.00	414 710.00 0.13
AUD	AUSTRALIA & NZ BANKING GRP-REG-S 1.55000% 19-29.08.24	5 000 000.00	4 856 950.00 1.55
AUD	AUSTRALIAN CAPITAL TERRITORY-REG-S 2.50000% 16-21.05.26	1 000 000.00	953 180.00 0.30
AUD	AUSTRALIAN CAPITAL TERRITORY 2.50000% 22-22.10.32	1 400 000.00	1 151 150.00 0.37
AUD	BARCLAYS PLC-REG-S 3.25000% 19-26.06.24	2 000 000.00	1 965 860.00 0.63
AUD	CLIFFORD CAPITAL PTE LTD 4.75300% 23-31.08.28	1 900 000.00	1 888 942.00 0.60
AUD	EUROPEAN INVESTMENT BANK-REG-S 3.10000% 16-17.08.26	2 300 000.00	2 212 393.00 0.71
AUD	EXPORT FINANCE&INSURANCE CORP 1.46500% 21-18.08.31	2 500 000.00	1 948 175.00 0.62
AUD	INCITEC PIVOT LTD-REG-S 4.30000% 19-18.03.26	2 300 000.00	2 216 073.00 0.71
AUD	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION 4.40000% 23-13.01.28	6 000 000.00	5 939 820.00 1.90
AUD	INTERNATIONAL FINANCE CORP-REG-S 3.20000% 16-22.07.26	3 600 000.00	3 470 328.00 1.11
AUD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 3.00000% 16-19.10.26	1 900 000.00	1 816 476.00 0.58

注記は、財務書類と不可分のものである。

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 KOMMUNALBANKEN AS 0.60000% 20-01.06.26	2 800 000.00	2 510 676.00	0.80
AUD LANDESKREDITBANK B-WUERTT FOERDBK 4.25000% 14-07.08.25	1 400 000.00	1 385 412.00	0.44
AUD LLOYDS BANKING GROUP PLC 5.80200% 23-17.03.29	1 600 000.00	1 582 192.00	0.50
AUD MACQUARIE BANK LTD-REG-S 1.75000% 19-07.08.24	4 200 000.00	4 093 698.00	1.31
AUD MCDONALD'S CORP-REG-S 3.00000% 19-08.03.24	2 000 000.00	1 984 800.00	0.63
AUD NATIONAL HOUSING FINANCE AND INV CORP 2.38000% 19-28.03.29	500 000.00	449 515.00	0.14
AUD NATIONAL HOUSING FINANCE AND INV CORP 1.41000% 20-29.06.32	1 600 000.00	1 211 680.00	0.39
AUD NATIONAL HOUSING FNC AND INV CORP-REG-S 1.52000% 19-27.05.30	1 900 000.00	1 574 796.00	0.50
AUD NEW SOUTH WALES TREASURY CORP-REG-S 3.00000% 17-20.05.27	7 200 000.00	6 881 544.00	2.20
AUD TASMANIAN PUBLIC FINANCE-REG-S 2.50000% 21-21.01.33	4 700 000.00	3 839 054.00	1.22
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 2.50000% 19-22.10.29	1 300 000.00	1 158 404.00	0.37
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 2.25000% 19-20.11.34	4 400 000.00	3 294 852.00	1.05
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 1.25000% 20-19.11.27	2 800 000.00	2 470 748.00	0.79
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA-REG-S 3.00000% 15-20.10.28	5 000 000.00	4 670 200.00	1.49
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 2.00000% 20-20.11.37	2 700 000.00	1 788 345.00	0.57
AUD WOOLWORTHS LTD-REG-S 1.85000% 21-15.11.27	1 500 000.00	1 318 980.00	0.42
Total AUD		77 522 611.00	24.74

固定利付メディアム・ターム・ノート合計	77 522 611.00	24.74
---------------------	---------------	-------

固定利付債券

AUD AUSTRALIA-REG-S 1.00000% 20-21.12.30	13 600 000.00	10 805 472.00	3.45
AUD AUSTRALIA-REG-S 2.25000% 16-21.05.28	3 100 000.00	2 856 588.00	0.91
AUD AUSTRALIA-REG-S 2.75000% 18-21.05.41	7 500 000.00	5 688 975.00	1.81
AUD AUSTRALIA-REG-S 2.75000% 18-21.11.29	10 500 000.00	9 664 620.00	3.08
AUD AUSTRALIA-REG-S 3.00000% 16-21.03.47	5 800 000.00	4 297 510.00	1.37
AUD AUSTRALIA-REG-S 3.25000% 15-21.06.39	2 300 000.00	1 924 893.00	0.61
AUD AUSTRALIA-REG-S 3.25000% 12-21.04.29	1 700 000.00	1 621 341.00	0.52
AUD AUSTRALIA-REG-S 3.25000% 13-21.04.25	5 900 000.00	5 816 515.00	1.86
AUD AUSTRALIA-REG-S 3.75000% 22-21.05.34	3 800 000.00	3 559 042.00	1.14
AUD AUSTRALIA-REG-S 4.75000% 11-21.04.27	300 000.00	306 465.00	0.10
AUD AUSTRALIAN CAPITAL TERRITORY 1.75000% 19-23.10.31	1 300 000.00	1 033 526.00	0.33
AUD AUSTRALIAN CAPITAL TERRITORY-REG-S 1.75000% 21-17.05.30	2 400 000.00	2 002 944.00	0.64
AUD AUSTRALIAN CAPITAL TERRITORY 4.50000% 23-23.10.34	3 000 000.00	2 856 240.00	0.91
AUD NEW SOUTH WALES TREASURY CORP 2.00000% 19-20.03.31	3 600 000.00	2 975 688.00	0.95
AUD NORTHERN TERRITORY CORP-REG-S 3.50000% 18-21.05.30	900 000.00	835 434.00	0.27
AUD QUEENSLAND TREASURY CORP-REG-S 6.50000% 08-14.03.33	800 000.00	893 208.00	0.28
AUD QUEENSLAND TREASURY CORP-144A-REG-S 4.75000% 14-21.07.25	500 000.00	502 930.00	0.16
AUD QUEENSLAND TREASURY CORP-144A-REG-S 1.25000% 20-10.03.31	1 500 000.00	1 174 905.00	0.37
AUD QUEENSLAND TREASURY CORP-144A-REG-S 1.50000% 21-20.08.32	3 300 000.00	2 497 836.00	0.80
AUD SOUTH AUSTRALIAN GOV FIN AUTHOR-REG-S 1.75000% 21-24.05.34	3 300 000.00	2 373 195.00	0.76
AUD SOUTH AUSTRALIAN GOVERNMENT FIN-REG-S 2.00000% 21-23.05.36	2 200 000.00	1 522 840.00	0.49
AUD SOUTH AUSTRALIAN GOV FIN AUTHOR-REG-S 4.75000% 23-24.05.38	1 000 000.00	925 980.00	0.30
AUD SUNCORP-METWAY LTD-REG-S 3.25000% 16-24.08.26	2 000 000.00	1 900 520.00	0.61
AUD TASMANIAN PUBLIC FINANCE CORP-REG-S 2.00000% 19-24.01.30	1 900 000.00	1 627 255.00	0.52
AUD TASMANIAN PUBLIC FINANCE CORP-REG-S 2.25000% 21-22.01.32	3 100 000.00	2 546 588.00	0.81
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA-REG-S 2.25000% 21-15.09.33	2 700 000.00	2 098 197.00	0.67
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 2.00000% 21-17.09.35	7 900 000.00	5 592 094.00	1.78
AUD WESTERN AUSTRALIAN TREASURY CORP-REG-S 2.00000% 19-24.10.34	2 400 000.00	1 788 384.00	0.57
Total AUD		81 689 185.00	26.07

固定利付債券合計	81 689 185.00	26.07
----------	---------------	-------

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	188 489 051.16	60.14
---------------------------------------	----------------	-------

注記は、財務書類と不可分のものである。

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	ING BANK (AUSTRALIA) LTD-REG-S 1.10000% 21-19.08.26	2 400 000.00	2 147 760.00 0.69
Total AUD			2 147 760.00 0.69
固定利付ノート合計			2 147 760.00 0.69
固定利付ミディアム・ターム・ノート			
AUD			
AUD	AGI FINANCE PTY LTD-REG-S 1.81520% 20-23.11.28	2 800 000.00	2 298 324.00 0.73
AUD	BANK OF QUEENSLAND LTD 1.40000% 21-06.05.26	3 800 000.00	3 427 942.00 1.09
AUD	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 2.40000% 22-14.01.27	2 500 000.00	2 298 775.00 0.73
AUD	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 5.00000% 23-13.01.28	4 200 000.00	4 185 636.00 1.34
AUD	COMPUTERSHARE US INC 3.14700% 21-30.11.27	1 100 000.00	978 076.00 0.31
AUD	CPIF FINANCE PTY LTD-REG-S 2.48500% 20-28.10.30	900 000.00	684 819.00 0.22
AUD	CPPIB CAPITAL INC-REG-S 4.45000% 22-01.09.27	3 200 000.00	3 156 768.00 1.01
AUD	CPPIB CAPITAL INC-REG-S 4.20000% 23-02.05.28	3 300 000.00	3 206 082.00 1.02
AUD	DOWNER GROUP FINANCE PTY 3.70000% 19-29.04.26	2 600 000.00	2 437 890.00 0.78
AUD	DWPF FINANCE PTY-REG-S 1.90000% 21-04.08.28	2 500 000.00	2 047 900.00 0.65
AUD	EDITH COWAN UNIVERSITY 3.00000% 19-11.04.29	1 300 000.00	1 150 786.00 0.37
AUD	ELECTRANET PTY LTD 2.47370% 21-15.12.28	900 000.00	759 159.00 0.24
AUD	ENERGY PARTNERSHIP GAS PTY LTD-REG-S 3.64200% 17-11.12.24	1 000 000.00	980 220.00 0.31
AUD	GTA FINANCE CO PTY LTD 2.20000% 20-26.08.27	600 000.00	520 062.00 0.17
AUD	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 1.00000% 21-04.08.28	3 000 000.00	2 509 080.00 0.80
AUD	MACQUARIE UNIVERSITY-REG-S 3.50000% 18-07.09.28	990 000.00	908 028.00 0.29
AUD	MACQUARIE UNIVERSITY-REG-S 2.25000% 19-22.05.30	1 600 000.00	1 300 768.00 0.41
AUD	MONASH UNIVERSITY 4.05000% 22-06.04.29	1 100 000.00	1 020 580.00 0.33
AUD	NBN CO LTD-REG-S 1.00000% 20-03.12.25	7 100 000.00	6 493 092.00 2.07
AUD	NETWORK FINANCE CO PTY LTD 2.25000% 19-11.11.26	1 200 000.00	1 082 088.00 0.35
AUD	NETWORK FINANCE CO PTY LTD 6.06100% 23-19.06.30	1 800 000.00	1 794 528.00 0.57
AUD	PACIFIC NATIONAL FINANCE PTY LTD-REG-S 3.80000% 21-08.09.31	2 200 000.00	1 615 240.00 0.52
AUD	SUNCORP METWAY INSURANCE LTD 4.40000% 22-22.08.25	1 600 000.00	1 577 056.00 0.50
AUD	SUNCORP-METWAY LTD 2.50000% 22-25.01.27	3 300 000.00	3 016 596.00 0.96
AUD	SVENSK EXPORTKREDIT AB 4.30000% 23-30.05.28	2 000 000.00	1 942 800.00 0.62
AUD	SVENSKA HANDELSBANKEN AB-REG-S 5.00000% 23-02.03.28	2 600 000.00	2 563 314.00 0.82
AUD	TRANSPower NEW ZEALAND LTD-REG-S 4.97700% 22-29.11.28	800 000.00	795 792.00 0.25
AUD	UNIVERSITY OF MELBOURNE 4.67400% 22-22.08.29	1 900 000.00	1 822 974.00 0.58
AUD	UNIVERSITY OF TECHNOLOGY SYDNEY-REG-S 3.75000% 17-20.07.27	2 700 000.00	2 574 315.00 0.82
AUD	UNIVERSITY OF WOLLONGONG/THE 3.50000% 17-08.12.27	1 200 000.00	1 117 764.00 0.36
AUD	VICTORIA POWER NETWORKS FINANCE PTY LTD 2.13200% 21-21.04.28	1 400 000.00	1 188 208.00 0.38
AUD	VIRGIN AUSTRALIA HOLDINGS *DEFAULTED* 8.07500% 19-05.03.24	500 000.00	2 075.00 0.00
AUD	WESTCONNEX FIN CO PTY LTD-REG-S 3.15000% 21-31.03.31	2 600 000.00	2 096 692.00 0.67
AUD	WESTPAC BANKING CORP 4.80000% 23-16.02.28	3 500 000.00	3 445 995.00 1.10
AUD	WESTPAC BANKING CORP 4.80000% 23-10.08.26	2 200 000.00	2 185 898.00 0.70
AUD	WORLEY FINANCIAL SERVICES PTY LTD-REG-S 5.95000% 23-13.10.28	2 400 000.00	2 339 232.00 0.75
AUD	WSO FINANCE PTY LTD-REG-S 4.50000% 17-31.03.27	700 000.00	678 825.00 0.22
Total AUD			72 203 379.00 23.04
固定利付ミディアム・ターム・ノート合計			72 203 379.00 23.04

注記は、財務書類と不可分のものである。

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 (%)
固定利付債券			
AUD			
AUD BENDIGO & ADELAIDE BANK LTD LTD 1.70000% 19-06.09.24	4 000 000.00	3 876 080.00	1.24
AUD NORTHERN TERRITORY TREASURY CORP 2.50000% 21-21.05.32	1 900 000.00	1 561 572.00	0.50
AUD NSW ELECTRICITY NETWORKS FIN PTY-REG-S 2.54300% 20-23.09.30	1 900 000.00	1 482 684.00	0.47
AUD SUNCORP-METWAY LTD 4.85000% 22-17.10.25	1 500 000.00	1 494 135.00	0.48
AUD UBS AG AUSTRALIA-REG-S 1.10000% 21-26.02.26	2 800 000.00	2 524 060.00	0.80
AUD UNITED ENERGY DISTRIBUTION PTY LTD 2.20000% 19-29.10.26	1 700 000.00	1 550 128.00	0.49
AUD WESTERN AUSTRALIAN TREASURY CORP 1.50000% 21-22.10.30	6 700 000.00	5 447 770.00	1.74
Total AUD		17 936 429.00	5.72
固定利付債券合計		17 936 429.00	5.72
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		92 287 568.00	29.45
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			
変動利付モーゲージ・バック証券			
AUD			
AUD TORRENS SERIES TRUST 1M BBSW+60BP 21-09.11.52	2 700 000.00	1 141 278.00	0.36
Total AUD		1 141 278.00	0.36
変動利付モーゲージ・バック証券合計		1 141 278.00	0.36
固定利付ミディアム・ターム・ノート			
AUD			
AUD CIP FUNDING PTY LTD 3.02600% 21-16.12.27	4 000 000.00	3 535 120.00	1.13
AUD NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 5.35000% 23-19.09.28	6 100 000.00	6 028 020.00	1.92
AUD TELSTRA GROUP LTD 4.90000% 23-08.03.28	1 500 000.00	1 485 540.00	0.47
AUD WESTCONNEX FINANCE CO PTY LTD 6.15000% 23-09.10.30	1 400 000.00	1 392 412.00	0.45
Total AUD		12 441 092.00	3.97
固定利付ミディアム・ターム・ノート合計		12 441 092.00	3.97
固定利付債券			
AUD			
AUD BENDIGO & ADELAIDE BANK LTD-REG-S 5.10000% 23-16.06.28	3 500 000.00	3 444 455.00	1.10
AUD ING BANK AUSTRALIA LTD-REG-S 4.50000% 22-26.05.29	3 200 000.00	3 025 952.00	0.97
AUD KOREA HOUSING FINANCE CORP-REG-S 4.47500% 23-06.04.26	3 300 000.00	3 229 611.00	1.03
AUD SUNCORP-METWAY LTD-REG-S 5.20000% 23-12.07.28	2 300 000.00	2 293 330.00	0.73
Total AUD		11 993 348.00	3.83
固定利付債券合計		11 993 348.00	3.83
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		25 575 718.00	8.16
投資有価証券合計		306 352 337.16	97.75

注記は、財務書類と不可分のものである。

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 3YR BOND FUTURE 15.09.23	0.00	0.00	-0.01
AUD AUSTRALIA 3YR BOND FUTURE 15.12.23	175.00	-103 489.94	-0.03
AUD AUSTRALIA 10YR BOND FUTURE 15.12.23	202.00	-573 742.62	-0.18
債券に係る金融先物合計		-677 232.56	-0.22
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計			-0.22
派生商品合計			-0.22
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		1 513 353.94	0.48
当座借越およびその他の短期負債		-190 617.72	-0.06
定期預金および信託預金		5 538 312.40	1.77
その他の資産および負債		857 342.44	0.28
純資産合計		313 393 495.66	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・フレキシブル
2023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			
BRL			
BRL BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 10.00000% 20-01.01.31	4 000.00	701 012.42	0.66
Total BRL		701 012.42	0.66
EUR			
EUR ALTICE FRANCE HOLDING SA-REG-S 8.00000% 19-15.05.27	195 000.00	111 204.60	0.11
EUR ALTICE FRANCE-REG-S 5.87500% 18-01.02.27	600 000.00	514 899.60	0.49
EUR ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV-REG-S 3.70000% 20-02.04.40	100 000.00	90 517.40	0.09
EUR ARGENTINA, REPUBLIC OF 0.12500% 20-09.07.30	679 000.00	171 264.17	0.16
EUR ARGENTINA, REPUBLIC OF 0.50000% 20-09.07.29	22 046.00	5 270.97	0.01
EUR AT&T INC 3.95000% 23-30.04.31	250 000.00	240 346.00	0.23
EUR CELANESE US HOLDINGS LLC 4.77700% 22-19.07.26	530 000.00	525 419.74	0.50
EUR CHILE, REPUBLIC OF 0.83000% 19-02.07.31	700 000.00	539 322.00	0.51
EUR CHINA, PEOPLE'S REPUBLIC OF-REG-S 1.00000% 19-12.11.39	435 000.00	285 490.50	0.27
EUR CORP ANDINA DE FOMENTO-REG-S 0.25000% 21-04.02.26	1 010 000.00	915 177.16	0.86
EUR FISERV INC 4.50000% 23-24.05.31	100 000.00	98 995.00	0.09
EUR GTC AURORA LUXEMBOURG SA-REG-S 2.25000% 21-23.06.26	245 000.00	159 250.00	0.15
EUR HEIDELBERGCEMENT AG-REG-S 3.75000% 23-31.05.32	310 000.00	285 468.46	0.27
EUR HOLDING D'INFRAS DES METIERS-REG-S 4.50000% 23-06.04.27	240 000.00	236 904.96	0.22
EUR INDONESIA, REPUBLIC OF 1.40000% 19-30.10.31	400 000.00	312 184.00	0.30
EUR LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON-REG-S 0.12500% 20-11.02.28	200 000.00	172 612.40	0.16
EUR MACIF-REG-S-SUB 0.62500% 21-21.06.27	300 000.00	259 090.20	0.24
EUR PERU, REPUBLIC OF 1.25000% 21-11.03.33	400 000.00	290 364.00	0.27
EUR REWE INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 4.87500% 23-13.09.30	100 000.00	100 153.60	0.09
EUR SARTORIUS FINANCE BV-REG-S 4.50000% 23-14.09.32	100 000.00	98 488.20	0.09
EUR TDF INFRASTRUCTURE SASU-REG-S 5.62500% 23-21.07.28	200 000.00	200 315.50	0.19
EUR TRITAX EUROBOX PLC-REG-S 0.95000% 21-02.06.26	140 000.00	122 864.56	0.12
EUR TURKEY, REPUBLIC OF 4.37500% 21-08.07.27	600 000.00	561 000.00	0.53
EUR VERISURE MIDHOLDING AB-REG-S 5.25000% 21-15.02.29	145 000.00	127 161.23	0.12
Total EUR		6 423 764.25	6.07
USD			
USD BANCO SANTANDER SA-SUB 6.92100% 23-08.08.33	200 000.00	180 492.79	0.17
USD CONCENTRIX CORP 6.60000% 23-02.08.28	480 000.00	437 420.20	0.41
USD CONCENTRIX CORP 6.65000% 23-02.08.26	185 000.00	173 681.94	0.16
USD CONCENTRIX CORP 6.85000% 23-02.08.33	650 000.00	567 085.06	0.54
USD ECUADOR GOVT INTERNATIONAL BD-REG-S STEP-UP/DOWN 20-31.07.35	198 120.00	69 105.75	0.07
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S STEP-UP 0.50000% 20-31.07.30	75 600.00	36 288.00	0.03
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S STEP-UP 20-31.07.40	90 800.00	28 110.04	0.03
USD HEICO CORP 5.25000% 23-01.08.28	50 000.00	46 070.59	0.04
USD MEITUAN DIANPING-REG-S 3.05000% 20-28.10.30	700 000.00	513 223.14	0.48
USD NISSAN MOTOR ACCEPTANCE-REG-S 7.05000% 23-15.09.28	70 000.00	66 104.27	0.06
USD NORDSON CORP 5.80000% 23-15.09.33	100 000.00	92 259.37	0.09
USD PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS-REG-S 9.25000% 21-30.04.26	260 000.00	246 815.21	0.23
USD RAKUTEN GROUP INC-REG-S 10.25000% 22-30.11.24	200 000.00	188 699.60	0.18
USD SANTOS FINANCE LTD-REG-S 3.64900% 21-29.04.31	320 000.00	242 673.50	0.23

注記は、財務書類と不可分のものである。

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 SANTOS FINANCE LTD-REG-S 6.87500% 23-19.09.33	170 000.00	157 262.55	0.15
USD SHIMAO PRPTY HLDG LTD-REG-S *DEFAULTED* 3.45000% 21-11.01.31	200 000.00	7 556.08	0.01
USD SHIMAO PRPTY HLDG LTD-REG-S *DEFAULTED* 5.20000% 21-16.01.27	200 000.00	6 562.46	0.01
USD SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP-SUB 6.18400% 23-13.07.43	200 000.00	181 375.02	0.17
Total USD		3 240 785.57	3.06
固定利付ノート合計		10 365 562.24	9.79
ノート、ゼロ・クーポン			
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 20-31.07.30	16 232.00	4 532.08	0.00
Total USD		4 532.08	0.00
ノート、ゼロ・クーポン合計		4 532.08	0.00
変動利付ノート			
EUR BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENT-REG-S-SUB 6.000%/VAR 19-PRP	200 000.00	197 252.00	0.19
EUR BAYNGR AG-REG-S-SUB 7.000%/VAR 23-25.09.83	100 000.00	98 909.60	0.09
EUR BPCE SA-REG-S-SUB 1.500%/VAR 21-13.01.42	400 000.00	345 587.20	0.33
EUR BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC-REG-S -SUB 3.750%/VAR 21-PRP	375 000.00	299 062.50	0.28
EUR ENI SPA-REG-S-SUB 3.375%/VAR 20-PRP	100 000.00	84 000.00	0.08
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB COCO 9.125%/VAR 23-PRP	200 000.00	202 000.00	0.19
EUR MORGAN STANLEY 0.406%/VAR 21-29.10.27	300 000.00	265 616.40	0.25
EUR UBS GROUP AG-REG-S 2.125%/VAR 22-13.10.26	520 000.00	493 446.72	0.47
EUR UBS GROUP AG-REG-S 2.875%/VAR 22-02.04.32	420 000.00	361 404.96	0.34
EUR UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD-SUB 7.250%/VAR 23-PRP	100 000.00	89 701.16	0.09
EUR VIRGIN MONEY UK PLC-REG-S 4.625%/VAR 23-29.10.28	355 000.00	341 610.11	0.32
EUR WESTPAC BANKING CORP-REG-SUB 0.766%/VAR 21-13.05.31	250 000.00	221 174.20	0.21
EUR WINTERSHALL DEA FINANCE 2BV-REG-S-SUB 2.498%/VAR 21-PRP	400 000.00	348 040.00	0.33
EUR WINTERSHALL DEA FINANCE 2BV-REG-S-SUB 3.000%/VAR 21-PRP	400 000.00	319 724.00	0.30
Total EUR		3 667 528.85	3.47
USD ALLIANZ SE-REG-S-SUB 6.350%/VAR 23-06.09.53	200 000.00	182 369.37	0.17
USD BANK OF AMERICA CORP 5.015%/VAR 22-22.07.33	300 000.00	260 697.56	0.25
USD FIFTH THIRD BANCORP 6.339%/VAR 23-27.07.29	70 000.00	65 313.48	0.06
USD JPMORGAN CHASE & CO 5.299%/VAR 23-24.07.29	390 000.00	358 406.84	0.34
USD SANTANDER HOLDINGS USA INC 6.499%/VAR 23-09.03.29	200 000.00	184 228.76	0.17
Total USD		1 051 016.01	0.99
変動利付ノート合計		4 718 544.86	4.46
固定利付ミディアム・ターム・ノート			
EUR ABN AMRO BANK NV-REG-S 1.25000% 18-10.01.33	500 000.00	407 500.00	0.39
EUR AKER BP ASA-REG-S 1.12500% 21-12.05.29	200 000.00	165 939.20	0.16
EUR ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV-REG-S 1.15000% 18-22.01.27	200 000.00	184 086.23	0.17
EUR ASB BANK LTD-REG-S 0.25000% 21-08.09.28	350 000.00	290 028.90	0.27
EUR ASTRAZENECA PLC-REG-S 0.37500% 21-03.06.29	185 000.00	153 113.03	0.14
EUR AURIZON NETWORK PTY LTD-REG-S 2.00000% 14-18.09.24	100 000.00	97 768.00	0.09
EUR AUTOROUTES DU SUD DE LA FRANCE SA-REG-S 2.75000% 22-02.09.32	200 000.00	180 309.60	0.17
EUR BANK OF AMERICA CORP-REG-S 4.13400% 23-12.06.28	605 000.00	598 179.23	0.57

注記は、財務書類と不可分のものである。

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 BANQUE FEDER DU CRE MUTUEL SA-REG-S-SUB 5.12500% 23-13.01.33	200 000.00	194 546.00	0.18
EUR BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC-REG-S 0.87500% 15-13.10.23	200 000.00	199 780.80	0.19
EUR BNP PARIBAS-REG-S 0.12500% 19-04.09.26	600 000.00	536 034.38	0.51
EUR BPCE SA-REG-S 3.62500% 23-17.04.26	200 000.00	197 292.25	0.19
EUR BPCE SA-REG-S 4.50000% 23-13.01.33	200 000.00	194 332.80	0.18
EUR CADENT FINANCE PLC-REG-S 4.25000% 23-05.07.29	240 000.00	237 154.03	0.22
EUR CANAL DE ISABEL II GESTION SA-REG-S 1.68000% 15-26.02.25	400 000.00	386 056.00	0.37
EUR CITIGROUP INC-REG-S 2.37500% 14-22.05.24	300 000.00	296 550.60	0.28
EUR COOPERATIEVE RABOBANK UA-REG-S 4.00000% 23-10.01.30	500 000.00	487 965.00	0.46
EUR CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S 2.75000% 20-12.05.26	155 000.00	128 632.18	0.12
EUR CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 3.39000% 22-05.12.25	580 000.00	570 319.80	0.54
EUR CTP NV-REG-S 0.87500% 22-20.01.26	700 000.00	621 738.61	0.59
EUR DANSKE BANK AS-REG-S-SUB 1.50000% 20-02.09.30	120 000.00	111 237.12	0.11
EUR DEXIA CREDIT LOCAL SA-REG-S 0.50000% 18-17.01.25	400 000.00	383 012.00	0.36
EUR DNB BANK ASA-REG-S 0.05000% 19-14.11.23	335 000.00	333 438.90	0.32
EUR EDP FINANCE BV-REG-S 3.87500% 22-11.03.30	300 000.00	294 055.20	0.28
EUR EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 6.37500% 19-11.04.31	400 000.00	222 252.00	0.21
EUR ELECTRICITE DE FRANCE-REG-S 1.87500% 16-13.10.36	1 600 000.00	1 143 200.00	1.08
EUR ELECTRICITE DE FRANCE-REG-S 2.00000% 19-09.12.49	300 000.00	162 933.00	0.15
EUR ELENIA VERKKO OYJ-REG-S 0.37500% 20-06.02.27	100 000.00	87 856.91	0.08
EUR ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 0.37500% 19-17.06.27	400 000.00	350 530.98	0.33
EUR EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FAC-REG-S 1.80000% 17-10.07.48	1 700 000.00	1 165 180.00	1.10
EUR EUROPEAN STABILITY MECHANISM-REG-S 0.50000% 16-02.03.26	1 100 000.00	1 026 504.60	0.97
EUR FERROVIE DELLO STATO ITALIANE SPA-REG-S 3.75000% 22-14.04.27	250 000.00	245 251.00	0.23
EUR FMS WERTMANAGEMENT-REG-S 0.37500% 15-29.04.30	1 800 000.00	1 487 444.40	1.41
EUR GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC-REG-S 4.30000% 23-15.02.29	320 000.00	309 285.76	0.29
EUR GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 0.25000% 21-26.01.28	350 000.00	295 554.70	0.28
EUR KAZAKHSTAN, REPUBLIC OF-REG-S 2.37500% 18-09.11.28	800 000.00	715 224.00	0.68
EUR KBC GROUP NV-REG-S 1.12500% 19-25.01.24	200 000.00	198 166.00	0.19
EUR KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU-REG-S 0.37500% 15-23.04.30	2 000 000.00	1 658 988.00	1.57
EUR METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 4.00000% 23-05.04.28	340 000.00	338 538.72	0.32
EUR MEXICO, UNITED STATES OF 3.00000% 15-06.03.45	200 000.00	137 780.00	0.13
EUR NATIONAL GAS TRANSMISSION PLC-REG-S 4.25000% 23-05.04.30	105 000.00	103 254.90	0.10
EUR NBN CO LTD-REG-S 4.12500% 23-15.03.29	250 000.00	246 894.83	0.23
EUR NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.25000% 20-23.01.27	390 000.00	346 048.56	0.33
EUR P3 GROUP SARL-REG-S 0.87500% 22-26.01.26	425 000.00	377 278.78	0.36
EUR PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 2.87500% 14-03.03.26	1 450 000.00	1 410 110.50	1.33
EUR PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 0.87500% 19-17.05.27	500 000.00	442 080.00	0.42
EUR POLAND, REPUBLIC OF-REG-S 2.00000% 19-08.03.49	560 000.00	353 640.00	0.33
EUR RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S 1.50000% 18-26.04.38	1 500 000.00	1 118 745.00	1.06
EUR REDEXIS GAS FINANCE BV-REG-S 1.87500% 15-27.04.27	300 000.00	274 500.00	0.26
EUR ROMANIA-REG-S 4.62500% 19-03.04.49	1 000 000.00	739 130.00	0.70
EUR RWE AG-REG-S 2.75000% 22-24.05.30	400 000.00	363 384.00	0.34
EUR SELP FINANCE SARL-REG-S 3.75000% 22-10.08.27	170 000.00	161 935.88	0.15
EUR SOCIETE GENERALE SA-REG-S-SUB 5.62500% 23-02.06.33	100 000.00	96 484.80	0.09
EUR VAR ENERGI ASA-REG-S 5.50000% 23-04.05.29	100 000.00	100 061.40	0.09
EUR VF CORP 4.25000% 23-07.03.29	120 000.00	115 932.00	0.11
EUR VONOVIA SE-REG-S 0.37500% 21-16.06.27	300 000.00	253 959.60	0.24
EUR VONOVIA SE-REG-S 1.62500% 21-01.09.51	200 000.00	95 002.00	0.09
EUR VONOVIA SE-REG-S 5.00000% 22-23.11.30	100 000.00	98 500.00	0.09
EUR WESTERN POWER DISTRIBUTION EAST-REG-S 3.94900% 22-20.09.32	105 000.00	99 828.54	0.09
EUR WESTPAC BANKING CORP-REG-S 0.01000% 21-22.09.28	925 000.00	763 187.90	0.72
Total EUR		24 353 718.62	23.01
GBP			
GBP FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.74800% 20-14.06.24	200 000.00	222 771.27	0.21
Total GBP		222 771.27	0.21
固定利付メディアム・ターム・ノート合計		24 576 489.89	23.22

注記は、財務書類と不可分のものである。

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 (%)
メディアム・ターム・ノート、ゼロ・クーポン			
EUR			
EUR STEDIN HOLDING NV-REG-S 0.00000% 21-16.11.26	270 000.00	238 884.12	0.22
Total EUR		238 884.12	0.22
メディアム・ターム・ノート、ゼロ・クーポン合計			
		238 884.12	0.22
変動利付メディアム・ターム・ノート			
EUR			
EUR ABANCA CORP BANCARIA SA-REG-S-SUB 8.375%/VAR 23-23.09.33	300 000.00	303 565.20	0.29
EUR ABANCA CORP BANCARIA SA-REG-S 5.875%/VAR 23-02.04.30	300 000.00	297 423.60	0.28
EUR AXA SA-REG-S-SUB 3.250%/VAR 18-28.05.49	100 000.00	89 640.20	0.08
EUR BANCO DE CREDITO SOCIAL CO SA-REG-S 7.500%/VAR 23-14.09.29	200 000.00	197 251.20	0.19
EUR BANK OF AMERICA CORP-REG-S 0.808%/VAR 19-09.05.26	450 000.00	425 250.00	0.40
EUR BARCLAYS BANK PLC-SUB 4.750%/3M EURIBOR+71BP 05-PRP	210 000.00	187 341.00	0.18
EUR BARCLAYS PLC-REG-S 4.918%/VAR 23-08.08.30	105 000.00	103 436.34	0.10
EUR COMMONWEALTH BK OF AUSTRALIA-REG-S-SUB 1.936%/VAR 17-03.10.29	200 000.00	192 140.00	0.18
EUR DEUTSCHE BANK AG-REG-S 1.000%/VAR 20-19.11.25	100 000.00	95 657.94	0.09
EUR DEUTSCHE BANK AG-REG-S 4.000%/VAR 22-24.06.32	500 000.00	445 654.91	0.42
EUR TOTAL SE-REG-S-SUB 2.625%/VAR 15-PRP	750 000.00	715 312.50	0.67
Total EUR		3 052 672.89	2.88
変動利付メディアム・ターム・ノート合計			
		3 052 672.89	2.88
固定利付債券			
EUR			
EUR ALSTRIA OFFICE REIT-AG-REG-S 1.50000% 20-23.06.26	200 000.00	154 155.60	0.14
EUR ALTRIA GROUP INC 2.20000% 19-15.06.27	400 000.00	369 844.80	0.35
EUR ATHORA HOLDING LTD-REG-S 6.62500% 23-16.06.28	150 000.00	146 604.03	0.14
EUR AUSTRIA, REPUBLIC OF-144A-REG-S 2.40000% 13-23.05.34	1 920 000.00	1 738 944.00	1.64
EUR BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUT-REG-S 0.25000% 21-19.07.28	300 000.00	245 837.40	0.23
EUR BECTON DICKINSON EURO FINANCE SARL 0.33400% 21-13.08.28	350 000.00	292 878.60	0.28
EUR BELGIUM, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.00000% 15-22.06.31	1 100 000.00	929 049.00	0.88
EUR BELGIUM, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.90000% 15-22.06.38	2 230 000.00	1 770 843.00	1.67
EUR BNZ INTERNATIONAL FUND LTD/LONDON-REG-S 0.50000% 17-03.07.24	900 000.00	875 592.00	0.83
EUR CAISSE D'AMOR DE LA DETTE SOCIALE-REG-S 2.37500% 13-25.01.24	200 000.00	198 992.00	0.19
EUR CHUBB INA HOLDINGS INC 2.50000% 18-15.03.38	200 000.00	154 946.40	0.15
EUR DEUTSCHE BOERSE AG-REG-S 3.87500% 23-28.09.26	400 000.00	400 148.80	0.38
EUR EUROPEAN INVESTMENT BANK-REG-S 1.00000% 16-14.04.32	2 000 000.00	1 650 859.81	1.56
EUR EUROPEAN UNION-REG-S 3.00000% 22-04.03.53	650 000.00	546 947.36	0.52
EUR FINNAIR OYJ-REG-S 4.25000% 21-19.05.25	295 000.00	281 742.70	0.27
EUR FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 4.50000% 09-25.04.41	940 000.00	1 031 465.76	0.97
EUR FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 3.25000% 12-25.05.45	1 150 000.00	1 058 724.55	1.00
EUR FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 1.50000% 19-25.05.50	700 000.00	431 698.40	0.41
EUR GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.50000% 16-15.02.26	2 560 000.00	2 413 025.28	2.28
EUR GREECE, HELLENIC REPUBLIC OF-144A-REG-S 1.87500% 19-23.07.26	1 100 000.00	1 047 096.60	0.99
EUR IMPERIAL BRANDS FINANCE PLC-REG-S 1.37500% 17-27.01.25	900 000.00	864 959.40	0.82
EUR IRELAND, REPUBLIC OF-REG-S 1.70000% 17-15.05.37	730 000.00	583 430.60	0.55
EUR ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 3.250% 14-01.09.46	2 210 000.00	1 679 644.20	1.59
EUR ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 2.70000% 16-01.03.47	1 300 000.00	892 000.20	0.84
EUR ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 2.25000% 16-01.09.36	3 370 000.00	2 537 138.20	2.40
EUR ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 2.45000% 20-01.09.50	100 000.00	62 544.60	0.06
EUR JAPAN BANK FOR INTL COOPERATION 3.12500% 23-15.02.28	300 000.00	293 603.07	0.28
EUR MAPFRE SA-REG-S-SUB 2.87500% 22-13.04.30	200 000.00	170 118.00	0.16

注記は、財務書類と不可分のものである。

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 MPT OPERATING PARTNERSHIP LP/FIN CORP 3.32500% 17-24.03.25	200 000.00	175 650.00	0.17
EUR NETHERLANDS, KINGDOM OF THE 4.00000% 05-15.01.37	1 200 000.00	1 293 178.08	1.22
EUR PERU, REPUBLIC OF 3.75000% 16-01.03.30	350 000.00	330 144.50	0.31
EUR PORTUGAL, REPUBLIC OF-144A-REG-S 2.87500% 15-15.10.25	1 000 000.00	992 978.40	0.94
EUR PORTUGAL, REPUBLIC OF-144A-REG-S 2.25000% 18-18.04.34	500 000.00	435 705.00	0.41
EUR SARTORIUS FINANCE BV-REG-S 4.37500% 23-14.09.29	100 000.00	99 656.00	0.09
EUR SLOVAKIA, REPUBLIC OF-REG-S 3.75000% 23-23.02.35	350 000.00	332 560.90	0.31
EUR SLOVAKIA, REPUBLIC OF-REG-S 0.75000% 19-09.04.30	800 000.00	654 763.20	0.62
EUR SLOVENIA, REPUBLIC OF-REG-S 1.50000% 15-25.03.35	1 800 000.00	1 382 832.00	1.31
EUR SLOVENIA, REPUBLIC OF-REG-S 3.12500% 15-07.08.45	700 000.00	602 198.80	0.57
EUR SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.95000% 15-30.07.30	900 000.00	810 414.00	0.76
EUR SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 2.90000% 16-31.10.46	1 200 000.00	943 317.21	0.89
EUR SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 2.70000% 18-31.10.48	2 600 000.00	1 929 200.00	1.82
EUR SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.85000% 19-30.07.35	1 000 000.00	798 882.00	0.75
EUR SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.90000% 22-31.10.52	950 000.00	554 648.00	0.52
EUR TAURON POLSKA ENERGIA SA-REG-S 2.37500% 17-05.07.27	200 000.00	174 952.00	0.16
EUR UMG GROUPE VYV 1.62500% 19-02.07.29	100 000.00	84 742.60	0.08
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 3.12500% 20-15.02.26	335 000.00	305 687.50	0.29
EUR VERIZON COMMUNICATIONS INC 0.87500% 19-08.04.27	220 000.00	197 237.48	0.19
EUR WINTERSHALL DEA FINANCE BV-REG-S 1.33200% 19-25.09.28	300 000.00	254 661.00	0.24
Total EUR		35 176 243.03	33.23
GBP BELLIS ACQUISITION CO PLC-REG-S 3.25000% 21-16.02.26	310 000.00	310 294.18	0.29
GBP BERKELEY GROUP PLC/THE-REG-S 2.50000% 21-11.08.31	160 000.00	124 152.07	0.12
GBP ROTHESAY LIFE PLC-REG-S-SUB 3.37500% 19-12.07.26	315 000.00	331 685.21	0.32
GBP UNITED KING OF GREAT BRIT & N IRL-REG-S 1.25000% 20-22.10.41	400 000.00	265 656.23	0.25
Total GBP		1 031 787.69	0.98
NZD NEW ZEALAND 1.50000% 19-15.05.31	800 000.00	346 716.13	0.32
NZD NEW ZEALAND 1.75000% 20-15.05.41	5 100 000.00	1 669 979.36	1.58
NZD NEW ZEALAND 2.75000% 21-15.05.51	1 800 000.00	621 960.20	0.59
NZD NEW ZEALAND-REG-S 2.75000% 16-15.04.37	13 400 000.00	5 643 007.27	5.33
Total NZD		8 281 662.96	7.82
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 6.12500% 09-18.01.41	200 000.00	148 053.83	0.14
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 2.70000% 21-12.07.26	200 000.00	11 806.37	0.01
USD EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 10.87500% 23-28.02.26	200 000.00	179 188.67	0.17
Total USD		339 048.87	0.32
固定利付債券合計		44 828 742.55	42.35
変動利付債券			
EUR BANCO DE CREDITO SOCIAL-REG-S 8.000%/VAR 22-22.09.26	300 000.00	305 414.40	0.29
EUR BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S 3.250%/VAR 20-PRP	130 000.00	121 353.70	0.12
EUR BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S-SUB 3.625%/VAR 20-PRP	100 000.00	86 961.00	0.08
EUR COMMERZBANK AG-REG-S 5.250%/VAR 23-25.03.29	100 000.00	99 783.00	0.09
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 4.000%/VAR 18-PRP	200 000.00	194 670.00	0.18
EUR RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S-SUB 3.250%/VAR 19-PRP	200 000.00	166 040.00	0.16
EUR SES SA-REG-S-SUB 2.875%/VAR 21-PRP	595 000.00	520 351.30	0.49
EUR UNIBAIL-RODAMCO SE-REG-S-SUB 2.875%/VAR 18-PRP	100 000.00	81 500.00	0.08
EUR UNICAJA BANCO SA-REG-S 1.000%/VAR 21-01.12.26	200 000.00	182 279.20	0.17
Total EUR		1 758 352.60	1.66

注記は、財務書類と不可分のものである。

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 (%)
GBP			
GBP YORKSHIRE BUILDING SOCIETY-REG-S 7.375%/VAR 23-12.09.27	180 000.00	208 876.63	0.20
Total GBP		208 876.63	0.20
変動利付債券合計		1 967 229.23	1.86
固定利付米国中期国債			
USD			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 15-15.08.45	1 950 000.00	1 333 934.10	1.26
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.00000% 18-15.02.48	1 000 000.00	691 041.90	0.65
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.87500% 23-15.02.43	950 000.00	780 917.94	0.74
Total USD		2 805 893.94	2.65
固定利付米国中期国債合計		2 805 893.94	2.65
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		92 558 551.80	87.43
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 4.430%/VAR 17-26.03.40	475 000.00	407 284.98	0.38
Total USD		407 284.98	0.38
変動利付アセット・バック証券合計		407 284.98	0.38
変動利付モーゲージ・バック証券			
USD			
USD AVENTURA MALL TRUST-144A 4.112%/VAR 18-01.07.40	650 000.00	551 872.19	0.52
USD BAML COMMERCIAL MORT SET-144A 1M LIBOR+135BP 18-15.09.34	550 000.00	515 950.02	0.49
USD CAMB COMM MORTGAGE TRUST-144A-SUB 1M LIBOR+145BP 19-15.12.37	175 000.00	163 517.80	0.15
USD CAMB COMM MORTGAGE TRUST-144A-SUB 1M LIBOR+175BP 19-15.12.37	430 000.00	401 276.12	0.38
USD CORE TRUST CORE-144A 1M LIBOR+110BP 19-15.12.31	230 000.00	40 085.76	0.04
USD GS MORTGAGE SECURITIES TRUST-144A VAR 17-01.01.43	1 225 000.00	961 646.92	0.91
Total USD		2 634 348.81	2.49
変動利付モーゲージ・バック証券合計		2 634 348.81	2.49
固定利付ノート			
USD			
USD AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD-144A 2.12500% 21-21.02.26	165 000.00	139 440.00	0.13
USD CONSTELLATION ENERGY GENERATION LLC 6.50000% 23-01.10.53	75 000.00	71 003.66	0.07
USD SOCIETE GENERALE SA-SUB-144A 7.36700% 23-10.01.53	415 000.00	355 936.83	0.34
Total USD		566 380.49	0.54
固定利付ノート合計		566 380.49	0.54
固定利付債券			
RUB			
RUB RUSSIA, FEDERATION OF 7.65000% 19-10.04.30	270 000 000.00	130 644.32	0.12
Total RUB		130 644.32	0.12
固定利付債券合計		130 644.32	0.12
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		3 738 658.60	3.53

注記は、財務書類と不可分のものである。

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			
EUR UBS (LUX) BOND FUND - EURO HIGH YIELD (EUR) I-X-ACC	100.00	14 249.00	0.01
USD UBS (LUX) BOND SICAV - ASIAN HIGH YIELD (USD) I-X-DIST	21 400.00	978 487.84	0.93
USD UBS (LUX) BOND SICAV - CHINA HIGH YIELD (USD) U-X-ACC	167.00	665 351.66	0.63
ルクセンブルグ合計		1 658 088.50	1.57
投資信託、オープン・エンド型合計		1 658 088.50	1.57
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			
		1 658 088.50	1.57
投資有価証券合計		97 955 298.90	92.53

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-SCHATZ FUTURE 07.12.23	-50.00	18 250.00	0.02
EUR EURO-BUXL FUTURE 07.12.23	-12.00	98 640.00	0.09
EUR EURO-OAT FUTURE 07.12.23	76.00	-213 560.00	-0.20
EUR EURO BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 07.12.23	11.00	-44 330.00	-0.04
EUR SHORT EURO BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 07.12.23	33.00	-20 790.00	-0.02
EUR EURO-BUND FUTURE 07.12.23	43.00	-113 090.00	-0.11
EUR EURO-BOBL FUTURE 07.12.23	78.00	-86 580.00	-0.08
GBP LONG GILT FUTURE 27.12.23	9.00	3 527.63	0.00
CAD CAN 5YR BOND FUTURE 18.12.23	187.00	-199 877.05	-0.19
USD US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.12.23	-5.00	8 412.04	0.01
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 19.12.23	-52.00	163 459.27	0.15
USD US LONG BOND FUTURE 19.12.23	-4.00	24 409.68	0.02
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.12.23	49.00	-96 074.38	-0.09
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 29.12.23	19.00	-12 337.62	-0.01
JPY JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 13.12.23	-23.00	160 134.72	0.15
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 29.12.23	74.00	-66 860.95	-0.06
CAD CAN 10YR BOND FUTURE 18.12.23	-105.00	273 754.22	0.26
債券に係る金融先物合計		-102 912.44	-0.10
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		-102 912.44	-0.10

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

PLN LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 1.91900% 20-10.02.30	-16 000 000.00	508 723.86	0.48
PLN LCH/INTEREST RATE SWAP REC 6MWIB 20-10.02.30			
PLN LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 0.88000% 20-07.05.30	-10 000 000.00	511 528.59	0.48
PLN LCH/INTEREST RATE SWAP REC 6MWIB 20-07.05.30			
NZD LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 1.67500% 24-30.10.29	-18 000 000.00	1 400 702.16	1.32
NZD LCH/INTEREST RATE SWAP REC 3MFRA 24-30.10.29			
NZD LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 1.58300% 24-24.09.29	-19 000 000.00	1 536 898.56	1.45
NZD LCH/INTEREST RATE SWAP REC 3MFRA 24-24.09.29			
CNY CITI/INTEREST RATE SWAP PAY 2.80500% 21-02.04.26	-55 000 000.00	-127 691.48	-0.12
CNY CITI/INTEREST RATE SWAP REC CNRR007 21-02.04.26			

注記は、財務書類と不可分のものである。

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 (%)	
PLN	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 3.79250% 22-17.01.32	-8 000 000.00	104 076.36	0.10
PLN	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 6MWIB 22-17.01.32			
KRW	JPMORGAN/INTEREST RATE SWAP PAY 2.15900% 22-25.01.32	-1 000 000 000.00	86 074.51	0.08
KRW	JPMORGAN/INTEREST RATE SWAP REC 3MKWCD 22-25.01.32			
CNY	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 2.79400% 23-10.01.28	-23 000 000.00	-8 270.44	-0.01
CNY	LCH/INTEREST RATE SWAP REC CNRR007 23-10.01.28			
SEK	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 3.39500% 23-10.03.28	-20 000 000.00	-13 363.93	-0.01
SEK	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 3MS 23-10.02.28			
USD	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 3.19431% 23-10.03.53	-1 800 000.00	258 637.89	0.24
USD	LCH/INTEREST RATE SWAP TP PAY SOFR O/N 23-10.03.53			
SEK	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 3.00000% 23-18.04.28	-20 000 000.00	33 852.88	0.03
SEK	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 3MS 23-10.02.28			
SEK	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 2.93250% 23-09.05.28	-20 000 000.00	38 505.71	0.04
SEK	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 3M 23-09.05.28			
CNY	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 2.45500% 23-29.06.28	-20 000 000.00	-1 243.39	0.00
CNY	LCH/INTEREST RATE SWAP REC CNRR007 23-29.06.28			
CHF	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 1.69200% 23-08.09.28	-3 000 000.00	-1 130.21	0.00
CHF	LCH/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 23-08.09.28			
CNY	JPMORGAN/INTEREST RATE SWAP REC 2.23500% 20-10.06.25	50 000 000.00	19 571.55	0.02
CNY	JPMORGAN/INTEREST RATE SWAP PAY CNRR007 20-10.06.25			
MXN	CME/INTEREST RATE SWAP REC 8.07000% 18-26.06.28	135 000 000.00	-441 761.55	-0.42
MXN	CME/INTEREST RATE SWAP PAY MXI 18-26.06.28			
MXN	CME/INTEREST RATE SWAP REC 8.13500% 18-12.07.28	120 000 000.00	-385 143.05	-0.36
MXN	CME/INTEREST RATE SWAP PAY MXI 18-12.07.28			
NZD	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 1.32000% 21-22.06.26	11 000 000.00	-643 469.40	-0.61
NZD	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 3MFRA 21-22.06.26			
HUF	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 2.59600% 21-10.08.26	2 200 000 000.00	-916 468.79	-0.87
HUF	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 6ML 21-10.08.26			
MXN	CME/INTEREST RATE SWAP REC 7.44000% 21-16.10.26	80 000 000.00	-303 103.04	-0.29
MXN	CME/INTEREST RATE SWAP PAY MXI 21-16.10.26			
MXN	CME/INTEREST RATE SWAP REC 7.49250% 21-19.10.26	80 000 000.00	-295 924.07	-0.28
MXN	CME/INTEREST RATE SWAP PAY MXI 21-19.10.26			
ZAR	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 7.67000% 22-06.01.32	26 000 000.00	-149 178.01	-0.14
ZAR	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 3MZAR 22-06.01.32			
KRW	JPMORGAN/INTEREST RATE SWAP REC 2.02000% 22-25.01.24	23 000 000 000.00	-144 114.90	-0.14
KRW	JPMORGAN/INTEREST RATE SWAP PAY 3MKWCD 22-25.01.24			
NZD	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 4.60500% 22-29.11.27	2 500 000.00	-21 121.60	-0.02
NZD	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 3MFRA 22-29.11.27			
MXN	CME/INTEREST RATE SWAP REC 8.51000% 22-01.12.27	50 000 000.00	-118 267.93	-0.11
MXN	CME/INTEREST RATE SWAP PAY MXI 22-01.12.27			
ZAR	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 9.22100% 22-12.12.32	20 000 000.00	-33 509.78	-0.03
ZAR	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 3MZAR 22-12.12.32			
NZD	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 4.65000% 22-19.12.27	4 000 000.00	-28 559.38	-0.03
NZD	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 3MFRA 22-19.12.27			
NZD	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 4.67500% 22-19.12.27	4 000 000.00	-26 278.40	-0.01
NZD	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 3MFRA 22-19.12.27			
BRL	CITI/INTEREST RATE SWAP REC 13.81500% 22-02.01.25	20 000 000.00	116 516.37	0.11
BRL	CITI/INTEREST RATE SWAP PAY BZD 22-02.01.25			
NZD	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 4.56500% 23-11.01.28	2 750 000.00	-46 622.26	-0.04
NZD	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 3MFRA 23-11.01.28			
BRL	CME/INTEREST RATE SWAP REC 12.70000% 23-02.01.25	29 000 000.00	77 731.52	0.07
BRL	CME/INTEREST RATE SWAP PAY BZD 23-02.01.25			
BRL	CME/INTEREST RATE SWAP REC 12.67000% 23-02.01.25	20 000 000.00	55 192.17	0.05
BRL	CME/INTEREST RATE SWAP PAY BZD 23-02.01.25			
EUR	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 3.45360% 23-10.03.28	2 000 000.00	37 267.52	0.04
EUR	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 6MEIB 23-10.03.28			
ZAR	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 9.10100% 23-05.04.33	17 500 000.00	-38 106.02	-0.04
ZAR	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 3MZAR 23-05.04.33			

注記は、財務書類と不可分のものである。

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 (%)
ZAR LCH/INTEREST RATE SWAP REC 9.08000% 23-05.04.33	17 500 000.00	-39 306.46	-0.04
ZAR LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 3MZAR 23-05.04.33			
BRL CME/INTEREST RATE SWAP REC 11.69500% 23-02.01.25	30 000 000.00	19 543.03	0.02
BRL CME/INTEREST RATE SWAP PAY BZD 23-02.01.25			
USD LCH/INTEREST RATE SWAP REC 3.76250% 24-03.07.26	10 000 000.00	-106 849.81	-0.10
USD LCH/INTEREST RATE SWAP TP PAY SOFR 0/N 24-03.07.26			
CAD LCH/INTEREST RATE SWAP REC 4.05250% 24-22.07.26	14 000 000.00	-94 220.31	-0.09
CAD LCH/INTEREST RATE SWAP REC 3MCAD 24-22.07.26			
EUR LCH/INTEREST RATE SWAP REC 3.24540% 23-08.09.28	3 300 000.00	-22 799.90	-0.02
EUR LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 6MEIB 23-08.09.28			
MXN CME/INTEREST RATE SWAP REC 9.25000% 23-05.09.28	65 000 000.00	-55 836.57	-0.05
MXN CME/INTEREST RATE SWAP PAY MXI 23-05.09.28			
金利に係るスワップおよびフォワード・スワップ合計		742 482.00	0.70

クレジット・デフォルト・スワップ *

USD BOA/MEX CREDIT DEFAULT SWAP PAY 1.00000% 19-20.06.24	-3 200 000.00	-15 486.34	-0.01
USD BOA/TURKEY CREDIT DEFAULT SWAP REC 1.00000% 19-20.06.24	3 200 000.00	2 970.45	0.00
クレジット・デフォルト・スワップ合計		-12 515.89	-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

派生商品合計 729 966.11 0.69

派生商品合計 627 053.67 0.59

為替予約契約

購入通貨 / 購入額 / 売却通貨 / 売却額 / 満期日

MYR 3 329 000.00	USD 717 921.07	5.10.2023	-7 536.54	-0.01
USD 481 497.13	PHP 27 350 000.00	5.10.2023	-1 639.82	0.00
INR 90 880 000.00	USD 1 096 499.96	5.10.2023	-2 104.01	0.00
CNY 3 255 000.00	USD 450 045.63	10.10.2023	4 310.10	0.00
USD 481 525.78	TWD 15 300 000.00	5.10.2023	6 259.12	0.01
USD 718 283.49	BRL 3 510 000.00	5.10.2023	16 461.85	0.02
TWD 15 300 000.00	USD 480 678.61	5.10.2023	-5 469.38	-0.02
PHP 27 350 000.00	USD 482 951.03	5.10.2023	266.04	0.00
USD 450 145.21	CNY 3 255 000.00	10.10.2023	-4 132.89	0.00
CAD 80 000.00	EUR 54 521.58	5.10.2023	1 361.45	0.00
EUR 16 202 852.35	USD 17 600 000.00	5.10.2023	-418 177.32	-0.40
GBP 385 000.00	CAD 661 971.31	5.10.2023	-18 631.11	-0.02
EUR 5 087 199.62	GBP 4 355 000.00	5.10.2023	67 269.06	0.06
EUR 284 811.17	SEK 3 390 000.00	5.10.2023	-9 905.78	-0.01
EUR 1 264 906.48	JPY 199 500 000.00	5.10.2023	1 658.31	0.00
EUR 757 252.16	HUF 291 950 000.00	5.10.2023	6 051.84	0.01
AUD 3 360 000.00	EUR 2 009 662.41	5.10.2023	38 512.25	0.04
EUR 926 158.13	SGD 1 355 000.00	5.10.2023	-11 511.64	-0.01
PLN 1 190 000.00	EUR 265 793.76	5.10.2023	-8 357.03	-0.01
EUR 885 854.08	CHF 845 000.00	5.10.2023	13 215.95	0.01
EUR 8 742 633.51	NZD 15 915 000.00	5.10.2023	-287 994.75	-0.27
NOK 24 700 000.00	EUR 2 143 520.46	5.10.2023	48 824.42	0.05
CAD 641 040.05	USD 470 000.00	5.10.2023	3 934.23	0.00
EUR 53 686.35	HUF 20 900 000.00	5.10.2023	-90.28	0.00
GBP 370 000.00	USD 460 918.99	5.10.2023	-8 790.01	-0.01
USD 460 000.00	INR 38 320 622.00	5.10.2023	-1 334.57	0.00
MXN 4 300 000.00	EUR 229 229.64	5.10.2023	4 301.78	0.00
USD 460 000.00	CAD 623 385.28	5.10.2023	-1 045.01	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。

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						
EUR	107 743.07	MXN	1 990 000.00	5.10.2023	-333.10	0.00
EUR	119 753.19	JPY	18 900 000.00	5.10.2023	77.05	0.00
NZD	778 303.96	AUD	715 000.00	5.10.2023	5 785.44	0.01
USD	631 623.08	INR	52 559 378.00	5.10.2023	-1 167.96	0.00
PLN	2 005 000.00	HUF	165 729 209.80	5.10.2023	7 325.78	0.01
EUR	50 147.38	NZD	90 000.00	5.10.2023	-921.21	0.00
GBP	430 000.00	AUD	818 019.96	5.10.2023	-2 991.91	0.00
EUR	131 708.81	NZD	235 000.00	5.10.2023	-1 636.94	0.00
CHF	418 549.97	CAD	620 000.00	5.10.2023	-853.66	0.00
MXN	2 350 000.00	GBP	111 395.65	5.10.2023	-776.18	0.00
BRL	1 116 292.50	USD	225 000.00	5.10.2023	-1 985.85	0.00
USD	225 000.00	ZAR	4 230 011.03	5.10.2023	506.51	0.00
MXN	4 030 000.00	EUR	217 863.88	5.10.2023	1 003.94	0.00
MYR	3 329 000.00	USD	708 855.91	6.11.2023	3 167.96	0.00
USD	707 049.25	MYR	3 329 000.00	5.10.2023	-2 727.30	0.00
USD	150 000.00	EUR	142 224.45	5.10.2023	-567.95	0.00
USD	453 355.25	CNY	3 255 000.00	10.10.2023	-1 160.77	0.00
MXN	7 050 000.00	EUR	378 801.68	5.10.2023	4 081.22	0.00
GBP	431 728.50	EUR	500 000.00	5.10.2023	-2 354.28	0.00
USD	472 533.96	BRL	2 400 000.00	6.11.2023	-4 408.36	0.00
BRL	2 393 707.50	USD	473 064.72	5.10.2023	4 630.58	0.00
為替予約契約合計					-569 600.73	-0.54
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					9 514 685.81 *	8.99
当座借越およびその他の短期負債					-2 342 414.90	-2.21
その他の資産および負債					676 235.09	0.64
純資産合計					105 861 257.84	100.00

* 2023年9月30日現在、20,000.00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、76,000.00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 - アジア・フレキシブル(米ドル)
2023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 (%)
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			
米国中期国債、ゼロ・クーポン			
USD			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 03.11.22-02.11.23	3 500 000.00	3 484 056.52	0.91
Total USD		3 484 056.52	0.91
米国中期国債、ゼロ・クーポン合計		3 484 056.52	0.91
固定利付ノート			
USD			
USD ADANI ELECTRICITY MUMBAI LTD-REG-S 3.94900% 20-12.02.30	1 700 000.00	1 249 500.00	0.33
USD ADANI ELECTRICITY MUMBAI LTD-REG-S 3.86700% 21-22.07.31	1 100 000.00	763 081.00	0.20
USD ADANI PORTS & SPL ECO ZONE LTD-REG-S 5.00000% 21-02.08.41	700 000.00	458 689.00	0.12
USD AIA GROUP LTD-REG-S 5.62500% 22-25.10.27	200 000.00	201 828.48	0.05
USD AIA GROUP LTD-REG-S 4.95000% 23-04.04.33	400 000.00	379 317.00	0.10
USD AIRPORT AUTHORITY-REG-S 3.25000% 22-12.01.52	1 650 000.00	1 104 551.25	0.29
USD AIRPORT AUTHORITY-REG-S 4.75000% 23-12.01.28	2 875 000.00	2 825 135.72	0.74
USD ALIBABA GROUP HOLDING LTD 3.15000% 21-09.02.51	4 800 000.00	2 704 272.00	0.70
USD ANTON OILFIELD SERVICES GROUP-REG-S 8.75000% 21-26.01.25	200 000.00	167 082.00	0.04
USD AYC FINANCE LTD-REG-S 3.90000% 21-PRP	800 000.00	491 400.00	0.13
USD BAIDU INC 4.12500% 15-30.06.25	800 000.00	774 792.00	0.20
USD BAYFRONT INFRASTRUCTURE MANAGEMEN-REG-S 4.25700% 23-16.05.26	2 325 000.00	2 272 557.40	0.59
USD BHARTI AIRTEL LTD-REG-S 4.37500% 15-10.06.25	3 950 000.00	3 847 932.00	1.00
USD CA MAGNUM HOLDINGS-REG-S 5.37500% 21-31.10.26	575 000.00	507 247.75	0.13
USD CENTRAL CHINA REAL-REG-S *DEFAULTED* 7.25000% 20-16.07.24	800 000.00	28 000.00	0.01
USD CHAMPION PATH HOLDINGS-REG-S 4.85000% 21-27.01.28	300 000.00	241 434.00	0.06
USD CHINA HUANENG GP HK TREASURY MGT-REG-S 2.60000% 19-10.12.24	3 300 000.00	3 177 933.00	0.83
USD CHINA OIL AND GAS GROUP LTD-REG-S 4.70000% 21-30.06.26	350 000.00	277 959.50	0.07
USD CIFI HOL GROUP CO LTD REG-S*DEFAULTED* 4.37500% 21-12.04.27	1 800 000.00	117 000.00	0.03
USD CK HUTCHISON INTERNATIONAL 23 LTD-REG-S 4.75000% 23-21.04.28	2 725 000.00	2 624 829.00	0.68
USD CK HUTCHISON INTERNATIONAL 20 LTD-REG-S 2.50000% 20-08.05.30	1 500 000.00	1 233 605.79	0.32
USD CLIFFTON LTD-REG-S 6.25000% 21-25.10.25	750 000.00	730 515.00	0.19
USD CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 5.12500% 18-14.03.28	1 375 000.00	1 321 581.25	0.34
USD CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 3.87500% 19-19.06.29	1 200 000.00	1 070 592.00	0.28
USD CNOOC CURTIS FUNDING NO.1 PTY LTD-REG-S 4.50000% 13-03.10.23	1 700 000.00	1 698 980.00	0.44
USD CNOOC FINANCE 2015 USA LLC 4.37500% 18-02.05.28	1 050 000.00	1 010 856.00	0.26
USD DEVELOPMENT BK OF THE PHILIPPINES-REG-S 2.37500% 21-11.03.31	1 300 000.00	1 017 536.00	0.26
USD EASY TACTIC LTD (PIK) 6.50000% 22-11.07.27	538 203.00	32 292.18	0.01
USD EASY TACTIC LTD (PIK) 6.50000% 22-11.07.28	634 439.00	31 721.95	0.01
USD EHI CAR SERVICES LTD-REG-S 7.00000% 21-21.09.26	800 000.00	460 440.00	0.12
USD ENN CLEAN ENERGY INTERNAT INVEST-REG-S 3.37500% 21-12.05.26	300 000.00	274 752.00	0.07
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 3.62500% 18-27.11.23	5 000 000.00	4 983 400.00	1.30
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 5.12500% 23-11.01.33	350 000.00	342 461.00	0.09
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA-REG-S 4.62500% 23-07.06.33	200 000.00	187 811.48	0.05
USD FORTUNE STAR BVI LTD-REG-S 5.05000% 21-27.01.27	500 000.00	317 255.00	0.08
USD FORTUNE STAR BVI LTD-REG-S 5.00000% 21-18.05.26	435 000.00	302 438.10	0.08
USD FRANSION BRILLIANT LTD-REG-S 4.25000% 19-23.07.29	1 500 000.00	932 160.00	0.24
USD GS-CALTEX CORP-REG-S 5.37500% 23-07.08.28	2 750 000.00	2 688 015.00	0.70
USD HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING-REG-S 2.15000% 21-14.01.26	200 000.00	180 000.00	0.05
USD HANWHA Q CELLS AMERICAS HOLDINGS-REG-S 5.00000% 23-27.07.28	775 000.00	754 757.00	0.20

注記は、財務書類と不可分のものである。

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 HKT CAPITAL NO 6 LTD-REG-S 3.00000% 22-18.01.32	900 000.00	723 879.00	0.19
USD HONG KONG GOVERNMENT INTERNATI BD-REG-S 4.00000% 23-07.06.28	425 000.00	411 825.08	0.11
USD HUARONG FINANCE 2017 CO-REG-S 4.75000% 17-27.04.27	500 000.00	425 985.00	0.11
USD INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT-REG-S 4.74500% 21-09.06.51	1 775 000.00	1 215 768.50	0.32
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 3.50000% 17-11.01.28	2 650 000.00	2 445 102.00	0.64
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 4.65000% 22-20.09.32	6 975 000.00	6 516 045.00	1.70
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 4.85000% 23-11.01.33	2 000 000.00	1 903 720.00	0.50
USD INDUSTRIAL BANK OF KOREA-REG-S 5.37500% 23-04.10.28	1 425 000.00	1 425 731.60	0.37
USD INTERNATIONAL CONT TERM SERV-REG-S 4.75000% 20-17.06.30	250 000.00	233 430.00	0.06
USD JINGRUI HOLDINGS LTD-REG-S *DEFAULTED* 14.50000% 20-19.02.23	200 000.00	10 455.40	0.00
USD JMH CO LTD-REG-S 2.50000% 21-09.04.31	1 475 000.00	1 188 023.52	0.31
USD JOY TREASURE ASSETS HOLDINGS INC-REG-S 2.75000% 20-17.11.30	1 000 000.00	742 159.32	0.19
USD JSW HYDRO ENERGY LTD-REG-S 4.12500% 21-18.05.31	400 000.00	278 097.12	0.07
USD JSW STEEL LTD-REG-S 5.05000% 21-05.04.32	600 000.00	482 082.00	0.13
USD KAISA GROUP HOLDINGS-REG-S *DEFAULTED* 10.50000% 20-15.01.25	1 250 000.00	68 750.00	0.02
USD KOREA DEVELOPMENT BANK 2.12500% 19-01.10.24	3 000 000.00	2 893 980.00	0.75
USD KOREA DEVELOPMENT BANK 4.37500% 23-15.02.28	1 000 000.00	962 610.00	0.25
USD KOREA DEVELOPMENT BANK 4.37500% 23-15.02.33	250 000.00	230 304.80	0.06
USD KOREA MINE REHABILITATION & MIN-REG-S 4.12500% 22-20.04.27	300 000.00	280 938.00	0.07
USD KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 4.87500% 23-03.04.28	650 000.00	633 113.00	0.16
USD KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 4.75000% 23-03.04.26	1 400 000.00	1 371 846.00	0.36
USD KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 2.62500% 16-14.04.26	200 000.00	186 034.00	0.05
USD KOREA, REPUBLIC OF 2.00000% 19-19.06.24	2 100 000.00	2 045 337.00	0.53
USD KWG GROUP HOLDING LTD-REG-S *DEFAULTED* 6.30000% 20-13.02.26	975 000.00	87 750.00	0.02
USD LAI SUN MTN LTD-REG-S 5.00000% 21-28.07.26	1 400 000.00	764 960.00	0.20
USD LENOVO GROUP LTD-REG-S 3.42100% 20-02.11.30	600 000.00	489 096.00	0.13
USD LEVC FINANCE LTD-REG-S 1.37500% 21-25.03.24	3 512 000.00	3 429 608.48	0.89
USD LG ENERGY SOLUTION LTD-REG-S 5.75000% 23-25.09.28	1 550 000.00	1 541 707.50	0.40
USD LLPL CAPITAL PTE LTD-REG-S 6.87500% 19-04.02.39	625 000.00	446 009.89	0.12
USD MALAYSIA SOVEREIGN SUKUK BHD-REG-S 3.04300% 15-22.04.25	2 500 000.00	2 414 850.00	0.63
USD MEDCO BELL PTE LTD-REG-S 6.37500% 20-30.01.27	200 000.00	187 972.00	0.05
USD MEDCO LAUREL TREE PTE LTD-REG-S 6.95000% 21-12.11.28	300 000.00	278 742.00	0.07
USD MEITUAN DIANPING-REG-S 3.05000% 20-28.10.30	1 165 000.00	904 331.25	0.24
USD MELCO RESORTS FINANCE LTD-REG-S 5.75000% 20-21.07.28	1 550 000.00	1 341 525.00	0.35
USD MONG DUONG FINANCE HOLDINGS BV-REG-S 5.12500% 19-07.05.29	250 000.00	226 212.50	0.06
USD NEW METRO GLOBAL LTD-REG-S 4.50000% 21-02.05.26	1 342 000.00	300 057.78	0.08
USD NTT FINANCE CORP-REG-S 1.16200% 21-03.04.26	1 200 000.00	1 077 454.92	0.28
USD PAKUWON JATI TBK PT-REG-S 4.87500% 21-29.04.28	250 000.00	223 882.50	0.06
USD PERIAMA HOLDINGS LLC/DE-REG-S 5.95000% 20-19.04.26	300 000.00	283 863.00	0.07
USD PERTAMINA PT-REG-S 1.40000% 21-09.02.26	3 500 000.00	3 151 925.00	0.82
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 4.32500% 15-28.05.25	1 900 000.00	1 862 741.00	0.49
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF 2.65000% 20-10.12.45	375 000.00	224 182.50	0.06
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 5.60900% 22-13.04.33	275 000.00	275 178.75	0.07
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 5.17000% 22-13.10.27	2 475 000.00	2 455 200.00	0.64
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 5.50000% 23-17.01.48	600 000.00	563 004.00	0.15
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 4.62500% 23-17.07.28	1 250 000.00	1 207 775.00	0.31
USD POSCO-REG-S 4.50000% 22-04.08.27	3 000 000.00	2 860 830.00	0.74
USD POSCO-REG-S 5.75000% 23-17.01.28	200 000.00	198 744.00	0.05
USD POWERLONG REAL ESTATE HOLDINGS-REG-S 6.25000% 20-10.08.24	800 000.00	72 128.00	0.02
USD REDSUN PROPERTIES GRP-REG-S *DEFAULTED* 9.50000% 21-20.09.23	1 650 000.00	66 000.00	0.02
USD RELIANCE INDUSTRIES LTD-REG-S 2.87500% 22-12.01.32	2 150 000.00	1 711 959.00	0.45
USD RENEW WIND ENER AP2 / RENEW POWER-REG-S 4.50000% 21-14.07.28	700 000.00	584 003.00	0.15
USD RKPF OVERSEAS 2020 A LTD-REG-S 5.20000% 21-12.01.26	750 000.00	275 550.00	0.07
USD RONSHINE CHNA HOL LTD-REG-S *DEFAULTED* 7.35000% 20-15.12.23	3 275 000.00	98 250.00	0.03
USD SANDS CHINA LTD STEP-UP 21-18.06.30	900 000.00	776 936.07	0.20
USD SANDS CHINA LTD STEP-UP 22-08.03.29	1 150 000.00	947 108.38	0.25
USD SANTOS FINANCE LTD-REG-S 6.87500% 23-19.09.33	2 000 000.00	1 958 843.80	0.51
USD SHIMAO PRPTY HLDG LTD-REG-S *DEFAULTED* 5.20000% 21-16.01.27	1 600 000.00	55 584.00	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

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 SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD-REG-S 5.00000% 23-24.07.28	1 400 000.00	1 352 152.90	0.35
USD SHUI ON DEVELOPMENT HOLDINGLT-REG-S 5.50000% 21-29.06.26	1 050 000.00	451 500.00	0.12
USD SINO-OCEAN LAND TREASURE IV LTD-REG-S 3.25000% 21-05.05.26	850 000.00	25 500.00	0.01
USD SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOP-REG-S 4.37500% 14-10.04.24	2 778 000.00	2 758 831.80	0.72
USD SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMNT-REG-S 3.25000% 15-28.04.25	1 500 000.00	1 442 085.00	0.38
USD SINOPEC GRP OVERSEAS DEV LTD-REG-S 2.15000% 20-13.05.25	400 000.00	377 272.00	0.10
USD SINOPEC GRP OVERSEAS DEV LTD-REG-S 2.70000% 20-13.05.30	1 250 000.00	1 078 012.50	0.28
USD SK HYNIX INC-REG-S 2.37500% 21-19.01.31	2 400 000.00	1 803 792.00	0.47
USD SK HYNIX INC-REG-S 6.37500% 23-17.01.28	900 000.00	898 560.00	0.23
USD SK HYNIX INC-REG-S 6.50000% 23-17.01.33	1 400 000.00	1 366 428.00	0.36
USD SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULT* 6.75000% 18-18.04.28	1 250 000.00	576 712.50	0.15
USD SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULT* 7.55000% 19-28.03.30	1 000 000.00	461 610.00	0.12
USD STATE BANK OF INDIA LONDON-REG-S 4.37500% 19-24.01.24	4 840 000.00	4 809 798.40	1.25
USD STUDIO CITY CO LTD-REG-S 7.00000% 22-15.02.27	200 000.00	188 656.00	0.05
USD STUDIO CITY FINANCE LTD-REG-S 6.50000% 20-15.01.28	1 150 000.00	966 745.43	0.25
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 2.69600% 19-16.07.24	1 000 000.00	975 085.10	0.25
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.28000% 19-11.04.24	1 800 000.00	1 775 898.00	0.46
USD TIMES CHINA HOLD LTD-REG-S *DEFAULTED* 6.75000% 20-08.07.25	1 800 000.00	67 500.00	0.02
USD TSMC GLOBAL LTD-REG-S 2.25000% 21-23.04.31	2 650 000.00	2 124 399.00	0.55
USD WANDA PROPERTIES GLOBAL CO LTD-REG-S 11.00000% 23-13.02.26	300 000.00	108 000.00	0.03
USD WESTPAC BANKING CORP 5.35000% 22-18.10.24	1 500 000.00	1 494 016.31	0.39
USD WYNN MACAU LTD-REG-S 5.50000% 17-01.10.27	800 000.00	711 995.44	0.19
USD WYNN MACAU LTD-REG-S 5.12500% 19-15.12.29	600 000.00	489 681.00	0.13
USD WYNN MACAU LTD-REG-S 5.50000% 20-15.01.26	450 000.00	418 597.11	0.11
USD YANGO JUSTICE INT LTD-REG-S *DEFAULTED* 7.50000% 20-15.04.24	1 675 000.00	16 750.00	0.00
USD YANGO JUSTICE INT LTD-REG-S*DEFAULTED* 7.50000% 20-17.02.25	275 000.00	2 750.00	0.00
USD YANLORD LAND HK CO LTD-REG-S 5.12500% 21-20.05.26	200 000.00	115 500.00	0.03
USD YUZHOU PROPERTIES-REG-S *DEFAULTED* 7.37500% 20-13.01.26	1 824 000.00	109 440.00	0.03
USD ZHENRO PROP GROUP-REG-S *DEFAULTED* 8.30000% 20-15.09.23	1 000 000.00	6 550.00	0.00
Total USD		130 778 711.00	34.06
固定利付ノート合計		130 778 711.00	34.06
変動利付ノート			
USD GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES-REG-S-SUB 4.500%/VAR 21-PRP	1 300 000.00	484 380.00	0.13
USD IND & COM BK CHINA MACAU-REG-S-SUB 2.875%/VAR 19-12.09.29	700 000.00	679 427.15	0.18
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 5.063%/VAR 22-12.09.25	800 000.00	791 186.24	0.20
USD NANYANG COMMERCIAL BANK LTD-REG-S-SUB 7.350%/VAR 23-PRP	400 000.00	389 193.89	0.10
USD OVERSEA-CHINESE BKNG-REG-S-SUB 1.832%/VAR 20-10.09.30	3 476 000.00	3 194 258.31	0.83
USD STANDARD CHARTERED PLC-REG-S 6.301%/VAR 23-09.01.29	5 000 000.00	4 982 967.55	1.30
USD STANDARD CHARTERED PLC-REG-S-SUB 4.866%/VAR 18-15.03.33	1 975 000.00	1 767 664.46	0.46
USD STANDARD CHARTERED PLC-REG-S-SUB 3.603%/VAR 22-12.01.33	1 350 000.00	1 036 374.75	0.27
Total USD		13 325 452.35	3.47
変動利付ノート合計		13 325 452.35	3.47
固定利付メディアム・ターム・ノート			
USD AIA GROUP LTD-REG-S 3.20000% 15-11.03.25	1 200 000.00	1 160 275.20	0.30
USD BANGKOK BANK PCL/HONG KONG-REG-S 4.30000% 22-15.06.27	200 000.00	190 858.00	0.05
USD BANGKOK BANK PCL/HONG KONG-REG-S 5.50000% 23-21.09.33	3 300 000.00	3 181 662.00	0.83
USD BANK MANDIRI PERSERO TBK PT-REG-S 4.75000% 20-13.05.25	2 550 000.00	2 496 093.00	0.65
USD BANK MANDIRI PERSERO TBK PT-REG-S 5.50000% 23-04.04.26	850 000.00	839 375.00	0.22
USD BANK OF CHINA LTD/HUNGARY-REG-S 1.62500% 22-16.02.24	1 600 000.00	1 575 280.00	0.41
USD BANK OF CHINA/HONG KONG-REG-S 3.62500% 19-17.04.29	400 000.00	366 224.00	0.10
USD BANK OF EAST ASIA LTD-REG-S-SUB 4.00000% 20-29.05.30	450 000.00	413 275.50	0.11
USD BOC AVIATION LTD-REG-S 3.50000% 19-10.10.24	950 000.00	924 227.38	0.24
USD BOC AVIATION USA CORP-REG-S 1.62500% 21-29.04.24	4 000 000.00	3 897 783.68	1.02
USD BOC AVIATION USA CORP-REG-S 4.87500% 23-03.05.33	200 000.00	184 560.00	0.05
USD BOCOM LEASING MGT HONG KONG-REG-S 4.37500% 19-22.01.24	950 000.00	945 269.00	0.25

注記は、財務書類と不可分のものである。

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 CDBL FUNDING 1-REG-S 3.50000% 20-24.10.27	1 008 000.00	930 575.52	0.24
USD CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD-REG-S 3.12500% 20-18.03.30	300 000.00	243 249.00	0.06
USD CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD-REG-S 3.00000% 21-20.01.31	1 100 000.00	860 365.00	0.22
USD CHINA CINDA FINANCE 2017 I LTD-REG-S 4.75000% 18-08.02.28	1 100 000.00	1 025 135.98	0.27
USD CHINA CONSTRUCTION BANK CORP/HK-REG-S 1.25000% 20-04.08.25	2 750 000.00	2 539 157.50	0.66
USD CHINA DEVELOPMENT BANK CORP-REG-S 1.00000% 20-27.10.25	1 000 000.00	912 220.00	0.24
USD CHINA DEVELOPMENT BANK/HONG KONG-REG-S 0.62500% 21-09.09.24	500 000.00	476 620.00	0.12
USD CHINA GRT WALL INT HLDGS III LTD-REG-S 3.87500% 17-31.08.27	200 000.00	169 708.00	0.04
USD CHINA OVERSEAS FINAN CAYMAN VIII-REG-S 3.45000% 19-15.07.29	200 000.00	171 104.00	0.05
USD CICC HONG KONG FIN 2016 MTN LTD-REG-S 2.00000% 21-26.01.26	1 975 000.00	1 816 723.50	0.47
USD CITIC LTD-REG-S 3.50000% 22-17.02.32	2 200 000.00	1 858 560.00	0.48
USD CITIC LTD-REG-S 4.00000% 18-11.01.28	850 000.00	798 294.50	0.21
USD CLP POWER HONG KONG FINANCING LTD-REG-S 2.12500% 20-30.06.30	750 000.00	600 402.29	0.16
USD CMB INTERNATIONAL LEASING MGT LTD-REG-S 2.75000% 20-12.08.30	2 750 000.00	2 193 977.50	0.57
USD EXPORT IMPORT BANK OF THAILAND-REG-S 1.45700% 20-15.10.25	2 275 000.00	2 080 555.75	0.54
USD EXPORT-IMPORT BANK OF INDIA-REG-S 2.25000% 21-13.01.31	625 000.00	484 368.75	0.13
USD EXPORT-IMPORT BANK OF INDIA-REG-S 3.87500% 19-12.03.24	2 000 000.00	1 981 800.00	0.52
USD FAR EAST HORIZON LTD-REG-S 3.37500% 20-18.02.25	400 000.00	361 136.00	0.09
USD FAR EAST HORIZON LTD-REG-S 4.25000% 21-26.10.26	1 900 000.00	1 592 143.00	0.42
USD GC TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 4.40000% 22-30.03.32	1 000 000.00	853 060.00	0.22
USD GEMDALE EVER PROSPERITY INVESTMENT-REG-S 4.95000% 21-08.24	200 000.00	86 292.00	0.02
USD GLP CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 2.95000% 21-29.03.26	350 000.00	213 535.00	0.06
USD HONG KONG GOVERNMENT INTERNATIONA-REG-S 5.25000% 23-11.01.53	1 225 000.00	1 211 308.73	0.32
USD HONG KONG MORTGAGE CORP LTD-REG-S 4.87500% 23-13.09.28	2 300 000.00	2 280 886.77	0.59
USD HONGKONG ELECTRIC FINANCE LTD-REG-S 1.87500% 20-27.08.30	1 550 000.00	1 217 053.29	0.32
USD HONGKONG LAND FINANCE CO LTD-REG-S 5.25000% 23-14.07.33	2 975 000.00	2 794 438.53	0.73
USD HUARONG FINANCE 2017 CO-REG-S 4.25000% 17-07.11.27	2 500 000.00	2 076 250.00	0.54
USD HUARONG FINANCE-REG-S 4.50000% 19-29.05.29	400 000.00	318 256.00	0.08
USD ICBCIL FINANCE CO LTD-REG-S 1.75000% 20-25.08.25	800 000.00	739 496.00	0.19
USD INDIAN RAILWAY FINANCE CORP LTD-REG-S 3.73000% 19-29.03.24	4 250 000.00	4 197 682.50	1.09
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.12500% 15-15.01.45	1 000 000.00	903 330.00	0.24
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 3.85000% 17-18.07.27	400 000.00	377 320.00	0.10
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 4.75000% 17-18.07.47	300 000.00	255 906.00	0.07
USD INDUSTRIAL COMMERCIAL BANK CHINA-REG-S 1.20000% 20-09.09.25	3 025 000.00	2 774 590.50	0.72
USD INVENTIVE GLOBAL INVESTMENTS LTD-REG-S 1.10000% 21-01.09.24	2 951 000.00	2 818 795.74	0.73
USD KHAZANAH CAPITAL LTD-REG-S 4.87600% 23-01.06.33	1 250 000.00	1 177 650.00	0.31
USD KHAZANAH GLOBAL SUKUK BHD-REG-S 4.68700% 23-01.06.28	1 675 000.00	1 623 410.00	0.42
USD LI & FUNG LTD-REG-S-SUB 5.25000% 16-PRP	650 000.00	232 245.00	0.06
USD LINK FINANCE CAYMAN 2009 LTD-REG-S 3.60000% 14-03.09.24	1 850 000.00	1 810 454.77	0.47
USD MITSUI & CO LTD-REG-S 5.50900% 23-10.10.28	3 150 000.00	3 139 290.00	0.82
USD NAN FUNG TREASURY LTD-REG-S 3.62500% 20-27.08.30	1 100 000.00	884 702.19	0.23
USD OVERSEA-CHINESE BANKING CORP-REG-S-SUB 4.25000% 14-19.06.24	1 000 000.00	986 938.30	0.26
USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 7.37500% 21-08.04.31	3 000 000.00	1 394 280.00	0.36
USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 8.87500% 21-08.04.51	750 000.00	346 785.00	0.09
USD PERTAMINA PERSERO PT-REG-S 4.70000% 19-30.07.49	2 000 000.00	1 513 640.00	0.39
USD PERTAMINA PT-REG-S 6.45000% 14-30.05.44	800 000.00	760 392.00	0.20
USD PERTAMINA PT-REG-S 6.50000% 18-07.11.48	450 000.00	434 074.50	0.11
USD PERU PERS PT PERSUSAHAAN LIST NEG-REG-S 4.00000% 20-30.06.50	1 000 000.00	641 550.00	0.17
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 6.15000% 18-21.05.48	750 000.00	663 915.00	0.17
USD PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 3.50000% 20-21.04.30	1 000 000.00	885 430.00	0.23
USD PSA TREASURY PTE LTD-REG-S 2.50000% 16-12.04.26	2 400 000.00	2 233 549.68	0.58
USD PSA TREASURY PTE LTD-REG-S 2.12500% 19-05.09.29	500 000.00	420 565.40	0.11
USD PTT TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 5.87500% 19-03.08.35	2 320 000.00	2 226 712.80	0.58
USD REC LTD-REG-S 2.25000% 21-01.09.26	1 895 000.00	1 703 794.50	0.44
USD REC LTD-REG-S 5.62500% 23-11.04.28	350 000.00	341 274.50	0.09
USD REDCO PROPERTIES GRP-REG-S *DEFAULTED* 9.90000% 20-17.02.24	2 050 000.00	101 854.25	0.03

注記は、財務書類と不可分のものである。

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 RHB BANK BHD-REG-S 1.65800% 21-29.06.26	850 000.00	760 333.50	0.20
USD RHB BANK BHD-REG-S 3.76600% 19-19.02.24	200 000.00	198 402.00	0.05
USD SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD-REG-S 4.40000% 21-13.03.24	600 000.00	590 244.00	0.15
USD SIAM COMMERCIAL BK CAYMAN ISLAND-REG-S 3.90000% 19-11.02.24	1 250 000.00	1 239 437.50	0.32
USD SINGAPORE AIRLINES LTD-REG-S 3.00000% 21-20.07.26	700 000.00	654 724.25	0.17
USD SINGAPORE EXCHANGE LTD-REG-S 1.23400% 21-03.09.26	3 825 000.00	3 397 614.69	0.89
USD SINGTEL GROUP TREASURY PTE LTD-REG-S 3.25000% 15-30.06.25	2 500 000.00	2 406 998.50	0.63
USD SINOCEM OFFSHORE CAPITAL CO LTD-REG-S 2.37500% 21-23.09.31	1 200 000.00	914 316.00	0.24
USD SP GROUP TREASURY PTE LTD-REG-S 3.37500% 19-27.02.29	600 000.00	546 738.18	0.14
USD SP POWERASSETS LTD-REG-S 3.25000% 15-24.11.25	750 000.00	715 707.38	0.19
USD STATE BANK OF INDIA/LONDON-REG-S 1.80000% 21-13.07.26	300 000.00	270 441.00	0.07
USD STATE GRID OVERSEAS INVESTMENT-REG-S 3.50000% 17-04.05.27	2 250 000.00	2 117 790.00	0.55
USD STATE GRID OVERSEAS INVESTMENT-REG-S 4.25000% 18-02.05.28	2 257 000.00	2 165 798.69	0.56
USD SUMITOMO CORP-REG-S 5.55000% 23-09.03.28	475 000.00	473 434.18	0.12
USD SUN HUNG KAI PROP CAP MRKT LTD-REG-S 2.87500% 20-21.01.30	3 000 000.00	2 529 943.99	0.66
USD SWIRE PACIFIC MT FINANCING HK LTD-REG-S 2.87500% 20-30.01.30	500 000.00	422 661.58	0.11
USD SWIRE PACIFIC MTN FINANCING LTD-REG-S 4.50000% 13-09.10.23	1 200 000.00	1 199 905.56	0.31
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 2.39000% 20-03.06.30	1 500 000.00	1 205 070.00	0.31
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.24000% 20-03.06.50	2 210 000.00	1 265 070.30	0.33
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.84000% 21-22.04.51	1 850 000.00	1 179 578.50	0.31
USD THAI OIL TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 3.50000% 19-17.10.49	1 300 000.00	751 569.00	0.20
USD THAI OIL TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 3.75000% 20-18.06.50	200 000.00	120 498.00	0.03
USD VANKE REAL ESTAT HONG KONG CO LTD-REG-S 3.50000% 19-12.11.29	1 550 000.00	941 315.00	0.25
USD WHEELLOCK MTN BVI LTD-REG-S 2.37500% 21-25.01.26	970 000.00	892 453.98	0.23
Total USD		110 871 733.78	28.88

固定利付メディアム・ターム・ノート合計 110 871 733.78 28.88

変動利付メディアム・ターム・ノート

USD BANGKOK BANK PCL/HONG KONG-REG-S-SUB 5.000%/VAR 20-PRP	275 000.00	258 304.75	0.07
USD BANK OF EAST ASIA LTD-REG-S-SUB 5.825%/VAR 20-PRP	550 000.00	437 415.00	0.11
USD BANK OF EAST ASIA LTD-REG-S-SUB 4.875%/VAR 22-22.04.32	250 000.00	216 973.77	0.06
USD DAH SING BANK LTD-REG-S-SUB 3.000%/VAR 21-02.11.31	1 200 000.00	1 048 532.33	0.27
USD DBS GROUP HOLDINGS LTD-REG-S-SUB 4.520%/VAR 18-11.12.28	800 000.00	797 464.00	0.21
USD KASIKORN BANK PCL-REG-S-SUB 5.275%/VAR 20-PRP	350 000.00	329 175.00	0.08
USD KASIKORN BANK PCL/HONG KONG-REG-S-SUB 4.000%/VAR 21-PRP	400 000.00	343 068.00	0.09
USD KEB HANA BANK-REG-S-SUB 3.500%/VAR 21-PRP	200 000.00	176 692.00	0.05
USD SHINHAN FIN GROUP CO LTD-REG-S-SUB 3.340%/VAR 19-05.02.30	4 425 000.00	4 238 220.75	1.10
USD UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S-SUB 2.000%/VAR 21-14.10.31	1 200 000.00	1 064 424.60	0.28
Total USD		8 910 270.20	2.32

変動利付メディアム・ターム・ノート合計 8 910 270.20 2.32

固定利付債券

USD AGILE GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 6.05000% 20-13.10.25	1 400 000.00	154 000.00	0.04
USD AZURE POWER ENERGY LTD-REG-S 3.57500% 21-19.08.26	500 000.00	347 397.75	0.09
USD BANK RAKYAT INDONESIA-REG-S 3.95000% 19-28.03.24	725 000.00	716 416.00	0.19
USD BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO-REG-S-SUB 4.20000% 20-23.01.25	250 000.00	235 472.50	0.06
USD BIM LAND JSC-REG-S 7.37500% 21-07.05.26	1 200 000.00	839 172.00	0.22
USD CENTRAL PLAZA DEVELOPMENT LTD-REG-S 4.65000% 21-19.01.26	200 000.00	144 606.00	0.04
USD CHINA SCE GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 7.00000% 20-02.05.25	400 000.00	24 900.00	0.01
USD CHINA SCE GROUP HOLDINGS LTD-REG-S- 6.00000% 21-04.02.26	700 000.00	40 250.00	0.01
USD CHINA SCE PROPERTY HOLDINGS LTD-REG-S 5.95000% 21-29.09.24	775 000.00	54 250.00	0.01
USD CK HUTCHISON INTERNATIONAL 23 LTD-REG-S 4.87500% 23-21.04.33	775 000.00	721 075.50	0.19

注記は、財務書類と不可分のものである。

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	CMHI FINANCE BVI CO LTD-REG-S 5.00000% 18-06.08.28	1 450 000.00	1 420 623.00	0.37
USD	CONTINUUM ENERGY AURA PTE LTD-REG-S 9.50000% 23-24.02.27	600 000.00	596 250.00	0.15
USD	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 5.12500% 20-14.01.27	1 500 000.00	93 750.00	0.02
USD	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 5.62500% 20-14.01.30	1 400 000.00	87 500.00	0.02
USD	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 4.20000% 20-06.02.26	1 600 000.00	100 000.00	0.03
USD	EHI CAR SERVICES LTD-REG-S 7.75000% 21-14.11.24	200 000.00	153 066.00	0.04
USD	ELECT GLOBAL INVESTMENTS LTD-REG-S 4.85000% 20-PRP	800 000.00	528 845.18	0.14
USD	FPC RESOURCES LTD-REG-S 4.37500% 20-11.09.27	600 000.00	570 936.00	0.15
USD	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD-REG-S 3.87500% 15-04.06.25	375 000.00	257 642.96	0.07
USD	GREENKO DUTCH BV-REG-S 3.85000% 21-29.03.26	815 000.00	688 302.55	0.18
USD	GREENKO SOLAR MAURITIUS LTD-REG-S 5.95000% 19-29.07.26	500 000.00	464 535.00	0.12
USD	HARVEST OPERATIONS CORP-REG-S 1.00000% 21-26.04.24	1 000 000.00	971 420.00	0.25
USD	HUTCHISON WHAMPOA INTERNATIONAL14-REG-S 3.62500% 14-31.10.24	1 972 000.00	1 924 395.92	0.50
USD	INDUSTRIAL BANK OF KOREA-REG-S 0.62500% 21-17.09.24	6 475 000.00	6 169 185.75	1.61
USD	KAISA GROUP HOLDINGS-REG-S *DEFAULT* 11.70000% 21-11.11.25	1 000 000.00	55 000.00	0.01
USD	KASIKORNBANK PCL/HONG KONG-REG-S 5.45800% 23-07.03.28	400 000.00	394 772.00	0.10
USD	KOREA EAST-WEST POWER CO LTD-REG-S 4.87500% 23-12.07.28	3 425 000.00	3 311 759.56	0.86
USD	KOREA LAND & HOUSING CORP-REG-S 5.75000% 23-06.10.25	4 825 000.00	4 828 667.00	1.26
USD	KUBOTA CREDIT CORP USA-REG-S 4.95800% 23-31.05.26	925 000.00	909 042.53	0.24
USD	KWG GROUP HOLDING LTD-REG-S *DEFAULTED* 5.87500% 17-10.11.24	500 000.00	45 000.00	0.01
USD	KWG GROUP HOLDINGS LTD 7.87500% 22-30.08.24	700 000.00	53 067.00	0.01
USD	LMIRT CAPITAL PTE LTD-REG-S 7.50000% 21-09.02.26	350 000.00	193 767.00	0.05
USD	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 3.95000% 19-16.09.29	1 200 000.00	571 152.00	0.15
USD	LS FINANCE 2017 LTD-REG-S 4.80000% 21-18.06.26	1 150 000.00	842 375.00	0.22
USD	MALAYSIA WAKALA SUKUK BHD-REG-S 3.07500% 21-28.04.51	500 000.00	336 090.00	0.09
USD	MINEJESA CAPITAL BV-REG-S 5.62500% 17-10.08.37	2 050 000.00	1 560 952.00	0.41
USD	MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 4.45000% 21-07.07.31	300 000.00	231 342.00	0.06
USD	NAN FUNG TREASURY III LTD-REG-S 5.00000% 20-PRP	1 500 000.00	945 876.84	0.25
USD	NEW METRO GLOBAL LTD-REG-S 4.80000% 20-15.12.24	200 000.00	72 536.00	0.02
USD	NWD FINANCE BVI LTD-REG-S 4.80000% 20-PRP	750 000.00	306 562.50	0.08
USD	NWD MTN LTD-REG-S 4.12500% 19-18.07.29	775 000.00	465 775.00	0.12
USD	PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 5.37500% 18-25.01.29	538 000.00	521 009.96	0.14
USD	PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 4.20000% 14-21.01.24	3 100 000.00	3 081 555.00	0.80
USD	PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 3.95000% 15-20.01.40	1 025 000.00	808 622.50	0.21
USD	PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 3.70000% 16-01.03.41	2 250 000.00	1 689 345.00	0.44
USD	POWER FINANCE CORP LTD-REG-S 3.75000% 19-18.06.24	1 500 000.00	1 472 040.00	0.38
USD	POWERLONG REAL ESTATE HOLDING LTD-REG-S 4.90000% 21-13.05.26	2 200 000.00	181 390.00	0.05
USD	POWERLONG REAL ESTATE HOLDINGS LTD 6.95000% 23-06.12.25	200 000.00	18 000.00	0.00
USD	RKPF OVERSEAS 2020 A LTD-REG-S 5.12500% 21-26.07.26	1 100 000.00	355 916.00	0.09
USD	SEAZEN GROUP LTD-REG-S 4.45000% 21-13.07.25	400 000.00	105 860.00	0.03
USD	SHINHAN CARD CO LTD-REG-S 1.37500% 21-23.06.26	900 000.00	797 400.00	0.21
USD	SK BROADBAND CO LTD-REG-S 4.87500% 23-28.06.28	600 000.00	583 164.00	0.15
USD	SK ON CO LTD-REG-S 5.37500% 23-11.05.26	1 850 000.00	1 834 053.00	0.48
USD	SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULT* 6.85000% 15-03.11.25	2 050 000.00	981 437.50	0.25
USD	SUNAC CHINA HOLDINGS-REG-S *DEFAULTED* 6.50000% 20-10.01.25	900 000.00	121 500.00	0.03
USD	TALENT YIELD INTERNATIONAL LTD-REG-S 3.12500% 21-06.05.31	200 000.00	165 716.00	0.04
USD	VEDANTA RESOURCES FINANCE II PLC-REG-S 8.95000% 21-11.03.25	500 000.00	367 235.00	0.10
USD	VIETNAM, SOCIALIST REPUBLIC-REG-S 4.80000% 14-19.11.24	1 000 000.00	980 510.00	0.25
USD	WEST CHINA CEMENT LTD-REG-S 4.95000% 21-08.07.26	700 000.00	493 500.00	0.13
USD	WOORI BANK-REG-S-SUB 4.75000% 14-30.04.24	700 000.00	692 622.00	0.18
USD	XIAOMI BEST TIME INTER LTD-REG-S 4.10000% 21-14.07.51	4 900 000.00	2 749 243.00	0.72
USD	YUZHOU PROPERTIES-REG-S *DEFAULTED* 8.30000% 19-27.05.25	2 275 000.00	136 500.00	0.04
Total	USD		50 564 347.50	13.17
固定利付債券合計			50 564 347.50	13.17

注記は、財務書類と不可分のものである。

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 (%)
変動利付債券			
USD			
USD BANK NEGARA INDONESIA PERSERO-REG-S-SUB 4.300%/VAR 21-PRP	1 225 000.00	998 950.75	0.26
USD BANK OF COMMUNICATIONS H/K-REG-S 2.304%/VAR 21-08.07.31	1 600 000.00	1 446 520.38	0.38
USD BANK OF EAST ASIA LTD/THE-REG-S-SUB 5.875%/VAR 19-PRP	1 000 000.00	865 000.00	0.22
USD CASHLD FLR REG-S-SUB 4.000%/VAR 21-PRP	800 000.00	649 453.36	0.17
USD CELESTIAL MILES LTD-REG-S 5.750%/VAR 19-PRP	200 000.00	192 600.00	0.05
USD CHINA TAIPING INSURANCE-REG-S-SUB 6.400%/VAR 23-PRP	350 000.00	354 931.50	0.09
USD ELECT GLOBAL INVESTMENTS LTD-REG-S-SUB 4.100%/VAR 20-PRP	1 000 000.00	815 500.00	0.21
USD GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES-REG-S-SUB 4.600%/VAR 21-PRP	1 663 000.00	599 544.76	0.16
USD GLOBE TELECOM INC-REG-S 4.200%/VAR 21-PRP	500 000.00	464 210.00	0.12
USD INDUSTRIAL & COMM BK OF CHINA-REG-S 3.200%/VAR 21-PRP	200 000.00	183 600.00	0.05
USD NETWORK 121 LTD-REG-S-SUB 5.650%/VAR 19-PRP	400 000.00	387 272.00	0.10
USD NWD FINANCE BVI LTD-REG-S 4.125%/VAR 21-PRP	3 300 000.00	1 625 249.99	0.42
USD SINO OCEAN LAND TREASURE-REG-S-SUB 4.900%/VAR 17-PRP	525 000.00	5 250.00	0.00
USD SMC GLOBAL POWER HOLDINGS CORP-REG-S 5.950%/VAR 19-PRP	380 000.00	287 964.00	0.07
USD SMC GLOBAL POWER HOLDINGS CORP-REG-S 5.450%/VAR 21-PRP	2 300 000.00	1 560 550.00	0.41
USD STANDARD CHARTERED PLC-REG-S-SUB COCO 4.300%/VAR 21-PRP	1 200 000.00	871 464.84	0.23
Total USD		11 308 061.58	2.94
変動利付債券合計		11 308 061.58	2.94
固定利付転換社債			
USD			
USD STANDARD CHARTERED PLC-REG-S-SUB COCO 4.75000% 21-PRP	800 000.00	569 876.00	0.15
Total USD		569 876.00	0.15
固定利付転換社債合計		569 876.00	0.15
変動利付転換社債			
USD			
USD KRUNG THAI/CAYMAN ISLANDS-REG-S-SUB COCO 4.400%/VAR 21-PRP	325 000.00	291 281.25	0.08
Total USD		291 281.25	0.08
変動利付転換社債合計		291 281.25	0.08
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		330 103 790.18	85.98
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			
USD			
USD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BK GROUP LTD 5.08800% 22-08.12.25	1 500 000.00	1 485 246.15	0.39
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 2.85000% 16-18.05.26	1 500 000.00	1 401 206.22	0.35
USD MIZUHO FINANCIAL GROUP INC-REG-S 3.47700% 16-12.04.26	1 000 000.00	943 660.30	0.25
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK NEW YORK BRANCH 4.96600% 23-12.01.26	1 500 000.00	1 482 458.55	0.39
Total USD		5 312 571.22	1.38
固定利付ノート合計		5 312 571.22	1.38

注記は、財務書類と不可分のものである。

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 (%)
固定利付メディアム・ターム・ノート			
USD			
USD DBS GROUP HOLDINGS-REG-S 1.16900% 21-22.11.24	1 750 000.00	1 663 923.70	0.43
USD HDFC BANK LTD/GIFT CITY-REG-S 5.68600% 23-02.03.26	2 175 000.00	2 171 607.00	0.57
USD PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 3.50000% 15-18.03.25	3 000 000.00	2 905 170.00	0.76
Total USD		6 740 700.70	1.76
固定利付メディアム・ターム・ノート合計		6 740 700.70	1.76
固定利付債券			
USD			
USD MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 3.50000% 21-07.07.27	700 000.00	584 822.00	0.15
Total USD		584 822.00	0.15
固定利付債券合計		584 822.00	0.15
変動利付債券			
USD			
USD SCENTRE GROUP TRUST 2-REG-S-SUB 4.750%/VAR 20-24.09.80	3 000 000.00	2 696 250.00	0.70
USD SCENTRE GROUP TRUST 2-REG-S-SUB 5.125%/VAR 20-24.09.80	200 000.00	167 141.48	0.05
Total USD		2 863 391.48	0.75
変動利付債券合計		2 863 391.48	0.75
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		15 501 485.40	4.04
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			
香港			
USD UBS (HK) FUND SERIES - ASIA INCOME BOND (USD)-E USD ACC	1 420.00	11 227 120.66	2.92
香港合計		11 227 120.66	2.92
ルクセンブルグ			
USD UBS (LUX) BD SICAV-ASIAN INVEST GR BDS SUSTAIN (USD) U-X-ACC	1 470.00	17 120 413.80	4.46
USD UBS (LUX) BOND SICAV - CHINA HIGH YIELD (USD) U-X-ACC	550.00	2 320 015.50	0.60
ルクセンブルグ合計		19 440 429.30	5.06
投資信託、オープン・エンド型合計		30 667 549.96	7.98
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		30 667 549.96	7.98
投資有価証券合計		376 272 825.54	98.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

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 (%)
派生商品			
公認の証券取引所に上場されている派生商品			
債券に係る金融先物			
USD	US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.12.23	102.00	-839 937.50 -0.22
USD	US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.12.23	120.00	-111 929.68 -0.03
USD	US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 29.12.23	91.00	-7 429.52 0.00
USD	US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 29.12.23	69.00	-29 343.75 -0.01
債券に係る金融先物合計			-988 640.45 -0.26
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計			-988 640.45 -0.26
派生商品合計			-988 640.45 -0.26
為替予約契約			
購入通貨 / 購入額 / 売却通貨 / 売却額 / 満期日			
CNH	146 971 621.90	USD 20 690 000.00 30.10.2023	-498 938.77 -0.13
USD	12 430 000.00	SGD 16 463 535.00 30.10.2023	353 135.16 0.09
USD	8 149 603.45	CNH 58 990 000.00 30.10.2023	45 517.19 0.01
USD	8 020 000.00	SGD 10 836 682.55 30.10.2023	70 726.02 0.02
AUD	12 390 482.50	USD 8 020 000.00 30.10.2023	-14 888.72 0.00
CNH	58 112 085.92	USD 8 020 000.00 30.10.2023	-36 522.17 -0.01
EUR	41 337 100.00	USD 44 431 223.27 17.10.2023	-639 995.52 -0.17
GBP	99 322 900.00	USD 123 765 431.38 17.10.2023	-2 526 437.46 -0.66
SGD	8 062 800.00	USD 5 928 921.77 17.10.2023	-17 972.33 0.00
JPY	1 155 855 093.00	EUR 7 355 000.00 30.10.2023	-12 481.99 0.00
USD	486 884.31	EUR 453 600.00 17.10.2023	6 354.69 0.00
USD	7 922 568.68	AUD 12 390 482.50 30.10.2023	-82 542.60 -0.02
為替予約契約合計			-3 354 046.50 -0.87
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			19 640 896.88 5.12
その他の資産および負債			-7 626 637.96 -1.99
純資産合計			383 944 397.51 100.00

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)
2023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	ALLWYN ENTERTAINMENT FINANCING UK-REG-S 7.25000% 23-30.04.30	7 870 000.00	0.60
EUR	ALTICE FINCO SA-REG-S 4.75000% 17-15.01.28	8 780 000.00	0.53
EUR	ALTICE FRANCE HOLDING SA-REG-S 8.00000% 19-15.05.27	10 525 000.00	0.45
EUR	ALTICE FRANCE HOLDING SA-REG-S 4.00000% 20-15.02.28	1 105 000.00	0.04
EUR	ALTICE FRANCE-REG-S 5.87500% 18-01.02.27	28 695 000.00	1.86
EUR	ARD FINANCE SA-REG-S (PIK) 5.00000% 19-30.06.27	8 030 621.00	0.45
EUR	ARDAGH METAL PACKAGING FINANCE -REG-S 3.00000% 21-01.09.29	4 670 000.00	0.27
EUR	ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-REG-S 2.12500% 19-15.08.26	2 943 000.00	0.20
EUR	AZELIS FINANCE NV-REG-S 5.75000% 23-15.03.28	2 145 000.00	0.16
EUR	BRITISH AIRWAYS PLC-REG-S 2.75000% 21-25.03.25	2 700 000.00	0.20
EUR	CARNIVAL PLC 1.00000% 19-28.10.29	1 640 000.00	0.08
EUR	CHEPLAPHARM ARZNEIMITTEL GMBH-REG-S 3.50000% 20-11.02.27	2 865 000.00	0.20
EUR	CHROME HOLDCO REG-S-SUB 5.00000% 21-31.05.29	8 255 000.00	0.47
EUR	CONSOLIDATED ENERGY FINANCE SA-REG-S 5.00000% 21-15.10.28	2 604 000.00	0.15
EUR	CROWN EUROPEAN HOLDINGS SA-REG-S 5.00000% 23-15.05.28	5 675 000.00	0.43
EUR	DANA FINANCING LUXEMBOURG SARL-REG-S 8.50000% 23-15.07.31	2 110 000.00	0.16
EUR	DOUGLAS GMBH-REG-S 6.00000% 21-08.04.26	3 520 000.00	0.26
EUR	DUFREY ONE BV-REG-S 2.50000% 17-15.10.24	1 730 000.00	0.13
EUR	EDREAMS ODIGEO SA-REG-S 5.50000% 22-15.07.27	3 890 000.00	0.27
EUR	ELIOR GROUP SA-REG-S 3.75000% 21-15.07.26	2 390 000.00	0.14
EUR	EP INFRASTRUCTURE AS-REG-S 1.69800% 19-30.07.26	5 220 000.00	0.34
EUR	FAURECIA SE-REG-S 3.75000% 20-15.06.28	12 650 000.00	0.85
EUR	FAURECIA-REG-S 2.75000% 21-15.02.27	3 750 000.00	0.25
EUR	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.38600% 19-17.02.26	6 895 000.00	0.49
EUR	GARFUNKELUX HOLDCO 3 SA-REG-S 6.75000% 20-01.11.25	2 310 000.00	0.13
EUR	GRIFOLS SA-REG-S 3.87500% 21-15.10.28	6 330 000.00	0.40
EUR	GTC AURORA LUXEMBOURG SA-REG-S 2.25000% 21-23.06.26	4 400 000.00	0.22
EUR	IHO VERWALTUNGS GMBH-REG-S (PIK) 3.87500% 19-15.05.27	2 585 000.00	0.18
EUR	ILIAD HOLDING SASU-REG-S 5.12500% 21-15.10.26	4 710 000.00	0.34
EUR	ILIAD HOLDING SASU-REG-S 5.62500% 21-15.10.28	3 000 000.00	0.21
EUR	INEOS QUATTRO FINANCE 1 PLC-REG-S 3.75000% 21-15.07.26	7 520 000.00	0.50
EUR	INTL CONSOLIDATED AIRLINES GP-REG-S 3.75000% 21-25.03.29	3 400 000.00	0.22
EUR	INTRUM AB-REG-S 3.00000% 19-15.09.27	1 680 000.00	0.09
EUR	INTRUM AB-REG-S 4.87500% 20-15.08.25	3 110 000.00	0.21
EUR	IQVIA INC-REG-S 2.25000% 19-15.01.28	4 835 000.00	0.32
EUR	IQVIA INC-REG-S 2.87500% 20-15.06.28	3 450 000.00	0.23
EUR	JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-REG-S 6.87500% 19-15.11.26	1 000 000.00	0.08
EUR	LABORATOIRE EIMER SELARL-REG-S 5.00000% 21-01.02.29	2 015 000.00	0.12
EUR	LOXAM SAS-REG-S 3.75000% 19-15.07.26	9 085 000.00	0.64
EUR	NH HOTEL GROUP SA-REG-S 4.00000% 21-02.07.26	3 090 000.00	0.22
EUR	NIDDA BONDCO GMBH-REG-S 5.00000% 17-30.09.25	8 325 000.00	0.62
EUR	NIDDA HEALTHCARE HOLDING GMBH-REG-S 7.50000% 22-21.08.26	23 151 000.00	1.76
EUR	O1 EUROPEAN GROUP BV-REG-S 6.25000% 23-15.05.28	6 290 000.00	0.48
EUR	OLYMPUS WATER US HOLDING CORP-REG-S 9.62500% 23-15.11.28	2 450 000.00	0.18
EUR	ONTEX GROUP N.V-REG-S 3.50000% 21-15.07.26	12 140 000.00	0.82
EUR	PICARD BONDCO SA-REG-S 5.37500% 21-01.07.27	2 280 000.00	0.16
EUR	ROLLS-ROYCE PLC-REG-S 4.62500% 20-16.02.26	3 300 000.00	0.24
EUR	SOFTBANK GROUP CORP REG-S 3.87500% 21-06.07.32	3 120 000.00	0.18
EUR	SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 4.00000% 17-19.09.29	3 170 000.00	0.20
EUR	SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 5.00000% 18-15.04.28	10 130 000.00	0.70

注記は、財務書類と不可分のものである。

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 SUMMER BC HOLDCO A SARL-REG-S 9.25000% 19-31.10.27	1 630 000.00	1 194 579.98	0.09
EUR TELECOM ITALIA SPA/MILANO-REG-S 6.87500% 23-15.02.28	7 390 000.00	7 428 058.50	0.56
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 3.75000% 21-09.05.27	17 319 000.00	15 681 142.17	1.18
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 7.37500% 23-15.09.29	20 925 000.00	21 269 425.50	1.60
EUR TI AUTOMOTIVE FINANCE PLC-REG-S 3.75000% 21-15.04.29	2 700 000.00	2 197 125.00	0.17
EUR TUI CRUISES GMBH-REG-S 6.50000% 21-15.05.26	6 940 000.00	6 542 490.67	0.49
EUR VERISURE HOLDING AB-REG-S 9.25000% 22-15.10.27	2 835 000.00	3 005 100.00	0.23
EUR VERISURE MIDHOLDING AB-REG-S 5.25000% 21-15.02.29	2 890 000.00	2 534 454.86	0.19
EUR VERTICAL HOLDCO GMBH-REG-S 6.62500% 20-15.07.28	3 360 000.00	2 634 660.00	0.20
EUR WP/AP TELECOM HOLDINGS III BV-REG-S 5.50000% 21-15.01.30	1 000 000.00	814 302.00	0.06
EUR ZIGGO BOND CO BV-REG-S 3.37500% 20-28.02.30	1 040 000.00	763 256.00	0.06
Total EUR		308 424 848.55	23.26
GBP			
GBP BRACKEN MIDCO1 PLC-REG-S 6.75000% 21-01.11.27	7 380 000.00	7 231 650.67	0.54
GBP CPUK FINANCE LTD-REG-S 6.50000% 20-28.08.26	2 920 000.00	3 206 248.80	0.24
GBP MPT OPERATING PARTNERSHIP LP/FIN CORP 2.50000% 21-24.03.26	1 150 000.00	1 004 225.31	0.08
GBP PINNACLE BIDCO PLC-REG-S 6.37500% 18-15.02.25	12 540 000.00	14 427 471.64	1.09
Total GBP		25 869 596.42	1.95
USD			
USD DRAX FINCO PLC-144A 6.62500% 18-01.11.25	3 300 000.00	2 981 984.41	0.22
USD MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-144A 5.75000% 18-15.06.26	1 790 000.00	1 614 382.10	0.12
USD NEPTUNE ENERGY BONDCO PLC-REG-S 6.62500% 18-15.05.25	10 145 000.00	9 491 024.79	0.72
USD SPRINGLEAF FINANCE CORP 6.87500% 18-15.03.25	3 830 000.00	3 588 797.62	0.27
USD TELECOM ITALIA CAPITAL 6.37500% 04-15.11.33	2 090 000.00	1 711 623.83	0.13
Total USD		19 387 812.75	1.46
固定利付ノート合計		353 682 257.72	26.67
変動利付ノート			
EUR ABANCA CORP BANCARIA SA-REG-S-SUB VAR 21-PRP	2 000 000.00	1 781 040.00	0.13
EUR ABANCA CORP BANCARIA SA-REG-S-SUB 10.625%/VAR 23-PRP	3 400 000.00	3 469 224.00	0.26
EUR ABERTIS INFRA FINANCE BV-REG-S-SUB 3.248%/VAR 20-PRP	8 000 000.00	7 292 448.00	0.55
EUR ACCOR SA-REG-S-SUB 2.625%/VAR 19-PRP	4 400 000.00	4 162 400.00	0.31
EUR ALPHA BANK AE-REG-S-SUB 5.500%/VAR 21-11.06.31	4 820 000.00	4 482 600.00	0.34
EUR BANCA MONTE DEI PASCHI DI-REG-S-SUB 8.520%/VAR 20-10.09.30	3 230 000.00	3 051 413.30	0.23
EUR BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENT-REG-S-SUB 8.375%/VAR 23-PRP	6 200 000.00	6 187 600.00	0.47
EUR BANCO BPM SPA-REG-S-SUB 5.000%/VAR 20-14.09.30	3 490 000.00	3 407 370.76	0.26
EUR BANKINTER SA-REG-S-SUB COCO 7.375%/VAR 23-PRP	3 000 000.00	2 850 912.00	0.22
EUR BAYER AG-REG-S-SUB 5.375%/VAR 22-25.03.82	5 900 000.00	5 405 875.00	0.41
EUR BAYNGR AG-REG-S-SUB 7.000%/VAR 23-25.09.83	3 400 000.00	3 362 926.40	0.25
EUR CASTELLUM AB-REG-S 3.125%/VAR 21-PRP	2 990 000.00	2 162 607.20	0.16
EUR CITCON-REG-S-SUB 4.496%/VAR 19-PRP	500 000.00	351 750.00	0.03
EUR CITYCON OYJ-REG-S-SUB 3.250%/VAR 21-PRP	2 730 000.00	1 616 269.20	0.12
EUR CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S-SUB 4.875%/VAR 20-PRP	1 300 000.00	446 459.00	0.03
EUR DEUTSCHE BANK AG-REG-S-SUB 6.750%/VAR 22-PRP	2 800 000.00	2 268 000.00	0.17
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 3.375%/VAR 20-PRP	5 800 000.00	4 465 280.80	0.34
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 2.875%/VAR 20-PRP	9 200 000.00	7 993 420.00	0.60
EUR FASTIGHETS AB BALDER-REG-S-SUB 2.873%/VAR 21-02.06.81	2 190 000.00	1 506 124.32	0.11
EUR HEIMSTADEN AB-REG-S-SUB 6.750%/VAR 21-PRP	5 300 000.00	1 855 000.00	0.14
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB COCO 9.125%/VAR 23-PRP	2 685 000.00	2 711 850.00	0.21
EUR NOVO BANCO SA-REG-S-SUB 9.875%/VAR 23-01.12.33	4 300 000.00	4 449 425.00	0.34
EUR PERMANENT TSB GROUP HOLDINGS PLC-REG-S-SUB VAR 22-PRP	2 110 000.00	2 394 850.00	0.18
EUR PERMANENT TSB GROUP HOLD PLC-REG-S 6.625%/VAR 23-25.04.28	3 590 000.00	3 632 003.00	0.27
EUR RABOBANK NEDERLAND-REG-S-SUB 3.100%/VAR 21-PRP	5 600 000.00	4 214 000.00	0.32
EUR REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV-SUB 4.247%/VAR 20-PRP	2 645 000.00	2 406 696.08	0.18

注記は、財務書類と不可分のものである。

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 REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S-SUB 2.500%/VAR 21-PRP	2 200 000.00	1 936 000.00	0.15
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 2.376%/VAR 21-PRP	3 500 000.00	2 746 100.00	0.21
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 2.880%/VAR 21-PRP	1 300 000.00	1 106 625.00	0.08
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 7.125%/VAR 22-PRP	800 000.00	820 000.00	0.06
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 6.135%/VAR 23-PRP	3 500 000.00	3 360 240.00	0.25
EUR UNICREDIT SPA-REG-S-SUB 2.731%/VAR 20-15.01.32	3 175 000.00	2 791 910.85	0.21
EUR VODAFONE GROUP PLC-REG-S-SUB 3.000%/VAR 20-27.08.80	5 670 000.00	4 593 834.00	0.35
Total EUR		105 282 433.91	7.94
GBP			
GBP CO-OPRATIVE BNK FINCE PLC/THE-REG-S 9.000%/VAR 20-27.11.25	7 580 000.00	8 642 476.11	0.65
Total GBP		8 642 476.11	0.65
USD			
USD BARCLAYS PLC-SUB COCO 8.000%/VAR 22-PRP	2 150 000.00	1 822 431.59	0.14
USD SOCIETE GENERALE SA-REG-S-SUB 9.375%/VAR 22-PRP	2 270 000.00	2 100 869.94	0.16
USD VODAFONE GROUP PLC-SUB 3.250%/VAR 21-04.06.81	1 663 000.00	1 382 909.80	0.10
Total USD		5 306 211.33	0.40
変動利付ノート合計		119 231 121.35	8.99
固定利付ミディアム・ターム・ノート			
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 5.62500% 16-06.05.26	1 000 000.00	996 910.00	0.08
EUR BLACKSTONE PROPERTY PARTNERS EUR-REG-S 2.20000% 18-24.07.25	3 970 000.00	3 722 295.82	0.28
EUR CASTELLUM HELSINKI FINANCE HOLDIN-REG-S 2.00000% 22-24.03.25	1 857 000.00	1 738 614.84	0.13
EUR CELLNEX FINANCE CO SA -REG-S 1.25000% 21-15.01.29	2 600 000.00	2 168 873.20	0.16
EUR CELLNEX FINANCE CO SA-REG-S 2.00000% 21-15.09.32	9 300 000.00	7 249 852.20	0.55
EUR CELLNEX FINANCE CO SA-REG-S 2.25000% 22-12.04.26	5 800 000.00	5 470 212.00	0.41
EUR CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S 2.75000% 20-12.05.26	5 470 000.00	4 539 470.95	0.34
EUR CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S 1.75000% 22-14.01.30	900 000.00	560 250.00	0.04
EUR CTP NV-REG-S 1.50000% 21-27.09.31	4 350 000.00	3 065 078.90	0.23
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA AG-REG-S 3.75000% 21-11.02.28	1 100 000.00	1 014 670.80	0.08
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA AG-REG-S 3.50000% 21-14.07.29	1 700 000.00	1 504 840.00	0.11
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA AG-REG-S 2.87500% 21-16.05.27	6 800 000.00	6 179 540.80	0.47
EUR FASTIGHETS AB BALDER-REG-S 1.25000% 20-28.01.28	1 470 000.00	1 101 456.30	0.08
EUR HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV-REG-S 1.00000% 21-13.04.28	750 000.00	547 668.00	0.04
EUR INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALI SPA-REG-S 1.62500% 20-21.10.28	2 760 000.00	2 411 875.68	0.18
EUR LOXAM SAS-REG-S 6.37500% 23-15.05.28	7 790 000.00	7 624 462.50	0.58
EUR MAHLE GMBH-REG-S 2.37500% 21-14.05.28	4 100 000.00	3 136 270.40	0.24
EUR NASSA TOPCO AS-REG-S 2.87500% 17-06.04.24	5 754 000.00	5 659 634.40	0.43
EUR NATIONAL BANK OF GREECE SA-REG-S 7.25000% 22-22.11.27	3 320 000.00	3 468 457.12	0.26
EUR PPF TELECOM GROUP BV-REG-S 3.25000% 20-29.09.27	2 750 000.00	2 564 375.00	0.19
EUR RENAULT SA-REG-S 2.37500% 20-25.05.26	13 700 000.00	12 672 500.00	0.96
EUR ROLLS-ROYCE PLC-REG-S 1.62500% 18-09.05.28	3 700 000.00	3 145 000.00	0.24
EUR SHAEFFLER AG-REG-S 3.37500% 20-12.10.28	5 000 000.00	4 511 200.00	0.34
EUR TELECOM ITALIA SPA-REG-S 2.37500% 17-12.10.27	8 840 000.00	7 677 982.00	0.58
EUR TELECOM ITALIA SPA-REG-S 2.87500% 18-28.01.26	12 490 000.00	11 615 700.00	0.88
EUR TELECOM ITALIA SPA/MILANO-REG-S 1.62500% 21-18.01.29	2 770 000.00	2 163 979.40	0.16
EUR VALEO SA-REG-S 5.37500% 22-28.05.27	3 100 000.00	3 097 247.20	0.23
EUR ZF EUROPE FINANCE BV-REG-S 6.12500% 23-13.03.29	4 000 000.00	3 996 000.00	0.30
EUR ZF FINANCE GMBH-REG-S 3.75000% 20-21.09.28	6 400 000.00	5 741 363.20	0.43
EUR ZF FINANCE GMBH-REG-S 2.75000% 20-25.05.27	5 700 000.00	5 080 125.00	0.38
Total EUR		124 425 905.71	9.38
GBP			
GBP FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.74800% 20-14.06.24	5 110 000.00	5 691 805.94	0.43
Total GBP		5 691 805.94	0.43
固定利付ミディアム・ターム・ノート合計		130 117 711.65	9.81

注記は、財務書類と不可分のものである。

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 (%)
変動利付メディアム・ターム・ノート			
EUR			
EUR	ALPHA BANK AE-REG-S-SUB 4.250%/VAR 20-13.02.30	1 140 000.00	0.08
EUR	ALPHA BANK SA-REG-S 7.500%/VAR 22-16.06.27	3 550 000.00	0.28
EUR	BANCA MONT DEI PAS DI SIENA-REG-S-SUB 5.375%/VAR 18-18.01.28	1 490 000.00	0.10
EUR	BANCO BPM SPA-REG-S 6.000%/VAR 22-21.01.28	2 215 000.00	0.17
EUR	BANCO BPM SPA-REG-S-SUB 3.250%/VAR 20-14.01.2031	3 480 000.00	0.24
EUR	BANCO COMERCIAL PORTUGUES SA +656.50BP 22-25.10.25	5 500 000.00	0.43
EUR	BANCO COMERCIAL PORTUGUES SA-SUB 8.750%/VAR 22-05.03.33	1 500 000.00	0.11
EUR	BANCO COMERCIAL PORTUGUES-REG-S-SUB 3.871%/VAR 19-27.03.30	2 600 000.00	0.18
EUR	BANCO DE CREDITO SOC COOP-REG-S-SUB 5.250%/VAR 21-27.11.31	3 600 000.00	0.23
EUR	BANCO DE CREDITO SOCIAL CO SA-REG-S 7.500%/VAR 23-14.09.29	4 900 000.00	0.36
EUR	BANCO DE SABADELL SA-REG-S 5.500%/VAR 23-08.09.29	4 200 000.00	0.31
EUR	BANCO SANTANDER SA-REG-S-SUB 5.750%/VAR 23-23.08.33	3 600 000.00	0.27
EUR	BANK OF CYPRUS PCL-REG-S 7.375%/VAR 23-25.07.28	3 195 000.00	0.24
EUR	BANK OF IRELAND GROUP PLC-REG-S-SUB 6.750%/VAR 22-01.03.33	2 105 000.00	0.16
EUR	BARCLAYS BANK PLC-SUB 4.750%/3M EURIBOR+71BP 05-PRP	4 930 000.00	0.33
EUR	CAIXABANK SA-REG-S-SUB 6.125%/VAR 23-30.05.34	2 800 000.00	0.21
EUR	COMMERZBANK AG-REG-S-SUB 4.000%/VAR 20-05.12.30	3 000 000.00	0.22
EUR	DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG-REG-S-SUB 2.875%/VAR 17-28.06.27	1 700 000.00	0.10
EUR	EDP - ENERGIAS DE PORT SA-REG-S-SUB 5.943%/VAR 23-23.04.83	8 300 000.00	0.62
EUR	ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 5.000%/VAR 14-PRP	6 100 000.00	0.44
EUR	ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 7.500%/VAR 22-PRP	3 200 000.00	0.25
EUR	ENEL SPA-REG-S-SUB 6.375%/VAR 23-PRP	3 740 000.00	0.29
EUR	ICCREA BANCA SPA-REG-S 6.875%/VAR 23-20.01.28	3 310 000.00	0.25
EUR	NATIONAL BANK OF GREECE SA-REG-S-SUB 8.000%/VAR 23-03.01.34	1 675 000.00	0.13
EUR	PIRAEUS BANK S.A-REG-S 8.250%/VAR 22-28.01.27	4 410 000.00	0.35
EUR	PIRAEUS GROUP FINANCE PLC-REG-S-SUB 9.750%/VAR 19-26.06.29	5 515 000.00	0.42
EUR	UNICAJA BANCO SA-REG-S 6.500%/VAR 23-11.09.28	3 100 000.00	0.23
EUR	UNICREDIT SPA-REG-S-SUB 4.450%/VAR 21-PRP	2 500 000.00	0.14
EUR	VODAFONE GROUP PLC-REG-S-SUB 6.500%/VAR 23-30.08.84	3 820 000.00	0.29
Total EUR		98 604 858.41	7.43
変動利付メディアム・ターム・ノート合計		98 604 858.41	7.43
固定利付債券			
EUR			
EUR	888 ACQUISITIONS LTD-REG-S 7.5580% 22-15.07.27	4 920 000.00	0.34
EUR	ADLER FINANCING SARL (PIK) 12.50000% 23-30.06.25	5 900 000.00	0.47
EUR	ALMAVIVA-THE ITALIAN INNOVATION-REG-S 4.87500% 21-30.10.26	6 550 000.00	0.48
EUR	ALTICE FINANCING SA-REG-S 2.25000% 20-15.01.25	2 830 000.00	0.21
EUR	ALTICE FINANCING SA-REG-S 3.00000% 20-15.01.28	8 320 000.00	0.53
EUR	ALTICE FRANCE-REG-S 3.37500% 19-15.01.28	8 190 000.00	0.46
EUR	ALTICE FRANCE-REG-S 2.50000% 19-15.01.25	5 395 000.00	0.38
EUR	BANIJAY ENTERTAINMENT SASU-REG-S 7.00000% 23-01.05.29	3 300 000.00	0.25
EUR	BANIJAY GROUP SAS-REG-S 6.50000% 20-01.03.26	1 650 000.00	0.12
EUR	CAB SELAS-REG-S 3.37500% 21-01.02.28	4 095 000.00	0.26
EUR	CANARY WHARF GROUP INVST HOLG PLC-REG-S 1.75000% 21-07.04.26	3 230 000.00	0.17
EUR	CARNIVAL CORP-REG-S 7.62500% 20-01.03.26	3 890 000.00	0.29
EUR	CASTOR SPA-REG-S 6.00000% 22-15.02.29	4 025 000.00	0.26
EUR	CHEMOURS CO/THE 4.00000% 18-15.05.26	3 650 000.00	0.26

注記は、財務書類と不可分のものである。

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	CHEPLAPHARM ARZNEIMITTEL GMBH-REG-S 4.37500% 20-15.01.28	3 775 000.00	3 435 687.90	0.26
EUR	CHROME BIDCO SASU-REG-S 3.50000% 21-31.05.28	4 220 000.00	3 491 931.84	0.26
EUR	CIDRON AIDA FINCO SARL-REG-S 5.00000% 21-01.04.28	3 940 000.00	3 558 135.20	0.27
EUR	CIRSA FINANCE INTERNATIONAL SARL-REG-S 10.37500% 22-30.11.27	6 820 000.00	7 322 975.00	0.55
EUR	CIRSA FINANCE INTERNATIONAL SARL-REG-S 7.87500% 23-31.07.28	5 660 000.00	5 687 552.88	0.43
EUR	CITYCON TREASURY BV-REG-S 1.25000% 16-08.09.26	1 050 000.00	889 484.40	0.07
EUR	CONTOURGLOBAL POWER HOLDINGS SA-REG-S 2.75000% 20-01.01.26	5 540 000.00	5 095 270.96	0.38
EUR	DRAX FINCO PLC-REG-S 2.62500% 20-01.11.25	3 450 000.00	3 162 891.00	0.24
EUR	DUFY ONE BV-REG-S 3.37500% 21-15.04.28	5 215 000.00	4 659 185.30	0.35
EUR	EP INFRASTRUCTURE AS-REG-S 1.65900% 18-26.04.24	1 030 000.00	1 004 239.70	0.08
EUR	EP INFRASTRUCTURE AS-REG-S 2.04500% 19-09.10.28	3 650 000.00	2 950 295.00	0.22
EUR	EP INFRASTRUCTURE AS-REG-S 1.81600% 21-02.03.31	1 350 000.00	979 411.50	0.07
EUR	FASTIGHETS AB BALDER-REG-S 1.87500% 17-14.03.25	1 369 000.00	1 273 824.38	0.10
EUR	FASTIGHETS AB BALDER-REG-S 1.87500% 17-23.01.26	4 300 000.00	3 774 662.55	0.28
EUR	FAURECIA SE-REG-S 7.25000% 22-15.06.26	2 430 000.00	2 503 726.20	0.19
EUR	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.86700% 23-03.08.27	2 910 000.00	2 868 270.60	0.22
EUR	GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 2.60000% 23-15.08.33	5 620 000.00	5 513 804.48	0.42
EUR	GRIFOLS SA-REG-S 3.20000% 17-01.05.25	12 173 000.00	11 686 080.00	0.88
EUR	GRUENENTHAL GMBH-REG-S 4.12500% 21-15.05.28	2 850 000.00	2 629 267.50	0.20
EUR	GRUENENTHAL GMBH-REG-S 6.75000% 23-15.05.30	2 640 000.00	2 673 000.00	0.20
EUR	GRUPO ANTOLIN-IRAUSA SA-REG-S 3.50000% 21-30.04.28	5 660 000.00	3 869 391.08	0.29
EUR	GRUPO-ANTOLIN IRAUSA SA-REG-S 3.37500% 18-30.04.26	1 450 000.00	1 179 896.90	0.09
EUR	HEIMSTADEN AB-REG-S 4.37500% 21-06.03.27	5 400 000.00	2 583 282.78	0.19
EUR	IHO VERWALTUNGS GMBH-REG-S (PIK) 3.75000% 16-15.09.26	4 930 000.00	4 623 501.90	0.35
EUR	INEOS QUATTRO FINANCE 2 PLC-REG-S 2.50000% 21-15.01.26	1 685 000.00	1 530 940.45	0.12
EUR	INTER MEDIA AND COMMUNICATION-REG-S 6.75000% 22-09.02.27	1 850 000.00	1 769 895.00	0.13
EUR	INTRUM JUSTITIA AB-REG-S 3.12500% 17-15.07.24	5 040 000.00	2 537 706.47	0.19
EUR	IPD 3 BV-REG-S 8.00000% 23-15.06.28	5 700 000.00	5 746 740.00	0.43
EUR	ITALY, REPUBLIC OF-BTP 3.75000% 14-01.09.24	5 000 000.00	4 990 343.05	0.38
EUR	ITALY, REPUBLIC OF-BTP 4.35000% 23-01.11.33	31 010 000.00	30 137 730.87	2.27
EUR	KAPLA HOLDING SAS-REG-S 3.37500% 19-15.12.26	5 140 000.00	4 594 903.00	0.35
EUR	LHMC FINCO 2 SARL-REG-S (PIK) 7.25000% 19-02.10.25	12 279 743.00	11 988 099.10	0.90
EUR	LORCA TELECOM BONDCO SAU-REG-S 4.00000% 20-18.09.27	9 410 000.00	8 732 762.30	0.66
EUR	LOTTOMATICA SPA/ROMA-REG-S 7.12500% 23-01.06.28	5 680 000.00	5 793 600.00	0.44
EUR	LOXAM SAS-REG-S 6.00000% 17-15.04.25	4 655 000.00	2 300 050.67	0.17
EUR	MARCOLIN SPA-REG-S 6.12500% 21-15.11.26	7 304 000.00	6 840 882.57	0.52
EUR	MONICHEM HOLDCO 3 SA-REG-S 8.75000% 23-01.05.28	3 530 000.00	3 445 703.60	0.26
EUR	MOTION FINCO SARL-REG-S 7.37500% 23-15.06.30	6 540 000.00	6 414 889.80	0.48
EUR	NIDDA BONDCO GMBH-REG-S 7.25000% 18-30.09.25	11 817 000.00	7 984 897.00	0.60
EUR	NOVAFIVES SAS-REG-S 5.00000% 18-15.06.25	3 370 000.00	3 262 160.00	0.25
EUR	PARTS EUROPE SA-REG-S 6.50000% 20-16.07.25	14 275 000.00	14 239 312.50	1.07
EUR	PHM GROUP HOLDING OY-144A-REG-S 4.75000% 21-18.06.26	754 000.00	684 255.00	0.05
EUR	PICARD GROUPE SAS-REG-S 3.87500% 21-01.07.26	2 190 000.00	2 025 969.00	0.15
EUR	PINNACLE BIDCO PLC-REG-S 5.50000% 20-15.02.25	14 780 000.00	14 946 127.20	1.13
EUR	PLT VII FINANCE SARL-REG-S 4.62500% 20-05.01.26	7 230 000.00	6 985 987.50	0.53
EUR	ROSSINI SARL-REG-S 6.75000% 18-30.10.25	16 080 000.00	16 071 960.00	1.21
EUR	SIGMA HOLDCO BV-REG-S 5.75000% 18-15.05.26	4 340 000.00	3 613 050.00	0.27
EUR	SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 5.25000% 15-30.07.27	1 260 000.00	1 191 109.50	0.09
EUR	SUMMER BC HOLDCO B SARL-REG-S 5.75000% 19-31.10.26	9 755 000.00	8 938 018.75	0.67
EUR	SUMMER BIDCO BV-REG-S (PIK) 9.00000% 19-15.11.25	4 559 000.00	5 332 997.78	0.40
EUR	SUMMER BIDCO BV-REG-S (PIK) 9.00000% 20-15.11.25	9 195 000.00	10 482 066.00	0.79
EUR	SUPERIOR INDUSTRIES INTERNATIONAL-REG-S 6.00000% 17-15.06.25	4 234 000.00	3 808 161.22	0.29
EUR	TEREOS FINANCE GROUPE I SA-REG-S 7.50000% 20-30.10.25	2 860 000.00	2 903 014.40	0.22
EUR	TRIVIUM PACKAGING FINANCE BV-REG-S 3.75000% 19-15.08.28	10 394 000.00	9 599 378.70	0.72
EUR	UNITED GROUP BV-REG-S 4.62500% 21-15.08.28	1 420 000.00	1 207 000.00	0.09
EUR	UNITED GROUP BV-REG-S 4.00000% 20-15.11.27	4 000 000.00	3 480 000.00	0.26
EUR	UNITED GROUP BV-REG-S 3.12500% 20-15.02.26	1 120 000.00	1 022 000.00	0.08
EUR	UNITED GROUP BV-REG-S 5.25000% 22-01.02.30	2 420 000.00	1 987 158.80	0.15
EUR	VALLOUREC SA-REG-S 8.50000% 21-30.06.26	9 970 000.00	9 970 000.00	0.75
EUR	VERISURE HOLDING AB-REG-S 3.87500% 20-15.07.26	5 190 000.00	4 878 600.00	0.37

注記は、財務書類と不可分のものである。

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 VERTICAL MIDCO GMBH-REG-S 4.37500% 20-15.07.27	2 520 000.00	2 279 844.00	0.17
EUR VIA CELERE DESARROLLOS INMOB-REG-S 5.25000% 21-01.04.26	2 650 000.00	2 488 615.00	0.19
EUR VZ VENDOR FINANCING II BV-REG-S 2.87500% 20-15.01.29	1 590 000.00	1 224 271.38	0.09
EUR WP/AP TELECOM HOLDINGS IV BV-REG-S 3.75000% 21-15.01.29	1 571 000.00	1 351 060.00	0.10
EUR ZIGGO BV-REG-S 2.87500% 19-15.01.30	4 540 000.00	3 671 952.00	0.28
EUR ZONCOLAN BIDCO SPA-REG-S 4.87500% 21-21.10.28	2 690 000.00	1 775 400.00	0.13
Total EUR		390 931 372.51	29.47
GBP			
GBP BELLIS ACQUISITION CO PLC-REG-S 4.50000% 21-16.02.26	7 615 000.00	7 779 436.18	0.59
GBP CIDRON AIDA FINCO SARL-REG-S 6.25000% 21-01.04.28	3 815 000.00	3 872 056.28	0.29
GBP GALAXY BIDCO LTD-REG-S 6.50000% 19-31.07.26	3 870 000.00	4 126 813.56	0.31
GBP GALAXY FINCO LTD-REG-S 9.25000% 19-31.07.27	10 010 000.00	10 194 137.27	0.77
GBP GARFUNKELUX HOLDCO 3 SA-REG-S 7.75000% 20-01.11.25	1 225 000.00	1 063 979.06	0.08
GBP ICELAND BONDCO PLC-REG-S 4.62500% 17-15.03.25	4 855 000.00	5 504 543.84	0.42
GBP ICELAND BONDCO PLC-REG-S 10.87500% 23-15.12.27	3 660 000.00	4 307 125.81	0.32
GBP JERROLD FINCO PLC-REG-S 4.87500% 20-15.01.26	4 870 000.00	5 240 389.44	0.40
GBP JERROLD FINCO PLC-REG-S 5.25000% 21-15.01.27	8 775 000.00	8 950 140.40	0.67
GBP MAISON FINCO PLC-REG-S 6.00000% 21-31.10.27	7 325 000.00	6 751 313.09	0.51
GBP TVL FINANCE PLC-REG-S 10.25000% 23-28.04.28	4 400 000.00	5 087 632.83	0.38
GBP VERY GROUP FUNDING PLC/THE-REG-S 6.50000% 21-01.08.26	7 098 000.00	6 800 338.42	0.51
GBP VIRGIN MEDIA VENDOR FINANCING-REG-S 4.87500% 20-15.07.28	4 675 000.00	4 473 236.49	0.34
Total GBP		74 151 142.67	5.59
USD			
USD TELECOM ITALIA CAPITAL 6.00000% 05-30.09.34	8 522 000.00	6 711 200.36	0.51
Total USD		6 711 200.36	0.51
固定利付債券合計		471 793 715.54	35.57
変動利付債券			
EUR			
EUR 888 ACQUISITIONS LTD-REG-S 3M EURIBOR+550BP 22-15.07.28	3 730 000.00	3 565 880.00	0.27
EUR BANCO BPM SPA-REG-S-SUB 4.250%/VAR 19-01.10.29	4 540 000.00	4 443 824.64	0.33
EUR BANCO DE CREDITO SOCIAL-REG-S 8.000%/VAR 22-22.09.26	2 600 000.00	2 646 924.80	0.20
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 5.000%/VAR 21-PRP	2 200 000.00	1 663 750.00	0.12
EUR BANCO SANTANDER SA-REG-S-SUB 4.375%/VAR 20-PRP	1 400 000.00	1 162 616.00	0.09
EUR BAYER AG-REG-S-SUB 2.375%/VAR 19-12.11.79	4 500 000.00	4 245 300.00	0.32
EUR CASTOR SPA-REG-S 3M EURIBOR+525BP 22-15.02.29	3 338 000.00	3 163 115.50	0.24
EUR CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S-SUB 4.875%/VAR 19-PRP	2 550 000.00	875 338.50	0.07
EUR ENBW ENERGIE BADEN-WUERTTEM-REG-S-SUB 2.125%/VAR 21-31.08.81	3 400 000.00	2 388 296.00	0.18
EUR ENEL SPA-REG-S-SUB 3.375%/VAR 18-PRP	4 310 000.00	3 985 893.38	0.30
EUR GOLDEN GOOSE SPA-REG-S 3M EURIBOR+487.5BP 21-14.05.27	11 585 000.00	11 563 567.75	0.87
EUR HEIMSTADEN BOSTAD AB-REG-S-SUB 2.625%/VAR 21-PRP	2 400 000.00	1 038 000.00	0.08
EUR KAPLA HOLDING SAS-REG-S 3M EURIBOR+550BP 23-15.07.27	1 245 000.00	1 266 055.44	0.10
EUR LEASEPLAN CORPORATION NV-REG-S-SUB 7.375%/VAR 19-PRP	6 880 000.00	6 802 737.60	0.51
EUR LIBERTY MUTUAL GROUP INC-REG-S-SUB 3.625%/VAR 19-23.05.59	4 460 000.00	4 237 713.60	0.32
EUR ROSSINI SARL-REG-S 3M EURIBOR+387.5BP 19-30.10.25	2 100 000.00	2 094 750.00	0.16
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 3.875%/VAR 18-PRP	7 000 000.00	6 492 500.00	0.49
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 4.375%/VAR 19-PRP	4 500 000.00	4 401 288.00	0.33
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 3M EURIBOR+487.5BP 22-01.02.29	2 990 000.00	2 950 292.80	0.22
EUR VODAFONE GROUP PLC-REG-S-SUB 4.200%/VAR 18-03.10.78	1 045 000.00	961 400.00	0.07
Total EUR		69 949 244.01	5.27
USD			
USD SOCIETE GENERALE SA-SUB-144A 7.875%/VAR 13-PRP	2 630 000.00	2 463 557.20	0.19
Total USD		2 463 557.20	0.19
変動利付債券合計		72 412 801.21	5.46

注記は、財務書類と不可分のものである。

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 (%)
変動利付転換社債			
EUR			
EUR	BANK OF IRELAND GROUP PLC-REG-S-SUB COCO 7.500%/VAR 20-PRP 1 980 000.00	1 941 390.00	0.15
EUR	BANK OF IRELAND GROUP PLC-REG-S-SUB COCO 6.000%/VAR 20-PRP 1 580 000.00	1 497 998.00	0.11
Total EUR		3 439 388.00	0.26
変動利付転換社債合計		3 439 388.00	0.26
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		1 249 281 853.88	94.19
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			
USD			
USD	CSC HOLDINGS LLC-144A 5.25000% 14-01.06.24 3 880 000.00	3 486 019.95	0.26
Total USD		3 486 019.95	0.26
固定利付ノート合計		3 486 019.95	0.26
変動利付ミディアム・ターム・ノート			
USD			
USD	INTESA SANPAOLO SPA-144A-SUB 7.700%/VAR 15-PRP 1 615 000.00	1 430 133.87	0.11
Total USD		1 430 133.87	0.11
変動利付ミディアム・ターム・ノート合計		1 430 133.87	0.11
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		4 916 153.82	0.37
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			
EUR			
EUR	PINNACLE BIDCO PLC-REG-S 8.25000% 23-11.10.28 5 545 000.00	5 524 594.40	0.42
Total EUR		5 524 594.40	0.42
GBP			
GBP	GTCR W-2 MERGER SUB LLC / GTCR-REG-S 8.50000% 23-15.01.31 2 910 000.00	3 425 998.83	0.26
GBP	PINNACLE BIDCO PLC-REG-S 10.00000% 23-11.10.28 8 500 000.00	9 778 432.26	0.73
Total GBP		13 204 431.09	0.99
固定利付債券合計		18 729 025.49	1.41
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		18 729 025.49	1.41
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 10.85	108 500.00	0.01
アイルランド合計		108 500.00	0.01
投資信託、オープン・エンド型合計		108 500.00	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

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 / その他の投資信託合計		108 500.00	0.01

投資有価証券合計	1 273 035 533.19	95.98
----------	------------------	-------

派生商品

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

クレジット・デフォルト・スワップ *

EUR	CITI/ALGSCO CREDIT DEFAULT SWAP REC 5.00000%	22-20.12.26	2 000 000.00	226 100.80	0.02
EUR	CITI/ALGSCO CREDIT DEFAULT SWAP REC 5.00000%	21-20.12.26	3 000 000.00	339 151.20	0.03
EUR	JPMORGAN/UNITED GROUP BV CREDIT DEFAULT SWAP REC 5.00000%	22-20.12.27	4 500 000.00	-127 611.00	-0.01
EUR	JPMORGAN/UNITED GROUP BV CREDIT DEFAULT SWAP REC 5.00000%	22-20.12.25	5 000 000.00	185 779.50	0.01
クレジット・デフォルト・スワップ合計				623 420.50	0.05

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	623 420.50	0.05
--------	------------	------

派生商品合計	623 420.50	0.05
--------	------------	------

為替予約契約

購入通貨 / 購入額 / 売却通貨 / 売却額 / 満期日

GBP	13 433 300.00	EUR	15 540 228.66	20.10.2023	-64 573.97	0.00
HKD	86 600 400.00	EUR	10 356 479.75	20.10.2023	83 348.23	0.01
SGD	38 227 600.00	EUR	26 222 706.15	20.10.2023	232 279.49	0.02
EUR	106 701 479.95	GBP	92 235 000.00	20.10.2023	443 374.30	0.03
JPY	9 070 131 600.00	EUR	57 666 417.02	20.10.2023	-110 094.58	-0.01
CAD	20 887 200.00	EUR	14 514 030.95	20.10.2023	70 082.20	0.01
AUD	56 777 700.00	EUR	34 267 712.53	20.10.2023	340 475.95	0.02
CHF	31 011 900.00	EUR	32 419 201.32	20.10.2023	-359 768.83	-0.04
CNH	75 259 800.00	EUR	9 636 486.09	20.10.2023	118 273.37	0.01
EUR	45 512 055.04	USD	48 670 000.00	20.10.2023	-420 487.29	-0.03
USD	288 446 300.00	EUR	269 730 509.16	20.10.2023	2 492 048.55	0.19
JPY	166 908 100.00	EUR	1 060 505.55	20.10.2023	-1 357.03	0.00
EUR	3 334 402.53	USD	3 550 000.00	20.10.2023	-15 926.73	0.00
EUR	2 707 504.28	GBP	2 350 000.00	20.10.2023	218.02	0.00
EUR	3 296 886.09	GBP	2 870 000.00	20.10.2023	-9 459.26	0.00
JPY	104 799 800.00	EUR	665 210.31	20.10.2023	-182.35	0.00
EUR	365 216.22	AUD	602 700.00	20.10.2023	-2 152.57	0.00
JPY	126 552 200.00	EUR	808 024.66	20.10.2023	-4 962.53	0.00
為替予約契約合計					2 791 134.97	0.21

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

49 278 813.72	**
---------------	----

当座借越およびその他の短期負債

-7.67	0.00
-------	------

その他の資産および負債

654 906.50	0.04
------------	------

純資産合計

1 326 383 801.21	100.00
------------------	--------

* 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。

** 2023年9月30日現在、130,000.00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 - オーストラリア・ドル

最も重要な数字

	ISIN	30.9.2023	31.3.2023	31.3.2022
純資産額、オーストラリア・ドル		313,393,495.66	330,529,881.20	381,371,627.11
クラス P - a c c 受益証券	LU0035338325			
発行済受益証券		212,473.4680	290,447.5070	324,657.2900
受益証券1口当たりの純資産価格、オーストラリア・ドル		499.44	517.55	518.32
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		498.99	517.55	518.32
クラス P - d i s t 受益証券	LU0035338242			
発行済受益証券		502,221.4190	537,911.5800	620,597.6220
受益証券1口当たりの純資産価格、オーストラリア・ドル		101.58	107.32	109.36
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		101.49	107.32	109.36

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	78.25	公益、非営利団体	24.17
国際機関	6.07	金融および持株会社	20.71
アメリカ合衆国	2.87	国債および中央政府債	14.85
イギリス	2.22	銀行およびその他の金融機関	14.70
カナダ	2.03	国際機関	5.09
韓国	1.97	その他の非分類会社	4.20
スウェーデン	1.44	地方債	3.00
スイス	0.81	通信	2.07
ノルウェー	0.80	ヘルスケアおよび社会福祉	1.77
シンガポール	0.60	石油	1.19
ドイツ	0.44	交通および運輸	0.97
ニュージーランド	0.25	エネルギーおよび水道	0.97
合計	97.75	化学	0.71
		宿泊、ケータリングおよび娯楽施設	0.63
		保険	0.50
		電気機器および部品	0.50
		コンピューター・ハードウェアおよびネットワーク設備	0.47
		モーゲージおよび貸付機関	0.47
		小売業および百貨店	0.42
		市および地方自治体	0.36
		合計	97.75

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	30.9.2023	31.3.2023	31.3.2022
純資産額、ユーロ		105,861,257.84	117,400,339.60	177,740,627.69
クラスP - a c c 受益証券	LU0033050237			
発行済受益証券		208,936.4030	225,679.4660	252,566.4880
受益証券1口当たりの純資産価格、ユーロ		347.77	357.65	410.37
受益証券1口当たり発行および買戻価格、ユーロ ¹		347.77	357.65	410.37
クラスP - d i s t 受益証券	LU0033049577			
発行済受益証券		270,464.9370	275,962.6880	290,830.4380
受益証券1口当たりの純資産価格、ユーロ		106.75	111.34	130.35
受益証券1口当たり発行および買戻価格、ユーロ ¹		106.75	111.34	130.35

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%
アメリカ合衆国	13.75	国債および中央政府債	42.02
ニュージーランド	8.92	銀行およびその他の金融機関	14.97
フランス	8.88	金融および持株会社	9.68
ドイツ	7.68	国際機関	5.01
スペイン	6.85	モーゲージおよび貸付機関	2.35
オランダ	6.40	タバコおよびアルコール飲料	2.22
イタリア	5.39	エネルギーおよび水道	2.19
ルクセンブルグ	4.32	通信	1.92
イギリス	3.93	公益、非営利団体	1.59
国際機関	3.91	投資信託	1.57
ベルギー	3.00	保険	1.20
スロベニア	1.88	不動産	1.16
オーストラリア	1.81	コンピューター・ハードウェアおよびネットワーク設備	1.11
オーストリア	1.64	石油	1.01
ポルトガル	1.35	交通および運輸	0.99
スイス	1.35	その他の非分類会社	0.69
ギリシャ	0.99	各種サービス	0.69
スロバキア	0.93	化学	0.59
トルコ	0.76	インターネット、ソフトウェアおよびITサービス	0.58
ルーマニア	0.70	繊維、衣類および革製品	0.27
カザフスタン	0.68	建築業および資材	0.27
ブラジル	0.66	小売業および百貨店	0.18
ケイマン諸島	0.64	医薬品、化粧品および医療製品	0.14
日本	0.63	機械工学および産業機器	0.09
ペルー	0.59	航空宇宙産業	0.04
ノルウェー	0.57	合計	92.53
アイルランド	0.55		
チリ	0.51		
ポーランド	0.50		
フィリピン	0.42		
エジプト	0.38		
フィンランド	0.35		
インドネシア	0.29		
中国	0.27		
アルゼンチン	0.17		
コロンビア	0.14		
バミューダ	0.14		
エクアドル	0.13		
メキシコ	0.13		
ロシア連邦(CIS)	0.12		
スウェーデン	0.12		
デンマーク	0.10		
合計	92.53		

UBS(Lux) ボンド・ファンド - アジア・フレキシブル(米ドル)

最も重要な数字

	ISIN	30.9.2023	31.3.2023	31.3.2022
純資産額、米ドル		383,944,397.51	412,455,055.75	611,977,496.21
クラスP - a c c 受益証券	LU0464244333			
発行済受益証券		200,424.9590	221,542.4260	249,429.2450
受益証券1口当たりの純資産価格、米ドル		131.55	136.44	144.49
受益証券1口当たり発行および買戻価格、米ドル ²		131.55	136.44	144.49

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%
香港	13.73	金融および持株会社	29.33
韓国	13.25	銀行およびその他の金融機関	20.34
英領ヴァージン諸島	9.63	国債および中央政府債	9.85
インドネシア	7.47	投資信託	8.68
シンガポール	7.06	石油	3.66
ケイマン諸島	6.70	エネルギーおよび水道	3.34
インド	5.91	不動産	2.33
ルクセンブルグ	5.06	インターネット、ソフトウェアおよびITサービス	2.01
中国	4.65	その他の非分類会社	1.94
イギリス	3.82	通信	1.73
フィリピン	3.61	各種貿易会社	1.58
オーストラリア	3.23	化学	1.38
アメリカ合衆国	2.74	各種サービス	1.27
マレーシア	2.68	公益、非営利団体	1.26
タイ	2.67	宿泊、ケータリングおよび娯楽施設	1.17
日本	1.93	グラフィック・デザイン、出版およびメディア	1.11
オランダ	0.65	電子および半導体	1.06
モーリシャス	0.54	市および地方自治体	1.02
スリランカ	0.53	鉱業、石炭採掘および鉄鋼業	1.00
ベトナム	0.47	電気機器および部品	0.93
マカオ	0.47	建築業および資材	0.74
パキスタン	0.45	交通および運輸	0.70
カナダ	0.25	保険	0.55
モンゴル国	0.21	モーゲージおよび貸付機関	0.49
ジャージー島	0.13	食品および清涼飲料	0.36
チリ	0.10	コンピューター・ハードウェアおよびネットワーク設備	0.13
パミューダ	0.06	機械工学および産業機器	0.04
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	30.9.2023	31.3.2023	31.3.2022
純資産額、ユーロ		1,326,383,801.21	1,148,200,385.80	1,431,122,028.59
クラス P - a c c 受益証券	LU0086177085			
発行済受益証券		721,807.7710	691,314.2040	795,564.4730
受益証券 1 口当たりの純資産価格、ユーロ		218.34	210.32	218.27
受益証券 1 口当たり発行および買戻価格、ユーロ ²		218.34	210.32	218.27
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		246,984.4020	173,109.9180	311,545.3350
受益証券 1 口当たりの純資産価格、米ドル		148.25	141.59	143.32
受益証券 1 口当たり発行および買戻価格、米ドル ²		148.25	141.59	143.32
クラス P - m d i s t 受益証券	LU0417441200			
発行済受益証券		682,349.0350	674,816.5100	793,035.7560
受益証券 1 口当たりの純資産価格、ユーロ		112.68	111.29	121.09
受益証券 1 口当たり発行および買戻価格、ユーロ ²		112.68	111.29	121.09
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		1,899,289.8760	1,981,242.5690	2,485,152.6710
受益証券 1 口当たりの純資産価格、米ドル		80.57	79.93	86.36
受益証券 1 口当たり発行および買戻価格、米ドル ²		80.57	79.93	86.36

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%
フランス	14.33	金融および持株会社	39.03
イギリス	13.76	銀行およびその他の金融機関	12.02
ルクセンブルグ	11.49	通信	8.45
イタリア	10.91	エネルギーおよび水道	3.86
オランダ	10.81	自動車	3.43
ドイツ	9.59	国債および中央政府債	3.06
スペイン	7.46	各種サービス	2.87
アメリカ合衆国	3.42	ヘルスケアおよび社会福祉	2.68
スウェーデン	2.43	インターネット、ソフトウェアおよび IT サービス	2.42
ギリシャ	1.85	不動産	2.30
ポルトガル	1.68	化学	1.98
アイルランド	1.22	交通および運輸	1.90
イスラエル	1.18	医薬品、化粧品および医療製品	1.64
日本	1.17	バイオテクノロジー	1.29
ベルギー	0.98	各種貿易会社	1.07
チェコ共和国	0.72	宿泊、ケータリングおよび娯楽施設	1.02
ジャージー島	0.62	その他の非分類会社	0.90
ジブラルタル	0.61	航空宇宙産業	0.90
多国籍企業	0.46	繊維、衣類および革製品	0.87
ノルウェー	0.43	機械工学および産業機器	0.75
フィンランド	0.33	石油	0.64
パナマ	0.29	包装業	0.62
キプロス	0.24	写真・光学	0.52
合計	95.98	保険	0.32
		各種消費財	0.28
		食品および清涼飲料	0.27
		公益、非営利団体	0.26
		グラフィック・デザイン、出版およびメディア	0.25
		農業および漁業	0.22
		小売業および百貨店	0.15
		投資信託	0.01
		合計	95.98

[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20億円）は、1株2,000ユーロ（315,200円）の株式6,500株によって表章される。2023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21億円）は、1株2,000ユーロ（317,320円）の株式6,500株によって表章される。2023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、2023年6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	407	469,731,678.29オーストラリア・ドル
			1,907,396,286.05カナダ・ドル
			15,271,847,618.99スイス・フラン
			3,728,761,049.91中国元
			480,590,298.93デンマーク・クローネ
			52,056,290,600.71ユーロ
			2,248,741,605.20英ポンド
			284,273,674.10香港ドル
			653,023,377,293.85日本円
			21,641,721.64シンガポール・ドル
			118,990,773,041.01米ドル

<訂正後>

(前略)

管理会社は、2023年10月末日現在、以下のとおり、405本の投資信託/投資法人のサブ・ファンドの管理・運用を行っている。

国別(設立国)	種別(基本的性格)	本数	純資産額の合計(通貨別)
ルクセンブルグ	オープン・エンド型 投資信託/投資法人	405	487,401,038.73オーストラリア・ドル
			1,709,654,095.59カナダ・ドル
			14,312,691,372.61スイス・フラン
			2,397,233,315.38中国元
			482,630,487.74デンマーク・クローネ
			48,754,517,781.31ユーロ
			2,268,788,827.64英ポンド
			270,627,268.02香港ドル
			518,176,687,073.39日本円
			18,999,447.25シンガポール・ドル
108,490,789,496.70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、2023年10月31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=158.66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

2023年6月30日現在

	2023年6月30日		2022年12月31日	
	ユーロ	千円	ユーロ	千円
A．未払込資本	0.00	0	0.00	0
B．創業費	0.00	0	0.00	0
C．固定資産	23,719,883.42	3,763,397	5,842.90	927
．無形資産	23,684,084.79	3,757,717	0.00	0
1．開発費	0.00	0	0.00	0
2．譲許、特許、認可、登録商標 ならびに類似する権利および資産	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	23,684,084.79	3,757,717	0.00	
．有形資産	29,955.73	4,753	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	29,955.73	4,753	0.00	0
．金融資産	5,842.90	927	5,842.90	927
1．関連会社持分	0.00	0	0.00	0
2．関連会社に対する債権	0.00	0	0.00	0
3．参加持分	0.00	0	0.00	0
4．参加持分に連動する 関連会社に対する債権	0.00	0	0.00	0
5．固定資産として保有の投資	0.00	0	0.00	0
6．その他の債権	5,842.90	927	5,842.90	927
D．流動資産	131,397,102.96	20,847,464	178,126,824.65	28,261,602
．棚卸資産	0.00	0	0.00	0
．債権	91,782,613.07	14,562,229	98,222,861.95	15,584,039
1．売掛金	78,256,285.46	12,416,142	91,825,282.30	14,568,999
a) 1年以内に期限到来	78,256,285.46	12,416,142	91,825,282.30	14,568,999
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	10,533,971.23	1,671,320	6,397,579.65	1,015,040
a) 1年以内に期限到来	10,533,971.23	1,671,320	6,397,579.65	1,015,040
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	2,992,356.38	474,767	0.00	0
a) 1年以内に期限到来	0.00	0	0.00	0
b) 1年を超えて期限到来	2,992,356.38	474,767	0.00	0
．投資	150,782.39	23,923	140,722.53	22,327
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	150,782.39	23,923	140,722.53	22,327
．銀行預金および手元現金	39,463,707.50	6,261,312	79,763,240.17	12,655,236
E．前払金	1,615,348.77	256,291	1,389,523.17	220,462
資産合計	156,732,335.15	24,867,152	179,522,190.72	28,482,991

	2023年6月30日		2022年12月31日	
	ユーロ	千円	ユーロ	千円
A. 資本金および準備金	57,893,751.09	9,185,423	54,692,758.30	8,677,553
・ 払込資本金	13,738,000.00	2,179,671	13,000,000.00	2,062,580
・ 資本剰余金	22,636,000.00	3,591,428	0.00	0
・ 再評価積立金	0.00	0	0.00	0
・ 準備金	8,668,625.00	1,375,364	8,617,625.00	1,367,272
1. 法定準備金	1,300,000.00	206,258	1,300,000.00	206,258
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	7,368,625.00	1,169,106	7,317,625.00	1,161,014
a) その他の分配可能準備金	150,000.00	23,799	150,000.00	23,799
b) その他の分配不能準備金	7,218,625.00	1,145,307	7,167,625.00	1,137,215
・ 繰越損益	24,133.30	3,829	66,743.77	10,590
・ 当期損益	12,826,992.79	2,035,131	33,008,389.53	5,237,111
・ 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	904,994.05	143,586	13,824,568.12	2,193,406
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	904,994.05	143,586	13,824,568.12	2,193,406
3. その他の引当金	0.00	0	0.00	0
C. 債務	97,933,590.01	15,538,143	111,004,864.30	17,612,032
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	74,559,496.50	11,829,610	82,579,547.05	13,102,071
a) 1年以内に期限到来	74,559,496.50	11,829,610	82,579,547.05	13,102,071
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	23,374,093.51	3,708,534	28,425,317.25	4,509,961
a) 税金債務	1,512,155.26	239,919	1,373,718.13	217,954
b) 社会保障債務	386,851.54	61,378	280,546.94	44,512
c) その他の債務	21,475,086.71	3,407,237	26,771,052.18	4,247,495
) 1年以内に期限到来	21,475,086.71	3,407,237	26,771,052.18	4,247,495
) 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	156,732,335.15	24,867,152	179,522,190.72	28,482,991

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

2023年6月30日に終了した期間および2022年12月31日に終了した年度

	2023年1月1日から 2023年6月30日まで		2022年1月1日から 2022年12月31日まで	
	ユーロ	千円	ユーロ	千円
1. 純取引高	401,198,813.64	63,654,204	930,589,584.41	147,647,343
4. その他の営業収益	4,145,360.29	657,703	3,884,289.68	616,281
5. 原材料および消耗品ならびに その他の外部費用	366,607,287.38	58,165,912	854,401,326.56	135,559,314
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	366,607,287.38	58,165,912	854,401,326.56	135,559,314
6. 人件費	8,663,469.11	1,374,546	12,560,559.82	1,992,858
a) 賃金および給与	7,406,118.91	1,175,055	10,908,572.79	1,730,754
b) 社会保障費	1,081,561.06	171,600	1,535,110.66	243,561
) 年金に関連するもの	726,099.60	115,203	1,100,619.59	174,624
) その他の社会保障費	355,461.46	56,398	434,491.07	68,936
c) その他の人件費	175,789.14	27,891	116,876.37	18,544
7. 評価額調整	834,996.69	132,481	0.00	0
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	834,996.69	132,481	0.00	0
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	13,430,672.13	2,130,910	23,485,724.50	3,726,245
11. その他の受取利息および類似収益	698,056.79	110,754	242,755.95	38,516
a) 関連会社に関連するもの	634,350.47	100,646	210,075.90	33,331
b) その他の受取利息および類似収益	63,706.32	10,108	32,680.05	5,185
14. 支払利息および類似費用	3,087.64	490	267,667.61	42,468
a) 関連会社に関連するもの	0.00	0	202,310.82	32,099
b) その他の支払利息および類似費用	3,087.64	490	65,356.79	10,370
15. 損益にかかる税金	3,675,724.98	583,191	10,992,962.02	1,744,143
16. 税引後損益	12,826,992.79	2,035,131	33,008,389.53	5,237,111
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	12,826,992.79	2,035,131	33,008,389.53	5,237,111