

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成28年11月30日
【計算期間】	第7期中（自 平成28年3月1日 至 平成28年8月31日）
【ファンド名】	UBS 豪ドル・ボンド・インカム (UBS AUD Bond Income)
【発行者名】	ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A. (Mitsubishi UFJ Investor Services & Banking (Luxembourg) S.A.)

(注) 平成28年5月1日付で、ミツビシUFJグローバルカストディ・エス・エイ (Mitsubishi UFJ Global Custody S.A.) はその名称をルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A. (Mitsubishi UFJ Investor Services & Banking (Luxembourg) S.A.) に変更した。

【代表者の役職氏名】	マネージング・ディレクター 寺脇 恒
【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-1150、アーロン通り 287-289番 (287-289, Route d'Arlon, L-1150 Luxembourg, Grand Duchy of Luxembourg)
【代理人の氏名又は名称】	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 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
【縦覧に供する場所】	該当事項なし

1【ファンドの運用状況】

UBS豪ドル・ボンド・インカム（UBS AUD Bond Income）（以下「ファンド」という。）の運用状況は、以下のとおりである。

（1）【投資状況】

① 資産別および地域別の投資状況

（2016年9月末日現在）

資産の種類	国名	時価合計（豪ドル）	投資比率（%）
社債	オーストラリア	6,295,383.61	46.65
	ドイツ	1,571,364.97	11.64
	アメリカ合衆国	521,035.00	3.86
	小計	8,387,783.58	62.16
州債	オーストラリア	2,367,345.50	17.54
	小計	2,367,345.50	17.54
国債	オーストラリア	1,210,154.50	8.97
	カナダ	503,630.00	3.73
	小計	1,713,784.50	12.70
地方債	オーストラリア	530,525.00	3.93
	小計	530,525.00	3.93
小計		12,999,438.58	96.33
現金・その他の資産（負債控除後）		494,748.90	3.67
合計（純資産総額）		13,494,187.48 （約1,040百万円）	100.00

（注1）投資比率とは、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）オーストラリア・ドル（以下「豪ドル」という。）の円貨換算は、便宜上、平成28年9月30日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1豪ドル＝77.04円）による。以下、豪ドルの円貨表示はすべてこれによるものとする。

（注3）ファンドは、ケイマン諸島の法律に基づいて設立されているが、受益証券は豪ドル建てのため、本書の金額表示は別段の記載がない限り豪ドルをもって行う。

（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。したがって、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、本書中で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ある。したがって、本書中の同一情報につき異なった円貨表示がなされている場合もある。

② 投資資産

(i) 投資有価証券の主要銘柄

(2016年9月末日現在)

順位	銘柄名	国名	種類	利率 (%)	償還日	額面金額 (豪ドル)	簿価 (豪ドル)	時価 (豪ドル)	投資比率 (%)
1.	KFW	ドイツ	社債	3.75	2017年8月10日	1,000,000	1,006,305.00	1,015,569.99	7.53
2.	Queensland Treasury Corp	オーストラリア	州債	4.75	2025年7月21日	550,000	629,384.50	656,804.50	4.87
3.	Export Finance & Insurance Corp	オーストラリア	社債	6.00	2020年11月12日	500,000	501,715.00	577,505.00	4.28
4.	Westpac Banking Corp	オーストラリア	社債	7.25	2020年2月11日	500,000	573,280.00	576,515.00	4.27
5.	Landwirtschaftliche Rentenbank	ドイツ	社債	5.50	2020年3月9日	500,000	529,990.00	555,794.98	4.12
6.	QPH Finance Co Pty Ltd	オーストラリア	社債	5.75	2020年7月29日	500,000	499,930.00	547,645.00	4.06
7.	Australian Capital Territory	オーストラリア	地方債	5.50	2018年6月7日	500,000	543,230.00	530,525.00	3.93
8.	Ale Direct Property Trust	オーストラリア	社債	5.00	2020年8月20日	500,000	500,165.00	525,485.00	3.89
9.	Metropolitan Life Global Funding I	アメリカ合衆国	社債	4.50	2019年4月16日	500,000	499,169.60	521,035.00	3.86
10.	National Wealth Management Holdings Ltd	オーストラリア	社債	5.25	2017年12月7日	500,000	497,615.00	514,735.00	3.81
11.	Crown Group Finance Ltd	オーストラリア	社債	5.75	2017年7月18日	500,000	516,070.00	511,370.00	3.79
12.	Suncorp-Metway Ltd	オーストラリア	社債	4.00	2017年11月9日	500,000	497,315.00	509,970.00	3.78
13.	United Energy Distribution Pty Ltd	オーストラリア	社債	6.25	2017年4月11日	500,000	509,400.00	509,016.14	3.77
14.	Westpac Banking Corp	オーストラリア	社債	5.75	2017年2月6日	500,000	517,742.50	506,261.93	3.75
15.	BHP Billiton Finance Ltd	オーストラリア	社債	3.75	2017年10月18日	500,000	495,280.00	506,185.00	3.75
16.	Commonwealth Bank of Australia	オーストラリア	社債	5.75	2017年1月25日	500,000	534,880.00	505,665.56	3.75
17.	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	オーストラリア	社債	変動	2022年6月20日	5,000	500,000.00	505,029.98	3.74
18.	Export Development Canada	カナダ	国債	2.40	2021年6月7日	500,000	499,065.00	503,630.00	3.73
19.	Queensland Treasury Corp	オーストラリア	州債	5.75	2024年7月22日	400,000	456,768.00	500,784.00	3.71
20.	Western Australian Treasury Corp	オーストラリア	州債	6.00	2023年10月16日	400,000	437,280.00	496,732.00	3.68
21.	Australia Government Bond	オーストラリア	国債	4.50	2033年4月21日	350,000	334,915.00	455,735.00	3.38
22.	New South Wales Treasury Corp	オーストラリア	州債	4.00	2023年4月20日	300,000	330,468.00	337,437.00	2.50
23.	Australia Government Bond	オーストラリア	国債	4.75	2027年4月21日	250,000	253,236.25	316,312.50	2.34
24.	Treasury Corp of Victoria	オーストラリア	州債	5.50	2024年12月17日	200,000	222,312.00	252,034.00	1.87
25.	Australia Government Bond	オーストラリア	国債	2.75	2035年6月21日	200,000	192,271.00	208,286.00	1.54
26.	Treasury Corp of Victoria	オーストラリア	州債	6.00	2022年10月17日	100,000	117,390.60	123,554.00	0.92
27.	Australia Government Bond	オーストラリア	国債	3.75	2037年4月21日	100,000	105,648.00	119,327.00	0.88
28.	Australia Government Bond	オーストラリア	国債	3.25	2039年6月21日	100,000	99,141.00	110,494.00	0.82

（ii）投資不動産物件

該当事項なし（2016年9月末日現在）。

（iii）その他投資資産の主要なもの

該当事項なし（2016年9月末日現在）。

（２）【運用実績】**①【純資産の推移】**

2016年9月末日および同日前1年以内における各月末についてのファンドの純資産総額および1口当たり純資産価格は、以下のとおりである。

	純資産総額		1口当たり純資産価格		
	豪ドル	円	豪ドル		円
2015年10月末日	17,086,252.48	1,316,324,891	クラスA受益証券 クラスT受益証券	10.31 11.53	794 888
11月末日	15,742,764.48	1,212,822,576	クラスA受益証券 クラスT受益証券	10.17 11.42	783 880
12月末日	14,904,796.99	1,148,265,560	クラスA受益証券 クラスT受益証券	10.18 11.47	784 884
2016年1月末日	14,703,119.87	1,132,728,355	クラスA受益証券 クラスT受益証券	10.21 11.55	787 890
2月末日	14,699,964.56	1,132,485,270	クラスA受益証券 クラスT受益証券	10.29 11.68	793 900
3月末日	14,469,384.53	1,114,721,384	クラスA受益証券 クラスT受益証券	10.22 11.64	787 897
4月末日	14,020,699.07	1,080,154,656	クラスA受益証券 クラスT受益証券	10.19 11.65	785 898
5月末日	14,065,479.86	1,083,604,568	クラスA受益証券 クラスT受益証券	10.29 11.81	793 910
6月末日	13,958,691.14	1,075,377,565	クラスA受益証券 クラスT受益証券	10.39 11.96	800 921
7月末日	13,854,065.24	1,067,317,186	クラスA受益証券 クラスT受益証券	10.43 12.05	804 928
8月末日	13,644,274.44	1,051,154,903	クラスA受益証券 クラスT受益証券	10.43 12.10	804 932
9月末日	13,494,187.48	1,039,592,203	クラスA受益証券 クラスT受益証券	10.36 12.05	798 928

<参考情報>

純資産総額およびクラスA受益証券1口当たり純資産価格の推移

(2010年8月4日～2016年9月末日)



(注1) 課税前分配金再投資換算クラスA受益証券1口当たり純資産価格はクラスA受益証券の公表されている1口当たり純資産価格に各収益分配金(課税前)をその分配を行う日に全額再投資したと仮定して算出したものであり、公表されている1口当たり純資産価格とは異なります。以下同じです。

(注2) ベンチマークは参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。また、上記のグラフは、過去のベンチマークの推移に基づくものであり、将来におけるベンチマークの推移を示唆または保証するものではありません。さらに、ファンドの受益証券1口当たり純資産価格は、必ずしもベンチマークに関連して推移するものではなく、ファンドの収益率がベンチマークの騰落率と関連することは保証されません。以下同じです。

②【分配の推移】

2016年9月末日までの1年間の1口当たりの分配の額は、以下のとおりである。

クラスA受益証券

計算期間	1口当たり分配金	
	豪ドル	円
2015年10月1日～2016年9月末日	0.360	27.73

<参考情報>

(クラスA受益証券)

(単位:豪ドル、1口当たり、課税前)

	金額
第1会計年度	0.210
第2会計年度	0.504
第3会計年度	0.504
第4会計年度	0.504
第5会計年度	0.408
第6会計年度	0.360
2016年 5月	0.030
6月	0.030
7月	0.030
8月	0.030
9月	0.030

直近1年累計	0.360
設定来累計	2.700

クラスT受益証券

該当事項なし。

③【収益率の推移】

計算期間	収益率（注）
2015年10月1日～2016年9月末日	クラスA受益証券 3.68% クラスT受益証券 4.51%

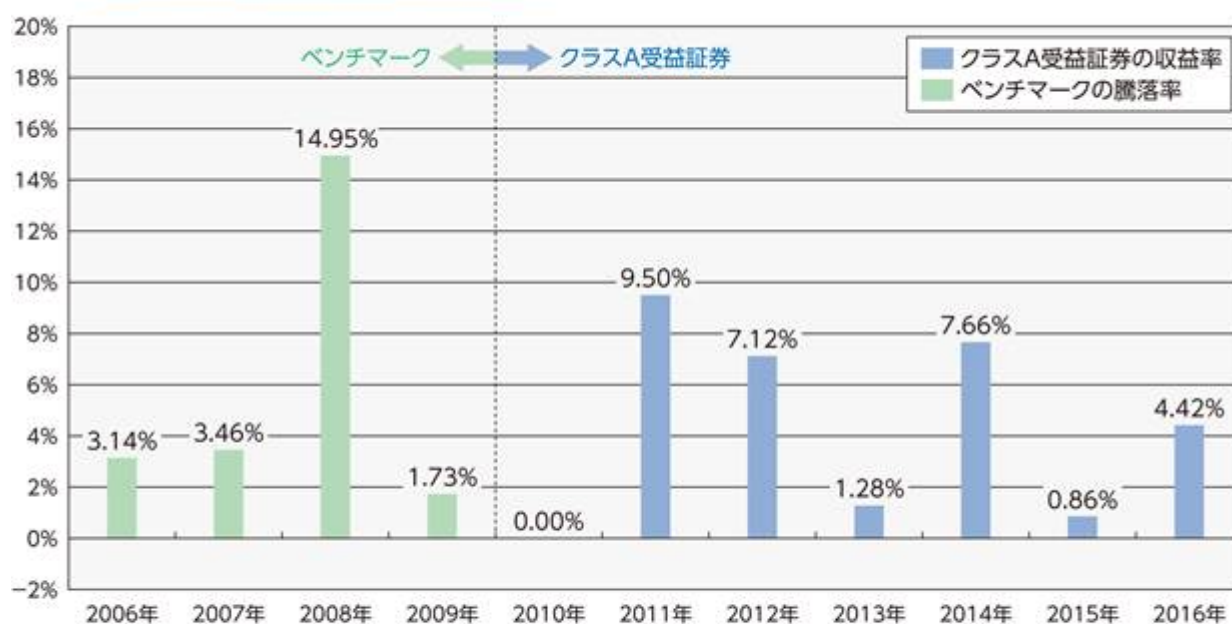
（注）収益率（%）＝ $100 \times (a - b) / b$

a＝2016年9月末日現在の1口当たり純資産価格（当該期間の分配金の合計額を加えた額）

b＝2015年9月末日現在の1口当たり純資産価格（分配落の額）

<参考情報>

年間収益率の推移



（注1）収益率（%）＝ $100 \times (a - b) / b$

a＝各暦年末現在の課税前分配金再投資換算受益証券1口当たり純資産価格

b＝当該各暦年の直前の各暦年末現在の課税前分配金再投資換算受益証券1口当たり純資産価格（ただし、2010年の場合は当初発行価格（10.00豪ドル））

（注2）クラスA受益証券について、2010年は8月4日（運用開始日）から12月末日までの収益率です。2016年は1月1日から9月末日までの収益率です。

2【販売及び買戻しの実績】

2016年9月末日までの1年間における販売および買戻しの実績ならびに2016年9月末日現在の発行済口数は、以下のとおりである。

なお、括弧内の数値は、本邦内における販売、買戻しおよび発行済口数である。

クラスA受益証券

販売口数	買戻し口数	発行済口数
0 (0)	202,408 (202,408)	321,133 (321,133)

クラスT受益証券

販売口数	買戻し口数	発行済口数
0 (0)	221,000 (0)	843,490 (0)

3【ファンドの経理状況】

- a. ファンドの日本語の中間財務書類は、米国において一般に認められる会計原則に準拠して作成された原文（英語）の中間財務書類を翻訳したものである（ただし、円換算部分を除く）。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、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. ファンドの原文の中間財務書類は、豪ドルで表示されている。日本語の中間財務書類には、主要な金額について円換算額が併記されている。日本円による金額は、平成28年9月30日現在における株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1豪ドル＝77.04円）で換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

（１）【資産及び負債の状況】

U B S 豪ドル・ボンド・インカム

貸借対照表

2016年8月31日現在

（豪ドルで表示）

	豪ドル	千円
資産		
現金	440,658.62	33,948
銀行預金－基準通貨	440,343.05	33,924
銀行預金－外国通貨	315.57	24
ブローカー保有現金	27,358.93	2,108
ブローカー保有現金 （豪ドル）	27,358.93	2,108
有価証券、取得原価	12,399,966.45	955,293
債券、取得原価	12,399,966.45	955,293
未実現評価損益	711,829.93	54,839
未実現時価評価損益	712,145.50	54,864
未実現通貨運用評価損益	(315.57)	(24)
未収収益	124,887.21	9,621
未収預金利息	307.65	24
未収債券利息	124,579.56	9,598
資産合計	13,704,701.14	1,055,810
負債		
未払費用	60,426.70	4,655
未払監査報酬	34,022.92	2,621
未払保管報酬	472.99	36
クラスA受益証券	472.99	36
未払報告書作成費用	10,117.19	779
未払投資運用報酬	10,070.75	776
クラスA受益証券	2,627.98	202
クラスT受益証券	7,442.77	573
未払受託報酬	2,232.41	172
未払代行協会員報酬	568.98	44
クラスA受益証券	568.98	44
未払販売報酬	2,844.71	219
クラスA受益証券	2,844.71	219
未払副管理報酬	96.75	7
クラスA受益証券	96.75	7
負債合計	60,426.70	4,655

資本

ファンド受益証券		6,769,285.91	521,506
発行済ファンド受益証券 （額面価額）	11,720,230.00		902,927
クラスA受益証券	3,215,330.00		247,709
クラスT受益証券	8,504,900.00		655,217
受益証券額面超過額	(4,950,944.09)		(381,421)
クラスA受益証券	(345,088.09)		(26,586)
クラスS受益証券	(2,974,400.00)		(229,148)
クラスT受益証券	(1,631,456.00)		(125,687)
支払分配金		(2,840,886.06)	(218,862)
支払分配金	(2,840,886.06)		(218,862)
クラスA受益証券	(2,840,886.06)		(218,862)
利益剰余金		9,238,175.52	711,709
利益剰余金	9,238,175.52		711,709
クラスA受益証券	7,761,520.40		597,948
クラスS受益証券	5,119,905.03		394,437
クラスT受益証券	8,206,843.83		632,255
当期純利益		477,699.07	36,802
資本合計		<u>13,644,274.44</u>	<u>1,051,155</u>
負債および資本合計		<u>13,704,701.14</u>	<u>1,055,810</u>
純資産総額		<u>13,644,274.44</u>	<u>1,051,155</u>
発行済受益証券総数		1,172,023.00000 口	
受益証券1口当たり純資産 価格（平均）		11.64	897円

UBS 豪ドル・ボンド・インカム

損益計算書

2016年3月1日から2016年8月31日までの期間

（豪ドルで表示）

	豪ドル	千円
収益		
実現損益	227,255.62	17,508
為替取引にかかる実現差益	8.08	1
為替取引にかかる実現差損	(341.05)	(26)
市場にかかる実現利益	84,522.35	6,512
通貨にかかる実現利益	97.95	8
通貨にかかる実現損失	(23.57)	(2)
先物契約にかかる実現利益	142,744.06	10,997
先物契約にかかる実現損失	(2.20)	(0)
雑収益	250.00	19
受取利息	322,174.55	24,820
預金利息	2,950.18	227
債券利息	319,077.65	24,582
証拠金勘定利息	146.72	11
未実現評価損益	15,628.77	1,204
未実現時価評価損益	15,628.77	1,204
収益合計	565,058.94	43,532
費用		
費用－報酬	86,815.84	6,688
監査報酬	17,707.67	1,364
保管報酬	1,432.33	110
クラスA受益証券	1,432.33	110
報告書作成費用	8,962.24	690
弁護士報酬	4,535.34	349
投資運用報酬	30,416.55	2,343
クラスA受益証券	8,196.55	631
クラスT受益証券	22,220.00	1,712
受託報酬	6,471.83	499
立替費用	3,327.09	256
代行協会員報酬	1,714.89	132
クラスA受益証券	1,714.89	132
販売報酬	8,574.38	661
クラスA受益証券	8,574.38	661
副保管報酬	3,380.18	260
副管理報酬	293.34	23
クラスA受益証券	293.34	23
その他の費用	538.59	41
先物契約手数料	538.59	41

支払利息	5.44	0
証拠金利息にかかる当座借 越勘定	5.44	0
費用合計	87,359.87	6,730
投資純利益	477,699.07	36,802

（２）【投資有価証券明細表等】

保有有価証券残高明細表
 UBS 豪ドル・ボンド・インカム
 種別・グループ別 2016年8月31日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 (表示通 貨) (注1)	取得原価 (基準通 貨) (注2) (豪ドル)	基準価格	価額 (表示通 貨) (注1)	価額 (基準通 貨) (注2) (豪ドル)	市場 (豪ドル)	未実 現損 益 通貨 (豪 ドル)	合計 (豪ドル)
現金											
基準通貨現金											
440,343.05000	豪ドル現金	08/31/2016		440,343.05	440,343.05	1.000000000	440,343.05	440,343.05	0.00	0.00	0.00
	豪ドル現金					1.000000000					
440,343.05000	基準通貨現金	小計		440,343.05	440,343.05		440,343.05	440,343.05	0.00	0.00	0.00
440,343.05000	現金合計			440,343.05	440,343.05		440,343.05	440,343.05	0.00	0.00	0.00
社債											
変動利付債											
5,000.00000	AUST & NZ BANK FRN 06202022 BAUS0784AU0000ANZHA6	02/22/2012		500,000.00	500,000.00	101.929000854 ^C	509,645.00	509,645.00	9,645.00	0.00	9,645.00
						1.000000000					
5,000.00000	変動利付債	小計		500,000.00	500,000.00		509,645.00	509,645.00	9,645.00	0.00	9,645.00
メディアム・ターム・ノート											
500,000.00000	ALE DIRECT PROPE 5 % 08202020 BAUS0855AU3CB0221687	05/29/2014		500,165.00	500,165.00	105.333000000 ^C	526,665.00	526,665.00	26,500.00	0.00	26,500.00
						1.000000000					
500,000.00000	BHP BILLITON FIN 3.75 % 10182017 BAUS080JAU3CB0200590	10/09/2012		495,280.00	495,280.00	101.352000000 ^C	506,760.00	506,760.00	11,480.00	0.00	11,480.00
						1.000000000					
500,000.00000	EXPORT FIN & INS COR 6% 11122020 BAUS0723AU3CB0163707	11/04/2010		501,715.00	501,715.00	116.025000000 ^C	580,125.00	580,125.00	78,410.00	0.00	78,410.00
						1.000000000					
500,000.00000	MET LIFE GLOB 4.5 % 04162019 BUSA9819AU3CB0220192	04/09/2014		499,169.60	499,169.60	104.405998230 ^C	522,029.99	522,029.99	22,860.39	0.00	22,860.39
						1.000000000					
500,000.00000	NATIONAL WEALTH 5.25 % 12072017 BAUS080YAU3CB0202877	11/30/2012		497,615.00	497,615.00	103.215000000 ^C	516,075.00	516,075.00	18,460.00	0.00	18,460.00
						1.000000000					

口数／金額	種類	取引日	サブ ユ ニ ッ ト ク ラ ス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (豪ドル)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (豪ドル)	市場 (豪ドル)	通貨 (豪 ド ル)	未実 現損 益	合計 (豪ドル)
社債（続き）												
ミディアム・ターム・ノート （続き）												
500,000.00000	QPH FINANCE CO P 5.75 % 07292020 BAUS0838 AU3CB0211647	07/22/2013		499,930.00	499,930.00	109.892000000 ^C	549,460.00	549,460.00	49,530.00	0.00		49,530.00
						1.000000000						
500,000.00000	RENTENBANK 5.5 % 03092020 BDEU435F AU3CB0191278	08/24/2012		529,990.00	529,990.00	111.736999512 ^C	558,685.00	558,685.00	28,695.00	0.00		28,695.00
						1.000000000						
500,000.00000	WESTPAC BANKING 7.25 % 02112020 BAUS081E AU000WBCHAM4	09/18/2014		573,280.00	573,280.00	115.753000000 ^C	578,765.00	578,765.00	5,485.00	0.00		5,485.00
						1.000000000						
4,000,000.00000	ミディアム・ターム・ ノート 小計			4,097,144.60	4,097,144.60		4,338,564.99	4,338,564.99	241,420.39	0.00		241,420.39
公募債												
500,000.00000	COM BK AUSTRALIA 5.75 % 01252017 BAUS080C AU3CB0188951	09/11/2012		534,880.00	534,880.00	101.465137494 ^C	507,325.69	507,325.69	-27,554.31	0.00		-27,554.31
						1.000000000						
500,000.00000	CROWN GROUP LTD 5.75 % 07182017 BAUS080M AU3CB0196848	10/12/2012		516,070.00	516,070.00	102.504000000 ^C	512,520.00	512,520.00	-3,550.00	0.00		-3,550.00
						1.000000000						
1,000,000.00000	KFW 3.75 % 08102017 BDEU435E AU0000KFWHV4	08/01/2012		1,006,305.00	1,006,305.00	101.774002075 ^C	1,017,740.02	1,017,740.02	11,435.02	0.00		11,435.02
						1.000000000						
500,000.00000	SUNCORP METWAY 4 % 11092017 BAUS080N AU3CB0201630	11/01/2012		497,315.00	497,315.00	102.162000000 ^C	510,810.00	510,810.00	13,495.00	0.00		13,495.00
						1.000000000						
500,000.00000	UNITED ENERGY DI 6.25 % 04112017 BAUS0809 AU3CB0192599	08/14/2012		509,400.00	509,400.00	102.024000000 ^C	510,120.00	510,120.00	720.00	0.00		720.00
						1.000000000						
500,000.00000	WESTPAC BANKING 5.75 % 02062017 BAUS0774 AU3CB0189322	01/24/2012		517,742.50	517,742.50	101.572931822 ^C	507,864.66	507,864.66	-9,877.84	0.00		-9,877.84
						1.000000000						
3,500,000.00000	公募債 小計			3,581,712.50	3,581,712.50		3,566,380.37	3,566,380.37	-15,332.13	0.00		-15,332.13
7,505,000.00000	社債合計			8,178,857.10	8,178,857.10		8,414,590.36	8,414,590.36	235,733.26	0.00		235,733.26

未実現
損益

口数／金額	種類	取引日	サブ ユ ニ ッ ト ク ラ ス	取得原価 （表示通 貨） （注1）	取得原価 （基準通 貨） （注2） （豪ドル）	基準価格	価額 （表示通 貨） （注1）	価額 （基準通 貨） （注2） （豪ドル）	市場 （豪ドル）	通貨 （豪ド ル）	合計 （豪ドル）
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
561,750.00000	日本円	01/22/2016		561,750	6,800.03	1.000000000S 77.480000000	561,750	7,250.26	0.00	450.23	450.23
	日本円 外国通貨: 日本円										
561,750.00000	日本円	MultiLot		-561,750	-6,484.46	1.000000000S 77.480000000	-561,750	-7,250.26	0.00	-765.80	-765.80
	日本円 外国通貨: 日本円										
0.00000	非グループ化の有価証券 小計			0.00	315.57		0.00	0.00	0.00	-315.57	-315.57
0.00000	外貨建現金勘定合計			0.00	315.57		0.00	0.00	0.00	-315.57	-315.57
先物											
先物											
17.00	AUST 10Y BOND FUT Se SEP 16	MultiLot		0.00	0.00	3,121.047251545M 1.000000000	51,393.99	51,393.99	51,393.99	0.00	51,393.99
	XMU6										
1.00	AUST 3YR BOND FUT Se SEP 16	08/24/2016		0.00	0.00	3.739999390M 1.000000000	-94.90	-94.90	-94.90	0.00	-94.90
	YMU6										
18.00000	先物 小計			0.00	0.00		51,299.09	51,299.09	51,299.09	0.00	51,299.09
18.00000	先物合計			0.00	0.00		51,299.09	51,299.09	51,299.09	0.00	51,299.09
国債											
地方債											
500,000.00000	AUSTRALIAN CPTL 5.5 % 06072018 BAUS080D AU3CB0177269	09/11/2012		543,230.00	543,230.00	106.643000000C 1.000000000	533,215.00	533,215.00	10,015.00	0.00	10,015.00
300,000.00000	NSWTC- DOMESTIC 4 % 04202023 BAUS087B AU3SG0001159	03/25/2015		330,468.00	330,468.00	113.258000000C 1.000000000	339,774.00	339,774.00	9,306.00	0.00	9,306.00
400,000.00000	QUEENSLAND TREAS 5.75 % 07222024 BAUS0824 AU0000XQLQU0	08/21/2014		456,768.00	456,768.00	126.082000000C 1.000000000	504,328.00	504,328.00	47,560.00	0.00	47,560.00
550,000.00000	QUEENSLAND TREAS 4.75 % 07212025 BAUS0877 AU0000XQLQZ9	03/11/2015		629,384.50	629,384.50	120.168000000C 1.000000000	660,924.00	660,924.00	31,539.50	0.00	31,539.50

口数／金額	種類	取引日	サブ ユ ニ ッ ト ク ラ ス	取得原価 (表示通貨) (注１)	取得原価 (基準通貨) (注２) (豪ドル)	基準価格	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通貨) (注２) (豪ドル)	市場 (豪ドル)	通貨 (豪 ド ル)	未 実 現 損 益 合 計 (豪 ド ル)
国債（続き）											
地方債（続き）											
200,000.00000	TREAS CORP VICT 5.5 % 12172024 BAUS0832 AU0000XVG2B1	06/13/2013		222,312.00	222,312.00	127.092000000 ^C	254,184.00	254,184.00	31,872.00	0.00	31,872.00
						1.000000000					
400,000.00000	WEST AUST T CORP 6 % 10162023 BAUS084F AU300WT60390	01/15/2014		437,280.00	437,280.00	124.750000000 ^C	499,000.00	499,000.00	61,720.00	0.00	61,720.00
						1.000000000					
2,350,000.00000	地方債 小計			2,619,442.50	2,619,442.50		2,791,425.00	2,791,425.00	171,982.50	0.00	171,982.50
公債											
500,000.00000	EXPORT DEV CAN 2.4 % 06072021 BCAN10CN AU3CB0237766	06/07/2016		499,065.00	499,065.00	101.164000000 ^C	505,820.00	505,820.00	6,755.00	0.00	6,755.00
						1.000000000					
500,000.00000	公債 小計			499,065.00	499,065.00		505,820.00	505,820.00	6,755.00	0.00	6,755.00
ソブリン債											
250,000.00000	AUSTRALIAN GOVT. 4.75 % 04212027 BAUS0760 AU3TB0000135	10/31/2011		253,236.25	253,236.25	127.632000000 ^C	319,080.00	319,080.00	65,843.75	0.00	65,843.75
						1.000000000					
350,000.00000	AUSTRALIAN GOVT. 4.5 % 04212033 BAUS084C AU000XCLWAG2	11/28/2013		334,915.00	334,915.00	131.563000000 ^C	460,470.50	460,470.50	125,555.50	0.00	125,555.50
						1.000000000					
100,000.00000	AUSTRALIAN GOVT. 3.75 % 04212037 BAUS086P AU3TB0000192	08/17/2015		105,648.00	105,648.00	121.300000000 ^C	121,300.00	121,300.00	15,652.00	0.00	15,652.00
						1.000000000					
200,000.00000	AUSTRALIAN GOVT. 2.75 % 06212035 BAUS087D AU000XCLWAMO	03/26/2015		192,271.00	192,271.00	105.627000000 ^C	211,254.00	211,254.00	18,983.00	0.00	18,983.00
						1.000000000					
100,000.00000	AUSTRALIAN GOVT. 3.25 % 06212039 BAUS0882 AU000XCLWAP3	10/30/2015		99,141.00	99,141.00	112.563000000 ^C	112,563.00	112,563.00	13,422.00	0.00	13,422.00
						1.000000000					
100,000.00000	TREAS CORP VICT 6% 10172022 BAUS0716 AU0000XVGZZ0	08/21/2012		117,390.60	117,390.60	124.310000000 ^C	124,310.00	124,310.00	6,919.40	0.00	6,919.40
						1.000000000					
1,100,000.00000	ソブリン 債 小計			1,102,601.85	1,102,601.85		1,348,977.50	1,348,977.50	246,375.65	0.00	246,375.65
3,950,000.00000	国債合計			4,221,109.35	4,221,109.35		4,646,222.50	4,646,222.50	425,113.15	0.00	425,113.15

									未実現 損益		
口数／金額	種類	取引日	サブ ユ ニ ッ ト ク ラ ス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (豪ドル)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (豪ドル)	市場 (豪ドル)	通貨 (豪ドル)	合計 (豪ドル)
証拠金勘定											
証拠金勘定											
27,358.93	AUD MARGIN	MultiLot		27,358.93	27,358.93	1.0000000000 ^S	27,358.93	27,358.93	0.00	0.00	0.00
	AUDMAR					1.0000000000					
27,358.93000	証拠金 勘定 小計			27,358.93	27,358.93		27,358.93	27,358.93	0.00	0.00	0.00
27,358.93000	証拠金 勘定合計			27,358.93	27,358.93		27,358.93	27,358.93	0.00	0.00	0.00
11,922,719.98000	投資明 細合計			12,867,668.43	12,867,984.00		13,579,813.93	13,579,813.93	712,145.50	- 315.57	711,829.93

（注1）表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいう。表示通貨は各投資対象により異なる。

（注2）基準通貨とは、ファンド計理上の基準通貨をいう。ファンドの基準通貨は豪ドルである。

4【管理会社の概況】

（１）【資本金の額】（平成28年9月末日現在）

払込済資本金の額 37,117,968.52米ドル（約38億円）

発行済株式総数 1,002,080株

（注）米ドルの円貨換算は、便宜上、平成28年9月30日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝101.12円）による。

（２）【事業の内容及び営業の状況】

管理会社は、投資信託の事務管理、国際的な保管業務、信託会計の事務管理およびこれらに関する一般的な銀行業務ならびに外国為替業務に従事する。

管理会社は、信託証書に基づき、期間の限定なく任命されているが、受託会社は、以下の場合、かかる任命を直ちに解除することができる。(a) 管理会社が清算手続に入った場合、(b) 管理会社の事業に関して財産保全管理人が任命される場合、(c) 受託会社が、管理会社の変更が受益者の利益にとって望ましいとの見解を有し、受益者に対してその旨を書面で表明した場合、(d) 管理会社が法により許容される限りできるだけ早期に解任されるべきことが、受益者により受益者集会において特別決議により決議され、その旨決定された場合、または(e) 発行済受益証券の価格の4分の3の多数を占める受益者が管理会社の解任を書面で受託会社に要求した場合である。管理会社がファンドの管理者でなくなった場合、受託会社は、ファンドの管理者になる適格性を有する他の者を任命することを要する。管理会社はまた、受託会社への通知により、管理会社の関連会社である他の管理者を後任者として、直ちに退任する権利を有する。ただし、管理会社が関連会社でない他の管理者を後任者として退任することを希望する場合、受託会社に対し60日前に通知を行う。

信託証書の規定に基づき、管理会社は、義務の履行に関する故意の不履行、詐欺または重過失の場合を除き、ファンド、受益者または受託会社に対していかなる責任も負わない。

信託証書に基づき、受託会社は、ファンドのために、かつファンドの資産からのみ、管理会社ならびに管理会社の関係会社、代理人および受任者ならびに管理会社およびこれらの者の役員、取締役、株主および支配者に対して、(i) ファンドの運営もしくはファンドの受益証券の募集もしくは(ii) 管理会社の行為に関係し、もしくはこれらから生じ、もしくはこれらに基づき、または信託証書に基づきファンドのために行われた事業もしくは業務に別途に関連して、管理会社が現実に一時的に負担したあらゆる損失、責任、損害、費用または経費（弁護士費用および会計士費用を含むが、これらに限定されない。）、判決および和解において支払われる金額（ただし、受託会社が、ファンドを代表して、かかる和解を承認していることを条件とする。）を補償するものとし、前記の者を前記のあらゆる損失、責任、損害、費用または経費から免責するものとする。ただし、かかる行為が信託証書に基づく義務の履行に関する故意の不履行、詐欺または重過失を構成する場合はこの限りでない。

管理会社は、平成28年8月末日現在、以下の投資信託を運営および管理している。

国別（設立国）	種別（基本的性格）	本数	純資産価額の合計（通貨別）
ケイマン諸島	契約型投資信託（アンブレラ・ファンドのサブ・ファンドを含む。）	75	6,588,755,740.00米ドル

（３）【その他】

本書提出前6か月以内において、訴訟事件その他管理会社に重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はない。

5【管理会社の経理の概況】

- a. 管理会社の日本文の中間財務書類は、管理会社が作成し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. 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. 管理会社の原文の中間財務書類は米ドルで表示されている。日本文の財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円による金額は、平成28年9月30日現在における株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝101.12円）で換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

(1) 【資産及び負債の状況】

ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.

貸借対照表

2016年6月30日現在

(単位：米ドル)

資産

米ドル

千円

		米ドル	千円
1.1	現金および中央銀行における現金残高	1,899,536,172.00	192,081,098
1.2	売買目的で保有される金融資産	51,327,462.00	5,190,233
1.2.1	売買目的で保有されるデリバティブ	51,327,462.00	5,190,233
1.2.2	持分証券		
1.2.3	債務証券		
1.2.4	ローンおよび貸付金		
1.3	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融資産	0.00	0
1.3.1	持分証券		
1.3.2	債務証券		
1.3.3	ローンおよび貸付金		
1.4	売却可能金融資産	11,888,375.00	1,202,152
1.4.1	持分証券	11,888,375.00	1,202,152
1.4.2	債務証券		
1.4.3	ローンおよび貸付金		
1.5	ローンおよび未収金（ファイナンス・リースを含む）	3,195,536,480.00	323,132,649
1.5.1	債務証券		
1.5.2	ローンおよび貸付金	3,195,536,480.00	323,132,649
1.6	満期保有目的投資有価証券	0.00	0
1.6.1	債務証券		
1.6.2	ローンおよび貸付金		
1.7	デリバティブヘッジ会計	0.00	0
1.7.1	公正価値ヘッジ		
1.7.2	キャッシュ・フロー・ヘッジ		
1.7.3	外国事業純投資のヘッジ		
1.7.4	金利リスクの公正価値ヘッジ		
1.7.5	金利リスク・キャッシュ・フロー・ヘッジ		
1.8	金利リスクのポートフォリオ・ヘッジにおけるヘッジ項目の公正価値変動		
1.9	有形資産	1,343,232.00	135,828
1.9.1	有形固定資産	1,343,232.00	135,828
1.9.2	投資不動産		
1.10	無形資産	3,743,860.00	378,579
1.10.1	営業権		
1.10.99	その他の無形資産	3,743,860.00	378,579
1.12	税金資産	124,840.00	12,624
1.12.1	現行税金資産	124,840.00	12,624
1.12.2	繰延税金資産	0.00	0
1.13	その他の資産	21,344,120.00	2,158,317
1.14	売却目的保有に分類される非流動資産および売却グループ		
1.15	資産合計	5,184,844,541.00	524,291,480

ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.

貸借対照表

2016年6月30日現在

（単位：米ドル）

負債

		米ドル	千円
2.1	中央銀行預金		
2.2	売買目的で保有される金融負債	43,298,019.00	4,378,296
2.2.1	売買目的で保有されるデリバティブ	43,298,019.00	4,378,296
2.2.2	ショート・ポジション		
2.2.3	金融機関からの預金		
2.2.4	金融機関以外からの預金		
2.2.5	債務証書（短期間で買戻す予定の債券を含む）		
2.2.99	その他の金融負債		
2.3	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融負債	0.00	0
2.3.1	金融機関からの預金		
2.3.2	金融機関以外からの預金		
2.3.3	債務証書（債券を含む）		
2.3.4	劣後債務		
2.3.99	その他の金融負債		
2.4	償却後原価で測定される金融負債	4,949,902,146.00	500,534,105
2.4.1	金融機関からの預金	1,525,457,379.00	154,254,250
2.4.2	金融機関以外からの預金	3,424,444,767.00	346,279,855
2.4.3	債務証書（債券を含む）		
2.4.4	劣後債務		
2.4.99	その他の金融負債		
2.5	譲渡された金融資産に関連する金融負債		
2.6	デリバティブヘッジ会計	0.00	0
2.6.1	公正価値ヘッジ		
2.6.2	キャッシュ・フロー・ヘッジ		
2.6.3	外国事業純投資のヘッジ		
2.6.4	金利リスクの公正価値ヘッジ		
2.6.5	金利リスク・キャッシュ・フロー・ヘッジ		
2.7	金利リスクのポートフォリオ・ヘッジにおけるヘッジ項目の公正価値変動		
2.8	引当金	274,539.00	27,761
2.8.1	再編		
2.8.2	係属中の法的問題および租税訟務	274,539.00	27,761
2.8.3	年金およびその他の退職後給付金債務		
2.8.4	ローン契約および保証		
2.8.5	有償契約		
2.8.99	その他の引当金		
2.9	税金負債	11,045,467.00	1,116,918
2.9.1	現行税金負債	11,045,467.00	1,116,918
2.9.2	繰延税金負債	0.00	0
2.10	その他の負債	15,048,412.00	1,521,695
2.11	要求払株式資本（例えば、共同株式）		
2.12	売却目的保有に分類される売却グループに含まれる負債		
2.13	負債合計	5,019,568,583.00	507,578,775

ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.

貸借対照表

2016年6月30日現在

（単位：米ドル）

資本

		米ドル	千円
3.1	発行済み資本	37,117,969.00	3,753,369
3.1.1	払込資本	37,117,969.00	3,753,369
3.1.2	未払込請求資本		
3.2	株式発行差金		
3.3	その他のエクイティ	0.00	0
3.3.1	複合金融商品のエクイティ部分		
3.3.99	その他のエクイティ商品		
3.4	再評価準備金およびその他の評価差額：	3,388,782.00	342,674
3.4.1	有形資産		
3.4.2	無形資産		
3.4.3	外国事業純投資のヘッジ（有効部分）		
3.4.4	外貨換算		
3.4.5	キャッシュ・フロー・ヘッジ（有効部分）		
3.4.6	売却可能金融資産	3,388,782.00	342,674
3.4.7	売却目的で保有される非流動資産および売却グループ	0.00	0
3.4.99	その他の項目		
3.5	準備金（利益剰余金を含む）	110,531,939.00	11,176,990
3.6	＜自己株式＞		
3.7	当期利益	14,237,268.00	1,439,673
3.8	＜中間配当＞		
3.10	資本合計	165,275,958.00	16,712,705
3.11	負債および資本合計	5,184,844,541.00	524,291,480

(2) 【損益の状況】

ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.

損益計算書

2016年6月30日に終了した期間

(単位：米ドル)

		米ドル	千円
5.1	金融および運用収益および費用（＋／－）	39,434,012.00	3,987,567
5.2	利息収益	12,948,861.00	1,309,389
5.2.1	現金および中央銀行における現金残高	2,800.00	283
5.2.2	売買目的で保有される金融資産（区別して計上される場合）	6,627,225.00	670,145
5.2.3	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融資産		
5.2.4	売却可能金融資産		
5.2.5	ローンおよび未収金（ファイナンス・リースを含む。）	6,318,836.00	638,961
5.2.6	満期保有目的投資有価証券		
5.2.7	デリバティブヘッジ会計、金利リスク		
5.2.99	その他の資産		
5.3	（支払利息）（－）	3,570,906.00	361,090
5.3.1	中央銀行からの預金	2,427,476.00	245,466
5.3.2	売買目的で保有される金融負債（区別して計上される場合）	86,859.00	8,783
5.3.3	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融負債		
5.3.4	償却後原価で測定される金融負債	1,056,571.00	106,840
5.3.5	デリバティブヘッジ会計、金利リスク		
5.3.99	その他の負債		
5.4	要求払株式資本に係る費用（－）		
5.5	受取配当（＋）	1,540,573.00	155,783
5.5.1	売買目的で保有される金融資産（区別して計上される場合）		
5.5.2	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融資産		
5.5.3	売却可能金融資産	1,540,573.00	155,783
5.6	受取手数料（＋）	50,949,549.00	5,152,018
5.7	（支払手数料）（－）	24,944,611.00	2,522,399
5.8	損益計算書を通じて公正価値で測定されない金融資産および負債に係る実現利益（損失）、純額（＋／－）	0.00	0
5.8.1	売却可能金融資産	0.00	0
5.8.2	ローンおよび未収金（ファイナンス・リースを含む。）		
5.8.3	満期保有目的投資有価証券		
5.8.4	償却後原価で測定される金融負債		
5.8.99	その他		
5.9	売買目的で保有される金融資産および負債に係る利益（損失）、純額（＋／－）	2,533,259.00	256,163
5.9.1	デリバティブに関するエクイティ商品		
5.9.2	金利商品およびデリバティブ関連		
5.9.3	為替取引	2,533,259.00	256,163
5.9.4	信用リスク商品およびデリバティブ関連		
5.9.5	商品およびデリバティブ関連		
5.9.99	その他（ハイブリッド・デリバティブを含む。）		
5.10	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融資産および負債に係る利益（損失）、純額（＋／－）		
5.11	ヘッジ会計からの利益（損失）、純額（＋／－）		
5.12	為替差額、純額（＋／－）		
5.13	売却目的以外で保有される資産の認識除外に係る利益（損失）、純額（＋／－）		
5.14	その他の事業収益（＋）	650,711.00	65,800

米ドル

千円

		米ドル	千円
5.15	その他の事業費用（－）	673,424.00	68,097
5.16	一般管理費（－）	22,071,208.00	2,231,841
5.16.1	従業員費用（－）	9,275,931.00	937,982
5.16.2	一般管理費用（－）	12,795,277.00	1,293,858
5.17	減価償却（＋／－）	1,091,868.00	110,410
5.17.1	有形固定資産	190,017.00	19,215
5.17.2	投資不動産		
5.17.3	無形資産（営業権を除く）	901,851.00	91,195
5.18	引当金（＋／－）	(2,237,832.00)	(226,290)
5.19	減損（＋／－）	0.00	0
5.19.1	損益計算書を通じて公正価値で測定されない金融資産に係る減損（＋／－）	0.00	0
5.19.1.1	取得原価で測定される金融資産（値付けされていないエクイティ）		
5.19.1.2	売却可能金融資産		
5.19.1.3	償却後原価で測定されるローンおよび未収金（ファイナンス・リースを含む）		
5.19.1.4	償却後原価で測定される満期保有目的投資証券		
5.19.2	非金融資産に係る減損、純額（＋／－）	0.00	0
5.19.2.1	有形固定資産		
5.19.2.2	投資不動産		
5.19.2.3	営業権		
5.19.2.4	その他の無形資産		
5.19.2.99	その他		
5.20	直ちに損益認識されるマイナスの営業権（＋）		
5.22	非流動資産および非継続事業の条件を満たさない売却目的保有に分類される除却グループからの損益（＋／－）	0.00	0
5.23	継続事業からの税引前損益合計（＋／－）	18,508,768.00	1,871,607
5.24	継続事業からの損益に関する税金費用（収入）（－／＋）	4,271,500.00	431,934
5.25	継続事業からの税引後損益合計（＋／－）	14,237,268.00	1,439,673
5.26	非継続事業からの税引後損益（＋／－）		
5.27	当期利益または損失（＋／－）	14,237,268.00	1,439,673