

## 【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 令和3年12月24日

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

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

【本店の所在の場所】 ルクセンブルグ大公国、ルクセンブルグ L - 1855、  
J.F.ケネディ通り33A番  
（33A avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg,  
Grand Duchy of Luxembourg）

【代理人の氏名又は名称】 弁護士 三 浦 健  
弁護士 大 西 信 治

【代理人の住所又は所在地】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング  
森・濱田松本法律事務所

【事務連絡者氏名】 弁護士 三 浦 健  
弁護士 大 西 信 治

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

【電話番号】 03（6212）8316

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

【届出の対象とした募集（売出）外国投資信託受益証券の金額】  
UBS（Lux）ボンド・ファンド - オーストラリア・ドル  
（UBS（Lux）Bond Fund-AUD）  
クラスP - d i s t 受益証券  
17億9,880万オーストラリア・ドル（約1,495億円）  
クラスP - a c c 受益証券  
39億796万オーストラリア・ドル（約3,248億円）  
UBS（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル  
（UBS（Lux）Bond Fund-EUR Flexible）  
クラスP - d i s t 受益証券  
11億5,216万ユーロ（約1,516億円）  
クラスP - a c c 受益証券  
17億8,880万ユーロ（約2,354億円）

## UBS（Lux）ボンド・ファンド -

フルサイクル・アジア・ボンド（米ドル）

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

クラスP - a c c 受益証券

8億4,770万アメリカ合衆国ドル（約937億円）

## 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）

11億7,248万アメリカ合衆国ドル（約1,297億円）

クラスP - m d i s t 受益証券（米ドル・ヘッジ）

7億3,840万アメリカ合衆国ドル（約817億円）

クラスP - a c c 受益証券

17億9,528万ユーロ（約2,362億円）

クラスP - m d i s t 受益証券

10億3,440万ユーロ（約1,361億円）

（注）オーストラリア・ドル（以下「豪ドル」という。）、ユーロおよびアメリカ合衆国ドル（以下「米ドル」という。）の円貨換算は、便宜上、2021年6月30日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1豪ドル＝83.12円、1ユーロ＝131.58円、1米ドル＝110.58円）による。

## 【縦覧に供する場所】

該当事項なし。

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出しましたので、2021年8月31日付をもって提出した有価証券届出書（2021年9月24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っています。

## 2【訂正の内容】

原届出書の訂正内容は下記のとおりです。

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

[次へ](#)

## 第二部 ファンド情報

### 第1 ファンドの状況

#### 1 ファンドの性格

##### （3）ファンドの仕組み

##### 管理会社の概況

##### （ハ）資本金の額

##### <訂正前>

株主資本の13,000,000ユーロ（約17億円）は、1株2,000ユーロ（263,160円）の株式6,500株によって表章される。2021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17億円）は、1株2,000ユーロ（265,540円）の株式6,500株によって表章される。2021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、2021年10月29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＝132.77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）

（2021年10月末日現在）

| 資産の種類                             | 国・地域名   | 時価合計<br>(オーストラリア・ドル)           | 投資比率<br>(%) |
|-----------------------------------|---------|--------------------------------|-------------|
| 債券                                | オーストラリア | 285,251,699.07                 | 75.05       |
|                                   | 米国      | 27,336,522.00                  | 7.19        |
|                                   | ノルウェー   | 14,344,568.00                  | 3.77        |
|                                   | イギリス    | 11,010,868.00                  | 2.90        |
|                                   | ドイツ     | 10,257,060.00                  | 2.70        |
|                                   | 国際機関    | 6,912,474.00                   | 1.82        |
|                                   | スイス     | 4,474,400.00                   | 1.18        |
|                                   | フィリピン   | 2,566,675.00                   | 0.68        |
|                                   | 日本      | 1,926,182.00                   | 0.51        |
|                                   | カナダ     | 1,235,772.00                   | 0.33        |
|                                   | 小計      | 365,316,220.07                 | 96.11       |
| モーゲージ担保証券 /<br>資産担保証券 /<br>その他割引債 | オーストラリア | 3,210,699.19                   | 0.84        |
| 投資有価証券合計                          |         | 368,526,919.26                 | 96.96       |
| 現金・その他の資産（負債控除後）                  |         | 11,562,232.66                  | 3.04        |
| 合計<br>(純資産総額)                     |         | 380,089,151.92<br>(約32,532百万円) | 100.00      |

（注1）投資比率とは、ファンドの各サブ・ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいう。以下同じ。

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

（注3）オーストラリア・ドル（以下「豪ドル」という。）、ユーロ、アメリカ合衆国ドル（以下「米ドル」という。）の円貨換算は、2021年10月29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＝85.59円、1ユーロ＝132.77円、1米ドル＝113.67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）

（2021年10月末日現在）

| 資産の種類 | 国・地域名    | 時価合計<br>(ユーロ) | 投資比率<br>(%) |
|-------|----------|---------------|-------------|
| 債券    | ニュージーランド | 21,252,613.62 | 10.29       |
|       | フランス     | 20,490,005.58 | 9.92        |
|       | 米国       | 14,368,963.62 | 6.96        |
|       | オランダ     | 14,322,631.83 | 6.93        |
|       | スペイン     | 13,868,072.67 | 6.71        |
|       | ドイツ      | 13,602,855.97 | 6.59        |
|       | イタリア     | 12,223,878.28 | 5.92        |
|       | イギリス     | 8,809,105.14  | 4.26        |
|       | ルクセンブルグ  | 7,931,809.82  | 3.84        |
|       | アイルランド   | 4,494,400.18  | 2.18        |
|       | ベルギー     | 3,933,484.69  | 1.90        |
|       | スロベニア    | 3,914,063.50  | 1.89        |
|       | ポルトガル    | 3,907,838.00  | 1.89        |
|       | 南アフリカ    | 3,262,547.90  | 1.58        |
|       | ロシア連邦    | 3,205,481.01  | 1.55        |
|       | オーストラリア  | 2,851,875.27  | 1.38        |
|       | オーストリア   | 2,425,545.60  | 1.17        |
|       | ギリシャ     | 2,336,952.13  | 1.13        |
|       | 国際機関     | 2,045,826.20  | 0.99        |
|       | メキシコ     | 1,971,390.06  | 0.95        |
|       | コスタリア    | 1,348,915.54  | 0.65        |
|       | ルーマニア    | 1,261,487.50  | 0.61        |
|       | ケイマン諸島   | 1,152,689.34  | 0.56        |
|       | スウェーデン   | 1,102,175.82  | 0.53        |
|       | ウクライナ    | 1,055,160.06  | 0.51        |
|       | スイス      | 1,033,262.00  | 0.50        |
|       | ベネズエラ    | 1,002,930.00  | 0.49        |
|       | インド      | 957,795.94    | 0.46        |
|       | カザフスタン   | 885,600.00    | 0.43        |
|       | ポーランド    | 880,942.50    | 0.43        |
|       | スロバキア    | 843,208.00    | 0.41        |
|       | トルコ      | 820,801.70    | 0.40        |
|       | ペルー      | 798,659.38    | 0.39        |
|       | サウジアラビア  | 714,875.00    | 0.35        |
|       | チリ       | 691,600.00    | 0.33        |
|       | オマーン     | 668,345.21    | 0.32        |
|       | 日本       | 667,350.12    | 0.32        |
|       | ウルグアイ    | 610,434.22    | 0.30        |

|                                   |         |                                |        |
|-----------------------------------|---------|--------------------------------|--------|
|                                   | インドネシア  | 602,518.26                     | 0.29   |
|                                   | フィリピン   | 504,937.50                     | 0.24   |
|                                   | 香港      | 503,218.75                     | 0.24   |
|                                   | ブラジル    | 500,745.30                     | 0.24   |
|                                   | モンゴル    | 484,985.95                     | 0.23   |
|                                   | コロンビア   | 478,181.03                     | 0.23   |
|                                   | モロッコ    | 477,100.88                     | 0.23   |
|                                   | ノルウェー   | 436,596.26                     | 0.21   |
|                                   | 中国      | 424,206.56                     | 0.21   |
|                                   | ブルガリア   | 406,534.68                     | 0.20   |
|                                   | フィンランド  | 402,325.82                     | 0.19   |
|                                   | グアテマラ   | 374,875.78                     | 0.18   |
|                                   | デンマーク   | 374,217.00                     | 0.18   |
|                                   | エジプト    | 373,500.00                     | 0.18   |
|                                   | バミューダ   | 278,509.88                     | 0.13   |
|                                   | ジャージー   | 251,255.96                     | 0.12   |
|                                   | アルゼンチン  | 235,326.61                     | 0.11   |
|                                   | エクアドル   | 221,103.98                     | 0.11   |
|                                   | カナダ     | 189,231.80                     | 0.09   |
|                                   | 小計      | 185,234,945.40                 | 89.68  |
| 投資信託                              | ルクセンブルグ | 8,166,345.30                   | 3.95   |
| モーゲージ担保证券 /<br>資産担保证券 /<br>その他割引債 | 米国      | 7,607,654.31                   | 3.68   |
| 従来型オプション                          | イギリス    | 40,260.40                      | 0.02   |
| 投資有価証券合計                          |         | 201,049,205.41                 | 97.33  |
| 現金・その他の資産（負債控除後）                  |         | 5,508,024.78                   | 2.67   |
| 合計<br>（純資産総額）                     |         | 206,557,230.19<br>(約27,425百万円) | 100.00 |

（フルサイクル・アジア・ボンド（米ドル））

（2021年10月末日現在）

| 資産の種類            | 国・地域名     | 時価合計<br>（米ドル）                  | 投資比率<br>（％） |
|------------------|-----------|--------------------------------|-------------|
| 債券               | ケイマン諸島    | 117,358,694.50                 | 16.38       |
|                  | 香港        | 103,247,748.23                 | 14.41       |
|                  | 英領ヴァージン諸島 | 72,474,105.33                  | 10.12       |
|                  | シンガポール    | 55,396,172.80                  | 7.73        |
|                  | 中国        | 51,524,409.53                  | 7.19        |
|                  | フィリピン     | 42,720,316.93                  | 5.96        |
|                  | 韓国        | 34,133,420.61                  | 4.77        |
|                  | 日本        | 22,794,424.52                  | 3.18        |
|                  | インド       | 22,335,606.62                  | 3.12        |
|                  | インドネシア    | 18,211,992.69                  | 2.54        |
|                  | タイ        | 16,052,535.63                  | 2.24        |
|                  | マレーシア     | 12,478,638.62                  | 1.74        |
|                  | イギリス      | 12,407,409.50                  | 1.73        |
|                  | 米国        | 9,210,831.74                   | 1.29        |
|                  | パキスタン     | 6,067,500.00                   | 0.85        |
|                  | ベトナム      | 5,423,625.00                   | 0.76        |
|                  | フランス      | 3,742,389.75                   | 0.52        |
|                  | マカオ       | 2,766,592.23                   | 0.39        |
|                  | モーリシャス    | 2,339,531.25                   | 0.33        |
|                  | スリランカ     | 1,914,906.25                   | 0.27        |
|                  | メキシコ      | 1,153,143.75                   | 0.16        |
|                  | オランダ      | 808,129.51                     | 0.11        |
|                  | モンゴル      | 483,180.00                     | 0.07        |
|                  | チリ        | 405,056.00                     | 0.06        |
|                  | 小計        | 615,450,360.99                 | 85.92       |
| 投資信託             | ルクセンブルグ   | 33,094,977.60                  | 4.62        |
|                  | 香港        | 13,279,064.68                  | 1.85        |
|                  | 小計        | 46,374,042.28                  | 6.47        |
| 投資有価証券合計         |           | 661,824,403.27                 | 92.40       |
| 現金・その他の資産（負債控除後） |           | 54,452,902.58                  | 7.60        |
| 合計<br>（純資産総額）    |           | 716,277,305.85<br>(約81,419百万円) | 100.00      |

（ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ））

（2021年10月末日現在）

| 資産の種類            | 国・地域名   | 時価合計<br>(ユーロ)                     | 投資比率<br>(%) |
|------------------|---------|-----------------------------------|-------------|
| 債券               | イギリス    | 236,807,571.36                    | 13.16       |
|                  | ルクセンブルグ | 217,519,169.71                    | 12.09       |
|                  | フランス    | 199,477,180.23                    | 11.09       |
|                  | 米国      | 182,955,433.02                    | 10.17       |
|                  | ドイツ     | 179,098,574.21                    | 9.95        |
|                  | イタリア    | 160,452,813.94                    | 8.92        |
|                  | オランダ    | 157,656,814.41                    | 8.76        |
|                  | スウェーデン  | 42,204,152.86                     | 2.35        |
|                  | デンマーク   | 41,336,400.08                     | 2.30        |
|                  | スペイン    | 37,166,744.29                     | 2.07        |
|                  | アイルランド  | 18,088,749.07                     | 1.01        |
|                  | 日本      | 16,490,306.99                     | 0.92        |
|                  | メキシコ    | 15,041,129.88                     | 0.84        |
|                  | ギリシャ    | 13,192,946.26                     | 0.73        |
|                  | パナマ     | 12,216,376.80                     | 0.68        |
|                  | ジャージー   | 11,741,447.19                     | 0.65        |
|                  | スイス     | 9,713,663.86                      | 0.54        |
|                  | チェコ共和国  | 9,386,959.38                      | 0.52        |
|                  | ベルギー    | 9,244,431.50                      | 0.51        |
|                  | ノルウェー   | 7,664,280.00                      | 0.43        |
|                  | ブルガリア   | 6,420,273.30                      | 0.36        |
|                  | フィンランド  | 5,292,972.44                      | 0.29        |
|                  | シンガポール  | 4,712,067.79                      | 0.26        |
|                  | ポルトガル   | 4,197,898.00                      | 0.23        |
|                  | オーストリア  | 4,189,664.00                      | 0.23        |
|                  | マーシャル諸島 | 3,534,357.74                      | 0.20        |
|                  | 小計      | 1,605,802,378.31                  | 89.24       |
| 投資信託             | アイルランド  | 61,158,845.71                     | 3.40        |
|                  | ルクセンブルグ | 15,329,274.69                     | 0.85        |
|                  | 小計      | 76,488,120.40                     | 4.25        |
| 投資有価証券合計         |         | 1,682,290,498.71                  | 93.50       |
| 現金・その他の資産（負債控除後） |         | 117,035,573.40                    | 6.50        |
| 合計<br>（純資産総額）    |         | 1,799,326,072.11<br>(約238,897百万円) | 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。

2021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）

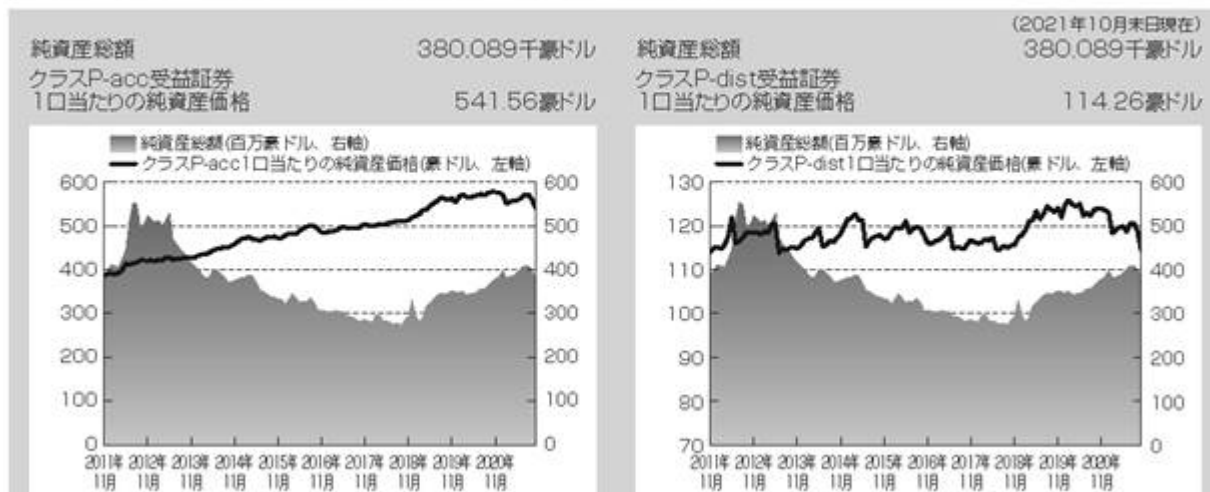
|             | 純資産総額   |        | １口当たり純資産価格               |                  |                  |
|-------------|---------|--------|--------------------------|------------------|------------------|
|             | 千豪ドル    | 百万円    | 受益証券の<br>クラス             | 豪ドル              | 円                |
| 2020年11月末日  | 377,473 | 32,308 | P - d i s t<br>P - a c c | 123.91<br>576.86 | 10,605<br>49,373 |
| 12月末日       | 382,894 | 32,772 | P - d i s t<br>P - a c c | 123.55<br>575.19 | 10,575<br>49,231 |
| 2021年 1 月末日 | 396,355 | 33,924 | P - d i s t<br>P - a c c | 122.97<br>572.46 | 10,525<br>48,997 |
| 2 月末日       | 382,666 | 32,752 | P - d i s t<br>P - a c c | 118.24<br>550.46 | 10,120<br>47,114 |
| 3 月末日       | 382,901 | 32,772 | P - d i s t<br>P - a c c | 119.04<br>554.17 | 10,189<br>47,431 |
| 4 月末日       | 386,045 | 33,042 | P - d i s t<br>P - a c c | 119.70<br>557.25 | 10,245<br>47,695 |
| 5 月末日       | 391,124 | 33,476 | P - d i s t<br>P - a c c | 119.92<br>558.28 | 10,264<br>47,783 |
| 6 月末日       | 401,168 | 34,336 | P - d i s t<br>P - a c c | 118.58<br>562.05 | 10,149<br>48,106 |
| 7 月末日       | 407,515 | 34,879 | P - d i s t<br>P - a c c | 120.56<br>571.43 | 10,319<br>48,909 |
| 8 月末日       | 407,768 | 34,901 | P - d i s t<br>P - a c c | 120.56<br>571.43 | 10,319<br>48,909 |
| 9 月末日       | 399,150 | 34,163 | P - d i s t<br>P - a c c | 118.66<br>562.43 | 10,156<br>48,138 |
| 10月末日       | 380,089 | 32,532 | P - d i s t<br>P - a c c | 114.26<br>541.56 | 9,780<br>46,352  |

（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。

## &lt; 参考情報 &gt;

## 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。

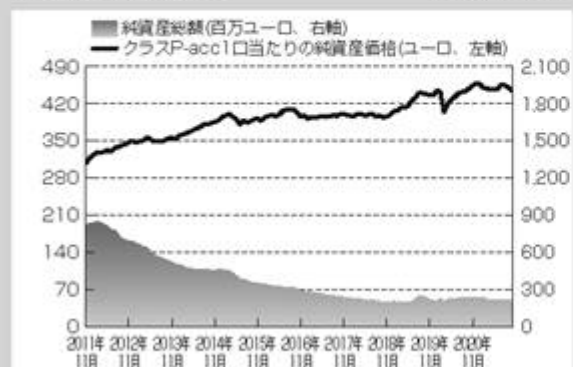
## （ユーロ・フレキシブル）

|             | 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<br>クラス             | ユーロ              | 円                |
| 2020年11月末日  | 231,713 | 30,765 | P - d i s t<br>P - a c c | 146.06<br>453.54 | 19,392<br>60,217 |
| 12月末日       | 234,852 | 31,181 | P - d i s t<br>P - a c c | 147.63<br>458.41 | 19,601<br>60,863 |
| 2021年 1 月末日 | 235,231 | 31,232 | P - d i s t<br>P - a c c | 147.12<br>456.83 | 19,533<br>60,653 |
| 2 月末日       | 230,019 | 30,540 | P - d i s t<br>P - a c c | 144.62<br>449.07 | 19,201<br>59,623 |
| 3 月末日       | 217,572 | 28,887 | P - d i s t<br>P - a c c | 144.27<br>447.97 | 19,155<br>59,477 |
| 4 月末日       | 217,613 | 28,892 | P - d i s t<br>P - a c c | 143.70<br>446.20 | 19,079<br>59,242 |
| 5 月末日       | 216,222 | 28,708 | P - d i s t<br>P - a c c | 144.02<br>447.20 | 19,122<br>59,375 |
| 6 月末日       | 212,451 | 28,207 | P - d i s t<br>P - a c c | 142.04<br>447.17 | 18,859<br>59,371 |
| 7 月末日       | 215,388 | 28,597 | P - d i s t<br>P - a c c | 144.74<br>455.67 | 19,217<br>60,499 |
| 8 月末日       | 215,143 | 28,565 | P - d i s t<br>P - a c c | 144.33<br>454.37 | 19,163<br>60,327 |
| 9 月末日       | 211,730 | 28,111 | P - d i s t<br>P - a c c | 142.92<br>449.94 | 18,975<br>59,739 |
| 10月末日       | 206,557 | 27,425 | P - d i s t<br>P - a c c | 140.87<br>443.47 | 18,703<br>58,880 |

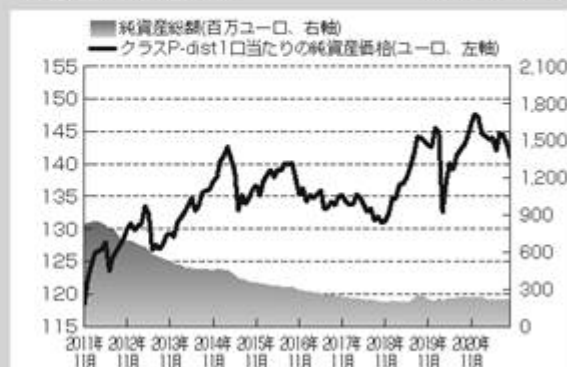
## &lt; 参考情報 &gt;

## 純資産総額および1口当たりの純資産価格の推移

純資産総額 206,557千ユーロ  
 クラスP-acc受益証券 1口当たりの純資産価格 443.47ユーロ



(2021年10月末日現在)  
 純資産総額 206,557千ユーロ  
 クラスP-dist受益証券 1口当たりの純資産価格 140.87ユーロ



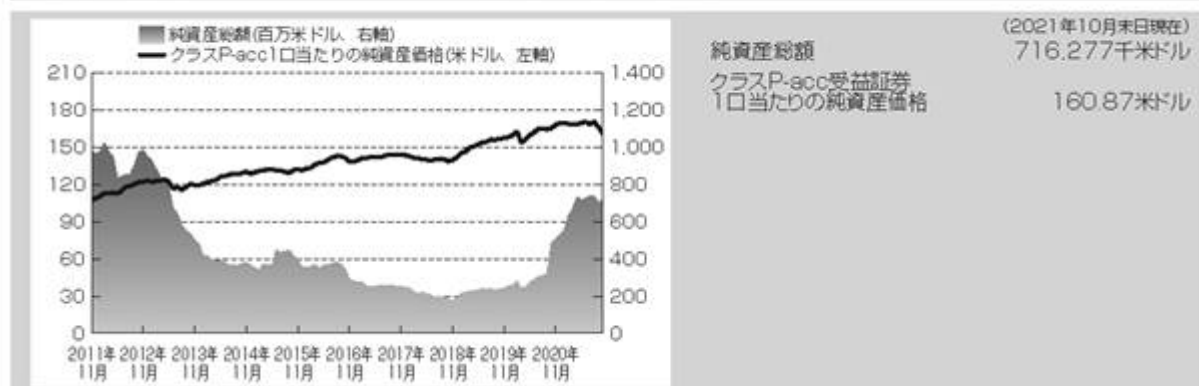
サブ・ファンドの運用実績は、あくまで過去の実績であり将来の運用成果を約束するものではない。

## （フルサイクル・アジア・ボンド（米ドル））

|            | 純資産総額   |        | 1口当たり純資産価格   |        |        |
|------------|---------|--------|--------------|--------|--------|
|            | 千米ドル    | 百万円    | 受益証券の<br>クラス | 米ドル    | 円      |
| 2020年11月末日 | 508,241 | 57,772 | P - a c c    | 167.92 | 19,087 |
| 12月末日      | 526,937 | 59,897 | P - a c c    | 169.39 | 19,255 |
| 2021年1月末日  | 555,073 | 63,095 | P - a c c    | 169.69 | 19,289 |
| 2月末日       | 629,657 | 71,573 | P - a c c    | 168.79 | 19,186 |
| 3月末日       | 670,961 | 76,268 | P - a c c    | 168.13 | 19,111 |
| 4月末日       | 729,350 | 82,905 | P - a c c    | 168.49 | 19,152 |
| 5月末日       | 719,913 | 81,833 | P - a c c    | 169.54 | 19,272 |
| 6月末日       | 723,077 | 82,192 | P - a c c    | 170.34 | 19,363 |
| 7月末日       | 739,839 | 84,097 | P - a c c    | 168.34 | 19,135 |
| 8月末日       | 736,591 | 83,728 | P - a c c    | 170.50 | 19,381 |
| 9月末日       | 699,667 | 79,531 | P - a c c    | 166.17 | 18,889 |
| 10月末日      | 716,277 | 81,419 | P - a c c    | 160.87 | 18,286 |

## &lt; 参考情報 &gt;

## 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））

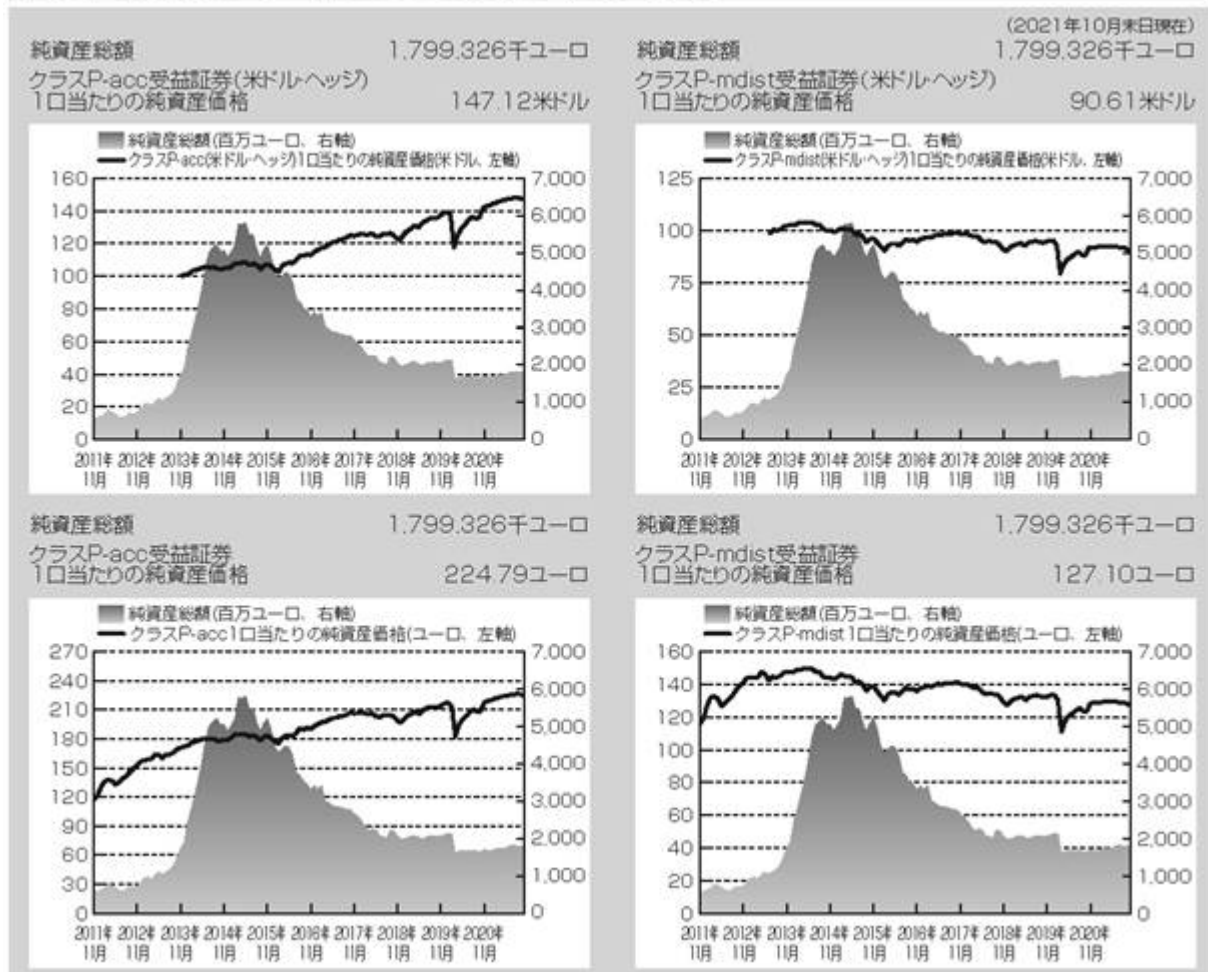
|             | 純資産総額     |         | 1口当たり純資産価格                 |           |        |
|-------------|-----------|---------|----------------------------|-----------|--------|
|             | 千ユーロ      | 百万円     | 受益証券の<br>クラス               |           | 円      |
| 2020年11月末日  | 1,703,737 | 226,205 | P - a c c<br>(米ドル・ヘッジ)     | 141.52米ドル | 16,087 |
|             |           |         | P - m d i s t<br>(米ドル・ヘッジ) | 91.58米ドル  | 10,410 |
|             |           |         | P - a c c                  | 217.67ユーロ | 28,900 |
|             |           |         | P - m d i s t              | 128.37ユーロ | 17,044 |
| 12月末日       | 1,673,454 | 222,184 | P - a c c<br>(米ドル・ヘッジ)     | 142.75米ドル | 16,226 |
|             |           |         | P - m d i s t<br>(米ドル・ヘッジ) | 91.96米ドル  | 10,453 |
|             |           |         | P - a c c                  | 219.24ユーロ | 29,108 |
|             |           |         | P - m d i s t              | 128.80ユーロ | 17,101 |
| 2021年 1 月末日 | 1,668,942 | 221,585 | P - a c c<br>(米ドル・ヘッジ)     | 143.48米ドル | 16,309 |
|             |           |         | P - m d i s t<br>(米ドル・ヘッジ) | 92.01米ドル  | 10,459 |
|             |           |         | P - a c c                  | 220.24ユーロ | 29,241 |
|             |           |         | P - m d i s t              | 128.89ユーロ | 17,113 |
| 2 月末日       | 1,718,545 | 228,171 | P - a c c<br>(米ドル・ヘッジ)     | 144.46米ドル | 16,421 |
|             |           |         | P - m d i s t<br>(米ドル・ヘッジ) | 92.22米ドル  | 10,483 |
|             |           |         | P - a c c                  | 221.68ユーロ | 29,432 |
|             |           |         | P - m d i s t              | 129.23ユーロ | 17,158 |
| 3 月末日       | 1,730,168 | 229,714 | P - a c c<br>(米ドル・ヘッジ)     | 145.21米ドル | 16,506 |
|             |           |         | P - m d i s t<br>(米ドル・ヘッジ) | 92.28米ドル  | 10,489 |
|             |           |         | P - a c c                  | 222.72ユーロ | 29,571 |
|             |           |         | P - m d i s t              | 129.33ユーロ | 17,171 |
| 4 月末日       | 1,735,949 | 230,482 | P - a c c<br>(米ドル・ヘッジ)     | 146.12米ドル | 16,609 |
|             |           |         | P - m d i s t<br>(米ドル・ヘッジ) | 92.44米ドル  | 10,508 |
|             |           |         | P - a c c                  | 223.91ユーロ | 29,729 |
|             |           |         | P - m d i s t              | 129.51ユーロ | 17,195 |
| 5 月末日       | 1,741,311 | 231,194 | P - a c c<br>(米ドル・ヘッジ)     | 146.56米ドル | 16,659 |
|             |           |         | P - m d i s t<br>(米ドル・ヘッジ) | 92.30米ドル  | 10,492 |
|             |           |         | P - a c c                  | 224.41ユーロ | 29,795 |
|             |           |         | P - m d i s t              | 129.30ユーロ | 17,167 |

|       | 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<br>クラス               |           | 円      |
| 6月末日  | 1,798,773 | 238,823 | P - a c c<br>(米ドル・ヘッジ)     | 147.20米ドル | 16,732 |
|       |           |         | P - m d i s t<br>(米ドル・ヘッジ) | 92.30米ドル  | 10,492 |
|       |           |         | P - a c c                  | 225.37ユーロ | 29,922 |
|       |           |         | P - m d i s t              | 129.37ユーロ | 17,176 |
| 7月末日  | 1,822,076 | 241,917 | P - a c c<br>(米ドル・ヘッジ)     | 147.51米ドル | 16,767 |
|       |           |         | P - m d i s t<br>(米ドル・ヘッジ) | 92.08米ドル  | 10,467 |
|       |           |         | P - a c c                  | 225.70ユーロ | 29,966 |
|       |           |         | P - m d i s t              | 129.07ユーロ | 17,137 |
| 8月末日  | 1,803,134 | 239,402 | P - a c c<br>(米ドル・ヘッジ)     | 148.11米ドル | 16,836 |
|       |           |         | P - m d i s t<br>(米ドル・ヘッジ) | 92.04米ドル  | 10,462 |
|       |           |         | P - a c c                  | 226.52ユーロ | 30,075 |
|       |           |         | P - m d i s t              | 129.05ユーロ | 17,134 |
| 9月末日  | 1,811,103 | 240,460 | P - a c c<br>(米ドル・ヘッジ)     | 148.00米ドル | 16,823 |
|       |           |         | P - m d i s t<br>(米ドル・ヘッジ) | 91.57米ドル  | 10,409 |
|       |           |         | P - a c c                  | 226.27ユーロ | 30,042 |
|       |           |         | P - m d i s t              | 128.41ユーロ | 17,049 |
| 10月末日 | 1,799,326 | 238,897 | P - a c c<br>(米ドル・ヘッジ)     | 147.12米ドル | 16,723 |
|       |           |         | P - m d i s t<br>(米ドル・ヘッジ) | 90.61米ドル  | 10,300 |
|       |           |         | P - a c c                  | 224.79ユーロ | 29,845 |
|       |           |         | P - m d i s t              | 127.10ユーロ | 16,875 |

（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。

## &lt; 参考情報 &gt;

## 純資産総額および1口当たりの純資産価格の推移



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

## 分配の推移

分配の推移については、以下の内容が原届出書に追加されます。

(オーストラリア・ドル) (クラスP - d i s t 受益証券)

| 期間      | 1口当たりの分配金額 (豪ドル) |
|---------|------------------|
| 第32会計年度 | 2.14 (約183円)     |

(ユーロ・フレキシブル) (クラスP - d i s t 受益証券)

| 期間      | 1口当たりの分配金額 (ユーロ) |
|---------|------------------|
| 第32会計年度 | 1.97 (約262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） |
|----------|-----------------|
| 2020年10月 | 0.40 （約45円）     |
| 11月      | 0.42 （約48円）     |
| 12月      | 0.42 （約48円）     |
| 2021年1月  | 0.42 （約48円）     |
| 2月       | 0.42 （約48円）     |
| 3月       | 0.42 （約48円）     |
| 4月       | 0.41 （約47円）     |
| 5月       | 0.41 （約47円）     |
| 6月       | 0.41 （約47円）     |
| 7月       | 0.41 （約47円）     |
| 8月       | 0.41 （約47円）     |
| 9月       | 0.41 （約47円）     |
| 直近1年累計   | 4.96 （約564円）    |
| 設定来累計    | 51.18 （約5,818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）  |
|----------|------------------|
| 2020年10月 | 0.48 （約64円）      |
| 11月      | 0.50 （約66円）      |
| 12月      | 0.50 （約66円）      |
| 2021年1月  | 0.50 （約66円）      |
| 2月       | 0.51 （約68円）      |
| 3月       | 0.51 （約68円）      |
| 4月       | 0.49 （約65円）      |
| 5月       | 0.49 （約65円）      |
| 6月       | 0.49 （約65円）      |
| 7月       | 0.49 （約65円）      |
| 8月       | 0.49 （約65円）      |
| 9月       | 0.48 （約64円）      |
| 直近1年累計   | 5.93 （約787円）     |
| 設定来累計    | 96.11 （約12,761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。

2021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<br>受益証券 | クラスP - a c c<br>受益証券 |
| （オーストラリア・ドル）              | - 6.11                 | - 6.17               |
| （ユーロ・フレキシブル）              | - 0.92                 | - 0.93               |
| （フルサイクル・アジア・ボンド<br>（米ドル）） | -                      | - 2.55               |

## （ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ））

| 収益率（％）                            |                                       |                      |                          |
|-----------------------------------|---------------------------------------|----------------------|--------------------------|
| クラスP - a c c<br>受益証券<br>（米ドル・ヘッジ） | クラスP - m d i s t<br>受益証券<br>（米ドル・ヘッジ） | クラスP - a c c<br>受益証券 | クラスP - m d i s t<br>受益証券 |
| 8.57                              | 8.50                                  | 7.76                 | 7.73                     |

（注1）収益率（％）＝ $100 \times (a - b) / b$

a＝2021年10月末日の1口当たり純資産価格（当該期間の分配金の合計額を加えた額）

b＝当該期間の直前の日の1口当たり純資産価格（分配落の額）。

（注2）「収益率」は日本で販売しているクラスのみ記載している。

## （４）販売及び買戻しの実績

販売及び買戻しの実績については、以下の内容が原届出書に追加されます。

2021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2021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 | 111,497.0280<br>( 0 ) | 142,590.1500<br>( 0 )       | 688,085.2580<br>( 3,956 ) |
| P - a c c   | 51,375.2160<br>( 0 )  | 45,423.0970<br>( 446.6190 ) | 298,072.6270<br>( 1,678 ) |

（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 | 12,696.4170<br>( 0 ) | 33,918.2630<br>( 0 ) | 296,319.2600<br>( 854 )     |
| P - a c c   | 18,769.7400<br>( 0 ) | 36,284.6340<br>( 0 ) | 268,612.1450<br>( 629.361 ) |

## （フルサイクル・アジア・ボンド（米ドル））

|           | 販売口数                            | 買戻し口数                          | 発行済口数                           |
|-----------|---------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|
| P - a c c | 151,046.3990<br>( 10,692.9570 ) | 150,366.9210<br>( 4,832.2510 ) | 289,924.3460<br>( 20,818.8160 ) |

## （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<br>( 米ドル・ヘッジ )     | 428,279.6700<br>( 0 )          | 427,133.6800<br>( 13,803.2670 )  | 360,956.4360<br>( 23,828.210 )    |
| P - m d i s t<br>( 米ドル・ヘッジ ) | 337,697.8020<br>( 0 )          | 852,660.5020<br>( 110,119.7980 ) | 2,690,741.6200<br>( 45,627.9300 ) |
| P - a c c                    | 126,334.2190<br>( 894.2940 )   | 215,828.1940<br>( 10,150 )       | 887,637.7650<br>( 21,134.1590 )   |
| P - m d i s t                | 131,606.5910<br>( 5,736.4340 ) | 213,000.3040<br>( 3,500 )        | 925,124.4880<br>( 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<br>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<br>クラスP - d i s t 受益証券                                                                 |
| 3) - フルサイクル・アジア・ボンド（米ドル） | クラスP - a c c 受益証券                                                                                        |
| 4) - ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）    | クラスP - a c c 受益証券<br>クラスP - m d i s t 受益証券<br>クラスP - a c c（米ドル・ヘッジ）受益証券<br>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2021年10月29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＝85.59円、1ユーロ＝132.77円、1米ドル＝113.67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

2021年9月30日現在

|                                   | UBS（Lux）ボンド・ファンド |              |
|-----------------------------------|------------------|--------------|
|                                   | 結 合              |              |
|                                   | ユーロ              | 千 円          |
| 資 産                               |                  |              |
| 投資有価証券取得原価                        | 3,887,238,666.12 | 516,108,678  |
| 投資有価証券未実現評価（損）益                   | 26,054,757.97    | 3,459,290    |
| 投資有価証券合計（注１）                      | 3,913,293,424.09 | 519,567,968  |
| 現金預金、要求払い預金および貯蓄預金                | 256,164,701.12 * | 34,010,987   |
| その他の流動資産（委託証拠金）                   | 5,197,253.30     | 690,039      |
| 有価証券売却未収金（注１）                     | 14,268,587.52    | 1,894,440    |
| 発行受益証券未収金                         | 11,164,086.44    | 1,482,256    |
| 未収有価証券利息                          | 38,613,994.60    | 5,126,780    |
| 流動資産に係る未収利息                       | 43,691.21        | 5,801        |
| その他の未収金                           | 7,580,602.29     | 1,006,477    |
| 金融先物に係る未実現利益（注１）                  | 595,504.25       | 79,065       |
| 為替予約契約に係る未実現利益（注１）                | 6,672,770.04     | 885,944      |
| スワップに係る未実現利益（注１）                  | 6,702,396.00     | 889,877      |
| 資産合計                              | 4,260,297,010.86 | 565,639,634  |
| 負 債                               |                  |              |
| T B A モーゲージ・バック証券に係る<br>未実現損失（注１） | (63,378.07)      | (8,415)      |
| 金融先物に係る未実現損失（注１）                  | (147,507.22)     | (19,585)     |
| 為替予約契約に係る未実現損失（注１）                | (5,438,311.26)   | (722,045)    |
| 当座借越                              | (15,996,995.65)  | (2,123,921)  |
| 当座借越に係る未払利息                       | (60,238.67)      | (7,998)      |
| その他の流動負債（委託証拠金）                   | (268,858.34)     | (35,696)     |
| 有価証券購入未払金（注１）                     | (54,982,783.91)  | (7,300,064)  |
| 買戻受益証券未払金                         | (7,339,390.74)   | (974,451)    |
| 報酬引当金（注２）                         | (1,220,378.10)   | (162,030)    |
| 年次税引当金（注３）                        | (335,794.44)     | (44,583)     |
| その他の手数料および報酬に係る引当金（注２）            | (554,680.94)     | (73,645)     |
| 引当金合計                             | (2,110,853.48)   | (280,258)    |
| 負債合計                              | (86,408,317.34)  | (11,472,432) |
| 期末現在純資産額                          | 4,173,888,693.52 | 554,167,202  |

\* 2021年9月30日現在、106,000.00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および770,000.00ユーロの現金が取引相手方であるバンク・オブ・アメリカに対する担保となっている。

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

## 純 資 産 計 算 書

2021年9月30日現在

## U B S（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

|                        |                |            |
|------------------------|----------------|------------|
| <b>資 産</b>             |                |            |
| 投資有価証券取得原価             | 391,286,198.15 | 33,490,186 |
| 投資有価証券未実現評価（損）益        | (528,582.78)   | (45,241)   |
| 投資有価証券合計（注１）           | 390,757,615.37 | 33,444,944 |
| 現金預金、要求払い預金および貯蓄預金     | 8,162,811.87   | 698,655    |
| その他の流動資産（委託証拠金）        | 133,696.72     | 11,443     |
| 発行受益証券未収金              | 48,985.78      | 4,193      |
| 未収有価証券利息               | 2,484,454.81   | 212,644    |
| 流動資産に係る未収利息            | 47,505.25      | 4,066      |
| その他の未収金                | 61,229.97      | 5,241      |
| 金融先物に係る未実現利益（注１）       | 155,568.18     | 13,315     |
| 資産合計                   | 401,851,867.95 | 34,394,501 |
| <b>負 債</b>             |                |            |
| 有価証券購入未払金（注１）          | (2,296,970.00) | (196,598)  |
| 買戻受益証券未払金              | (223,605.02)   | (19,138)   |
| 報酬引当金（注２）              | (99,259.47)    | (8,496)    |
| 年次税引当金（注３）             | (41,665.61)    | (3,566)    |
| その他の手数料および報酬に係る引当金（注２） | (40,426.18)    | (3,460)    |
| 引当金合計                  | (181,351.26)   | (15,522)   |
| 負債合計                   | (2,701,926.28) | (231,258)  |
| 期末現在純資産額               | 399,149,941.67 | 34,163,244 |

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

## 純 資 産 計 算 書

2021年9月30日現在

## U B S（Lux）ボンド・ファンド

## - ユーロ・フレキシブル

ユーロ 千 円

| 資 産                    |                |            |
|------------------------|----------------|------------|
| 投資有価証券取得原価             | 194,919,152.19 | 25,879,416 |
| 投資有価証券未実現評価（損）益        | 10,592,123.63  | 1,406,316  |
| 投資有価証券合計（注１）           | 205,511,275.82 | 27,285,732 |
| 現金預金、要求払い預金および貯蓄預金     | 7,069,864.80 * | 938,666    |
| その他の流動資産（委託証拠金）        | 1,432,969.25   | 190,255    |
| 発行受益証券未収金              | 103,253.84     | 13,709     |
| 未収有価証券利息               | 1,655,306.95   | 219,775    |
| 流動資産に係る未収利息            | 15.55          | 2          |
| その他の未収金                | 41,405.72      | 5,497      |
| スワップに係る未実現利益（注１）       | 2,352,851.91   | 312,388    |
| 資産合計                   | 218,166,943.84 | 28,966,025 |
| 負 債                    |                |            |
| 金融先物に係る未実現損失（注１）       | (147,507.22)   | (19,585)   |
| 為替予約契約に係る未実現損失（注１）     | (664,186.28)   | (88,184)   |
| 当座借越                   | (3,977,685.19) | (528,117)  |
| 当座借越に係る未払利息            | (9.42)         | (1)        |
| 有価証券購入未払金（注１）          | (1,166,216.94) | (154,839)  |
| 買戻受益証券未払金              | (367,671.24)   | (48,816)   |
| 報酬引当金（注２）              | (70,452.39)    | (9,354)    |
| 年次税引当金（注３）             | (21,804.24)    | (2,895)    |
| その他の手数料および報酬に係る引当金（注２） | (21,651.36)    | (2,875)    |
| 引当金合計                  | (113,907.99)   | (15,124)   |
| 負債合計                   | (6,437,184.28) | (854,665)  |
| 期末現在純資産額               | 211,729,759.56 | 28,111,360 |

\* 2021年9月30日現在、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および410,000.00ユーロの現金が取引相手方であるバンク・オブ・アメリカに対する担保となっている。

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

## 純 資 産 計 算 書

2021年9月30日現在

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

|                        | 米ドル             | 千 円         |
|------------------------|-----------------|-------------|
| <b>資 産</b>             |                 |             |
| 投資有価証券取得原価             | 642,679,823.07  | 73,053,415  |
| 投資有価証券未実現評価（損）益        | (17,147,258.32) | (1,949,129) |
| 投資有価証券合計（注１）           | 625,532,564.75  | 71,104,287  |
| 現金預金、要求払い預金および貯蓄預金     | 95,803,862.16   | 10,890,025  |
| その他の流動資産（委託証拠金）        | 209,020.13      | 23,759      |
| 発行受益証券未収金              | 2,273,597.78    | 258,440     |
| 未収有価証券利息               | 6,285,441.59    | 714,466     |
| その他の未収金                | 8,417,205.44    | 956,784     |
| 金融先物に係る未実現利益（注１）       | 421,015.74      | 47,857      |
| 資産合計                   | 738,942,707.59  | 83,995,618  |
| <b>負 債</b>             |                 |             |
| 為替予約契約に係る未実現損失（注１）     | (3,558,271.86)  | (404,469)   |
| 当座借越に係る未払利息            | (6.85)          | (1)         |
| 有価証券購入未払金（注１）          | (33,094,987.68) | (3,761,907) |
| 買戻受益証券未払金              | (2,317,981.32)  | (263,485)   |
| 報酬引当金（注２）              | (188,071.98)    | (21,378)    |
| 年次税引当金（注３）             | (46,309.50)     | (5,264)     |
| その他の手数料および報酬に係る引当金（注２） | (70,287.15)     | (7,990)     |
| 引当金合計                  | (304,668.63)    | (34,632)    |
| 負債合計                   | (39,275,916.34) | (4,464,493) |
| 期末現在純資産額               | 699,666,791.25  | 79,531,124  |

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

2021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         |
| <b>資 産</b>             |                    |             |
| 投資有価証券取得原価             | 1,674,452,046.56   | 222,316,998 |
| 投資有価証券未実現評価（損）益        | 34,988,007.59      | 4,645,358   |
| 投資有価証券合計（注１）           | 1,709,440,054.15   | 226,962,356 |
| 現金預金、要求払い預金および貯蓄預金     | 60,420,026.57      | 8,021,967   |
| 有価証券売却未収金（注１）          | 14,262,326.51      | 1,893,609   |
| 発行受益証券未収金              | 8,200,732.63       | 1,088,811   |
| 未収有価証券利息               | 23,899,167.42      | 3,173,092   |
| 流動資産に係る未収利息            | 7,300.55           | 969         |
| 為替予約契約に係る未実現利益（注１）     | 5,878,707.22       | 780,516     |
| スワップに係る未実現利益（注１）       | 3,660,730.97       | 486,035     |
| 資産合計                   | 1,825,769,046.02   | 242,407,356 |
| <b>負 債</b>             |                    |             |
| 当座借越                   | (2,197,182.30)     | (291,720)   |
| その他の短期負債（委託証拠金）        | (268,858.34)       | (35,696)    |
| 当座借越に係る未払利息            | (44,129.74)        | (5,859)     |
| 有価証券購入未払金（注１）          | (7,587,431.12)     | (1,007,383) |
| 買戻受益証券未払金              | (3,448,811.13)     | (457,899)   |
| 報酬引当金（注２）              | (640,153.61)       | (84,993)    |
| 年次税引当金（注３）             | (160,835.74)       | (21,354)    |
| その他の手数料および報酬に係る引当金（注２） | (318,383.50)       | (42,272)    |
| 引当金合計                  | (1,119,372.85)     | (148,619)   |
| 負債合計                   | (14,665,785.48)    | (1,947,176) |
| 期末現在純資産額               | 1,811,103,260.54   | 240,460,180 |

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S（Lux）ボンド・ファンド  
運 用 計 算 書  
自2021年4月1日 至2021年9月30日

| U B S（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            | 62,315.08       | 8,274       |
| 有価証券に係る利息            | 63,883,140.60   | 8,481,765   |
| 配当金                  | 665,705.77      | 88,386      |
| スワップに係る受取利息（注1）      | 5,073,577.10    | 673,619     |
| 貸付有価証券に係る純利益         | 613,932.14      | 81,512      |
| その他の収益               | 338,663.12      | 44,964      |
| 収益合計                 | 70,637,333.81   | 9,378,519   |
| 費 用                  |                 |             |
| スワップに係る支払利息（注1）      | (3,857,173.74)  | (512,117)   |
| 報酬（注2）               | (14,976,414.23) | (1,988,419) |
| 年次税（注3）              | (672,426.82)    | (89,278)    |
| その他の手数料および報酬（注2）     | (405,712.64)    | (53,866)    |
| 現金および当座借越に係る利息       | (405,294.10)    | (53,811)    |
| その他の費用               | (412,736.49)    | (54,799)    |
| 費用合計                 | (20,729,758.02) | (2,752,290) |
| 投資に係る純（損）益           | 49,907,575.79   | 6,626,229   |
| 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        | 35,062,837.10   | 4,655,293   |
| 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      | 74,562.32       | 9,900       |
| 金融先物に係る実現（損）益        | (1,715,725.23)  | (227,797)   |
| 為替予約契約に係る実現（損）益      | 2,226,429.47    | 295,603     |
| スワップに係る実現（損）益        | (2,584,497.42)  | (343,144)   |
| 外国為替に係る実現（損）益        | (2,965,653.28)  | (393,750)   |
| 実現（損）益合計             | 30,097,952.96   | 3,996,105   |
| 当期実現純（損）益            | 80,005,528.75   | 10,622,334  |
| 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     | (36,446,264.71) | (4,838,971) |
| オプションに係る未実現評価（損）益    | 30,551.54       | 4,056       |
| 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   | (289,172.95)    | (38,393)    |
| T B A モーゲージ・バック証券に係る |                 |             |
| 未実現評価（損）益            | 16,864.82       | 2,239       |
| 金融先物に係る未実現評価（損）益     | (49,085.58)     | (6,517)     |
| 為替予約契約に係る未実現評価（損）益   | 267,328.36      | 35,493      |
| スワップに係る未実現評価（損）益     | 1,397,606.79    | 185,560     |
| 未実現評価（損）益の変動合計       | (35,072,171.73) | (4,656,532) |
| 運用の結果による純資産の純増（減）    | 44,933,357.02   | 5,965,802   |

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2021年4月1日 至2021年9月30日

| UBS（Lux）ボンド・ファンド<br>- オーストラリア・ドル |                |           |
|----------------------------------|----------------|-----------|
|                                  | オーストラリア・ドル     | 千 円       |
| 収 益                              |                |           |
| 有価証券に係る利息                        | 4,744,933.74   | 406,119   |
| 貸付有価証券に係る純利益                     | 208.22         | 18        |
| 収益合計                             | 4,745,141.96   | 406,137   |
| 費 用                              |                |           |
| 報酬（注2）                           | (1,200,379.72) | (102,741) |
| 年次税（注3）                          | (84,556.94)    | (7,237)   |
| その他の手数料および報酬（注2）                 | (39,497.72)    | (3,381)   |
| 現金および当座借越に係る利息                   | (122,291.55)   | (10,467)  |
| その他の費用                           | (11,454.77)    | (980)     |
| 費用合計                             | (1,458,180.70) | (124,806) |
| 投資に係る純（損）益                       | 3,286,961.26   | 281,331   |
| 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                    | 771,658.01     | 66,046    |
| 金融先物に係る実現（損）益                    | 149,250.21     | 12,774    |
| 外国為替に係る実現（損）益                    | 588.96         | 50        |
| 実現（損）益合計                         | 921,497.18     | 78,871    |
| 当期実現純（損）益                        | 4,208,458.44   | 360,202   |
| 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                 | 1,750,949.69   | 149,864   |
| 金融先物に係る未実現評価（損）益                 | 174,415.74     | 14,928    |
| 未実現評価（損）益の変動合計                   | 1,925,365.43   | 164,792   |
| 運用の結果による純資産の純増（減）                | 6,133,823.87   | 524,994   |

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S（Lux）ボンド・ファンド  
運 用 計 算 書  
自2021年4月1日 至2021年9月30日

U B S（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          | 8,964.00       | 1,190     |
| 有価証券に係る利息          | 2,553,387.33   | 339,013   |
| 配当金                | 255,099.89     | 33,870    |
| スワップに係る受取利息（注１）    | 1,520,491.01   | 201,876   |
| 貸付有価証券に係る純利益       | 29,584.27      | 3,928     |
| その他の収益             | 5,461.54       | 725       |
| 収益合計               | 4,372,988.04   | 580,602   |
| 費 用                |                |           |
| スワップに係る支払利息（注１）    | (1,284,955.03) | (170,603) |
| 報酬（注２）             | (873,866.41)   | (116,023) |
| 年次税（注３）            | (44,290.63)    | (5,880)   |
| その他の手数料および報酬（注２）   | (21,337.21)    | (2,833)   |
| 現金および当座借越に係る利息     | (39,129.25)    | (5,195)   |
| その他の費用             | (11,914.44)    | (1,582)   |
| 費用合計               | (2,275,492.97) | (302,117) |
| 投資に係る純（損）益         | 2,097,495.07   | 278,484   |
| 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      | (86,314.90)    | (11,460)  |
| 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    | (3,552.25)     | (472)     |
| 金融先物に係る実現（損）益      | 713,369.01     | 94,714    |
| 為替予約契約に係る実現（損）益    | (1,799,057.92) | (238,861) |
| スワップに係る実現（損）益      | (1,770,324.27) | (235,046) |
| 外国為替に係る実現（損）益      | 633,209.47     | 84,071    |
| 実現（損）益合計           | (2,312,670.86) | (307,053) |
| 当期実現純（損）益          | (215,175.79)   | (28,569)  |
| 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   | (361,667.05)   | (48,019)  |
| オプションに係る未実現評価（損）益  | 12,989.83      | 1,725     |
| 利回り評価有価証券および       |                |           |
| 短期金融商品に係る未実現評価（損）益 | (19,893.13)    | (2,641)   |
| 金融先物に係る未実現評価（損）益   | (190,708.47)   | (25,320)  |
| 為替予約契約に係る未実現評価（損）益 | 167,769.11     | 22,275    |
| スワップに係る未実現評価（損）益   | 1,613,297.46   | 214,198   |
| 未実現評価（損）益の変動合計     | 1,221,787.75   | 162,217   |
| 運用の結果による純資産の純増（減）  | 1,006,611.96   | 133,648   |

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S（Lux）ボンド・ファンド  
運 用 計 算 書  
自2021年4月1日 至2021年9月30日

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

|                    | 米ドル             | 千 円         |
|--------------------|-----------------|-------------|
| 収 益                |                 |             |
| 流動資産に係る利息          | 241.82          | 27          |
| 有価証券に係る利息          | 12,982,438.74   | 1,475,714   |
| 貸付有価証券に係る純利益       | 107,092.55      | 12,173      |
| 収益合計               | 13,089,773.11   | 1,487,915   |
| 費 用                |                 |             |
| 報酬（注2）             | (2,461,807.34)  | (279,834)   |
| 年次税（注3）            | (96,197.35)     | (10,935)    |
| その他の手数料および報酬（注2）   | (71,816.24)     | (8,163)     |
| 現金および当座借越に係る利息     | (9,281.72)      | (1,055)     |
| その他の費用             | (21,202.70)     | (2,410)     |
| 費用合計               | (2,660,305.35)  | (302,397)   |
| 投資に係る純（損）益         | 10,429,467.76   | 1,185,518   |
| 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      | 5,656,370.43    | 642,960     |
| 金融先物に係る実現（損）益      | (3,542,647.97)  | (402,693)   |
| 為替予約契約に係る実現（損）益    | (6,451,041.39)  | (733,290)   |
| 外国為替に係る実現（損）益      | 286,608.47      | 32,579      |
| 実現（損）益合計           | (4,050,710.46)  | (460,444)   |
| 当期実現純（損）益          | 6,378,757.30    | 725,073     |
| 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   | (18,097,462.82) | (2,057,139) |
| 金融先物に係る未実現評価（損）益   | (605,390.40)    | (68,815)    |
| 為替予約契約に係る未実現評価（損）益 | (473,850.16)    | (53,863)    |
| 未実現評価（損）益の変動合計     | (19,176,703.38) | (2,179,816) |
| 運用の結果による純資産の純増（減）  | (12,797,946.08) | (1,454,743) |

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2021年4月1日 至2021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          | 11,818.50       | 1,569       |
| 有価証券に係る利息          | 38,577,326.36   | 5,121,912   |
| スワップに係る受取利息（注1）    | 1,520,571.08    | 201,886     |
| 貸付有価証券に係る純利益       | 453,412.00      | 60,200      |
| 収益合計               | 40,563,127.94   | 5,385,566   |
| 費 用                |                 |             |
| スワップに係る支払利息（注1）    | (819,509.01)    | (108,806)   |
| 報酬（注2）             | (7,736,619.89)  | (1,027,191) |
| 年次税（注3）            | (319,326.07)    | (42,397)    |
| その他の手数料および報酬（注2）   | (176,731.75)    | (23,465)    |
| 現金および当座借越に係る利息     | (148,989.73)    | (19,781)    |
| その他の費用             | (247,755.45)    | (32,894)    |
| 費用合計               | (9,448,931.90)  | (1,254,535) |
| 投資に係る純（損）益         | 31,114,196.04   | 4,131,032   |
| 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      | 18,766,576.11   | 2,491,638   |
| 為替予約契約に係る実現（損）益    | 10,532,241.52   | 1,398,366   |
| スワップに係る実現（損）益      | (35,488.27)     | (4,712)     |
| 外国為替に係る実現（損）益      | (4,099,496.32)  | (544,290)   |
| 実現（損）益合計           | 25,163,833.04   | 3,341,002   |
| 当期実現純（損）益          | 56,278,029.08   | 7,472,034   |
| 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   | (16,579,552.57) | (2,201,267) |
| 為替予約契約に係る未実現評価（損）益 | (94,457.85)     | (12,541)    |
| スワップに係る未実現評価（損）益   | (742,545.81)    | (98,588)    |
| 未実現評価（損）益の変動合計     | (17,416,556.23) | (2,312,396) |
| 運用の結果による純資産の純増（減）  | 38,861,472.85   | 5,159,638   |

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  
純 資 産 変 動 計 算 書  
自2021年4月1日 至2021年9月30日

|                   | U B S（Lux）ボンド・ファンド |              |
|-------------------|--------------------|--------------|
|                   | 結 合                |              |
|                   | ユーロ                | 千 円          |
| 期首現在純資産額          | 3,963,927,287.61 * | 526,290,626  |
| 受益証券発行            | 690,308,334.79     | 91,652,238   |
| 受益証券買戻し           | (495,255,343.60)   | (65,755,052) |
| 受益証券発行（買戻し）純額合計   | 195,052,991.19     | 25,897,186   |
| 支払分配金             | (30,024,942.30)    | (3,986,412)  |
| 純投資（損）益           | 49,907,575.79      | 6,626,229    |
| 実現（損）益合計          | 30,097,952.96      | 3,996,105    |
| 未実現評価（損）益の変動合計    | (35,072,171.73)    | (4,656,532)  |
| 運用の結果による純資産の純増（減） | 44,933,357.02      | 5,965,802    |
| 期末現在純資産額          | 4,173,888,693.52   | 554,167,202  |

\* 2021年9月30日の為替レートを使用して計算された。2021年3月31日の為替レートを使用して計算された当期の期首現在純資産額は、3,948,984,458.83ユーロであった。

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  
純 資 産 変 動 計 算 書  
自2021年4月1日 至2021年9月30日

| U B S（Lux）ボンド・ファンド<br>- 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                           | 382,900,537.66  | 32,772,457  |
| 受益証券発行                             | 35,978,711.42   | 3,079,418   |
| 受益証券買戻し                            | (22,736,095.51) | (1,945,982) |
| 受益証券発行（買戻し）純額合計                    | 13,242,615.91   | 1,133,435   |
| 支払分配金                              | (3,127,035.77)  | (267,643)   |
| 純投資（損）益                            | 3,286,961.26    | 281,331     |
| 実現（損）益合計                           | 921,497.18      | 78,871      |
| 未実現評価（損）益の変動合計                     | 1,925,365.43    | 164,792     |
| 運用の結果による純資産の純増（減）                  | 6,133,823.87    | 524,994     |
| 期末現在純資産額                           | 399,149,941.67  | 34,163,244  |

発行済受益証券数の変動  
自2021年4月1日 至2021年9月30日

| クラス          | P-acc         | P-dist        |
|--------------|---------------|---------------|
| 期首現在発行済受益証券数 | 294,461.4790  | 683,458.3790  |
| 発行受益証券数      | 23,822.7500   | 72,888.9630   |
| 買戻受益証券数      | (17,495.0270) | (63,090.0140) |
| 期末現在発行済受益証券数 | 300,789.2020  | 693,257.3280  |

| 年次分配金 <sup>1</sup>              |           |           |                  |         |
|---------------------------------|-----------|-----------|------------------|---------|
| U B S（Lux）ボンド・ファンド - オーストラリア・ドル |           |           |                  |         |
|                                 | 権利落ち日     | 支払日       | 通貨<br>オーストラリア・ドル | 1口当たり金額 |
| P-dist                          | 2021年6月1日 | 2021年6月4日 | ドル               | 2.14    |

<sup>1</sup> 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。

U B S（Lux）ボンド・ファンド  
純資産変動計算書  
自2021年4月1日 至2021年9月30日

|                   | U B S（Lux）ボンド・ファンド<br>- ユーロ・フレキシブル |             |
|-------------------|------------------------------------|-------------|
|                   | ユーロ                                | 千 円         |
| 期首現在純資産額          | 217,572,340.82                     | 28,887,080  |
| 受益証券発行            | 43,395,277.28                      | 5,761,591   |
| 受益証券買戻し           | (49,612,654.93)                    | (6,587,072) |
| 受益証券発行（買戻し）純額合計   | (6,217,377.65)                     | (825,481)   |
| 支払分配金             | (631,815.57)                       | (83,886)    |
| 純投資（損）益           | 2,097,495.07                       | 278,484     |
| 実現（損）益合計          | (2,312,670.86)                     | (307,053)   |
| 未実現評価（損）益の変動合計    | 1,221,787.75                       | 162,217     |
| 運用の結果による純資産の純増（減） | 1,006,611.96                       | 133,648     |
| 期末現在純資産額          | 211,729,759.56                     | 28,111,360  |

発行済受益証券数の変動  
自2021年4月1日 至2021年9月30日

| クラス          | P-acc         | P-dist        |
|--------------|---------------|---------------|
| 期首現在発行済受益証券数 | 286,619.8160  | 311,310.6320  |
| 発行受益証券数      | 4,568.6780    | 6,537.6770    |
| 買戻受益証券数      | (20,412.6580) | (16,779.7330) |
| 期末現在発行済受益証券数 | 270,775.8360  | 301,068.5760  |

年次分配金<sup>1</sup>

U B S（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 | 2021年6月1日 | 2021年6月4日 | ユーロ | 1.97    |

四半期毎分配金<sup>1</sup>

U B S（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。 |       |     |    |         |

<sup>1</sup> 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。

U B S（Lux）ボンド・ファンド  
純 資 産 変 動 計 算 書  
自2021年4月1日 至2021年9月30日

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

|                   | 米ドル              | 千 円          |
|-------------------|------------------|--------------|
| 期首現在純資産額          | 670,960,500.68   | 76,268,080   |
| 受益証券発行            | 225,857,085.79   | 25,673,175   |
| 受益証券買戻し           | (179,134,609.83) | (20,362,231) |
| 受益証券発行（買戻し）純額合計   | 46,722,475.96    | 5,310,944    |
| 支払分配金             | (5,218,239.31)   | (593,157)    |
| 純投資（損）益           | 10,429,467.76    | 1,185,518    |
| 実現（損）益合計          | (4,050,710.46)   | (460,444)    |
| 未実現評価（損）益の変動合計    | (19,176,703.38)  | (2,179,816)  |
| 運用の結果による純資産の純増（減） | (12,797,946.08)  | (1,454,743)  |
| 期末現在純資産額          | 699,666,791.25   | 79,531,124   |

発行済受益証券数の変動  
自2021年4月1日 至2021年9月30日

| クラス          | P-acc         |
|--------------|---------------|
| 期首現在発行済受益証券数 | 316,817.3310  |
| 発行受益証券数      | 39,581.8750   |
| 買戻受益証券数      | (64,017.0540) |
| 期末現在発行済受益証券数 | 292,382.1520  |

年次分配金<sup>1</sup>

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

| 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<sup>1</sup>

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

| 権利落ち日 | 支払日 | 通貨 | 1口当たり金額 |
|-------|-----|----|---------|
| 該当なし。 |     |    |         |

<sup>1</sup> 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。

U B S（Lux）ボンド・ファンド  
純資産変動計算書  
自2021年4月1日 至2021年9月30日

|                   | U B S（Lux）ボンド・ファンド<br>- ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）<br>ユーロ 千 円 |              |
|-------------------|-----------------------------------------------------|--------------|
| 期首現在純資産額          | 1,730,167,720.42                                    | 229,714,368  |
| 受益証券発行            | 273,115,013.20                                      | 36,261,480   |
| 受益証券買戻し           | (212,058,947.34)                                    | (28,155,066) |
| 受益証券発行（買戻し）純額合計   | 61,056,065.86                                       | 8,106,414    |
| 支払分配金             | (18,981,998.59)                                     | (2,520,240)  |
| 純投資（損）益           | 31,114,196.04                                       | 4,131,032    |
| 実現（損）益合計          | 25,163,833.04                                       | 3,341,002    |
| 未実現評価（損）益の変動合計    | 17,416,556.23                                       | 2,312,396    |
| 運用の結果による純資産の純増（減） | 38,861,472.85                                       | 5,159,638    |
| 期末現在純資産額          | 1,811,103,260.54                                    | 240,460,180  |

発行済受益証券数の変動  
自2021年4月1日 至2021年9月30日

|              | (米ドル・ヘッジ)     |                | (米ドル・ヘッジ)     |                |
|--------------|---------------|----------------|---------------|----------------|
| クラス          | P-acc         | P-acc          | P-mdist       | P-mdist        |
| 期首現在発行済受益証券数 | 942,986.0270  | 360,809.2340   | 942,819.8360  | 2,960,617.9170 |
| 発行受益証券数      | 47,239.4870   | 126,386.9930   | 89,523.0060   | 186,346.0750   |
| 買戻受益証券数      | (96,292.2510) | (131,500.6640) | (79,569.8160) | (432,026.9480) |
| 期末現在発行済受益証券数 | 893,933.2630  | 355,695.5630   | 952,773.0260  | 2,714,937.0440 |

年次分配金<sup>1</sup>

U B S（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<sup>1</sup>

U B S（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          | 2021年4月15日 | 2021年4月20日 | ユーロ | 0.51    |
| P-mdist          | 2021年5月17日 | 2021年5月20日 | ユーロ | 0.49    |
| P-mdist          | 2021年6月15日 | 2021年6月18日 | ユーロ | 0.49    |
| P-mdist          | 2021年7月15日 | 2021年7月20日 | ユーロ | 0.49    |
| P-mdist          | 2021年8月16日 | 2021年8月19日 | ユーロ | 0.49    |
| P-mdist          | 2021年9月15日 | 2021年9月20日 | ユーロ | 0.49    |
| (米ドル・ヘッジ)P-mdist | 2021年4月15日 | 2021年4月20日 | 米ドル | 0.42    |
| (米ドル・ヘッジ)P-mdist | 2021年5月17日 | 2021年5月20日 | 米ドル | 0.41    |
| (米ドル・ヘッジ)P-mdist | 2021年6月15日 | 2021年6月18日 | 米ドル | 0.41    |
| (米ドル・ヘッジ)P-mdist | 2021年7月15日 | 2021年7月20日 | 米ドル | 0.41    |
| (米ドル・ヘッジ)P-mdist | 2021年8月16日 | 2021年8月19日 | 米ドル | 0.41    |
| (米ドル・ヘッジ)P-mdist | 2021年9月15日 | 2021年9月20日 | 米ドル | 0.41    |

<sup>1</sup> 注記4を参照のこと。

注記は、財務書類と不可分のものである。

## 財務書類に対する注記

## 注１．重要な会計方針の概要

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

## a) 純資産価格の計算

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

「営業日」とは、12月24日および31日、ルクセンブルグにおける個々の法定外休日ならびに各サブ・ファンドが投資する主要各国の証券取引所の休業日またはサブ・ファンドの投資対象の50%以上を適切に評価することができない日を除く、ルクセンブルグにおける通常の銀行営業日（即ち、銀行が通常の営業時間に営業を行っている日）である。

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

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

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

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

評価調整が行われる場合、サブ・ファンドが正味発行ポジションまたは正味買戻しポジションにあるかどうかに応じて、受益証券1口当たり純資産価格に増額または減額される。評価調整の範囲は、取締役会の意見により、報酬および手数料ならびに売買スプレッドを適切にカバーするものとする。特に、それぞれのサブ・ファンドの純資産価額は、（ ）見積り税金費用を反映した金額、（ ）サブ・ファンドが負担する可能性のある取引費用、および（ ）サブ・ファンドが投資する資産の見積り買値売値スプレッドを反映した金額が（上方または下方に）調整される。株式市場および国によっては、買い手側と売り手側に異なる報酬体系を示すことがあり、純流入と流出の調整は異なる可能性がある。通常、調整は関連する該当する受益証券1口当たり純資産価格の2%を上限とする。例外的な状況（例：高い市場のボラティリティーおよび/または非流動性、異常な市況、市場の混乱など）の下では、取締役会は各サブ・ファンドおよび/または評価日に関連する該当する受益証券1口当たり純資産価格の2%を超える希薄化調整を一時的に適用することを決定することができるが、これは現行の市況を表わすものであり、受益者にとって最善の利益であることを取締役会が正当化できることを条件とする。この希薄化調整は、取締役会が定めた手続きに従って計算されるものとする。受益者は、一時的措置が導入された時およびその一時的措置が終了した時はいつでも、通常の経路を通じて通知を受けるものとする。

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

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

年度末時点で純資産額へのスウィング・プライシング調整があった場合は、サブ・ファンドの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ッドにより計算される。この過程で以下の原則が適用される。各短期金融商品は、満期までの残存期間にもっとも近い金利が補間される。かかる方法により計算された金利は、原借主の信用力を反映する信用スプレッドを加算することで市場価格に転換される。借主の信用格付けが大幅に変更された場合、かかる信用スプレッドは調整が行われる。
- 外国為替取引によりヘッジされない当該サブ・ファンドの勘定通貨以外の通貨建ての証券、短期金融商品、派生商品およびその他の資産は、当該通貨のルクセンブルグにおける平均為替レート（売買価格の仲値）またはこれが提供されない場合は当該通貨を最も代表する市場におけるレートで評価される。
- 定期預金および信託預金は、これらの額面額に発生利息を付して評価される。
- スワップの価値は、外部サービス・プロバイダーにより計算され、第2次の独立した評価が他の外部サービス・プロバイダーにより提供されている。かかる計算は、イン・フローおよびアウト・フローの両方のすべてのキャッシュ・フローの純現在価値に基づくものである。特定の場合に、内部計算（ブルームバーグにより提供されたモデルおよび市場データに基づく。）および/またはブローカーの報告評価が利用される。評価方法は、該当する有価証券に依拠し、U B S 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2021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2021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 | = | 1.604416 | オーストラリア・ドル |
| 1 ユーロ | = | 1.081127 | スイス・フラン    |
| 1 ユーロ | = | 1.158950 | 米ドル        |

## j) モーゲージ・バック証券

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

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

## k) 有価証券売却未収金、有価証券購入未払金

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

外国為替取引からの未収金および未払金は相殺される。

## l) 利益の認識

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

## m) 発表予定（「TBA」）モーゲージ・バック証券

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

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

T B A ポジションは、「T B A モーゲージ・バック証券に係る未実現評価（損）益」に含まれている。2021年9月30日現在のUBS（Lux）ボンド・ファンド - グローバル・フレキシブルのT B A ポジションの価額は、9,928,707.12スイス・フランである。

#### n）クロス・サブ・ファンド投資

2021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       | ユーロでの金額       |
|-------------------------------------|---------------|
| UBS（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ） | 14,389.00 ユーロ |
| 合計                                  | 14,389.00 ユーロ |

| UBS（Lux）ボンド・ファンド - グローバル・フレキシブル     | スイス・フランでの金額       |
|-------------------------------------|-------------------|
| UBS（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ） | 23,334.49 スイス・フラン |
| 合計                                  | 23,334.49 スイス・フラン |

クロス・サブ・ファンド投資の総額は35,972.50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合計は4,173,852,721.02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 - オーストラリア・ドル

UBS（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル

|                  | 上限定率報酬              | 名称に「ヘッジ」が付く<br>クラス受益証券の<br>上限定率報酬 |
|------------------|---------------------|-----------------------------------|
| 名称に「P」が付くクラス受益証券 | 0.900% <sup>1</sup> | 0.950%                            |

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

UBS（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）

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

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

|                  | 上限定率報酬              | 名称に「ヘッジ」が付く<br>クラス受益証券の<br>上限定率報酬 |
|------------------|---------------------|-----------------------------------|
| 名称に「P」が付くクラス受益証券 | 1.500% <sup>1</sup> | 1.550% <sup>2</sup>               |

<sup>1</sup> 上限：1.500% / 実効：1.300%。

<sup>2</sup> 上限：1.550% / 実効：1.350%。

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 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。

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

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

クラスⅠ - B 受益証券については、ファンドの管理事務費用（管理会社、管理事務代行会社および保管受託銀行の費用により構成される。）をカバーする手数料が課せられる。資産運用および販売に係る当該費用については、投資家およびUBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジーまたは授権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は、トレイル・フィーを考慮に入れ、最大で3%にのぼることがある。

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

ファンドの現行の手数料については、KⅠⅠDで参照することができる。

### 注3．年次税

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

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

### 注4．利益分配

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

分配の詳細については、未監査である。

### 注5．ソフト・コミッション・アレンジメント

2021年4月1日から2021年9月30日までの会計期間中、いかなる「ソフト・コミッション・アレンジメント」もUBS（Lux）ボンド・ファンドに代わって締結されておらず、「ソフト・コミッション・アレンジメント」の金額もなかった。

注6．金融先物、オプションおよびスワップに係る契約債務

2021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、オプション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）<br>ボンド・ファンド      | 債券に係る金融先物（買い）     | 債券に係る金融先物（売り）            |
|---------------------------|-------------------|--------------------------|
| - オーストラリア・ドル              | - オーストラリア・ドル      | 20,440,142.46 オーストラリア・ドル |
| - ユーロ・フレキシブル              | 78,322,509.74 ユーロ | 41,625,781.01 ユーロ        |
| - フルサイクル・アジア・<br>ボンド（米ドル） | 4,585,500.00 米ドル  | 88,946,039.23 米ドル        |

債券または指数に係る金融先物契約（もしあれば）は、当該金融先物の時価（契約数×想定取引規模×当該先物の市場価格）に基づき計算される。

b）オプション

| UBS（Lux）<br>ボンド・ファンド | その他のスワップ<br>に係るオプション、従来型<br>（売り） |
|----------------------|----------------------------------|
| - ユーロ・フレキシブル         | 4,411,665.73 ユーロ                 |

## c) スワップ

| UBS (Lux)<br>ボンド・ファンド  | クレジット・デフォルト・<br>スワップ（買い） | クレジット・デフォルト・<br>スワップ（売り） |
|------------------------|--------------------------|--------------------------|
| - ユーロ・フレキシブル           | 6,050,220.85 ユーロ         | 23,974,583.41 ユーロ        |
| - ユーロ・ハイ・イールド<br>（ユーロ） | 127,899,428.64 ユーロ       | 239,466,442.86 ユーロ       |

| UBS (Lux)<br>ボンド・ファンド | 金利に係るスワップおよび<br>フォワード・スワップ（買い） | 金利に係るスワップおよび<br>フォワード・スワップ（売り） |
|-----------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| - ユーロ・フレキシブル          | 74,327,642.98 ユーロ              | 74,980,178.08 ユーロ              |

## 注7．総経費率（TER）

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

## 過去12か月におけるTER

| UBS (Lux) ボンド・ファンド                               | 総経費率（TER） |
|--------------------------------------------------|-----------|
| - オーストラリア・ドル クラスP - a c c 受益証券                   | 0.88%     |
| - オーストラリア・ドル クラスP - d i s t 受益証券                 | 0.88%     |
| - ユーロ・フレキシブル クラスP - a c c 受益証券                   | 0.97%     |
| - ユーロ・フレキシブル クラスP - d i s t 受益証券                 | 0.97%     |
| - ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）クラスP - a c c 受益証券              | 1.33%     |
| - 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     | 1.38%     |
| - ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）クラスP - m d i s t 受益証券          | 1.33%     |
| - ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）（米ドル・ヘッジ）クラスP - m d i s t 受益証券 | 1.38%     |
| - フルサイクル・アジア・ボンド（米ドル）クラスP - a c c 受益証券           | 1.40%     |

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．準拠法、営業地域および言語

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

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

## 注9．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。

|                           | 2021年9月30日現在の貸付有価証券<br>からの取引相手方エクスポージャー |                              | 2021年9月30日現在の<br>担保の内訳（％） |       |      |
|---------------------------|-----------------------------------------|------------------------------|---------------------------|-------|------|
|                           | 貸付有価証券の<br>時価                           | 担保<br>（ユービーエス・<br>スイス・エイ・ジー） | 株式                        | 債券    | 現金   |
| UBS（Lux）ボンド・ファンド          |                                         |                              |                           |       |      |
| - オーストラリア・ドル              | 986,270.48<br>オーストラリア・ドル                | 1,054,966.68<br>オーストラリア・ドル   | 46.77                     | 53.23 | 0.00 |
| - ユーロ・フレキシブル              | 43,164,142.83<br>ユーロ                    | 46,170,633.05<br>ユーロ         | 46.77                     | 53.23 | 0.00 |
| - ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）        | 287,199,654.94<br>ユーロ                   | 307,203,827.29<br>ユーロ        | 46.77                     | 53.23 | 0.00 |
| - フルサイクル・アジア・ボンド<br>（米ドル） | 100,401,978.69<br>米ドル                   | 107,395,226.94<br>米ドル        | 46.77                     | 53.23 | 0.00 |

[次へ](#)

## （２）投資有価証券明細表等

## U B S（Lux）bond・ファンド - オーストラリア・ドル

2021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<br>オーストラリア・ドル<br>先物 / 為替予約契約 /<br>スワップに係る<br>未実現損益<br>(注1) | 純資産<br>割合<br>(%) |
|-----------------------------------------------------------------|--------------|----------------------------------------------------------------|------------------|
| 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 | 934 948.24                                                     | 0.23             |
| Total AUD                                                       |              | 934 948.24                                                     | 0.23             |
| 変動利付モーゲージ・バック証券合計                                               |              | 934 948.24                                                     | 0.23             |
| 固定利付ノート                                                         |              |                                                                |                  |
| AUD                                                             |              |                                                                |                  |
| AUD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.45000% 19-17.01.24                 | 2 500 000.00 | 2 619 525.00                                                   | 0.66             |
| AUD AT&T INC 3.45000% 18-19.09.23                               | 4 400 000.00 | 4 628 888.00                                                   | 1.16             |
| AUD AT&T INC 4.60000% 18-19.09.28                               | 1 600 000.00 | 1 834 352.00                                                   | 0.46             |
| AUD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 4.75000% 14-06.05.26         | 5 000 000.00 | 5 838 950.00                                                   | 1.46             |
| AUD NEW SOUTH WALES TREASURY CORP-REG-S 3.00000% 17-20.04.29    | 2 000 000.00 | 2 217 900.00                                                   | 0.55             |
| AUD NEW SOUTH WALES TREASURY CORP 2.00000% 20-08.03.33          | 4 800 000.00 | 4 796 064.00                                                   | 1.20             |
| AUD NEW SOUTH WALES TREASURY CORP-REG-S 1.75000% 21-20.03.34    | 3 500 000.00 | 3 359 904.91                                                   | 0.84             |
| AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 1.50000% 20-20.11.30              | 3 300 000.00 | 3 232 812.00                                                   | 0.81             |
| AUD WESTERN AUSTRALIAN TREASURY-REG-S 5.00000% 13-23.07.25      | 3 900 000.00 | 4 533 672.00                                                   | 1.14             |
| Total AUD                                                       |              | 33 062 067.91                                                  | 8.28             |
| 固定利付ノート合計                                                       |              | 33 062 067.91                                                  | 8.28             |
| 変動利付ノート                                                         |              |                                                                |                  |
| AUD                                                             |              |                                                                |                  |
| AUD STANDARD CHARTERED PLC-REG-S 2.900%/VAR 19-28.06.25         | 3 000 000.00 | 3 135 210.00                                                   | 0.79             |
| Total AUD                                                       |              | 3 135 210.00                                                   | 0.79             |
| 変動利付ノート合計                                                       |              | 3 135 210.00                                                   | 0.79             |
| 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                 | 4 400 000.00 | 4 298 140.00                                                   | 1.08             |
| AUD AURIZON NETWORK PTY LTD-REG-S 4.00000% 17-21.06.24          | 1 000 000.00 | 1 067 850.00                                                   | 0.27             |
| AUD AURIZON NETWORK PTY LTD 2.90000% 20-02.09.30                | 3 200 000.00 | 3 144 096.00                                                   | 0.79             |
| AUD AUSGRID FINANCE PTY LTD-REG-S 3.75000% 17-30.10.24          | 1 900 000.00 | 2 035 983.00                                                   | 0.51             |
| AUD AUSNET SERVICES HOLDINGS PTY LTD 2.60000% 19-31.07.29       | 500 000.00   | 506 155.00                                                     | 0.13             |
| AUD AUSTRALIAN CAPITAL TERRITORY 2.50000% 16-21.05.26           | 1 000 000.00 | 1 071 050.00                                                   | 0.27             |
| AUD BARCLAYS PLC-REG-S 3.25000% 19-26.06.24                     | 2 000 000.00 | 2 110 360.00                                                   | 0.53             |
| AUD EXPORT FINANCE&INSURANCE CORP 1.46500% 21-18.08.31          | 3 000 000.00 | 2 919 600.00                                                   | 0.73             |
| AUD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 3.85000% 19-21.02.23        | 1 400 000.00 | 1 456 896.00                                                   | 0.36             |
| AUD INCITEC PIVOT LTD 4.30000% 19-18.03.26                      | 2 300 000.00 | 2 508 748.00                                                   | 0.63             |
| AUD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 1.00000% 21-04.08.28        | 3 500 000.00 | 3 371 655.00                                                   | 0.84             |
| AUD INTERNATIONAL FINANCE CORP-REG-S 3.20000% 16-22.07.26       | 3 600 000.00 | 3 964 932.00                                                   | 0.99             |
| AUD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 3.00000% 16-19.10.26 | 2 700 000.00 | 2 951 316.00                                                   | 0.74             |
| AUD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 3.30000% 18-14.08.28 | 2 600 000.00 | 2 907 268.00                                                   | 0.73             |

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

## 2021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<br>オーストラリア・ドル<br>先物 / 為替予約契約 /<br>スワップに係る<br>未実現損益<br>(注1) | 純資産<br>割合<br>(%) |
|-----------------------------------------------------------------|--------------|----------------------------------------------------------------|------------------|
| AUD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.50000% 20-18.05.26 | 5 200 000.00 | 5 076 136.00                                                   | 1.27             |
| AUD KOMMUNALBANKEN AS 0.60000% 20-01.06.26                      | 2 800 000.00 | 2 731 260.00                                                   | 0.68             |
| AUD KOMMUNALBANKEN AS 2.70000% 18-05.09.23                      | 3 600 000.00 | 3 765 672.00                                                   | 0.94             |
| AUD KOMMUNALBANKEN AS 4.50000% 13-17.04.23                      | 7 600 000.00 | 8 102 588.00                                                   | 2.03             |
| AUD LANDESKREDITBANK B-WUERTT FOERDBK 4.25000% 14-07.08.25      | 1 900 000.00 | 2 137 766.00                                                   | 0.53             |
| AUD LLOYDS BANK PLC-REG-S 1.65000% 19-12.08.22                  | 4 200 000.00 | 4 248 048.00                                                   | 1.06             |
| AUD LLOYDS BANKING GROUP 3.65000% 17-20.03.23                   | 1 600 000.00 | 1 671 936.00                                                   | 0.42             |
| AUD MACQUARIE BANK LTD 1.75000% 19-07.08.24                     | 4 200 000.00 | 4 300 338.00                                                   | 1.08             |
| AUD MACQUARIE GROUP LTD 3.25000% 17-15.12.22                    | 2 600 000.00 | 2 615 054.00                                                   | 0.65             |
| AUD MCDONALD ' S CORP 3.00000% 19-08.03.24                      | 3 600 000.00 | 3 774 204.00                                                   | 0.95             |
| AUD NATIONAL HOUSING FINANCE AND INV CORP 2.38000% 19-28.03.29  | 1 500 000.00 | 1 600 335.00                                                   | 0.40             |
| AUD NATIONAL HOUSING FINANCE AND INV CORP 1.52000% 19-27.05.30  | 1 900 000.00 | 1 888 372.00                                                   | 0.47             |
| AUD NEW SOUTH WALES TREASURY CORP 3.00000% 17-20.05.27          | 5 500 000.00 | 6 069 745.00                                                   | 1.52             |
| AUD QANTAS AIRWAYS LTD 3.15000% 21-27.09.28                     | 1 400 000.00 | 1 383 522.00                                                   | 0.35             |
| AUD QUEENSLAND TREASURY CORP-144A-REG-S 3.00000% 17-22.03.24    | 3 500 000.00 | 3 736 145.00                                                   | 0.94             |
| AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 2.50000% 19-22.10.29              | 1 300 000.00 | 1 390 519.00                                                   | 0.35             |
| AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 1.25000% 20-19.11.27              | 5 500 000.00 | 5 506 490.00                                                   | 1.38             |
| AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 4.25000% 13-20.12.32              | 2 800 000.00 | 3 457 580.00                                                   | 0.87             |
| AUD VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.50000% 17-17.02.23             | 1 100 000.00 | 1 143 989.00                                                   | 0.29             |
| AUD WESTPAC BANKING CORP 3.25000% 18-16.11.23                   | 2 000 000.00 | 2 117 200.00                                                   | 0.53             |
| AUD WOOLWORTHS GROUP LTD 2.85000% 19-23.04.24                   | 900 000.00   | 944 721.00                                                     | 0.24             |
| AUD WOOLWORTHS LTD 1.85000% 21-15.11.27                         | 1 200 000.00 | 1 193 664.00                                                   | 0.30             |
| AUD WOOLWORTHS LTD-REG-S 2.80000% 20-20.05.30                   | 2 500 000.00 | 2 526 700.00                                                   | 0.63             |
| Total AUD                                                       |              | 105 696 033.00                                                 | 26.48            |

|                     |                |       |
|---------------------|----------------|-------|
| 固定利付メディアム・ターム・ノート合計 | 105 696 033.00 | 26.48 |
|---------------------|----------------|-------|

## 固定利付債券

|                                                              |               |               |      |
|--------------------------------------------------------------|---------------|---------------|------|
| AUD                                                          |               |               |      |
| AUD AUSTRALIA 1.25000% 20-21.05.32                           | 1 700 000.00  | 1 653 216.00  | 0.41 |
| AUD AUSTRALIA 4.75000% 11-21.04.27                           | 3 600 000.00  | 4 356 612.00  | 1.09 |
| AUD AUSTRALIA-REG-S 0.50000% 20-21.09.26                     | 11 700 000.00 | 11 538 540.00 | 2.89 |
| AUD AUSTRALIA-REG-S 1.00000% 20-21.12.30                     | 8 600 000.00  | 8 285 928.00  | 2.08 |
| AUD AUSTRALIA-REG-S 1.75000% 20-21.06.51                     | 4 800 000.00  | 4 160 784.00  | 1.04 |
| AUD AUSTRALIA-REG-S 2.25000% 16-21.05.28                     | 8 200 000.00  | 8 816 230.00  | 2.21 |
| AUD AUSTRALIA-REG-S 2.75000% 18-21.05.41                     | 6 900 000.00  | 7 501 335.00  | 1.88 |
| AUD AUSTRALIA-REG-S 2.75000% 16-21.11.27                     | 15 900 000.00 | 17 568 705.00 | 4.40 |
| AUD AUSTRALIA-REG-S 2.75000% 17-21.11.28                     | 7 100 000.00  | 7 881 639.00  | 1.98 |
| AUD AUSTRALIA-REG-S 2.75000% 18-21.11.29                     | 9 500 000.00  | 10 575 020.00 | 2.65 |
| AUD AUSTRALIA-REG-S 3.00000% 16-21.03.47                     | 6 300 000.00  | 7 093 611.00  | 1.78 |
| AUD AUSTRALIA-REG-S 3.25000% 15-21.06.39                     | 2 900 000.00  | 3 398 510.00  | 0.85 |
| AUD AUSTRALIA-REG-S 3.25000% 12-21.04.29                     | 10 500 000.00 | 12 049 905.00 | 3.02 |
| AUD AUSTRALIA-REG-S 3.75000% 14-21.04.37                     | 2 000 000.00  | 2 490 380.00  | 0.62 |
| AUD AUSTRALIA-REG-S 4.50000% 13-21.04.33                     | 2 000 000.00  | 2 624 120.00  | 0.66 |
| AUD AUSTRALIAN CAPITAL TERRITORY 1.75000% 19-23.10.31        | 1 800 000.00  | 1 775 952.00  | 0.45 |
| AUD AUSTRALIAN CAPITAL TERRITORY-REG-S 1.75000% 21-17.05.30  | 2 900 000.00  | 2 919 285.00  | 0.73 |
| AUD NEW SOUTH WALES TREASURY CORP 2.00000% 19-20.03.31       | 3 600 000.00  | 3 672 036.00  | 0.92 |
| AUD NORTHERN TERRITORY CORP 3.50000% 18-21.05.30             | 1 300 000.00  | 1 483 898.00  | 0.37 |
| AUD NORTHERN TERRITORY TREASURY CORP 3.50000% 17-21.04.28    | 1 900 000.00  | 2 153 669.00  | 0.54 |
| AUD QUEENSLAND TREASURY CORP-REG-S 6.50000% 08-14.03.33      | 800 000.00    | 1 171 800.00  | 0.29 |
| AUD QUEENSLAND TREASURY CORP-144A-REG-S 4.75000% 14-21.07.25 | 1 900 000.00  | 2 190 187.00  | 0.55 |
| AUD QUEENSLAND TREASURY CORP-144A-REG-S 1.25000% 20-10.03.31 | 2 500 000.00  | 2 389 275.00  | 0.60 |
| AUD QUEENSLAND TREASURY CORP-144A-REG-S 1.50000% 21-20.08.32 | 3 800 000.00  | 3 643 972.00  | 0.91 |

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

## 2021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<br>オーストラリア・ドル<br>先物 / 為替予約契約 /<br>スワップに係る<br>未実現損益<br>(注1) | 純資産<br>割合<br>(%) |
|------------------------------------------------------------------|--------------|----------------------------------------------------------------|------------------|
| AUD SOUTH AUSTRALIAN GOV FIN AUTHORITY 1.75000% 20-24.05.32      | 2 700 000.00 | 2 658 906.00                                                   | 0.67             |
| AUD SOUTH AUSTRALIAN GOV FIN AUTHOR 1.75000% 21-24.05.34         | 3 400 000.00 | 3 235 338.00                                                   | 0.81             |
| AUD SOUTH AUSTRALIAN GOVERNMENT FIN-REG-S 2.00000% 21-23.05.36   | 2 200 000.00 | 2 093 352.10                                                   | 0.52             |
| AUD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 3.66200% 17-29.03.22              | 1 900 000.00 | 1 932 300.00                                                   | 0.48             |
| AUD SUNCORP-METWAY LTD-REG-S 3.25000% 16-24.08.26                | 2 000 000.00 | 2 181 240.00                                                   | 0.55             |
| AUD TASMANIAN PUBLIC FINANCE CORP 2.00000% 19-24.01.30           | 2 400 000.00 | 2 438 640.00                                                   | 0.61             |
| AUD TASMANIAN PUBLIC FINANCE CORP-REG-S 2.25000% 21-22.01.32     | 3 700 000.00 | 3 787 246.00                                                   | 0.95             |
| AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 2.25000% 21-15.09.33               | 6 100 000.00 | 6 232 065.00                                                   | 1.56             |
| AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 2.00000% 21-17.09.35               | 3 400 000.00 | 3 270 120.00                                                   | 0.82             |
| AUD WESTERN AUSTRALIAN TREASURY CORP 2.00000% 19-24.10.34        | 3 500 000.00 | 3 439 940.00                                                   | 0.86             |
| AUD WESTPAC BANKING CORP-REG-S 5.25000% 13-21.11.23              | 3 900 000.00 | 4 295 655.00                                                   | 1.08             |
| Total AUD                                                        |              | 166 959 411.10                                                 | 41.83            |
| 固定利付債券合計                                                         |              | 166 959 411.10                                                 | 41.83            |
| 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                            |              | 309 787 670.25                                                 | 77.61            |
| 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                              |              |                                                                |                  |
| 変動利付モーゲージ・バック証券                                                  |              |                                                                |                  |
| AUD TORRENS SERIES TRUST 1M BBSW+60BP 21-09.11.52                | 2 700 000.00 | 2 380 466.53                                                   | 0.60             |
| Total AUD                                                        |              | 2 380 466.53                                                   | 0.60             |
| 変動利付モーゲージ・バック証券合計                                                |              | 2 380 466.53                                                   | 0.60             |
| 固定利付ミディアム・ターム・ノート                                                |              |                                                                |                  |
| AUD CPIF FINANCE PTY LTD-REG-S 2.48500% 20-28.10.30              | 900 000.00   | 873 738.00                                                     | 0.22             |
| AUD DOWNER GROUP FINANCE PTY LTD 4.50000% 15-11.03.22            | 900 000.00   | 907 380.00                                                     | 0.23             |
| AUD DOWNER GROUP FINANCE PTY 3.70000% 19-29.04.26                | 2 100 000.00 | 2 250 738.00                                                   | 0.56             |
| AUD EDITH COWAN UNIVERSITY 3.00000% 19-11.04.29                  | 1 800 000.00 | 1 901 970.00                                                   | 0.48             |
| AUD ENERGY PARTNERSHIP GAS PTY LTD 3.64200% 17-11.12.24          | 1 000 000.00 | 1 073 910.00                                                   | 0.27             |
| AUD GTA FINANCE CO PTY LTD 2.20000% 20-26.08.27                  | 600 000.00   | 597 138.00                                                     | 0.15             |
| AUD LANDESKREDITBANK B-WUERTE FORERDERBANK 2.70000% 17-19.06.23  | 2 500 000.00 | 2 598 375.00                                                   | 0.65             |
| AUD MACQUARIE UNIVERSITY-REG-S 3.50000% 18-07.09.28              | 1 450 000.00 | 1 597 030.00                                                   | 0.40             |
| AUD MACQUARIE UNIVERSITY-REG-S 2.25000% 19-22.05.30              | 2 100 000.00 | 2 106 594.00                                                   | 0.53             |
| AUD NBN CO LTD-REG-S 1.00000% 20-03.12.25                        | 7 000 000.00 | 6 883 030.00                                                   | 1.72             |
| AUD PACCAR FINANCIAL PTY LTD-REG-S 3.00000% 18-13.09.22          | 600 000.00   | 613 860.00                                                     | 0.15             |
| AUD UNITED ENERGY LTD-REG-S 3.50000% 16-12.09.23                 | 1 100 000.00 | 1 147 454.00                                                   | 0.29             |
| AUD UNIVERSITY OF WOLLONGONG/THE 3.50000% 17-08.12.27            | 1 200 000.00 | 1 321 536.00                                                   | 0.33             |
| AUD VICTORIA POWER NETWORKS FINANCE PTY LTD 2.13200% 21-21.04.28 | 1 400 000.00 | 1 400 126.00                                                   | 0.35             |
| AUD VIRGIN AUSTRALIA HOLDINGS * DEFAULTED * 8.07500% 19-05.03.24 | 500 000.00   | 38 750.00                                                      | 0.01             |
| AUD WESTCONNEX FIN CO PTY LTD-REG-S 3.15000% 21-31.03.31         | 2 600 000.00 | 2 613 754.00                                                   | 0.66             |
| AUD WSO FINANCE PTY LTD 4.50000% 17-31.03.27                     | 800 000.00   | 913 016.00                                                     | 0.23             |
| AUD WSO FINANCE PTY LTD-REG-S 3.50000% 16-14.07.23               | 500 000.00   | 519 195.00                                                     | 0.13             |
| Total AUD                                                        |              | 29 357 594.00                                                  | 7.36             |
| 固定利付ミディアム・ターム・ノート合計                                              |              | 29 357 594.00                                                  | 7.36             |

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

## 2021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<br>オーストラリア・ドル<br>先物 / 為替予約契約 /<br>スワップに係る<br>未実現損益<br>(注1) | 純資産<br>割合<br>(%) |
|-----------------------------------------------------------------|--------------|----------------------------------------------------------------|------------------|
| <b>固定利付債券</b>                                                   |              |                                                                |                  |
| AUD                                                             |              |                                                                |                  |
| AUD BENDIGO & ADELAIDE BANK LTD LTD 1.70000% 19-06.09.24        | 4 000 000.00 | 4 090 600.00                                                   | 1.02             |
| AUD EXPORT DEVELOPMENT CANADA 2.80000% 18-31.05.23              | 1 200 000.00 | 1 250 736.00                                                   | 0.31             |
| AUD NORTHERN TERRITORY CORP-REG-S 6.00000% 01-15.03.24          | 800 000.00   | 908 520.00                                                     | 0.23             |
| AUD NSW ELECTRICITY NETWORKS FINANCE PTY 2.54300% 20-23.09.30   | 2 400 000.00 | 2 296 920.00                                                   | 0.58             |
| AUD SUNCORP-METWAY LTD 3.00000% 18-13.09.23                     | 3 100 000.00 | 3 252 861.00                                                   | 0.82             |
| AUD UBS AG AUSTRALIA-REG-S 1.10000% 21-26.02.26                 | 4 700 000.00 | 4 644 587.00                                                   | 1.16             |
| AUD WESTPAC BANKING CORP 2.75000% 17-31.08.22                   | 3 800 000.00 | 3 890 136.00                                                   | 0.97             |
| Total AUD                                                       |              | 20 334 360.00                                                  | 5.09             |
| <b>固定利付債券合計</b>                                                 |              | 20 334 360.00                                                  | 5.09             |
| 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                           |              |                                                                |                  |
|                                                                 |              | 52 072 420.53                                                  | 13.05            |
| 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譲渡性のある有価証券および短期金融商品       |              |                                                                |                  |
| <b>固定利付ノート</b>                                                  |              |                                                                |                  |
| AUD                                                             |              |                                                                |                  |
| AUD ING BANK (AUSTRALIA) LTD 1.10000% 21-19.08.26               | 2 400 000.00 | 2 372 347.37                                                   | 0.59             |
| Total AUD                                                       |              | 2 372 347.37                                                   | 0.59             |
| <b>固定利付ノート合計</b>                                                |              | 2 372 347.37                                                   | 0.59             |
| <b>固定利付ミディアム・ターム・ノート</b>                                        |              |                                                                |                  |
| AUD                                                             |              |                                                                |                  |
| AUD AGI FINANCE PTY LTD-REG-S 1.81520% 20-23.11.28              | 2 800 000.00 | 2 660 560.00                                                   | 0.67             |
| AUD BANK OF QUEENSLAND LTD 1.40000% 21-06.05.26                 | 7 000 000.00 | 6 966 960.00                                                   | 1.75             |
| AUD DWPF FINANCE PTY 1.90000% 21-04.08.28                       | 1 500 000.00 | 1 471 515.00                                                   | 0.37             |
| AUD ELECTRANET PTY LTD 2.47370% 21-15.12.28                     | 900 000.00   | 891 601.22                                                     | 0.22             |
| AUD ING BANK AUSTRALIA LTD-REG-S 3.00000% 18-07.09.23           | 1 600 000.00 | 1 676 624.00                                                   | 0.42             |
| AUD LGFV PROGRAM TRUST-REG-S 4.31000% 14-12.11.21               | 2 100 000.00 | 2 107 497.00                                                   | 0.53             |
| AUD LONSDALE FINANCE PTY LTD-REG-S 2.45000% 19-20.11.26         | 2 000 000.00 | 2 054 120.00                                                   | 0.51             |
| AUD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 5.00000% 14-25.06.24            | 2 000 000.00 | 2 232 480.00                                                   | 0.56             |
| AUD NETWORK FINANCE CO PTY LTD 2.25000% 19-11.11.26             | 1 200 000.00 | 1 219 164.00                                                   | 0.31             |
| AUD PACIFIC NATIONAL FINANCE PTY LTD-REG-S 3.80000% 21-08.09.31 | 2 200 000.00 | 2 167 044.00                                                   | 0.54             |
| AUD UNIVERSITY OF TECHNOLOGY SYDNEY 3.75000% 17-20.07.27        | 1 000 000.00 | 1 113 620.00                                                   | 0.28             |
| Total AUD                                                       |              | 24 561 185.22                                                  | 6.16             |
| <b>固定利付ミディアム・ターム・ノート合計</b>                                      |              | 24 561 185.22                                                  | 6.16             |

注記は、財務書類と不可分のものである。

## U B S（Lux）ボンド・ファンド - オーストラリア・ドル

## 2021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<br>オーストラリア・ドル<br>先物 / 為替予約契約 /<br>スワップに係る<br>未実現損益<br>(注1) | 純資産<br>割合<br>(%) |
|-----------------------------------------------------------------|--------------|----------------------------------------------------------------|------------------|
| <b>固定利付債券</b>                                                   |              |                                                                |                  |
| AUD                                                             |              |                                                                |                  |
| AUD NORTHERN TERRITORY TREASURY CORP 2.50000% 21-21.05.32       | 1 900 000.00 | 1 963 992.00                                                   | 0.49             |
| Total AUD                                                       |              | 1 963 992.00                                                   | 0.49             |
| <b>固定利付債券合計</b>                                                 |              | 1 963 992.00                                                   | 0.49             |
| 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<br>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 |              | 28 897 524.59                                                  | 7.24             |
| <b>投資有価証券合計</b>                                                 |              | 390 757 615.37                                                 | 97.90            |
| <b>派生商品</b>                                                     |              |                                                                |                  |
| 公認の証券取引所に上場されている派生商品                                            |              |                                                                |                  |
| <b>債券に係る金融先物</b>                                                |              |                                                                |                  |
| AUD AUSTRALIAN 3YR BOND FUTURE 15.12.21                         | -99.00       | 19 682.08                                                      | 0.01             |
| AUD AUSTRALIA 10YR BOND FUTURE 15.12.21                         | -63.00       | 135 886.10                                                     | 0.03             |
| <b>債券に係る金融先物合計</b>                                              |              | 155 568.18                                                     | 0.04             |
| <b>公認の証券取引所に上場されている派生商品合計</b>                                   |              | 155 568.18                                                     | 0.04             |
| <b>派生商品合計</b>                                                   |              | 155 568.18                                                     | 0.04             |
| 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                                  |              | 8 296 508.59                                                   | 2.08             |
| その他の資産および負債                                                     |              | -59 750.47                                                     | -0.02            |
| <b>純資産合計</b>                                                    |              | 399 149 941.67                                                 | 100.00           |

注記は、財務書類と不可分のものである。

## U B S（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル

## 2021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<br>ユーロ<br>先物 / 為替予約契約 /<br>スワップに係る<br>未実現損益<br>(注1) | 純資産<br>割合<br>(%) |
|------------------------------------------------------------------|--------------|---------------------------------------------------------|------------------|
| 公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品                              |              |                                                         |                  |
| 固定利付ノート                                                          |              |                                                         |                  |
| EUR                                                              |              |                                                         |                  |
| EUR ALTICE FINCO SA-REG-S 4.75000% 17-15.01.28                   | 330 000.00   | 313 585.80                                              | 0.15             |
| EUR ALTICE FRANCE HOLDING SA-REG-S 8.00000% 19-15.05.27          | 195 000.00   | 207 480.00                                              | 0.10             |
| EUR ALTICE FRANCE-REG-S 5.87500% 18-01.02.27                     | 600 000.00   | 627 216.00                                              | 0.30             |
| EUR AMERICAN EXPRESS CREDIT CORP 0.62500% 16-22.11.21            | 100 000.00   | 100 073.60                                              | 0.05             |
| EUR ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV-REG-S 3.70000% 20-02.04.40        | 100 000.00   | 133 814.22                                              | 0.06             |
| EUR ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-REG-S 2.12500% 19-15.08.26       | 200 000.00   | 200 000.00                                              | 0.09             |
| EUR ARGENTINA, REPUBLIC OF 0.12500% 20-09.07.30                  | 679 000.00   | 244 440.00                                              | 0.12             |
| EUR ARGENTINA, REPUBLIC OF 0.50000% 20-09.07.29                  | 22 046.00    | 8 465.67                                                | 0.00             |
| EUR AT&T INC 0.80000% 19-04.03.30                                | 460 000.00   | 462 946.76                                              | 0.22             |
| EUR BACARDI LTD-REG-S 2.75000% 13-03.07.23                       | 100 000.00   | 104 696.00                                              | 0.05             |
| EUR BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S 1.87600% 20-07.04.24            | 700 000.00   | 735 672.00                                              | 0.35             |
| EUR BULGARIAN ENERGY HOLDING EAD-REG-S 2.45000% 21-22.07.28      | 410 000.00   | 411 312.00                                              | 0.19             |
| EUR CHILE, REPUBLIC OF 0.83000% 19-02.07.31                      | 700 000.00   | 697 725.00                                              | 0.33             |
| EUR CHINA, PEOPLE ' S REPUBLIC OF-REG-S 1.00000% 19-12.11.39     | 435 000.00   | 430 187.82                                              | 0.20             |
| EUR CORP ANDINA DE FOMENTO-REG-S 0.25000% 21-04.02.26            | 1 010 000.00 | 1 010 735.28                                            | 0.48             |
| EUR FISERV INC 1.62500% 19-01.07.30                              | 395 000.00   | 423 263.91                                              | 0.20             |
| EUR GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 3.37500% 20-27.03.25           | 815 000.00   | 908 395.74                                              | 0.43             |
| EUR GTC AURORA LUXEMBOURG SA-REG-S 2.25000% 21-23.06.26          | 245 000.00   | 249 064.06                                              | 0.12             |
| EUR INDONESIA, REPUBLIC OF 1.40000% 19-30.10.31                  | 400 000.00   | 406 200.00                                              | 0.19             |
| EUR INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC-REG-S 2.37500% 19-15.04.28 | 160 000.00   | 157 800.00                                              | 0.07             |
| EUR JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-REG-S 4.50000% 18-15.01.26  | 300 000.00   | 303 750.00                                              | 0.14             |
| EUR JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-REG-S 4.50000% 21-15.07.28  | 295 000.00   | 290 798.02                                              | 0.14             |
| EUR LOXAM SAS-REG-S 3.75000% 19-15.07.26                         | 400 000.00   | 408 600.00                                              | 0.19             |
| EUR LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON-REG-S 0.12500% 20-11.02.28  | 200 000.00   | 201 204.00                                              | 0.10             |
| EUR LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON-REG-S 0.37500% 20-11.02.31  | 100 000.00   | 100 989.00                                              | 0.05             |
| EUR MACIF-REG-S-SUB 0.62500% 21-21.06.27                         | 200 000.00   | 198 638.00                                              | 0.09             |
| EUR NATIONAL GRID ELECTRICITY TRANS-REG-S 0.19000% 20-20.01.25   | 100 000.00   | 100 649.00                                              | 0.05             |
| EUR NETFLIX INC 3.62500% 17-15.05.27                             | 200 000.00   | 231 000.00                                              | 0.11             |
| EUR PERU, REPUBLIC OF 0.12500% 21-11.03.33                       | 400 000.00   | 386 000.00                                              | 0.18             |
| EUR PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 4.75000% 14-14.01.25             | 300 000.00   | 335 587.50                                              | 0.16             |
| EUR SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 0.75000% 19-09.07.27 | 700 000.00   | 717 150.00                                              | 0.34             |
| EUR TELE COLUMBUS AG-REG-S 3.87500% 18-02.05.25                  | 560 000.00   | 561 400.00                                              | 0.27             |
| EUR TRITAX EUROBOX PLC-REG-S 0.95000% 21-02.06.26                | 140 000.00   | 141 528.10                                              | 0.07             |
| EUR TURKEY, REPUBLIC OF 4.37500% 21-08.07.27                     | 600 000.00   | 594 351.60                                              | 0.28             |
| EUR UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 4.37500% 20-27.01.30            | 600 000.00   | 556 500.00                                              | 0.26             |
| EUR UNILABS SUBHOLDING AB-REG-S 5.75000% 17-15.05.25             | 400 000.00   | 406 160.00                                              | 0.19             |
| EUR VANTAGE TOWERS AG-REG-S 0.37500% 21-31.03.27                 | 300 000.00   | 299 724.00                                              | 0.14             |
| EUR VEB FINANCE PLC-REG-S LPN 4.03200% 13-21.02.23               | 610 000.00   | 636 801.87                                              | 0.30             |
| EUR VERISURE MIDHOLDING AB-REG-S 5.25000% 21-15.02.29            | 145 000.00   | 148 752.60                                              | 0.07             |
| Total EUR                                                        |              | 14 452 657.55                                           | 6.83             |
| GBP                                                              |              |                                                         |                  |
| GBP CPUK FINANCE LTD-REG-S 4.50000% 21-28.08.27                  | 110 000.00   | 130 084.11                                              | 0.06             |
| Total GBP                                                        |              | 130 084.11                                              | 0.06             |
| USD                                                              |              |                                                         |                  |
| USD AERCAP IRELAND CAP/ GLBL AVIATION TRUST 6.50000% 20-15.07.25 | 150 000.00   | 150 058.46                                              | 0.07             |
| USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 4.25000% 12-26.01.23           | 800 000.00   | 703 999.30                                              | 0.33             |
| USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 7.15800% 15-12.03.45           | 740 000.00   | 638 628.71                                              | 0.30             |

注記は、財務書類と不可分のものである。

## U B S（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル

## 2021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<br>ユーロ<br>先物 / 為替予約契約 /<br>スワップに係る<br>未実現損益<br>(注1) | 純資産<br>割合<br>(%) |
|------------------------------------------------------------------|--------------|---------------------------------------------------------|------------------|
| USD ECUADOR GOVT INTERNATIONAL BD-REG-S STEP-UP/DOWN 20-31.07.35 | 198 120.00   | 111 116.10                                              | 0.05             |
| USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S STEP-UP 0.50000% 20-31.07.30      | 75 600.00    | 54 631.34                                               | 0.03             |
| USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S STEP-UP 20-31.07.40               | 90 800.00    | 45 382.37                                               | 0.02             |
| USD EQT CORP 3.90000% 17-01.10.27                                | 430 000.00   | 401 534.92                                              | 0.19             |
| USD GENERAL ELECTRIC CO 3.45000% 20-01.05.27                     | 60 000.00    | 56 779.99                                               | 0.03             |
| USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 4.87500% 13-13.02.28            | 400 000.00   | 371 953.05                                              | 0.18             |
| USD MEITUAN DIANPING-REG-S 3.05000% 20-28.10.30                  | 700 000.00   | 559 186.12                                              | 0.26             |
| USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.75000% 18-17.01.48      | 760 000.00   | 646 462.31                                              | 0.31             |
| USD PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS-REG-S 9.25000% 21-30.04.26      | 260 000.00   | 236 679.76                                              | 0.11             |
| USD PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP 3.80000% 20-15.09.30         | 135 000.00   | 124 358.48                                              | 0.06             |
| USD SANTOS FINANCE LTD-REG-S 3.64900% 21-29.04.31                | 320 000.00   | 281 167.83                                              | 0.13             |
| USD SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD-REG-S 3.45000% 21-11.01.31      | 200 000.00   | 153 587.30                                              | 0.07             |
| USD SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD-REG-S 5.20000% 21-16.01.27      | 200 000.00   | 166 745.76                                              | 0.08             |
| USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.37500% 17-25.09.32            | 560 000.00   | 492 799.52                                              | 0.23             |
| USD URUGUAY, REPUBLIC OF 4.12500% 12-20.11.45                    | 600 000.00   | 603 552.79                                              | 0.29             |
| USD VISTRA OPERATIONS CO LLC-144A 4.37500% 21-01.05.29           | 80 000.00    | 69 451.14                                               | 0.03             |
| USD WASTE CONNECTIONS INC 2.95000% 21-15.01.52                   | 220 000.00   | 185 736.77                                              | 0.09             |
| Total USD                                                        |              | 6 053 812.02                                            | 2.86             |
| 固定利付ノート合計                                                        |              | 20 636 553.68                                           | 9.75             |
| ノート、ゼロ・クーポン                                                      |              |                                                         |                  |
| USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 20-31.07.30              | 16 232.00    | 7 283.01                                                | 0.00             |
| Total USD                                                        |              | 7 283.01                                                | 0.00             |
| ノート、ゼロ・クーポン合計                                                    |              | 7 283.01                                                | 0.00             |
| 変動利付ノート                                                          |              |                                                         |                  |
| EUR ABANCA CORP BANCARIA SA-REG-S-SUB VAR 21-PRP                 | 200 000.00   | 214 750.40                                              | 0.10             |
| EUR AUSTRALIA & NZ BANKING GRP-REG-S-SUB 1.125%/VAR 19-21.11.29  | 200 000.00   | 204 730.00                                              | 0.10             |
| EUR BARCLAYS PLC-REG-S 0.577%VAR 21-09.08.29                     | 605 000.00   | 597 301.98                                              | 0.28             |
| EUR BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC-REG-S -SUB 3.750%/VAR 21-PRP    | 375 000.00   | 372 562.50                                              | 0.18             |
| EUR ENI SPA-REG-S-SUB 3.375%/VAR 20-PRP                          | 100 000.00   | 106 530.00                                              | 0.05             |
| EUR MORGAN STANLEY 0.406%VAR 21-29.10.27                         | 1 100 000.00 | 1 105 500.00                                            | 0.52             |
| EUR RAKUTEN GROUP INC-REG-S-SUB 4.250%VAR 21-PRP                 | 425 000.00   | 428 292.35                                              | 0.20             |
| EUR WESTPAC BANKING CORP-REG-SUB 0.766%/VAR 21-13.05.31          | 500 000.00   | 500 065.75                                              | 0.24             |
| EUR WINTERSHALL DEA FINANCE 2BV-REG-S-SUB 3.000%/VAR 21-PRP      | 800 000.00   | 792 267.20                                              | 0.37             |
| Total EUR                                                        |              | 4 322 000.18                                            | 2.04             |
| USD ALLIANZ SE-REG-S-SUB 3.500%/VAR 20-PRP                       | 200 000.00   | 174 589.07                                              | 0.08             |
| Total USD                                                        |              | 174 589.07                                              | 0.08             |
| 変動利付ノート合計                                                        |              | 4 496 589.25                                            | 2.12             |
| 固定利付ミディアム・ターム・ノート                                                |              |                                                         |                  |
| AUD QANTAS AIRWAYS LTD 3.15000% 21-27.09.28                      | 220 000.00   | 135 507.61                                              | 0.06             |
| Total AUD                                                        |              | 135 507.61                                              | 0.06             |

注記は、財務書類と不可分のものである。

## U B S（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル

## 2021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<br>ユーロ<br>先物 / 為替予約契約 /<br>スワップに係る<br>未実現損益<br>(注1) | 純資産<br>割合<br>(%) |      |
|-----|--------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|------------------|------|
| EUR |                                                              |                                                         |                  |      |
| EUR | ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA-REG-S 2.37500% 19-27.09.27       | 100 000.00                                              | 109 938.80       | 0.05 |
| EUR | ABN AMRO BANK NV-REG-S 1.25000% 18-10.01.33                  | 500 000.00                                              | 554 925.00       | 0.26 |
| EUR | AEROPORTI DI ROMA SPA-REG-S 1.75000% 21-30.07.31             | 215 000.00                                              | 222 778.70       | 0.11 |
| EUR | AKER BP ASA-REG-S 1.12500% 21-12.05.29                       | 100 000.00                                              | 100 679.37       | 0.05 |
| EUR | ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV-REG-S 1.15000% 18-22.01.27        | 200 000.00                                              | 210 334.14       | 0.10 |
| EUR | AROUNDTOWN SA-REG-S 2.00000% 18-02.11.26                     | 100 000.00                                              | 108 192.00       | 0.05 |
| EUR | ASTRAZENECA PLC-REG-S 0.37500% 21-03.06.29                   | 185 000.00                                              | 184 915.27       | 0.09 |
| EUR | AURIZON NETWORK PTY LTD-REG-S 2.00000% 14-18.09.24           | 100 000.00                                              | 105 994.91       | 0.05 |
| EUR | AUTOSTRADE PER L ' ITALIA SPA-REG-S 1.12500% 15-04.11.21     | 100 000.00                                              | 100 000.00       | 0.05 |
| EUR | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 0.62500% 16-18.03.23      | 1 000 000.00                                            | 1 015 262.00     | 0.48 |
| EUR | BANCO BPM SPA 2.50000% 19-21.06.24                           | 400 000.00                                              | 422 020.00       | 0.20 |
| EUR | BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 2.50000% 21-15.04.31          | 600 000.00                                              | 609 456.00       | 0.29 |
| EUR | BANCO SANTANDER SA-REG-S-SUB 3.25000% 16-04.04.26            | 100 000.00                                              | 112 321.00       | 0.05 |
| EUR | BANK OF IRELAND GROUP PLC-REG-S 1.37500% 18-29.08.23         | 255 000.00                                              | 262 099.20       | 0.12 |
| EUR | BANQUE FEDER DU CREDIT MUTUEL-REG-S-SUB 3.00000% 15-11.09.25 | 200 000.00                                              | 221 837.20       | 0.10 |
| EUR | BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC-REG-S 0.87500% 15-13.10.23     | 200 000.00                                              | 203 138.40       | 0.10 |
| EUR | BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC-REG-S 1.25000% 15-13.03.27     | 300 000.00                                              | 308 664.00       | 0.15 |
| EUR | BNP PARIBAS-REG-S-SUB 2.87500% 16-01.10.26                   | 2 400 000.00                                            | 2 687 136.00     | 1.27 |
| EUR | BPCE SA-REG-S 1.37500% 18-23.03.26                           | 300 000.00                                              | 315 145.20       | 0.15 |
| EUR | CANAL DE ISABEL II GESTION SA-REG-S 1.68000% 15-26.02.25     | 400 000.00                                              | 421 525.00       | 0.20 |
| EUR | CELLNEX FINANCE CO SA-REG-S 1.50000% 21-08.06.28             | 500 000.00                                              | 500 557.00       | 0.24 |
| EUR | CELLNEX FINANCE CO SA-REG-S 2.00000% 21-15.09.32             | 400 000.00                                              | 391 688.00       | 0.18 |
| EUR | CITIGROUP INC-REG-S 2.37500% 14-22.05.24                     | 300 000.00                                              | 320 187.00       | 0.15 |
| EUR | CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE SA-REG-S 1.87500% 18-19.01.26  | 305 000.00                                              | 325 093.56       | 0.15 |
| EUR | COMMERZBANK AG-REG-S 0.62500% 19-28.08.24                    | 165 000.00                                              | 168 291.17       | 0.08 |
| EUR | CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S 2.75000% 20-12.05.26             | 155 000.00                                              | 169 785.45       | 0.08 |
| EUR | CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 1.37500% 18-13.03.25         | 300 000.00                                              | 313 743.00       | 0.15 |
| EUR | CTP BV-REG-S 0.50000% 21-21.06.25                            | 295 000.00                                              | 296 502.73       | 0.14 |
| EUR | DAIMLER AG-REG-S 2.00000% 20-22.08.26                        | 175 000.00                                              | 191 485.00       | 0.09 |
| EUR | DANSKE BANK AS-REG-S 1.37500% 19-24.05.22                    | 250 000.00                                              | 252 811.00       | 0.12 |
| EUR | DANSKE BANK AS-REG-S-SUB 1.50000% 20-02.09.30                | 120 000.00                                              | 122 996.64       | 0.06 |
| EUR | DEUTSCHE BANK AG-REG-S 1.12500% 18-30.08.23                  | 480 000.00                                              | 492 253.01       | 0.23 |
| EUR | DEUTSCHE LUFTHANSA AG-REG-S 2.00000% 21-14.07.24             | 400 000.00                                              | 407 322.40       | 0.19 |
| EUR | DNB BANK ASA-REG-S 0.05000% 19-14.11.23                      | 335 000.00                                              | 337 810.65       | 0.16 |
| EUR | EDP FINANCE BV-REG-S 1.50000% 17-22.11.27                    | 270 000.00                                              | 289 263.96       | 0.14 |
| EUR | EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 6.37500% 19-11.04.31                | 400 000.00                                              | 391 000.00       | 0.18 |
| EUR | ELECTRICITE DE FRANCE-REG-S 1.87500% 16-13.10.36             | 2 600 000.00                                            | 2 845 882.00     | 1.34 |
| EUR | ELENIA VERKKO OYJ-REG-S 0.37500% 20-06.02.27                 | 100 000.00                                              | 100 334.80       | 0.05 |
| EUR | ELIA TRANSMISSION BELGIUM SA-REG-S 0.87500% 20-28.04.30      | 100 000.00                                              | 102 873.14       | 0.05 |
| EUR | EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FAC-REG-S 1.80000% 17-10.07.48  | 1 700 000.00                                            | 2 192 731.40     | 1.04 |
| EUR | EUROPEAN STABILITY MECHANISM-REG-S 0.50000% 16-02.03.26      | 1 500 000.00                                            | 1 556 727.00     | 0.74 |
| EUR | FMS WERTMANAGEMENT 0.37500% 15-29.04.30                      | 1 800 000.00                                            | 1 846 720.80     | 0.87 |
| EUR | FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.02100% 19-06.03.24                | 250 000.00                                              | 260 578.00       | 0.12 |
| EUR | GE CAPITAL EUROPEAN FUNDING 4.62500% 07-22.02.27             | 1 550 000.00                                            | 1 900 710.60     | 0.90 |
| EUR | GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC-REG-S 1.69400% 18-26.03.25   | 500 000.00                                              | 523 534.00       | 0.25 |
| EUR | GLENCORE FINANCE EUROPE SA-REG-S 1.75000% 15-17.03.25        | 200 000.00                                              | 209 414.80       | 0.10 |
| EUR | GLOBALWORTH REAL ESTATE INVEST-REG-S 3.00000% 18-29.03.25    | 100 000.00                                              | 106 956.25       | 0.05 |
| EUR | GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 2.00000% 18-01.11.28           | 410 000.00                                              | 451 282.90       | 0.21 |
| EUR | HEIDELBERGCEMENT FIN LUX SA-REG-S 1.12500% 19-01.12.27       | 80 000.00                                               | 83 696.00        | 0.04 |
| EUR | KAZAKHSTAN, REPUBLIC OF-REG-S 2.37500% 18-09.11.28           | 800 000.00                                              | 889 400.00       | 0.42 |
| EUR | KBC GROUP NV-REG-S 1.12500% 19-25.01.24                      | 200 000.00                                              | 206 370.00       | 0.10 |
| EUR | KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU-REG-S 0.37500% 15-23.04.30   | 2 000 000.00                                            | 2 074 588.00     | 0.98 |
| EUR | MEXICO, UNITED STATES OF 3.00000% 15-06.03.45                | 200 000.00                                              | 207 912.50       | 0.10 |

注記は、財務書類と不可分のものである。

## U B S（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル

## 2021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<br>ユーロ<br>先物 / 為替予約契約 /<br>スワップに係る<br>未実現損益<br>(注1) | 純資産<br>割合<br>(%) |
|-----------------------------------------------------------------|--------------|---------------------------------------------------------|------------------|
| EUR NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 1.87500% 12-13.01.23            | 500 000.00   | 514 825.00                                              | 0.24             |
| EUR NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.25000% 20-23.01.27     | 390 000.00   | 393 120.00                                              | 0.19             |
| EUR PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 3.75000% 17-21.02.24              | 300 000.00   | 309 993.75                                              | 0.15             |
| EUR PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 2.87500% 14-03.03.26        | 1 450 000.00 | 1 626 235.90                                            | 0.77             |
| EUR PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 0.87500% 19-17.05.27           | 500 000.00   | 509 000.00                                              | 0.24             |
| EUR POLAND, REPUBLIC OF-REG-S 2.00000% 19-08.03.49              | 560 000.00   | 690 655.00                                              | 0.33             |
| EUR PPF ARENA 1 BV-REG-S 2.12500% 19-31.01.25                   | 450 000.00   | 463 568.40                                              | 0.22             |
| EUR RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S 1.50000% 18-26.04.38            | 1 500 000.00 | 1 743 625.95                                            | 0.82             |
| EUR REDEXIS GAS FINANCE BV-REG-S 1.87500% 15-27.04.27           | 600 000.00   | 642 788.40                                              | 0.30             |
| EUR REN FINANCE B V-REG-S 2.50000% 15-12.02.25                  | 400 000.00   | 433 958.40                                              | 0.20             |
| EUR ROBERT BOSCH GMBH-REG-S 1.75000% 14-08.07.24                | 1 500 000.00 | 1 583 790.00                                            | 0.75             |
| EUR ROMANIA-REG-S 4.62500% 19-03.04.49                          | 1 000 000.00 | 1 170 500.00                                            | 0.55             |
| EUR RYANAIR DAC-REG-S 0.87500% 21-25.05.26                      | 335 000.00   | 340 285.63                                              | 0.16             |
| EUR SVENSKA HANDELSBANKEN AB-REG-S 1.00000% 20-15.04.25         | 145 000.00   | 151 005.90                                              | 0.07             |
| EUR TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA-REG-S 1.99400% 20-08.04.32   | 100 000.00   | 114 477.80                                              | 0.05             |
| EUR TRATON FINANCE LUXEMBOURG SA-REG-S 1.25000% 21-24.03.33     | 300 000.00   | 301 998.00                                              | 0.14             |
| EUR UBS GROUP AG-REG-S 1.25000% 16-01.09.26                     | 900 000.00   | 943 416.00                                              | 0.45             |
| EUR UNION FENOSA FINANCE BV-REG-S 1.25000% 20-15.01.26          | 200 000.00   | 209 931.62                                              | 0.10             |
| EUR VODAFONE GROUP PLC-REG-S 1.60000% 16-29.07.31               | 300 000.00   | 323 211.00                                              | 0.15             |
| EUR VODAFONE GROUP PLC-REG-S 2.50000% 19-24.05.39               | 150 000.00   | 173 565.00                                              | 0.08             |
| EUR VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG-REG-S 1.50000% 19-01.10.24 | 680 000.00   | 709 260.40                                              | 0.33             |
| EUR VONOVIA SE-REG-S 0.37500% 21-16.06.27                       | 300 000.00   | 300 061.20                                              | 0.14             |
| EUR VONOVIA SE-REG-S 1.62500% 21-01.09.51                       | 200 000.00   | 186 492.00                                              | 0.09             |
| EUR WESTPAC BANKING CORP-REG-S 0.37500% 19-02.04.26             | 600 000.00   | 614 794.38                                              | 0.29             |
| EUR WESTPAC BANKING CORP-REG-S 0.01000% 21-22.09.28             | 925 000.00   | 922 049.25                                              | 0.44             |
| EUR ZF FINANCE GMBH-REG-S 3.75000% 20-21.09.28                  | 300 000.00   | 327 000.00                                              | 0.15             |
| Total EUR                                                       |              | 44 506 473.93                                           | 21.02            |
| GBP                                                             |              |                                                         |                  |
| GBP AA BOND CO LTD-REG-S 3.25000% 21-31.07.28                   | 100 000.00   | 118 823.26                                              | 0.06             |
| Total GBP                                                       |              | 118 823.26                                              | 0.06             |
| USD                                                             |              |                                                         |                  |
| USD INDIAN RAILWAY FINANCE CORP LTD-REG-S 2.80000% 21-10.02.31  | 585 000.00   | 486 954.01                                              | 0.23             |
| USD MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 8.75000% 17-09.03.24          | 500 000.00   | 487 860.78                                              | 0.23             |
| USD PERTAMINA PERSERO PT-REG-S 4.70000% 19-30.07.49             | 215 000.00   | 199 229.09                                              | 0.10             |
| USD QTEL INTERNATIONAL FINANCE LTD-REG-S 2.62500% 21-08.04.31   | 200 000.00   | 176 021.40                                              | 0.08             |
| USD REC LTD-REG-S 2.25000% 21-01.09.26                          | 560 000.00   | 470 753.70                                              | 0.22             |
| Total USD                                                       |              | 1 820 818.98                                            | 0.86             |
| 固定利付ミディアム・ターム・ノート合計                                             |              | 46 581 623.78                                           | 22.00            |
| ミディアム・ターム・ノート、ゼロ・クーポン                                           |              |                                                         |                  |
| EUR                                                             |              |                                                         |                  |
| EUR SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCH NV-REG-S 0.00000% 20-20.02.23  | 400 000.00   | 402 092.00                                              | 0.19             |
| Total EUR                                                       |              | 402 092.00                                              | 0.19             |
| ミディアム・ターム・ノート、ゼロ・クーポン合計                                         |              | 402 092.00                                              | 0.19             |
| 変動利付ミディアム・ターム・ノート                                               |              |                                                         |                  |

注記は、財務書類と不可分のものである。

## U B S（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル

## 2021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<br>ユーロ<br>先物 / 為替予約契約 /<br>スワップに係る<br>未実現損益<br>(注1) | 純資産<br>割合<br>(%) |
|------------------------------------------------------------------|------------|---------------------------------------------------------|------------------|
| EUR                                                              |            |                                                         |                  |
| EUR AXA SA-REG-S-SUB 3.250%/VAR 18-28.05.49                      | 100 000.00 | 114 387.60                                              | 0.05             |
| EUR BANK OF AMERICA CORP-REG-S 0.808%/VAR 19-09.05.26            | 900 000.00 | 924 021.00                                              | 0.44             |
| EUR BANK OF AMERICA CORP-REG-S 3.648%/VAR 20-31.03.29            | 330 000.00 | 395 811.24                                              | 0.19             |
| EUR BARCLAYS PLC-REG-S 3.375%/VAR 20-02.04.25                    | 170 000.00 | 183 943.96                                              | 0.09             |
| EUR COMMONWEALTH BK OF AUSTRLIA-REG-S-SUB 1.936%/VAR 17-03.10.29 | 200 000.00 | 209 414.00                                              | 0.10             |
| EUR CREDIT AGRICOLE SA-REG-S 1.000%/VAR 20-22.04.26              | 700 000.00 | 721 308.00                                              | 0.34             |
| EUR CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S 3.250%/VAR 20-02.04.26          | 100 000.00 | 110 128.00                                              | 0.05             |
| EUR DEUTSCHE BANK AG-REG-S 1.000%/VAR 20-19.11.25                | 200 000.00 | 204 290.00                                              | 0.10             |
| EUR DEUTSCHE BANK AG-REG-S 1.750%/VAR 20-19.11.30                | 200 000.00 | 210 460.00                                              | 0.10             |
| EUR IBERDROLA INTERNATIONAL BV-REG-S-SUB 2.625%/VAR 18-PRP       | 100 000.00 | 105 071.00                                              | 0.05             |
| EUR ING GROEP NV-SUB 3.000%/VAR 17-11.04.28                      | 600 000.00 | 626 958.00                                              | 0.29             |
| EUR LLOYDS BANKING GROUP PLC-REG-S 3.500%/VAR 20-01.04.26        | 115 000.00 | 128 639.00                                              | 0.06             |
| EUR NATWEST GROUP PLC-REG-S 2.000%/VAR 18-04.03.25               | 400 000.00 | 419 030.40                                              | 0.20             |
| EUR NATWEST GROUP PLC-REG-S-SUB 1.043%/VAR 21-14.09.32           | 270 000.00 | 268 937.82                                              | 0.13             |
| EUR TOTAL SE-REG-S-SUB 2.625%/VAR 15-PRP                         | 100 000.00 | 105 328.60                                              | 0.05             |
| EUR TOTAL SE-REG-S-SUB 2.125%/VAR 21-PRP                         | 510 000.00 | 498 518.88                                              | 0.23             |
| EUR VIRGIN MONEY UK PLC-REG-S 0.000%/VAR 21-27.05.24             | 230 000.00 | 231 863.00                                              | 0.11             |
| Total EUR                                                        |            | 5 458 110.50                                            | 2.58             |
| 変動利付ミディアム・ターム・ノート合計                                              |            | 5 458 110.50                                            | 2.58             |

## 固定利付債券

|                                                                  |              |              |      |
|------------------------------------------------------------------|--------------|--------------|------|
| EUR                                                              |              |              |      |
| EUR ABBOTT IRELAND FINCING DAC-REG-S 0.87500% 18-27.09.23        | 225 000.00   | 230 197.50   | 0.11 |
| EUR ADLER REAL ESTATE AG-REG-S 3.00000% 18-27.04.26              | 400 000.00   | 349 600.00   | 0.16 |
| EUR ADO PROPERTIES SA-REG-S 1.50000% 17-26.07.24                 | 100 000.00   | 87 750.00    | 0.04 |
| EUR ALSTRIA OFFICE REIT-AG-REG-S 1.50000% 20-23.06.26            | 200 000.00   | 208 328.80   | 0.10 |
| EUR ALTRIA GROUP INC 2.20000% 19-15.06.27                        | 400 000.00   | 430 718.40   | 0.20 |
| EUR APPLE INC 1.37500% 17-24.05.29                               | 500 000.00   | 544 264.00   | 0.26 |
| EUR AROUNDTOWN SA-REG-S 0.37500% 19-23.09.22                     | 100 000.00   | 100 452.60   | 0.05 |
| EUR AUSTRIA, REPUBLIC OF 2.40000% 13-23.05.34                    | 2 500 000.00 | 3 189 580.00 | 1.51 |
| EUR AUTOSTRADE PER L'ITALIA SPA REG-S 2.00000% 21-15.01.30       | 455 000.00   | 477 067.50   | 0.23 |
| EUR BELGIUM, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.90000% 15-22.06.38          | 2 700 000.00 | 3 300 442.20 | 1.56 |
| EUR BNZ INTERNATIONAL FUND LTD/LONDON 0.50000% 17-03.07.24       | 900 000.00   | 919 908.00   | 0.43 |
| EUR BPCE SA-REG-S 0.25000% 20-15.01.26                           | 200 000.00   | 201 644.00   | 0.10 |
| EUR BRISTOL MYERS SQUIBB CO 1.75000% 15-15.05.35                 | 200 000.00   | 225 256.40   | 0.11 |
| EUR CAIXABANK SA-REG-S 1.12500% 15-05.08.22                      | 1 000 000.00 | 1 013 148.00 | 0.48 |
| EUR CELANESE US HOLDINGS LLC 0.62500% 21-10.09.28                | 180 000.00   | 178 937.64   | 0.08 |
| EUR CHUBB INA HOLDINGS INC 2.50000% 18-15.03.38                  | 200 000.00   | 239 038.40   | 0.11 |
| EUR CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 1.75000% 18-14.06.22          | 500 000.00   | 505 250.00   | 0.24 |
| EUR EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.00000% 16-14.04.32                | 2 000 000.00 | 2 193 024.00 | 1.04 |
| EUR EUROPEAN UNION-REG-S 0.10000% 20-04.10.40                    | 535 000.00   | 498 596.46   | 0.24 |
| EUR FINNAIR OYJ-REG-S 4.25000% 21-19.05.25                       | 295 000.00   | 304 956.25   | 0.14 |
| EUR FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 4.00000% 06-25.10.38                 | 1 910 000.00 | 3 009 090.40 | 1.42 |
| EUR FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 4.50000% 09-25.04.41                 | 1 040 000.00 | 1 790 441.12 | 0.85 |
| EUR FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 3.25000% 12-25.05.45           | 2 000 000.00 | 3 104 552.00 | 1.47 |
| EUR FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 1.50000% 19-25.05.50      | 700 000.00   | 810 247.20   | 0.38 |
| EUR GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 1.25000% 17-15.08.48              | 1 000 000.00 | 1 262 062.00 | 0.60 |
| EUR GREECE, HELLENIC REPUBLIC OF-144A-REG-S 1.87500% 19-23.07.26 | 2 210 000.00 | 2 394 259.19 | 1.13 |
| EUR IMPERIAL BRANDS FINANCE PLC-REG-S 1.37500% 17-27.01.25       | 900 000.00   | 928 569.60   | 0.44 |
| EUR INEOS QUATTRO FINANCE 2 PLC-REG-S 2.50000% 21-15.01.26       | 200 000.00   | 201 744.40   | 0.10 |
| EUR INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 0.37500% 19-31.01.23    | 300 000.00   | 302 922.60   | 0.14 |

注記は、財務書類と不可分のものである。

## U B S（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル

## 2021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<br>ユーロ<br>先物 / 為替予約契約 /<br>スワップに係る<br>未実現損益<br>(注1) | 純資産<br>割合<br>(%) |
|------------------------------------------------------------------|--------------|---------------------------------------------------------|------------------|
| EUR INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 1.25000% 19-29.01.27    | 200 000.00   | 211 636.00                                              | 0.10             |
| EUR INTRUM JUSTITIA AB-REG-S 3.12500% 17-15.07.24                | 400 000.00   | 402 020.00                                              | 0.19             |
| EUR IRELAND, REPUBLIC OF-REG-S 1.70000% 17-15.05.37              | 730 000.00   | 861 662.80                                              | 0.41             |
| EUR ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 3.250% 14-01.09.46         | 3 600 000.00 | 4 731 120.00                                            | 2.23             |
| EUR ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 1.65000% 15-01.03.32       | 2 600 000.00 | 2 788 656.00                                            | 1.32             |
| EUR ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 2.70000% 16-01.03.47       | 1 300 000.00 | 1 561 300.00                                            | 0.74             |
| EUR ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 2.25000% 16-01.09.36       | 4 283 000.00 | 4 859 543.19                                            | 2.29             |
| EUR ITALY, REPUBLIC OF-BTP 2.05000% 17-01.08.27                  | 600 000.00   | 660 960.00                                              | 0.31             |
| EUR ITALY, REPUBLIC OF-BTP-REG-S 3.00000% 19-01.08.29            | 200 000.00   | 237 040.00                                              | 0.11             |
| EUR MATTERHORN TELECOM SA-REG-S 3.12500% 19-15.09.26             | 330 000.00   | 330 000.00                                              | 0.16             |
| EUR MPT OPERATING PARTNERSHIP LP/FIN CORP 3.32500% 17-24.03.25   | 300 000.00   | 325 746.60                                              | 0.15             |
| EUR NETHERLANDS, KINGDOM OF THE 4.00000% 05-15.01.37             | 1 200 000.00 | 1 904 380.80                                            | 0.90             |
| EUR PERU, REPUBLIC OF 3.75000% 16-01.03.30                       | 350 000.00   | 414 378.12                                              | 0.20             |
| EUR PORTUGAL, REPUBLIC OF-144A-REG-S 2.87500% 15-15.10.25        | 2 000 000.00 | 2 274 751.20                                            | 1.07             |
| EUR PORTUGAL, REPUBLIC OF-144A-REG-S 2.25000% 18-18.04.34        | 1 400 000.00 | 1 689 336.60                                            | 0.80             |
| EUR RABOBANK NEDERLAND NV-SUB 3.87500% 13-25.07.23               | 3 000 000.00 | 3 218 928.00                                            | 1.52             |
| EUR SLOVAKIA, REPUBLIC OF-REG-S 0.75000% 19-09.04.30             | 800 000.00   | 852 819.20                                              | 0.40             |
| EUR SLOVENIA, REPUBLIC OF-REG-S 1.50000% 15-25.03.35             | 2 500 000.00 | 2 822 720.00                                            | 1.33             |
| EUR SLOVENIA, REPUBLIC OF-REG-S 3.12500% 15-07.08.45             | 750 000.00   | 1 125 178.50                                            | 0.53             |
| EUR SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 2.90000% 16-31.10.46            | 2 000 000.00 | 2 737 968.00                                            | 1.29             |
| EUR SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.50000% 17-30.04.27            | 100 000.00   | 109 316.73                                              | 0.05             |
| EUR SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 2.70000% 18-31.10.48            | 2 600 000.00 | 3 457 864.80                                            | 1.63             |
| EUR SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.85000% 19-30.07.35            | 2 826 000.00 | 3 239 647.27                                            | 1.53             |
| EUR STANDARD PROFIL AUTOMOTIVE GMBH-REG-S 6.25000% 21-30.04.26   | 470 000.00   | 428 640.00                                              | 0.20             |
| EUR TAURON POLSKA ENERGIA SA-REG-S 2.37500% 17-05.07.27          | 200 000.00   | 209 600.00                                              | 0.10             |
| EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV-REG-S 1.12500% 16-15.10.24 | 200 000.00   | 190 787.50                                              | 0.09             |
| EUR UMG GROUPE VYV 1.62500% 19-02.07.29                          | 100 000.00   | 106 728.40                                              | 0.05             |
| EUR UNITED GROUP BV-REG-S 3.12500% 20-15.02.26                   | 335 000.00   | 323 945.00                                              | 0.15             |
| EUR UPC HOLDING BV-REG-S 3.87500% 17-15.06.29                    | 350 000.00   | 359 247.00                                              | 0.17             |
| EUR UTAH ACQUISITION SUB INC-REG-S 3.12500% 16-22.11.28          | 100 000.00   | 115 527.20                                              | 0.05             |
| EUR VERIZON COMMUNICATIONS INC 0.87500% 19-08.04.27              | 550 000.00   | 568 714.30                                              | 0.27             |
| EUR VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FIN NV-REG-S 1.12500% 17-02.10.23   | 600 000.00   | 614 916.00                                              | 0.29             |
| EUR VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FIN NV-REG-S 4.12500% 18-16.11.38   | 200 000.00   | 275 728.00                                              | 0.13             |
| EUR WINTERSHALL DEA FINANCE BV-REG-S 1.33200% 19-25.09.28        | 300 000.00   | 310 651.80                                              | 0.15             |
| Total EUR                                                        |              | 73 323 507.67                                           | 34.63            |
| GBP                                                              |              |                                                         |                  |
| GBP BELLIS ACQUISITION CO PLC-REG-S 3.25000% 21-16.02.26         | 310 000.00   | 354 245.21                                              | 0.17             |
| GBP BERKELEY GROUP PLC/THE-REG-S 2.50000% 21-11.08.31            | 160 000.00   | 180 447.59                                              | 0.09             |
| GBP PREMIER FOODS FINANCE PLC-REG-S 3.50000% 21-15.10.26         | 280 000.00   | 327 797.26                                              | 0.15             |
| GBP ROTHESAY LIFE PLC-REG-S-SUB 3.37500% 19-12.07.26             | 315 000.00   | 390 465.24                                              | 0.18             |
| GBP VERY GROUP FUNDING PLC/THE-REG-S 6.50000% 21-01.08.26        | 450 000.00   | 530 666.09                                              | 0.25             |
| Total GBP                                                        |              | 1 783 621.39                                            | 0.84             |
| MXN                                                              |              |                                                         |                  |
| MXN MEXICO, UNITED MEXICAN STATES 7.75000% 11-13.11.42           | 1 003 800.00 | 4 163 148.98                                            | 1.97             |
| Total MXN                                                        |              | 4 163 148.98                                            | 1.97             |
| USD                                                              |              |                                                         |                  |
| USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 5.62500% 16-21.02.47          | 600 000.00   | 516 027.43                                              | 0.24             |
| USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 6.12500% 09-18.01.41                   | 500 000.00   | 474 513.56                                              | 0.22             |
| USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 2.70000% 21-12.07.26    | 200 000.00   | 159 627.25                                              | 0.08             |
| USD MOROCCO, KINGDOM OF THE-REG-S 5.50000% 12-11.12.42           | 500 000.00   | 484 894.74                                              | 0.23             |
| Total USD                                                        |              | 1 635 062.98                                            | 0.77             |

注記は、財務書類と不可分のものである。

## U B S（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル

## 2021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<br>ユーロ<br>先物 / 為替予約契約 /<br>スワップに係る<br>未実現損益<br>(注1) | 純資産<br>割合<br>(%) |
|--------------------------------------------------------------|---------------|---------------------------------------------------------|------------------|
| ZAR                                                          |               |                                                         |                  |
| ZAR SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 8.75000% 12-28.02.48           | 70 000 000.00 | 3 304 245.65                                            | 1.56             |
| Total ZAR                                                    |               | 3 304 245.65                                            | 1.56             |
| 固定利付債券合計                                                     |               | 84 209 586.67                                           | 39.77            |
| 変動利付債券                                                       |               |                                                         |                  |
| EUR                                                          |               |                                                         |                  |
| EUR BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S 3.250%/VAR 20-PRP           | 130 000.00    | 138 728.20                                              | 0.06             |
| EUR BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S-SUB 3.625%/VAR 20-PRP       | 100 000.00    | 108 250.00                                              | 0.05             |
| EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 4.000%/VAR 18-PRP     | 200 000.00    | 213 420.00                                              | 0.10             |
| EUR HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA-REG-S-SUB 3.000%/VAR 19-PRP | 300 000.00    | 313 672.80                                              | 0.15             |
| EUR SES SA-REG-S-SUB 2.875%/VAR 21-PRP                       | 695 000.00    | 707 839.43                                              | 0.33             |
| EUR UNIBAIL-RODAMCO SE-REG-S-SUB 2.125%/VAR 18-PRP           | 100 000.00    | 99 754.00                                               | 0.05             |
| EUR UNIBAIL-RODAMCO SE-REG-S-SUB 2.875%/VAR 18-PRP           | 100 000.00    | 101 859.00                                              | 0.05             |
| EUR VONOVIA FINANCE BV-REG-S-SUB 4.000%/VAR 14-PRP           | 100 000.00    | 100 738.00                                              | 0.05             |
| Total EUR                                                    |               | 1 784 261.43                                            | 0.84             |
| GBP                                                          |               |                                                         |                  |
| GBP M&G PLC-REG-S-SUB 5.625%/VAR 18-20.10.51                 | 190 000.00    | 260 802.04                                              | 0.13             |
| Total GBP                                                    |               | 260 802.04                                              | 0.13             |
| NZD                                                          |               |                                                         |                  |
| NZD NEW ZEALAND-REG-S 2.500%/CPI LINKED 14-20.09.35          | 8 000 000.00  | 6 705 417.00                                            | 3.17             |
| Total NZD                                                    |               | 6 705 417.00                                            | 3.17             |
| USD                                                          |               |                                                         |                  |
| USD RAKUTEN GROUP INC-REG-S-SUB 6.250%/VAR 21-PRP            | 540 000.00    | 492 730.48                                              | 0.23             |
| Total USD                                                    |               | 492 730.48                                              | 0.23             |
| 変動利付債券合計                                                     |               | 9 243 210.95                                            | 4.37             |
| 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                        |               | 171 035 049.84                                          | 80.78            |
| 他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品                          |               |                                                         |                  |
| 変動利付アセット・バック証券                                               |               |                                                         |                  |
| USD                                                          |               |                                                         |                  |
| USD SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM LLC-144A VAR 17-26.03.40  | 475 000.00    | 427 496.59                                              | 0.20             |
| Total USD                                                    |               | 427 496.59                                              | 0.20             |
| 変動利付アセット・バック証券合計                                             |               | 427 496.59                                              | 0.20             |
| 固定利付モーゲージ・バック証券                                              |               |                                                         |                  |
| USD                                                          |               |                                                         |                  |
| USD BENCHMARK MORTGAGE TRUST-SUB 3.97900% 19-01.03.62        | 750 000.00    | 723 352.75                                              | 0.34             |
| USD MSBAM LYNCH TRUST-SUB 3.99400% 16-01.12.49               | 313 000.00    | 294 312.21                                              | 0.14             |
| Total USD                                                    |               | 1 017 664.96                                            | 0.48             |
| 固定利付モーゲージ・バック証券合計                                            |               | 1 017 664.96                                            | 0.48             |

注記は、財務書類と不可分のものである。

## U B S（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル

## 2021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<br>ユーロ<br>先物 / 為替予約契約 /<br>スワップに係る<br>未実現損益<br>(注1) | 純資産<br>割合<br>(%) |
|------------------------------------------------------------------|----------------|---------------------------------------------------------|------------------|
| <b>変動利付モーゲージ・バック証券</b>                                           |                |                                                         |                  |
| USD                                                              |                |                                                         |                  |
| USD AVENTURA MALL TRUST-144A FLR 18-01.07.40                     | 650 000.00     | 633 183.06                                              | 0.30             |
| USD BAML COMMERCIAL MORT SET-144A 1M LIBOR+135BP 18-15.09.34     | 550 000.00     | 472 772.87                                              | 0.22             |
| USD BANK 2017-BNK9 VAR 17-01.11.54                               | 450 000.00     | 427 342.79                                              | 0.20             |
| USD BANK-SUB FLR 18-01.02.61                                     | 505 000.00     | 466 903.72                                              | 0.22             |
| USD BBCMS TRUST CBM-144A 1M LIBOR+119.1098BP 18-15.07.37         | 550 000.00     | 474 721.58                                              | 0.22             |
| USD BENCHMARK MORTGAGE TRUST VAR 18-01.02.51                     | 250 000.00     | 240 914.11                                              | 0.11             |
| USD BENCHMARK MORTGAGE TRUST-SUB FLR 18-01.10.51                 | 550 000.00     | 519 989.97                                              | 0.25             |
| USD CAMB COMM MORTGAGE TRUST-144A-SUB 1M LIBOR+145BP 19-15.12.37 | 175 000.00     | 151 138.38                                              | 0.07             |
| USD CAMB COMM MORTGAGE TRUST-144A-SUB 1M LIBOR+175BP 19-15.12.37 | 430 000.00     | 371 369.41                                              | 0.18             |
| USD CHT COSMO MORTGAGE TRUST-144A-SUB 1M LIBOR+225BP 17-15.11.36 | 600 000.00     | 518 200.63                                              | 0.25             |
| USD CORE TRUST CORE-144A 1M LIBOR+110BP 19-15.12.31              | 230 000.00     | 158 572.71                                              | 0.08             |
| USD GS MORTGAGE SECURITIES TRUST-144A VAR 17-01.01.43            | 1 225 000.00   | 1 151 810.97                                            | 0.54             |
| USD JP MORGAN CHASE MORTGAGE SECURITIES-144A-SUB FLR 18-01.01.31 | 685 000.00     | 601 709.80                                              | 0.28             |
| Total USD                                                        |                | 6 188 630.00                                            | 2.92             |
| <b>変動利付モーゲージ・バック証券合計</b>                                         |                | 6 188 630.00                                            | 2.92             |
| <b>固定利付ノート</b>                                                   |                |                                                         |                  |
| USD                                                              |                |                                                         |                  |
| USD AMERICAN AIRLINES GROUP INC-144A 3.75000% 20-01.03.25        | 700 000.00     | 544 259.89                                              | 0.26             |
| USD AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD-144A 2.12500% 21-21.02.26        | 165 000.00     | 140 768.59                                              | 0.06             |
| USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 5.30000% 21-01.10.29       | 280 000.00     | 292 047.79                                              | 0.14             |
| USD ENLINK MIDSTREAM PARTNERS LP 4.40000% 14-01.04.24            | 110 000.00     | 98 654.99                                               | 0.05             |
| Total USD                                                        |                | 1 075 731.26                                            | 0.51             |
| <b>固定利付ノート合計</b>                                                 |                | 1 075 731.26                                            | 0.51             |
| <b>固定利付債券</b>                                                    |                |                                                         |                  |
| EUR                                                              |                |                                                         |                  |
| EUR PANTHER BF AGGR 2/PANTHER FIN CO-REG-S 4.37500% 19-15.05.26  | 400 000.00     | 413 505.60                                              | 0.19             |
| Total EUR                                                        |                | 413 505.60                                              | 0.19             |
| RUB                                                              |                |                                                         |                  |
| RUB RUSSIA, FEDERATION OF 7.65000% 19-10.04.30                   | 270 000 000.00 | 3 293 708.91                                            | 1.56             |
| Total RUB                                                        |                | 3 293 708.91                                            | 1.56             |
| <b>固定利付債券合計</b>                                                  |                | 3 707 214.51                                            | 1.75             |
| <b>変動利付債券</b>                                                    |                |                                                         |                  |
| NZD                                                              |                |                                                         |                  |
| NZD NEW ZEALAND 2.500%/CPI LINKED 17-20.09.40                    | 14 000 000.00  | 11 677 479.85                                           | 5.52             |
| NZD NEW ZEALAND 3.000%/CPI LINKED 13-20.09.30                    | 1 800 000.00   | 1 511 922.39                                            | 0.71             |
| Total NZD                                                        |                | 13 189 402.24                                           | 6.23             |
| <b>変動利付債券合計</b>                                                  |                | 13 189 402.24                                           | 6.23             |
| <b>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</b>                     |                | 25 606 139.56                                           | 12.09            |

注記は、財務書類と不可分のものである。

## U B S（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル

## 2021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<br>ユーロ<br>先物 / 為替予約契約 /<br>スワップに係る<br>未実現損益<br>(注1) | 純資産<br>割合<br>(%) |
|----|---------|---------------------------------------------------------|------------------|
|----|---------|---------------------------------------------------------|------------------|

## 最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品

## 固定利付ノート

|       |          |          |          |             |            |            |      |
|-------|----------|----------|----------|-------------|------------|------------|------|
| USD   |          |          |          |             |            |            |      |
| USD   | BROADCOM | INC-144A | 1.95000% | 21-15.02.28 | 200 000.00 | 170 395.07 | 0.08 |
| USD   | BROADCOM | INC-144A | 2.60000% | 21-15.02.33 | 700 000.00 | 580 190.61 | 0.27 |
| Total | USD      |          |          |             |            | 750 585.68 | 0.35 |

|           |  |            |      |
|-----------|--|------------|------|
| 固定利付ノート合計 |  | 750 585.68 | 0.35 |
|-----------|--|------------|------|

|                              |  |            |      |
|------------------------------|--|------------|------|
| 最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計 |  | 750 585.68 | 0.35 |
|------------------------------|--|------------|------|

## 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    | 14 389.00    | 0.01 |
| USD       | UBS (LUX) BOND SICAV - ASIAN HIGH YIELD (USD) I-X-DIST | 45 000.00 | 3 474 351.78 | 1.64 |
| USD       | UBS (LUX) BOND SICAV - MULTI INCOME (USD)-U-X-ACC- CAP | 320.00    | 2 960 887.01 | 1.40 |
| USD       | UBS (LUX) BOND SICAV - CHINA HIGH YIELD (USD) U-X-ACC  | 200.00    | 1 628 927.91 | 0.77 |
| ルクセンブルグ合計 |                                                        |           | 8 078 555.70 | 3.82 |

|                  |  |              |      |
|------------------|--|--------------|------|
| 投資信託、オープン・エンド型合計 |  | 8 078 555.70 | 3.82 |
|------------------|--|--------------|------|

## 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

|  |  |              |      |
|--|--|--------------|------|
|  |  | 8 078 555.70 | 3.82 |
|--|--|--------------|------|

## 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

## その他のスワップに係るオプション、従来型

|       |                                                              |                |            |       |
|-------|--------------------------------------------------------------|----------------|------------|-------|
| USD   |                                                              |                |            |       |
| USD   | GOLDMAN SACH/CDX.NA.HY.36 SWAPTION PUT 108.00000 21-17.11.21 | 19 500 000.00  | 115 741.45 | 0.05  |
| USD   | GOLDMAN SACH/CDX.NA.HY.36 SWAPTION PUT 105.00000 21-17.11.21 | -19 500 000.00 | -47 165.45 | -0.02 |
| USD   | GOLDMAN SACH/CDX.NA.HY.36 SWAPTION PUT 103.00000 21-17.11.21 | -19 500 000.00 | -27 630.96 | -0.01 |
| Total | USD                                                          |                | 40 945.04  | 0.02  |

|                        |  |           |      |
|------------------------|--|-----------|------|
| その他のスワップに係るオプション、従来型合計 |  | 40 945.04 | 0.02 |
|------------------------|--|-----------|------|

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

|  |  |           |      |
|--|--|-----------|------|
|  |  | 40 945.04 | 0.02 |
|--|--|-----------|------|

|          |  |                |       |
|----------|--|----------------|-------|
| 投資有価証券合計 |  | 205 511 275.82 | 97.06 |
|----------|--|----------------|-------|

注記は、財務書類と不可分のものである。

## U B S（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル

## 2021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<br>ユーロ<br>先物 / 為替予約契約 /<br>スワップに係る<br>未実現損益<br>(注1) | 純資産<br>割合<br>(%) |
|-----------------------------------------------------|---------|---------------------------------------------------------|------------------|
| 派生商品                                                |         |                                                         |                  |
| 公認の証券取引所に上場されている派生商品                                |         |                                                         |                  |
| 債券に係る金融先物                                           |         |                                                         |                  |
| EUR EURO BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 08.12.21       | 40.00   | -50 290.00                                              | -0.02            |
| EUR SHORT EURO BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 08.12.21 | 40.00   | -6 400.00                                               | 0.00             |
| EUR EURO-BOBL FUTURE 08.12.21                       | 112.00  | -91 840.00                                              | -0.04            |
| EUR EURO-SCHATZ FUTURE 08.12.21                     | 280.00  | -21 000.00                                              | -0.01            |
| EUR EURO-BUXL FUTURE 08.12.21                       | -9.00   | 9 600.00                                                | 0.00             |
| EUR EURO-OAT FUTURE 08.12.21                        | 110.00  | -321 200.00                                             | -0.15            |
| GBP LONG GILT FUTURE 29.12.21                       | 20.00   | -87 954.84                                              | -0.04            |
| JPY JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 13.12.21 | -5.00   | 18 560.07                                               | 0.01             |
| CAD CAN 10YR BOND FUTURE 20.12.21                   | -10.00  | 22 884.92                                               | 0.01             |
| USD US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 21.12.21        | -21.00  | 88 617.40                                               | 0.04             |
| USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.12.21           | -35.00  | 38 457.51                                               | 0.02             |
| USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.12.21            | -120.00 | 58 242.37                                               | 0.03             |
| USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 21.12.21              | -76.00  | 139 808.66                                              | 0.06             |
| USD US LONG BOND FUTURE 21.12.21                    | -24.00  | 55 006.69                                               | 0.02             |
| 債券に係る金融先物合計                                         |         | -147 507.22                                             | -0.07            |
| 公認の証券取引所に上場されている派生商品合計                              |         | -147 507.22                                             | -0.07            |

## 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

|                                                       |                |             |       |
|-------------------------------------------------------|----------------|-------------|-------|
| NZD LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER 2.27500% 18-17.10.22 | -27 000 000.00 | -350 557.68 | -0.16 |
| NZD LCH/INTEREST RATE SWAP REC 3MF 18-17.10.22        |                |             |       |
| USD LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 1.29910% 20-03.03.50   | -1 000 000.00  | 107 674.86  | 0.05  |
| USD LCH/INTEREST RATE SWAP REC 3M LIBOR 20-03.03.50   |                |             |       |
| PLN LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 2.11600% 20-23.01.30   | -24 500 000.00 | -66 463.51  | -0.03 |
| PLN LCH/INTEREST RATE SWAP REC 6MWIB 20-23.01.30      |                |             |       |
| PLN LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 1.91900% 20-10.02.30   | -29 000 000.00 | 30 639.88   | 0.01  |
| 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 | 211 612.45  | 0.10  |
| PLN LCH/INTEREST RATE SWAP REC 6MWIB 20-07.05.30      |                |             |       |
| GBP LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 0.50088% 21-02.02.51   | -2 700 000.00  | 395 663.72  | 0.19  |
| GBP LCH/INTEREST RATE SWAP REC SONIA O/N 21-02.02.51  |                |             |       |
| GBP LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 0.51415% 21-03.02.51   | -1 500 000.00  | 213 829.74  | 0.10  |
| GBP LCH/INTEREST RATE SWAP REC SONIA O/N 21-03.02.51  |                |             |       |
| GBP LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 0.52190% 21-04.02.51   | -1 500 000.00  | 210 369.27  | 0.10  |
| GBP LCH/INTEREST RATE SWAP REC SONIA O/N 21-04.02.51  |                |             |       |
| GBP LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 0.88544% 21-28.02.51   | -800 000.00    | 24 724.28   | 0.01  |
| GBP LCH/INTEREST RATE SWAP REC SONIA O/N 21-28.02.51  |                |             |       |
| NZD LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 1.20750% 19-27.09.29   | -11 200 000.00 | 449 383.83  | 0.21  |
| NZD LCH/INTEREST RATE SWAP REC 3MFRA 19-27.09.29      |                |             |       |
| NZD LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 1.67500% 24-30.10.29   | -18 000 000.00 | 369 322.56  | 0.17  |
| 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 | 431 940.52  | 0.20  |
| 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 | -118 195.55 | -0.05 |
| 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。

## U B S（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル

## 2021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<br>ユーロ<br>先物 / 為替予約契約 /<br>スワップに係る<br>未実現損益<br>(注1) | 純資産<br>割合<br>(%) |
|----------------------------------------------------------|-------------------|---------------------------------------------------------|------------------|
| CNY CITI/INTEREST RATE SWAP PAY CNRR007 19-28.08.24      | -80 000 000.00    | 131 447.11                                              | 0.06             |
| CNY CITI/INTEREST RATE SWAP REC 2.77000% 19-28.08.24     |                   |                                                         |                  |
| CNY JPMORGAN/INTEREST RATE SWAP PAY CNRR007 20-10.06.25  | -50 000 000.00    | -41 080.57                                              | -0.02            |
| CNY JPMORGAN/INTEREST RATE SWAP REC 2.23500% 20-10.06.25 |                   |                                                         |                  |
| CNY CITI/INTEREST RATE SWAP PAY CNRR007 20-11.06.25      | -50 000 000.00    | -32 239.30                                              | -0.01            |
| CNY CITI/INTEREST RATE SWAP REC 2.27000% 20-11.06.25     |                   |                                                         |                  |
| CNY JPMORGAN/INTEREST RATE SWAP PAY CNRR007 20-12.06.25  | -48 000 000.00    | -48 030.71                                              | -0.02            |
| CNY JPMORGAN/INTEREST RATE SWAP REC 2.19500% 20-12.06.25 |                   |                                                         |                  |
| MXN CME/INTEREST RATE SWAP PAY MXI 18-26.06.28           | -135 000 000.00   | 258 835.87                                              | 0.12             |
| MXN CME/INTEREST RATE SWAP REC 8.07000% 18-26.06.28      |                   |                                                         |                  |
| MXN CME/INTEREST RATE SWAP PAY MXI 18-12.07.28           | -120 000 000.00   | 254 071.66                                              | 0.12             |
| MXN CME/INTEREST RATE SWAP REC 8.13500% 18-12.07.28      |                   |                                                         |                  |
| CNY HSBC/INTEREST RATE SWAP PAY CNRR007 18-20.11.21      | -133 000 000.00   | 28 072.87                                               | 0.01             |
| CNY HSBC/INTEREST RATE SWAP REC 2.89500% 18-20.11.21     |                   |                                                         |                  |
| NZD LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 3MFRA 21-22.06.26         | -11 000 000.00    | -133 619.23                                             | -0.06            |
| NZD LCH/INTEREST RATE SWAP REC 1.32000% 21-22.06.26      |                   |                                                         |                  |
| HUF LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 6ML 21-10.08.26           | -2 200 000 000.00 | -101 764.21                                             | -0.05            |
| HUF LCH/INTEREST RATE SWAP REC 2.59600% 21-10.08.26      |                   |                                                         |                  |
| HUF LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 6ML 21-17.09.26           | -1 220 000 000.00 | -27 980.70                                              | -0.01            |
| HUF LCH/INTEREST RATE SWAP REC 2.83500% 21-17.09.26      |                   |                                                         |                  |
| 金利に係るスワップおよびフォワード・スワップ合計                                 |                   | 2 197 657.16                                            | 1.04             |

## クレジット・デフォルト・スワップ\*

|                                                                    |               |             |       |
|--------------------------------------------------------------------|---------------|-------------|-------|
| USD CITIBANK/BRAZIL CREDIT DEFAULT SWAP PAYER 1.00000% 19-20.06.24 | -1 900 000.00 | 12 871.25   | 0.01  |
| USD BOA/MEX CREDIT DEFAULT SWAP PAY 1.00000% 19-20.06.24           | -3 200 000.00 | -37 691.16  | -0.02 |
| USD JPMORGAN/BRAZIL CREDIT DEFAULT SWAP PAY 1.00000% 19-20.06.24   | -1 900 000.00 | 12 871.25   | 0.01  |
| USD BOA/TURKEY CREDIT DEFAULT SWAP REC 1.00000% 19-20.06.24        | 3 200 000.00  | -202 609.94 | -0.10 |
| USD CITI/SOAF CREDIT DEFAULT SWAP REC 1.00000% 19-20.06.24         | 1 900 000.00  | -11 262.82  | -0.01 |
| USD JPMORGAN/SOAF CREDIT DEFAULT SWAP REC 1.00000% 19-20.06.24     | 1 900 000.00  | -11 262.82  | -0.01 |
| EUR ICE/MARKIT ITRX EUR CDI REC 1.00000% 19-20.06.22               | 11 300 000.00 | 78 676.88   | 0.04  |
| EUR ICE/MARKIT ITRX EUR CDI REC 5.00000% 20-20.12.22               | 6 253 310.00  | 313 602.11  | 0.15  |
| クレジット・デフォルト・スワップ合計                                                 |               | 155 194.75  | 0.07  |

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

2 352 851.91 1.11

派生商品合計

2 205 344.69 1.04

## 為替予約契約

| 購入通貨 | 購入額              | 売却通貨 | 売却額               | 満期日       |             |       |
|------|------------------|------|-------------------|-----------|-------------|-------|
| MYR  | 4 004 000.00     | USD  | 955 608.59        | 6.10.2021 | 541.55      | 0.00  |
| KRW  | 2 283 000 000.00 | USD  | 1 970 872.86      | 6.10.2021 | -36 566.26  | -0.02 |
| USD  | 3 736 964.16     | RUB  | 275 223 300.00    | 6.10.2021 | -36 244.73  | -0.02 |
| USD  | 2 019 872.35     | TWD  | 55 700 000.00     | 6.10.2021 | 16 811.96   | 0.01  |
| USD  | 1 030 287.11     | IDR  | 14 712 500 000.00 | 6.10.2021 | 2 260.35    | 0.00  |
| USD  | 1 031 726.51     | INR  | 75 510 000.00     | 6.10.2021 | 12 547.89   | 0.01  |
| EUR  | 34 376 074.25    | USD  | 40 740 000.00     | 6.10.2021 | -773 947.51 | -0.37 |
| EUR  | 3 762 430.25     | CAD  | 5 620 000.00      | 6.10.2021 | -65 045.40  | -0.03 |
| EUR  | 860 000.00       | NZD  | 1 434 038.30      | 6.10.2021 | 6 480.01    | 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。

## U B S（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル

## 2021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 |                   | 満期日       | 評価額<br>ユーロ<br>先物 / 為替予約契約 /<br>スワップに係る<br>未実現損益<br>(注1) | 純資産<br>割合<br>(%) |
|--------------------------------|-------------------|---------|-------------------|-----------|---------------------------------------------------------|------------------|
| 購入通貨                           | 購入額               | 売却通貨    | 売却額               |           |                                                         |                  |
| EUR                            | 19 318 824.14     | NZD     | 32 230 000.00     | 6.10.2021 | 135 968.80                                              | 0.06             |
| NOK                            | 44 760 000.00     | EUR     | 4 354 655.78      | 6.10.2021 | 69 253.39                                               | 0.03             |
| PLN                            | 12 160 000.00     | EUR     | 2 693 040.33      | 6.10.2021 | -51 192.80                                              | -0.02            |
| EUR                            | 1 484 376.67      | GBP     | 1 275 000.00      | 6.10.2021 | 1 111.88                                                | 0.00             |
| TRY                            | 4 450 000.00      | EUR     | 443 483.14        | 6.10.2021 | -12 079.75                                              | -0.01            |
| SGD                            | 1 385 000.00      | EUR     | 868 175.65        | 6.10.2021 | 12 019.88                                               | 0.01             |
| EUR                            | 2 514 299.49      | SEK     | 25 600 000.00     | 6.10.2021 | -10 460.66                                              | 0.00             |
| EUR                            | 4 092 642.29      | ZAR     | 70 320 000.00     | 6.10.2021 | 62 075.43                                               | 0.03             |
| AUD                            | 2 445 000.00      | EUR     | 1 530 009.88      | 6.10.2021 | -6 177.75                                               | 0.00             |
| EUR                            | 852 111.26        | CHF     | 925 000.00        | 6.10.2021 | -3 499.81                                               | 0.00             |
| EUR                            | 4 374 008.93      | MXN     | 104 140 000.00    | 6.10.2021 | 3 624.80                                                | 0.00             |
| EUR                            | 1 458 465.27      | JPY     | 190 600 000.00    | 6.10.2021 | -15 445.81                                              | -0.01            |
| CHF                            | 925 000.00        | EUR     | 850 697.53        | 6.10.2021 | 4 913.54                                                | 0.00             |
| CAD                            | 1 291 880.58      | NZD     | 1 445 000.00      | 6.10.2021 | 19 786.89                                               | 0.01             |
| EUR                            | 860 000.00        | NOK     | 8 856 355.68      | 6.10.2021 | -15 328.71                                              | -0.01            |
| AUD                            | 1 390 000.00      | NZD     | 1 440 889.29      | 6.10.2021 | 8 712.61                                                | 0.00             |
| INR                            | 75 510 000.00     | USD     | 1 021 786.20      | 6.10.2021 | -3 969.74                                               | 0.00             |
| USD                            | 1 020 000.00      | CNY     | 6 597 972.00      | 8.10.2021 | -1 343.79                                               | 0.00             |
| PLN                            | 3 890 000.00      | JPY     | 110 585 733.00    | 6.10.2021 | -10 030.18                                              | 0.00             |
| USD                            | 360 000.00        | EUR     | 304 662.27        | 6.10.2021 | 5 941.75                                                | 0.00             |
| ZAR                            | 3 060 000.00      | USD     | 210 261.23        | 6.10.2021 | -6 019.88                                               | 0.00             |
| USD                            | 453 634.95        | NZD     | 645 000.00        | 6.10.2021 | 7 496.68                                                | 0.00             |
| CAD                            | 1 279 318.65      | AUD     | 1 380 000.00      | 6.10.2021 | 11 197.80                                               | 0.02             |
| EUR                            | 866 941.36        | NOK     | 8 740 000.00      | 6.10.2021 | 3 112.80                                                | 0.00             |
| EUR                            | 215 902.84        | GBP     | 185 000.00        | 6.10.2021 | 684.03                                                  | 0.00             |
| CNY                            | 6 597 972.00      | USD     | 1 020 331.25      | 8.10.2021 | 1 058.73                                                | 0.00             |
| USD                            | 1 017 654.77      | CNY     | 6 600 000.00      | 4.11.2021 | -1 717.89                                               | 0.00             |
| USD                            | 1 924 552.16      | KRW     | 2 283 000 000.00  | 6.10.2021 | -3 401.28                                               | 0.00             |
| KRW                            | 2 283 000 000.00  | USD     | 1 923 595.43      | 4.11.2021 | 3 749.37                                                | 0.00             |
| USD                            | 995 000.00        | IDR     | 14 307 105 000.00 | 4.11.2021 | -879.42                                                 | 0.00             |
| USD                            | 995 000.00        | CNY     | 6 449 092.50      | 4.11.2021 | -1 148.23                                               | 0.00             |
| USD                            | 955 608.59        | MYR     | 4 004 000.00      | 6.10.2021 | -541.63                                                 | 0.00             |
| RUB                            | 275 223 300.00    | USD     | 3 778 484.51      | 6.10.2021 | 397.47                                                  | 0.00             |
| MYR                            | 4 004 000.00      | USD     | 954 014.77        | 3.11.2021 | 611.89                                                  | 0.00             |
| USD                            | 3 759 644.89      | RUB     | 275 223 300.00    | 3.11.2021 | 1 213.28                                                | 0.00             |
| IDR                            | 14 712 500 000.00 | USD     | 1 028 990.07      | 6.10.2021 | -1 139.38                                               | 0.00             |
| TWD                            | 55 700 000.00     | USD     | 2 003 597.12      | 6.10.2021 | -2 777.85                                               | 0.00             |
| USD                            | 1 020 378.58      | CNY     | 6 597 972.00      | 8.10.2021 | -1 017.30                                               | 0.00             |
| USD                            | 1 025 475.71      | IDR     | 14 712 500 000.00 | 4.11.2021 | 1 071.96                                                | 0.00             |
| USD                            | 2 006 556.43      | TWD     | 55 700 000.00     | 4.11.2021 | 1 755.83                                                | 0.00             |
| USD                            | 130 000.00        | EUR     | 112 356.54        | 6.10.2021 | -193.98                                                 | 0.00             |
| USD                            | 995 000.00        | CAD     | 1 258 201.18      | 6.10.2021 | 1 582.89                                                | 0.00             |
| 為替予約契約合計                       |                   |         |                   |           | -664 186.28                                             | -0.31            |
| 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 |                   |         |                   |           | 8 502 834.05**                                          | 4.02             |
| 当座借越およびその他の短期負債                |                   |         |                   |           | -3 977 694.61                                           | -1.88            |
| その他の資産および負債                    |                   |         |                   |           | 152 185.89                                              | 0.07             |
| 純資産合計                          |                   |         |                   |           | 211 729 759.56                                          | 100.00           |

\*\* 2021年9月30日現在、76,000.00ユーロの現金が取引相手方であるJ P モルガンに対する担保および410,000.00ユーロの現金が取引相手方であるバンク・オブ・アメリカに対する担保となっている。

注記は、財務書類と不可分のものである。

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

## 2021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<br>米ドル<br>先物 / 為替予約契約 /<br>スワップに係る<br>未実現損益<br>(注1) | 純資産<br>割合<br>(%) |
|------------------------------------------------------------------|---------------|---------------------------------------------------------|------------------|
| USD                                                              |               |                                                         |                  |
| USD AIRPORT AUTHORITY-REG-S 1.62500% 21-04.02.31                 | 4 600 000.00  | 4 428 632.98                                            | 0.63             |
| USD ANTON OILFIELD SERVICES GROUP-REG-S 8.75000% 21-26.01.25     | 3 500 000.00  | 3 377 500.00                                            | 0.48             |
| USD AYC FINANCE LTD-REG-S 3.90000% 21-PRP                        | 11 975 000.00 | 11 528 931.25                                           | 1.65             |
| USD BHARTI AIRTEL LTD-REG-S 3.25000% 21-03.06.31                 | 1 950 000.00  | 1 938 690.00                                            | 0.28             |
| USD CENTRAL CHINA REAL ESTATE-REG-S 7.25000% 19-24.04.23         | 425 000.00    | 282 625.00                                              | 0.04             |
| USD CENTRAL CHINA REAL ESTATE-REG-S 7.25000% 20-16.07.24         | 3 600 000.00  | 2 189 925.00                                            | 0.31             |
| USD CENTRAL CHINA REAL ESTATE-REG-S 7.65000% 20-27.08.23         | 2 000 000.00  | 1 260 000.00                                            | 0.18             |
| USD CHAMPION PATH HOLDINGS-REG-S 4.50000% 21-27.01.26            | 1 750 000.00  | 1 780 261.88                                            | 0.25             |
| USD CHINA HUANENG GP HK TREASURY MGT-REG-S 2.60000% 19-10.12.24  | 4 000 000.00  | 4 163 840.00                                            | 0.60             |
| USD CHINA OIL AND GAS GROUP LTD-REG-S 4.70000% 21-30.06.26       | 1 400 000.00  | 1 435 000.00                                            | 0.21             |
| USD CK HUTCHISON INTERNATIONAL 20 LTD-REG-S 2.50000% 20-08.05.30 | 3 400 000.00  | 3 457 934.94                                            | 0.49             |
| USD CLIFFTON LTD-REG-S 6.25000% 21-25.10.25                      | 1 350 000.00  | 1 323 000.00                                            | 0.19             |
| USD CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 5.12500% 18-14.03.28          | 1 375 000.00  | 1 568 352.50                                            | 0.22             |
| USD CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 3.87500% 19-19.06.29          | 3 500 000.00  | 3 734 010.00                                            | 0.53             |
| USD CNOOC FINANCE 2015 USA LLC 4.37500% 18-02.05.28              | 1 250 000.00  | 1 399 062.50                                            | 0.20             |
| USD EASY TACTIC LTD-REG-S 8.12500% 19-11.07.24                   | 3 850 000.00  | 2 473 625.00                                            | 0.35             |
| USD FANTASIA HOLDINGS GROUP CO LTD-REG-S 12.25000% 19-18.10.22   | 200 000.00    | 66 000.00                                               | 0.01             |
| USD FANTASIA HOLDINGS GROUP CO LTD-REG-S 9.25000% 20-28.07.23    | 475 000.00    | 147 805.75                                              | 0.02             |
| USD FANTASIA HOLDINGS GROUP CO LTD-REG-S 9.87500% 20-19.10.23    | 2 200 000.00  | 660 000.00                                              | 0.09             |
| USD FORTUNE STAR BVI LTD-REG-S 6.85000% 20-02.07.24              | 1 400 000.00  | 1 452 500.00                                            | 0.21             |
| USD FORTUNE STAR BVI LTD-REG-S 5.95000% 20-19.10.25              | 2 650 000.00  | 2 696 375.00                                            | 0.39             |
| USD GOLDEN WHEEL TIANDI HLDGS CO LTD-REG-S 16.00000% 20-11.07.23 | 2 000 000.00  | 920 600.00                                              | 0.13             |
| USD HYUNDAI CAPITAL AMERICA-REG-S 3.50000% 19-02.11.26           | 800 000.00    | 856 778.85                                              | 0.12             |
| USD HYUNDAI CAPITAL AMERICA-REG-S 2.65000% 20-10.02.25           | 500 000.00    | 519 361.96                                              | 0.07             |
| USD INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT-REG-S 4.74500% 21-09.06.51 | 3 375 000.00  | 3 476 621.25                                            | 0.50             |
| USD INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT-REG-S 3.39800% 21-09.06.31 | 4 300 000.00  | 4 343 473.00                                            | 0.62             |
| USD INTERNATIONAL CONT TERM SERV-REG-S 4.75000% 20-17.06.30      | 250 000.00    | 279 656.25                                              | 0.04             |
| USD JINGRUI HOLDINGS LTD-REG-S 14.50000% 20-19.02.23             | 200 000.00    | 173 662.50                                              | 0.02             |
| USD JMH CO LTD-REG-S 2.50000% 21-09.04.31                        | 5 225 000.00  | 5 191 983.90                                            | 0.74             |
| USD JSW HYDRO ENERGY LTD-REG-S 4.12500% 21-18.05.31              | 200 000.00    | 198 000.00                                              | 0.03             |
| USD KAISA GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 10.50000% 20-15.01.25         | 3 250 000.00  | 2 486 250.00                                            | 0.36             |
| USD KAISA GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 11.25000% 20-16.04.25         | 6 675 000.00  | 5 156 437.50                                            | 0.74             |
| USD KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 2.37500% 21-07.04.31           | 8 400 000.00  | 8 453 340.00                                            | 1.21             |
| USD KWG GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 6.30000% 20-13.02.26            | 2 675 000.00  | 2 394 125.00                                            | 0.34             |
| USD LAI SUN MTN LTD-REG-S 5.00000% 21-28.07.26                   | 3 650 000.00  | 3 630 665.58                                            | 0.52             |
| USD LAI SUN MTN LTD-REG-S 5.00000% 21-28.07.26                   | 4 800 000.00  | 4 773 960.00                                            | 0.68             |
| USD LEVC FINANCE LTD-REG-S 1.37500% 21-25.03.24                  | 7 512 000.00  | 7 528 692.42                                            | 1.08             |
| USD LOGAN GROUP CO LTD-REG-S 4.70000% 21-06.07.26                | 1 700 000.00  | 1 598 000.00                                            | 0.23             |
| USD MEGA ADVANCE INVESTMENTS LTD-REG-S 6.37500% 11-12.05.41      | 6 230 000.00  | 8 434 485.50                                            | 1.21             |
| USD MEITUAN DIANPING-REG-S 3.05000% 20-28.10.30                  | 14 965 000.00 | 13 854 784.06                                           | 1.98             |
| USD MELCO RESORTS FINANCE LTD-REG-S 5.75000% 20-21.07.28         | 2 000 000.00  | 2 045 795.40                                            | 0.29             |
| USD NEW METRO GLOBAL LTD-REG-S 4.50000% 21-02.05.26              | 7 000 000.00  | 6 422 500.00                                            | 0.92             |
| USD ONGC VIDESH VANKORNEFT PTE LTD-REG-S 3.75000% 16-27.07.26    | 300 000.00    | 317 118.75                                              | 0.05             |
| USD PAKUWON JATI TBK PT-REG-S 4.87500% 21-29.04.28               | 675 000.00    | 696 642.19                                              | 0.10             |
| USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF 2.65000% 20-10.12.45                | 6 075 000.00  | 5 551 031.25                                            | 0.79             |
| USD POWERLONG REAL ESTATE HOLDINGS-REG-S 6.95000% 19-23.07.23    | 1 800 000.00  | 1 790 212.50                                            | 0.26             |
| USD REDSUN PROPERTIES GROUP LTD-REG-S 9.50000% 21-20.09.23       | 3 150 000.00  | 2 962 449.00                                            | 0.42             |
| USD RELIANCE INDUSTRIES LTD-REG-S 5.40000% 12-14.02.22           | 2 250 000.00  | 2 282 765.63                                            | 0.33             |
| USD RONSHINE CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 7.35000% 20-15.12.23       | 3 475 000.00  | 2 432 500.00                                            | 0.35             |

注記は、財務書類と不可分のものである。

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

## 2021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<br>米ドル<br>先物 / 為替予約契約 /<br>スワップに係る<br>未実現損益<br>(注1) | 純資産<br>割合<br>(%) |
|----------------------------------------------------------------|--------------|---------------------------------------------------------|------------------|
| USD SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD-REG-S 5.20000% 21-16.01.27    | 2 350 000.00 | 2 270 687.50                                            | 0.32             |
| USD SHUI ON DEVELOPMENT HOLDINGLT-REG-S 5.50000% 21-29.06.26   | 2 525 000.00 | 2 398 750.00                                            | 0.34             |
| USD SINOPEC GRP OVERSEAS DEV LTD-REG-S 2.15000% 20-13.05.25    | 400 000.00   | 408 908.00                                              | 0.06             |
| USD SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 4.00000% 21-06.07.26             | 4 175 000.00 | 4 101 581.28                                            | 0.59             |
| USD SRILANKAN AIRLINES LTD-REG-S 7.00000% 19-25.06.24          | 525 000.00   | 318 379.68                                              | 0.05             |
| USD STUDIO CITY FINANCE LTD-REG-S 6.50000% 20-15.01.28         | 2 900 000.00 | 2 863 750.00                                            | 0.41             |
| USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 7.00000% 20-09.07.25        | 1 000 000.00 | 797 500.00                                              | 0.11             |
| USD TIMES CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 6.75000% 20-08.07.25        | 2 000 000.00 | 1 830 000.00                                            | 0.26             |
| USD TSMC GLOBAL LTD-REG-S 2.25000% 21-23.04.31                 | 9 250 000.00 | 9 218 180.00                                            | 1.32             |
| USD VEDANTA RESOURCES PLC-REG-S 6.12500% 17-09.08.24           | 5 500 000.00 | 4 914 937.50                                            | 0.70             |
| USD WOORI BANK-REG-S 1.75000% 21-23.03.26                      | 2 600 000.00 | 2 592 356.00                                            | 0.37             |
| USD WYNN MACAU LTD-REG-S 5.50000% 20-15.01.26                  | 650 000.00   | 629 203.64                                              | 0.09             |
| USD YANGO JUSTICE INTERNATIONAL LTD-REG-S 7.50000% 20-15.04.24 | 1 675 000.00 | 1 289 750.00                                            | 0.18             |
| USD YANGO JUSTICE INTERNATIONAL LTD-REG-S 7.50000% 20-17.02.25 | 275 000.00   | 178 750.00                                              | 0.03             |
| USD YUZHOU PROPERTIES CO LTD-REG-S 7.37500% 20-13.01.26        | 6 524 000.00 | 4 371 080.00                                            | 0.62             |
| USD ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD-REG-S 7.35000% 20-05.02.25     | 2 575 000.00 | 2 214 500.00                                            | 0.32             |
| Total USD                                                      |              | 190 534 277.89                                          | 27.23            |

|           |                |       |
|-----------|----------------|-------|
| 固定利付ノート合計 | 190 534 277.89 | 27.23 |
|-----------|----------------|-------|

## 変動利付ノート

|                                                                 |               |               |      |
|-----------------------------------------------------------------|---------------|---------------|------|
| USD                                                             |               |               |      |
| USD CHINA DEV BANK FIN LEASING-REG-S-SUB 2.875%/VAR 20-28.09.30 | 8 675 000.00  | 8 779 642.19  | 1.26 |
| USD GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES-REG-S-SUB 4.500%/VAR 21-PRP      | 4 150 000.00  | 4 072 187.50  | 0.58 |
| USD IND & COM BK CHINA MACAU-REG-S-SUB 2.875%/VAR 19-12.09.29   | 2 100 000.00  | 2 167 331.25  | 0.31 |
| USD OVERSEA-CHINESE BKNG-REG-S-SUB 1.832%/VAR 20-10.09.30       | 17 076 000.00 | 17 017 600.08 | 2.43 |
| Total USD                                                       |               | 32 036 761.02 | 4.58 |

|           |               |      |
|-----------|---------------|------|
| 変動利付ノート合計 | 32 036 761.02 | 4.58 |
|-----------|---------------|------|

## 固定利付ミディアム・ターム・ノート

|                                                                  |               |               |      |
|------------------------------------------------------------------|---------------|---------------|------|
| USD                                                              |               |               |      |
| USD AIRPORT AUTHORITY HONG KONG-REG-S 3.45000% 19-21.02.29       | 450 000.00    | 494 221.40    | 0.07 |
| USD BANK MANDIRI PERSERO TBK PT-REG-S 4.75000% 20-13.05.25       | 3 000 000.00  | 3 314 625.00  | 0.47 |
| USD BANK MANDIRI PERSERO TBK PT-REG-S 2.00000% 21-19.04.26       | 1 275 000.00  | 1 275 000.00  | 0.18 |
| USD BANK NEGARA INDONESIA PERSERO-REG-S-SUB 3.75000% 21-30.03.26 | 725 000.00    | 741 392.25    | 0.11 |
| USD BANK OF CHINA LTD/PARIS 0.95000% 20-21.09.23                 | 3 750 000.00  | 3 757 462.50  | 0.54 |
| USD BANK OF CHINA/HONG KONG-REG-S 3.62500% 19-17.04.29           | 3 400 000.00  | 3 719 838.00  | 0.53 |
| USD BDO UNIBANK INC-REG-S 2.12500% 20-13.01.26                   | 3 150 000.00  | 3 228 750.00  | 0.46 |
| USD BOC AVIATION LTD-REG-S 3.50000% 19-10.10.24                  | 4 950 000.00  | 5 259 570.03  | 0.75 |
| USD BOC AVIATION USA CORP-REG-S 1.62500% 21-29.04.24             | 2 443 000.00  | 2 461 773.26  | 0.35 |
| USD BOCOM LEASING MGT HONG KONG-REG-S 4.37500% 19-22.01.24       | 950 000.00    | 1 014 006.25  | 0.15 |
| USD CDBL FUNDING 1-REG-S 3.50000% 20-24.10.27                    | 10 008 000.00 | 10 556 238.24 | 1.51 |
| USD CHINA CONSTRUCTION BANK CORP/HK-REG-S 1.25000% 20-04.08.25   | 3 000 000.00  | 2 978 940.00  | 0.43 |
| USD CHINA DEVELOPMENT BANK CORP-REG-S 1.00000% 20-27.10.25       | 1 000 000.00  | 985 860.00    | 0.14 |
| USD CHINA EVERGRANDE GROUP-REG-S 9.50000% 17-29.03.24            | 475 000.00    | 113 346.87    | 0.02 |
| USD CHINA MERCHANTS FINANCE CO LTD-REG-S 5.00000% 12-04.05.22    | 2 550 000.00  | 2 610 243.75  | 0.37 |
| USD CHINA OVERSEAS FINAN CAYMAN VIII-REG-S 3.45000% 19-15.07.29  | 2 000 000.00  | 2 086 625.00  | 0.30 |
| USD CHINA OVERSEAS FINAN CAYMAN VIII-REG-S 2.75000% 20-02.03.30  | 500 000.00    | 496 343.75    | 0.07 |
| USD CHINA PING AN INSUROVER HOLD LTD-REG-S 2.85000% 21-12.08.31  | 6 650 000.00  | 6 174 721.77  | 0.88 |
| USD CICC HONG KONG FIN 2016 MTN LTD-REG-S 2.00000% 21-26.01.26   | 1 975 000.00  | 1 957 304.00  | 0.28 |

注記は、財務書類と不可分のものである。

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

## 2021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<br>米ドル<br>先物 / 為替予約契約 /<br>スワップに係る<br>未実現損益<br>(注1) | 純資産<br>割合<br>(%) |
|------------------------------------------------------------------|---------------|---------------------------------------------------------|------------------|
| USD CITIC LTD-REG-S 4.00000% 18-11.01.28                         | 1 200 000.00  | 1 310 475.00                                            | 0.19             |
| USD CMB INTERNATIONAL LEASING MGT LTD-REG-S 2.75000% 20-12.08.30 | 2 550 000.00  | 2 499 478.13                                            | 0.36             |
| USD EXPORT IMPORT BANK OF THAILAND-REG-S 1.45700% 20-15.10.25    | 5 425 000.00  | 5 405 578.50                                            | 0.77             |
| USD EXPORT-IMPORT BANK OF INDIA-REG-S 2.25000% 21-13.01.31       | 625 000.00    | 583 881.25                                              | 0.08             |
| USD FAR EAST HORIZON LTD-REG-S 2.62500% 21-03.03.24              | 6 925 000.00  | 6 932 790.63                                            | 0.99             |
| USD GC TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 4.30000% 21-18.03.51         | 1 825 000.00  | 1 984 578.00                                            | 0.28             |
| USD HONGKONG LAND FINANCE CO LTD-REG-S 2.25000% 21-15.07.31      | 2 525 000.00  | 2 467 180.40                                            | 0.35             |
| USD ICBCIL FINANCE CO LTD-REG-S 1.75000% 20-25.08.25             | 1 000 000.00  | 994 562.50                                              | 0.14             |
| USD INDIAN RAILWAY FINANCE CORP LTD-REG-S 3.73000% 19-29.03.24   | 8 000 000.00  | 8 454 000.00                                            | 1.21             |
| USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 3.85000% 17-18.07.27            | 600 000.00    | 664 987.50                                              | 0.10             |
| USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 4.75000% 17-18.07.47            | 525 000.00    | 615 168.75                                              | 0.09             |
| USD INDUSTRIAL COMMERCIAL BANK CHINA-REG-S 1.20000% 20-09.09.25  | 3 525 000.00  | 3 491 583.00                                            | 0.50             |
| USD NAN FUNG TREASURY LTD-REG-S 3.87500% 17-03.10.27             | 1 450 000.00  | 1 515 953.83                                            | 0.22             |
| USD NAN FUNG TREASURY LTD-REG-S 5.00000% 18-05.09.28             | 1 000 000.00  | 1 099 747.50                                            | 0.16             |
| USD NWD MTN LTD-REG-S 4.50000% 20-19.05.30                       | 2 000 000.00  | 2 042 985.80                                            | 0.29             |
| USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 7.37500% 21-08.04.31     | 6 000 000.00  | 5 977 500.00                                            | 0.85             |
| USD PERTAMINA PT-REG-S 6.45000% 14-30.05.44                      | 800 000.00    | 1 039 150.00                                            | 0.15             |
| USD PERTAMINA PT-REG-S 6.50000% 18-07.11.48                      | 900 000.00    | 1 189 856.25                                            | 0.17             |
| USD PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 4.55000% 20-21.04.50              | 1 700 000.00  | 2 075 381.25                                            | 0.30             |
| USD PSA TREASURY PTE LTD-REG-S 2.12500% 19-05.09.29              | 2 500 000.00  | 2 530 706.00                                            | 0.36             |
| USD PTT TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 4.50000% 19-25.10.42        | 2 020 000.00  | 2 248 260.00                                            | 0.32             |
| USD REC LTD-REG-S 2.25000% 21-01.09.26                           | 4 075 000.00  | 3 970 068.75                                            | 0.57             |
| USD REDCO PROPERTIES GROUP LTD-REG-S 9.90000% 20-17.02.24        | 2 050 000.00  | 1 728 790.63                                            | 0.25             |
| USD RHB BANK BHD-REG-S 1.65800% 21-29.06.26                      | 8 650 000.00  | 8 673 182.00                                            | 1.24             |
| USD SHINHAN FIN GROUP CO LTD-REG-S 1.35000% 20-10.01.26          | 5 275 000.00  | 5 236 123.25                                            | 0.75             |
| USD SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD-REG-S 5.10000% 20-16.07.23  | 700 000.00    | 711 506.25                                              | 0.10             |
| USD SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD-REG-S 4.40000% 21-13.03.24  | 3 675 000.00  | 3 667 650.00                                            | 0.52             |
| USD SIAM COMMERCIAL BK CAYMAN ISLAND-REG-S 4.40000% 19-11.02.29  | 225 000.00    | 256 190.63                                              | 0.04             |
| USD SINGAPORE AIRLINES LTD-REG-S 3.00000% 21-20.07.26            | 925 000.00    | 945 470.25                                              | 0.14             |
| USD SINGAPORE EXCHANGE LTD-REG-S 1.23400% 21-03.09.26            | 4 975 000.00  | 4 947 940.48                                            | 0.71             |
| USD SINGTEL GROUP TREASURY PTE LTD-REG-S 3.25000% 15-30.06.25    | 1 000 000.00  | 1 070 189.30                                            | 0.15             |
| USD SP GROUP TREASURY PTE LTD-REG-S 3.37500% 19-27.02.29         | 600 000.00    | 657 675.00                                              | 0.09             |
| USD SP POWERASSETS LTD-REG-S 3.25000% 15-24.11.25                | 1 000 000.00  | 1 080 869.20                                            | 0.15             |
| USD STATE BANK OF INDIA/LONDON-REG-S 1.80000% 21-13.07.26        | 300 000.00    | 297 024.00                                              | 0.04             |
| USD STATE GRID OVERSEAS INVESTMENT-REG-S 3.50000% 17-04.05.27    | 2 750 000.00  | 3 005 090.00                                            | 0.43             |
| USD STATE GRID OVERSEAS INVESTMENT-REG-S 4.25000% 18-02.05.28    | 2 657 000.00  | 3 023 666.00                                            | 0.43             |
| USD SUMITOMO CORP-REG-S 1.55000% 21-06.07.26                     | 10 600 000.00 | 10 551 389.56                                           | 1.51             |
| USD SUN HUNG KAI PROP CAP MRKT LTD-REG-S 2.87500% 20-21.01.30    | 6 100 000.00  | 6 328 990.95                                            | 0.90             |
| USD SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD-REG-S 2.75000% 20-13.05.30       | 2 000 000.00  | 2 034 580.00                                            | 0.29             |
| USD TEMASEK FINANCIAL I LTD-REG-S 2.50000% 20-06.10.70           | 1 300 000.00  | 1 190 350.85                                            | 0.17             |
| USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.92500% 18-19.01.38              | 1 000 000.00  | 1 062 062.50                                            | 0.15             |
| USD WHEELLOCK MTN BVI LTD-REG-S 2.37500% 21-25.01.26             | 8 270 000.00  | 8 177 565.13                                            | 1.17             |
| USD YES BANK IFSC BANKING UNIT BR-REG-S 3.75000% 18-06.02.23     | 300 000.00    | 296 212.50                                              | 0.04             |
| Total USD                                                        |               | 177 262 653.59                                          | 25.33            |
| 固定利付ミディアム・ターム・ノート合計                                              |               | 177 262 653.59                                          | 25.33            |
| 変動利付ミディアム・ターム・ノート                                                |               |                                                         |                  |
| USD                                                              |               |                                                         |                  |
| USD BANGKOK BANK PCL/HONG KONG-REG-S-SUB 5.000%/VAR 20-PRP       | 275 000.00    | 286 653.13                                              | 0.04             |
| USD DAH SING BANK LTD-REG-S-SUB 4.250%/VAR 16-30.11.26           | 9 460 000.00  | 9 488 285.40                                            | 1.36             |
| USD DBS GROUP HOLDINGS LTD-REG-S-SUB 4.520%/VAR 18-11.12.28      | 1 000 000.00  | 1 072 060.00                                            | 0.15             |

注記は、財務書類と不可分のものである。

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

## 2021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<br>米ドル<br>先物 / 為替予約契約 /<br>スワップに係る<br>未実現損益<br>(注1) | 純資産<br>割合<br>(%) |
|------------------------------------------------------------------|---------------|---------------------------------------------------------|------------------|
| USD KASIKORNBANK PCL-REG-S-SUB 5.275%/VAR 20-PRP                 | 350 000.00    | 366 034.38                                              | 0.05             |
| USD SHINHAN BANK-REG-S-SUB 3.875%/VAR 16-07.12.26                | 2 000 000.00  | 2 009 125.00                                            | 0.29             |
| USD SHINHAN FIN GROUP CO LTD-REG-S-SUB 3.340%/VAR 19-05.02.30    | 3 475 000.00  | 3 605 964.06                                            | 0.52             |
| USD UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S-SUB 2.880%/VAR 16-08.03.27    | 830 000.00    | 836 730.89                                              | 0.12             |
| USD WING LUNG BANK LTD-REG-S-SUB 3.750%/H15T5Y+175BP 17-22.11.27 | 625 000.00    | 637 914.38                                              | 0.09             |
| Total USD                                                        |               | 18 302 767.24                                           | 2.62             |
| 変動利付ミディアム・ターム・ノート合計                                              |               | 18 302 767.24                                           | 2.62             |
| 固定利付債券                                                           |               |                                                         |                  |
| USD                                                              |               |                                                         |                  |
| USD AGILE GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 6.05000% 20-13.10.25          | 1 000 000.00  | 937 500.00                                              | 0.13             |
| USD AGILE GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 5.50000% 21-21.04.25          | 2 250 000.00  | 2 103 750.00                                            | 0.30             |
| USD BANK RAKYAT INDONESIA-REG-S 3.95000% 19-28.03.24             | 725 000.00    | 768 579.75                                              | 0.11             |
| USD BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO-REG-S-SUB 4.20000% 20-23.01.25  | 250 000.00    | 254 715.00                                              | 0.04             |
| USD BIM LAND JSC-REG-S 7.37500% 21-07.05.26                      | 6 000 000.00  | 5 509 875.00                                            | 0.79             |
| USD CENTRAL PLAZA DEVELOPMENT LTD-REG-S 4.65000% 21-19.01.26     | 1 600 000.00  | 1 547 300.00                                            | 0.22             |
| USD CHIBA BANK LTD/THE-REG-S 1.35000% 21-08.09.26                | 8 425 000.00  | 8 380 963.11                                            | 1.20             |
| USD CHINA AOYUAN PROPERTY GROUP LTD-REG-S 5.88000% 21-01.03.27   | 2 000 000.00  | 1 510 000.00                                            | 0.22             |
| USD CHINA EVERGRANDE GROUP-REG-S 7.50000% 17-28.06.23            | 1 100 000.00  | 261 250.00                                              | 0.04             |
| USD CHINA EVERGRANDE GROUP-REG-S 8.75000% 17-28.06.25            | 2 500 000.00  | 593 750.00                                              | 0.08             |
| USD CMHI FINANCE BVI CO LTD-REG-S 5.00000% 18-06.08.28           | 1 750 000.00  | 1 998 828.13                                            | 0.29             |
| USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 5.12500% 20-14.01.27    | 450 000.00    | 455 568.75                                              | 0.06             |
| USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 5.62500% 20-14.01.30    | 15 600 000.00 | 15 924 675.00                                           | 2.28             |
| USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 5.40000% 20-27.05.25    | 4 000 000.00  | 4 072 000.00                                            | 0.58             |
| USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 4.80000% 20-06.08.30    | 950 000.00    | 942 162.50                                              | 0.13             |
| USD EHI CAR SERVICES LTD-REG-S 7.75000% 21-14.11.24              | 3 650 000.00  | 3 650 000.00                                            | 0.52             |
| USD ENN ENERGY HOLDINGS LTD-REG-S 3.25000% 17-24.07.22           | 2 110 000.00  | 2 140 726.88                                            | 0.31             |
| USD FPC RESOURCES LTD-REG-S 4.37500% 20-11.09.27                 | 1 175 000.00  | 1 253 431.25                                            | 0.18             |
| USD GREENKO DUTCH BV-REG-S 3.85000% 21-29.03.26                  | 815 000.00    | 825 340.31                                              | 0.12             |
| USD HUTCHISON WHAMPOA INTERNATIONAL14-REG-S 3.62500% 14-31.10.24 | 5 572 000.00  | 6 032 734.75                                            | 0.86             |
| USD INDUSTRIAL BANK OF KOREA-REG-S 0.62500% 21-17.09.24          | 8 775 000.00  | 8 756 533.89                                            | 1.25             |
| USD KAISA GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 9.37500% 17-30.06.24          | 3 000 000.00  | 2 302 500.00                                            | 0.33             |
| USD KAISA GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 11.70000% 21-11.11.25         | 1 200 000.00  | 909 000.00                                              | 0.13             |
| USD KWG GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 7.87500% 19-01.09.23            | 1 750 000.00  | 1 688 750.00                                            | 0.24             |
| USD LMIRT CAPITAL PTE LTD-REG-S 7.50000% 21-09.02.26             | 3 575 000.00  | 3 673 312.50                                            | 0.52             |
| USD LS FINANCE 2017 LTD-REG-S 4.80000% 21-18.06.26               | 4 375 000.00  | 4 232 014.46                                            | 0.60             |
| USD MALAYSIA WAKALA SUKUK BHD-REG-S 3.07500% 21-28.04.51         | 1 750 000.00  | 1 776 031.25                                            | 0.25             |
| USD MINERA Y METALURGICA DEL BOLEO-REG-S 3.25000% 19-17.04.24    | 1 100 000.00  | 1 160 486.36                                            | 0.17             |
| USD MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 4.45000% 21-07.07.31           | 500 000.00    | 483 125.00                                              | 0.07             |
| USD NEW METRO GLOBAL LTD-REG-S 4.80000% 20-15.12.24              | 2 150 000.00  | 2 022 182.50                                            | 0.29             |
| USD NWD MTN LTD-REG-S 4.12500% 19-18.07.29                       | 1 425 000.00  | 1 420 354.50                                            | 0.20             |
| USD OIL INDIA LTD-REG-S 5.12500% 19-04.02.29                     | 268 000.00    | 299 456.50                                              | 0.04             |
| USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 3.95000% 15-20.01.40            | 4 625 000.00  | 5 043 562.50                                            | 0.72             |
| USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 3.70000% 16-01.03.41            | 10 150 000.00 | 10 729 184.37                                           | 1.53             |
| USD POWERLONG REAL ESTATE HOLDINGS-REG-S 5.95000% 20-30.04.25    | 500 000.00    | 475 000.00                                              | 0.07             |
| USD POWERLONG REAL ESTATE HOLDING LTD-REG-S 4.90000% 21-13.05.26 | 3 000 000.00  | 2 790 000.00                                            | 0.40             |
| USD RKPF OVERSEAS 2020 A LTD-REG-S 5.12500% 21-26.07.26          | 4 100 000.00  | 3 690 000.00                                            | 0.53             |
| USD SHINHAN CARD CO LTD-REG-S 1.37500% 21-23.06.26               | 3 800 000.00  | 3 746 078.00                                            | 0.54             |
| USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 6.85000% 15-03.11.25      | 2 500 000.00  | 1 564 531.25                                            | 0.22             |
| USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 7.50000% 19-01.02.24          | 3 000 000.00  | 2 437 500.00                                            | 0.35             |

注記は、財務書類と不可分のものである。

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

## 2021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<br>米ドル<br>先物 / 為替予約契約 /<br>スワップに係る<br>未実現損益<br>(注1) | 純資産<br>割合<br>(%) |
|------------------------------------------------------------------|---------------|---------------------------------------------------------|------------------|
| USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 6.50000% 20-10.01.25          | 3 000 000.00  | 2 392 500.00                                            | 0.34             |
| USD TALENT YIELD INTERNATIONAL LTD-REG-S 3.12500% 21-06.05.31    | 2 475 000.00  | 2 558 799.29                                            | 0.37             |
| USD TSINGHUA UNIC LTD *DEFAULTED *-REG-S 5.37500% 18-31.01.23    | 325 000.00    | 139 100.00                                              | 0.02             |
| USD YUZHOU PROPERTIES CO LTD-REG-S 8.30000% 19-27.05.25          | 2 275 000.00  | 1 666 437.50                                            | 0.24             |
| Total USD                                                        |               | 125 119 590.30                                          | 17.88            |
| 固定利付債券合計                                                         |               | 125 119 590.30                                          | 17.88            |
| 変動利付債券                                                           |               |                                                         |                  |
| USD                                                              |               |                                                         |                  |
| USD BANK OF COMMUNICATIONS H/K-REG-S 2.304%/VAR 21-08.07.31      | 14 150 000.00 | 13 882 028.72                                           | 1.98             |
| USD BANK OF EAST ASIA LTD/THE-REG-S-SUB 5.875%/VAR 19-PRP        | 500 000.00    | 516 040.00                                              | 0.07             |
| USD CHINA CONSTRUCTION BK CORP-REG-S-SUB 2.450%/VAR 20-24.06.30  | 225 000.00    | 227 650.50                                              | 0.03             |
| USD CHINA MINMETALS CORP-REG-S 3.750%/VAR 17-PRP                 | 250 000.00    | 255 422.50                                              | 0.04             |
| USD HUANENG HONG KONG CAPITAL LTD-REG-S 3.600%/VAR 17-PRP        | 500 000.00    | 507 945.00                                              | 0.07             |
| USD INDUSTRIAL & COMM BK OF CHINA-REG-S 3.200%/VAR 21-PRP        | 1 400 000.00  | 1 401 750.00                                            | 0.20             |
| USD SINO OCEAN LAND TREASURE-REG-S-SUB 4.900%/VAR 17-PRP         | 525 000.00    | 441 000.00                                              | 0.06             |
| USD SMC GLOBAL POWER HOLDINGS CORP-REG-S 5.700%/VAR 20-PRP       | 675 000.00    | 673 650.00                                              | 0.10             |
| USD SMC GLOBAL POWER HOLDINGS CORP-REG-S 7.000%/VAR 20-PRP       | 2 575 000.00  | 2 688 139.06                                            | 0.39             |
| USD SMC GLOBAL POWER HOLDINGS CORP-REG-S 5.450%/VAR 21-PRP       | 8 450 000.00  | 8 365 500.00                                            | 1.20             |
| Total USD                                                        |               | 28 959 125.78                                           | 4.14             |
| 変動利付債券合計                                                         |               | 28 959 125.78                                           | 4.14             |
| 変動利付転換社債                                                         |               |                                                         |                  |
| USD                                                              |               |                                                         |                  |
| USD KRUNG THAI /CAYMAN ISLANDS-REG-S-SUB COCO 4.400%/VAR 21-PRP  | 425 000.00    | 423 984.25                                              | 0.06             |
| Total USD                                                        |               | 423 984.25                                              | 0.06             |
| 変動利付転換社債合計                                                       |               | 423 984.25                                              | 0.06             |
| 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                            |               | 572 639 160.07                                          | 81.84            |
| 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 SMBC AVIATION CAPITAL FINANCE DAC-REG-S 2.30000% 21-15.06.28 | 4 250 000.00  | 4 264 260.96                                            | 0.61             |
| Total USD                                                        |               | 4 264 260.96                                            | 0.61             |
| 固定利付ノート合計                                                        |               | 4 264 260.96                                            | 0.61             |
| 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                            |               | 4 264 260.96                                            | 0.61             |

注記は、財務書類と不可分のものである。

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

## 2021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<br>米ドル<br>先物 / 為替予約契約 /<br>スワップに係る<br>未実現損益<br>(注1) | 純資産<br>割合<br>(%) |
|----|---------|---------------------------------------------------------|------------------|
|----|---------|---------------------------------------------------------|------------------|

## 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 | 13 776 223.72 | 1.97 |
| Total Hong Kong                                             |          | 13 776 223.72 | 1.97 |

## ルクセンブルグ

|                                                                |          |               |      |
|----------------------------------------------------------------|----------|---------------|------|
| USD UBS (LUX) BOND SICAV-ASIAN INVST GRADE BONDS (USD)-U-X-CAP | 1 500.00 | 19 407 255.00 | 2.77 |
| USD UBS (LUX) BOND SICAV - MULTI INCOME (USD)-U-X-ACC- CAP     | 120.00   | 1 286 820.00  | 0.19 |
| USD UBS (LUX) BOND SICAV - CHINA HIGH YIELD (USD) U-X-ACC      | 1 500.00 | 14 158 845.00 | 2.02 |
| ルクセンブルグ合計                                                      |          | 34 852 920.00 | 4.98 |

|                  |  |               |      |
|------------------|--|---------------|------|
| 投資信託、オープン・エンド型合計 |  | 48 629 143.72 | 6.95 |
|------------------|--|---------------|------|

## 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

|  |  |               |      |
|--|--|---------------|------|
|  |  | 48 629 143.72 | 6.95 |
|--|--|---------------|------|

|          |  |                |       |
|----------|--|----------------|-------|
| 投資有価証券合計 |  | 625 532 564.75 | 89.40 |
|----------|--|----------------|-------|

## 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 21.12.21 | 24.00   | -198 000.00 | -0.03 |
| USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.12.21    | -369.00 | 412 187.64  | 0.06  |
| USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.12.21     | -329.00 | 206 828.10  | 0.03  |
| 債券に係る金融先物合計                                  |         | 421 015.74  | 0.06  |

|                        |  |            |      |
|------------------------|--|------------|------|
| 公認の証券取引所に上場されている派生商品合計 |  | 421 015.74 | 0.06 |
|------------------------|--|------------|------|

|        |  |            |      |
|--------|--|------------|------|
| 派生商品合計 |  | 421 015.74 | 0.06 |
|--------|--|------------|------|

## 為替予約契約

| 購入通貨     | 購入額            | 売却通貨 | 売却額            | 満期日        |               |       |
|----------|----------------|------|----------------|------------|---------------|-------|
| USD      | 36 517 631.85  | CNH  | 237 350 000.00 | 15.12.2021 | -40 266.80    | -0.01 |
| EUR      | 163 888 900.00 | USD  | 192 313 610.54 | 27.10.2021 | -2 281 900.63 | -0.32 |
| SGD      | 13 296 200.00  | USD  | 9 864 469.45   | 27.10.2021 | -71 069.96    | -0.01 |
| GBP      | 59 300 100.00  | USD  | 81 056 553.58  | 27.10.2021 | -1 096 515.48 | -0.16 |
| EUR      | 5 341 900.00   | USD  | 6 261 216.95   | 27.10.2021 | -67 201.42    | -0.01 |
| USD      | 135 535.09     | SGD  | 184 400.00     | 27.10.2021 | -285.89       | 0.00  |
| USD      | 234 937.68     | GBP  | 175 000.00     | 27.10.2021 | -1 031.68     | 0.00  |
| 為替予約契約合計 |                |      |                |            | -3 558 271.86 | -0.51 |

|                                |  |                |        |
|--------------------------------|--|----------------|--------|
| 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 |  | 96 012 882.29  | 13.72  |
| その他の資産および負債                    |  | -18 741 399.67 | -2.67  |
| 純資産合計                          |  | 699 666 791.25 | 100.00 |

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）  
2021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<br>ユーロ<br>先物 / 為替予約契約 /<br>スワップに係る<br>未実現損益<br>(注1) | 純資産<br>割合<br>(%) |
|------------------------------------------------------------------|---------------|---------------------------------------------------------|------------------|
| 公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品                              |               |                                                         |                  |
| 固定利付ノート                                                          |               |                                                         |                  |
| EUR                                                              |               |                                                         |                  |
| EUR ADIENT GLOBAL HOLDINGS LTD-REG-S 3.50000% 16-15.08.24        | 8 535 000.00  | 8 598 159.00                                            | 0.47             |
| EUR ADLER GROUP SA-REG-S 2.75000% 20-13.11.26                    | 3 100 000.00  | 2 650 500.00                                            | 0.15             |
| EUR ADLER GROUP SA-REG-S 2.25000% 21-27.04.27                    | 7 200 000.00  | 5 988 312.00                                            | 0.33             |
| EUR ALTICE FRANCE HOLDING SA-REG-S 8.00000% 19-15.05.27          | 18 375 000.00 | 19 551 000.00                                           | 1.08             |
| EUR ALTICE FRANCE-REG-S 5.87500% 18-01.02.27                     | 26 860 000.00 | 28 078 369.60                                           | 1.55             |
| EUR ARD FINANCE SA-REG-S (PIK) 5.00000% 19-30.06.27              | 21 545 000.00 | 22 367 286.47                                           | 1.24             |
| EUR ASR MEDIA AND SPONSORSHIP SPA-REG-S 5.12500% 19-01.08.24     | 9 146 000.00  | 8 797 899.58                                            | 0.49             |
| EUR ATLANTIA SPA-REG-S 1.87500% 21-12.02.28                      | 1 250 000.00  | 1 299 815.00                                            | 0.07             |
| EUR AUTOSTRADE PER L'ITALIA SPA-REG-S 2.00000% 20-04.12.28       | 11 815 000.00 | 12 399 937.02                                           | 0.68             |
| EUR BANFF MERGER SUB INC-REG-S 8.37500% 18-01.09.26              | 8 340 000.00  | 8 656 086.00                                            | 0.48             |
| EUR BOXER PARENT CO INC-REG-S 6.50000% 20-02.10.25               | 5 985 000.00  | 6 283 675.43                                            | 0.35             |
| EUR BRITISH AIRWAYS PLC-REG-S 2.75000% 21-25.03.25               | 4 700 000.00  | 4 741 143.80                                            | 0.26             |
| EUR BULGARIAN ENERGY HOLDING EAD-REG-S 2.45000% 21-22.07.28      | 6 475 000.00  | 6 495 720.00                                            | 0.36             |
| EUR CASINO GUICHARD PERRACHON SA-REG-S 6.62500% 20-15.01.26      | 9 610 000.00  | 10 007 469.60                                           | 0.55             |
| EUR CGG SA-REG-S 7.75000% 21-01.04.27                            | 6 870 000.00  | 6 979 233.00                                            | 0.39             |
| EUR CHEPLAPHARM ARZNEIMITTEL GMBH-REG-S 3.50000% 20-11.02.27     | 4 205 000.00  | 4 252 306.25                                            | 0.23             |
| EUR COGENT COMMUNICATIONS GROUP INC-REG-S 4.37500% 19-30.06.24   | 11 960 000.00 | 12 182 575.60                                           | 0.67             |
| EUR COTY INC-REG-S 4.00000% 18-15.04.23                          | 6 480 000.00  | 6 516 404.64                                            | 0.36             |
| EUR CROWN EUROPEAN HOLDINGS SA-REG-S 2.87500% 18-01.02.26        | 10 090 000.00 | 10 739 674.92                                           | 0.59             |
| EUR DKT FINANCE APS-REG-S 7.00000% 18-17.06.23                   | 37 796 000.00 | 38 485 777.00                                           | 2.13             |
| EUR EDREAMS ODIGEO SA-REG-S 5.50000% 18-01.09.23                 | 7 170 000.00  | 7 180 755.00                                            | 0.40             |
| EUR EG GLOBAL FINANCE PLC-REG-S 4.37500% 19-07.02.25             | 960 000.00    | 953 846.40                                              | 0.05             |
| EUR EG GLOBAL FINANCE PLC-REG-S 3.62500% 19-07.02.24             | 2 750 000.00  | 2 727 598.50                                            | 0.15             |
| EUR EG GLOBAL FINANCE PLC-REG-S 6.25000% 19-30.10.25             | 5 360 000.00  | 5 475 240.00                                            | 0.30             |
| EUR FAURECIA SE-REG-S 3.75000% 20-15.06.28                       | 9 750 000.00  | 10 140 000.00                                           | 0.56             |
| EUR FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.38600% 19-17.02.26                | 11 390 000.00 | 11 732 839.00                                           | 0.65             |
| EUR FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.33000% 19-25.11.25                | 1 500 000.00  | 1 541 280.00                                            | 0.09             |
| EUR GARFUNKELUX HOLDCO 3 SA-REG-S 6.75000% 20-01.11.25           | 6 245 000.00  | 6 519 143.01                                            | 0.36             |
| EUR GTC AURORA LUXEMBOURG SA-REG-S 2.25000% 21-23.06.26          | 4 610 000.00  | 4 686 470.68                                            | 0.26             |
| EUR HERENS MIDCO SARL-REG-S 5.25000% 21-15.05.29                 | 15 215 000.00 | 14 758 550.00                                           | 0.81             |
| EUR HOUSE OF FINANCE NV/THE-REG-S 4.37500% 19-15.07.26           | 500 000.00    | 512 500.00                                              | 0.03             |
| EUR HOUSE OF HR-REG-S-SUB 7.50000% 20-15.01.27                   | 8 265 000.00  | 8 792 720.25                                            | 0.49             |
| EUR IHO VERWALTUNGS GMBH-REG-S (PIK) 3.87500% 19-15.05.27        | 2 705 000.00  | 2 775 876.41                                            | 0.15             |
| EUR INEOS QUATTRO FINANCE 1 PLC-REG-S 3.75000% 21-15.07.26       | 2 090 000.00  | 2 146 329.68                                            | 0.12             |
| EUR INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC-REG-S 3.50000% 19-15.06.26 | 10 333 000.00 | 10 598 558.10                                           | 0.59             |
| EUR INTL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP-REG-S 1.50000% 19-04.07.27  | 2 900 000.00  | 2 669 885.00                                            | 0.15             |
| EUR IQVIA INC-REG-S 2.25000% 19-15.01.28                         | 5 675 000.00  | 5 709 787.75                                            | 0.32             |
| EUR IQVIA INC-REG-S 2.87500% 20-15.06.28                         | 8 880 000.00  | 9 124 288.80                                            | 0.50             |
| EUR JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-REG-S 6.87500% 19-15.11.26  | 2 980 000.00  | 3 316 167.84                                            | 0.18             |
| EUR JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-REG-S 5.87500% 19-15.11.24  | 6 001 000.00  | 6 391 305.04                                            | 0.35             |
| EUR LABORATOIRE EIMER SELARL-REG-S 5.00000% 21-01.02.29          | 3 915 000.00  | 4 042 237.50                                            | 0.22             |
| EUR LHMC FINCO SARL-REG-S 6.25000% 18-20.12.23                   | 2 951 000.00  | 2 542 237.54                                            | 0.14             |
| EUR LINCOLN FINANCING SARL-REG-S 3.62500% 19-01.04.24            | 6 230 000.00  | 6 280 774.50                                            | 0.35             |
| EUR LOXAM SAS-REG-S 3.75000% 19-15.07.26                         | 9 155 000.00  | 9 351 832.50                                            | 0.52             |
| EUR MONICHEM HOLDCO 2 SA-REG-S-SUB 9.50000% 19-15.09.26          | 10 652 000.00 | 11 530 790.00                                           | 0.64             |
| EUR MONICHEM HOLDCO 3 SA-REG-S 5.25000% 19-15.03.25              | 1 230 000.00  | 1 260 745.08                                            | 0.07             |
| EUR NETFLIX INC 3.62500% 17-15.05.27                             | 15 355 000.00 | 17 735 025.00                                           | 0.98             |
| EUR NETFLIX INC-REG-S 3.87500% 19-15.11.29                       | 9 910 000.00  | 11 991 179.28                                           | 0.66             |
| EUR NIDDA BONDCO GMBH-REG-S 5.00000% 17-30.09.25                 | 5 275 000.00  | 5 254 163.75                                            | 0.29             |

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）  
2021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<br>ユーロ<br>先物 / 為替予約契約 /<br>スワップに係る<br>未実現損益<br>(注1) | 純資産<br>割合<br>(%) |
|-----------|--------------------------------------------------------------|---------------|---------------------------------------------------------|------------------|
| EUR       | NIDDA HEALTHCARE HOLDING AG-REG-S 3.50000% 17-30.09.24       | 15 980 000.00 | 15 868 140.00                                           | 0.88             |
| EUR       | NIDDA HEALTHCARE HOLDING AG-REG-S 3.50000% 20-30.09.24       | 4 425 000.00  | 4 397 343.75                                            | 0.24             |
| EUR       | ORGANON FINANCE 1 LLC-REG-S 2.87500% 21-30.04.28             | 5 260 000.00  | 5 367 367.12                                            | 0.30             |
| EUR       | PROMONTORIA HOLDING-REG-S 6.75000% 18-15.08.23               | 9 640 000.00  | 9 688 257.84                                            | 0.54             |
| EUR       | PUBLIC POWER CORP SA-REG-S 3.87500% 21-30.03.26              | 4 720 000.00  | 4 920 600.00                                            | 0.27             |
| EUR       | SAZKA GROUP AS-REG-S 4.12500% 19-20.11.24                    | 1 750 000.00  | 1 789 375.00                                            | 0.10             |
| EUR       | SAZKA GROUP AS-REG-S 3.87500% 20-15.02.27                    | 6 840 000.00  | 6 942 600.00                                            | 0.38             |
| EUR       | SCIENTIFIC GAMES INTERNATIONAL-REG-S 5.50000% 18-15.02.26    | 4 270 000.00  | 4 391 148.44                                            | 0.24             |
| EUR       | SILGAN HOLDINGS INC 2.25000% 20-01.06.28                     | 4 250 000.00  | 4 276 562.50                                            | 0.24             |
| EUR       | SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 5.00000% 18-15.04.28               | 3 160 000.00  | 3 324 493.80                                            | 0.18             |
| EUR       | SUMMER BC HOLDCO A SARL-REG-S 9.25000% 19-31.10.27           | 13 360 000.00 | 13 079 355.61                                           | 0.72             |
| EUR       | TELE COLUMBUS AG-REG-S 3.87500% 18-02.05.25                  | 20 085 000.00 | 20 135 212.50                                           | 1.11             |
| EUR       | TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 4.50000% 18-01.03.25       | 15 533 000.00 | 16 118 399.94                                           | 0.89             |
| EUR       | TEVA PHARMACEUTICAL FIN 6.00000% 20-31.01.25                 | 14 990 000.00 | 16 201 379.38                                           | 0.89             |
| EUR       | TI AUTOMOTIVE FINANCE PLC-REG-S 3.75000% 21-15.04.29         | 6 305 000.00  | 6 366 789.00                                            | 0.35             |
| EUR       | TUI CRUISES GMBH-REG-S 6.50000% 21-15.05.26                  | 5 310 000.00  | 5 469 300.00                                            | 0.30             |
| EUR       | UNILABS SUBHOLDING AB-REG-S 5.75000% 17-15.05.25             | 8 730 000.00  | 8 864 442.00                                            | 0.49             |
| EUR       | UNITED GROUP BV-REG-S 4.87500% 17-01.07.24                   | 3 210 000.00  | 3 246 722.40                                            | 0.18             |
| EUR       | VERISURE MIDHOLDING AB-REG-S 5.25000% 21-15.02.29            | 5 710 000.00  | 5 857 774.80                                            | 0.32             |
| EUR       | VERTICAL HOLDCO GMBH-REG-S 6.62500% 20-15.07.28              | 7 820 000.00  | 7 472 863.94                                            | 0.41             |
| EUR       | VIRGIN MEDIA FINANCE PLC-REG-S 3.75000% 20-15.07.30          | 1 690 000.00  | 1 711 125.00                                            | 0.09             |
| EUR       | WMG ACQUISITION CORP-REG-S 2.75000% 20-15.07.28              | 1 810 000.00  | 1 864 249.32                                            | 0.10             |
| EUR       | WMG ACQUISITION CORP-REG-S 2.25000% 21-15.08.31              | 3 795 000.00  | 3 791 630.04                                            | 0.21             |
| EUR       | ZF EUROPE FINANCE BV-REG-S 2.00000% 19-23.02.26              | 2 900 000.00  | 2 925 293.80                                            | 0.16             |
| Total EUR |                                                              |               | 586 883 897.70                                          | 32.40            |
| GBP       |                                                              |               |                                                         |                  |
| GBP       | CPUK FINANCE LTD-REG-S 4.50000% 21-28.08.27                  | 1 850 000.00  | 2 187 778.21                                            | 0.12             |
| GBP       | ENCORE CAPITAL GROUP INC-REG-S 4.25000% 21-01.06.26          | 3 655 000.00  | 4 244 659.78                                            | 0.24             |
| GBP       | PINNACLE BIDCO PLC-REG-S 6.37500% 18-15.02.25                | 6 730 000.00  | 7 994 268.78                                            | 0.44             |
| Total GBP |                                                              |               | 14 426 706.77                                           | 0.80             |
| USD       |                                                              |               |                                                         |                  |
| USD       | DRESDNER FUND TRUST I-REG-S 8.15100% 99-30.06.31             | 3 000 000.00  | 3 692 566.54                                            | 0.20             |
| USD       | EQT CORP 3.90000% 17-01.10.27                                | 3 620 000.00  | 3 380 363.77                                            | 0.19             |
| USD       | GENESIS ENERGY LP 8.00000% 20-15.01.27                       | 5 125 000.00  | 4 477 382.55                                            | 0.25             |
| USD       | ITHACA ENERGY NORTH SEA PLC-REG-S 9.00000% 21-15.07.26       | 5 220 000.00  | 4 603 391.86                                            | 0.25             |
| USD       | NEPTUNE ENERGY BONDCO PLC-REG-S 6.62500% 18-15.05.25         | 12 205 000.00 | 10 833 852.84                                           | 0.60             |
| USD       | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 3.20000% 19-15.08.26               | 3 776 000.00  | 3 326 346.64                                            | 0.18             |
| USD       | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 2.90000% 19-15.08.24               | 2 520 000.00  | 2 213 303.43                                            | 0.12             |
| USD       | ZIGGO BV-144A 5.50000% 16-15.01.27                           | 9 876 000.00  | 8 809 107.38                                            | 0.49             |
| Total USD |                                                              |               | 41 336 315.01                                           | 2.28             |
| 固定利付ノート合計 |                                                              |               | 642 646 919.48                                          | 35.48            |
| 変動利付ノート   |                                                              |               |                                                         |                  |
| EUR       |                                                              |               |                                                         |                  |
| EUR       | ABANCA CORP BANCARIA SA-REG-S-SUB VAR 21-PRP                 | 5 400 000.00  | 5 798 260.80                                            | 0.32             |
| EUR       | ACCOR SA-REG-S-SUB 2.625%/VAR 19-PRP                         | 7 200 000.00  | 6 930 000.00                                            | 0.38             |
| EUR       | BANCA MONT DEI PAS DI SIENA-REG-S-SUB 8.000%/VAR 20-22.01.30 | 3 755 000.00  | 3 004 000.00                                            | 0.17             |
| EUR       | BANCA MONTE DEI PASCHI DI-REG-S-SUB 8.520%/VAR 20-10.09.30   | 2 000 000.00  | 1 625 000.00                                            | 0.09             |
| EUR       | BANCO BPM SPA-REG-S-SUB 5.000%/VAR 20-14.09.30               | 3 340 000.00  | 3 642 470.40                                            | 0.20             |
| EUR       | BANCO SANTANDER SA SUB-REG-S 3.625%/VAR 21-PRP               | 3 000 000.00  | 2 917 500.00                                            | 0.16             |

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）  
2021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<br>ユーロ<br>先物 / 為替予約契約 /<br>スワップに係る<br>未実現損益<br>(注1) | 純資産<br>割合<br>(%) |
|------------------------------------------------------------------|---------------|---------------------------------------------------------|------------------|
| EUR BANQUE INTL A LUXEMBOURG SA-REG-S-SUB VAR 19-PRP             | 4 800 000.00  | 5 006 976.00                                            | 0.28             |
| EUR BORMIOLI PHARMA SPA-REG-S 3M EURIBOR+350BP 17-15.11.24       | 7 510 000.00  | 7 314 740.00                                            | 0.40             |
| EUR DTE POSTBANK FUNDING TRUST I-SUB 10YR EUSA+2.5BP 04-PRP      | 2 872 000.00  | 2 823 032.40                                            | 0.16             |
| EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 3.375%/VAR 20-PRP         | 8 800 000.00  | 9 251 528.00                                            | 0.51             |
| EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 2.875%/VAR 20-PRP         | 7 600 000.00  | 7 848 960.80                                            | 0.43             |
| EUR PROMONTORIA HOLDING-REG-S 3M EURIBOR+625BP 18-15.08.23       | 1 955 000.00  | 1 947 473.25                                            | 0.11             |
| EUR REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S-SUB 3.750%/VAR 20-PRP  | 1 225 000.00  | 1 304 294.25                                            | 0.07             |
| EUR REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV-SUB 4.247%/VAR 20-PRP        | 1 225 000.00  | 1 341 497.50                                            | 0.07             |
| EUR SAMHALLSBYGGNADSBOLAGET I NORDEN-REG-S-SUB 2.875%/VAR 21-PRP | 4 480 000.00  | 4 466 918.40                                            | 0.25             |
| EUR UNICREDIT SPA-REG-S-SUB 2.731%/VAR 20-15.01.32               | 3 365 000.00  | 3 494 209.27                                            | 0.19             |
| Total EUR                                                        |               | 68 716 861.07                                           | 3.79             |
| GBP                                                              |               |                                                         |                  |
| GBP MILLER HOMES GROUP HOLD PLC-REG-S 3M LIBOR+525BP 17-15.10.23 | 3 216 000.00  | 1 183 333.54                                            | 0.07             |
| Total GBP                                                        |               | 1 183 333.54                                            | 0.07             |
| USD                                                              |               |                                                         |                  |
| USD BARCLAYS PLC 4.375%/VAR 21-PRP                               | 4 460 000.00  | 3 845 617.16                                            | 0.21             |
| USD HSBC BANK PLC-SUB 6M LIBOR+25BP 85-PRP                       | 1 670 000.00  | 1 362 283.10                                            | 0.08             |
| USD SOFTBANK GROUP CORP-REG-S-SUB 6.000%/VAR 17-PRP              | 10 290 000.00 | 8 839 296.89                                            | 0.49             |
| Total USD                                                        |               | 14 047 197.15                                           | 0.78             |
| 変動利付ノート合計                                                        |               | 83 947 391.76                                           | 4.64             |
| 固定利付メディアム・ターム・ノート                                                |               |                                                         |                  |
| EUR                                                              |               |                                                         |                  |
| EUR ATLANTIA SPA-REG-S 1.87500% 17-13.07.27                      | 2 510 000.00  | 2 612 965.22                                            | 0.14             |
| EUR AUTOSTRADA PER L'ITALIA SPA-REG-S 1.75000% 15-26.06.26       | 14 940 000.00 | 15 424 115.76                                           | 0.85             |
| EUR AUTOSTRADA PER L'ITALIA SPA-REG-S 1.75000% 16-01.02.27       | 7 300 000.00  | 7 544 170.40                                            | 0.42             |
| EUR AUTOSTRADA PER L'ITALIA SPA-REG-S 1.87500% 17-26.09.29       | 6 037 000.00  | 6 293 403.46                                            | 0.35             |
| EUR BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA-REG-S 3.62500% 19-24.09.24   | 7 555 000.00  | 7 878 024.60                                            | 0.43             |
| EUR CASINO GUICHARD PERRACHON SA-REG-S STEP-UP 14-07.03.24       | 4 100 000.00  | 4 121 910.40                                            | 0.23             |
| EUR CASINO GUICHARD PERRACHON SA-REG-S STEP-UP 14-07.02.25       | 1 900 000.00  | 1 836 350.00                                            | 0.10             |
| EUR COMMERZBANK AG-REG-S-SUB 4.00000% 16-23.03.26                | 2 067 000.00  | 2 321 861.10                                            | 0.13             |
| EUR DEUTSCHE BANK AG-SUB 4.50000% 16-19.05.26                    | 6 200 000.00  | 7 168 266.40                                            | 0.40             |
| EUR DEUTSCHE LUFTHANSA AG-REG-S 3.50000% 21-14.07.29             | 5 900 000.00  | 6 092 104.00                                            | 0.34             |
| EUR DEUTSCHE LUFTHANSA AG-REG-S 2.00000% 21-14.07.24             | 3 100 000.00  | 3 156 748.60                                            | 0.17             |
| EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB 3.92800% 14-15.09.26           | 1 775 000.00  | 2 006 602.00                                            | 0.11             |
| EUR LEONARDO SPA-REG-S 2.37500% 20-08.01.26                      | 1 955 000.00  | 2 049 817.50                                            | 0.11             |
| EUR NASSA TOPCO AS-REG-S 2.87500% 17-06.04.24                    | 7 514 000.00  | 7 748 436.80                                            | 0.43             |
| EUR ORANO SA-REG-S 2.75000% 20-08.03.28                          | 2 000 000.00  | 2 110 008.00                                            | 0.12             |
| EUR PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 2.75000% 15-21.04.27               | 1 130 000.00  | 1 063 824.38                                            | 0.06             |
| EUR PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 5.12500% 16-15.03.23               | 5 521 000.00  | 5 796 359.88                                            | 0.32             |
| EUR PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 3.75000% 17-21.02.24               | 2 295 000.00  | 2 371 452.18                                            | 0.13             |
| EUR PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 4.87500% 17-21.02.28               | 3 365 000.00  | 3 397 177.81                                            | 0.19             |
| EUR PPF TELECOM GROUP BV-REG-S 3.25000% 20-29.09.27              | 6 070 000.00  | 6 585 950.00                                            | 0.36             |
| EUR RENAULT SA-REG-S 2.37500% 20-25.05.26                        | 9 000 000.00  | 9 090 000.00                                            | 0.50             |
| EUR SHAEFFLER AG-REG-S 3.37500% 20-12.10.28                      | 17 100 000.00 | 19 130 693.40                                           | 1.06             |
| EUR TELECOM ITALIA FINANCE SA 7.75000% 03-24.01.33               | 1 402 000.00  | 2 044 814.19                                            | 0.11             |
| EUR TELECOM ITALIA SPA-REG-S 3.00000% 16-30.09.25                | 830 000.00    | 880 973.62                                              | 0.05             |
| EUR TELECOM ITALIA SPA-REG-S 2.37500% 17-12.10.27                | 2 890 000.00  | 2 990 861.00                                            | 0.16             |
| EUR TELECOM ITALIA SPA-REG-S 2.87500% 18-28.01.26                | 610 000.00    | 643 733.00                                              | 0.04             |

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）  
2021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<br>ユーロ<br>先物 / 為替予約契約 /<br>スワップに係る<br>未実現損益<br>(注1) | 純資産<br>割合<br>(%) |
|----------------------------------------------------------------|---------------|---------------------------------------------------------|------------------|
| EUR TELECOM ITALIA SPA-REG-S 2.75000% 19-15.04.25              | 4 475 000.00  | 4 693 380.00                                            | 0.26             |
| EUR THYSSENKRUPP AG-REG-S 2.87500% 19-22.02.24                 | 7 540 000.00  | 7 728 500.00                                            | 0.43             |
| EUR UNIPOL GRUPPO SPA-REG-S 3.50000% 17-29.11.27               | 3 800 000.00  | 4 387 434.40                                            | 0.24             |
| EUR ZF FINANCE GMBH-REG-S 3.75000% 20-21.09.28                 | 9 800 000.00  | 10 682 000.00                                           | 0.59             |
| EUR ZF FINANCE GMBH-REG-S 3.00000% 20-21.09.25                 | 2 300 000.00  | 2 420 750.00                                            | 0.13             |
| EUR ZF FINANCE GMBH-REG-S 2.75000% 20-25.05.27                 | 4 300 000.00  | 4 451 067.60                                            | 0.25             |
| EUR ZF FINANCE GMBH-REG-S 2.00000% 21-06.05.27                 | 2 600 000.00  | 2 613 000.00                                            | 0.14             |
| Total EUR                                                      |               | 169 336 755.70                                          | 9.35             |
| GBP                                                            |               |                                                         |                  |
| GBP FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.74800% 20-14.06.24              | 4 295 000.00  | 5 047 164.06                                            | 0.28             |
| GBP PETROLEOS MEXICANOS 8.25000% 09-02.06.22                   | 3 942 000.00  | 4 758 199.70                                            | 0.26             |
| Total GBP                                                      |               | 9 805 363.76                                            | 0.54             |
| USD                                                            |               |                                                         |                  |
| USD ENQUEST PLC-144A-REG-S (PIK) 7.00000% 16-15.04.22          | 24 272 850.00 | 20 074 659.58                                           | 1.11             |
| Total USD                                                      |               | 20 074 659.58                                           | 1.11             |
| 固定利付メディアム・ターム・ノート合計                                            |               | 199 216 779.04                                          | 11.00            |
| 変動利付メディアム・ターム・ノート                                              |               |                                                         |                  |
| EUR                                                            |               |                                                         |                  |
| EUR AIB GROUP PLC-REG-S-SUB 2.875%/VAR 20-30.05.31             | 4 925 000.00  | 5 283 894.60                                            | 0.29             |
| EUR BANCO BPM SPA-REG-S-SUB 3.250%/VAR 20-14.01.2031           | 2 185 000.00  | 2 232 750.99                                            | 0.12             |
| EUR BANCO COMERCIAL PORTUGUES-REG-S-SUB 4.500%/VAR 17-07.12.27 | 1 500 000.00  | 1 550 250.00                                            | 0.09             |
| EUR BANCO COMERCIAL PORTUGUES-REG-S-SUB 3.871%/VAR 19-27.03.30 | 2 600 000.00  | 2 672 805.20                                            | 0.15             |
| EUR BANK OF CYPRUS HOLDINGS-REG-S-SUB 6.625%/VAR 21-23.10.31   | 4 045 000.00  | 4 198 467.30                                            | 0.23             |
| EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 5.000%/VAR 14-PRP       | 3 100 000.00  | 3 479 068.00                                            | 0.19             |
| EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB 5.875%/VAR 19-04.03.29       | 2 030 000.00  | 2 270 916.34                                            | 0.13             |
| EUR PIRAEUS GROUP FINANCE PLC-REG-S-SUB 9.750%/VAR 19-26.06.29 | 5 145 000.00  | 5 623 207.17                                            | 0.31             |
| EUR UNICREDIT SPA-REG-S-SUB 4.875%/VAR 19-20.02.29             | 7 000 000.00  | 7 605 892.00                                            | 0.42             |
| EUR UNICREDIT SPA-REG-S-SUB 2.000%/VAR 19-23.09.29             | 1 110 000.00  | 1 130 352.96                                            | 0.06             |
| EUR UNICREDIT SPA-REG-S-SUB 4.450%/VAR 21-PRP                  | 7 310 000.00  | 7 565 850.00                                            | 0.42             |
| EUR UNIPOLSAI SPA-SUB 5.750%/VAR 14-PRP                        | 3 090 000.00  | 3 410 587.50                                            | 0.19             |
| Total EUR                                                      |               | 47 024 042.06                                           | 2.60             |
| GBP                                                            |               |                                                         |                  |
| GBP HSBC BANK PLC 5.84400%/6M LIBOR+176BP 03-PRP               | 1 905 000.00  | 3 075 710.16                                            | 0.17             |
| Total GBP                                                      |               | 3 075 710.16                                            | 0.17             |
| USD                                                            |               |                                                         |                  |
| USD HSBC BANK PLC-SUB 6M LIBOR+25BP 85-PRP                     | 980 000.00    | 799 288.32                                              | 0.04             |
| Total USD                                                      |               | 799 288.32                                              | 0.04             |
| 変動利付メディアム・ターム・ノート合計                                            |               | 50 899 040.54                                           | 2.81             |
| 固定利付債券                                                         |               |                                                         |                  |
| EUR                                                            |               |                                                         |                  |
| EUR ADLER REAL ESTATE AG-REG-S 1.50000% 19-17.04.22            | 1 900 000.00  | 1 812 284.60                                            | 0.10             |
| EUR AEDAS HOMES OPCO SLU-REG-S 4.00000% 21-15.08.26            | 2 420 000.00  | 2 502 038.00                                            | 0.14             |
| EUR ALTICE FINANCING SA-REG-S 2.25000% 20-15.01.25             | 2 375 000.00  | 2 286 887.50                                            | 0.13             |
| EUR ALTICE FINANCING SA-REG-S 3.00000% 20-15.01.28             | 8 110 000.00  | 7 633 943.00                                            | 0.42             |

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）  
2021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<br>ユーロ<br>先物 / 為替予約契約 /<br>スワップに係る<br>未実現損益<br>(注1) | 純資産<br>割合<br>(%) |
|--------------------------------------------------------------|---------------|---------------------------------------------------------|------------------|
| EUR ALTICE FRANCE SA/FRANCE-REG-S 4.00000% 21-15.07.29       | 5 685 000.00  | 5 594 983.71                                            | 0.31             |
| EUR AVANTOR FUNDING INC-REG-S 2.62500% 20-01.11.25           | 2 840 000.00  | 2 902 536.80                                            | 0.16             |
| EUR BK LC LUX FINCO1 SARL-REG-S 5.25000% 21-30.04.29         | 4 860 000.00  | 5 042 250.00                                            | 0.28             |
| EUR CAB SELAS-REG-S 3.37500% 21-01.02.28                     | 3 665 000.00  | 3 696 819.53                                            | 0.20             |
| EUR CARNIVAL CORP-REG-S 10.12500% 20-01.02.26                | 8 645 000.00  | 9 924 460.00                                            | 0.55             |
| EUR CARNIVAL CORP-REG-S 7.62500% 20-01.03.26                 | 3 320 000.00  | 3 583 574.80                                            | 0.20             |
| EUR CHEPLAPHARM ARZNEIMITTEL GMBH-REG-S 4.37500% 20-15.01.28 | 2 595 000.00  | 2 698 800.00                                            | 0.15             |
| EUR CIDRON AIDA FINCO SARL-REG-S 5.00000% 21-01.04.28        | 2 410 000.00  | 2 427 756.89                                            | 0.13             |
| EUR CIRSA FINANCE INTERNATIONAL-REG-S 4.75000% 19-22.05.25   | 5 890 000.00  | 5 904 725.00                                            | 0.33             |
| EUR CIRSA FINANCE INTERNATIONAL-REG-S 4.50000% 21-15.03.27   | 6 530 000.00  | 6 458 953.60                                            | 0.36             |
| EUR CMA CGM SA-REG-S 5.25000% 17-15.01.25                    | 10 270 000.00 | 10 412 013.56                                           | 0.57             |
| EUR COTY INC-REG-S 3.87500% 21-15.04.26                      | 4 815 000.00  | 4 924 589.40                                            | 0.27             |
| EUR CRYSTAL ALMOND SARL-REG-S 4.25000% 19-15.10.24           | 7 370 000.00  | 7 524 180.40                                            | 0.41             |
| EUR CTC BONDCO GMBH-REG-S 5.25000% 17-15.12.25               | 6 732 000.00  | 6 869 332.80                                            | 0.38             |
| EUR DUFFRY ONE BV-REG-S 3.37500% 21-15.04.28                 | 6 005 000.00  | 5 959 962.50                                            | 0.33             |
| EUR FAURECIA SE-REG-S 2.37500% 19-15.06.27                   | 175 000.00    | 175 875.00                                              | 0.01             |
| EUR GRUENENTHAL GMBH-REG-S 3.62500% 21-15.11.26              | 1 500 000.00  | 1 555 680.00                                            | 0.09             |
| EUR GRUENENTHAL GMBH-REG-S 4.12500% 21-15.05.28              | 4 800 000.00  | 5 029 056.00                                            | 0.28             |
| EUR HEIMSTADEN AB-REG-S 4.37500% 21-06.03.27                 | 5 500 000.00  | 5 511 871.75                                            | 0.30             |
| EUR IHO VERWALTUNGS GMBH-REG-S (PIK) 3.75000% 16-15.09.26    | 1 670 000.00  | 1 700 661.20                                            | 0.09             |
| EUR INEOS QUATTRO FINANCE 2 PLC-REG-S 2.50000% 21-15.01.26   | 8 445 000.00  | 8 518 657.29                                            | 0.47             |
| EUR INTRUM JUSTITIA AB-REG-S 3.12500% 17-15.07.24            | 11 545 000.00 | 11 603 302.25                                           | 0.64             |
| EUR KAPLA HOLDING SAS-REG-S 3.37500% 19-15.12.26             | 4 665 000.00  | 4 677 959.37                                            | 0.26             |
| EUR KEDRION SPA-REG-S 3.37500% 21-15.05.26                   | 10 405 000.00 | 10 367 958.20                                           | 0.57             |
| EUR KLEOPATRA FINCO SARL-REG-S 4.25000% 21-01.03.26          | 3 215 000.00  | 3 144 977.30                                            | 0.17             |
| EUR KME AG-REG-S 6.75000% 18-01.02.23                        | 7 680 000.00  | 7 261 286.40                                            | 0.40             |
| EUR LHMC FINCO 2 SARL-REG-S (PIK) 7.25000% 19-02.10.25       | 8 731 983.95  | 8 876 707.85                                            | 0.49             |
| EUR LOXAM SAS-REG-S 4.25000% 17-15.04.24                     | 1 400 000.00  | 1 411 760.00                                            | 0.08             |
| EUR LOXAM SAS-REG-S 6.00000% 17-15.04.25                     | 7 945 000.00  | 8 087 580.97                                            | 0.45             |
| EUR MATTERHORN TELECOM SA-REG-S 3.12500% 19-15.09.26         | 4 020 000.00  | 4 020 000.00                                            | 0.22             |
| EUR MOTION FINCO SARL-REG-S 7.00000% 20-15.05.25             | 9 015 000.00  | 9 463 045.50                                            | 0.52             |
| EUR MULHACEN PTE LTD-REG-S (PIK) 7.50000% 18-01.08.23        | 5 310 197.00  | 4 429 766.34                                            | 0.24             |
| EUR NIDDA BONDCO GMBH-REG-S 7.25000% 18-30.09.25             | 9 432 000.00  | 9 577 762.13                                            | 0.53             |
| EUR NOBIAN FINANCE BV-REG-S 3.62500% 21-15.07.26             | 7 205 000.00  | 7 135 241.19                                            | 0.39             |
| EUR NOMAD FOODS BONDCO PLC-REG-S 2.50000% 21-24.06.28        | 7 510 000.00  | 7 615 140.00                                            | 0.42             |
| EUR OI EUROPEAN GROUP BV-REG-S 3.12500% 16-15.11.24          | 2 950 000.00  | 3 047 704.00                                            | 0.17             |
| EUR OI EUROPEAN GROUP BV-REG-S 2.87500% 19-15.02.25          | 9 720 000.00  | 9 849 237.12                                            | 0.54             |
| EUR PAPREC HOLDING-REG-S 4.00000% 18-31.03.25                | 3 838 000.00  | 3 905 165.00                                            | 0.22             |
| EUR PAPREC HOLDING-REG-S 3.50000% 21-01.07.28                | 6 605 000.00  | 6 686 849.15                                            | 0.37             |
| EUR PARTS EUROPE SA-REG-S 6.50000% 20-16.07.25               | 9 055 000.00  | 9 439 837.50                                            | 0.52             |
| EUR PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 5.50000% 05-24.02.25           | 610 000.00    | 665 776.88                                              | 0.04             |
| EUR PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 3.75000% 14-16.04.26           | 3 779 000.00  | 3 799 784.50                                            | 0.21             |
| EUR PHM GROUP HOLDING OY-144A-REG-S 4.75000% 21-18.06.26     | 5 185 000.00  | 5 330 180.00                                            | 0.29             |
| EUR PINNACLE BIDCO PLC-REG-S 5.50000% 20-15.02.25            | 9 540 000.00  | 9 826 200.00                                            | 0.54             |
| EUR PLT VII FINANCE SARL-REG-S 4.62500% 20-05.01.26          | 7 260 000.00  | 7 466 764.80                                            | 0.41             |
| EUR PRIMO WATER HOLDINGS INC-REG-S 3.87500% 20-31.10.28      | 6 520 000.00  | 6 745 565.92                                            | 0.37             |
| EUR QUATRIM SASU-REG-S 5.87500% 19-15.01.24                  | 3 170 000.00  | 3 263 832.00                                            | 0.18             |
| EUR REKEEP SPA-REG-S 7.25000% 21-01.02.26                    | 4 460 000.00  | 4 807 969.20                                            | 0.27             |
| EUR REXEL SA-REG-S 2.75000% 19-15.06.26                      | 3 675 000.00  | 3 750 153.75                                            | 0.21             |
| EUR ROSSINI SARL-REG-S 6.75000% 18-30.10.25                  | 11 930 000.00 | 12 376 182.00                                           | 0.68             |
| EUR RUBIS TERMINAL INFRA SAS -REG-S 5.62500% 20-15.05.25     | 12 375 000.00 | 12 993 750.00                                           | 0.72             |
| EUR SIGMA HOLDCO BV-REG-S 5.75000% 18-15.05.26               | 7 320 000.00  | 6 990 600.00                                            | 0.39             |
| EUR SIGMA DEVELOPMENT FINANCE SCS-REG-S 5.50000% 21-23.07.26 | 8 400 000.00  | 7 790 815.20                                            | 0.43             |
| EUR SOFIMA HOLDING SPA-REG-S 3.75000% 20-15.01.28            | 4 565 000.00  | 4 599 237.50                                            | 0.25             |

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）  
2021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<br>ユーロ<br>先物 / 為替予約契約 /<br>スワップに係る<br>未実現損益<br>(注1) | 純資産<br>割合<br>(%) |
|------------------------------------------------------------------|---------------|---------------------------------------------------------|------------------|
| EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 5.25000% 15-30.07.27               | 4 000 000.00  | 4 290 546.80                                            | 0.24             |
| EUR STANDARD PROFIL AUTOMOTIVE GMBH-REG-S 6.25000% 21-30.04.26   | 7 480 000.00  | 6 821 760.00                                            | 0.38             |
| EUR SUMMER BC HOLDCO B SARL-REG-S 5.75000% 19-31.10.26           | 4 115 000.00  | 4 310 462.49                                            | 0.24             |
| EUR SUMMER BIDCO BV-REG-S 9.00000% 19-15.11.25                   | 8 129 000.00  | 8 716 152.91                                            | 0.48             |
| EUR SUMMER BIDCO BV-REG-S (PIK) STEP-DOWN 20-15.11.25            | 7 375 000.00  | 7 730 255.22                                            | 0.43             |
| EUR TEREOS FINANCE GROUPE I SA-REG-S 4.12500% 16-16.06.23        | 2 500 000.00  | 2 540 110.00                                            | 0.14             |
| EUR TEREOS FINANCE GROUPE I SA-REG-S 7.50000% 20-30.10.25        | 3 000 000.00  | 3 220 230.00                                            | 0.18             |
| EUR TRIVIMUM PACKAGING FINANCE BV-REG-S 3.75000% 19-15.08.26     | 15 044 000.00 | 15 390 012.00                                           | 0.85             |
| EUR UNITED GROUP BV-REG-S 3.12500% 20-15.02.26                   | 6 575 000.00  | 6 358 025.00                                            | 0.35             |
| EUR UPC HOLDING BV-REG-S 3.87500% 17-15.06.29                    | 1 300 000.00  | 1 334 346.00                                            | 0.07             |
| EUR VERTICAL MIDCO GMBH-REG-S 4.37500% 20-15.07.27               | 3 580 000.00  | 3 736 660.80                                            | 0.21             |
| EUR VIVION INVESTMENTS SARL-REG-S 3.00000% 19-08.08.24           | 4 100 000.00  | 3 990 940.00                                            | 0.22             |
| Total EUR                                                        |               | 410 099 486.57                                          | 22.64            |
| GBP                                                              |               |                                                         |                  |
| GBP ARQIVA BROADCAST FINANCE PLC-REG-S 6.75000% 18-30.09.23      | 5 810 000.00  | 6 895 574.31                                            | 0.38             |
| GBP BRACKEN MIDCO1 PLC-REG-S (PIK) 8.87500% 18-15.10.23          | 10 777 897.00 | 12 811 990.71                                           | 0.71             |
| GBP CIDRON AIDA FINCO SARL-REG-S 6.25000% 21-01.04.28            | 1 505 000.00  | 1 769 425.36                                            | 0.10             |
| GBP DEUCE FINCO PLC-REG-S 5.50000% 21-15.06.27                   | 3 820 000.00  | 4 494 570.33                                            | 0.25             |
| GBP GALAXY BIDCO LTD-REG-S 6.50000% 19-31.07.26                  | 3 670 000.00  | 4 462 493.97                                            | 0.25             |
| GBP GALAXY FINCO LTD-REG-S 9.25000% 19-31.07.27                  | 7 510 000.00  | 9 196 021.57                                            | 0.51             |
| GBP GARFUNKELUX HOLDCO 3 SA-REG-S 7.75000% 20-01.11.25           | 1 685 000.00  | 2 047 762.33                                            | 0.11             |
| GBP JERROLD FINCO PLC-REG-S 4.87500% 20-15.01.26                 | 4 180 000.00  | 4 990 768.11                                            | 0.28             |
| GBP JERROLD FINCO PLC-REG-S 5.25000% 21-15.01.27                 | 8 825 000.00  | 10 656 342.38                                           | 0.59             |
| GBP MILLER HOMES GROUP HOLDINGS PLC-REG-S 5.50000% 17-15.10.24   | 14 205 000.00 | 16 737 955.10                                           | 0.92             |
| GBP PREMIER FOODS FINANCE PLC-REG-S 3.50000% 21-15.10.26         | 4 700 000.00  | 5 502 311.12                                            | 0.30             |
| GBP PUNCH FINANCE PLC-REG-S 6.12500% 21-30.06.26                 | 5 380 000.00  | 6 401 351.22                                            | 0.35             |
| GBP STONEGATE PUB CO FIN2019 PLC-REG-S 8.25000% 20-31.07.25      | 4 740 000.00  | 5 795 874.83                                            | 0.32             |
| GBP VERY GROUP FUNDING PLC/THE-REG-S 6.50000% 21-01.08.26        | 15 635 000.00 | 18 437 698.61                                           | 1.02             |
| GBP VIRGIN MEDIA VENDOR FINANCING-REG-S 4.87500% 20-15.07.28     | 3 425 000.00  | 4 057 607.12                                            | 0.22             |
| Total GBP                                                        |               | 114 257 747.07                                          | 6.31             |
| 固定利付債券合計                                                         |               | 524 357 233.64                                          | 28.95            |
| 変動利付債券                                                           |               |                                                         |                  |
| EUR                                                              |               |                                                         |                  |
| EUR ABANCA CORP BANCARIA SA-REG-S-SUB 6.125%/VAR 19-18.01.29     | 3 200 000.00  | 3 524 000.00                                            | 0.19             |
| EUR ACCOR SA-REG-S-SUB 4.375%/VAR 19-PRP                         | 900 000.00    | 928 591.20                                              | 0.05             |
| EUR BANCO BPM SPA-REG-S-SUB 4.250%/VAR 19-01.10.29               | 7 740 000.00  | 8 234 431.20                                            | 0.46             |
| EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 6.500%/VAR 17-PRP             | 5 000 000.00  | 5 124 600.00                                            | 0.28             |
| EUR CAIXABANK SA-REG-S-SUB 3.625%/VAR 21-PRP                     | 5 200 000.00  | 5 054 400.00                                            | 0.28             |
| EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 4.000%/VAR 18-PRP         | 1 300 000.00  | 1 387 230.00                                            | 0.08             |
| EUR GOLDEN GOOSE SPA-REG-S 3M EURIBOR+487.5BP 21-14.05.27        | 13 045 000.00 | 12 898 243.75                                           | 0.71             |
| EUR LIBERTY MUTUAL GROUP INC-REG-S-SUB 3.625%/VAR 19-23.05.59    | 3 460 000.00  | 3 613 970.00                                            | 0.20             |
| EUR PLT VII FINANCE SARL-REG-S 3M LIBOR+462.5BP 20-05.01.26      | 2 090 000.00  | 2 097 887.66                                            | 0.12             |
| EUR RAIFFEISEN BANK INTL AG-REG-S-SUB 6.125%/VAR 17-PRP          | 4 000 000.00  | 4 208 384.00                                            | 0.23             |
| EUR REPSOL INTERNATIONAL FINANC-REG-S-SUB 4.500%/VAR 15-25.03.75 | 3 570 000.00  | 3 886 623.30                                            | 0.21             |
| EUR ROSSINI SARL-REG-S 3M EURIBOR+387.5BP 19-30.10.25            | 2 100 000.00  | 2 105 250.00                                            | 0.12             |
| EUR SISAL PAY SPA-REG-S 3M EURIBOR+387.5BP 19-17.12.26           | 5 815 000.00  | 5 815 000.00                                            | 0.32             |
| EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 5.875%/VAR 14-PRP             | 2 500 000.00  | 2 771 875.00                                            | 0.15             |
| EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 3.000%/VAR 18-PRP             | 2 300 000.00  | 2 374 750.00                                            | 0.13             |
| EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 3.875%/VAR 18-PRP             | 4 100 000.00  | 4 438 250.00                                            | 0.25             |

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）  
2021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<br>ユーロ<br>先物 / 為替予約契約 /<br>スワップに係る<br>未実現損益<br>(注1) | 純資産<br>割合<br>(%) |
|-----------------------------------------------------------------|--------------|---------------------------------------------------------|------------------|
| EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 4.375%/VAR 19-PRP            | 8 700 000.00 | 9 429 147.00                                            | 0.52             |
| EUR UNICREDIT SPA-REG-S-SUB 6.625%/VAR 17-PRP                   | 4 140 000.00 | 4 393 575.00                                            | 0.24             |
| EUR VERTICAL MIDCO GMBH-REG-S 3M EURIBOR+475BP 20-15.07.27      | 2 980 000.00 | 3 006 647.16                                            | 0.17             |
| EUR VODAFONE GROUP PLC-REG-S-SUB 3.100%/VAR 18-03.01.79         | 4 150 000.00 | 4 308 986.50                                            | 0.24             |
| Total EUR                                                       |              | 89 601 841.77                                           | 4.95             |
| GBP                                                             |              |                                                         |                  |
| GBP CYBG PLC-REG-S-SUB 8.750%/VAR 16-PRP                        | 5 160 000.00 | 6 039 166.28                                            | 0.33             |
| Total GBP                                                       |              | 6 039 166.28                                            | 0.33             |
| USD                                                             |              |                                                         |                  |
| USD CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S-SUB 7.500%/VAR 18-PRP          | 5 690 000.00 | 5 253 289.62                                            | 0.29             |
| Total USD                                                       |              | 5 253 289.62                                            | 0.29             |
| 変動利付債券合計                                                        |              | 100 894 297.67                                          | 5.57             |
| 変動利付転換社債                                                        |              |                                                         |                  |
| EUR                                                             |              |                                                         |                  |
| EUR BANK OF IRELAND GROUP PLC-REG-S-SUB COCO 7.500%/VAR 20-PRP  | 3 980 000.00 | 4 672 918.00                                            | 0.26             |
| EUR CAIXABANK SA-REG-S-SUB 6.375%/VAR 18-PRP                    | 3 400 000.00 | 3 670 334.00                                            | 0.20             |
| Total EUR                                                       |              | 8 343 252.00                                            | 0.46             |
| 変動利付転換社債合計                                                      |              | 8 343 252.00                                            | 0.46             |
| 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                           |              | 1 610 304 914.13                                        | 88.91            |
| 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 AMERICAN AIRLINES GROUP INC-144A 5.00000% 19-01.06.22       | 1 910 000.00 | 1 650 103.54                                            | 0.09             |
| USD AMERICAN AIRLINES GROUP INC-144A 3.75000% 20-01.03.25       | 5 920 000.00 | 4 602 883.64                                            | 0.26             |
| USD CINEMARK USA INC-144A 5.25000% 21-15.07.28                  | 1 960 000.00 | 1 665 818.19                                            | 0.09             |
| USD DKT FINANCE APS-144A 9.37500% 18-17.06.23                   | 3 340 000.00 | 2 932 352.56                                            | 0.16             |
| Total USD                                                       |              | 10 851 157.93                                           | 0.60             |
| 固定利付ノート合計                                                       |              | 10 851 157.93                                           | 0.60             |
| 固定利付債券                                                          |              |                                                         |                  |
| EUR                                                             |              |                                                         |                  |
| EUR PANTHER BF AGGR 2/PANTHER FIN CO-REG-S 4.37500% 19-15.05.26 | 4 160 000.00 | 4 300 458.24                                            | 0.24             |
| Total EUR                                                       |              | 4 300 458.24                                            | 0.24             |
| 固定利付債券合計                                                        |              | 4 300 458.24                                            | 0.24             |
| 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                           |              | 15 151 616.17                                           | 0.84             |

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）  
2021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<br>ユーロ<br>先物 / 為替予約契約 /<br>スワップに係る<br>未実現損益<br>(注1) | 純資産<br>割合<br>(%) |
|----|---------|---------------------------------------------------------|------------------|
|----|---------|---------------------------------------------------------|------------------|

最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品

固定利付ノート

|           |                                               |              |              |      |
|-----------|-----------------------------------------------|--------------|--------------|------|
| USD       |                                               |              |              |      |
| USD       | CINEMARK USA INC-144A 5.87500% 21-15.03.26    | 1 960 000.00 | 1 708 097.84 | 0.09 |
| USD       | COINBASE GLOBAL INC-144A 3.62500% 21-01.10.31 | 900 000.00   | 738 222.10   | 0.04 |
| USD       | SEASPAN CORP-144A 5.50000% 21-01.08.29        | 4 050 000.00 | 3 565 202.12 | 0.20 |
| Total USD |                                               |              | 6 011 522.06 | 0.33 |

|           |  |  |              |      |
|-----------|--|--|--------------|------|
| 固定利付ノート合計 |  |  | 6 011 522.06 | 0.33 |
|-----------|--|--|--------------|------|

|                              |  |  |              |      |
|------------------------------|--|--|--------------|------|
| 最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計 |  |  | 6 011 522.06 | 0.33 |
|------------------------------|--|--|--------------|------|

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 | 6 213.04 | 61 191 544.95 | 3.38 |
| アイルランド合計 |                                               |          | 61 191 544.95 | 3.38 |

|           |                                                 |          |               |      |
|-----------|-------------------------------------------------|----------|---------------|------|
| ルクセンブルグ   |                                                 |          |               |      |
| USD       | UBS (LUX) BOND SICAV - ASIAN HIGH YIELD U-X-ACC | 1 659.00 | 16 780 456.84 | 0.93 |
| ルクセンブルグ合計 |                                                 |          | 16 780 456.84 | 0.93 |

|                  |  |  |               |      |
|------------------|--|--|---------------|------|
| 投資信託、オープン・エンド型合計 |  |  | 77 972 001.79 | 4.31 |
|------------------|--|--|---------------|------|

|                                                            |  |  |               |      |
|------------------------------------------------------------|--|--|---------------|------|
| 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 |  |  | 77 972 001.79 | 4.31 |
|------------------------------------------------------------|--|--|---------------|------|

|          |  |  |                  |       |
|----------|--|--|------------------|-------|
| 投資有価証券合計 |  |  | 1 709 440 054.15 | 94.39 |
|----------|--|--|------------------|-------|

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                | ICE/ITRX.EUROPE.34-V1 CDI PAYER 1.00000% 20-20.12.30        | -105 200 000.00 | -2 056 508.05 | -0.11 |
| EUR                | JPMORGAN/TKAGR CREDIT DEFAULT SWAP PAY 1.00000% 20-20.12.25 | -10 000 000.00  | 388 813.00    | 0.02  |
| EUR                | ICE/MARKIT ITRX EUR CDI PAY 5.00000% 20-20.12.25            | -9 866 600.00   | -1 206 266.84 | -0.07 |
| EUR                | ICE/ITRX.EUROPE.34-V1 CDI REC 1.00000% 20-20.12.25          | 200 000 000.00  | 5 323 711.12  | 0.29  |
| EUR                | JPMORGAN/TKAGR CREDIT DEFAULT SWAP REC 1.00000% 20-20.12.22 | 23 000 000.00   | 7 394.50      | 0.00  |
| EUR                | JPMORGAN/VMED CREDIT DEFAULT SWAP REC 5.00000% 21-20.06.26  | 10 000 000.00   | 1 203 587.24  | 0.07  |
| クレジット・デフォルト・スワップ合計 |                                                             |                 | 3 660 730.97  | 0.20  |

|                                              |  |  |              |      |
|----------------------------------------------|--|--|--------------|------|
| 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 |  |  | 3 660 730.97 | 0.20 |
|----------------------------------------------|--|--|--------------|------|

|        |  |  |              |      |
|--------|--|--|--------------|------|
| 派生商品合計 |  |  | 3 660 730.97 | 0.20 |
|--------|--|--|--------------|------|

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

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）  
2021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<br>ユーロ<br>先物 / 為替予約契約 /<br>スワップに係る<br>未実現損益<br>(注 1) | 純資産<br>割合<br>( % )      |
|--------------------------------|------------------|------|----------------|----------------------------------------------------------|-------------------------|
| 為替予約契約                         |                  |      |                |                                                          |                         |
| 購入通貨                           | 購入額              | 売却通貨 | 売却額            | 満期日                                                      |                         |
| ZAR                            | 16 774 300.00    | EUR  | 938 185.52     | 5.10.2021                                                | 23 842.04 0.00          |
| EUR                            | 13 228.40        | ZAR  | 231 100.00     | 5.10.2021                                                | -25.48 0.00             |
| ZAR                            | 324 100.00       | EUR  | 18 936.35      | 5.10.2021                                                | -348.80 0.00            |
| CNH                            | 106 448 800.00   | EUR  | 13 979 949.65  | 22.10.2021                                               | 222 710.86 0.01         |
| JPY                            | 3 732 769 600.00 | EUR  | 28 827 498.67  | 22.10.2021                                               | 32 116.33 0.00          |
| HKD                            | 142 701 100.00   | EUR  | 15 642 722.96  | 22.10.2021                                               | 169 080.51 0.01         |
| CNH                            | 1 848 900.00     | EUR  | 242 334.24     | 22.10.2021                                               | 4 350.54 0.00           |
| AUD                            | 79 355 100.00    | EUR  | 49 204 744.93  | 22.10.2021                                               | 240 621.06 0.01         |
| CAD                            | 30 019 600.00    | EUR  | 20 045 274.08  | 22.10.2021                                               | 392 389.39 0.02         |
| CHF                            | 33 009 700.00    | EUR  | 30 392 092.86  | 22.10.2021                                               | 144 119.88 0.01         |
| EUR                            | 167 864 424.39   | GBP  | 144 010 000.00 | 22.10.2021                                               | 380 930.94 0.02         |
| SGD                            | 64 638 300.00    | EUR  | 40 766 035.65  | 22.10.2021                                               | 298 355.57 0.02         |
| GBP                            | 19 886 800.00    | EUR  | 23 180 933.51  | 22.10.2021                                               | -52 603.97 0.00         |
| EUR                            | 125 643 594.38   | USD  | 147 490 000.00 | 22.10.2021                                               | -1 568 322.87 -0.09     |
| USD                            | 520 882 700.00   | EUR  | 443 728 894.70 | 22.10.2021                                               | 5 538 763.66 0.31       |
| JPY                            | 40 906 900.00    | EUR  | 319 074.84     | 22.10.2021                                               | -2 806.36 0.00          |
| EUR                            | 507 774.04       | SGD  | 805 700.00     | 22.10.2021                                               | -4 083.17 0.00          |
| USD                            | 5 890 400.00     | EUR  | 5 021 837.97   | 27.10.2021                                               | 58 214.96 0.00          |
| EUR                            | 11 302.60        | ZAR  | 199 100.00     | 5.10.2021                                                | -116.04 0.00            |
| JPY                            | 58 917 700.00    | EUR  | 453 074.68     | 22.10.2021                                               | 2 442.89 0.00           |
| ZAR                            | 16 668 200.00    | EUR  | 951 774.02     | 5.10.2021                                                | 4 168.57 0.00           |
| EUR                            | 951 774.02       | ZAR  | 16 668 200.00  | 5.10.2021                                                | -4 168.57 0.00          |
| JPY                            | 47 137 400.00    | EUR  | 365 363.83     | 22.10.2021                                               | -924.72 0.00            |
| 為替予約契約合計                       |                  |      |                |                                                          | 5 878 707.22 0.32       |
| 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 |                  |      |                |                                                          | 60 420 026.57 3.34      |
| 当座借越およびその他の短期負債                |                  |      |                |                                                          | -2 466 040.64 -0.14     |
| その他の資産および負債                    |                  |      |                |                                                          | 34 169 782.27 1.89      |
| 純資産合計                          |                  |      |                |                                                          | 1 811 103 260.54 100.00 |

注記は、財務書類と不可分のものである。

## U B S（Lux）ボンド・ファンド - オーストラリア・ドル

## 最も重要な数字

|                                              | ISIN         | 30.9.2021      | 31.3.2021      | 31.3.2020      |
|----------------------------------------------|--------------|----------------|----------------|----------------|
| 純資産額、オーストラリア・ドル                              |              | 399 149 941.67 | 382 900 537.66 | 341 435 681.63 |
| クラス P - a c c 受益証券                           | LU0035338325 |                |                |                |
| 発行済受益証券                                      |              | 300 789.2020   | 294 461.4790   | 287 487.7960   |
| 受益証券 1 口当たりの純資産価格、オーストラリア・ドル                 |              | 562.43         | 554.17         | 566.20         |
| 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 <sup>1</sup> |              | 562.43         | 554.17         | 567.05         |
| クラス P - d i s t 受益証券                         | LU0035338242 |                |                |                |
| 発行済受益証券                                      |              | 693 257.3280   | 683 458.3790   | 764 457.5380   |
| 受益証券 1 口当たりの純資産価格、オーストラリア・ドル                 |              | 118.66         | 119.04         | 124.80         |
| 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 <sup>1</sup> |              | 118.66         | 119.04         | 124.99         |

<sup>1</sup> 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 | 77.30  | 国債および中央政府債       | 27.56  |
| アメリカ合衆国 | 7.07   | 公益、非営利団体         | 18.37  |
| ノルウェー   | 3.66   | 金融および持株会社        | 14.17  |
| イギリス    | 2.80   | 銀行およびその他の金融機関    | 12.31  |
| ドイツ     | 2.65   | 国際機関             | 5.23   |
| 国際機関    | 1.81   | 通信               | 3.63   |
| スイス     | 1.16   | モーゲージおよび貸付機関     | 3.39   |
| フィリピン   | 0.66   | その他の非分類会社        | 3.30   |
| 日本      | 0.48   | 地方債              | 3.22   |
| カナダ     | 0.31   | 交通および運輸          | 1.40   |
| 合計      | 97.90  | 小売業および百貨店        | 1.17   |
|         |        | 宿泊、ケータリングおよび娯楽施設 | 0.95   |
|         |        | エネルギーおよび水道       | 0.86   |
|         |        | ヘルスケアおよび社会福祉     | 0.75   |
|         |        | 化学               | 0.63   |
|         |        | 石油               | 0.40   |
|         |        | 市および地方自治体        | 0.33   |
|         |        | 電気機器および部品        | 0.22   |
|         |        | 航空宇宙産業           | 0.01   |
|         |        | 合計               | 97.90  |

## U B S（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         | 30.9.2021      | 31.3.2021      | 31.3.2020      |
|---------------------------------------|--------------|----------------|----------------|----------------|
| 純資産額、ユーロ                              |              | 211 729 759.56 | 217 572 340.82 | 202 290 809.89 |
| クラス P - a c c 受益証券                    | LU0033050237 |                |                |                |
| 発行済受益証券                               |              | 270 775.8360   | 286 619.8160   | 287 108.4080   |
| 受益証券 1 口当たりの純資産価格、ユーロ                 |              | 449.94         | 447.97         | 404.54         |
| 受益証券 1 口当たり発行および買戻価格、ユーロ <sup>1</sup> |              | 449.94         | 447.97         | 401.71         |
| クラス P - d i s t 受益証券                  | LU0033049577 |                |                |                |
| 発行済受益証券                               |              | 301 068.5760   | 311 310.6320   | 329 176.9000   |
| 受益証券 1 口当たりの純資産価格、ユーロ                 |              | 142.92         | 144.27         | 132.57         |
| 受益証券 1 口当たり発行および買戻価格、ユーロ <sup>1</sup> |              | 142.92         | 144.27         | 131.64         |

<sup>1</sup> 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    | 10.41  | 国債および中央政府債                      | 46.94  |
| ニュージーランド   | 9.83   | 銀行およびその他の金融機関                   | 12.42  |
| フランス       | 8.93   | 金融および持株会社                       | 10.41  |
| イタリア       | 7.64   | 投資信託                            | 3.87   |
| ルクセンブルグ    | 7.54   | モーゲージおよび貸付機関                    | 3.66   |
| オランダ       | 6.80   | 国際機関                            | 3.52   |
| スペイン       | 6.58   | 通信                              | 2.11   |
| ドイツ        | 5.57   | エネルギーおよび水道                      | 2.00   |
| イギリス       | 3.98   | 交通および運輸                         | 1.41   |
| メキシコ       | 2.21   | タバコおよびアルコール飲料                   | 1.31   |
| アイルランド     | 2.06   | 不動産                             | 1.15   |
| ポルトガル      | 1.87   | 電気機器および部品                       | 0.90   |
| ベルギー       | 1.87   | 公益、非営利団体                        | 0.87   |
| スロベニア      | 1.86   | コンピューター・ハードウェアおよびネットワーク設備プロバイダー | 0.86   |
| オーストラリア    | 1.65   | 石油                              | 0.84   |
| 南アフリカ      | 1.56   | 保険                              | 0.70   |
| ロシア連邦(CIS) | 1.56   | インターネット、ソフトウェアおよびITサービス         | 0.65   |
| オーストリア     | 1.51   | 自動車                             | 0.57   |
| ギリシャ       | 1.13   | 各種サービス                          | 0.56   |
| 国際機関       | 0.97   | その他の非分類会社                       | 0.50   |
| コスタリカ      | 0.63   | 小売業および百貨店                       | 0.43   |
| ルーマニア      | 0.60   | 医薬品、化粧品および医療製品                  | 0.39   |
| ケイマン諸島     | 0.56   | 化学                              | 0.32   |
| スウェーデン     | 0.52   | 機械工学および産業機器                     | 0.20   |
| スイス        | 0.50   | ヘルスケアおよび社会福祉                    | 0.15   |
| ウクライナ      | 0.50   | 繊維、衣類および革製品                     | 0.14   |
| ベネズエラ      | 0.48   | 包装業                             | 0.09   |
| インド        | 0.45   | 環境サービスおよびリサイクル                  | 0.09   |
| ポーランド      | 0.43   | 合計                              | 97.06  |
| 日本         | 0.42   |                                 |        |
| カザフスタン     | 0.42   |                                 |        |
| スロバキア      | 0.40   |                                 |        |
| トルコ        | 0.39   |                                 |        |
| ペルー        | 0.38   |                                 |        |
| サウジアラビア    | 0.34   |                                 |        |
| チリ         | 0.33   |                                 |        |
| オマーン       | 0.31   |                                 |        |
| インドネシア     | 0.29   |                                 |        |
| ウルグアイ      | 0.29   |                                 |        |
| ブラジル       | 0.24   |                                 |        |
| フィリピン      | 0.24   |                                 |        |
| 香港         | 0.24   |                                 |        |
| モンゴル国      | 0.23   |                                 |        |
| モロッコ       | 0.23   |                                 |        |
| コロンビア      | 0.22   |                                 |        |
| ノルウェー      | 0.21   |                                 |        |
| 中国         | 0.20   |                                 |        |
| ブルガリア      | 0.19   |                                 |        |
| フィンランド     | 0.19   |                                 |        |
| エジプト       | 0.18   |                                 |        |
| デンマーク      | 0.18   |                                 |        |
| グアテマラ      | 0.18   |                                 |        |
| バミューダ      | 0.13   |                                 |        |
| アルゼンチン     | 0.12   |                                 |        |
| ジャージー島     | 0.12   |                                 |        |
| エクアドル      | 0.10   |                                 |        |
| カナダ        | 0.09   |                                 |        |
| 合計         | 97.06  |                                 |        |

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

## 最も重要な数字

|                                       | ISIN         | 30.9.2021      | 31.3.2021      | 31.3.2020      |
|---------------------------------------|--------------|----------------|----------------|----------------|
| 純資産額、米ドル                              |              | 699 666 791.25 | 670 960 500.68 | 239 902 499.64 |
| クラス P - a c c 受益証券                    | LU0464244333 |                |                |                |
| 発行済受益証券                               |              | 292 382.1520   | 316 817.3310   | 308 150.1680   |
| 受益証券 1 口当たりの純資産価格、米ドル                 |              | 166.17         | 168.13         | 153.78         |
| 受益証券 1 口当たり発行および買戻価格、米ドル <sup>1</sup> |              | 167.00         | 168.13         | 152.63         |

<sup>1</sup> 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        | 15.97  | 金融および持株会社                  | 26.58  |
| ケイマン諸島    | 15.84  | 銀行およびその他の金融機関              | 15.74  |
| 英領ヴァージン諸島 | 9.89   | 不動産                        | 11.00  |
| 中国        | 7.74   | 投資信託                       | 7.31   |
| シンガポール    | 6.88   | 国債および中央政府債                 | 4.38   |
| フィリピン     | 5.22   | 建築業および資材                   | 4.14   |
| ルクセンブルグ   | 4.98   | インターネット、ソフトウェアおよび I T サービス | 3.88   |
| 韓国        | 4.92   | エネルギーおよび水道                 | 3.13   |
| 日本        | 3.29   | 石油                         | 2.50   |
| インド       | 3.20   | 各種貿易会社                     | 1.83   |
| インドネシア    | 2.63   | 食品および清涼飲料                  | 1.12   |
| マレーシア     | 1.79   | その他の非分類会社                  | 1.11   |
| タイ        | 1.49   | 化学                         | 1.08   |
| パキスタン     | 0.85   | 各種サービス                     | 1.01   |
| ベトナム      | 0.79   | 交通および運輸                    | 0.93   |
| アメリカ合衆国   | 0.75   | 鉱業、石炭採掘および鉄鋼業              | 0.91   |
| イギリス      | 0.74   | 保険                         | 0.88   |
| アイルランド    | 0.61   | 市および地方自治体                  | 0.70   |
| フランス      | 0.54   | 宿泊、ケータリングおよび娯楽施設           | 0.50   |
| マカオ       | 0.40   | 通信                         | 0.28   |
| スリランカ     | 0.27   | 機械工学および産業機器                | 0.22   |
| モーリシャス    | 0.19   | グラフィック・デザイン、出版およびメディア      | 0.15   |
| メキシコ      | 0.16   | 電子および半導体                   | 0.02   |
| オランダ      | 0.12   | 合計                         | 89.40  |
| モンゴル国     | 0.07   |                            |        |
| チリ        | 0.07   |                            |        |
| 合計        | 89.40  |                            |        |

## 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         | 30.9.2021        | 31.3.2021        | 31.3.2020        |
|---------------------------------------|--------------|------------------|------------------|------------------|
| 純資産額、ユーロ                              |              | 1 811 103 260.54 | 1 730 167 720.42 | 1 597 048 818.93 |
| クラス P - a c c 受益証券                    | LU0086177085 |                  |                  |                  |
| 発行済受益証券                               |              | 893 933.2630     | 942 986.0270     | 1 089 353.0640   |
| 受益証券 1 口当たりの純資産価格、ユーロ                 |              | 226.27           | 222.72           | 182.68           |
| 受益証券 1 口当たり発行および買戻価格、ユーロ <sup>1</sup> |              | 226.27           | 222.72           | 183.90           |
| 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                               |              | 355 695.5630     | 360 809.2340     | 345 389.5480     |
| 受益証券 1 口当たりの純資産価格、米ドル                 |              | 148.00           | 145.21           | 117.54           |
| 受益証券 1 口当たり発行および買戻価格、米ドル <sup>1</sup> |              | 148.00           | 145.21           | 118.33           |
| クラス P - m d i s t 受益証券                | LU0417441200 |                  |                  |                  |
| 発行済受益証券                               |              | 952 773.0260     | 942 819.8360     | 1 081 839.6340   |
| 受益証券 1 口当たりの純資産価格、ユーロ                 |              | 128.41           | 129.33           | 111.15           |
| 受益証券 1 口当たり発行および買戻価格、ユーロ <sup>1</sup> |              | 128.41           | 129.33           | 111.89           |
| 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                               |              | 2 714 937.0440   | 2 960 617.9170   | 3 282 339.2430   |
| 受益証券 1 口当たりの純資産価格、米ドル                 |              | 91.57            | 92.28            | 79.39            |
| 受益証券 1 口当たり発行および買戻価格、米ドル <sup>1</sup> |              | 91.57            | 92.28            | 79.92            |

<sup>1</sup> 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% |
|---------|--------|---------------------------|--------|
| ルクセンブルグ | 13.35  | 金融および持株会社                 | 39.15  |
| イギリス    | 12.43  | 銀行およびその他の金融機関             | 7.99   |
| フランス    | 11.38  | 通信                        | 6.59   |
| アメリカ合衆国 | 10.15  | 交通および運輸                   | 5.16   |
| ドイツ     | 10.02  | 投資信託                      | 4.51   |
| イタリア    | 9.63   | 各種サービス                    | 3.55   |
| オランダ    | 9.03   | 石油                        | 3.47   |
| アイルランド  | 4.38   | インターネット、ソフトウェアおよび IT サービス | 3.42   |
| デンマーク   | 2.29   | 自動車                       | 2.90   |
| スペイン    | 2.24   | ヘルスケアおよび社会福祉              | 2.37   |
| スウェーデン  | 2.00   | 宿泊、ケータリングおよび娯楽施設          | 2.17   |
| メキシコ    | 1.21   | 医薬品、化粧品および医療製品            | 2.08   |
| 日本      | 0.91   | エネルギーおよび水道                | 1.79   |
| ジャージー島  | 0.77   | 不動産                       | 1.35   |
| パナマ     | 0.75   | 小売業および百貨店                 | 0.88   |
| ギリシャ    | 0.58   | 包装業                       | 0.83   |
| ベルギー    | 0.51   | 機械工学および産業機器               | 0.78   |
| チェコ共和国  | 0.48   | 食品および清涼飲料                 | 0.76   |
| ノルウェー   | 0.43   | 繊維、衣類および革製品               | 0.71   |
| ブルガリア   | 0.36   | 保険                        | 0.63   |
| フィンランド  | 0.29   | 航空宇宙産業                    | 0.52   |
| スイス     | 0.29   | 各種貿易会社                    | 0.52   |
| シンガポール  | 0.25   | その他の非分類会社                 | 0.49   |
| ポルトガル   | 0.23   | 鉱業、石炭採掘および鉄鋼業             | 0.43   |
| オーストリア  | 0.23   | 化学                        | 0.36   |
| マーシャル諸島 | 0.20   | 農業および漁業                   | 0.32   |
| 合計      | 94.39  | 各種消費財                     | 0.31   |
|         |        | 電気機器および部品                 | 0.21   |
|         |        | 建築業および資材                  | 0.14   |
|         |        | 合計                        | 94.39  |

[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17億円）は、1株2,000ユーロ（263,160円）の株式6,500株によって表章される。2021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17億円）は、1株2,000ユーロ（265,540円）の株式6,500株によって表章される。2021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、2021年6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<br>投資信託／投資法人 | <u>359</u> | <u>543,959,650.32</u> オーストラリア・ドル |
|         |                        |            | <u>209,347,146.60</u> カナダ・ドル     |
|         |                        |            | <u>15,051,174,683.69</u> スイス・フラン |
|         |                        |            | <u>15,052,508,692.48</u> 中国元     |
|         |                        |            | <u>586,473,953.83</u> デンマーク・クローネ |
|         |                        |            | <u>44,816,671,727.98</u> ユーロ     |
|         |                        |            | <u>1,623,491,064.68</u> 英ポンド     |
|         |                        |            | <u>261,974,421.63</u> 香港ドル       |
|         |                        |            | <u>13,115,538,283.86</u> 日本円     |
|         |                        |            | <u>62,970,203.18</u> シンガポール・ドル   |
|         |                        |            | <u>144,409,869,174.58</u> 米ドル    |
| アイルランド  | オープン・エンド型<br>投資信託／投資法人 | <u>46</u>  | <u>459,023,033.40</u> オーストラリア・ドル |
|         |                        |            | <u>212,016,174.52</u> スイス・フラン    |
|         |                        |            | <u>2,504,596,615.64</u> ユーロ      |
|         |                        |            | <u>2,178,667,586.79</u> 英ポンド     |
|         |                        |            | <u>1,828,952,933.98</u> 日本円      |
|         |                        |            | <u>32,256,102,571.79</u> 米ドル     |

&lt;訂正後&gt;

（前略）

管理会社は、2021年10月末日現在、以下のとおり、413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<br>投資信託／投資法人 | 358 | 525,267,508.99オーストラリア・ドル |
|         |                        |     | 4,035,623,964.78カナダ・ドル   |
|         |                        |     | 15,939,481,967.47スイス・フラン |
|         |                        |     | 23,442,624,179.62中国元     |
|         |                        |     | 584,072,715.31デンマーク・クローネ |
|         |                        |     | 54,863,012,036.04ユーロ     |
|         |                        |     | 1,890,934,608.34英ポンド     |
|         |                        |     | 330,146,198.38香港ドル       |
|         |                        |     | 600,942,737,579.66日本円    |
|         |                        |     | 64,233,315.61シンガポール・ドル   |
|         |                        |     | 147,342,670,115.15米ドル    |
| アイルランド  | オープン・エンド型<br>投資信託／投資法人 | 55  | 459,487,792.02オーストラリア・ドル |
|         |                        |     | 230,659,063.00スイス・フラン    |
|         |                        |     | 2,654,910,390.47ユーロ      |
|         |                        |     | 2,391,676,201.14英ポンド     |
|         |                        |     | 3,785,114,769.00日本円      |
|         |                        |     | 35,762,870,298.63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、2021年10月29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＝132.77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。

## U B S 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

2021年6月30日現在

|                           | 2021年6月30日     |            | 2020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                    | 0.00           | 0          | 0.00           | 0          |
| ．無形資産                     | 0.00           | 0          | 0.00           | 0          |
| 1．開発費                     | 0.00           | 0          | 0.00           | 0          |
| 3．有価約因として取得された<br>範囲内ののれん | 0.00           | 0          | 0.00           | 0          |
| 4．事前支払額および無形資産仮勘定         | 0.00           | 0          | 0.00           | 0          |
| ．有形資産                     | 0.00           | 0          | 0.00           | 0          |
| 1．土地および建物                 | 0.00           | 0          | 0.00           | 0          |
| 2．工場および機械                 | 0.00           | 0          | 0.00           | 0          |
| 3．その他の什器・備品、器具<br>および機器   | 0.00           | 0          | 0.00           | 0          |
| 4．事前支払額および建設仮勘定           | 0.00           | 0          | 0.00           | 0          |
| D．流動資産                    | 125,906,732.72 | 16,716,637 | 150,504,776.98 | 19,982,519 |
| ．棚卸資産                     | 0.00           | 0          | 0.00           | 0          |
| ．債権                       | 42,299,059.04  | 5,616,046  | 70,553,446.59  | 9,367,381  |
| 1．売掛金                     | 36,042,758.41  | 4,785,397  | 66,274,187.00  | 8,799,224  |
| a) 1年以内に期限到来              | 36,042,758.41  | 4,785,397  | 66,274,187.00  | 8,799,224  |
| 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              | 6,256,300.63   | 830,649    | 4,279,259.59   | 568,157    |
| a) 1年以内に期限到来              | 6,256,300.63   | 830,649    | 4,279,259.59   | 568,157    |
| 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<br>関連会社に対する債権 | 0.00           | 0          | 0.00           | 0          |
| 4．その他の債権                  | 0.00           | 0          | 0.00           | 0          |
| ．投資                       | 151,825.10     | 20,158     | 135,958.09     | 18,051     |
| 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                  | 151,825.10     | 20,158     | 135,958.09     | 18,051     |
| ．銀行預金および手元現金              | 83,455,848.58  | 11,080,433 | 79,815,372.30  | 10,597,087 |
| E．前払金                     | 922,824.66     | 122,523    | 803,078.59     | 106,625    |
| 資産合計                      | 126,829,557.38 | 16,839,160 | 151,307,855.57 | 20,089,144 |

|                                   | 2021年 6 月30日   |            | 2020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                       | 49,049,201.26  | 6,512,262  | 58,254,861.36  | 7,734,498  |
| ．払込資本金                            | 13,000,000.00  | 1,726,010  | 13,000,000.00  | 1,726,010  |
| ．資本剰余金                            | 0.00           | 0          | 0.00           | 0          |
| ．再評価積立金                           | 0.00           | 0          | 0.00           | 0          |
| ．準備金                              | 8,080,095.00   | 1,072,794  | 8,132,000.00   | 1,079,686  |
| 1．法定準備金                           | 1,300,000.00   | 172,601    | 1,300,000.00   | 172,601    |
| 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<br>その他の準備金           | 6,780,095.00   | 900,193    | 6,832,000.00   | 907,085    |
| a) その他の分配可能準備金                    | 150,000.00     | 19,916     | 150,000.00     | 19,916     |
| b) その他の分配不能準備金                    | 6,630,095.00   | 880,278    | 6,682,000.00   | 887,169    |
| ．繰越損益                             | 74,766.35      | 9,927      | 88,076.96      | 11,694     |
| ．当期損益                             | 27,894,339.91  | 3,703,532  | 37,034,784.40  | 4,917,108  |
| ．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                             | 11,846,442.32  | 1,572,852  | 6,524,967.44   | 866,320    |
| 1．年金および類似の債務に対する<br>引当金           | 0.00           | 0          | 0.00           | 0          |
| 2．納税引当金                           | 11,846,442.32  | 1,572,852  | 6,524,967.44   | 866,320    |
| 3．その他の引当金                         | 0.00           | 0          | 0.00           | 0          |
| C．債務                              | 65,933,913.80  | 8,754,046  | 86,528,026.77  | 11,488,326 |
| 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<br>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                      | 41,518,574.60  | 5,512,421  | 63,085,553.87  | 8,375,869  |
| a) 1年以内に期限到来                      | 41,518,574.60  | 5,512,421  | 63,085,553.87  | 8,375,869  |
| 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<br>関連会社に対する債務         | 0.00           | 0          | 0.00           | 0          |
| 8．その他の債務                          | 24,415,339.20  | 3,241,625  | 23,442,472.90  | 3,112,457  |
| a) 税金債務                           | 778,392.93     | 103,347    | 296,271.62     | 39,336     |
| b) 社会保障債務                         | 397,882.90     | 52,827     | 292,677.00     | 38,859     |
| c) その他の債務                         | 23,239,063.37  | 3,085,450  | 22,853,524.28  | 3,034,262  |
| ) 1年以内に期限到来                       | 23,239,063.37  | 3,085,450  | 22,853,524.28  | 3,034,262  |
| ) 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                    | 126,829,557.38 | 16,839,160 | 151,307,855.57 | 20,089,144 |

## U B S 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

2021年6月30日に終了した期間および2020年12月31日に終了した年度

|                                      | 2021年1月1日から<br>2021年6月30日まで |            | 2020年1月1日から<br>2020年12月31日まで |             |
|--------------------------------------|-----------------------------|------------|------------------------------|-------------|
|                                      | ユーロ                         | 千円         | ユーロ                          | 千円          |
| 1. 純取引高                              | 506,612,975.90              | 67,263,005 | 913,618,565.25               | 121,301,137 |
| 4. その他の営業収益                          | 953,193.15                  | 126,555    | 891,978.12                   | 118,428     |
| 5. 原材料および消耗品ならびに<br>その他の外部費用         | 457,561,850.00              | 60,750,487 | 835,859,572.29               | 110,977,075 |
| 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                          | 457,561,850.00              | 60,750,487 | 835,859,572.29               | 110,977,075 |
| 6. 人件費                               | 5,154,790.13                | 684,401    | 8,935,419.16                 | 1,186,356   |
| a) 賃金および給与                           | 4,564,286.59                | 606,000    | 7,744,027.92                 | 1,028,175   |
| b) 社会保障費                             | 583,062.69                  | 77,413     | 1,150,277.79                 | 152,722     |
| ) 年金に関連するもの                          | 435,656.39                  | 57,842     | 788,476.22                   | 104,686     |
| ) その他の社会保障費                          | 147,406.30                  | 19,571     | 361,801.57                   | 48,036      |
| c) その他の人件費                           | 7,440.85                    | 988        | 41,113.45                    | 5,459       |
| 7. 評価額調整                             | 0.00                        | 0          | 5,657,735.30                 | 751,178     |
| a) 創業費ならびに有形固定資産および<br>無形固定資産に関連するもの | 0.00                        | 0          | 5,657,735.30                 | 751,178     |
| 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                          | 7,476,226.85                | 992,619    | 3,138,703.64                 | 416,726     |
| 11. その他の受取利息および類似収益                  | 2.04                        | 0          | 31,877.98                    | 4,232       |
| a) 関連会社に関連するもの                       | 2.04                        | 0          | 31,877.98                    | 4,232       |
| b) その他の受取利息および類似収益                   | 0.00                        | 0          | 0.00                         | 0           |
| 14. 支払利息および類似費用                      | 201,351.42                  | 26,733     | 13,206,480.15                | 1,753,424   |
| a) 関連会社に関連するもの                       | 152,054.64                  | 20,188     | 13,103,305.07                | 1,739,726   |
| b) その他の支払利息および類似費用                   | 49,296.78                   | 6,545      | 103,175.08                   | 13,699      |
| 15. 損益にかかる税金                         | 9,277,612.78                | 1,231,789  | 10,709,726.41                | 1,421,930   |
| 16. 税引後損益                            | 27,894,339.91               | 3,703,532  | 37,034,784.40                | 4,917,108   |
| 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                             | 27,894,339.91               | 3,703,532  | 37,034,784.40                | 4,917,108   |