

【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4年12月23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
ジェフリー・ラーン（Geoffrey Lahaye）
ヘッド・オブ・レギュラトリー・コンプライアンス
ステファニー・ミネット（Stephanie Minet）

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

【代理人の氏名又は名称】 弁護士 三 浦 健
弁護士 大 西 信 治

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

【事務連絡者氏名】 弁護士 三 浦 健
弁護士 大 西 信 治

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

【電話番号】 03（6212）8316

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

【届出の対象とした募集（売出）外国投資信託受益証券の金額】
UBS（Lux）ボンド・ファンド - オーストラリア・ドル
（UBS（Lux）Bond Fund-AUD）
クラスP - d i s t 受益証券
15億9,735万オーストラリア・ドル（約1,500億円）
クラスP - a c c 受益証券
35億3,318万オーストラリア・ドル（約3,318億円）
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
9億8,872万ユーロ（約1,411億円）
クラスP - a c c 受益証券
15億5,632万ユーロ（約2,220億円）

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

6億9,565万アメリカ合衆国ドル（約951億円）

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）

11億664万アメリカ合衆国ドル（約1,513億円）

クラスP - m d i s t 受益証券（米ドル・ヘッジ）

6億6,064万アメリカ合衆国ドル（約903億円）

クラスP - a c c 受益証券

16億8,240万ユーロ（約2,400億円）

クラスP - m d i s t 受益証券

9億2,624万ユーロ（約1,321億円）

（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、2022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＝93.90円、1ユーロ＝142.67円、1米ドル＝136.68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、2022年8月31日付をもって提出した有価証券届出書（2022年9月22日付および2022年9月30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19億円）は、1株2,000ユーロ（285,340円）の株式6,500株によって表章される。2022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19億円）は、1株2,000ユーロ（295,180円）の株式6,500株によって表章される。2022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、2022年10月31日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1ユーロ＝147.59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）

（2022年10月末日現在）

資産の種類	国・地域名	時価合計 (オーストラリア・ドル)	投資比率 (%)
債券	オーストラリア	248,608,839.20	73.49
	米国	24,041,712.00	7.11
	ノルウェー	9,626,448.00	2.85
	ドイツ	8,940,036.00	2.64
	イギリス	6,864,873.00	2.03
	国際機関	5,415,502.00	1.60
	カナダ	4,334,176.00	1.28
	スイス	4,117,106.00	1.22
	フィリピン	2,750,272.00	0.81
	ルクセンブルグ	2,687,076.00	0.79
	小計	317,386,040.20	93.82
モーゲージ担保証券 / 資産担保証券 / その他割引債	オーストラリア	2,095,997.21	0.62
投資有価証券合計		319,482,037.41	94.44
現金・その他の資産（負債控除後）		18,805,709.14	5.56
合計 (純資産総額)		338,287,746.55 (約32,154百万円)	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。）およびスイス・フランの円貨換算は、2022年10月31日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1豪ドル＝95.05円、1ユーロ＝147.59円、1米ドル＝148.26円、1スイス・フラン＝148.72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）

（2022年10月末日現在）

資産の種類	国・地域名	時価合計 (ユーロ)	投資比率 (%)
債券	フランス	14,202,106.75	9.98
	ドイツ	13,843,342.48	9.73
	ニュージーランド	11,252,626.63	7.91
	米国	9,790,034.90	6.88
	スペイン	8,535,297.87	6.00
	イタリア	8,330,834.55	5.85
	オランダ	8,124,202.94	5.71
	イギリス	5,707,703.87	4.01
	ルクセンブルグ	5,075,972.69	3.57
	ベルギー	3,743,492.40	2.63
	ポルトガル	3,322,918.00	2.34
	スロベニア	2,600,234.50	1.83
	オーストラリア	2,405,346.78	1.69
	ロシア連邦	2,103,107.36	1.48
	ギリシャ	2,075,344.70	1.46
	オーストリア	2,016,038.32	1.42
	国際機関	1,706,292.68	1.20
	ブラジル	1,403,048.53	0.99
	スイス	1,108,276.46	0.78
	デンマーク	1,058,236.00	0.74
	ベネズエラ	903,849.00	0.64
	コスタリカ	806,293.31	0.57
	アイルランド	785,256.35	0.55
	トルコ	762,704.20	0.54
	ルーマニア	737,768.75	0.52
	カザフスタン	704,150.00	0.49
	スロバキア	659,632.00	0.46
	ケイマン諸島	595,708.91	0.42
	ペルー	585,812.50	0.41
	ポーランド	528,792.50	0.37
	インド	524,319.95	0.37
	チリ	509,162.50	0.36
	モンゴル	471,682.60	0.33
	フィリピン	427,906.25	0.30
	ノルウェー	404,386.70	0.28
	コロンビア	361,492.64	0.25
	フィンランド	311,564.41	0.22
	ブルガリア	294,123.75	0.21

	インドネシア	289,075.00	0.20
	中国	277,682.25	0.20
	日本	265,923.18	0.19
	スウェーデン	248,804.05	0.17
	エジプト	240,500.00	0.17
	エクアドル	148,195.71	0.10
	メキシコ	135,600.00	0.10
	アルゼンチン	131,434.27	0.09
	チェコ共和国	126,361.20	0.09
	ジャージー	106,357.32	0.07
	バミューダ	99,461.00	0.07
	小計	120,848,458.71	84.92
投資信託	ルクセンブルグ	5,931,350.91	4.17
モーゲージ担保证券 / 資産担保证券 / その他割引債	米国	6,918,065.58	4.86
投資有価証券合計		133,697,875.20	93.95
現金・その他の資産（負債控除後）		8,610,728.06	6.05
合計 （純資産総額）		142,308,603.26 (約21,003百万円)	100.00

（アジア・フレキシブル（米ドル））

（2022年10月末日現在）

資産の種類	国・地域名	時価合計 (米ドル)	投資比率 (%)
債券	ケイマン諸島	45,469,861.23	13.48
	英領ヴァージン諸島	33,189,812.30	9.84
	香港	30,585,086.16	9.07
	韓国	28,987,636.87	8.59
	シンガポール	26,252,834.65	7.78
	インド	18,357,455.25	5.44
	インドネシア	18,203,290.13	5.40
	フィリピン	17,152,778.75	5.09
	中国	15,508,949.96	4.60
	タイ	9,237,083.62	2.74
	イギリス	6,658,530.16	1.97
	米国	4,768,666.83	1.41
	日本	4,310,312.93	1.28
	フランス	3,024,080.80	0.90
	モーリシャス	1,922,665.63	0.57
	マカオ	1,922,513.67	0.57
	マレーシア	1,788,323.75	0.53
	メキシコ	1,064,112.50	0.32
	ベトナム	834,300.00	0.25
	パキスタン	817,047.00	0.24
	マン島	701,396.87	0.21
	スリランカ	620,181.25	0.18
	オランダ	605,731.43	0.18
	モンゴル	533,533.00	0.16
	チリ	371,888.00	0.11
	ジャージー	169,743.75	0.05
	小計	273,057,816.49	80.95
投資信託	ルクセンブルグ	19,067,822.60	5.65
	香港	10,055,546.82	2.98
	小計	29,123,369.42	8.63
短期金融商品	米国	9,870,272.20	2.93
投資有価証券合計		312,051,458.11	92.52
現金・その他の資産（負債控除後）		25,245,029.99	7.48
合計 （純資産総額）		337,296,488.10 (約50,008百万円)	100.00

（ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ））

（2022年10月末日現在）

資産の種類	国・地域名	時価合計 (ユーロ)	投資比率 (%)
債券	フランス	172,413,663.96	14.75
	ルクセンブルグ	156,767,597.09	13.41
	ドイツ	118,344,263.47	10.12
	イギリス	117,308,001.51	10.04
	オランダ	117,278,448.46	10.03
	イタリア	100,303,809.08	8.58
	米国	65,001,583.43	5.56
	スペイン	52,404,490.81	4.48
	デンマーク	42,316,764.87	3.62
	スウェーデン	33,802,813.89	2.89
	ポルトガル	17,498,099.80	1.50
	アイルランド	16,127,799.80	1.38
	ベルギー	14,905,281.10	1.28
	日本	14,460,168.43	1.24
	パナマ	13,984,636.80	1.20
	ノルウェー	11,736,925.42	1.00
	フィンランド	10,921,233.95	0.93
	スイス	10,637,119.38	0.91
	チェコ共和国	8,672,642.50	0.74
	ギリシャ	7,417,326.12	0.63
	ジャージー	7,091,280.00	0.61
	ジブラルタル	5,706,235.00	0.49
	イスラエル	2,504,613.12	0.21
	小計	1,117,604,797.99	95.61
投資信託	アイルランド	20,978,500.00	1.79
従来型オプション	イギリス	86,970.00	0.01
投資有価証券合計		1,138,670,267.99	97.42
現金・その他の資産（負債控除後）		30,195,987.33	2.58
合計 （純資産総額）		1,168,866,255.32 (約172,513百万円)	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。

2022年10月末日前１年以内における各月末の純資産の推移は、以下のとおりである。

（オーストラリア・ドル）

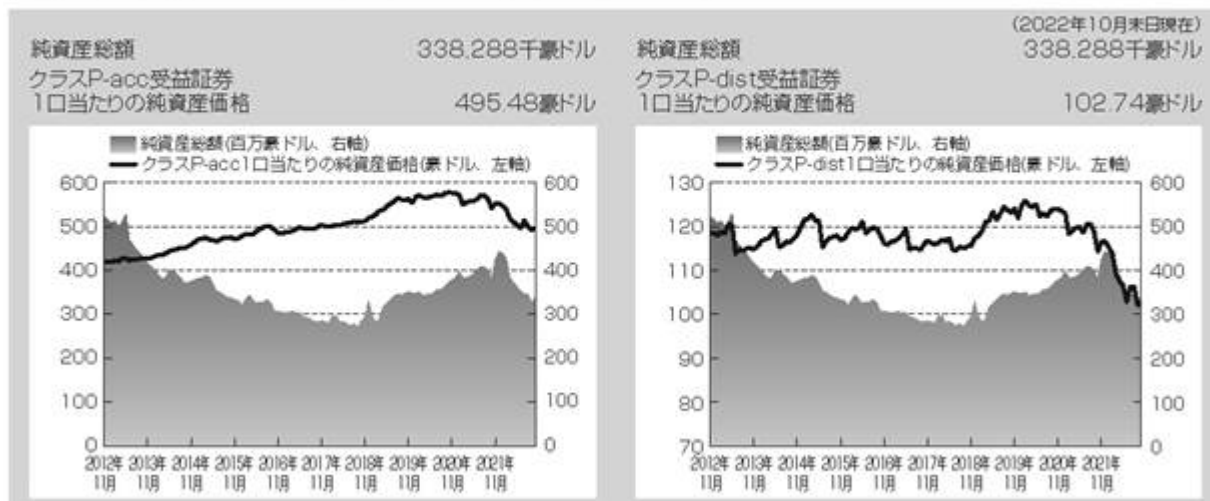
	純資産総額		１口当たり純資産価格		
	千豪ドル	百万円	受益証券の クラス	豪ドル	円
2021年11月末日	422,989	40,205	P - d i s t P - a c c	116.47 552.04	11,070 52,471
12月末日	441,921	42,005	P - d i s t P - a c c	116.65 552.91	11,088 52,554
2022年 1 月末日	437,498	41,584	P - d i s t P - a c c	115.29 546.46	10,958 51,941
2 月末日	427,587	40,642	P - d i s t P - a c c	113.81 539.46	10,818 51,276
3 月末日	381,372	36,249	P - d i s t P - a c c	109.36 518.32	10,395 49,266
4 月末日	372,761	35,431	P - d i s t P - a c c	107.61 510.04	10,228 48,479
5 月末日	360,922	34,306	P - d i s t P - a c c	106.49 504.74	10,122 47,976
6 月末日	352,090	33,466	P - d i s t P - a c c	102.81 495.79	9,772 47,125
7 月末日	346,326	32,918	P - d i s t P - a c c	106.35 512.87	10,109 48,748
8 月末日	346,117	32,898	P - d i s t P - a c c	103.64 499.81	9,851 47,507
9 月末日	323,661	30,764	P - d i s t P - a c c	102.11 492.42	9,706 46,805
10月末日	338,288	32,154	P - d i s t P - a c c	102.74 495.48	9,765 47,095

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

（注２）１口当たりの純資産価格は日本で販売しているクラスのみ記載している。以下同じ。

< 参考情報 >

純資産総額および1口当たりの純資産価格の推移



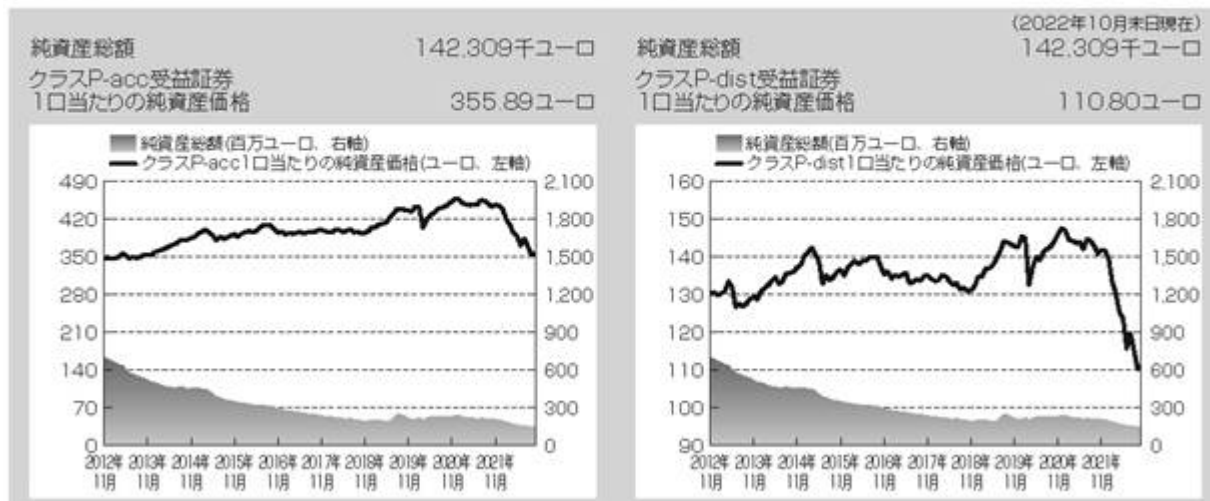
サブ・ファンドの運用実績は、あくまで過去の実績であり将来の運用成果を約束するものではない。

（ユーロ・フレキシブル）

	純資産総額		1口当たり純資産価格		
	千ユーロ	百万円	受益証券の クラス	ユーロ	円
2021年11月末日	206,299	30,448	P - d i s t P - a c c	141.96 446.91	20,952 65,959
12月末日	204,134	30,128	P - d i s t P - a c c	141.65 445.93	20,906 65,815
2022年 1 月末日	195,111	28,796	P - d i s t P - a c c	139.58 439.42	20,601 64,854
2 月末日	184,117	27,174	P - d i s t P - a c c	133.39 419.93	19,687 61,977
3 月末日	177,741	26,233	P - d i s t P - a c c	130.35 410.37	19,238 60,567
4 月末日	168,407	24,855	P - d i s t P - a c c	125.27 394.36	18,489 58,204
5 月末日	164,787	24,321	P - d i s t P - a c c	123.59 389.08	18,241 57,424
6 月末日	154,829	22,851	P - d i s t P - a c c	115.63 371.43	17,066 54,819
7 月末日	159,538	23,546	P - d i s t P - a c c	119.79 384.78	17,680 56,790
8 月末日	151,140	22,307	P - d i s t P - a c c	115.06 369.58	16,982 54,546
9 月末日	143,038	21,111	P - d i s t P - a c c	110.27 354.20	16,275 52,276
10月末日	142,309	21,003	P - d i s t P - a c c	110.80 355.89	16,353 52,526

< 参考情報 >

純資産総額および1口当たりの純資産価格の推移



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

（アジア・フレキシブル（米ドル））

	純資産総額		1口当たり純資産価格		
	千米ドル	百万円	受益証券の クラス	米ドル	円
2021年11月末日	712,527	105,639	P - a c c	160.38	23,778
12月末日	746,710	110,707	P - a c c	159.74	23,683
2022年1月末日	700,110	103,798	P - a c c	154.59	22,920
2月末日	651,992	96,664	P - a c c	148.71	22,048
3月末日	611,977	90,732	P - a c c	144.49	21,422
4月末日	553,727	82,096	P - a c c	141.26	20,943
5月末日	529,345	78,481	P - a c c	139.13	20,627
6月末日	468,136	69,406	P - a c c	134.49	19,939
7月末日	433,774	64,311	P - a c c	133.41	19,779
8月末日	428,141	63,476	P - a c c	133.32	19,766
9月末日	399,722	59,263	P - a c c	127.77	18,943
10月末日	337,296	50,008	P - a c c	121.75	18,051

< 参考情報 >

純資産総額および1口当たりの純資産価格の推移



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

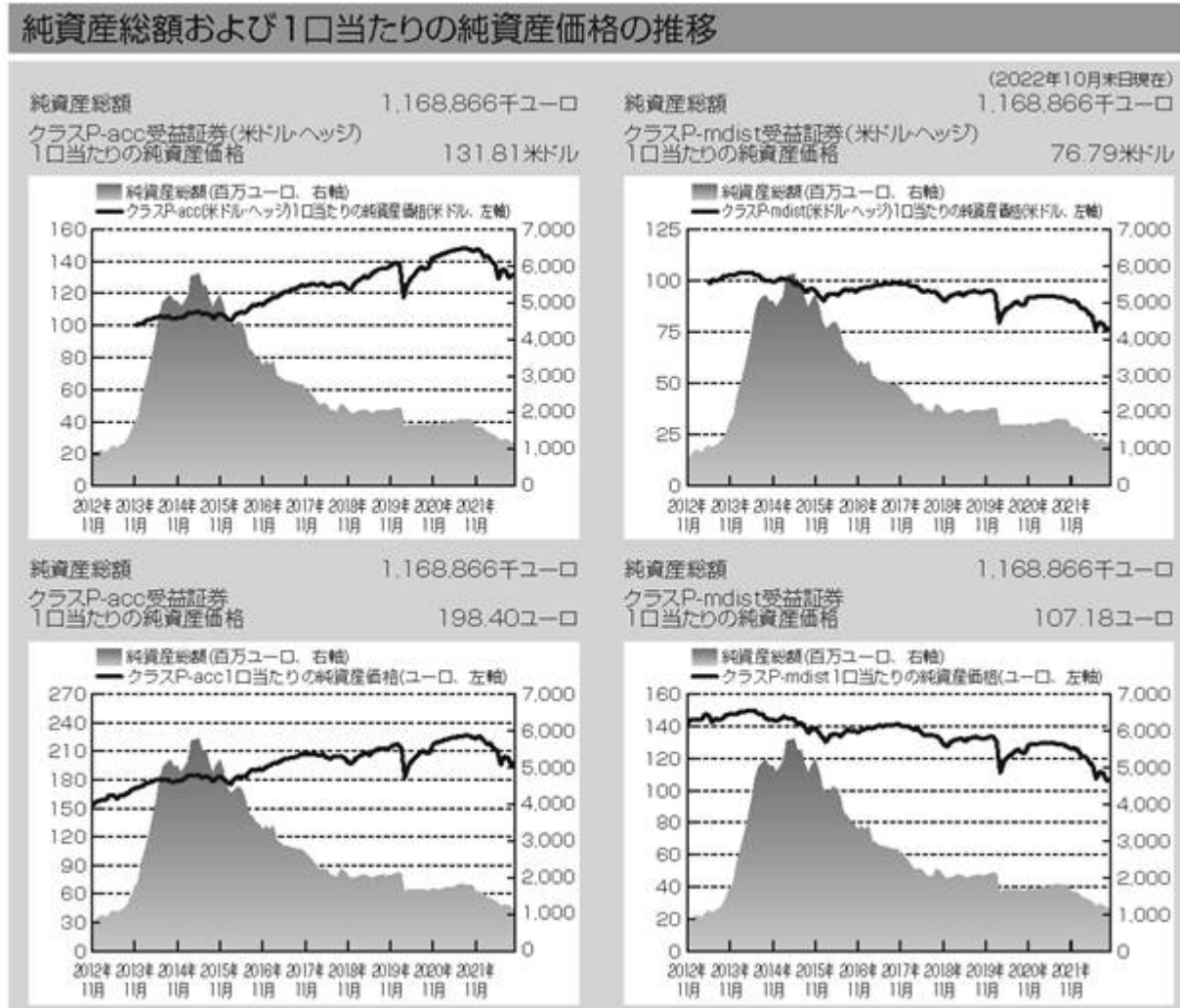
（ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ））

	純資産総額		1口当たり純資産価格		
	千ユーロ	百万円	受益証券の クラス		円
2021年11月末日	1,609,213	237,504	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	146.26米ドル	21,685
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	89.70米ドル	13,299
			P - a c c	223.49ユーロ	32,985
			P - m d i s t	125.89ユーロ	18,580
12月末日	1,611,102	237,783	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	147.92米ドル	21,931
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	90.33米ドル	13,392
			P - a c c	225.69ユーロ	33,310
			P - m d i s t	126.66ユーロ	18,694
2022年 1 月末日	1,578,956	233,038	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	146.07米ドル	21,656
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	88.81米ドル	13,167
			P - a c c	222.76ユーロ	32,877
			P - m d i s t	124.54ユーロ	18,381
2 月末日	1,467,921	216,650	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	142.69米ドル	21,155
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	86.37米ドル	12,805
			P - a c c	217.55ユーロ	32,108
			P - m d i s t	121.16ユーロ	17,882
3 月末日	1,431,122	211,219	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	143.32米ドル	21,249
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	86.36米ドル	12,804
			P - a c c	218.27ユーロ	32,214
			P - m d i s t	121.09ユーロ	17,872
4 月末日	1,393,639	205,687	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	139.98米ドル	20,753
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	83.98米ドル	12,451
			P - a c c	213.14ユーロ	31,457
			P - m d i s t	117.79ユーロ	17,385
5 月末日	1,325,344	195,608	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	138.33米ドル	20,509
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	82.58米ドル	12,243
			P - a c c	210.30ユーロ	31,038
			P - m d i s t	115.78ユーロ	17,088

	純資産総額		1口当たり純資産価格		
	千ユーロ	百万円	受益証券の クラス		円
6月末日	1,213,611	179,117	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	129.12米ドル	19,143
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	76.69米ドル	11,370
			P - a c c	196.06ユーロ	28,936
			P - m d i s t	107.52ユーロ	15,869
7月末日	1,267,924	187,133	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	134.86米ドル	19,994
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	79.72米ドル	11,819
			P - a c c	204.35ユーロ	30,160
			P - m d i s t	111.65ユーロ	16,478
8月末日	1,257,852	185,646	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	134.27米ドル	19,907
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	78.99米ドル	11,711
			P - a c c	203.10ユーロ	29,976
			P - m d i s t	110.56ユーロ	16,318
9月末日	1,166,256	172,128	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	129.59米ドル	19,213
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	75.87米ドル	11,248
			P - a c c	195.52ユーロ	28,857
			P - m d i s t	106.03ユーロ	15,649
10月末日	1,168,866	172,513	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	131.81米ドル	19,542
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	76.79米ドル	11,385
			P - a c c	198.40ユーロ	29,282
			P - m d i s t	107.18ユーロ	15,819

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

< 参考情報 >



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

分配の推移

分配の推移については、以下の内容が原届出書に追加されます。

(オーストラリア・ドル) (クラスP - d i s t 受益証券)

期間	1口当たりの分配金額(豪ドル)
第33会計年度	1.82 (約173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33会計年度	2.45 (約362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）
2021年10月	0.39 （約58円）
11月	0.39 （約58円）
12月	0.39 （約58円）
2022年 1 月	0.39 （約58円）
2 月	0.38 （約56円）
3 月	0.38 （約56円）
4 月	0.41 （約61円）
5 月	0.40 （約59円）
6 月	0.37 （約55円）
7 月	0.39 （約58円）
8 月	0.38 （約56円）
9 月	0.37 （約55円）
直近 1 年累計	4.64 （約688円）
設定来累計	55.82 （約8,276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）
2021年10月	0.48 （約71円）
11月	0.47 （約69円）
12月	0.48 （約71円）
2022年 1 月	0.47 （約69円）
2 月	0.46 （約68円）
3 月	0.46 （約68円）
4 月	0.44 （約65円）
5 月	0.44 （約65円）
6 月	0.40 （約59円）
7 月	0.42 （約62円）
8 月	0.42 （約62円）
9 月	0.40 （約59円）
直近 1 年累計	5.34 （約788円）
設定来累計	101.45 （約14,973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。

2022年10月末日前1年間における収益率の推移は、以下のとおりである。

	収益率（％）（注1）	
	クラスP - d i s t 受益証券	クラスP - a c c 受益証券
（オーストラリア・ドル）	- 8.49	- 8.51
（ユーロ・フレキシブル）	- 19.61	- 19.75
（アジア・フレキシブル（米ドル））	-	- 24.32

（ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ））

収益率（％）			
クラスP - a c c 受益証券 （米ドル・ヘッジ）	クラスP - m d i s t 受益証券 （米ドル・ヘッジ）	クラスP - a c c 受益証券	クラスP - m d i s t 受益証券
- 10.41	- 10.13	- 11.74	- 11.47

（注1）収益率（％）＝ $100 \times (a - b) / b$

a = 2022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。

2022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2022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	16,921.7610 (0)	135,613.6200 (0)	569,393.3990 (3,956)
P - a c c	46,805.5570 (0)	50,231.6010 (267)	294,646.5830 (1,411)

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

一方、（ ）の上段の数字は約定日を基準として算出している。以下同じ。

（ユーロ・フレキシブル）

	販売口数	買戻し口数	発行済口数
P - d i s t	12,532.6430 (0)	28,943.0520 (0)	279,908.8510 (854)
P - a c c	3,666.4710 (0)	38,752.3990 (66)	233,526.2170 (563.3610)

（アジア・フレキシブル（米ドル））

	販売口数	買戻し口数	発行済口数
P - a c c	15,736.8420 (0)	80,654.8500 (5,971.2180)	225,006.3380 (14,847.5980)

（ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ））

	販売口数	買戻し口数	発行済口数
P - a c c (米ドル・ヘッジ)	210,874.3700 (0)	308,272.2230 (0)	263,558.5830 (23,828.2160)
P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	116,465.7320 (0)	718,975.6990 (0)	2,088,231.6530 (45,627.9300)
P - a c c	38,744.0340 (0)	230,512.2010 (999.3400)	695,869.5980 (20,134.8190)
P - m d i s t	62,003.8900 (0)	287,805.7610 (0)	699,322.6170 (6,236.4340)

[次へ](#)

第3 ファンドの経理状況

1 財務諸表

以下の中間財務書類が追加されます。

a. ファンドの日本語の中間財務書類は、ルクセンブルグにおける諸法令および一般に認められた会計原則に準拠して作成された原文の中間財務書類を翻訳したものである。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。

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

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

c. ファンドの原文の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。

d. ファンドの原文の中間財務書類は、オーストラリア・ドル、ユーロおよび米ドルで表示されている。日本語の中間財務書類には、主要な金額について、それぞれ株式会社三菱UFJ銀行の2022年10月31日現在における対顧客電信売買相場の仲値（1オーストラリア・ドル＝95.05円、1ユーロ＝147.59円、1米ドル＝148.26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。

e. 2022年9月30日付で、UBS（Lux）ボンド・ファンド - フルサイクル・アジア・ボンド（米ドル）は、UBS（Lux）ボンド・ファンド - アジア・フレキシブル（米ドル）に名称が変更された。

（１）資産及び負債の状況

U B S（Lux）ボンド・ファンド

純 資 産 計 算 書

2022年 9 月30日現在

	U B S（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	3,324,338,012.60	490,639,047
投資有価証券未実現評価（損）益	(537,472,504.14)	(79,325,567)
投資有価証券合計（注１）	2,786,865,508.46	411,313,480
現金預金、要求払い預金および貯蓄預金	144,366,980.16 *	21,307,123
その他の流動資産（委託証拠金）	12,174,041.33	1,796,767
定期預金および信託預金	6,423,606.07	948,060
有価証券売却未収金（注１）	10,218,960.95	1,508,216
発行受益証券未収金	10,592,254.74	1,563,311
未収有価証券利息	31,995,557.70	4,722,224
流動資産に係る未収利息	6,253.67	923
前払費用	356,414.35	52,603
金融先物に係る未実現利益（注１）	13,202.27	1,949
為替予約契約に係る未実現利益（注１）	8,538,328.53	1,260,172
スワップに係る未実現利益（注１）	3,380,126.53	498,873
資産合計	3,014,931,234.76	444,973,701
負 債		
T B A モーゲージ・バック証券に係る		
未実現損失（注１）	(146,415.62)	(21,609)
金融先物に係る未実現損失（注１）	(4,568,181.76)	(674,218)
為替予約契約に係る未実現損失（注１）	(6,746,503.24)	(995,716)
当座借越	(10,450,744.41)	(1,542,425)
当座借越に係る未払利息	(10,278.85)	(1,517)
その他の流動負債（委託証拠金）	(11,295.37)	(1,667)
有価証券購入未払金（注１）	(9,235,901.33)	(1,363,127)
買戻受益証券未払金	(47,452,916.55)	(7,003,576)
報酬引当金（注２）	(1,869,487.87)	(275,918)
年次税引当金（注３）	(248,160.05)	(36,626)
その他の手数料および報酬に係る引当金（注２）	(591,477.46)	(87,296)
引当金合計	(2,709,125.38)	(399,840)
負債合計	(81,331,362.51)	(12,003,696)
期末現在純資産額	2,933,599,872.25	432,970,005

* 2022年 9 月30日現在、854,867.04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、296,024.09ユーロの現金が取引相手方であるシティバンクに対する担保および126,000.00ユーロの現金が取引相手方であるＪＰモルガンに対する担保となっている。

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S（Lux）ボンド・ファンド

純 資 産 計 算 書

2022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

資 産		
投資有価証券取得原価	360,400,551.59	34,256,072
投資有価証券未実現評価（損）益	(43,826,994.66)	(4,165,756)
投資有価証券合計（注1）	316,573,556.93	30,090,317
その他の流動資産（委託証拠金）	508,468.07	48,330
定期預金および信託預金	9,787,519.54	930,304
有価証券売却未収金（注1）	27,596.76	2,623
発行受益証券未収金	60,429.31	5,744
未収有価証券利息	2,598,149.19	246,954
流動資産に係る未収利息	230.86	22
前払費用	59,563.56	5,662
金融先物に係る未実現利益（注1）	20,116.04	1,912
資産合計	329,635,630.26	31,331,867
負 債		
当座借越	(4,880,483.92)	(463,890)
買戻受益証券未払金	(844,066.29)	(80,229)
報酬引当金（注2）	(167,420.64)	(15,913)
年次税引当金（注3）	(35,100.04)	(3,336)
その他の手数料および報酬に係る引当金（注2）	(47,596.53)	(4,524)
引当金合計	(250,117.21)	(23,774)
負債合計	(5,974,667.42)	(567,892)
期末現在純資産額	323,660,962.84	30,763,975

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

2022年9月30日現在

UBS（Lux）ボンド・ファンド

- ユーロ・フレキシブル

ユーロ 千 円

資 産		
投資有価証券取得原価	164,806,702.00	24,323,821
投資有価証券未実現評価（損）益	(29,870,584.47)	(4,408,600)
投資有価証券合計（注１）	134,936,117.53	19,915,222
現金預金、要求払い預金および貯蓄預金	10,420,467.39 *	1,537,957
その他の流動資産（委託証拠金）	4,040,919.03	596,399
有価証券売却未収金（注１）	15,302.07	2,258
発行受益証券未収金	1,583.61	234
未収有価証券利息	1,229,604.64	181,477
流動資産に係る未収利息	60.53	9
前払費用	36,620.56	5,405
スワップに係る未実現利益（注１）	1,539,259.44	227,179
資産合計	152,219,934.80	22,466,140
負 債		
金融先物に係る未実現損失（注１）	(1,163,197.16)	(171,676)
為替予約契約に係る未実現損失（注１）	(43,686.91)	(6,448)
当座借越	(4,073,705.62)	(601,238)
当座借越に係る未払利息	(23.88)	(3,524)
有価証券購入未払金（注１）	(3,526,917.88)	(520,538)
買戻受益証券未払金	(240,000.97)	(35,422)
報酬引当金（注２）	(98,858.46)	(14,591)
年次税引当金（注３）	(14,807.94)	(2,186)
その他の手数料および報酬に係る引当金（注２）	(21,020.74)	(3,102)
引当金合計	(134,687.14)	(19,878)
負債合計	(9,182,219.56)	(1,355,204)
期末現在純資産額	143,037,715.24	21,110,936

* 2022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370,000.00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

2022年9月30日現在

U B S（Lux）ボンド・ファンド

- アジア・フレキシブル（米ドル）^{*}^{*} 旧名称は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

資 産		
投資有価証券取得原価	482,916,733.49	71,597,235
投資有価証券未実現評価（損）益	(114,816,095.80)	(17,022,634)
投資有価証券合計（注1）	368,100,637.69	54,574,601
現金預金、要求払い預金および貯蓄預金	23,380,521.85 ^{**}	3,466,396
その他の流動資産（委託証拠金）	2,122,608.64	314,698
有価証券売却未収金（注1）	12,225.00	1,812
発行受益証券未収金	9,978,304.01	1,479,383
未収有価証券利息	3,859,958.58	572,277
前払費用	67,252.65	9,971
資産合計	407,521,508.42	60,419,139
負 債		
金融先物に係る未実現損失（注1）	(1,360,587.77)	(201,721)
為替予約契約に係る未実現損失（注1）	(5,300,970.59)	(785,922)
当座借越に係る未払利息	(4.75)	(1)
有価証券購入未払金（注1）	(197,465.11)	(29,276)
買戻受益証券未払金	(636,929.15)	(94,431)
報酬引当金（注2）	(217,082.58)	(32,185)
年次税引当金（注3）	(26,511.63)	(3,931)
その他の手数料および報酬に係る引当金（注2）	(59,462.34)	(8,816)
引当金合計	(303,056.55)	(44,931)
負債合計	(7,799,013.92)	(1,156,282)
期末現在純資産額	399,722,494.50	59,262,857

^{**} 2022年9月30日現在、260,000米ドルの現金が取引相手方であるシティバンクに対する担保となっている。

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS（Lux）ボンド・ファンド

純資産計算書

2022年9月30日現在

	UBS（Lux）ボンド・ファンド	
	- ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）	
	ユーロ	千円
資 産		
投資有価証券取得原価	1,285,087,759.72	189,666,102
投資有価証券未実現評価（損）益	(167,209,105.45)	(24,678,392)
投資有価証券合計（注１）	1,117,878,654.27	164,987,711
現金預金、要求払い預金および貯蓄預金	44,222,845.63 *	6,526,850
有価証券売却未収金（注１）	9,482,818.54	1,399,569
発行受益証券未収金	248,425.02	36,665
未収有価証券利息	19,720,142.82	2,910,496
流動資産に係る未収利息	2,881.17	425
為替予約契約に係る未実現利益（注１）	7,000,351.06	1,033,182
スワップに係る未実現利益（注１）	11,663.84	1,721
資産合計	1,198,567,782.35	176,896,619
負 債		
当座借越	(18,722.06)	(2,763)
当座借越に係る未払利息	(4,760.26)	(703)
有価証券購入未払金（注１）	(4,263,198.99)	(629,206)
買戻受益証券未払金	(26,612,021.12)	(3,927,668)
報酬引当金（注２）	(968,982.35)	(143,012)
年次税引当金（注３）	(115,187.76)	(17,001)
その他の手数料および報酬に係る引当金（注２）	(329,084.19)	(48,570)
引当金合計	(1,413,254.30)	(208,582)
負債合計	(32,311,956.73)	(4,768,922)
期末現在純資産額	1,166,255,825.62	172,127,697

* 2022年9月30日現在、20,000.00ユーロの現金が取引相手方であるＪＰモルガンに対する担保となっている。

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S（Lux）ボンド・ファンド
運 用 計 算 書
自2022年4月1日 至2022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	231,555.43	34,175
有価証券に係る利息	54,720,895.64	8,076,257
配当金	1,197,594.14	176,753
スワップに係る受取利息（注1）	6,681,016.98	986,051
貸付有価証券に係る純収益（注10）	884,337.94	130,519
その他の収益	2,312,173.82	341,254
収益合計	66,027,573.95	9,745,010
費 用		
スワップに係る支払利息（注1）	(5,527,026.03)	(815,734)
報酬（注2）	(12,192,265.03)	(1,799,456)
年次税（注3）	(511,659.73)	(75,516)
その他の手数料および報酬（注2）	(435,761.06)	(64,314)
現金および当座借越に係る利息	(295,900.85)	(43,672)
費用合計	(18,962,612.70)	(2,798,692)
投資に係る純（損）益	47,064,961.25	6,946,318
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	(114,654,077.73)	(16,921,795)
オプションに係る実現（損）益	228,993.28	33,797
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	(159,075.15)	(23,478)
金融先物に係る実現（損）益	(5,598,045.62)	(826,216)
為替予約契約に係る実現（損）益	(6,120,297.50)	(903,295)
スワップに係る実現（損）益	7,856,932.69	1,159,605
外国為替に係る実現（損）益	4,660,316.99	687,816
実現（損）益合計	(113,785,253.04)	(16,793,565)
当期実現純（損）益	(66,720,291.79)	(9,847,248)
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	(241,635,031.06)	(35,662,914)
オプションに係る未実現評価（損）益	589,638.90	87,025
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	(162,374.61)	(23,965)
T B A モーゲージ・バック証券に係る		
未実現評価（損）益	55,126.34	8,136
金融先物に係る未実現評価（損）益	(950,644.95)	(140,306)
為替予約契約に係る未実現評価（損）益	3,684,876.15	543,851
スワップに係る未実現評価（損）益	(5,123,697.05)	(756,206)
未実現評価（損）益の変動合計	(243,542,106.28)	(35,944,379)
運用の結果による純資産の純増（減）	(310,262,398.07)	(45,791,627)

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2022年4月1日 至2022年9月30日

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

収 益		
流動資産に係る利息	7,579.36	720
有価証券に係る利息	4,857,038.99	461,662
貸付有価証券に係る純収益（注10）	9,963.97	947
その他の収益	41,353.76	3,931
収益合計	4,915,936.08	467,260
費 用		
報酬（注2）	(1,072,155.78)	(101,908)
年次税（注3）	(71,908.14)	(6,835)
その他の手数料および報酬（注2）	(46,132.35)	(4,385)
現金および当座借越に係る利息	(211.56)	(20)
費用合計	(1,190,407.83)	(113,148)
投資に係る純（損）益	3,725,528.25	354,111
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	(12,300,706.52)	(1,169,182)
金融先物に係る実現（損）益	515,668.03	49,014
外国為替に係る実現（損）益	(17.62)	(2)
実現（損）益合計	(11,785,056.11)	(1,120,170)
当期実現純（損）益	(8,059,527.86)	(766,058)
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	(10,160,642.67)	(965,769)
金融先物に係る未実現評価（損）益	(214,304.30)	(20,370)
未実現評価（損）益の変動合計	(10,374,946.97)	(986,139)
運用の結果による純資産の純増（減）	(18,434,474.83)	(1,752,197)

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2022年4月1日 至2022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	19,249.35	2,841
有価証券に係る利息	1,932,442.64	285,209
配当金	278,560.14	41,113
スワップに係る受取利息（注1）	2,109,678.86	311,368
貸付有価証券に係る純収益（注10）	43,482.84	6,418
その他の収益	2,052.06	303
収益合計	4,385,465.89	647,251
費 用		
スワップに係る支払利息（注1）	(1,825,025.98)	(269,356)
報酬（注2）	(649,642.57)	(95,881)
年次税（注3）	(30,805.41)	(4,547)
その他の手数料および報酬（注2）	(20,889.96)	(3,083)
現金および当座借越に係る利息	(89,898.77)	(13,268)
費用合計	(2,616,262.69)	(386,134)
投資に係る純（損）益	1,769,203.20	261,117
実現（損）益（注1）		
オプション無し時価評価		
有価証券に係る実現（損）益	(1,953,225.48)	(288,277)
オプションに係る実現（損）益	42,274.50	6,239
金融先物に係る実現（損）益	(2,205,088.50)	(325,449)
為替予約契約に係る実現（損）益	(5,190,367.04)	(766,046)
スワップに係る実現（損）益	4,075,494.21	601,502
外国為替に係る実現（損）益	1,387,378.37	204,763
実現（損）益合計	(3,843,533.94)	(567,267)
当期実現純（損）益	(2,074,330.74)	(306,150)
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	(19,152,347.25)	(2,826,695)
オプションに係る未実現評価（損）益	(38,945.50)	(5,748)
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	(19,146.02)	(2,826)
金融先物に係る未実現評価（損）益	374,171.36	55,224
為替予約契約に係る未実現評価（損）益	527,543.35	77,860
スワップに係る未実現評価（損）益	(3,033,583.33)	(447,727)
未実現評価（損）益の変動合計	(21,342,307.39)	(3,149,911)
運用の結果による純資産の純増（減）	(23,416,638.13)	(3,456,062)

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2022年4月1日 至2022年9月30日

U B S（Lux）ボンド・ファンド
- アジア・フレキシブル（米ドル）^{*}

^{*} 旧名称は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	89,803.77	13,314
有価証券に係る利息	7,828,171.57	1,160,605
貸付有価証券に係る純収益（注10）	137,418.16	20,374
その他の収益	748,688.74	111,001
収益合計	8,804,082.24	1,305,293
費 用		
報酬（注2）	(1,521,498.17)	(225,577)
年次税（注3）	(57,139.46)	(8,471)
その他の手数料および報酬（注2）	(62,814.71)	(9,313)
現金および当座借越に係る利息	(3,020.55)	(448)
費用合計	(1,644,472.89)	(243,810)
投資に係る純（損）益	7,159,609.35	1,061,484
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	(52,714,718.70)	(7,815,484)
金融先物に係る実現（損）益	(4,203,449.91)	(623,203)
為替予約契約に係る実現（損）益	(38,616,856.33)	(5,725,335)
外国為替に係る実現（損）益	11,309,124.73	1,676,691
実現（損）益合計	(84,225,900.21)	(12,487,332)
当期実現純（損）益	(77,066,290.86)	(11,425,848)
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	(8,249,213.29)	(1,223,028)
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	17,788.00	2,637
金融先物に係る未実現評価（損）益	104,537.36	15,499
為替予約契約に係る未実現評価（損）益	(6,775,007.47)	(1,004,463)
未実現評価（損）益の変動合計	(14,901,895.40)	(2,209,355)
運用の結果による純資産の純増（減）	(91,968,186.26)	(13,635,203)

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2022年4月1日 至2022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	28,500.90	4,206
有価証券に係る利息	33,054,101.96	4,878,455
配当金	240,815.94	35,542
スワップに係る受取利息（注1）	660,415.79	97,471
貸付有価証券に係る純収益（注10）	625,261.27	92,282
その他の収益	496,813.65	73,325
収益合計	35,105,909.51	5,181,281
費 用		
スワップに係る支払利息（注1）	(92,076.77)	(13,590)
報酬（注2）	(6,223,222.19)	(918,485)
年次税（注3）	(234,064.43)	(34,546)
その他の手数料および報酬（注2）	(169,755.24)	(25,054)
現金および当座借越に係る利息	(52,589.69)	(7,762)
費用合計	(6,771,708.32)	(999,436)
投資に係る純（損）益	28,334,201.19	4,181,845
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	(34,049,501.43)	(5,025,366)
オプションに係る実現（損）益	105,875.00	15,626
為替予約契約に係る実現（損）益	55,588,641.87	8,204,328
スワップに係る実現（損）益	76,999.14	11,364
外国為替に係る実現（損）益	(15,341,177.56)	(2,264,204)
実現（損）益合計	6,380,837.02	941,748
当期実現純（損）益	34,715,038.21	5,123,592
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	(129,049,659.26)	(19,046,439)
オプションに係る未実現評価（損）益	703,065.00	103,765
為替予約契約に係る未実現評価（損）益	9,474,279.76	1,398,309
スワップに係る未実現評価（損）益	(1,166,280.31)	(172,131)
未実現評価（損）益の変動合計	(120,038,594.81)	(17,716,496)
運用の結果による純資産の純増（減）	(85,323,556.60)	(12,592,904)

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2022年4月1日 至2022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	3,728,228,350.35 *	550,249,222
受益証券発行	211,337,721.50	31,191,334
受益証券買戻し	(663,588,777.39)	(97,939,068)
受益証券発行（買戻し）純額合計	(452,251,055.89)	(66,747,733)
支払分配金	(32,115,024.14)	(4,739,856)
純投資（損）益	47,064,961.25	6,946,318
実現（損）益合計	(113,785,253.04)	(16,793,565)
未実現評価（損）益の変動合計	(243,542,106.28)	(35,944,379)
運用の結果による純資産の純増（減）	(310,262,398.07)	(45,791,627)
期末現在純資産額	2,933,599,872.25	432,970,005

* 2022年9月30日の為替レートを使用して計算された。2022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、3,615,928,042.16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2022年4月1日 至2022年9月30日

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
期首現在純資産額	381,371,627.11	36,249,373
受益証券発行	20,739,035.26	1,971,245
受益証券買戻し	(57,197,219.93)	(5,436,596)
受益証券発行（買戻し）純額合計	(36,458,184.67)	(3,465,350)
支払分配金	(2,818,004.77)	(267,851)
純投資（損）益	3,725,528.25	354,111
実現（損）益合計	(11,785,056.11)	(1,120,170)
未実現評価（損）益の変動合計	(10,374,946.97)	(986,139)
運用の結果による純資産の純増（減）	(18,434,474.83)	(1,752,197)
期末現在純資産額	323,660,962.84	30,763,975

発行済受益証券数の変動
自2022年4月1日 至2022年9月30日

クラス	P - a c c	P - d i s t
期首現在発行済受益証券数	324,657.2900	620,597.6220
発行受益証券数	3,169.7610	14,303.7440
買戻受益証券数	(31,343.3780)	(53,739.7200)
期末現在発行済受益証券数	296,483.6730	581,161.6460

年次分配金 ¹				
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	1口当たり金額
P - d i s t	2022年6月1日	2022年6月7日	オーストラリア・ドル	1.82

¹ 注記4を参照のこと。

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S（Lux）ボンド・ファンド
純 資 産 変 動 計 算 書
自2022年4月1日 至2022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
期首現在純資産額	177,740,627.69	26,232,739
受益証券発行	2,851,429.98	420,843
受益証券買戻し	(13,412,307.45)	(1,979,522)
受益証券発行（買戻し）純額合計	(10,560,877.47)	(1,558,680)
支払分配金	(725,396.85)	(107,061)
純投資（損）益	1,769,203.20	261,117
実現（損）益合計	(3,843,533.94)	(567,267)
未実現評価（損）益の変動合計	(21,342,307.39)	(3,149,911)
運用の結果による純資産の純増（減）	(23,416,638.13)	(3,456,062)
期末現在純資産額	143,037,715.24	21,110,936

発行済受益証券数の変動
自2022年4月1日 至2022年9月30日

クラス	P - a c c	P - d i s t
期首現在発行済受益証券数	252,566.4880	290,830.4380
発行受益証券数	1,429.5220	9,161.1100
買戻受益証券数	(17,929.9840)	(18,053.7840)
期末現在発行済受益証券数	236,066.0260	281,937.7640

年次分配金¹

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 - d i s t	2022年6月1日	2022年6月7日	ユーロ	2.45

四半期毎分配金¹

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。				

¹ 注記4を参照のこと。

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S（Lux）ボンド・ファンド
純資産変動計算書
自2022年4月1日至2022年9月30日

U B S（Lux）ボンド・ファンド
- アジア・フレキシブル（米ドル）^{*}

^{*} 旧名称はU B S（Lux）ボンド・ファンド - フルサイクル
ル・アジア・ボンド（米ドル）

	米ドル	千 円
期首現在純資産額	611,977,496.21	90,731,784
受益証券発行	48,008,690.95	7,117,769
受益証券買戻し	(160,776,827.24)	(23,836,772)
受益証券発行（買戻し）純額合計	(112,768,136.29)	(16,719,004)
支払分配金	(7,518,679.16)	(1,114,719)
純投資（損）益	7,159,609.35	1,061,484
実現（損）益合計	(84,225,900.21)	(12,487,332)
未実現評価（損）益の変動合計	(14,901,895.40)	(2,209,355)
運用の結果による純資産の純増（減）	(91,968,186.26)	(13,635,203)
期末現在純資産額	399,722,494.50	59,262,857

発行済受益証券数の変動
自2022年4月1日至2022年9月30日

クラス	P - a c c
期首現在発行済受益証券数	249,429.2450
発行受益証券数	3,159.9510
買戻受益証券数	(22,826.5790)
期末現在発行済受益証券数	229,762.6170

年次分配金¹

U B S（Lux）ボンド・ファンド - アジア・フレキシブル（米ドル）^{*}

権利落ち日	支払日	通貨	1口当たり金額
該当なし。			

月次分配金¹

U B S（Lux）ボンド・ファンド - アジア・フレキシブル（米ドル）^{*}

権利落ち日	支払日	通貨	1口当たり金額
該当なし。			

¹ 注記4を参照のこと。

^{*} 旧名称は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）

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2022年4月1日 至2022年9月30日

	U B S（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ） ユーロ 千 円	
期首現在純資産額	1,431,122,028.59	211,219,300
受益証券発行	62,858,248.58	9,277,249
受益証券買戻し	(224,908,352.83)	(33,194,224)
受益証券発行（買戻し）純額合計	(162,050,104.25)	(23,916,975)
支払分配金	(17,492,542.12)	(2,581,724)
純投資（損）益	28,334,201.19	4,181,845
実現（損）益合計	6,380,837.02	941,748
未実現評価（損）益の変動合計	(120,038,594.81)	(17,716,496)
運用の結果による純資産の純増（減）	(85,323,556.60)	(12,592,904)
期末現在純資産額	1,166,255,825.62	172,127,697

発行済受益証券数の変動
自2022年4月1日 至2022年9月30日

	（米ドル・ヘッジ）		（米ドル・ヘッジ）	
クラス	P - a c c	P - a c c	P - m d i s t	P - m d i s t
期首現在発行済受益証券数	795,564.4730	311,545.3350	793,035.7560	2,485,152.6710
発行受益証券数	13,011.6240	118,918.5680	10,719.2130	37,077.7260
買戻受益証券数	(103,924.5170)	(157,671.3520)	(97,020.8100)	(343,321.2190)
期末現在発行済受益証券数	704,651.5800	272,792.5510	706,734.1590	2,178,909.1780

年次分配金¹

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¹

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 - m d i s t	2022年4月19日	2022年4月22日	ユーロ	0.46
P - m d i s t	2022年5月16日	2022年5月19日	ユーロ	0.44
P - m d i s t	2022年6月15日	2022年6月21日	ユーロ	0.44
P - m d i s t	2022年7月15日	2022年7月20日	ユーロ	0.40
P - m d i s t	2022年8月16日	2022年8月19日	ユーロ	0.42
P - m d i s t	2022年9月15日	2022年9月20日	ユーロ	0.42
（米ドル・ヘッジ）P - m d i s t	2022年4月19日	2022年4月22日	米ドル	0.38
（米ドル・ヘッジ）P - m d i s t	2022年5月16日	2022年5月19日	米ドル	0.41
（米ドル・ヘッジ）P - m d i s t	2022年6月15日	2022年6月21日	米ドル	0.40
（米ドル・ヘッジ）P - m d i s t	2022年7月15日	2022年7月20日	米ドル	0.37
（米ドル・ヘッジ）P - m d i s t	2022年8月16日	2022年8月19日	米ドル	0.39
（米ドル・ヘッジ）P - m d i s t	2022年9月15日	2022年9月20日	米ドル	0.38

¹ 注記4を参照のこと。

注記は、財務書類と不可分のものである。

財務書類に対する注記

注１．重要な会計方針の概要

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

a) 純資産価格の計算

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

b) 評価原則

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

- 証券取引所に上場されていないまたは公開されている他の規制ある市場で取引されていない短期金融商品の価額は、関連するカーブを元に評価される。カーブに基づく評価は、金利および信用スプレッドにより計算される。この過程で以下の原則が適用される。各短期金融商品は、満期までの残存期間にもっとも近い金利が補間される。かかる方法により計算された金利は、原借主の信用力を反映する信用スプレッドを加算することで市場価格に転換される。借主の信用格付けが大幅に変更された場合、かかる信用スプレッドは調整が行われる。
- 外国為替取引によりヘッジされない当該サブ・ファンドの勘定通貨以外の通貨建ての証券、短期金融商品、派生商品およびその他の資産は、当該通貨のルクセンブルグにおける平均為替レート（売買価格の仲値）またはこれが提供されない場合は当該通貨を最も代表する市場におけるレートで評価される。
- 定期預金および信託預金は、これらの額面額に発生利息を付して評価される。
- スワップの価値は、外部サービス・プロバイダーにより計算され、第2次の独立した評価が他の外部サービス・プロバイダーにより提供されている。かかる計算は、イン・フローおよびアウト・フローの両方のすべてのキャッシュ・フローの純現在価値に基づくものである。特定の場合に、内部計算（ブルームバーグにより提供されたモデルおよび市場データに基づく。）および/またはブローカーの報告評価が利用される。評価方法は、該当する有価証券に依拠し、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2022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2022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	=	1.523680	オーストラリア・ドル
1 ユーロ	=	0.964221	スイス・フラン
1 ユーロ	=	0.979650	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。2022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、2,892,689.10スイス・フランである。

n) クロス・サブ・ファンド投資

2022年9月30日現在、UBS（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブルおよびUBS（Lux）ボンド・ファンド - グローバル・フレキシブルは、UBS（Lux）ボンド・ファンドのその他のサブ・ファンドに以下の投資を行った。

UBS（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル	金額（ユーロ）
UBS（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）クラスI - X - A c c 受益証券	12,596.00
合計	12,596.00

UBS（Lux）ボンド・ファンド - グローバル・フレキシブル	金額（スイス・フラン）
UBS（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）クラスI - X - A c c 受益証券	18,217.98
合計	18,217.98

クロス・サブ・ファンド投資の総額は31,490.00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2,933,568,382.25ユーロである。

注2．報酬

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

UBS（Lux）ボンド・ファンド - アジア・フレキシブル（米ドル）^{*}

	上限定率報酬	名称に「ヘッジ」が付く クラス受益証券の 上限定率報酬
名称に「P」が付くクラス受益証券	1.300%	1.350%

^{*} 旧名称は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）ボンド・ファンド - オーストラリア・ドル

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

¹ 上限：0.900% / 実効：0.810%。

UBS（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル

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

U B S（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）

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

U B S（Lux）ボンド・ファンド - グローバル・フレキシブル

	上限定率報酬	名称に「ヘッジ」が付く クラス受益証券の 上限定率報酬
名称に「P」が付くクラス受益証券	1.140%	1.190%

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。

4．管理会社またはその代理人は、投資者に直接リベートを支払うことができる。リベートは、関連する投資者に帰属するコストを削減する役割を果たす。

リベートは、以下の条件で認められる。

- ・管理会社またはその代理人の報酬から支払われるため、サブ・ファンドの資産を追加で毀損しない。
- ・客観的な基準に基づいて付与される。
- ・客観的な基準を同様に満たし、リベートを要求するすべての投資者に対して、同じ範囲で付与される。
- ・リベートが付与されるサービスの質を高め（例えば、資産のより効率的な運用およびサブ・ファンドの清算の可能性の低下をもたらす、ならびに／またはすべての投資者にとっての固定費比例配分率を低下させることにつながるサブ・ファンドのより価値の高い資産に貢献することにより）、すべての投資者がサブ・ファンドの報酬と費用の公正な割合を負担すること。

リベート付与の客観的な基準は、

- ・リベートの対象となるサブ・ファンドの株式クラスにおいて投資者が保有する総資産である。

追加的な基準は、

- ・投資家が保有するUBSの集団投資スキームの総資産および／または
- ・投資者が居住する地域である。

管理会社またはその代理人は、投資者の要請があり次第、当該リベート額を無償で開示するものとする。

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・ジーまたは授權された代理人の一人と別個に締結された契約に基づき、ファンド外で直接課せられる。

クラスI - X 受益証券、クラスK - X 受益証券およびクラスU - X 受益証券の資産運用に関して提供されるサービスに係る費用について、ファンドの管理事務費用（管理会社、管理事務代行会社および保管受託銀行の費用により構成される。）および販売報酬は、投資家と別個に締結された契約に基づき、その権利を有するUBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジーへの補償によりカバーされる。

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

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

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

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

管理会社自らもしくは共同経営または支配または実質的な直接／間接保有を通じて管理会社と関連がある他の会社により直接管理されるかまたは委任により管理されるファンドの受益証券にサブ・ファン

ドが投資する場合、当該対象ファンドの受益証券に関連する発行手数料または買戻手数料を全く請求されないことがある。

ファンドの現行の手数料については、K I I Dで参照することができる。

注３．年次税

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

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

注４．利益分配

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

分配の詳細については、未監査である。

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

分配が実際の収益を受ける権利に対応するよう収益平準化額が計算される。

注５．ソフト・コミッション・アレンジメント

2022年４月１日から2022年９月30日までの期間中、いかなる「ソフト・コミッション・アレンジメント」もUBS（Lux）ボンド・ファンドに代わって締結されておらず、「ソフト・コミッション・アレンジメント」の金額もなかった。

注６．金融先物、オプションおよびスワップに係る契約債務

2022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） ボンド・ファンド	金利に係る金融先物（買い）	金利に係る金融先物（売り）
- ユーロ・フレキシブル	42,653,626.29 ユーロ	- ユーロ
- グローバル・フレキシブル	74,029,502.53 スイス・フラン	- スイス・フラン

UBS（Lux） ボンド・ファンド	債券に係る金融先物（買い）	債券に係る金融先物（売り）
- アジア・フレキシブル（米ドル）*	22,259,367.19 米ドル	13,319,285.62 米ドル
- オーストラリア・ドル	22,369,249.59 オーストラリア・ドル	40,387,058.64 オーストラリア・ドル
- ユーロ・フレキシブル	44,546,437.76 ユーロ	87,100,204.57 ユーロ
- グローバル・フレキシブル	21,328,475.52 スイス・フラン	100,258,721.57 スイス・フラン

* 旧名称はUBS（Lux）ボンド・ファンド - フルサイクル・アジア・ボンド（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) ボンド・ファンド	その他のスワップに係るオプション、 従来型（売り）
- ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）	64,065,000.00 ユーロ

c) スワップ

UBS (Lux) ボンド・ファンド	クレジット・デフォルト・ スワップ（買い）	クレジット・デフォルト・ スワップ（売り）
- ユーロ・フレキシブル	3,263,725.29 ユーロ	9,550,817.21 ユーロ
- ユーロ・ハイ・イールド （ユーロ）	- ユーロ	31,604,869.85 ユーロ
- グローバル・フレキシブル	2,802,753.12 スイス・フラン	2,805,112.50 スイス・フラン

UBS (Lux) ボンド・ファンド	金利に係るスワップおよび フォワード・スワップ（買い）	金利に係るスワップおよび フォワード・スワップ（売り）
- ユーロ・フレキシブル	67,166,213.98 ユーロ	69,272,423.41 ユーロ
- グローバル・フレキシブル	88,113,558.47 スイス・フラン	152,664,041.82 スイス・フラン

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T E R

UBS（Lux）ボンド・ファンド	総経費率（T E R）
- アジア・フレキシブル（米ドル）* クラスP - a c c 受益証券	1.37%
- オーストラリア・ドル クラスP - a c c 受益証券	0.89%
- オーストラリア・ドル クラスP - d i s t 受益証券	0.88%
- ユーロ・フレキシブル クラスP - a c c 受益証券	0.98%
- ユーロ・フレキシブル クラスP - d i s t 受益証券	0.98%
- ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）クラスP - a c c 受益証券	1.33%
- 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%
- グローバル・フレキシブル（米ドル・ヘッジ）クラスP - d i s t 受益証券	1.27%

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

運用期間が12か月に満たないクラス受益証券のT E R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、T E Rに含まれない。

注8．名称変更

以下のとおり名称が変更された。

旧名称	新名称	日付
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）ボンド・ファンド - アジア・フレキシブル（米ドル）	2022年9月30日

注9．準拠法、営業地域および言語

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

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

注10．貸付有価証券

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

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

	2022年9月30日現在の貸付有価証券 からの取引相手方エクスポージャー*		2022年9月30日現在の 担保の内訳（%）		
U B S（Lux）ボンド・ファンド	貸付有価証券の 時価	担保 （ユービーエス・ スイス・エイ・ジー）	株式	債券	現金
- アジア・フレキシブル （米ドル）**	44,168,214.98 米ドル	46,245,564.50 米ドル	44.30	55.70	0.00
- ユーロ・フレキシブル	33,647,093.47 ユーロ	35,229,606.44 ユーロ	44.30	55.70	0.00
- ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）	241,340,210.59 ユーロ	252,691,087.47 ユーロ	44.30	55.70	0.00
- グローバル・フレキシブル	39,268,353.50 スイス・フラン	41,115,249.40 スイス・フラン	44.30	55.70	0.00

* 取引相手方エクスポージャーの価格および為替レートの情報は、2022年9月30日に証券貸付業者から直接入手されるため、2022年9月30日現在の財務書類の作成に使用された終値および為替レートとは異なる場合がある。

** 旧名称は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）

	U B S（Lux）ボンド・ファンド - アジア・フレキシブル（米ドル）*	U B S（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル
貸付証券収益	318,190.17	72,471.40
貸付証券コスト***		
ユービーエス・スイス・エイ・ジー	102,575.90米ドル	23,005.02ユーロ
U B S ヨーロッパ S E ルクセンブルグ支店	24,700.17米ドル	5,983.54ユーロ
純貸付証券収益	190,914.10米ドル	43,482.84ユーロ

	U B S（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）	U B S（Lux）ボンド・ファンド - グローバル・フレキシブル
貸付証券収益	1,042,102.12	98,107.03
貸付証券コスト***		
ユービーエス・スイス・エイ・ジー	329,111.57ユーロ	33,197.18スイス・フラン
U B S ヨーロッパ S E ルクセンブルグ支店	87,729.28ユーロ	6,045.63スイス・フラン
純貸付証券収益	625,261.27ユーロ	58,864.22スイス・フラン

* 旧名称は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）

*** 2022年6月1日より、総収益の30%は有価証券貸付サービス提供者としての役割を担うユービーエス・スイス・エイ・ジーが費用／報酬として受領し、10%は有価証券貸付代理人としての役割を担うU B S ヨーロッパ S E ルクセンブルグ支店が受領する。

（２）投資有価証券明細表等

U B S（Lux）bond・ファンド - オーストラリア・ドル
2022年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

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

公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品

変動利付モーゲージ・バック証券

AUD				
AUD	TRITON BOND TRUST 21 IN RESPECT 1M BBSW+85BP 21-22.10.52	1 000 000.00	589 104.50	0.18
Total AUD			589 104.50	0.18

変動利付モーゲージ・バック証券合計			589 104.50	0.18
-------------------	--	--	------------	------

固定利付ノート

AUD				
AUD	ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.45000% 19-17.01.24	2 800 000.00	2 743 384.00	0.85
AUD	AT&T INC 3.45000% 18-19.09.23	4 400 000.00	4 351 864.00	1.34
AUD	LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 4.75000% 14-06.05.26	4 500 000.00	4 555 080.00	1.41
AUD	NEW SOUTH WALES TREASURY CORP-REG-S 3.00000% 17-20.04.29	2 000 000.00	1 857 840.00	0.57
AUD	NEW SOUTH WALES TREASURY CORP 2.00000% 20-08.03.33	4 300 000.00	3 378 811.00	1.04
AUD	NEW SOUTH WALES TREASURY CORP-REG-S 1.75000% 21-20.03.34	4 400 000.00	3 253 404.00	1.01
AUD	WESTERN AUSTRALIAN TREASURY-REG-S 5.00000% 13-23.07.25	2 900 000.00	2 980 707.00	0.92
Total AUD			23 121 090.00	7.14

固定利付ノート合計			23 121 090.00	7.14
-----------	--	--	---------------	------

変動利付ノート

AUD				
AUD	STANDARD CHARTERED PLC-REG-S 2.900%/VAR 19-28.06.25	3 500 000.00	3 359 860.00	1.04
Total AUD			3 359 860.00	1.04

変動利付ノート合計			3 359 860.00	1.04
-----------	--	--	--------------	------

固定利付ミディアム・ターム・ノート

AUD				
AUD	ASIAN DEVELOPMENT BANK 0.50000% 20-05.05.26	3 400 000.00	2 962 624.00	0.92
AUD	AURIZON NETWORK PTY LTD-REG-S 4.00000% 17-21.06.24	1 000 000.00	981 740.00	0.30
AUD	AURIZON NETWORK PTY LTD 2.90000% 20-02.09.30	2 700 000.00	2 022 516.00	0.62
AUD	AUSGRID FINANCE PTY LTD-REG-S 3.75000% 17-30.10.24	1 900 000.00	1 851 721.00	0.57
AUD	AUSNET SERVICES HOLDINGS PTY LTD 2.60000% 19-31.07.29	500 000.00	395 695.00	0.12
AUD	AUSTRALIAN CAPITAL TERRITORY 2.50000% 16-21.05.26	1 000 000.00	947 120.00	0.29
AUD	BARCLAYS PLC-REG-S 3.25000% 19-26.06.24	2 000 000.00	1 928 460.00	0.60
AUD	EUROPEAN INVESTMENT BANK-REG-S 3.10000% 16-17.08.26	2 800 000.00	2 675 400.00	0.83
AUD	EXPORT FINANCE&INSURANCE CORP 1.46500% 21-18.08.31	2 500 000.00	1 952 250.00	0.60
AUD	GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 3.85000% 19-21.02.23	1 400 000.00	1 398 586.00	0.43
AUD	INCITEC PIVOT LTD 4.30000% 19-18.03.26	2 300 000.00	2 193 165.00	0.68
AUD	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 1.00000% 21-04.08.28	3 500 000.00	2 834 615.00	0.88
AUD	INTERNATIONAL FINANCE CORP-REG-S 3.20000% 16-22.07.26	3 600 000.00	3 455 640.00	1.07
AUD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 3.00000% 16-19.10.26	1 900 000.00	1 801 656.00	0.56
AUD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 3.30000% 18-14.08.28	2 600 000.00	2 423 278.00	0.75
AUD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.50000% 20-18.05.26	5 200 000.00	4 528 888.00	1.40
AUD	KOMMUNALBANKEN AS 0.60000% 20-01.06.26	2 800 000.00	2 431 352.00	0.75
AUD	KOMMUNALBANKEN AS 2.70000% 18-05.09.23	3 600 000.00	3 560 544.00	1.10

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	評価額 オーストラリア・ドル 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
AUD KOMMUNALBANKEN AS 4.50000% 13-17.04.23	3 600 000.00	3 617 604.00	1.12
AUD LANDESKREDITBANK B-WUERTT FOERDBK 4.25000% 14-07.08.25	1 900 000.00	1 887 270.00	0.58
AUD LLOYDS BANKING GROUP 3.65000% 17-20.03.23	1 600 000.00	1 593 216.00	0.49
AUD MACQUARIE BANK LTD-REG-S 1.75000% 19-07.08.24	4 200 000.00	3 965 472.00	1.22
AUD MCDONALD ' S CORP 3.00000% 19-08.03.24	3 600 000.00	3 517 380.00	1.09
AUD NATIONAL HOUSING FINANCE AND INV CORP 2.38000% 19-28.03.29	500 000.00	445 425.00	0.14
AUD NATIONAL HOUSING FINANCE AND INV CORP 1.52000% 19-27.05.30	1 900 000.00	1 541 584.00	0.48
AUD NATIONAL HOUSING FINANCE AND INV CORP 1.41000% 20-29.06.32	1 600 000.00	1 202 064.00	0.37
AUD NEW SOUTH WALES TREASURY CORP 3.00000% 17-20.05.27	4 800 000.00	4 576 800.00	1.41
AUD QANTAS AIRWAYS LTD 3.15000% 21-27.09.28	1 400 000.00	1 167 418.00	0.36
AUD TASMANIAN PUBLIC FINANCE 2.50000% 21-21.01.33	1 600 000.00	1 317 888.00	0.41
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 2.50000% 19-22.10.29	1 300 000.00	1 158 547.00	0.36
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 1.00000% 20-20.11.23	2 600 000.00	2 524 028.00	0.78
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 1.25000% 20-19.11.27	5 400 000.00	4 681 746.00	1.45
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA-REG-S 3.00000% 15-20.10.28	7 900 000.00	7 396 612.00	2.28
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 4.25000% 13-20.12.32	2 300 000.00	2 244 616.00	0.69
AUD VERIZON COMMUNICATIONS INC-REG-S 3.50000% 17-17.02.23	1 100 000.00	1 097 118.00	0.34
AUD WESTERN AUSTRALIAN TREASURY CORP 3.00000% 17-21.10.26	4 300 000.00	4 131 698.00	1.28
AUD WESTERN AUSTRALIAN TREASURY CORP 3.25000% 18-20.07.28	1 800 000.00	1 715 274.00	0.53
AUD WESTPAC BANKING CORP 3.25000% 18-16.11.23	1 000 000.00	987 170.00	0.30
AUD WOOLWORTHS GROUP LTD 2.85000% 19-23.04.24	900 000.00	875 817.00	0.27
AUD WOOLWORTHS LTD-REG _S 1.85000% 21-15.11.27	1 500 000.00	1 267 785.00	0.39
Total AUD		93 257 782.00	28.81
固定利付メディアム・ターム・ノート合計		93 257 782.00	28.81

固定利付債券

AUD			
AUD AUSTRALIA 1.25000% 20-21.05.32	2 200 000.00	1 736 284.00	0.54
AUD AUSTRALIA 4.75000% 11-21.04.27	4 300 000.00	4 493 027.00	1.39
AUD AUSTRALIA-REG-S 0.50000% 20-21.09.26	900 000.00	795 735.00	0.25
AUD AUSTRALIA-REG-S 1.00000% 20-21.12.30	13 100 000.00	10 471 616.00	3.24
AUD AUSTRALIA-REG-S 2.25000% 16-21.05.28	3 500 000.00	3 239 600.00	1.00
AUD AUSTRALIA-REG-S 2.50000% 18-21.05.30	2 300 000.00	2 098 060.00	0.65
AUD AUSTRALIA-REG-S 2.75000% 18-21.05.41	7 700 000.00	6 319 698.00	1.95
AUD AUSTRALIA-REG-S 2.75000% 18-21.11.29	9 300 000.00	8 689 455.00	2.68
AUD AUSTRALIA-REG-S 3.00000% 16-21.03.47	5 800 000.00	4 794 164.00	1.48
AUD AUSTRALIA-REG-S 3.25000% 15-21.06.39	4 300 000.00	3 854 262.00	1.19
AUD AUSTRALIA-REG-S 3.25000% 12-21.04.29	11 000 000.00	10 668 570.00	3.30
AUD AUSTRALIA-REG-S 3.25000% 13-21.04.25	8 900 000.00	8 838 501.00	2.73
AUD AUSTRALIA-REG-S 3.75000% 14-21.04.37	2 300 000.00	2 219 799.00	0.69
AUD AUSTRALIA-REG-S 4.50000% 13-21.04.33	10 200 000.00	10 721 730.00	3.31
AUD AUSTRALIAN CAPITAL TERRITORY 1.75000% 19-23.10.31	1 300 000.00	1 033 591.00	0.32
AUD AUSTRALIAN CAPITAL TERRITORY-REG-S 1.75000% 21-17.05.30	2 900 000.00	2 405 927.00	0.74
AUD NEW SOUTH WALES TREASURY CORP 2.00000% 19-20.03.31	3 600 000.00	2 984 544.00	0.92
AUD NORTHERN TERRITORY CORP 3.50000% 18-21.05.30	900 000.00	843 435.00	0.26
AUD QUEENSLAND TREASURY CORP-REG-S 6.50000% 08-14.03.33	800 000.00	931 248.00	0.29
AUD QUEENSLAND TREASURY CORP-144A-REG-S 4.75000% 14-21.07.25	500 000.00	510 470.00	0.16
AUD QUEENSLAND TREASURY CORP-144A-REG-S 3.25000% 15-21.07.26	4 600 000.00	4 472 626.00	1.38
AUD QUEENSLAND TREASURY CORP-144A-REG-S 1.25000% 20-10.03.31	2 500 000.00	1 949 350.00	0.60
AUD QUEENSLAND TREASURY CORP-144A-REG-S 1.50000% 21-20.08.32	3 300 000.00	2 517 042.00	0.78
AUD SOUTH AUSTRALIAN GOV FIN AUTHOR 1.75000% 21-24.05.34	3 200 000.00	2 346 720.00	0.73
AUD SOUTH AUSTRALIAN GOVERNMENT FIN-REG-S 2.00000% 21-23.05.36	2 200 000.00	1 562 440.00	0.48
AUD SUNCORP-METWAY LTD-REG-S 3.25000% 16-24.08.26	2 000 000.00	1 882 220.00	0.58
AUD TASMANIAN PUBLIC FINANCE CORP 2.00000% 19-24.01.30	2 400 000.00	2 036 424.00	0.63
AUD TASMANIAN PUBLIC FINANCE CORP-REG-S 2.25000% 21-22.01.32	3 200 000.00	2 646 528.00	0.82

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	評価額 オーストラリア・ドル 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 2.25000% 21-15.09.33	3 500 000.00	2 785 020.00	0.86
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 2.00000% 21-17.09.35	2 900 000.00	2 115 376.00	0.65
AUD WESTERN AUSTRALIAN TREASURY CORP-REG-S 2.00000% 19- 24.10.34	3 000 000.00	2 267 370.00	0.70
AUD WESTPAC BANKING CORP-REG-S 5.25000% 13-21.11.23	3 900 000.00	3 936 114.00	1.22
Total AUD		118 166 946.00	36.52
固定利付債券合計		118 166 946.00	36.52

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 238 494 782.50 73.69

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			
AUD TORRENS SERIES TRUST 1M BBSW+60BP 21-09.11.52	2 700 000.00	1 592 394.98	0.49
Total AUD		1 592 394.98	0.49

変動利付モーゲージ・バック証券合計 1 592 394.98 0.49

固定利付ミディアム・ターム・ノート

AUD			
AUD AUSTRALIAN CAPITAL TERRITORY 2.50000% 22-22.10.32	1 400 000.00	1 168 202.00	0.36
AUD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 2.40000% 22-14.01.27	3 500 000.00	3 145 310.00	0.97
AUD COMPUTERSHARE US INC 3.14700% 21-30.11.27	1 100 000.00	976 822.00	0.30
AUD CPIF FINANCE PTY LTD-REG-S 2.48500% 20-28.10.30	900 000.00	678 123.00	0.21
AUD DOWNER GROUP FINANCE PTY 3.70000% 19-29.04.26	2 600 000.00	2 440 204.00	0.75
AUD EDITH COWAN UNIVERSITY 3.00000% 19-11.04.29	1 300 000.00	1 129 063.00	0.35
AUD ENERGY PARTNERSHIP GAS PTY LTD-REG-S 3.64200% 17-11.12.24	1 000 000.00	971 310.00	0.30
AUD GTA FINANCE CO PTY LTD 2.20000% 20-26.08.27	600 000.00	503 712.00	0.16
AUD LANDESKREDITBANK B-WUERTT FOERDERBANK 2.70000% 17- 19.06.23	2 500 000.00	2 476 550.00	0.77
AUD MACQUARIE UNIVERSITY-REG-S 3.50000% 18-07.09.28	990 000.00	899 415.00	0.28
AUD MACQUARIE UNIVERSITY-REG-S 2.25000% 19-22.05.30	2 100 000.00	1 684 452.00	0.52
AUD NBN CO LTD-REG-S 1.00000% 20-03.12.25	7 000 000.00	6 195 070.00	1.91
AUD SUNCORP-METWAY LTD 2.50000% 22-25.01.27	3 300 000.00	2 952 114.00	0.91
AUD UNITED ENERGY LTD-REG-S 3.50000% 16-12.09.23	1 100 000.00	1 090 210.00	0.34
AUD UNIVERSITY OF WOLLONGONG/THE 3.50000% 17-08.12.27	1 200 000.00	1 112 388.00	0.34
AUD VICTORIA POWER NETWORKS FINANCE PTY LTD 2.13200% 21- 21.04.28	1 400 000.00	1 148 840.00	0.36
AUD VIRGIN AUSTRALIA HOLDINGS *DEFAULTED* 8.07500% 19- 05.03.24	500 000.00	22 589.45	0.01
AUD WESTCONNEX FIN CO PTY LTD-REG-S 3.15000% 21-31.03.31	2 600 000.00	2 019 056.00	0.62
AUD WSO FINANCE PTY LTD 4.50000% 17-31.03.27	700 000.00	674 856.00	0.21
AUD WSO FINANCE PTY LTD-REG-S 3.50000% 16-14.07.23	500 000.00	496 850.00	0.15
Total AUD		31 785 136.45	9.82

固定利付ミディアム・ターム・ノート合計 31 785 136.45 9.82

固定利付債券

AUD			
AUD BENDIGO & ADELAIDE BANK LTD LTD 1.70000% 19-06.09.24	4 000 000.00	3 765 160.00	1.16
AUD EXPORT DEVELOPMENT CANADA 2.80000% 18-31.05.23	1 200 000.00	1 192 128.00	0.37
AUD NORTHERN TERRITORY CORP-REG-S 6.00000% 01-15.03.24	800 000.00	822 632.00	0.25
AUD NSW ELECTRICITY NETWORKS FINANCE PTY 2.54300% 20-23.09.30	1 900 000.00	1 434 329.00	0.44
AUD SUNCORP-METWAY LTD 3.00000% 18-13.09.23	3 100 000.00	3 061 343.00	0.95

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	評価額 オーストラリア・ドル 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
AUD UBS AG AUSTRALIA-REG-S 1.10000% 21-26.02.26	4 700 000.00	4 098 165.00	1.27
AUD WESTERN AUSTRALIAN TREASURY CORP 1.50000% 21-22.10.30	3 300 000.00	2 664 618.00	0.82
Total AUD		17 038 375.00	5.26
固定利付債券合計		17 038 375.00	5.26
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		50 415 906.43	15.57
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されていない譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
固定利付ノート			
AUD			
AUD ING BANK (AUSTRALIA) LTD 1.10000% 21-19.08.26	2 400 000.00	2 070 048.00	0.64
Total AUD		2 070 048.00	0.64
固定利付ノート合計		2 070 048.00	0.64
固定利付ミディアム・ターム・ノート			
AUD			
AUD AGI FINANCE PTY LTD-REG-S 1.81520% 20-23.11.28	2 800 000.00	2 196 404.00	0.68
AUD BANK OF QUEENSLAND LTD 1.40000% 21-06.05.26	3 800 000.00	3 310 902.00	1.02
AUD CIP FUNDING PTY LTD 3.02600% 21-16.12.27	1 900 000.00	1 650 378.00	0.51
AUD CPPIB CAPITAL INC-REG-S 4.45000% 22-01.09.27	3 200 000.00	3 148 256.00	0.97
AUD DWPF FINANCE PTY 1.90000% 21-04.08.28	1 500 000.00	1 203 870.00	0.37
AUD ELECTRANET PTY LTD 2.47370% 21-15.12.28	900 000.00	727 947.00	0.22
AUD ING BANK AUSTRALIA LTD-REG-S 3.00000% 18-07.09.23	1 600 000.00	1 579 504.00	0.49
AUD MONASH UNIVERSITY 4.05000% 22-06.04.29	1 100 000.00	1 024 111.00	0.32
AUD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 5.00000% 14-25.06.24	2 000 000.00	2 013 300.00	0.62
AUD NETWORK FINANCE CO PTY LTD 2.25000% 19-11.11.26	1 200 000.00	1 058 592.00	0.33
AUD PACIFIC NATIONAL FINANCE PTY LTD-REG-S 3.80000% 21-08.09.31	2 200 000.00	1 735 030.00	0.54
AUD SUNCORP METWAY INSURANCE LTD 4.40000% 22-22.08.25	1 600 000.00	1 578 432.00	0.49
AUD UNIVERSITY OF MELBOURNE 4.67400% 22-22.08.29	1 900 000.00	1 835 951.00	0.57
AUD UNIVERSITY OF TECHNOLOGY SYDNEY 3.75000% 17-20.07.27	1 000 000.00	946 930.00	0.29
Total AUD		24 009 607.00	7.42
固定利付ミディアム・ターム・ノート合計		24 009 607.00	7.42
固定利付債券			
AUD			
AUD NORTHERN TERRITORY TREASURY CORP 2.50000% 21-21.05.32	1 900 000.00	1 583 213.00	0.49
Total AUD		1 583 213.00	0.49
固定利付債券合計		1 583 213.00	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			
投資有価証券合計		316 573 556.93	97.81

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	評価額 オーストラリア・ドル 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
派生商品			
公認の証券取引所に上場されている派生商品			
債券に係る金融先物			
AUD AUSTRALIA 3YR BOND FUTURE 15.12.22	-379.00	435 550.59	0.14
AUD AUSTRALIA 10YR BOND FUTURE 15.12.22	191.00	-415 434.55	-0.13
債券に係る金融先物合計		20 116.04	0.01
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計			
		20 116.04	0.01
派生商品合計			
		20 116.04	0.01
銀行預金、要求払い預金および貯蓄預金ならびにその他の流動資産		508 468.07	0.16
当座借越およびその他の短期負債		-4 880 483.92	-1.51
定期預金および信託預金		9 787 519.54	3.02
その他の資産および負債		1 651 786.18	0.51
純資産合計		323 660 962.84	100.00

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 - ユーロ・フレキシブル
2022年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

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

公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品

固定利付ノート

BRL				
BRL	BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 10.00000% 20-01.01.31	8 000.00	1 362 816.10	0.95
Total BRL			1 362 816.10	0.95
EUR				
EUR	ALTICE FINCO SA-REG-S 4.75000% 17-15.01.28	330 000.00	239 743.68	0.17
EUR	ALTICE FRANCE HOLDING SA-REG-S 8.00000% 19-15.05.27	195 000.00	147 427.80	0.10
EUR	ALTICE FRANCE-REG-S 5.87500% 18-01.02.27	600 000.00	517 590.00	0.36
EUR	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV-REG-S 3.70000% 20-02.04.40	100 000.00	90 532.80	0.06
EUR	ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-REG-S 2.12500% 19-15.08.26	200 000.00	153 486.70	0.11
EUR	ARGENTINA, REPUBLIC OF 0.12500% 20-09.07.30	679 000.00	126 166.69	0.09
EUR	ARGENTINA, REPUBLIC OF 0.50000% 20-09.07.29	22 046.00	4 702.69	0.00
EUR	BACARDI LTD-REG-S 2.75000% 13-03.07.23	100 000.00	99 549.00	0.07
EUR	BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S 1.87600% 20-07.04.24	700 000.00	688 044.00	0.48
EUR	BULGARIAN ENERGY HOLDING EAD-REG-S 2.45000% 21-22.07.28	410 000.00	301 042.50	0.21
EUR	CELANESE US HOLDINGS LLC 4.77700% 22-19.07.26	530 000.00	501 592.00	0.35
EUR	CHILE, REPUBLIC OF 0.83000% 19-02.07.31	700 000.00	515 068.75	0.36
EUR	CHINA, PEOPLE ' S REPUBLIC OF-REG-S 1.00000% 19-12.11.39	435 000.00	297 975.00	0.21
EUR	CORP ANDINA DE FOMENTO-REG-S 0.25000% 21-04.02.26	1 010 000.00	901 408.84	0.63
EUR	DEUTSCHE LUFTHANSA AG-REG-S 2.87500% 21-11.02.25	400 000.00	358 000.00	0.25
EUR	DKT FINANCE APS-REG-S 7.00000% 18-17.06.23	800 000.00	780 000.00	0.55
EUR	FISERV INC 1.62500% 19-01.07.30	395 000.00	321 570.29	0.22
EUR	GTC AURORA LUXEMBOURG SA-REG-S 2.25000% 21-23.06.26	245 000.00	181 074.60	0.13
EUR	INDONESIA, REPUBLIC OF 1.40000% 19-30.10.31	400 000.00	297 200.00	0.21
EUR	INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC-REG-S 2.37500% 19-15.04.28	160 000.00	126 000.00	0.09
EUR	JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-REG-S 4.50000% 18-15.01.26	300 000.00	233 640.00	0.16
EUR	JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-REG-S 4.50000% 21-15.07.28	295 000.00	191 026.66	0.13
EUR	LOXAM SAS-REG-S 3.75000% 19-15.07.26	400 000.00	337 562.40	0.24
EUR	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON-REG-S 0.12500% 20-11.02.28	200 000.00	171 485.60	0.12
EUR	MACIF-REG-S-SUB 0.62500% 21-21.06.27	200 000.00	161 833.20	0.11
EUR	NATIONAL GRID ELECTRICITY TRANS-REG-S 0.19000% 20-20.01.25	100 000.00	93 282.48	0.07
EUR	PERU, REPUBLIC OF 0.12500% 21-11.03.33	400 000.00	265 575.00	0.19
EUR	TELE COLUMBUS AG-REG-S 3.87500% 18-02.05.25	560 000.00	451 588.48	0.32
EUR	TRITAX EUROBOX PLC-REG-S 0.95000% 21-02.06.26	140 000.00	117 362.12	0.08
EUR	TURKEY, REPUBLIC OF 4.37500% 21-08.07.27	600 000.00	504 000.00	0.35

EUR	VEB FINANCE PLC-REG-S LPN 4.03200% 13-21.02.23	610 000.00	12 200.00	0.01
EUR	VERISURE MIDHOLDING AB-REG-S 5.25000% 21-15.02.29	145 000.00	106 575.00	0.07
Total EUR			9 294 306.28	6.50
GBP				
GBP	CPUK FINANCE LTD-REG-S 4.50000% 21-28.08.27	110 000.00	104 577.20	0.07
Total GBP			104 577.20	0.07
USD				
USD	AERCAP IRELAND CAP/ GLBL AVIATION TRUST 6.50000% 20-15.07.25	150 000.00	152 839.59	0.11
USD	AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP GLO 3.00000% 21-29.10.28	500 000.00	409 312.33	0.28
USD	COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 4.25000% 12-26.01.23	800 000.00	813 198.59	0.57
USD	ECUADOR GOVT INTERNATIONAL BD-REG-S STEP-UP/DOWN 20-31.07.35	198 120.00	66 522.84	0.05
USD	ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S STEP-UP 0.50000% 20-31.07.30	75 600.00	36 188.10	0.02
USD	ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S STEP-UP 20-31.07.40	90 800.00	26 954.30	0.02
USD	EQT CORP 3.90000% 17-01.10.27	430 000.00	399 427.16	0.28

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD MEITUAN DIANPING-REG-S 3.05000% 20-28.10.30	700 000.00	476 866.74	0.33
USD PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS-REG-S 9.25000% 21-30.04.26	260 000.00	240 901.09	0.17
USD PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP 3.80000% 20-15.09.30	135 000.00	115 550.57	0.08
USD RELIANCE INDUSTRIES LTD-REG-S 3.62500% 22-12.01.52	630 000.00	428 376.20	0.30
USD SANTOS FINANCE LTD-REG-S 3.64900% 21-29.04.31	320 000.00	256 870.61	0.18
USD SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD-REG-S 3.45000% 21-11.01.31	200 000.00	23 988.16	0.02
USD SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD-REG-S 5.20000% 21-16.01.27	200 000.00	24 498.54	0.02
USD VICI PROPERTIES LP 5.12500% 22-15.05.32	175 000.00	158 342.22	0.11
Total USD		3 629 837.04	2.54
固定利付ノート合計		14 391 536.62	10.06
ノート、ゼロ・クーポン			
USD			
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 20-31.07.30	16 232.00	4 782.28	0.00
Total USD		4 782.28	0.00
ノート、ゼロ・クーポン合計		4 782.28	0.00
変動利付ノート			
EUR			
EUR AUSTRALIA & NZ BANKING GRP-REG-S-SUB 1.125%/VAR 19-21.11.29	200 000.00	183 877.20	0.13
EUR BPCE SA-REG-S-SUB 1.500%/VAR 21-13.01.42	400 000.00	331 940.80	0.23
EUR BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC-REG-S -SUB 3.750%/VAR 21-PRP	375 000.00	261 577.50	0.18
EUR CREDIT SUISSE GROUP-REG-S 2.125%/VAR 22-13.10.26	420 000.00	377 297.76	0.26
EUR CREDIT SUISSE GROUP-REG-S 2.875%/VAR 22-02.04.32	270 000.00	208 439.46	0.15
EUR DEUTSCHE BANK AG-REG-S-SUB 4.500%/VAR 21-PRP	400 000.00	274 377.60	0.19
EUR ENI SPA-REG-S-SUB 3.375%/VAR 20-PRP	100 000.00	75 250.00	0.05
EUR KONINKLIJKE KPN-REG-S-SUB 6.000%/VAR 22-PRP	180 000.00	175 761.00	0.12
EUR MORGAN STANLEY 0.406%VAR 21-29.10.27	300 000.00	257 821.80	0.18
EUR RAIFFEISEN BANK INTER-REG-S-SUB 7.375%/VAR 22-20.12.32	200 000.00	191 747.60	0.14
EUR RAKUTEN GROUP INC-REG-S-SUB 4.250%VAR 21-PRP	425 000.00	269 983.04	0.19
EUR VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FIN-REG-S-SUB 4.375%/VAR 22-PRP	300 000.00	233 992.80	0.16
EUR WESTPAC BANKING CORP-REG-SUB 0.766%/VAR 21-13.05.31	500 000.00	422 901.40	0.30
EUR WINTERSHALL DEA FINANCE 2BV-REG-S-SUB 2.498%/VAR 21-PRP	400 000.00	298 728.00	0.21
EUR WINTERSHALL DEA FINANCE 2BV-REG-S-SUB 3.000%/VAR 21-PRP	400 000.00	283 516.80	0.20
Total EUR		3 847 212.76	2.69
USD			
USD ALLIANZ SE-REG-S-SUB 3.500%/VAR 20-PRP	200 000.00	156 268.05	0.11
USD BARCLAYS PLC-SUB COCO 8.000% 22-PRP	200 000.00	178 676.06	0.12
USD PRUDENTIAL PLC-SUB-REG-S 2.950%/VAR 21-03.11.33	535 000.00	415 865.36	0.29
Total USD		750 809.47	0.52
変動利付ノート合計		4 598 022.23	3.21
固定利付ミディアム・ターム・ノート			
EUR			
EUR ABN AMRO BANK NV-REG-S 1.25000% 18-10.01.33	500 000.00	414 584.00	0.29
EUR AEROPORTI DI ROMA SPA-REG-S 1.75000% 21-30.07.31	215 000.00	153 334.99	0.11
EUR AIR LIQUIDE FINANCE SA-REG-S 2.87500% 22-16.09.32	200 000.00	189 118.40	0.13
EUR AKER BP ASA-REG-S 1.12500% 21-12.05.29	100 000.00	79 634.46	0.06
EUR ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV-REG-S 1.15000% 18-22.01.27	200 000.00	181 052.00	0.13
EUR AROUNDTOWN SA-REG-S 2.00000% 18-02.11.26	100 000.00	85 330.00	0.06
EUR ASTRAZENECA PLC-REG-S 0.37500% 21-03.06.29	185 000.00	151 769.04	0.11
EUR AURIZON NETWORK PTY LTD-REG-S 2.00000% 14-18.09.24	100 000.00	96 201.00	0.07

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
EUR BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 0.62500% 16-18.03.23	1 000 000.00	994 700.00	0.69
EUR BANCO BPM SPA 2.50000% 19-21.06.24	400 000.00	384 842.40	0.27
EUR BANCO BPM SPA-REG-S 6.00000% 22-13.09.26	215 000.00	212 843.12	0.15
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 2.50000% 21-15.04.31	400 000.00	320 000.00	0.22
EUR BANQUE FEDER DU CREDIT MUTUEL-REG-S-SUB 3.00000% 15-11.09.25	200 000.00	193 035.20	0.13
EUR BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC-REG-S 0.87500% 15-13.10.23	200 000.00	194 700.80	0.14
EUR BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC-REG-S 1.25000% 15-13.03.27	300 000.00	253 260.85	0.18
EUR BNP PARIBAS-REG-S 0.12500% 19-04.09.26	600 000.00	513 297.60	0.36
EUR CANAL DE ISABEL II GESTION SA-REG-S 1.68000% 15-26.02.25	400 000.00	380 289.60	0.27
EUR CEZ AS-REG-S 2.37500% 22-06.04.27	140 000.00	126 050.40	0.09
EUR CITIGROUP INC-REG-S 2.37500% 14-22.05.24	300 000.00	295 764.00	0.21
EUR CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S 2.75000% 20-12.05.26	155 000.00	133 549.55	0.09
EUR CREDIT AGRICOLE SA LONDON 1.25000% 16-14.04.26	300 000.00	277 456.80	0.19
EUR CTP NV-REG-S 0.87500% 22-20.01.26	700 000.00	589 661.24	0.41
EUR DANSKE BANK AS-REG-S-SUB 1.50000% 20-02.09.30	120 000.00	104 724.00	0.07
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA AG-REG-S 2.87500% 21-16.05.27	800 000.00	623 680.00	0.44
EUR DNB BANK ASA-REG-S 0.05000% 19-14.11.23	335 000.00	324 085.70	0.23
EUR EDP FINANCE BV-REG-S 1.50000% 17-22.11.27	270 000.00	242 120.88	0.17
EUR EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 6.37500% 19-11.04.31	400 000.00	232 000.00	0.16
EUR ELECTRICITE DE FRANCE-REG-S 1.87500% 16-13.10.36	2 600 000.00	1 860 716.00	1.30
EUR ELENIA VERKKO OYJ-REG-S 0.37500% 20-06.02.27	100 000.00	85 054.43	0.06
EUR EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FAC-REG-S 1.80000% 17-10.07.48	1 700 000.00	1 373 770.00	0.96
EUR EUROPEAN STABILITY MECHANISM-REG-S 0.50000% 16-02.03.26	1 500 000.00	1 397 386.77	0.98
EUR FERROVIE DELLO STATO ITALIANE SPA-REG-S 3.75000% 22-14.04.27	375 000.00	362 821.50	0.25
EUR FMS WERTMANAGEMENT 0.37500% 15-29.04.30	1 800 000.00	1 484 654.40	1.04
EUR GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC-REG-S 1.69400% 18-26.03.25	500 000.00	466 675.00	0.33
EUR GLOBALWORTH REAL ESTATE INVEST-REG-S 3.00000% 18-29.03.25	100 000.00	87 237.50	0.06
EUR GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 2.00000% 18-01.11.28	250 000.00	218 607.50	0.15
EUR KAZAKHSTAN, REPUBLIC OF-REG-S 2.37500% 18-09.11.28	800 000.00	707 150.00	0.49
EUR KBC GROUP NV-REG-S 1.12500% 19-25.01.24	200 000.00	194 117.60	0.14
EUR KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU-REG-S 0.37500% 15-23.04.30	2 000 000.00	1 681 960.00	1.18
EUR MEXICO, UNITED STATES OF 3.00000% 15-06.03.45	200 000.00	134 100.00	0.09
EUR NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 1.87500% 12-13.01.23	500 000.00	500 807.00	0.35
EUR NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.25000% 20-23.01.27	390 000.00	338 787.15	0.24
EUR ORSTED AS REG-S 3.25000% 22-13.09.31	165 000.00	158 108.76	0.11
EUR P3 GROUP SARL-REG-S 0.87500% 22-26.01.26	425 000.00	355 284.61	0.25
EUR PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 2.87500% 14-03.03.26	1 450 000.00	1 398 475.70	0.98
EUR PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 0.87500% 19-17.05.27	500 000.00	431 500.00	0.30
EUR POLAND, REPUBLIC OF-REG-S 2.00000% 19-08.03.49	560 000.00	382 305.00	0.27
EUR PPF ARENA 1 BV-REG-S 2.12500% 19-31.01.25	750 000.00	690 000.00	0.48
EUR RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S 1.50000% 18-26.04.38	1 500 000.00	1 179 987.00	0.82
EUR REDEXIS GAS FINANCE BV-REG-S 1.87500% 15-27.04.27	600 000.00	530 340.00	0.37
EUR REN FINANCE B V-REG-S 2.50000% 15-12.02.25	400 000.00	388 248.80	0.27
EUR ROMANIA-REG-S 4.62500% 19-03.04.49	1 000 000.00	657 375.00	0.46
EUR RWE AG-REG-S 2.75000% 22-24.05.30	400 000.00	360 894.40	0.25
EUR SELP FINANCE SARL-REG-S 3.75000% 22-10.08.27	170 000.00	156 706.00	0.11
EUR SVENSKA HANDELSBANKEN AB-REG-S 1.00000% 20-15.04.25	145 000.00	138 013.90	0.10
EUR TDC NET A/S-REG-S 5.05600% 22-31.05.28	190 000.00	175 014.70	0.12
EUR TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA-REG-S 1.99400% 20-08.04.32	100 000.00	85 680.26	0.06
EUR UNICAJA BANCO SA-REG-S 4.50000% 22-30.06.25	200 000.00	198 518.40	0.14
EUR VONOVIA SE-REG-S 0.37500% 21-16.06.27	300 000.00	243 884.40	0.17
EUR VONOVIA SE-REG-S 1.62500% 21-01.09.51	200 000.00	93 352.40	0.06
EUR WESTERN POWER DISTRIBUTION EAST-REG-S 3.94900% 22-20.09.32	105 000.00	100 587.27	0.07
EUR WESTPAC BANKING CORP-REG-S 0.01000% 21-22.09.28	925 000.00	762 497.85	0.53
Total EUR		27 127 705.33	18.97
GBP			
GBP FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.74800% 20-14.06.24	200 000.00	205 098.83	0.14
Total GBP		205 098.83	0.14

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD			
USD GC TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 4.40000% 22-30.03.32	325 000.00	285 368.18	0.20
USD INDIAN RAILWAY FINANCE CORP LTD-REG-S 2.80000% 21-10.02.31	585 000.00	459 717.50	0.32
USD MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 8.75000% 17-09.03.24	500 000.00	462 633.34	0.32
Total USD		1 207 719.02	0.84
固定利付メディアム・ターム・ノート合計		28 540 523.18	19.95
メディアム・ターム・ノート、ゼロ・クーポン			
EUR			
EUR SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCH NV-REG-S 0.00000% 20-20.02.23	400 000.00	396 790.40	0.28
EUR STEDIN HOLDING NV-REG-S 0.00000% 21-16.11.26	270 000.00	234 266.58	0.16
Total EUR		631 056.98	0.44
メディアム・ターム・ノート、ゼロ・クーポン合計		631 056.98	0.44
変動利付メディアム・ターム・ノート			
EUR			
EUR AXA SA-REG-S-SUB 3.250%/VAR 18-28.05.49	100 000.00	86 774.05	0.06
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S 2.625%/VAR 22-24.03.26	100 000.00	92 469.20	0.06
EUR BANK OF AMERICA CORP-REG-S 0.808%/VAR 19-09.05.26	450 000.00	415 666.80	0.29
EUR BANK OF IRELAND GROUP PLC-REG-S 1.875%/VAR 22-05.06.26	170 000.00	156 868.18	0.11
EUR BARCLAYS PLC-REG-S 3.375%/VAR 20-02.04.25	170 000.00	167 630.88	0.12
EUR COMMONWEALTH BK OF AUSTRALIA-REG-S-SUB 1.936%/VAR 17-03.10.29	200 000.00	187 736.00	0.13
EUR CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S 0.650%/VAR 20-14.01.28	100 000.00	79 670.00	0.06
EUR DEUTSCHE BANK AG-REG-S 1.000%/VAR 20-19.11.25	200 000.00	184 058.80	0.13
EUR DEUTSCHE BANK AG-REG-S 1.750%/VAR 20-19.11.30	200 000.00	151 153.36	0.10
EUR IBERDROLA INTERNATIONAL BV-REG-S-SUB 2.625%/VAR 18-PRP	100 000.00	95 100.00	0.07
EUR TOTAL SE-REG-S-SUB 2.625%/VAR 15-PRP	750 000.00	685 836.00	0.48
EUR VIRGIN MONEY UK PLC-REG-S 0.000%/VAR 21-27.05.24	230 000.00	224 056.34	0.16
Total EUR		2 527 019.61	1.77
変動利付メディアム・ターム・ノート合計		2 527 019.61	1.77
固定利付債券			
EUR			
EUR ABBOTT IRELAND FINCING DAC-REG-S 0.87500% 18-27.09.23	225 000.00	221 215.05	0.15
EUR ADLER REAL ESTATE AG-REG-S 1.87500% 18-27.04.23	400 000.00	325 504.00	0.23
EUR ADO PROPERTIES SA-REG-S 1.50000% 17-26.07.24	100 000.00	60 750.00	0.04
EUR ALSTRIA OFFICE REIT-AG-REG-S 1.50000% 20-23.06.26	200 000.00	157 791.20	0.11
EUR ALTRIA GROUP INC 2.20000% 19-15.06.27	400 000.00	352 542.40	0.25
EUR APPLE INC 1.37500% 17-24.05.29	500 000.00	449 910.00	0.31
EUR AUSTRIA, REPUBLIC OF 2.40000% 13-23.05.34	1 920 000.00	1 819 315.20	1.27
EUR AUTOSTRADE PER L'ITALIA SPA REG-S 2.00000% 21-15.01.30	755 000.00	563 494.25	0.39
EUR BELGIUM, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.00000% 15-22.06.31	1 100 000.00	966 746.00	0.68
EUR BELGIUM, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.90000% 15-22.06.38	2 700 000.00	2 299 099.95	1.61
EUR BNZ INTERNATIONAL FUND LTD/LONDON 0.50000% 17-03.07.24	900 000.00	864 439.20	0.60
EUR BPCE SA-REG-S 0.25000% 20-15.01.26	200 000.00	180 098.00	0.13
EUR BRISTOL MYERS SQUIBB CO 1.75000% 15-15.05.35	200 000.00	156 758.42	0.11
EUR CHUBB INA HOLDINGS INC 2.50000% 18-15.03.38	200 000.00	151 760.80	0.11
EUR EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.00000% 16-14.04.32	2 000 000.00	1 682 332.00	1.18
EUR EUROPEAN UNION-REG-S 0.10000% 20-04.10.40	535 000.00	313 700.46	0.22
EUR FINNAIR OYJ-REG-S 4.25000% 21-19.05.25	295 000.00	230 100.00	0.16
EUR FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 4.00000% 06-25.10.38	500 000.00	558 376.00	0.39
EUR FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 4.50000% 09-25.04.41	1 040 000.00	1 243 205.60	0.87

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
EUR FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 3.25000% 12-25.05.45	2 000 000.00	2 076 400.00	1.45
EUR FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 1.75000% 13-25.05.23	3 500 000.00	3 505 950.00	2.45
EUR FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 1.50000% 19-25.05.50	700 000.00	504 630.00	0.35
EUR FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.50000% 19-25.05.29	1 000 000.00	885 828.00	0.62
EUR GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.50000% 16-15.02.26	2 560 000.00	2 452 986.88	1.72
EUR GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.25000% 18-15.08.28	2 170 000.00	1 965 369.00	1.37
EUR GREECE, HELLENIC REPUBLIC OF-144A-REG-S 1.87500% 19-23.07.26	2 210 000.00	2 045 858.88	1.43
EUR IMPERIAL BRANDS FINANCE PLC-REG-S 1.37500% 17-27.01.25	900 000.00	842 410.80	0.59
EUR INEOS QUATTRO FINANCE 2 PLC-REG-S 2.50000% 21-15.01.26	200 000.00	164 056.00	0.11
EUR INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 0.37500% 19-31.01.23	300 000.00	298 677.00	0.21
EUR IRELAND, REPUBLIC OF-REG-S 1.70000% 17-15.05.37	730 000.00	624 693.12	0.44
EUR ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 3.250% 14-01.09.46	3 600 000.00	2 999 145.60	2.10
EUR ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 2.70000% 16-01.03.47	1 300 000.00	979 568.20	0.68
EUR ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 2.25000% 16-01.09.36	3 500 000.00	2 720 347.00	1.90
EUR MAPFRE SA-REG-S-SUB 2.87500% 22-13.04.30	200 000.00	162 784.00	0.11
EUR MATTERHORN TELECOM SA-REG-S 3.12500% 19-15.09.26	330 000.00	287 100.00	0.20
EUR MPT OPERATING PARTNERSHIP LP/FIN CORP 3.32500% 17-24.03.25	300 000.00	280 047.00	0.20
EUR NETHERLANDS, KINGDOM OF THE 4.00000% 05-15.01.37	1 200 000.00	1 392 585.60	0.97
EUR PERU, REPUBLIC OF 3.75000% 16-01.03.30	350 000.00	320 534.37	0.22
EUR PORTUGAL, REPUBLIC OF-144A-REG-S 2.87500% 15-15.10.25	2 000 000.00	2 042 064.00	1.43
EUR PORTUGAL, REPUBLIC OF-144A-REG-S 2.25000% 18-18.04.34	1 400 000.00	1 274 011.20	0.89
EUR SLOVAKIA, REPUBLIC OF-REG-S 0.75000% 19-09.04.30	800 000.00	669 606.40	0.47
EUR SLOVENIA, REPUBLIC OF-REG-S 1.50000% 15-25.03.35	2 500 000.00	1 980 580.00	1.38
EUR SLOVENIA, REPUBLIC OF-REG-S 3.12500% 15-07.08.45	750 000.00	691 110.00	0.48
EUR SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 2.90000% 16-31.10.46	2 400 000.00	2 142 345.60	1.50
EUR SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.50000% 17-30.04.27	100 000.00	95 300.86	0.07
EUR SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 2.70000% 18-31.10.48	2 600 000.00	2 202 215.60	1.54
EUR SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.85000% 19-30.07.35	1 500 000.00	1 257 807.00	0.88
EUR TAURON POLSKA ENERGIA SA-REG-S 2.37500% 17-05.07.27	200 000.00	154 350.00	0.11
EUR UMG GROUPE VYV 1.62500% 19-02.07.29	100 000.00	83 742.20	0.06
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 3.12500% 20-15.02.26	335 000.00	253 450.95	0.18
EUR VERIZON COMMUNICATIONS INC 0.87500% 19-08.04.27	220 000.00	196 031.44	0.14
EUR VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FIN NV-REG-S 1.12500% 17-02.10.23	600 000.00	587 070.00	0.41
EUR WINTERSHALL DEA FINANCE BV-REG-S 1.33200% 19-25.09.28	300 000.00	244 147.20	0.17
Total EUR		50 979 942.43	35.64
GBP			
GBP BELLIS ACQUISITION CO PLC-REG-S 3.25000% 21-16.02.26	310 000.00	265 820.56	0.18
GBP BERKELEY GROUP PLC/THE-REG-S 2.50000% 21-11.08.31	160 000.00	110 873.52	0.08
GBP ROTHESAY LIFE PLC-REG-S-SUB 3.37500% 19-12.07.26	315 000.00	298 787.20	0.21
GBP UNITED KINGDOM OF GRT BRI & N IRL-REG-S 1.00000% 18-22.04.24	2 200 000.00	2 386 399.52	1.67
Total GBP		3 061 880.80	2.14
NZD			
NZD NEW ZEALAND 1.50000% 19-15.05.31	1 300 000.00	601 411.85	0.42
NZD NEW ZEALAND 1.75000% 20-15.05.41	2 600 000.00	954 698.72	0.67
NZD NEW ZEALAND 2.75000% 21-15.05.51	1 800 000.00	731 847.69	0.51
NZD NEW ZEALAND-REG-S 2.75000% 16-15.04.37	3 100 000.00	1 446 880.33	1.01
Total NZD		3 734 838.59	2.61
USD			
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 6.12500% 09-18.01.41	500 000.00	374 432.20	0.26
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 2.70000% 21-12.07.26	200 000.00	64 308.69	0.05
Total USD		438 740.89	0.31
固定利付債券合計		58 215 402.71	40.70

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
ゼロ・クーポン債			
EUR			
EUR BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 0.00000% 22-15.02.2032	180 000.00	148 365.36	0.10
EUR GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 20-15.08.30	1 200 000.00	1 025 937.60	0.72
Total EUR		1 174 302.96	0.82
ゼロ・クーポン債合計			1 174 302.96 0.82
変動利付債券			
EUR			
EUR ABANCA CORP BANCARIA SA-REG-S-SUB 6.125%/VAR 19-18.01.29	300 000.00	292 614.60	0.20
EUR BANCO DE CREDITO SOCIAL-REG-S 8.000%/VAR 22-22.09.26	400 000.00	397 189.60	0.28
EUR BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S 3.250%/VAR 20-PRP	130 000.00	115 284.00	0.08
EUR BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S-SUB 3.625%/VAR 20-PRP	100 000.00	80 600.00	0.06
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 4.000%/VAR 18-PRP	200 000.00	180 500.00	0.13
EUR HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA-REG-S-SUB 3.000%/VAR 19-PRP	300 000.00	282 300.00	0.20
EUR RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S-SUB 3.250%/VAR 19-PRP	200 000.00	152 356.00	0.11
EUR SES SA-REG-S-SUB 2.875%/VAR 21-PRP	695 000.00	516 159.82	0.36
EUR UNIBAIL-RODAMCO SE-REG-S-SUB 2.125%/VAR 18-PRP	100 000.00	86 772.00	0.06
EUR UNIBAIL-RODAMCO SE-REG-S-SUB 2.875%/VAR 18-PRP	100 000.00	77 251.00	0.05
Total EUR		2 181 027.02	1.53
GBP			
GBP M&G PLC-REG-S-SUB 5.625%/VAR 18-20.10.51	190 000.00	173 595.87	0.12
Total GBP		173 595.87	0.12
USD			
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S-SUB 7.500%/VAR 18-PRP	500 000.00	437 656.31	0.31
Total USD		437 656.31	0.31
変動利付債券合計			2 792 279.20 1.96
変動利付米国中期国債			
USD			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.750%/CPI LINKED 15-15.02.45	650 000.00	643 627.46	0.45
Total USD		643 627.46	0.45
変動利付米国中期国債合計			643 627.46 0.45
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			113 518 553.23 79.36
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	473 117.79	0.33
Total USD		473 117.79	0.33
変動利付アセット・バック証券合計			473 117.79 0.33

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
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	678 331.56	0.47
USD MSBAM LYNCH TRUST-SUB 3.99400% 16-01.12.49	313 000.00	294 650.50	0.21
Total USD		972 982.06	0.68
固定利付モーゲージ・バック証券合計		972 982.06	0.68
変動利付モーゲージ・バック証券			
USD			
USD AVENTURA MALL TRUST-144A FLR 18-01.07.40	650 000.00	597 787.75	0.42
USD BAML COMMERCIAL MORT SET-144A 1M LIBOR+135BP 18-15.09.34	550 000.00	534 550.48	0.37
USD BANK 2017-BNK9 VAR 17-01.11.54	450 000.00	412 141.53	0.29
USD BANK-SUB FLR 18-01.02.61	505 000.00	439 481.40	0.31
USD BBCMS TRUST CBM-144A 1M LIBOR+119.1098BP 18-15.07.37	550 000.00	536 034.45	0.38
USD BENCHMARK MORTGAGE TRUST VAR 18-01.02.51	250 000.00	230 934.16	0.16
USD BENCHMARK MORTGAGE TRUST-SUB FLR 18-01.10.51	550 000.00	484 701.78	0.34
USD CMB COMM MORTGAGE TRUST-144A-SUB 1M LIBOR+145BP 19-15.12.37	175 000.00	172 367.60	0.12
USD CMB COMM MORTGAGE TRUST-144A-SUB 1M LIBOR+175BP 19-15.12.37	430 000.00	422 432.64	0.30
USD CORE TRUST CORE-144A 1M LIBOR+110BP 19-15.12.31	230 000.00	42 951.68	0.03
USD GS MORTGAGE SECURITIES TRUST-144A VAR 17-01.01.43	1 225 000.00	1 107 522.29	0.77
USD JP MORGAN CHASE MORTGAGE SECURITIES-144A-SUB FLR 18-01.01.31	685 000.00	693 067.78	0.48
Total USD		5 673 973.54	3.97
変動利付モーゲージ・バック証券合計		5 673 973.54	3.97
固定利付ノート			
USD			
USD AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD-144A 2.12500% 21-21.02.26	165 000.00	142 333.03	0.10
USD T-MOBILE USA INC 5.65000% 22-15.01.53	120 000.00	115 708.48	0.08
Total USD		258 041.51	0.18
固定利付ノート合計		258 041.51	0.18
固定利付債券			
RUB			
RUB RUSSIA, FEDERATION OF 7.65000% 19-10.04.30	270 000 000.00	1 420 314.44	0.99
Total RUB		1 420 314.44	0.99
固定利付債券合計		1 420 314.44	0.99
変動利付債券			
NZD			
NZD NEW ZEALAND 2.500%/CPI LINKED 17-20.09.40	8 300 000.00	5 488 567.80	3.84
NZD NEW ZEALAND 3.000%/CPI LINKED 13-20.09.30	900 000.00	655 795.43	0.46
Total NZD		6 144 363.23	4.30
変動利付債券合計		6 144 363.23	4.30
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		14 942 792.57	10.45

注記は、財務書類と不可分のものである。

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

2010年12月17日のルクセンブルグ投信法（改訂済）第41条(1)e)に準拠した投資信託 / その他の投資信託

投資信託、オープン・エンド型

ルクセンブルグ

EUR	UBS (LUX) BOND FUND - EURO HIGH YIELD (EUR) I-X-ACC	100.00	12 596.00	0.01
USD	UBS (LUX) BOND SICAV - ASIAN HIGH YIELD (USD) I-X-DIST	45 000.00	2 184 198.44	1.53
USD	UBS (LUX) BOND SICAV - MULTI INCOME (USD)-U-X-ACC- CAP	320.00	3 086 225.49	2.16
USD	UBS (LUX) BOND SICAV - CHINA HIGH YIELD (USD) U-X-ACC	285.00	1 191 751.80	0.83
ルクセンブルグ合計			6 474 771.73	4.53

投資信託、オープン・エンド型合計		6 474 771.73	4.53
------------------	--	--------------	------

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		6 474 771.73	4.53
-------------------	--	--------------	------

投資有価証券合計		134 936 117.53	94.34
----------	--	----------------	-------

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 08.12.22	30.00	-140 700.00	-0.10
EUR	SHORT EURO BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 08.12.22	40.00	-47 200.00	-0.03
EUR	EURO-BUND FUTURE 08.12.22	50.00	-256 680.00	-0.18
EUR	EURO-BOBL FUTURE 08.12.22	95.00	-279 300.00	-0.20
EUR	EURO-SCHATZ FUTURE 08.12.22	37.00	-35 150.00	-0.02
EUR	EURO-BUXL FUTURE 08.12.22	-11.00	134 280.00	0.09
EUR	EURO-OAT FUTURE 08.12.22	87.00	-521 130.00	-0.36
GBP	LONG GILT FUTURE 28.12.22	4.00	-39 266.78	-0.03
CAD	CAN 10YR BOND FUTURE 19.12.22	-87.00	6 522.60	0.00
USD	US LONG BOND FUTURE 20.12.22	15.00	-27 752.26	-0.02
JPY	JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 13.12.22	-18.00	38 223.00	0.03
AUD	AUSTRALIA 3YR BOND FUTURE 15.12.22	-181.00	76 928.82	0.05
USD	US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 20.12.22	6.00	-77 897.72	-0.05
USD	US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 20.12.22	-50.00	266 421.68	0.19
USD	US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 20.12.22	-46.00	357 302.35	0.25
USD	US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 30.12.22	-95.00	210 175.43	0.15
USD	US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.12.22	-135.00	516 766.19	0.36
債券に係る金融先物合計			181 543.31	0.13

金利に係る金融先物

USD	90DAY EURO DOLLAR FUTURE 18.12.23	175.00	-1 344 740.47	-0.94
金利に係る金融先物合計			-1 344 740.47	-0.94

公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		-1 163 197.16	-0.81
------------------------	--	---------------	-------

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄		数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
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	-54 910.38	-0.04
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	385 348.12	0.27
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	1 354 196.58	0.95
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	1 671 490.80	1.17
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	761 853.86	0.53
PLN	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 6MWIB 20-07.05.30			
NZD	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 1.67500% 24-30.10.29	-18 000 000.00	1 154 302.69	0.81
NZD	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 3MFRA 24-30.10.29			
NZD	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 1.58300% 24-24.09.29	-19 000 000.00	1 267 190.17	0.89
NZD	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 3MFRA 24-24.09.29			
CNY	CITI/INTEREST RATE SWAP PAY 2.80500% 21-02.04.26	-55 000 000.00	-127 666.55	-0.09
CNY	CITI/INTEREST RATE SWAP REC CNRR007 21-02.04.26			
USD	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 1.82280% 21-29.10.51	-1 600 000.00	463 555.67	0.32
USD	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 3M LIBOR 21-29.10.51			
PLN	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 3.79250% 22-17.01.32	-8 000 000.00	323 610.17	0.23
PLN	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 6MWIB 22-17.01.32			
PLN	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 3.86400% 22-19.01.32	-8 000 000.00	314 922.59	0.22
PLN	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 6MWIB 22-19.01.32			
KRW	JPMORGAN/INTEREST RATE SWAP PAY 2.15900% 22-25.01.32	-4 500 000 000.00	437 976.08	0.31
KRW	JPMORGAN/INTEREST RATE SWAP REC 3MKWCD 22-25.01.32			
CNY	JPMORGAN/INTEREST RATE SWAP REC 2.23500% 20-10.06.25	50 000 000.00	-9 862.69	-0.01
CNY	JPMORGAN/INTEREST RATE SWAP PAY CNRR007 20-10.06.25			
MXN	CME/INTEREST RATE SWAP REC 8.07000% 18-26.06.28	135 000 000.00	-362 440.60	-0.25
MXN	CME/INTEREST RATE SWAP PAY MXI 18-26.06.28			
MXN	CME/INTEREST RATE SWAP REC 8.13500% 18-12.07.28	120 000 000.00	-308 208.67	-0.23
MXN	CME/INTEREST RATE SWAP PAY MXI 18-12.07.28			
NZD	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 1.32000% 21-22.06.26	11 000 000.00	-693 252.93	-0.48
NZD	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 3MFRA 21-22.06.26			
HUF	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 2.59600% 21-10.08.26	2 200 000 000.00	-1 441 494.12	-1.01
HUF	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 6ML 21-10.08.26			
HUF	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 2.83500% 21-17.09.26	1 220 000 000.00	-769 031.81	-0.54
HUF	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 6ML 21-17.09.26			
MXN	CME/INTEREST RATE SWAP REC 7.50000% 21-22.09.31	64 000 000.00	-338 347.53	-0.24
MXN	CME/INTEREST RATE SWAP PAY MXI 21-22.09.31			
MXN	CME/INTEREST RATE SWAP REC 7.44000% 21-16.10.26	80 000 000.00	-262 949.64	-0.18
MXN	CME/INTEREST RATE SWAP PAY MXI 21-16.10.26			
MXN	CME/INTEREST RATE SWAP REC 7.49250% 21-19.10.26	80 000 000.00	-255 357.52	-0.18
MXN	CME/INTEREST RATE SWAP PAY MXI 21-19.10.26			
ZAR	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 7.67000% 22-06.01.32	26 000 000.00	-164 180.82	-0.11
ZAR	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 3MZAR 22-06.01.32			
HUF	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 4.82000% 22-17.01.27	1 150 000 000.00	-535 344.38	-0.37
HUF	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 6MHUF 22-17.01.27			
HUF	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 4.95100% 22-19.01.27	1 150 000 000.00	-522 273.40	-0.38
HUF	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 6MHUF 22-19.01.27			
KRW	JPMORGAN/INTEREST RATE SWAP REC 2.02000% 22-25.01.24	23 000 000 000.00	-478 119.88	-0.33
KRW	JPMORGAN/INTEREST RATE SWAP PAY 3MKWCD 22-25.01.24			
金利に係るスワップおよびフォワード・スワップ合計			1 811 005.81	1.26

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
クレジット・デフォルト・スワップ *			
USD BOA/MEX CREDIT DEFAULT SWAP PAY 1.00000% 19-20.06.24	-3 200 000.00	1 840.08	0.00
USD BOA/TURKEY CREDIT DEFAULT SWAP REC 1.00000% 19-20.06.24	3 200 000.00	-313 306.09	-0.22
EUR ICE/MARKIT ITRX EUR CDI REC 5.00000% 20-20.12.22	6 253 310.00	39 719.64	0.03
クレジット・デフォルト・スワップ合計		-271 746.37	-0.19
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		1 539 259.44	1.07
派生商品合計		376 062.28	0.26

為替予約契約

購入通貨	購入額	売却通貨	売却額	満期日		
MYR	1 813 000.00	USD	405 212.11	6.10.2022	-14 887.21	-0.01
USD	1 336 449.52	TWD	40 600 000.00	6.10.2022	60 231.29	0.04
CNY	3 805 000.00	USD	551 129.78	11.10.2022	-13 131.34	-0.01
KRW	1 654 000 000.00	USD	1 227 950.35	6.10.2022	-75 952.55	-0.05
USD	1 400 187.73	BRL	7 160 000.00	6.10.2022	79 373.25	0.05
EUR	28 424 868.31	USD	28 570 000.00	6.10.2022	-731 688.73	-0.51
CAD	700 000.00	EUR	527 938.51	6.10.2022	-8 039.14	-0.01
EUR	13 357 580.73	NZD	21 940 000.00	6.10.2022	692 137.39	0.48
SEK	7 390 000.00	EUR	686 814.27	6.10.2022	-7 125.38	0.00
EUR	2 534 512.48	GBP	2 190 000.00	6.10.2022	39 440.16	0.03
EUR	1 131 064.43	CZK	27 820 000.00	6.10.2022	-457.80	0.00
EUR	1 206 406.40	MXN	24 420 000.00	6.10.2022	-32 210.89	-0.02
EUR	628 139.68	THB	23 020 000.00	6.10.2022	5 235.08	0.00
EUR	755 440.53	JPY	105 700 000.00	6.10.2022	9 960.61	0.01
PLN	5 760 000.00	EUR	1 213 830.82	6.10.2022	-24 262.44	-0.02
EUR	47 698.82	AUD	70 000.00	6.10.2022	1 766.85	0.00
EUR	207 338.42	HUF	83 500 000.00	6.10.2022	10 216.75	0.01
GBP	210 000.00	EUR	242 362.21	6.10.2022	-3 108.70	0.00
USD	485 000.00	EUR	488 055.72	6.10.2022	6 901.58	0.00
HUF	83 500 000.00	GBP	176 633.19	6.10.2022	-4 117.36	0.00
CNY	4 194 162.50	USD	605 000.00	11.10.2022	-11 925.02	-0.01
USD	605 000.00	IDR	9 025 390 000.00	6.10.2022	13 516.41	0.01
USD	595 000.00	CAD	780 610.25	6.10.2022	27 452.64	0.02
USD	1 817 340.16	GBP	1 570 000.00	6.10.2022	65 957.10	0.05
USD	684 116.72	EUR	680 000.00	6.10.2022	18 161.99	0.01
EUR	315 215.07	USD	320 000.00	6.10.2022	-11 354.70	-0.01
NZD	1 185 000.00	EUR	717 228.25	6.10.2022	-33 155.76	-0.02
EUR	226 877.93	CAD	300 000.00	6.10.2022	4 063.92	0.00
NZD	2 200 000.00	EUR	1 328 366.85	6.10.2022	-58 358.86	-0.04
ZAR	5 244 232.20	EUR	300 000.00	6.10.2022	-2 312.68	0.00
EUR	219 787.46	HUF	89 350 000.00	6.10.2022	8 855.47	0.01
PLN	1 065 000.00	EUR	225 000.30	6.10.2022	-5 054.06	0.00
ZAR	5 180 518.16	CAD	390 000.00	6.10.2022	4 413.51	0.00
NOK	6 128 862.95	EUR	595 000.00	6.10.2022	-21 045.62	-0.01
MXN	4 170 000.00	JPY	29 857 513.00	6.10.2022	929.69	0.00
AUD	885 000.00	USD	586 271.35	6.10.2022	-17 600.63	-0.01
MXN	3 200 000.00	EUR	162 309.20	6.10.2022	-0.63	0.00
CAD	380 000.00	ZAR	5 039 442.96	6.10.2022	-3 833.59	0.00
EUR	290 000.00	ZAR	5 066 250.99	6.10.2022	2 415.74	0.00

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

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面			評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
為替予約契約					
購入通貨	購入額	売却通貨	売却額	満期日	
GBP	206 985.93	PLN	1 105 000.00	6.10.2022	7 618.09
USD	563 339.79	AUD	870 000.00	6.10.2022	4 037.49
EUR	240 893.12	GBP	215 000.00	6.10.2022	-4 056.90
CNY	8 000 000.00	USD	1 122 807.02	4.11.2022	3 631.66
USD	1 128 231.66	CNY	7 999 162.50	11.10.2022	-3 410.57
EUR	518 123.73	PLN	2 470 000.00	6.10.2022	8 013.68
MXN	11 160 000.00	EUR	569 236.21	6.10.2022	-3 185.06
KRW	1 654 000 000.00	USD	1 147 105.54	4.11.2022	4 715.78
USD	1 146 477.39	KRW	1 654 000 000.00	6.10.2022	-7 222.78
EUR	570 000.00	SEK	6 212 758.21	6.10.2022	-1 413.09
IDR	9 025 390 000.00	USD	593 151.29	6.10.2022	-1 397.54
TWD	40 600 000.00	USD	1 279 384.89	6.10.2022	-1 919.79
USD	1 280 676.30	TWD	40 600 000.00	4.11.2022	2 823.57
USD	591 829.51	IDR	9 025 400 000.00	4.11.2022	1 884.90
MYR	1 813 000.00	USD	389 892.47	4.11.2022	84.93
USD	390 732.76	MYR	1 813 000.00	6.10.2022	107.52
EUR	323 871.91	MXN	6 340 000.00	6.10.2022	2 298.05
USD	595 000.00	EUR	613 639.42	6.10.2022	-6 423.76
BRL	7 160 000.00	USD	1 324 699.35	6.10.2022	-2 240.42
USD	1 316 152.28	BRL	7 160 000.00	4.11.2022	3 318.43
EUR	570 000.00	GBP	503 213.10	6.10.2022	-3 311.91
USD	535 930.59	CNY	3 805 000.00	11.10.2022	-2 376.12
USD	590 743.75	CNY	4 194 162.50	11.10.2022	-2 619.15
EUR	111 889.86	CAD	150 000.00	6.10.2022	482.85
USD	2 755 000.00	EUR	2 821 667.54	6.10.2022	-10 105.95
AUD	520 000.00	EUR	344 913.13	6.10.2022	-3 704.20
MXN	3 320 000.00	EUR	169 118.10	6.10.2022	-722.96
為替予約契約合計					-43 686.91
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					14 461 386.42*
当座借越およびその他の短期負債					-4 073 705.62
その他の資産および負債					-2 618 458.46
純資産合計					143 037 715.24

* 2022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370,000.00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）bond・ファンド - アジア・フレキシブル（米ドル）*

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

2022年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	評価額 米ドル 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
固定利付ノート			
USD			
USD ADANI PORTS & SPL ECO ZONE LTD-REG-S 5.00000% 21-02.08.41	1 200 000.00	873 756.00	0.22
USD AIRPORT AUTHORITY-REG-S 3.25000% 22-12.01.52	2 100 000.00	1 533 322.98	0.38
USD ALIBABA GROUP HOLDING LTD 2.80000% 17-06.06.23	2 800 000.00	2 761 948.00	0.69
USD ALIBABA GROUP HOLDING LTD 3.15000% 21-09.02.51	3 000 000.00	1 793 250.00	0.45
USD AMBER CIRCLE FUNDING LTD-REG-S 3.25000% 12-04.12.22	3 700 000.00	3 692 341.00	0.92
USD ANTON OILFIELD SERVICES GROUP-REG-S 8.75000% 21-26.01.25	1 200 000.00	850 725.00	0.21
USD AYC FINANCE LTD-REG-S 3.90000% 21-PRP	800 000.00	580 400.00	0.15
USD BAIDU INC 3.50000% 12-28.11.22	2 725 000.00	2 717 969.50	0.68
USD BAIDU INC 4.12500% 15-30.06.25	4 300 000.00	4 149 414.00	1.04
USD BHARTI AIRTEL LTD-REG-S 4.37500% 15-10.06.25	5 000 000.00	4 829 062.50	1.21
USD CA MAGNUM HOLDINGS-REG-S 5.37500% 21-31.10.26	975 000.00	822 783.00	0.21
USD CENTRAL CHINA REAL ESTATE-REG-S 7.25000% 20-16.07.24	2 000 000.00	462 875.00	0.12
USD CHINA HUANENG GP HK TREASURY MGT-REG-S 2.60000% 19-10.12.24	4 000 000.00	3 802 200.00	0.95
USD CHINA OIL AND GAS GROUP LTD-REG-S 4.70000% 21-30.06.26	1 000 000.00	770 000.00	0.19
USD CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD REG-S 4.37500% 21-12.04.27	1 800 000.00	324 000.00	0.08
USD CLIFFTON LTD-REG-S 6.25000% 21-25.10.25	1 000 000.00	872 000.00	0.22
USD CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 5.12500% 18-14.03.28	1 375 000.00	1 320 687.50	0.33
USD CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 3.37500% 19-19.06.24	1 370 000.00	1 328 050.60	0.33
USD CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 3.87500% 19-19.06.29	2 800 000.00	2 460 948.00	0.62
USD CNOOC FINANCE 2015 USA LLC 4.37500% 18-02.05.28	1 250 000.00	1 221 718.75	0.31
USD DEVELOPMENT BK OF THE PHILIPPINES-REG-S 2.37500% 21-11.03.31	7 500 000.00	5 625 000.00	1.41
USD EASY TACTIC LTD (PIK) 6.50000% 22-11.07.28	1 456 875.00	156 431.96	0.04
USD ENN CLEAN ENERGY INTERNAT INVEST-REG-S 3.37500% 21-12.05.26	300 000.00	260 681.25	0.07
USD FORTUNE STAR BVI LTD-REG-S 5.95000% 20-19.10.25	600 000.00	235 524.00	0.06
USD FORTUNE STAR BVI LTD-REG-S 5.00000% 21-18.05.26	435 000.00	164 082.00	0.04
USD FRANSION BRILLIANT LTD-REG-S 4.25000% 19-23.07.29	600 000.00	427 425.00	0.11
USD HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING-REG-S 2.15000% 21-14.01.26	1 100 000.00	891 781.00	0.22
USD HKT CAPITAL NO 6 LTD-REG-S 3.00000% 22-18.01.32	2 800 000.00	2 305 128.00	0.58
USD INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT-REG-S 4.74500% 21-09.06.51	3 575 000.00	2 252 643.25	0.56
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 3.50000% 17-11.01.28	3 000 000.00	2 738 062.50	0.69
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 4.65000% 22-20.09.32	2 175 000.00	2 047 458.00	0.51
USD INTERNATIONAL CONT TERM SERV-REG-S 4.75000% 20-17.06.30	250 000.00	224 031.25	0.06

USD	JINGRUI HOLDINGS LTD-REG-S * DEFAULTED * 14.50000% 20-19.02.23	200 000.00	15 000.00	0.00
USD	JMH CO LTD-REG-S 2.50000% 21-09.04.31	4 775 000.00	3 882 850.88	0.97
USD	JSW HYDRO ENERGY LTD-REG-S 4.12500% 21-18.05.31	200 000.00	144 992.00	0.04
USD	JSW STEEL LTD-REG-S 5.05000% 21-05.04.32	1 000 000.00	695 812.50	0.17
USD	KAISA GROUP HOLDINGS-REG-S * DEFAULTED * 10.50000% 20-15.01.25	3 250 000.00	335 765.63	0.08
USD	KAISA GROUP HOLDINGS-REG-S * DEFAULTED * 11.25000% 20-16.04.25	3 000 000.00	312 750.00	0.08
USD	KOREA MINE REHABILITATION & MIN-REG-S 4.12500% 22-20.04.27	4 000 000.00	3 749 578.80	0.94
USD	KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 2.62500% 16-14.04.26	200 000.00	183 850.00	0.05
USD	KWG GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 6.30000% 20-13.02.26	2 675 000.00	414 625.00	0.10
USD	LAI SUN MTN LTD-REG-S 5.00000% 21-28.07.26	1 400 000.00	973 366.10	0.24
USD	LENOVO GROUP LTD-REG-S 3.42100% 20-02.11.30	2 300 000.00	1 762 087.50	0.44
USD	LEVC FINANCE LTD-REG-S 1.37500% 21-25.03.24	7 512 000.00	7 122 502.80	1.78
USD	MEITUAN DIANPING-REG-S 3.05000% 20-28.10.30	8 165 000.00	5 449 116.88	1.36
USD	MELCO RESORTS FINANCE LTD-REG-S 5.75000% 20-21.07.28	1 200 000.00	776 220.00	0.19
USD	NEW METRO GLOBAL LTD-REG-S 4.50000% 21-02.05.26	2 842 000.00	918 335.46	0.23
USD	NONGHYUP BANK-REG-S 3.87500% 18-30.07.23	1 500 000.00	1 490 437.50	0.37

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄		数量 / 額面	評価額 米ドル 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD	NORINCHUKIN BANK/THE REG-S 4.86700% 22-14.09.27	800 000.00	786 274.00	0.20
USD	NORINCHUKIN BANK/THE-REG-S 5.07100% 22-14.09.32	800 000.00	775 635.04	0.19
USD	ONGC VIDESH VANKORNEFT PTE LTD-REG-S 3.75000% 16-27.07.26	300 000.00	279 993.75	0.07
USD	PAKUWON JATI TBK PT-REG-S 4.87500% 21-29.04.28	250 000.00	203 484.37	0.05
USD	PHILIPPINES, REPUBLIC OF 2.65000% 20-10.12.45	575 000.00	355 125.75	0.09
USD	POSCO-REG-S 4.50000% 22-04.08.27	4 000 000.00	3 812 240.00	0.95
USD	POWERLONG REAL ESTATE HOLDINGS-REG-S 6.95000% 19-23.07.23	1 550 000.00	240 885.50	0.06
USD	POWERLONG REAL ESTATE HOLDINGS-REG-S 6.25000% 20-10.08.24	800 000.00	115 150.00	0.03
USD	REDSUN PROPERTIES GRP-REG-S *DEFAULTED* 9.50000% 21-20.09.23	2 150 000.00	139 750.00	0.04
USD	RELANCE INDUSTRIES LTD-REG-S 2.87500% 22-12.01.32	4 300 000.00	3 354 645.00	0.84
USD	RENEW WIND ENER AP2 / RENEW POWER-REG-S 4.50000% 21-14.07.28	400 000.00	296 000.00	0.07
USD	RONSHINE CHNA HOL LTD-REG-S *DEFAULTED* 7.35000% 20-15.12.23	3 275 000.00	180 125.00	0.05
USD	SANDS CHINA LTD 3.10000% 22-08.03.29	1 800 000.00	1 335 303.36	0.33
USD	SANDS CHINA LTD 4.37500% 21-18.06.30	1 600 000.00	1 251 949.69	0.31
USD	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD-REG-S 5.20000% 21-16.01.27	2 000 000.00	240 000.00	0.06
USD	SHUI ON DEVELOPMENT HOLDINGLT-REG-S 5.50000% 21-29.06.26	450 000.00	265 725.00	0.07
USD	SINOPEC GRP OVERSEAS DEV LTD-REG-S 2.15000% 20-13.05.25	400 000.00	374 112.00	0.09
USD	SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULT* 6.75000% 18-18.04.28	750 000.00	183 656.25	0.05
USD	STATE BANK OF INDIA LONDON-REG-S 4.37500% 19-24.01.24	5 940 000.00	5 876 145.00	1.47
USD	STATE BANK OF INDIA LONDON-REG-S 4.50000% 18-28.09.23	750 000.00	746 670.00	0.19
USD	STUDIO CITY FINANCE LTD-REG-S 6.50000% 20-15.01.28	2 700 000.00	1 318 950.00	0.33
USD	SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD-REG-S 4.95000% 22-15.09.27	3 700 000.00	3 645 890.09	0.91
USD	TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.28000% 19-11.04.24	1 200 000.00	1 170 225.00	0.29
USD	TIMES CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 6.75000% 20-08.07.25	1 800 000.00	216 126.00	0.05
USD	TSMC GLOBAL LTD-REG-S 2.25000% 21-23.04.31	4 400 000.00	3 473 492.00	0.87
USD	VEDANTA RESOURCES PLC-REG-S 6.12500% 17-09.08.24	1 886 000.00	1 056 160.00	0.27
USD	WOORI BANK-REG-S 1.75000% 21-23.03.26	2 600 000.00	2 284 828.00	0.57
USD	WYNN MACAU LTD-REG-S 5.50000% 20-15.01.26	650 000.00	496 187.25	0.12
USD	YANGO JUSTICE INT LTD-REG-S *DEFAULTED* 7.50000% 20-15.04.24	1 675 000.00	83 750.00	0.02
USD	YANGO JUSTICE INT LTD-REG-S *DEFAULTED* 7.50000% 20-17.02.25	275 000.00	13 750.00	0.00
USD	YUZHOU PROPERTIES-REG-S *DEFAULTED* 7.37500% 20-13.01.26	6 224 000.00	389 000.00	0.10
USD	ZHENRO PROP GROUP-REG-S *DEFAULTED* 8.30000% 20-15.09.23	1 000 000.00	40 000.00	0.01
USD	ZHENRO PROP GROUP-REG-S *DEFAULTED* 7.35000% 20-05.02.25	2 575 000.00	103 000.00	0.03
Total USD			117 827 219.14	29.48

固定利付ノート合計	117 827 219.14	29.48
-----------	----------------	-------

変動利付ノート

USD				
USD	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES-REG-S-SUB 4.500%/VAR 21-PRP	450 000.00	298 200.02	0.07
USD	IND & COM BK CHINA MACAU-REG-S-SUB 2.875%/VAR 19-12.09.29	2 100 000.00	2 012 511.73	0.50
USD	OVERSEA-CHINESE BKNG-REG-S-SUB 1.832%/VAR 20-10.09.30	6 776 000.00	6 062 487.20	1.52
Total USD			8 373 198.95	2.09

変動利付ノート合計	8 373 198.95	2.09
-----------	--------------	------

固定利付ミディアム・ターム・ノート

USD				
USD	BANGKOK BANK PCL/HONG KONG-REG-S 4.30000% 22-15.06.27	2 800 000.00	2 702 084.00	0.68
USD	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT-REG-S 4.75000% 20-13.05.25	3 000 000.00	2 917 125.00	0.73
USD	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO-REG-S-SUB 3.75000% 21-30.03.26	725 000.00	639 892.25	0.16
USD	BANK OF CHINA LTD/PARIS 0.95000% 20-21.09.23	3 750 000.00	3 626 887.50	0.91
USD	BANK OF CHINA/HONG KONG-REG-S 3.62500% 19-17.04.29	400 000.00	377 884.00	0.09
USD	BDO UNIBANK INC-REG-S 2.95000% 17-06.03.23	2 000 000.00	1 979 125.00	0.49
USD	BOC AVIATION LTD-REG-S 3.50000% 19-10.10.24	3 950 000.00	3 805 456.43	0.95
USD	BOC AVIATION USA CORP-REG-S 1.62500% 21-29.04.24	4 000 000.00	3 776 524.52	0.94

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	評価額 米ドル 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD BOCOM LEASING MGT HONG KONG-REG-S 4.37500% 19-22.01.24	950 000.00	940 678.13	0.24
USD CDBL FUNDING 1-REG-S 3.50000% 20-24.10.27	6 308 000.00	5 792 699.48	1.45
USD CHINA CONSTRUCTION BANK CORP/HK-REG-S 1.25000% 20-04.08.25	3 000 000.00	2 739 900.00	0.69
USD CHINA DEVELOPMENT BANK CORP-REG-S 1.00000% 20-27.10.25	1 000 000.00	901 730.00	0.23
USD CHINA OVERSEAS FINAN CAYMAN VIII-REG-S 3.45000% 19-15.07.29	200 000.00	166 350.00	0.04
USD CICC HONG KONG FIN 2016 MTN LTD-REG-S 2.00000% 21-26.01.26	1 975 000.00	1 796 420.50	0.45
USD CITIC LTD-REG-S 3.50000% 22-17.02.32	3 850 000.00	3 291 865.50	0.82
USD CITIC LTD-REG-S 4.00000% 18-11.01.28	1 200 000.00	1 130 280.00	0.28
USD CMB INTERNATIONAL LEASING MGT LTD-REG-S 2.75000% 20-12.08.30	2 550 000.00	1 963 978.13	0.49
USD EXPORT IMPORT BANK OF THAILAND-REG-S 1.45700% 20-15.10.25	5 425 000.00	4 859 877.75	1.22
USD EXPORT-IMPORT BANK OF INDIA-REG-S 2.25000% 21-13.01.31	625 000.00	468 718.75	0.12
USD FAR EAST HORIZON LTD-REG-S 2.62500% 21-03.03.24	1 275 000.00	1 166 864.06	0.29
USD FAR EAST HORIZON LTD-REG-S 4.25000% 21-26.10.26	800 000.00	691 400.00	0.17
USD GC TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 2.98000% 21-18.03.31	600 000.00	471 112.50	0.12
USD GC TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 4.30000% 21-18.03.51	1 600 000.00	1 136 800.00	0.28
USD GLP CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 2.95000% 21-29.03.26	550 000.00	425 331.50	0.11
USD GREENKO POWER II LTD-REG-S 4.30000% 21-13.12.28	300 000.00	227 268.75	0.06
USD HONGKONG ELECTRIC FINANCE LTD-REG-S 1.87500% 20-27.08.30	1 900 000.00	1 484 197.94	0.37
USD HONGKONG LAND FINANCE CO LTD-REG-S 2.25000% 21-15.07.31	1 700 000.00	1 345 932.29	0.34
USD HUARONG FINANCE 2017 CO-REG-S 4.25000% 17-07.11.27	3 400 000.00	2 523 012.50	0.63
USD HUARONG FINANCE-REG-S 3.37500% 20-24.02.30	1 250 000.00	811 562.50	0.20
USD ICBCIL FINANCE CO LTD-REG-S 1.75000% 20-25.08.25	1 000 000.00	909 875.00	0.23
USD INDIAN RAILWAY FINANCE CORP LTD-REG-S 3.73000% 19-29.03.24	8 000 000.00	7 824 000.00	1.96
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 3.85000% 17-18.07.27	600 000.00	561 112.50	0.14
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 4.75000% 17-18.07.47	525 000.00	440 278.13	0.11
USD INDUSTRIAL COMMERCIAL BANK CHINA-REG-S 1.20000% 20-09.09.25	3 525 000.00	3 204 612.75	0.80
USD INVENTIVE GLOBAL INVESTMENTS LTD-REG-S 1.10000% 21-01.09.24	7 251 000.00	6 739 730.76	1.69
USD KASIKORN BANK PCL/HONG KONG-REG-S 3.25600% 18-12.07.23	2 555 000.00	2 525 936.88	0.63
USD LINK FINANCE CAYMAN 2009 LTD-REG-S 3.60000% 14-03.09.24	1 000 000.00	978 007.10	0.24
USD NWD MTN LTD-REG-S 4.50000% 20-19.05.30	1 000 000.00	802 009.70	0.20
USD OVERSEA-CHINESE BANKING CORP-REG-S-SUB 4.25000% 14-19.06.24	7 000 000.00	6 914 512.50	1.73
USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 7.37500% 21-08.04.31	3 150 000.00	1 134 000.00	0.28
USD PERTAMINA PT-REG-S 6.45000% 14-30.05.44	800 000.00	736 650.00	0.18
USD PERTAMINA PT-REG-S 6.50000% 18-07.11.48	900 000.00	824 512.50	0.21
USD PSA TREASURY PTE LTD-REG-S 2.12500% 19-05.09.29	500 000.00	424 741.20	0.11
USD REC LTD-REG-S 2.25000% 21-01.09.26	2 295 000.00	1 989 908.44	0.50
USD REDCO PROPERTIES GROUP LTD-REG-S 9.90000% 20-17.02.24	2 050 000.00	314 931.25	0.08
USD RHB BANK BHD-REG-S 1.65800% 21-29.06.26	1 350 000.00	1 191 753.00	0.30
USD SHINHAN FIN GROUP CO LTD-REG-S 1.35000% 20-10.01.26	3 275 000.00	2 900 929.50	0.73
USD SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD-REG-S 5.10000% 20-16.07.23	500 000.00	483 250.00	0.12
USD SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD-REG-S 4.40000% 21-13.03.24	600 000.00	558 750.00	0.14
USD SIAM COMMERCIAL BK CAYMAN ISLAND-REG-S 2.75000% 17-16.05.23	3 800 000.00	3 754 400.00	0.94
USD SIAM COMMERCIAL BK CAYMAN ISLAND-REG-S 3.90000% 19-11.02.24	1 600 000.00	1 578 800.00	0.39
USD SINGAPORE AIRLINES LTD-REG-S 3.00000% 21-20.07.26	1 700 000.00	1 590 233.45	0.40
USD SINGAPORE EXCHANGE LTD-REG-S 1.23400% 21-03.09.26	4 975 000.00	4 367 183.86	1.09
USD SINGTEL GROUP TREASURY PTE LTD-REG-S 3.25000% 15-30.06.25	1 000 000.00	962 928.30	0.24
USD SINOCHEN OFFSHORE CAPITAL CO LTD-REG-S 2.37500% 21-23.09.31	200 000.00	153 206.00	0.04
USD SP GROUP TREASURY PTE LTD-REG-S 3.37500% 19-27.02.29	600 000.00	559 365.60	0.14
USD SP POWERASSETS LTD-REG-S 3.25000% 15-24.11.25	1 000 000.00	957 291.30	0.24
USD STATE BANK OF INDIA/LONDON-REG-S 1.80000% 21-13.07.26	300 000.00	264 153.00	0.07
USD STATE GRID OVERSEAS INVESTMENT-REG-S 3.50000% 17-04.05.27	2 750 000.00	2 626 635.00	0.66
USD STATE GRID OVERSEAS INVESTMENT-REG-S 4.25000% 18-02.05.28	2 657 000.00	2 586 921.63	0.65
USD SUN HUNG KAI PROP CAP MRKT LTD-REG-S 2.87500% 20-21.01.30	900 000.00	776 736.81	0.19
USD SWIRE PACIFIC MTN FINANCING LTD-REG-S 4.50000% 13-09.10.23	1 500 000.00	1 495 640.70	0.37
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.92500% 18-19.01.38	600 000.00	470 362.50	0.12
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.24000% 20-03.06.50	2 000 000.00	1 220 375.00	0.30
USD THAI OIL TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 3.50000% 19-17.10.49	4 000 000.00	2 362 000.00	0.59
USD THAI OIL TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 3.75000% 20-18.06.50	3 300 000.00	2 032 074.00	0.51

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	評価額 米ドル 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注 1)	純資産 割合 (%)
USD WHEELLOCK MTN BVI LTD-REG-S 2.37500% 21-25.01.26	1 970 000.00	1 797 993.49	0.45
USD YES BANK IFSC BANKING UNIT BR-REG-S 3.75000% 18-06.02.23	300 000.00	293 775.00	0.07
Total USD		125 470 535.83	31.39
固定利付ミディアム・ターム・ノート合計		125 470 535.83	31.39
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	242 996.88	0.06
USD DAH SING BANK LTD-REG-S-SUB 3.000%/VAR 21-02.11.31	2 000 000.00	1 783 418.54	0.45
USD DBS GROUP HOLDINGS LTD-REG-S-SUB 4.520%/VAR 18-11.12.28	1 000 000.00	990 355.49	0.25
USD KASIKORNBANK PCL-REG-S-SUB 5.275%/VAR 20-PRP	350 000.00	309 378.13	0.08
USD SHINHAN FIN GROUP CO LTD-REG-S-SUB 3.340%/VAR 19-05.02.30	5 175 000.00	4 849 298.43	1.21
USD WING LUNG BANK LTD-REG-S-SUB 3.750%/H15T5Y+175BP 17-22.11.27	625 000.00	623 818.75	0.15
Total USD		8 799 266.22	2.20
変動利付ミディアム・ターム・ノート合計		8 799 266.22	2.20
固定利付債券			
USD			
USD AGILE GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 6.05000% 20-13.10.25	600 000.00	167 737.50	0.04
USD BAIDU INC 3.87500% 18-29.09.23	988 000.00	975 887.12	0.24
USD BANK RAKYAT INDONESIA-REG-S 3.95000% 19-28.03.24	725 000.00	705 062.50	0.18
USD BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO-REG-S-SUB 4.20000% 20-23.01.25	250 000.00	229 375.00	0.06
USD BIM LAND JSC-REG-S 7.37500% 21-07.05.26	1 200 000.00	911 100.00	0.23
USD CHINA EVERGRANDE GRO-REG-S *DEFAULTED* 7.50000% 17-28.06.23	900 000.00	55 575.00	0.01
USD CHINA EVERGRANDE GRO-REG-S *DEFAULTED* 8.75000% 17-28.06.25	2 500 000.00	150 000.00	0.04
USD CHINA SCE GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 7.25000% 19-19.04.23	200 000.00	64 000.00	0.02
USD CHINA SCE PROPERTY HOLDINGS LTD-REG-S 5.95000% 21-29.09.24	3 475 000.00	672 846.88	0.17
USD CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD-REG-S 5.25000% 20-13.05.26	300 000.00	58 500.00	0.01
USD CMHI FINANCE BVI CO LTD-REG-S 5.00000% 18-06.08.28	1 750 000.00	1 730 312.50	0.43
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 5.62500% 20-14.01.30	7 400 000.00	2 109 000.00	0.53
USD EHI CAR SERVICES LTD-REG-S 7.75000% 21-14.11.24	625 000.00	356 250.00	0.09
USD FPC RESOURCES LTD-REG-S 4.37500% 20-11.09.27	200 000.00	191 225.00	0.05
USD GOHL CAPITAL LTD-REG-S 4.25000% 17-24.01.27	1 150 000.00	962 262.50	0.24
USD GREENKO DUTCH BV-REG-S 3.85000% 21-29.03.26	815 000.00	622 660.00	0.16
USD HUTCHISON WHAMPOA INTERNATIONAL14-REG-S 3.62500% 14-31.10.24	10 572 000.00	10 283 252.25	2.57
USD INDUSTRIAL BANK OF KOREA-REG-S 0.62500% 21-17.09.24	8 775 000.00	8 113 101.75	2.03
USD KAISA GROUP HOLDINGS-REG-S *DEFAULT* 11.70000% 21-11.11.25	1 000 000.00	101 125.01	0.03
USD KWG GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 5.87500% 17-10.11.24	800 000.00	152 000.00	0.04
USD KWG GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 7.87500% 19-01.09.23	1 500 000.00	332 730.00	0.08
USD LMIRT CAPITAL PTE LTD-REG-S 7.50000% 21-09.02.26	1 200 000.00	782 880.00	0.20
USD LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 3.95000% 19-16.09.29	1 500 000.00	976 218.75	0.24
USD LS FINANCE 2017 LTD-REG-S 4.80000% 21-18.06.26	1 000 000.00	718 690.00	0.18
USD MALAYSIA WAKALA SUKUK BHD-REG-S 3.07500% 21-28.04.51	1 750 000.00	1 340 171.88	0.34
USD MINERA Y METALURGICA DEL BOLEO-REG-S 3.25000% 19-17.04.24	1 100 000.00	1 070 300.00	0.27
USD MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 4.45000% 21-07.07.31	500 000.00	327 555.00	0.08
USD NWD MTN LTD-REG-S 4.12500% 19-18.07.29	1 425 000.00	1 149 390.75	0.29
USD OIL INDIA LTD-REG-S 5.12500% 19-04.02.29	268 000.00	252 640.25	0.06
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 3.95000% 15-20.01.40	2 925 000.00	2 325 696.75	0.58
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 3.70000% 16-01.03.41	4 450 000.00	3 404 739.50	0.85
USD POWERLONG REAL ESTATE HOLDINGS-REG-S 5.95000% 20-30.04.25	500 000.00	63 531.25	0.02
USD POWERLONG REAL ESTATE HOLDING LTD-REG-S 4.90000% 21-13.05.26	3 000 000.00	375 000.00	0.09
USD RKPF OVERSEAS 2020 A LTD-REG-S 5.12500% 21-26.07.26	2 600 000.00	884 000.00	0.22
USD SHINHAN CARD CO LTD-REG-S 1.37500% 21-23.06.26	3 800 000.00	3 256 486.00	0.81

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄		数量 / 額面	評価額 米ドル 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD	SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULT* 6.85000% 15-03.11.25	2 500 000.00	625 468.75	0.16
USD	STATE GRID OVERSEAS INV 2013 LTD-REG-S 3.12500% 13-22.05.23	250 000.00	247 610.00	0.06
USD	SUNAC CHINA HOLDINGS-REG-S *DEFAULTED* 6.50000% 20-10.01.25	3 000 000.00	390 000.00	0.10
USD	TALENT YIELD INTERNATIONAL LTD-REG-S 3.12500% 21-06.05.31	200 000.00	169 850.00	0.04
USD	WEST CHINA CEMENT LTD-REG-S 4.95000% 21-08.07.26	300 000.00	211 931.25	0.05
USD	WOORI BANK-REG-S-SUB 4.75000% 14-30.04.24	2 000 000.00	1 977 875.00	0.49
USD	YUZHOU PROPERTIES-REG-S *DEFAULTED* 8.30000% 19-27.05.25	2 275 000.00	142 187.50	0.04
Total USD			49 636 225.64	12.42
固定利付債券合計			49 636 225.64	12.42
変動利付債券				
USD				
USD	BANK OF COMMUNICATIONS H/K-REG-S 2.304%/VAR 21-08.07.31	3 500 000.00	3 141 013.72	0.79
USD	BANK OF EAST ASIA LTD/THE-REG-S-SUB 5.875%/VAR 19-PRP	500 000.00	451 250.00	0.11
USD	CHINA CONSTRUCTION BK CORP-REG-S-SUB 2.450%/VAR 20-24.06.30	225 000.00	209 648.25	0.05
USD	CHINA MINMETALS CORP-REG-S 3.750%/VAR 17-PRP	250 000.00	249 457.50	0.06
USD	GLOBE TELECOM INC-REG-S 4.200%/VAR 21-PRP	900 000.00	792 168.75	0.20
USD	HUANENG HONG KONG CAPITAL LTD-REG-S 3.600%/VAR 17-PRP	500 000.00	499 090.00	0.12
USD	INDUSTRIAL & COMM BK OF CHINA-REG-S 3.200%/VAR 21-PRP	200 000.00	183 112.00	0.05
USD	SINO OCEAN LAND TREASURE-REG-S-SUB 4.900%/VAR 17-PRP	525 000.00	126 426.56	0.03
USD	SMC GLOBAL POWER HOLDINGS CORP-REG-S 5.450%/VAR 21-PRP	1 800 000.00	1 462 950.00	0.37
Total USD			7 115 116.78	1.78
変動利付債券合計			7 115 116.78	1.78
変動利付転換社債				
USD				
USD	KRUNG THAI/CAYMAN ISLANDS-REG-S-SUB COCO 4.400%/VAR 21-PRP	1 175 000.00	947 978.25	0.24
Total USD			947 978.25	0.24
変動利付転換社債合計			947 978.25	0.24
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			318 169 540.81	79.60

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

短期割引国債、ゼロ・クーポン

USD

USD	AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 24.02.22-23.02.23	15 000 000.00	14 789 350.50	3.70
Total USD			14 789 350.50	3.70

短期割引国債、ゼロ・クーポン合計

14 789 350.50 3.70

固定利付債券

USD

USD	MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 3.50000% 21-07.07.27	500 000.00	342 555.00	0.09
Total USD			342 555.00	0.09

固定利付債券合計

342 555.00 0.09

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

15 131 905.50 3.79

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	評価額 米ドル 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
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	10 560 893.58	2.64
Total Hong Kong		10 560 893.58	2.64
ルクセンブルグ			
USD UBS (LUX) BD SICAV-ASIAN INVEST GR BDS SUSTAIN (USD) U-X-ACC	1 500.00	16 959 780.00	4.24
USD UBS (LUX) BOND SICAV - MULTI INCOME (USD)-U-X-ACC- CAP	120.00	1 133 782.80	0.28
USD UBS (LUX) BOND SICAV - CHINA HIGH YIELD (USD) U-X-ACC	1 500.00	6 144 735.00	1.54
ルクセンブルグ合計		24 238 297.80	6.06
投資信託、オープン・エンド型合計		34 799 191.38	8.70
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		34 799 191.38	8.70
投資有価証券合計		368 100 637.69	92.09

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	評価額 米ドル 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
派生商品			
公認の証券取引所に上場されている派生商品			
債券に係る金融先物			
JPY JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 13.12.22	-13.00	26 529.41	0.01
USD US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 20.12.22	94.00	-1 064 843.75	-0.27
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 20.12.22	77.00	-295 968.75	-0.07
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.12.22	7.00	-26 304.68	-0.01
債券に係る金融先物合計		-1 360 587.77	-0.34
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		-1 360 587.77	-0.34
派生商品合計		-1 360 587.77	-0.34

為替予約契約

購入通貨	購入額	売却通貨	売却額	満期日		
GBP	69 364 100.00	USD	80 207 935.42	18.10.2022	-2 753 063.49	-0.69
SGD	4 874 900.00	USD	3 473 878.29	18.10.2022	-76 048.66	-0.02
EUR	115 179 800.00	USD	115 492 858.70	18.10.2022	-2 546 720.66	-0.64
USD	1 196 187.00	EUR	1 193 800.00	18.10.2022	25 538.16	0.01
USD	44 209.98	SGD	62 200.00	18.10.2022	856.27	0.00
USD	63 116.36	GBP	55 200.00	18.10.2022	1 477.72	0.00
USD	1 589 983.58	EUR	1 609 200.00	18.10.2022	11 990.52	0.00
USD	2 733 666.82	EUR	2 840 900.00	18.10.2022	-52 140.10	-0.01
USD	1 550 076.18	GBP	1 443 600.00	18.10.2022	-61 908.31	-0.02
USD	59 092.90	SGD	85 000.00	18.10.2022	-152.52	0.00
GBP	8 620 700.00	USD	9 461 944.11	18.10.2022	164 292.15	0.04
USD	1 206 924.16	EUR	1 237 300.00	18.10.2022	-6 381.09	0.00
USD	40 526.70	SGD	58 200.00	18.10.2022	-38.99	0.00
USD	1 024 445.65	GBP	925 200.00	18.10.2022	-8 671.59	0.00
為替予約契約合計					-5 300 970.59	-1.33
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					25 503 130.49 *	6.38
その他の資産および負債					12 780 284.68	3.20
純資産合計					399 722 494.50	100.00

* 2022年9月30日現在、260,000米ドルの現金が取引相手方であるシティバンクに対する担保となっている。

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）
2022年9月30日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
固定利付ノート			
EUR			
EUR ADIENT GLOBAL HOLDINGS LTD-REG-S 3.50000% 16-15.08.24	7 504 000.00	6 914 936.00	0.59
EUR ALTICE FINCO SA-REG-S 4.75000% 17-15.01.28	7 880 000.00	5 724 788.48	0.49
EUR ALTICE FRANCE HOLDING SA-REG-S 8.00000% 19-15.05.27	21 655 000.00	16 372 046.20	1.40
EUR ALTICE FRANCE-REG-S 5.87500% 18-01.02.27	29 080 000.00	25 085 862.00	2.15
EUR ARD FINANCE SA-REG-S (PIK) 5.00000% 19-30.06.27	5 656 621.00	3 846 502.28	0.33
EUR ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-REG-S 2.12500% 19-15.08.26	3 383 000.00	2 596 227.60	0.22
EUR AUTOSTRADA PER L'ITALIA SPA-REG-S 2.00000% 20-04.12.28	5 145 000.00	3 960 518.10	0.34
EUR BOXER PARENT CO INC-REG-S 6.50000% 20-02.10.25	5 715 000.00	5 343 524.99	0.46
EUR BRITISH AIRWAYS PLC-REG-S 2.75000% 21-25.03.25	4 300 000.00	3 576 972.80	0.31
EUR CHEPLAPHARM ARZNEIMITTEL GMBH-REG-S 3.50000% 20-11.02.27	4 015 000.00	3 278 271.59	0.28
EUR CONSOLIDATED ENERGY FINANCE SA-REG-S 5.00000% 21-15.10.28	5 005 000.00	3 841 337.50	0.33
EUR CROWN EUROPEAN HOLDINGS SA-REG-S 2.87500% 18-01.02.26	10 210 000.00	9 342 150.00	0.80
EUR DEMIRE DUTCH MITSTND REL EST AG-REG-S 1.87500% 19-15.10.24	4 500 000.00	3 256 650.00	0.28
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA AG-REG-S 2.87500% 21-11.02.25	1 900 000.00	1 700 500.00	0.15
EUR DKT FINANCE APS-REG-S 7.00000% 18-17.06.23	40 281 000.00	39 273 975.00	3.37
EUR DUFREY ONE BV-REG-S 2.00000% 19-15.02.27	3 740 000.00	2 839 707.20	0.24
EUR EG GLOBAL FINANCE PLC-REG-S 4.37500% 19-07.02.25	5 605 000.00	4 820 300.00	0.41
EUR EG GLOBAL FINANCE PLC-REG-S 3.62500% 19-07.02.24	2 100 000.00	1 857 450.00	0.16
EUR EG GLOBAL FINANCE PLC-REG-S 6.25000% 19-30.10.25	6 260 000.00	5 412 646.40	0.46
EUR ELIOR GROUP SA-REG-S 3.75000% 21-15.07.26	2 390 000.00	1 816 201.79	0.16
EUR EP INFRASTRUCTURE AS-REG-S 1.69800% 19-30.07.26	2 300 000.00	1 702 000.00	0.15
EUR FAURECIA SE-REG-S 3.75000% 20-15.06.28	13 740 000.00	10 390 875.00	0.89
EUR FAURECIA-REG-S 2.75000% 21-15.02.27	6 390 000.00	4 904 325.00	0.42
EUR FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.38600% 19-17.02.26	6 645 000.00	5 777 163.00	0.50
EUR FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.33000% 19-25.11.25	3 670 000.00	3 211 250.00	0.28
EUR GARFUNKELUX HOLDCO 3 SA-REG-S 6.75000% 20-01.11.25	6 455 000.00	4 978 741.50	0.43
EUR GRIFOLS ESCROW ISSUER SA-REG-S 3.87500% 21-15.10.28	5 430 000.00	3 991 864.50	0.34
EUR GTC AURORA LUXEMBOURG SA-REG-S 2.25000% 21-23.06.26	4 400 000.00	3 251 952.00	0.28
EUR HOUSE OF FINANCE NV/THE-REG-S 4.37500% 19-15.07.26	500 000.00	500 116.00	0.04
EUR HOUSE OF HR-REG-S-SUB 7.50000% 20-15.01.27	10 905 000.00	10 993 723.08	0.94
EUR IHO VERWALTUNGS GMBH-REG-S (PIK) 3.87500% 19-15.05.27	2 585 000.00	1 979 593.00	0.17
EUR ILIAD HOLDING SASU-REG-S 5.12500% 21-15.10.26	5 950 000.00	5 369 875.00	0.46
EUR ILIAD HOLDING SASU-REG-S 5.62500% 21-15.10.28	3 000 000.00	2 569 050.00	0.22
EUR INEOS QUATTRO FINANCE 1 PLC-REG-S 3.75000% 21-15.07.26	7 220 000.00	5 532 325.00	0.47
EUR INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC-REG-S 3.50000% 19-15.06.26	3 608 000.00	3 202 100.00	0.27
EUR INTL CONSOLIDATED AIRLINES GP-REG-S 3.75000% 21-25.03.29	1 600 000.00	1 072 000.00	0.09
EUR INTRUM AB-REG-S 3.00000% 19-15.09.27	1 680 000.00	1 243 200.00	0.11
EUR IQVIA INC-REG-S 2.25000% 19-15.01.28	5 135 000.00	4 122 511.51	0.35
EUR IQVIA INC-REG-S 2.87500% 20-15.06.28	5 030 000.00	4 086 875.00	0.35
EUR JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-REG-S 6.87500% 19-15.11.26	4 760 000.00	3 711 562.40	0.32
EUR JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-REG-S 5.87500% 19-15.11.24	4 511 000.00	3 969 228.90	0.34
EUR LA FINANCIERE ITALIAN SA-REG-S 5.12500% 18-15.05.25	465 000.00	441 168.75	0.04
EUR LABORATOIRE EIMER SELARL-REG-S 5.00000% 21-01.02.29	3 735 000.00	2 685 352.95	0.23
EUR LHMC FINCO SARL-REG-S 6.25000% 18-20.12.23	2 951 000.00	2 436 989.65	0.21
EUR LINCOLN FINANCING SARL-REG-S 3.62500% 19-01.04.24	5 940 000.00	5 726 160.00	0.49
EUR LOXAM SAS-REG-S 3.75000% 19-15.07.26	8 735 000.00	7 371 518.91	0.63
EUR MONITCHEM HOLDCO 2 SA-REG-S-SUB 9.50000% 19-15.09.26	8 422 000.00	7 790 350.00	0.67
EUR MONITCHEM HOLDCO 3 SA-REG-S 5.25000% 19-15.03.25	2 470 000.00	2 235 350.00	0.19
EUR NETFLIX INC 3.62500% 17-15.05.27	4 325 000.00	4 065 984.40	0.35

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
EUR NIDDA BONDCO GMBH-REG-S 5.00000% 17-30.09.25	4 675 000.00	4 056 974.35	0.35
EUR NIDDA HEALTHCARE HOLDING AG-REG-S 3.50000% 17-30.09.24	15 780 000.00	14 280 900.00	1.22
EUR NIDDA HEALTHCARE HOLDING AG-REG-S 3.50000% 20-30.09.24	4 725 000.00	4 254 390.00	0.36
EUR ONTEX GROUP N.V-REG-S 3.50000% 21-15.07.26	4 390 000.00	3 435 701.80	0.29
EUR PUBLIC POWER CORP SA-REG-S 3.87500% 21-30.03.26	4 500 000.00	3 947 985.00	0.34
EUR ROLLS-ROYCE PLC-REG-S 4.62500% 20-16.02.26	2 500 000.00	2 284 450.00	0.20
EUR SAIPEM FINANCE INTERNATIONAL BV-REG-S 3.37500% 20-15.07.26	3 320 000.00	2 589 799.20	0.22
EUR SAZKA GROUP AS-REG-S 4.12500% 19-20.11.24	1 750 000.00	1 645 000.00	0.14
EUR SAZKA GROUP AS-REG-S 3.87500% 20-15.02.27	4 090 000.00	3 435 600.00	0.30
EUR SILGAN HOLDINGS INC 2.25000% 20-01.06.28	4 060 000.00	3 247 025.60	0.28
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 3.12500% 17-19.09.25	1 645 000.00	1 406 787.55	0.12
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 5.00000% 18-15.04.28	6 410 000.00	5 050 347.33	0.43
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 2.12500% 21-06.07.24	5 170 000.00	4 743 475.00	0.41
EUR SUMMER BC HOLDCO A SARL-REG-S 9.25000% 19-31.10.27	10 950 000.00	7 848 821.67	0.67
EUR TELE COLUMBUS AG-REG-S 3.87500% 18-02.05.25	7 885 000.00	6 358 527.08	0.55
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 4.50000% 18-01.03.25	12 198 000.00	11 483 654.63	0.99
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FIN 6.00000% 20-31.01.25	14 170 000.00	13 831 691.25	1.19
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 3.75000% 21-09.05.27	2 870 000.00	2 413 131.87	0.21
EUR TITAN HOLDINGS II BV-REG-S 5.12500% 21-15.07.29	3 940 000.00	3 083 050.00	0.26
EUR TUI CRUISES GMBH-REG-S 6.50000% 21-15.05.26	3 880 000.00	2 929 400.00	0.25
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 4.87500% 17-01.07.24	5 340 000.00	4 959 578.40	0.43
EUR VERISURE HOLDING AB-REG-S 9.25000% 22-15.10.27	1 065 000.00	1 077 999.92	0.09
EUR VERISURE MIDHOLDING AB-REG-S 5.25000% 21-15.02.29	2 880 000.00	2 116 800.00	0.18
EUR VERTICAL HOLDCO GMBH-REG-S 6.62500% 20-15.07.28	2 050 000.00	1 448 325.00	0.12
EUR VIRGIN MEDIA FINANCE PLC-REG-S 3.75000% 20-15.07.30	1 290 000.00	921 382.50	0.08
EUR WMG ACQUISITION CORP-REG-S 2.25000% 21-15.08.31	1 925 000.00	1 371 562.50	0.12
Total EUR		384 396 134.13	32.96
GBP			
GBP BRACKEN MIDCO1 PLC-REG-S 6.75000% 21-01.11.27	3 380 000.00	2 696 030.01	0.23
GBP LA FINANCIERE ITALIAN SA-REG-S 6.62500% 18-15.05.25	940 000.00	1 019 705.55	0.09
GBP MPT OPERATING PARTNERSHIP LP/FIN CORP 2.55000% 19-05.12.23	1 030 000.00	1 089 525.57	0.10
GBP PINNACLE BIDCO PLC-REG-S 6.37500% 18-15.02.25	6 420 000.00	6 218 189.25	0.53
Total GBP		11 023 450.38	0.95
USD			
USD ITHACA ENERGY NORTH SEA PLC-REG-S 9.00000% 21-15.07.26	3 430 000.00	3 308 611.65	0.28
USD NEPTUNE ENERGY BONDCO PLC-REG-S 6.62500% 18-15.05.25	12 545 000.00	11 888 265.12	1.02
Total USD		15 196 876.77	1.30
固定利付ノート合計		410 616 461.28	35.21
変動利付ノート			
EUR			
EUR ABANCA CORP BANCARIA SA-REG-S-SUB VAR 21-PRP	3 400 000.00	2 681 750.00	0.23
EUR ABERTIS INFRA FINANCE BV-REG-S-SUB 3.248%/VAR 20-PRP	7 700 000.00	6 225 388.40	0.53
EUR ACCOR SA-REG-S-SUB 2.625%/VAR 19-PRP	5 800 000.00	4 463 169.60	0.38
EUR BANCO BPM SPA-REG-S-SUB 5.000%/VAR 20-14.09.30	3 340 000.00	3 110 655.56	0.27
EUR BANQUE INTL A LUXEMBOURG SA-REG-S-SUB VAR 19-PRP	3 800 000.00	3 146 400.00	0.27
EUR BAYER AG-REG-S-SUB 5.375%/VAR 22-25.03.82	2 800 000.00	2 310 364.00	0.20
EUR CASTELLUM AB-REG-S 3.125%/VAR 21-PRP	2 990 000.00	1 697 183.80	0.15
EUR CITYCON OYJ-REG-S-SUB 3.250%/VAR 21-PRP	2 140 000.00	1 224 957.40	0.11
EUR DEUTSCHE BANK AG-REG-S-SUB 6.750%/VAR 22-PRP	2 800 000.00	2 226 112.00	0.19
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 3.375%/VAR 20-PRP	7 400 000.00	5 018 102.80	0.43
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 2.875%/VAR 20-PRP	7 400 000.00	5 632 880.00	0.48
EUR FASTIGHETS AB BALDER-REG-S-SUB 2.873%/VAR 21-02.06.81	1 640 000.00	1 092 650.00	0.09
EUR HEIMSTADEN AB-REG-S-SUB 6.750%/VAR 21-PRP	5 100 000.00	3 208 563.00	0.28

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
EUR KONINKLIJKE KPN-REG-S-SUB 6.000%/VAR 22-PRP	960 000.00	937 392.00	0.08
EUR NOVO BANCO SA-REG-S-SUB 8.500%/VAR 18-06.07.28	2 800 000.00	2 540 720.00	0.22
EUR RAIFFEISEN BANK INTER-REG-S-SUB 7.375%/VAR 22-20.12.32	2 700 000.00	2 588 592.60	0.22
EUR REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S-SUB 3.750%/VAR 20-PRP	2 095 000.00	1 854 075.00	0.16
EUR REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV-SUB 4.247%/VAR 20-PRP	2 395 000.00	1 966 893.75	0.17
EUR SAMHALLSBYGGNADSBOLAGET I NORDEN-REG-S-SUB 2.875%/VAR 21-PRP	4 095 000.00	1 652 742.00	0.14
EUR VODAFONE GROUP PLC-REG-S-SUB 3.000%/VAR 20-27.08.80	3 230 000.00	2 382 932.50	0.20
Total EUR		55 961 524.41	4.80
GBP			
GBP TVL FINANCE PLC-REG-S O/N SONIA+537.5BP 19-15.07.25	5 040 000.00	5 125 647.59	0.44
Total GBP		5 125 647.59	0.44
変動利付ノート合計		61 087 172.00	5.24
固定利付ミディアム・ターム・ノート			
EUR			
EUR ATLANTIA SPA-REG-S 1.87500% 17-13.07.27	2 400 000.00	1 918 104.00	0.16
EUR AUTOSTRADA PER L'ITALIA SPA-REG-S 1.75000% 15-26.06.26	7 760 000.00	6 772 928.00	0.58
EUR AUTOSTRADA PER L'ITALIA SPA-REG-S 1.75000% 16-01.02.27	5 280 000.00	4 412 812.80	0.38
EUR BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA-REG-S 3.62500% 19-24.09.24	5 055 000.00	4 575 472.59	0.39
EUR BANCO BPM SPA-REG-S 6.00000% 22-13.09.26	4 335 000.00	4 291 511.28	0.37
EUR CELLNEX FINANCE CO SA-REG-S 2.00000% 21-15.09.32	4 800 000.00	3 180 902.40	0.27
EUR CELLNEX FINANCE CO SA-REG-S 2.25000% 22-12.04.26	8 100 000.00	7 300 854.00	0.63
EUR CELLNEX TELECOM SA-REG-S 2.87500% 17-18.04.25	600 000.00	573 048.00	0.05
EUR DEUTSCHE BANK AG-SUB 4.50000% 16-19.05.26	3 100 000.00	2 958 671.00	0.25
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA AG-REG-S 3.75000% 21-11.02.28	1 100 000.00	865 374.40	0.07
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA AG-REG-S 3.50000% 21-14.07.29	2 800 000.00	2 050 518.40	0.18
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA AG-REG-S 2.87500% 21-16.05.27	6 100 000.00	4 755 560.00	0.41
EUR FASTIGHETS AB BALDER-REG-S 1.25000% 20-28.01.28	3 780 000.00	2 740 500.00	0.23
EUR FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.25000% 20-15.09.25	2 740 000.00	2 479 563.00	0.21
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB 2.92500% 20-14.10.30	2 760 000.00	2 080 532.16	0.18
EUR NASSA TOPCO AS-REG-S 2.87500% 17-06.04.24	9 014 000.00	8 543 018.50	0.73
EUR PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 2.75000% 15-21.04.27	1 130 000.00	794 743.11	0.07
EUR PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 4.87500% 17-21.02.28	1 585 000.00	1 162 993.75	0.10
EUR PPF ARENA 1 BV-REG-S 2.12500% 19-31.01.25	500 000.00	460 000.00	0.04
EUR PPF TELECOM GROUP BV-REG-S 3.25000% 20-29.09.27	4 040 000.00	3 443 873.76	0.30
EUR RENAULT SA-REG-S 2.37500% 20-25.05.26	14 300 000.00	11 920 851.80	1.02
EUR RENAULT SA-REG-S 2.50000% 21-02.06.27	3 100 000.00	2 464 500.00	0.21
EUR ROLLS-ROYCE PLC-REG-S 1.62500% 18-09.05.28	1 700 000.00	1 200 506.00	0.10
EUR SAMHALLSBYGGNADSBOLAGET I NORDEN-REG-S 1.12500% 19-04.09.26	2 730 000.00	2 042 313.00	0.18
EUR SHAEFFLER AG-REG-S 3.37500% 20-12.10.28	6 500 000.00	5 290 025.00	0.45
EUR TELECOM ITALIA FINANCE SA 7.75000% 03-24.01.33	2 902 000.00	2 989 060.00	0.26
EUR TELECOM ITALIA SPA-REG-S 3.00000% 16-30.09.25	2 800 000.00	2 558 500.00	0.22
EUR TELECOM ITALIA SPA-REG-S 2.37500% 17-12.10.27	8 490 000.00	6 697 149.72	0.57
EUR TELECOM ITALIA SPA-REG-S 2.87500% 18-28.01.26	4 230 000.00	3 776 087.16	0.32
EUR TELECOM ITALIA SPA-REG-S 2.75000% 19-15.04.25	1 750 000.00	1 609 930.00	0.14
EUR TEOLLISUUDEN VOIMA OY-REG-S 1.12500% 19-09.03.26	4 557 000.00	4 018 098.30	0.35
EUR THYSSENKRUPP AG-REG-S 2.87500% 19-22.02.24	4 200 000.00	3 939 600.00	0.34
EUR ZF FINANCE GMBH-REG-S 3.75000% 20-21.09.28	6 700 000.00	5 210 965.20	0.45
EUR ZF FINANCE GMBH-REG-S 3.00000% 20-21.09.25	1 700 000.00	1 504 540.80	0.13
EUR ZF FINANCE GMBH-REG-S 2.75000% 20-25.05.27	5 500 000.00	4 362 600.00	0.37
EUR ZF FINANCE GMBH-REG-S 2.00000% 21-06.05.27	1 800 000.00	1 390 348.80	0.12
Total EUR		126 336 056.93	10.83

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD			
USD ENQUEST PLC-144A-REG-S (PIK) 7.00000% 16-15.10.23	14 155 850.00	13 657 368.24	1.17
Total USD		13 657 368.24	1.17
固定利付メディアム・ターム・ノート合計		139 993 425.17	12.00
変動利付メディアム・ターム・ノート			
EUR			
EUR BANCO BPM SPA-REG-S-SUB 3.250%/VAR 20-14.01.2031	2 185 000.00	1 867 082.50	0.16
EUR BANCO COMERCIAL PORTUGUES-REG-S-SUB 4.500%/VAR 17-07.12.27	1 500 000.00	1 320 000.00	0.11
EUR BANCO COMERCIAL PORTUGUES-REG-S-SUB 3.871%/VAR 19-27.03.30	2 600 000.00	2 087 415.20	0.18
EUR BANK OF CYPRUS HOLDINGS-REG-S-SUB 6.625%/VAR 21-23.10.31	4 045 000.00	3 412 726.05	0.29
EUR COMMERZBANK AG-REG-S-SUB 4.000%/VAR 20-05.12.30	3 000 000.00	2 727 438.00	0.24
EUR DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG-REG-S-SUB 2.875%/VAR 17-28.06.27	1 700 000.00	1 499 223.20	0.13
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 5.000%/VAR 14-PRP	3 000 000.00	2 610 000.00	0.22
EUR PIRAEUS GROUP FINANCE PLC-REG-S-SUB 9.750%/VAR 19-26.06.29	5 315 000.00	5 162 565.80	0.44
EUR UNIPOLSAI SPA-SUB 5.750%/VAR 14-PRP	3 090 000.00	2 908 771.50	0.25
Total EUR		23 595 222.25	2.02
変動利付メディアム・ターム・ノート合計		23 595 222.25	2.02
固定利付債券			
EUR			
EUR 888 ACQUISITIONS LTD-REG-S 7.5580% 22-15.07.27	4 340 000.00	3 613 050.00	0.31
EUR ADEVINTA ASA-REG-S 2.62500% 20-15.11.25	3 470 000.00	3 157 700.00	0.27
EUR ALMAVIVA-THE ITALIAN INNOVATION-REG-S 4.87500% 21-30.10.26	8 210 000.00	6 888 659.69	0.59
EUR ALTICE FINANCING SA-REG-S 2.25000% 20-15.01.25	1 060 000.00	930 892.00	0.08
EUR ALTICE FINANCING SA-REG-S 3.00000% 20-15.01.28	5 420 000.00	4 075 189.60	0.35
EUR ALTICE FRANCE SA/FRANCE-REG-S 4.00000% 21-15.07.29	755 000.00	570 025.00	0.05
EUR ALTICE FRANCE-REG-S 3.37500% 19-15.01.28	4 950 000.00	3 749 922.00	0.32
EUR ALTICE FRANCE-REG-S 2.50000% 19-15.01.25	2 010 000.00	1 779 219.84	0.15
EUR BCP V MODULAR SERVICES-REG-S 4.75000% 21-30.11.28	1 065 000.00	852 000.00	0.07
EUR BELDEN INC-REG-S-SUB 3.37500% 17-15.07.27	1 055 000.00	928 136.25	0.08
EUR BELDEN INC-REG-S-SUB 3.87500% 18-15.03.28	315 000.00	274 837.50	0.02
EUR BWAY HOLDING CO-REG-S 4.75000% 18-15.04.24	5 630 000.00	5 246 131.01	0.45
EUR CAB SELAS-REG-S 3.37500% 21-01.02.28	3 495 000.00	2 662 491.00	0.23
EUR CARNIVAL CORP 1.87500% 15-07.11.22	5 850 000.00	5 795 185.50	0.50
EUR CARNIVAL CORP-REG-S 10.12500% 20-01.02.26	9 200 000.00	9 051 052.00	0.78
EUR CARNIVAL CORP-REG-S 7.62500% 20-01.03.26	2 160 000.00	1 673 157.60	0.14
EUR CASTOR SPA-REG-S 6.00000% 22-15.02.29	2 065 000.00	1 796 178.30	0.15
EUR CHEPLAPHARM ARZNEIMITTEL GMBH-REG-S 4.37500% 20-15.01.28	2 475 000.00	2 028 846.60	0.18
EUR CIDRON AIDA FINCO SARL-REG-S 5.00000% 21-01.04.28	5 150 000.00	4 216 820.00	0.36
EUR CIRSA FINANCE INTERNATIONAL-REG-S 4.75000% 19-22.05.25	3 230 000.00	2 874 700.00	0.25
EUR CONTOURGLOBAL POWER HOLDINGS SA-REG-S 4.12500% 18-01.08.25	1 000 000.00	953 000.00	0.08
EUR CONTOURGLOBAL POWER HOLDINGS SA-REG-S 2.75000% 20-01.01.26	2 840 000.00	2 306 511.69	0.20
EUR DUFFRY ONE BV-REG-S 3.37500% 21-15.04.28	2 785 000.00	2 125 718.09	0.18
EUR ENERGIZER GAMMA ACQUISITION BV-REG-S 3.50000% 21-30.06.29	2 780 000.00	1 972 153.19	0.17
EUR EP INFRASTRUCTURE AS-REG-S 1.65900% 18-26.04.24	2 390 000.00	1 974 438.75	0.17
EUR EP INFRASTRUCTURE AS-REG-S 2.04500% 19-09.10.28	2 170 000.00	1 443 456.88	0.12
EUR GAMMA BONDCO SARL-REG-S 8.12500% 21-15.11.26	13 450 000.00	11 029 000.00	0.95
EUR GRUENENTHAL GMBH-REG-S 4.12500% 21-15.05.28	4 580 000.00	3 792 972.80	0.33
EUR GRUPO ANTOLIN-IRAUSA SA-REG-S 3.50000% 21-30.04.28	7 560 000.00	4 823 582.40	0.41
EUR GRUPO-ANTOLIN IRAUSA SA-REG-S 3.37500% 18-30.04.26	950 000.00	712 500.00	0.06
EUR HEIMSTADEN AB-REG-S 4.37500% 21-06.03.27	5 200 000.00	3 862 144.00	0.33
EUR IHO VERWALTUNGS GMBH-REG-S (PIK) 3.75000% 16-15.09.26	3 560 000.00	2 928 100.00	0.25
EUR INEOS QUATTRO FINANCE 2 PLC-REG-S 2.50000% 21-15.01.26	4 915 000.00	4 031 676.20	0.35

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
EUR INTER MEDIA AND COMMUNICATION-REG-S 6.75000% 22-09.02.27	6 335 000.00	5 859 697.62	0.50
EUR INTRUM JUSTITIA AB-REG-S 3.12500% 17-15.07.24	9 335 000.00	8 494 850.00	0.73
EUR KAPLA HOLDING SAS-REG-S 3.37500% 19-15.12.26	4 455 000.00	3 712 351.50	0.32
EUR KME AG-REG-S 6.75000% 18-01.02.23	2 650 000.00	944 265.66	0.08
EUR LA FINANCIERE ATALIAN SA-REG-S 4.00000% 17-15.05.24	2 860 000.00	2 705 817.40	0.23
EUR LAGARDERE SCA-REG-S 1.75000% 21-07.10.27	12 400 000.00	11 638 647.56	1.00
EUR LHMC FINCO 2 SARL-REG-S (PIK) 7.25000% 19-02.10.25	4 874 753.00	4 094 792.52	0.35
EUR LORCA TELECOM BONDCO SAU-REG-S 4.00000% 20-18.09.27	8 810 000.00	7 651 837.40	0.66
EUR LOTTOMATICA SPA-REG-S 9.75000% 22-30.09.27	1 640 000.00	1 639 770.40	0.14
EUR LOXAM SAS-REG-S 3.25000% 19-14.01.25	1 210 000.00	1 089 000.00	0.09
EUR LOXAM SAS-REG-S 4.25000% 17-15.04.24	860 000.00	826 958.80	0.07
EUR LOXAM SAS-REG-S 6.00000% 17-15.04.25	4 655 000.00	2 092 953.17	0.18
EUR MARCOLIN SPA-REG-S 6.12500% 21-15.11.26	4 954 000.00	4 331 034.50	0.37
EUR MATTERHORN TELECOM SA-REG-S 3.12500% 19-15.09.26	5 600 000.00	4 872 000.00	0.42
EUR MOTION FINCO SARL-REG-S 7.00000% 20-15.05.25	12 685 000.00	12 520 095.00	1.07
EUR NIDDA BONDCO GMBH-REG-S 7.25000% 18-30.09.25	12 157 000.00	10 651 355.55	0.91
EUR OI EUROPEAN GROUP BV-REG-S 2.87500% 19-15.02.25	2 140 000.00	1 915 300.00	0.17
EUR PAPREC HOLDING-REG-S 4.00000% 18-31.03.25	3 658 000.00	3 254 705.50	0.28
EUR PAPREC HOLDING-REG-S-3.50000% 21-01.07.28	6 305 000.00	4 801 257.49	0.41
EUR PARTS EUROPE SA-REG-S 6.50000% 20-16.07.25	10 415 000.00	10 373 340.00	0.89
EUR PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 3.75000% 14-16.04.26	1 119 000.00	896 458.88	0.08
EUR PHM GROUP HOLDING OY-144A-REG-S 4.75000% 21-18.06.26	4 945 000.00	4 351 421.98	0.37
EUR PICARD GROUPE SAS-REG-S 3.87500% 21-01.07.26	2 190 000.00	1 828 650.00	0.16
EUR PINNACLE BIDCO PLC-REG-S 5.50000% 20-15.02.25	11 540 000.00	10 001 718.00	0.86
EUR PLT VII FINANCE SARL-REG-S 4.62500% 20-05.01.26	6 930 000.00	6 193 687.50	0.53
EUR PRIMO WATER HOLDINGS INC-REG-S 3.87500% 20-31.10.28	6 220 000.00	4 988 813.20	0.43
EUR REKEEP SPA-REG-S 7.25000% 21-01.02.26	3 610 000.00	3 158 750.00	0.27
EUR ROSSINI SARL-REG-S 6.75000% 18-30.10.25	15 430 000.00	14 928 401.56	1.28
EUR SIGMA HOLDCO BV-REG-S 5.75000% 18-15.05.26	5 850 000.00	3 870 945.00	0.33
EUR SIGMA DEVELOPMENT FINANCE SCS-REG-S 5.50000% 21-23.07.26	4 400 000.00	2 835 800.00	0.24
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 5.25000% 15-30.07.27	3 820 000.00	3 206 632.15	0.27
EUR SUMMER BC HOLDCO B SARL-REG-S 5.75000% 19-31.10.26	7 625 000.00	6 482 775.00	0.56
EUR SUMMER BIDCO BV-REG-S (PIK) 9.00000% 19-15.11.25	8 129 000.00	6 546 971.74	0.56
EUR SUMMER BIDCO BV-REG-S (PIK) STEP-DOWN 20-15.11.25	8 365 000.00	6 621 882.40	0.57
EUR SUPERIOR INDUSTRIES INTERNATIONAL-REG-S 6.00000% 17-15.06.25	8 070 000.00	6 439 698.60	0.55
EUR TEREOS FINANCE GROUPE I SA-REG-S 7.50000% 20-30.10.25	4 310 000.00	4 271 210.00	0.37
EUR TEREOS FINANCE GROUPE-REG-S 4.75000% 22-30.04.27	3 420 000.00	3 044 525.04	0.26
EUR TRIVIMUM PACKAGING FINANCE BV-REG-S 3.75000% 19-15.08.26	10 304 000.00	9 260 720.00	0.79
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 3.12500% 20-15.02.26	4 545 000.00	3 438 610.65	0.30
EUR VERISURE HOLDING AB-REG-S 3.87500% 20-15.07.26	4 040 000.00	3 467 548.16	0.30
EUR VERTICAL MIDCO GMBH-REG-S 4.37500% 20-15.07.27	2 520 000.00	2 110 500.00	0.18
EUR WP/AP TELECOM HOLDINGS IV BV-REG-S 3.75000% 21-15.01.29	3 640 000.00	2 902 900.00	0.25
EUR ZONCOLAN BIDCO SPA-REG-S 4.87500% 21-21.10.28	2 860 000.00	2 354 981.20	0.20
Total EUR		320 793 079.02	27.51
GBP			
GBP CIDRON AIDA FINCO SARL-REG-S 6.25000% 21-01.04.28	1 505 000.00	1 350 507.63	0.12
GBP GALAXY BIDCO LTD-REG-S 6.50000% 19-31.07.26	3 700 000.00	3 436 127.85	0.29
GBP GALAXY FINCO LTD-REG-S 9.25000% 19-31.07.27	8 370 000.00	7 725 390.81	0.66
GBP GARFUNKELUX HOLDCO 3 SA-REG-S 7.75000% 20-01.11.25	2 895 000.00	2 573 079.19	0.22
GBP JERROLD FINCO PLC-REG-S 4.87500% 20-15.01.26	4 500 000.00	3 973 966.46	0.34
GBP JERROLD FINCO PLC-REG-S 5.25000% 21-15.01.27	8 425 000.00	7 166 542.88	0.61
GBP MAISON FINCO PLC-REG-S 6.00000% 21-31.10.27	7 025 000.00	5 771 538.21	0.50
GBP VIRGIN MEDIA VENDOR FINANCING-REG-S 4.87500% 20-15.07.28	3 265 000.00	2 768 208.46	0.24
Total GBP		34 765 361.49	2.98
固定利付債券合計		355 558 440.51	30.49

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
変動利付債券			
EUR			
EUR 888 ACQUISITIONS LTD-REG-S 3M EURIBOR+550BP 22-15.07.28	2 260 000.00	1 937 950.00	0.16
EUR ACCOR SA-REG-S-SUB 4.375%/VAR 19-PRP	900 000.00	782 298.00	0.07
EUR BANCO BPM SPA-REG-S-SUB 4.250%/VAR 19-01.10.29	7 740 000.00	7 178 850.00	0.61
EUR BANCO DE CREDITO SOCIAL-REG-S 8.000%/VAR 22-22.09.26	6 200 000.00	6 156 438.80	0.53
EUR BAYER AG-REG-S-SUB 2.375%/VAR 19-12.11.79	4 300 000.00	3 726 337.00	0.32
EUR BAYER AG-REG-S-SUB 3.750%/VAR 14-01.07.74	1 700 000.00	1 592 934.00	0.14
EUR CASTOR SPA-REG-S 3M EURIBOR+525BP 22-15.02.29	2 910 000.00	2 650 428.00	0.23
EUR ENEL SPA-REG-S-SUB 3.375%/VAR 18-24.11.81	5 050 000.00	4 298 812.50	0.37
EUR GOLDEN GOOSE SPA-REG-S 3M EURIBOR+487.5BP 21-14.05.27	8 925 000.00	7 691 118.75	0.66
EUR HEIMSTADEN BOSTAD AB-REG-S-SUB 2.625%/VAR 21-PRP	2 000 000.00	1 161 200.00	0.10
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB 7.750%/VAR 17-PRP	600 000.00	529 500.00	0.04
EUR LEASEPLAN CORPORATION NV-REG-S-SUB 7.375%/VAR 19-PRP	3 000 000.00	2 685 000.00	0.23
EUR LIBERTY MUTUAL GROUP INC-REG-S-SUB 3.625%/VAR 19-23.05.59	3 460 000.00	2 941 276.80	0.25
EUR NOVO BANCO SA-REG-S 4.250%/VAR 21-15.09.23	7 600 000.00	7 400 500.00	0.63
EUR ROSSINI SARL-REG-S 3M EURIBOR+387.5BP 19-30.10.25	2 100 000.00	1 992 375.00	0.17
EUR SISAL PAY SPA-REG-S 3M EURIBOR+387.5BP 19-17.12.26	5 545 000.00	5 223 390.00	0.45
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 3.875%/VAR 18-PRP	5 600 000.00	4 886 000.00	0.42
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 4.375%/VAR 19-PRP	6 900 000.00	6 506 493.00	0.56
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 3M EURIBOR+487.5BP 22-01.02.29	2 990 000.00	2 459 275.00	0.21
EUR VERTICAL MIDCO GMBH-REG-S 3M EURIBOR+475BP 20-15.07.27	2 340 000.00	2 173 794.48	0.19
EUR VODAFONE GROUP PLC-REG-S-SUB 4.200%/VAR 18-03.10.78	1 045 000.00	904 186.25	0.08
Total EUR		74 878 157.58	6.42
GBP			
GBP CREDIT AGRICOLE SA-REG-S-SUB 7.500%/VAR 21-PRP	2 931 000.00	3 039 175.22	0.26
Total GBP		3 039 175.22	0.26
USD			
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S-SUB 7.500%/VAR 18-PRP	7 190 000.00	6 293 497.68	0.54
Total USD		6 293 497.68	0.54
変動利付債券合計		84 210 830.48	7.22
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	3 722 334.80	0.32
EUR CAIXABANK SA-REG-S-SUB 6.375%/VAR 18-PRP	3 400 000.00	3 221 126.00	0.28
Total EUR		6 943 460.80	0.60
USD			
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S-SUB COCO 7.250%/VAR 18-PRP	3 660 000.00	2 857 750.12	0.24
Total USD		2 857 750.12	0.24
変動利付転換社債合計		9 801 210.92	0.84
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		1 084 862 762.61	93.02

注記は、財務書類と不可分のものである。

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

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	ASCENT RESOURCES UTICA HOLDINGS-144A 7.00000% 18-01.11.26	3 680 000.00	3 621 718.78	0.31
USD	DKT FINANCE APS-144A 9.37500% 18-17.06.23	3 340 000.00	3 281 529.12	0.28
Total USD			6 903 247.90	0.59

固定利付ノート合計			6 903 247.90	0.59
-----------	--	--	--------------	------

変動利付ミディアム・ターム・ノート

USD				
USD	INTESA SANPAOLO SPA-144A-SUB 7.700%/VAR 15-PRP	1 615 000.00	1 370 758.00	0.12
Total USD			1 370 758.00	0.12

変動利付ミディアム・ターム・ノート合計			1 370 758.00	0.12
---------------------	--	--	--------------	------

固定利付債券

EUR				
EUR	PANTHER BF AGGR 2/PANTHER FIN CO-REG-S 4.37500% 19-15.05.26	3 970 000.00	3 501 619.40	0.30
Total EUR			3 501 619.40	0.30

固定利付債券合計			3 501 619.40	0.30
----------	--	--	--------------	------

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			11 775 625.30	1.01
---------------------------------------	--	--	---------------	------

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	2 141.09	20 972 201.36	1.80
Total Ireland			20 972 201.36	1.80

投資信託、オープン・エンド型合計			20 972 201.36	1.80
------------------	--	--	---------------	------

2010年12月17日のルクセンブルグ投信法（改訂済）第41条(1)e)に準拠した
投資信託 / その他の投資信託合計

	20 972 201.36	1.80
--	---------------	------

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

EUR				
EUR	GS/ITRX.XOVER.S37-V1 SWAPTION PUT 800.00000% 22-16.11.22	-150 000 000.00	-936 765.00	-0.08
EUR	GS/ITRX.XOVER.S37-V1 SWAPTION PUT 750.00000% 22-16.11.22	-150 000 000.00	-1 267 200.00	-0.11
EUR	GS/ITRX.XOVER.S37-V1 SWAPTION PUT 650.00000% 22-16.11.22	150 000 000.00	2 472 030.00	0.21
Total EUR			268 065.00	0.02

その他のスワップに係るオプション、従来型合計			268 065.00	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

	268 065.00	0.02
--	------------	------

投資有価証券合計			1 117 878 654.27	95.85
----------	--	--	------------------	-------

注記は、財務書類と不可分のものである。

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

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	JPMORGAN/TKAGR CREDIT DEFAULT SWAP REC 1.00000% 20-20.12.22	11 000 000.00	-79 942.50	-0.01
EUR	CITI/ALGSCO CREDIT DEFAULT SWAP REC 5.00000% 22-20.12.26	2 000 000.00	179 294.60	0.02
EUR	CITI/ALGSCO CREDIT DEFAULT SWAP REC 5.00000% 21-20.12.26	3 000 000.00	268 941.90	0.02
EUR	GS/INTERNATIONAL GAME TECHNOLOG CREDIT DEFAULT SWAP REC 5.00000% 22-20.06.27	5 000 000.00	44 497.00	0.00
EUR	BOA/CASINO GUICHARD CREDIT DEFAULT SWAP REC 5.00000% 22-20.12.22	4 000 000.00	-224 534.84	-0.02
USD	GS/BHCCN CREDIT DEFAULT SWAP REC 5.00000% 22-20.12.22	6 000 000.00	-176 592.32	-0.02
クレジット・デフォルト・スワップ合計			11 663.84	-0.01
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されていない				
派生商品合計			11 663.84	-0.01
派生商品合計			11 663.84	-0.01

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

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面				評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
為替予約契約						
購入通貨	購入額	売却通貨	売却額	満期日		
JPY	5 058 060 900.00	EUR	35 205 003.34	25.10.2022	483 980.01	0.04
SGD	44 066 700.00	EUR	31 178 927.66	25.10.2022	129 512.79	0.01
AUD	63 192 500.00	EUR	42 221 036.66	25.10.2022	-798 495.47	-0.07
HKD	95 084 400.00	EUR	12 085 705.14	25.10.2022	266 954.05	0.03
CAD	22 577 600.00	EUR	16 929 668.05	25.10.2022	-182 775.83	-0.02
GBP	13 393 200.00	EUR	15 254 229.76	25.10.2022	-8 303.20	0.00
CHF	30 373 700.00	EUR	31 438 932.78	25.10.2022	75 165.57	0.01
EUR	73 473 879.42	GBP	64 510 000.00	25.10.2022	39 993.41	0.01
CNH	89 285 600.00	EUR	12 680 486.77	25.10.2022	88 691.42	0.01
EUR	54 655 293.40	USD	54 835 000.00	25.10.2022	-1 236 025.89	-0.11
USD	351 458 000.00	EUR	350 306 193.24	25.10.2022	7 922 151.71	0.68
EUR	4 938 097.83	USD	4 946 700.00	25.10.2022	-103 893.40	-0.01
EUR	508 178.53	AUD	755 300.00	25.10.2022	13 081.08	0.00
EUR	187 049.40	GBP	163 400.00	25.10.2022	1 045.73	0.00
HKD	1 395 500.00	EUR	179 646.08	25.10.2022	1 646.92	0.00
EUR	154 499.17	CNH	1 078 900.00	25.10.2022	200.31	0.00
EUR	245 289.66	CAD	326 600.00	25.10.2022	3 034.73	0.00
USD	7 738 800.00	EUR	7 931 450.17	25.10.2022	-43 573.05	0.01
EUR	212 597.39	HKD	1 623 500.00	25.10.2022	1 684.33	0.00
EUR	664 479.64	JPY	92 339 400.00	25.10.2022	12 945.51	0.00
EUR	281 079.10	HKD	2 122 400.00	25.10.2022	5 352.65	0.00
EUR	927 876.83	AUD	1 386 900.00	25.10.2022	18 767.01	0.00
EUR	631 125.47	CHF	599 800.00	25.10.2022	8 805.63	0.00
EUR	517 829.91	CNH	3 578 200.00	25.10.2022	6 093.71	0.00
EUR	727 523.18	AUD	1 082 700.00	25.10.2022	17 815.77	0.00
EUR	989 345.35	SGD	1 373 800.00	25.10.2022	13 290.06	0.00
EUR	258 751.16	GBP	232 100.00	25.10.2022	-5 456.02	0.00
EUR	8 150 805.66	USD	7 865 600.00	25.10.2022	133 685.92	0.01
EUR	245 746.73	CAD	324 700.00	25.10.2022	4 901.12	0.00
EUR	153 481.90	HKD	1 163 400.00	25.10.2022	2 341.61	0.00
EUR	215 317.88	CNH	1 498 100.00	25.10.2022	1 067.14	0.00
EUR	19 483 908.39	USD	18 991 400.00	25.10.2022	126 665.73	0.01
為替予約契約合計					7 000 351.06	0.61
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					44 222 845.63*	3.79
当座借越およびその他の短期負債					-18 722.06	0.00
その他の資産および負債					-2 838 967.12	-0.24
純資産合計					1 166 255 825.62	100.00

* 2022年9月30日現在、20,000.00ユーロの現金が取引相手方であるJ P モルガンに対する担保となっている。

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S（Lux）ボンド・ファンド - オーストラリア・ドル

最も重要な数字

	ISIN	30.9.2022	31.3.2022	31.3.2021
純資産額、オーストラリア・ドル		323 660 962.84	381 371 627.11	382 900 537.66
クラス P - a c c 受益証券	LU0035338325			
発行済受益証券		296 483.6730	324 657.2900	294 461.4790
受益証券 1 口当たりの純資産価格、オーストラリア・ドル		492.42	518.32	554.17
受益証券 1 口当たり発行および買戻価格、オーストラリア・ドル ¹		492.76	518.32	554.17
クラス P - d i s t 受益証券	LU0035338242			
発行済受益証券		581 161.6460	620 597.6220	683 458.3790
受益証券 1 口当たりの純資産価格、オーストラリア・ドル		102.11	109.36	119.04
受益証券 1 口当たり発行および買戻価格、オーストラリア・ドル ¹		102.18	109.36	119.04

¹ 注記 1 を参照のこと。

投資有価証券の構成

地域別分類	純資産割合%	業種別分類	純資産割合%
オーストラリア	76.61	国債および中央政府債	24.39
アメリカ合衆国	7.40	公益、非営利団体	20.16
ノルウェー	2.97	金融および持株会社	15.08
ドイツ	2.75	銀行およびその他の金融機関	12.20
イギリス	2.13	国際機関	6.32
国際機関	1.66	通信	3.60
カナダ	1.34	地方債	3.54
スイス	1.27	その他の非分類会社	3.53
フィリピン	0.85	モーゲージおよび貸付機関	1.79
ルクセンブルグ	0.83	交通および運輸	1.29
合計	97.81	ヘルスケアおよび社会福祉	1.21
		宿泊、ケータリングおよび娯楽施設	1.09
		エネルギーおよび水道	0.78
		化学	0.68
		小売業および百貨店	0.66
		保険	0.49
		石油	0.42
		市および地方自治体	0.34
		電気機器および部品	0.23
		航空宇宙産業	0.01
		合計	97.81

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	30.9.2022	31.3.2022	31.3.2021
純資産額、ユーロ		143 037 715.24	177 740 627.69	217 572 340.82
クラス P - a c c 受益証券	LU0033050237			
発行済受益証券		236 066.0260	252 566.4880	286 619.8160
受益証券 1 口当たりの純資産価格、ユーロ		354.20	410.37	447.97
受益証券 1 口当たり発行および買戻価格、ユーロ ¹		354.20	410.37	447.97
クラス P - d i s t 受益証券	LU0033049577			
発行済受益証券		281 937.7640	290 830.4380	311 310.6320
受益証券 1 口当たりの純資産価格、ユーロ		110.27	130.35	144.27
受益証券 1 口当たり発行および買戻価格、ユーロ ¹		110.27	130.35	144.27

¹ 注記 1 を参照のこと。

投資有価証券の構成

地域別分類	純資産割合%	業種別分類	純資産割合%
アメリカ合衆国	10.63	国債および中央政府債	45.39
フランス	10.15	金融および持株会社	10.48
ドイツ	8.49	銀行およびその他の金融機関	9.87
ルクセンブルグ	8.37	投資信託	4.59
ニュージーランド	7.51	モーゲージおよび貸付機関	4.43
スペイン	5.97	国際機関	3.96
イタリア	5.91	エネルギーおよび水道	2.33
オランダ	5.86	交通および運輸	1.84
イギリス	5.58	通信	1.60
ベルギー	2.61	タバコおよびアルコール飲料	1.60
ポルトガル	2.32	保険	1.18
スロベニア	1.87	不動産	1.15
オーストラリア	1.69	公益、非営利団体	1.04
ギリシャ	1.43	その他の非分類会社	0.71
オーストリア	1.41	石油	0.67
国際機関	1.20	化学	0.65
アイルランド	1.06	インターネット、ソフトウェアおよびITサービス	0.65
ロシア連邦(CIS)	0.99	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	0.52
ブラジル	0.95	各種サービス	0.42
デンマーク	0.85	自動車	0.30
スイス	0.77	医薬品、化粧品および医療製品	0.21
ベネズエラ	0.63	ヘルスケアおよび社会福祉	0.20
インド	0.62	小売業および百貨店	0.19
コスタリカ	0.57	電気機器および部品	0.13
トルコ	0.52	繊維、衣類および革製品	0.12
ルーマニア	0.52	包装業	0.11
ケイマン諸島	0.51	合計	94.34
カザフスタン	0.50		
スロバキア	0.47		
ペルー	0.41		
ポーランド	0.38		
チリ	0.36		
モンゴル	0.32		
フィリピン	0.30		
ノルウェー	0.28		
コロンビア	0.26		
フィンランド	0.22		
ブルガリア	0.21		
中国	0.21		
インドネシア	0.21		
タイ	0.20		
日本	0.19		
スウェーデン	0.17		
エジプト	0.16		
エクアドル	0.09		
メキシコ	0.09		
アルゼンチン	0.09		
チェコ共和国	0.09		
ジャージー	0.07		
バミューダ	0.07		
合計	94.34		

U B S（Lux）ボンド・ファンド - アジア・フレキシブル（米ドル）*

* 旧名称は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	30.9.2022	31.3.2022	31.3.2021
純資産額、米ドル		399 722 494.50	611 977 496.21	670 960 500.68
クラス P - a c c 受益証券	LU0464244333			
発行済受益証券		229 762.6170	249 429.2450	316 817.3310
受益証券 1 口当たりの純資産価格、米ドル		127.77	144.49	168.13
受益証券 1 口当たり発行および買戻価格、米ドル ¹		128.06	144.49	168.13

¹ 注記 1 を参照のこと。

投資有価証券の構成

地域別分類	純資産割合%	業種別分類	純資産割合%
ケイマン諸島	14.25	金融および持株会社	27.56
香港	12.34	銀行およびその他の金融機関	21.62
英領ヴァージン諸島	9.92	投資信託	8.81
韓国	8.16	国債および中央政府債	7.32
シンガポール	7.81	インターネット、ソフトウェアおよび I T サービス	4.20
ルクセンブルグ	6.06	各種サービス	3.17
インド	5.52	鉱業、石炭採掘および鉄鋼業	2.66
アメリカ合衆国	4.95	不動産	2.55
中国	4.80	石油	2.38
フィリピン	4.04	化学	2.22
インドネシア	3.58	通信	1.98
タイ	3.03	エネルギーおよび水道	1.30
イギリス	1.99	宿泊、ケータリングおよび娯楽施設	1.10
日本	1.30	交通および運輸	0.98
フランス	0.91	建築業および資材	0.96
マレーシア	0.63	その他の非分類会社	0.95
マカオ	0.63	食品および清涼飲料	0.79
モーリシャス	0.48	グラフィック・デザイン、出版およびメディア	0.72
パキスタン	0.28	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	0.44
メキシコ	0.27	市および地方自治体	0.38
マン島	0.24	合計	92.09
ベトナム	0.23		
スリランカ	0.20		
モンゴル	0.17		
オランダ	0.16		
チリ	0.09		
ジャージー	0.05		
合計	92.09		

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	30.9.2022	31.3.2022	31.3.2021
純資産額、ユーロ		1 166 255 825.62	1 431 122 028.59	1 730 167 720.42
クラス P - a c c 受益証券	LU0086177085			
発行済受益証券		704 651.5800	795 564.4730	942 986.0270
受益証券 1 口当たりの純資産価格、ユーロ		195.52	218.27	222.72
受益証券 1 口当たり発行および買戻価格、ユーロ ¹		195.52	218.27	222.72
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		272 792.5510	311 545.3350	360 809.2340
受益証券 1 口当たりの純資産価格、米ドル		129.59	143.32	145.21
受益証券 1 口当たり発行および買戻価格、米ドル ¹		129.59	143.32	145.21
クラス P - m d i s t 受益証券	LU0417441200			
発行済受益証券		706 734.1590	793 035.7560	942 819.8360
受益証券 1 口当たりの純資産価格、ユーロ		106.03	121.09	129.33
受益証券 1 口当たり発行および買戻価格、ユーロ ¹		106.03	121.09	129.33
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		2 178 909.1780	2 485 152.6710	2 960 617.9170
受益証券 1 口当たりの純資産価格、米ドル		75.87	86.36	92.28
受益証券 1 口当たり発行および買戻価格、米ドル ¹		75.87	86.36	92.28

¹ 注記 1 を参照のこと。

投資有価証券の構成

地域別分類	純資産割合 %	業種別分類	純資産割合 %
フランス	14.18	金融および持株会社	42.61
ルクセンブルグ	13.24	銀行およびその他の金融機関	8.09
イギリス	10.21	通信	7.92
ドイツ	9.83	自動車	4.51
オランダ	9.34	各種サービス	3.94
イタリア	9.05	インターネット、ソフトウェアおよび I T サービス	3.32
アメリカ合衆国	5.65	ヘルスケアおよび社会福祉	2.75
スペイン	3.85	交通および運輸	2.68
デンマーク	3.65	エネルギーおよび水道	2.47
スウェーデン	2.90	不動産	2.14
アイルランド	2.87	石油	1.97
パナマ	1.42	宿泊、ケータリングおよび娯楽施設	1.87
ベルギー	1.28	投資信託	1.80
日本	1.24	包装業	1.30
ポルトガル	1.14	グラフィック・デザイン、出版およびメディア	1.00
ノルウェー	1.00	化学	0.98
チェコ共和国	0.87	各種貿易会社	0.89
フィンランド	0.82	食品および清涼飲料	0.76
スイス	0.79	航空宇宙産業	0.70
ギリシャ	0.78	医薬品、化粧品および医療製品	0.66
ジャージー	0.59	繊維、衣類および革製品	0.66
ジブラルタル	0.48	農業および漁業	0.63
メキシコ	0.24	保険	0.50
オーストリア	0.22	写真・光学	0.37
イスラエル	0.21	その他の非分類会社	0.35
合計	95.85	バイオテクノロジー	0.34
		鉱業、石炭採掘および鉄鋼業	0.34
		各種消費財	0.12
		電気機器および部品	0.10
		機械工学および産業機器	0.08
		合計	95.85

[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19億円）は、1株2,000ユーロ（285,340円）の株式6,500株によって表章される。2022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19億円）は、1株2,000ユーロ（295,180円）の株式6,500株によって表章される。2022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、2022年6月末日現在、以下のとおり、419本の投資信託／投資法人のサブ・ファンドの管理・運用を行っている。

国別（設立国）	種類別（基本的性格）	本数	純資産額の合計（通貨別）
ルクセンブルグ	オープン・エンド型 投資信託／投資法人	<u>364</u>	<u>502,550,939.18</u> オーストラリア・ドル
			<u>2,807,258,999.31</u> カナダ・ドル
			<u>13,253,745,058.56</u> スイス・フラン
			<u>9,061,240,993.64</u> 中国元
			<u>503,483,113.29</u> デンマーク・クローネ
			<u>51,053,084,244.84</u> ユーロ
			<u>1,871,017,017.99</u> 英ポンド
			<u>280,816,526.99</u> 香港ドル
			<u>407,385,232,869.00</u> 日本円
			<u>46,973,796.17</u> シンガポール・ドル
			<u>125,108,645,694.69</u> 米ドル
アイルランド	オープン・エンド型 投資信託／投資法人	<u>55</u>	<u>1,276,664,254.78</u> オーストラリア・ドル
			<u>165,814,295.39</u> スイス・フラン
			<u>1,989,986,345.85</u> ユーロ
			<u>2,595,112,837.98</u> 英ポンド
			<u>19,106,891,532.83</u> 日本円
			<u>32,185,564,469.65</u> 米ドル

<訂正後>

（前略）

管理会社は、2022年10月末日現在、以下のとおり、438本の投資信託／投資法人のサブ・ファンドの管理・運用を行っている。

国別（設立国）	種類別（基本的性格）	本数	純資産額の合計（通貨別）
ルクセンブルグ	オープン・エンド型 投資信託／投資法人	386	481,546,420.42オーストラリア・ドル
			2,845,191,144.11カナダ・ドル
			14,925,552,582.82スイス・フラン
			8,197,365,221.62中国元
			487,234,105.75デンマーク・クローネ
			52,767,066,628.72ユーロ
			1,857,891,867.39英ポンド
			231,522,557.55香港ドル
			440,333,132,312.92日本円
			42,024,667.35シンガポール・ドル
			108,886,967,650.46米ドル
アイルランド	オープン・エンド型 投資信託／投資法人	52	452,204,936.13オーストラリア・ドル
			171,635,607.99スイス・フラン
			1,464,096,329.96ユーロ
			2,429,964,592.18英ポンド
			20,394,903,510.98日本円
			30,893,733,303.69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、2022年10月31日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1ユーロ＝147.59円）で換算された円換算額が併記されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

UBSファンド・マネジメント（ルクセンブルグ）エス・エイ

貸借対照表

2022年6月30日現在

	2022年6月30日		2021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
．発行済未請求資本金	0.00	0	0.00	0
．請求済未払込資本金	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
．有形資産	0.00	0	0.00	0
．金融資産	0.00	0	0.00	0
D．流動資産	177,792,115.07	26,240,338	224,747,914.97	33,170,545
．棚卸資産	0.00	0	0.00	0
．債権	105,587,968.18	15,583,728	117,496,595.49	17,341,323
1．売掛金	98,475,552.64	14,534,007	112,205,683.76	16,560,437
a) 1年以内に期限到来	98,475,552.64	14,534,007	112,205,683.76	16,560,437
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	7,112,415.54	1,049,721	5,290,911.73	780,886
a) 1年以内に期限到来	7,112,415.54	1,049,721	5,290,911.73	780,886
b) 1年を超えて期限到来	0.00	0	0.00	0
3．参加持分に連動する 関連会社に対する債権	0.00	0	0.00	0
4．その他の債権	0.00	0	0.00	0
．投資	134,587.44	19,864	167,425.93	24,710
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	134,587.44	19,864	167,425.93	24,710
．銀行預金および手元現金	72,069,559.45	10,636,746	107,083,893.55	15,804,512
E．前払金	1,958,240.00	289,017	945,913.70	139,607
資産合計	179,750,355.07	26,529,355	225,693,828.67	33,310,152

	2022年 6 月30日		2021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	40,793,384.50	6,020,696	77,784,368.77	11,480,195
．払込資本金	13,000,000.00	1,918,670	13,000,000.00	1,918,670
．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	8,617,625.00	1,271,875	8,083,000.00	1,192,970
1．法定準備金	1,300,000.00	191,867	1,300,000.00	191,867
2．自己株式に対する準備金	0.00	0	0.00	0
3．定款に規定された準備金	0.00	0	0.00	0
4．公正価値準備金を含む その他の準備金	7,317,625.00	1,080,008	6,783,000.00	1,001,103
a) その他の分配可能準備金	150,000.00	22,139	150,000.00	22,139
b) その他の分配不能準備金	7,167,625.00	1,057,870	6,633,000.00	978,964
．繰越損益	66,743.78	9,851	71,861.36	10,606
．当期損益	19,109,015.72	2,820,300	56,629,507.41	8,357,949
．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	14,546,119.01	2,146,862	18,445,360.25	2,722,351
1．年金および類似の債務に対する 引当金	0.00	0	0.00	0
2．納税引当金	14,546,119.01	2,146,862	18,445,360.25	2,722,351
3．その他の引当金	0.00	0	0.00	0
C．債務	124,410,851.56	18,361,798	129,464,099.65	19,107,606
1．社債	0.00	0	0.00	0
2．金融機関に対する債務	0.00	0	0.00	0
3．棚卸資産からの控除として 区分表示される範囲の注文前受金	0.00	0	0.00	0
4．買掛金	0.00	0	0.00	0
5．未払為替手形	0.00	0	0.00	0
6．関連会社に対する債務	91,982,671.84	13,575,723	105,047,123.71	15,503,905
a) 1年以内に期限到来	91,982,671.84	13,575,723	105,047,123.71	15,503,905
b) 1年を超えて期限到来	0.00	0	0.00	0
7．参加持分に連動する関連会社 に対する債務	0.00	0	0.00	0
8．その他の債務	32,428,179.72	4,786,075	24,416,975.94	3,603,701
a) 税金債務	1,361,886.56	201,001	1,474,617.09	217,639
b) 社会保障債務	584,502.14	86,267	576,805.27	85,131
c) その他の債務	30,481,791.02	4,498,808	22,365,553.58	3,300,932
) 1年以内に期限到来	30,481,791.02	4,498,808	22,365,553.58	3,300,932
) 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	179,750,355.07	26,529,355	225,693,828.67	33,310,152

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

2022年 6 月30日に終了した期間および2021年12月31日に終了した年度

	2022年 1 月 1 日から 2022年 6 月30日まで		2021年 1 月 1 日から 2021年12月31日まで	
	ユーロ	千円	ユーロ	千円
1 . 純取引高	479,027,038.20	70,699,601	1,102,559,858.01	162,726,809
4 . その他の営業収益	1,668,474.22	246,250	3,842,070.90	567,051
5 . 原材料および消耗品ならびに その他の外部費用	437,565,989.30	64,580,364	1,001,676,461.91	147,837,429
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	437,565,989.30	64,580,364	1,001,676,461.91	147,837,429
6 . 人件費	6,501,974.14	959,626	10,600,284.84	1,564,496
a) 賃金および給与	5,716,757.68	843,736	9,147,871.53	1,350,134
b) 社会保障費	725,572.54	107,087	1,425,293.40	210,359
) 年金に関連するもの	518,985.15	76,597	925,408.06	136,581
) その他の社会保障費	206,587.39	30,490	499,885.34	73,778
c) その他の人件費	59,643.92	8,803	27,119.91	4,003
7 . 評価額調整	0.00	0	911.58	135
a) 創業費ならびに有形固定資産および 無形固定資産に関連するもの	0.00	0	911.58	135
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	10,930,008.81	1,613,160	18,241,524.61	2,692,267
11 . その他の受取利息および類似収益	9,721.01	1,435	9.94	1
a) 関連会社に関連するもの	9,721.01	1,435	9.94	1
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	236,278.55	34,872	418,131.79	61,712
a) 関連会社に関連するもの	183,893.91	27,141	279,829.70	41,300
b) その他の支払利息および類似費用	52,384.64	7,731	138,302.09	20,412
15 . 損益にかかる税金	6,361,966.91	938,963	18,835,116.71	2,779,875
16 . 税引後損益	19,109,015.72	2,820,300	56,629,507.41	8,357,949
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	19,109,015.72	2,820,300	56,629,507.41	8,357,949