

## 【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2023年7月31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  
バルバラ・チェンバレン(Barbara Chamberlain)  
メンバー・オブ・ザ・エグゼクティブ・ボード  
アンドレア・パパゾーニ(Andrea Papazzoni)

【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)マネー・マーケット・ファンド  
- 米ドル・サステナブル  
(UBS(Lux) Money Market Fund - USD Sustainable)

【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)マネー・マーケット・ファンド  
- 米ドル・サステナブル クラスF - a c c 受益証券  
20億米ドル(約2,609億円)を上限とします。  
(注)米ドルの円貨換算は2023年1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米ドル=130.47円)によります。

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出しましたので、2023年4月28日に提出した有価証券届出書(以下「原届出書」といいます。)の関係情報を新たな情報により訂正するため、本訂正届出書を提出するものであります。

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おりますので、訂正前の換算レートとは異なっております。

## 2【訂正の内容】

## (1) 半期報告書に係る訂正

半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正内容は、下記のとおりです。

原届出書の下記事項については、半期報告書の記載内容と同一内容に更新または追加されます。

原届出書		半期報告書		訂正の方法
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 管理会社の概要 (c) 資本金の額	4 管理会社の概況	(1) 資本金の額	更新
5 運用状況	(1) 投資状況	1 ファンドの運用状況	(1) 投資状況 資産別および地域別の 投資状況	更新
	(3) 運用実績		(2) 運用実績	追加 または 更新
	(4) 販売及び買戻しの 実績	2 販売及び買戻しの実績		追加
第3 ファンドの経理状況 1 財務諸表		3 ファンドの経理状況		追加
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	4 管理会社の概況	(1) 資本金の額	更新
	2 事業の内容及び 営業の概況		(2) 事業の内容及び営業の 状況	更新
	5 その他		(3) その他	追加

\* 半期報告書の記載内容は、以下のとおりです(5 管理会社の経理の概況は、訂正内容に該当しないため省略します。 )。

[次へ](#)

## 1 ファンドの運用状況

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.）（以下「管理会社」といいます。）が管理するUBS（Lux）マネー・マーケット・ファンド - 米ドル・サステナブル（UBS（Lux）Money Market Fund - USD Sustainable）の運用状況は以下のとおりです。

（注）UBS（Lux）マネー・マーケット・ファンド - 米ドル・サステナブル（以下「サブ・ファンド」ということがあります。）は、アンブレラ・ファンドであるUBS（Lux）マネー・マーケット・ファンド（以下「ファンド」ということがあります。）のサブ・ファンドです。

## (1) 投資状況

資産別および地域別の投資状況

（米ドル・サステナブル）

（2023年5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 （%）
短期金融商品	英国	392,239,921.83	14.32
	フランス	354,005,558.24	12.92
	ドイツ	344,275,363.32	12.57
	オランダ	223,845,297.03	8.17
	スウェーデン	198,931,970.78	7.26
	カナダ	155,329,249.35	5.67
	フィンランド	154,171,236.79	5.63
	オーストラリア	106,955,744.76	3.90
	ノルウェー	89,626,883.64	3.27
	ルクセンブルグ	83,236,433.10	3.04
	デンマーク	74,302,859.00	2.71
	アイルランド	64,155,030.68	2.34
	国際機関	51,318,103.76	1.87
	日本	49,888,574.50	1.82
	韓国	24,839,368.00	0.91
		小計	2,367,121,594.78
投資信託	アイルランド	113,638,290.00	4.15
	小計	113,638,290.00	4.15
債券	カナダ	15,008,819.65	0.55
	アメリカ合衆国	9,873,886.30	0.36
	スウェーデン	7,970,008.24	0.29
	小計	32,852,714.19	1.20
ポートフォリオ合計		2,513,612,598.97	91.76
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		225,612,737.32	8.24
合計（純資産総額）		2,739,225,336.29 （約382,862百万円）	100.00

(注1) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。以下同じです。

(注2) 米ドルの円貨換算は、2023年5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米ドル=139.77円)によります。以下同じです。

(注3) 本書の中で金額および比率を表示する場合、四捨五入してあります。従って、合計の数字が一致しない場合があります。また、円貨への換算は、本書中でそれに対応する数字につき所定の換算率で単純計算のうえ、必要な場合四捨五入してあります。従って、本書中の同一情報につき異なった円貨表示がなされている場合があります。

## (2) 運用実績

### 純資産の推移

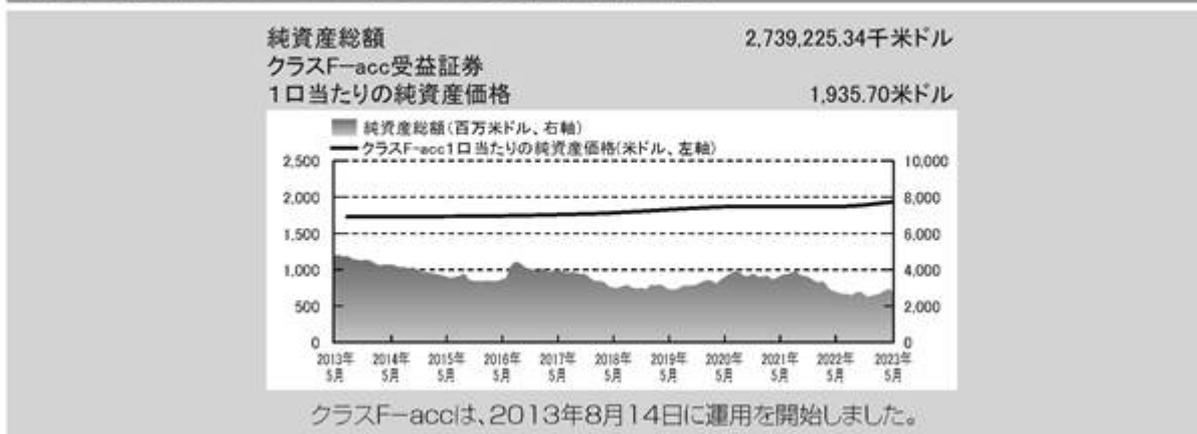
2023年5月末日および同日前1年以内におけるサブ・ファンドの各月末の純資産の推移は以下のとおりです。

(米ドル・サステナブル)

	純資産総額		クラスF - a c c 受益証券 1口当たりの純資産価格	
	千米ドル	百万円	米ドル	円
2022年6月末日	2,651,150.17	370,551	1,870.94	261,501
7月末日	2,664,518.22	372,420	1,873.41	261,847
8月末日	2,559,241.56	357,705	1,877.42	262,407
9月末日	2,747,215.73	383,978	1,880.68	262,863
10月末日	2,764,096.88	386,338	1,885.01	263,468
11月末日	2,533,601.28	354,121	1,891.61	264,390
12月末日	2,538,714.63	354,836	1,898.56	265,362
2023年1月末日	2,589,949.85	361,997	1,906.43	266,462
2月末日	2,653,442.23	370,872	1,912.74	267,344
3月末日	2,811,317.81	392,938	1,920.64	268,448
4月末日	2,918,514.54	407,921	1,927.59	269,419
5月末日	2,739,225.34	382,862	1,935.70	270,553

## &lt; 参考情報 &gt;

## 純資産総額および1口当たりの純資産価格の推移



(2023年5月末日現在)

## 分配の推移

2023年5月末日前1年間における分配の推移について、該当事項はありません。

## 収益率の推移

2023年5月末日前1年間における収益率は以下のとおりです。

	クラスF - a c c 受益証券 収益率（注）
米ドル・サステナブル	3.48%

（注）収益率（%）=  $100 \times (a - b) / b$ 

a = 2023年5月末日の1口当たりの純資産価格（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（2022年5月末日）の1口当たりの純資産価格（分配前の額）

[次へ](#)

## 2 販売及び買戻しの実績

2023年5月末日前1年間における販売および買戻しの実績ならびに2023年5月末日現在の発行済口数は以下のとおりです。

(米ドル・サステナブル)

	販売口数	買戻し口数	発行済口数
クラスF - a c c 受益証券	651,101.428 (0.000)	727,127.909 (0.000)	304,462.634 (0.000)

(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ます。  
一方、( )の上段の数字は約定日を基準として算出しています。以下同じです。

[次へ](#)

### 3 ファンドの経理状況

- a . ファンドの日本語の中間財務書類は、ルクセンブルグにおける法令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す。これは「特定有価証券の内容等の開示に関する内閣府令」に基づいて、「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す。
- b . ファンドの原文の中間財務書類は、UBS（Lux）マネー・マーケット・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ます。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ます。
- c . ファンドの中間財務書類は、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います。）の監査を受けていません。
- d . ファンドの原文の中間財務書類は、米ドルで表示されています。日本語の中間財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されています。日本円による金額は、2023年5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米ドル=139.77円）を使用して換算された円換算額が併記されています。なお、千円未満の金額は四捨五入されています。

## (1) 資産及び負債の状況

UBS (Lux) マネー・マーケット・ファンド - ミドル・サステナブル

2023年4月30日現在の中間報告書

## 純資産計算書

	米ドル	千円
	2023年4月30日	
<b>資産</b>		
投資有価証券、取得原価	2,618,024,515.67	365,921,287
投資有価証券、未実現評価損益	23,678,347.94	3,309,523
投資有価証券合計(注1)	2,641,702,863.61	369,230,809
現金預金、要求払預金および預託金勘定(注1)	11,371,407.79	1,589,382
定期預金および信託預金(注1)	315,000,000.00	44,027,550
受益証券発行未収金	67,250,821.65	9,399,647
有価証券にかかる未収利息	654,063.00	91,418
流動資産にかかる未収利息	214,740.55	30,014
前払費用	451,029.87	63,040
先渡為替契約にかかる未実現利益(注1)	205,438.29	28,714
資産合計	3,036,850,364.76	424,460,575
<b>負債</b>		
有価証券購入未払金(注1)	(92,625,104.10)	(12,946,211)
受益証券買戻未払金	(24,287,288.86)	(3,394,634)
報酬引当金(注2)	(861,691.57)	(120,439)
年次税引当金(注3)	(27,260.87)	(3,810)
その他の手数料および報酬にかかる引当金(注2)	(534,480.03)	(74,704)
引当金合計	(1,423,432.47)	(198,953)
負債合計	(118,335,825.43)	(16,539,798)
期末現在純資産	2,918,514,539.33	407,920,777

注記は、財務書類と不可分なものです。

## UBS（Lux）マネー・マーケット・ファンド - 米ドル・サステナブル

2023年4月30日現在の中間報告書

## 運用計算書

	米ドル	千円
	自2022年11月1日	至2023年4月30日
収益		
流動資産にかかる受取利息	7,029,674.62	982,538
有価証券にかかる受取利息	2,043,788.45	285,660
分配金	2,201,829.17	307,750
収益合計	11,275,292.24	1,575,948
費用		
報酬（注2）	(4,284,136.91)	(598,794)
年次税（注3）	(136,048.56)	(19,016)
その他の手数料および報酬（注2）	(102,948.05)	(14,389)
現金および当座借越にかかる利息	(60,141.86)	(8,406)
費用合計	(4,583,275.38)	(640,604)
投資純損益	6,692,016.86	935,343
実現損益（注1）		
無オプション市場価格証券にかかる実現損益	(294,418.59)	(41,151)
利回り評価有価証券および短期金融商品にかかる実現損益	34,728,701.61	4,854,031
先渡為替契約にかかる実現損益	(267,368.11)	(37,370)
外国為替にかかる実現損益	(55,420.35)	(7,746)
実現損益合計	34,111,494.56	4,767,764
当期実現純損益	40,803,511.42	5,703,107
未実現評価損益の変動（注1）		
無オプション市場価格証券にかかる未実現評価損益	432,213.90	60,411
利回り評価有価証券および短期金融商品にかかる未実現評価損益	14,721,326.40	2,057,600
先渡為替契約にかかる未実現評価損益	524,665.64	73,333
未実現評価損益の変動合計	15,678,205.94	2,191,343
運用の結果生じた純資産の純増減	56,481,717.36	7,894,450

注記は、財務書類と不可分なものです。

## UBS(Lux) マネー・マーケット・ファンド - 米ドル・サステナブル

2023年4月30日現在の中間報告書

## 純資産変動計算書

	米ドル		千円
	自2022年11月1日	至2023年4月30日	
期首現在純資産	2,764,096,879.04		386,337,821
受益証券発行	1,478,247,135.76		206,614,602
受益証券買戻し	(1,380,311,192.83)		(192,926,095)
純発行(買戻し)合計	97,935,942.93		13,688,507
投資純損益	6,692,016.86		935,343
実現損益合計	34,111,494.56		4,767,764
未実現評価損益の変動合計	15,678,205.94		2,191,343
運用の結果生じた純資産の純増減	56,481,717.36		7,894,450
期末現在純資産	2,918,514,539.33		407,920,777

注記は、財務書類と不可分なものです。

## UBS(Lux) マネー・マーケット・ファンド - ミドル・サステナブル

2023年4月30日現在の中間報告書

## 最重要数値

日付	ISINコード	2023年4月30日	2022年10月31日	2021年10月31日
純資産(米ドル)		2 918 514 539.33	2 764 096 879.04	3 636 388 040.88
クラスF - a c c	LU0454364208			
発行済受益証券口数		388 306.1930	377 501.2200	752 800.6030
1口当たり純資産価格(米ドル)		1 927.59	1 885.01	1 869.55
クラスI - B - a c c	LU0395210163			
発行済受益証券口数		11 184.4320	9 212.4320	15 519.1220
1口当たり純資産価格(米ドル)		1 038.28	1 014.98	1 006.00
クラスI N S T I T U T I O N A L - a c c	LU0395209405			
発行済受益証券口数		127 214.1850	258 465.6430	51 701.1590
1口当たり純資産価格(米ドル)		1 138.85	1 114.11	1 105.55
クラスI - X - a c c	LU0395210247			
発行済受益証券口数		37 971.5170	38 423.6190	24 081.4840
1口当たり純資産価格(米ドル)		1 148.75	1 122.82	1 112.51
クラスK - 1 - a c c	LU0395209157			
発行済受益証券口数		25.2200	31.5580	27.0000
1口当たり純資産価格(米ドル)		5 668 547.48	5 547 157.02	5 506 346.34
クラスP - a c c	LU0006277684			
発行済受益証券口数		748 234.7080	738 996.8680	981 437.1160
1口当たり純資産価格(米ドル)		1 870.04	1 832.37	1 821.11
クラスP R E F E R R E D - a c c <sup>1</sup>	LU2498540348			
発行済受益証券口数		35 557.9590	15 213.8640	-
1口当たり純資産価格(米ドル)		1 029.77	1 007.24	-
クラス(カナダ・ドル・ヘッジ) P - a c c	LU1397021822			
発行済受益証券口数		52 265.0980	51 382.2720	55 327.2600
1口当たり純資産価格(カナダ・ドル)		1 056.66	1 037.22	1 029.90
クラスQ - a c c	LU0357617645			
発行済受益証券口数		2 345 401.7590	651 917.3180	1 162 636.9200
1口当たり純資産価格(米ドル)		110.17	107.81	107.02
クラス(カナダ・ドル・ヘッジ) Q - a c c	LU1397022127			
発行済受益証券口数		64 700.4130	45 914.1760	8 712.7850
1口当たり純資産価格(カナダ・ドル)		107.15	105.04	104.17
クラスU - X - a c c	LU0395210593			
発行済受益証券口数		7 490.6840	4 821.9070	1 987.0800
1口当たり純資産価格(米ドル)		11 599.10	11 337.25	11 233.22

<sup>1</sup> 初回純資産価額：2022年7月8日

注記は、財務書類と不可分なものです。

## U B S（Lux）マネー・マーケット・ファンド - 米ドル・サステナブル

2023年4月30日現在の中間報告書

## 投資有価証券の構成

地域別分類（対純資産割合（％））	
ドイツ	13.71
フランス	13.64
英国	11.44
スウェーデン	10.30
オランダ	9.05
アイルランド	5.69
カナダ	5.08
フィンランド	4.62
日本	3.24
デンマーク	3.22
ノルウェー	3.06
ルクセンブルグ	2.84
スイス	2.07
オーストラリア	1.37
韓国	0.85
アメリカ合衆国	0.34
合計	90.52

産業別分類（対純資産割合（％））	
銀行および金融機関	72.66
信販会社および持株会社	4.03
投資信託	3.72
保険	3.15
交通および運輸	2.04
ヘルスケア・社会福祉	1.37
アセット・バック証券	1.19
公共、非営利機関	1.03
国際機関	0.99
コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置	0.34
合計	90.52

注記は、財務書類と不可分なものです。

## U B S（Lux）マネー・マーケット・ファンド - 米ドル・サステナブル

2023年4月30日現在の中間報告書

## 発行済受益証券口数の変動

	自2022年11月1日	至2023年4月30日
クラス		F - a c c
期首現在発行済受益証券口数		377,501.2200
発行受益証券口数		287,419.2460
買戻受益証券口数		(276,614.2730)
期末現在発行済受益証券口数		388,306.1930
クラス		I - B - a c c
期首現在発行済受益証券口数		9,212.4320
発行受益証券口数		26,639.1730
買戻受益証券口数		(24,667.1730)
期末現在発行済受益証券口数		11,184.4320
クラス		I N S T I T U T I O N A L - a c c
期首現在発行済受益証券口数		258,465.6430
発行受益証券口数		115,129.0410
買戻受益証券口数		(246,380.4990)
期末現在発行済受益証券口数		127,214.1850
クラス		I - X - a c c
期首現在発行済受益証券口数		38,423.6190
発行受益証券口数		270.2860
買戻受益証券口数		(722.3880)
期末現在発行済受益証券口数		37,971.5170
クラス		K - 1 - a c c
期首現在発行済受益証券口数		31.5580
発行受益証券口数		0.7650
買戻受益証券口数		(7.1030)
期末現在発行済受益証券口数		25.2200
クラス		P - a c c
期首現在発行済受益証券口数		738,996.8680
発行受益証券口数		235,087.9300
買戻受益証券口数		(225,850.0900)
期末現在発行済受益証券口数		748,234.7080
クラス		P R E F E R R E D - a c c
期首現在発行済受益証券口数		15,213.8640
発行受益証券口数		27,115.7000
買戻受益証券口数		(6,771.6050)
期末現在発行済受益証券口数		35,557.9590
クラス		(カナダ・ドル・ヘッジ) P - a c c
期首現在発行済受益証券口数		51,382.2720
発行受益証券口数		4,623.7290
買戻受益証券口数		(3,740.9030)
期末現在発行済受益証券口数		52,265.0980
クラス		Q - a c c
期首現在発行済受益証券口数		651,917.3180
発行受益証券口数		2,101,059.6520
買戻受益証券口数		(407,575.2110)
期末現在発行済受益証券口数		2,345,401.7590
クラス		(カナダ・ドル・ヘッジ) Q - a c c
期首現在発行済受益証券口数		45,914.1760
発行受益証券口数		59,427.8400
買戻受益証券口数		(40,641.6030)
期末現在発行済受益証券口数		64,700.4130
クラス		U - X - a c c
期首現在発行済受益証券口数		4,821.9070
発行受益証券口数		5,832.0500
買戻受益証券口数		(3,163.2730)
期末現在発行済受益証券口数		7,490.6840

注記は、財務書類と不可分なものです。

## UBS(Lux) マネー・マーケット・ファンド - 米ドル・サステナブル

2023年4月30日現在の中間報告書

## 2023年4月30日現在投資有価証券およびその他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドルでの評価額 先物 / 先渡し契約 / スワップにかかる 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			
<b>固定利付債</b>			
米ドル			
米ドル INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 3.62500% 14-12.02.24	10 000 000.00	9 889 182.60	0.34
米ドル SVENSKA HANDELSBANKEN AB-REG-S 0.62500% 20-30.06.23	8 000 000.00	7 935 849.84	0.27
米ドル合計		17 825 032.44	0.61
<b>固定利付債合計</b>		17 825 032.44	0.61
<b>変動利付ミディアム・ターム・ノート</b>			
米ドル			
米ドル TORONTO DOMINION BANK 3M SOFR+91BP 22-08.03.24	10 000 000.00	10 002 976.30	0.35
米ドル合計		10 002 976.30	0.35
<b>変動利付ミディアム・ターム・ノート合計</b>		10 002 976.30	0.35
<b>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</b>		27 828 008.74	0.96
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			
<b>変動利付ミディアム・ターム・ノート</b>			
米ドル			
米ドル TORONTO-DOMINION 0/N SOFR+35.5BP 21-04.03.24	5 000 000.00	4 981 551.75	0.17
米ドル合計		4 981 551.75	0.17
<b>変動利付ミディアム・ターム・ノート合計</b>		4 981 551.75	0.17
<b>他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計</b>		4 981 551.75	0.17
ルクセンブルグ2010年12月17日法(改訂済)の第41条(1)h)に規定されたその他の短期金融商品			
<b>ユーロ譲渡性預金証書、ゼロ・クーポン</b>			
米ドル			
米ドル ABN AMRO BANK NV ECD 0.00000% 13.04.23-02.10.23	8 000 000.00	7 819 483.68	0.27
米ドル BANK OF MONTREAL ECD 0.000000% 08.11.22-07.11.23	20 000 000.00	19 462 628.00	0.67
米ドル BANK OF MONTREAL LONDON ECD 0.00000% 06.04.23-06.10.23	30 000 000.00	29 331 324.90	1.01
米ドル BANK OF MONTREAL/LONDON ECD 0.00000% 06.07.22-05.07.23	10 000 000.00	9 907 264.00	0.34
米ドル BANK OF MONTREAL/LONDON ECD 0.00000% 20.07.22-19.07.23	23 000 000.00	22 742 458.88	0.78
米ドル BARCLAYS BANK PLC ECD 0.00000% 13.01.23-13.10.23	30 000 000.00	29 270 441.40	1.00
米ドル CANADIAN IMPRAL BK OF COM/LON ECD 0.00000% 05.04.23-03.04.24	21 000 000.00	19 970 081.46	0.68
米ドル CANADIAN IMPRAL BK OF COM/LON ECD 0.00000% 20.04.23-20.10.23	19 000 000.00	18 512 565.83	0.63
米ドル COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALI ECD 0.00000% 09.01.23-09.01.24	24 000 000.00	23 138 048.40	0.79
米ドル JYSKE BANK A/S ECD 0.00000% 01.02.23-02.08.23	50 000 000.00	49 314 566.00	1.69
米ドル JYSKE BANK A/S ECD 0.00000% 11.04.23-12.05.23	20 000 000.00	19 960 102.00	0.68
米ドル MITSUBISHI UFJ TRUST & BANK ECD 0.00000% 23.01.23-19.05.23	19 000 000.00	18 943 325.66	0.65
米ドル MIZUHO BANK LTD/SYDNEY ECD 0.00000% 15.02.23-15.05.23	15 000 000.00	14 963 480.85	0.51
米ドル MUFG BANK LTD/LONDON ECD 0.00000% 31.01.23-25.07.23	50 000 000.00	49 362 654.50	1.69

注記は、財務書類と不可分なものです。

## U B S（Lux）マネー・マーケット・ファンド - 米ドル・サステナブル

2023年4月30日現在の中間報告書

銘柄	数量 / 額面	米ドルでの評価額 先物 / 先渡し契約 / スワップにかかる 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
米ドル MUFG BANK LTD/SYDNEY-REG-S ECD 0.00000% 27.04.23-27.06.23	8 000 000.00	7 931 032.64	0.27
米ドル NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD ECD 0.00000% 11.04.23-13.11.23	40 000 000.00	38 831 446.00	1.33
米ドル NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD ECD 0.00000% 24.04.23-24.01.24	40 000 000.00	38 410 968.80	1.32
米ドル ROYAL BANK OF CANADA ECD 0.00000% 20.10.22-19.10.23	20 000 000.00	19 494 755.60	0.67
米ドル SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LT ECD 0.00000% 01.03.23-01.06.23	30 000 000.00	29 855 809.80	1.02
米ドル SUMITOMO MITSUI TRUST BK ECD 0.00000% 03.02.23-03.05.23	30 000 000.00	29 978 768.40	1.03
米ドル SUMITOMO MITSUI TRUST BK ECD 0.00000% 11.04.23-11.07.23	12 000 000.00	11 871 904.44	0.41
米ドル合計		509 073 111.24	17.44
ユーロ譲渡性預金証書、ゼロ・クーポン合計		509 073 111.24	17.44
変動利付ユーロ譲渡性預金証書			
米ドル			
米ドル TORONTO-DOMINION BK/LON ECD O/N SOFR+63BP 07.11.22-08.05.23	17 000 000.00	17 001 446.70	0.58
米ドル合計		17 001 446.70	0.58
変動利付ユーロ譲渡性預金証書合計		17 001 446.70	0.58
ユーロ・コマーシャル・ペーパー、ゼロ・クーポン			
米ドル			
米ドル ABN AMRO BANK NV ECP 0.00000% 05.01.23-05.07.23	46 000 000.00	45 555 168.50	1.56
米ドル ABN AMRO BANK NV ECP 0.00000% 06.02.23-05.02.24	45 000 000.00	43 159 513.05	1.48
米ドル AGENCE CENTRALE ORG SS-REG-S ECP 0.00000% 05.04.23-11.05.23	40 000 000.00	39 927 232.80	1.37
米ドル AKADEMISKA HUS AB-REG-S ECP 0.00000% 06.02.23-08.05.23	30 000 000.00	29 961 009.60	1.03
米ドル ALLIANZ SE REG-S ECP 0.00000% 17.02.23-17.08.23	21 000 000.00	20 655 761.28	0.71
米ドル ALLIANZ SE-REG-S ECP 0.00000% 01.03.23-01.06.23	30 000 000.00	29 854 739.70	1.02
米ドル ALLIANZ SE-REG-S ECP 0.00000% 02.02.23-02.08.23	42 000 000.00	41 405 546.28	1.42
米ドル BANQUE FED DU CRE MUTUEL ECP 0.00000% 23.02.23-26.02.24	25 000 000.00	23 909 707.25	0.82
米ドル BANQUE FED DU CREDIT MUTUEL ECP 0.00000% 24.04.23-26.10.23	20 000 000.00	19 461 277.40	0.67
米ドル BERLIN HYP AG-REG-S ECP 0.00000% 17.01.23-17.07.23	30 000 000.00	29 652 938.70	1.02
米ドル BERLIN HYP AG-REG-S ECP 0.00000% 21.02.23-22.05.23	30 000 000.00	29 898 362.10	1.02
米ドル BERLIN HYP AG-REG-S ECP 0.00000% 27.02.23-30.05.23	30 000 000.00	29 864 444.40	1.02
米ドル BGL BNP PARIBAS SA ECP 0.00000% 01.02.23-01.08.23	50 000 000.00	49 333 190.00	1.69
米ドル BNG BANK NV ECP 0.00000% 23.02.23-23.05.23	51 000 000.00	50 820 214.80	1.74
米ドル BQE FEDERATIVE DU CRMUT ECP 0.00000% 21.11.22-22.05.23	10 000 000.00	9 966 447.20	0.34
米ドル BQE FEDERATIVE DU CRMUT-REG-S ECP 0.00000% 17.01.23-17.08.23	28 000 000.00	27 541 610.60	0.94
米ドル BRED - BANQUE POPULAIRE ECP 0.00000% 02.05.23-02.08.23	20 000 000.00	19 730 740.00	0.68
米ドル BRED - BANQUE POPULAIRE ECP 0.00000% 27.02.23-30.05.23	20 000 000.00	19 908 955.60	0.68
米ドル BRED BANQUE POPULAIRE ECP 0.00000% 03.02.23-03.05.23	10 000 000.00	9 992 963.90	0.34
米ドル COOPERATIEVE RABOBANK ECP 0.00000% 06.01.23-06.10.23	11 000 000.00	10 744 748.30	0.37
米ドル COOPERATIEVE RABOBANK-REG-S ECP 0.00000% 02.05.23-05.09.23	25 000 000.00	24 542 000.00	0.84
米ドル COOPERATIEVE RABOBANK-REG-S ECP 0.00000% 12.04.23-12.10.23	40 000 000.00	39 034 566.80	1.34
米ドル COOPERATIEVE RABOBANK-REG-S ECP 0.00000% 20.01.23-20.07.23	21 000 000.00	20 759 420.64	0.71
米ドル CREDIT AGRICOLE SA ECP 0.00000% 02.03.23-02.06.23	35 000 000.00	34 825 574.00	1.19
米ドル CREDIT AGRICOLE SA ECP 0.00000% 17.04.23-17.07.23	45 000 000.00	44 480 403.00	1.52
米ドル DEKABANK DEUTSCHE GIROZENTRAL ECP 0.00000% 27.03.23-27.06.23	40 000 000.00	39 660 333.60	1.36
米ドル DEKABANK DEUTSCHE GIROZENTRAL ECP 0.00000% 28.03.23-28.06.23	20 000 000.00	19 827 284.00	0.68
米ドル DEN NORSKE BANK ASA ECP 0.00000% 06.06.22-05.06.23	15 000 000.00	14 921 456.70	0.51
米ドル DNB BANK ASA ECP 0.00000% 08.02.23-08.08.23	31 000 000.00	30 549 512.96	1.05

## UBSファンド・マネジメント(ルクセンブルグ) エス・エイ(E14900)

訂正有価証券届出書(外国投資信託受益証券)

米ドル	DNB BANK ASA ECP 0.00000%	11.01.23-11.07.23	15 000 000.00	14 844 406.20	0.51
米ドル	DNB BANK ASA ECP 0.00000%	30.12.22-29.12.23	30 000 000.00	28 939 859.70	0.99
米ドル	DZ BK AG DEUT ZEN-GENBK REG-S ECP 0.00000%	28.04.23-31.10.23	50 000 000.00	48 649 500.00	1.67

注記は、財務書類と不可分なものです。

## UBS（Lux）マネー・マーケット・ファンド - 米ドル・サステナブル

2023年4月30日現在の中間報告書

銘柄	数量 / 額面	米ドルでの評価額 先物 / 先渡し契約 / スワップにかかる 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
米ドル DZ PRIVATBANK SA ECP 0.00000% 10.02.23-09.02.24	15 000 000.00	14 385 775.05	0.49
米ドル DZ PRIVATBANK SA REG-S ECP 0.00000% 21.04.23-22.01.24	20 000 000.00	19 227 082.60	0.66
米ドル EUROFIMA ECP 0.00000% 27.02.23-04.05.23	29 000 000.00	28 975 517.62	0.99
米ドル EUROFIMA EUROPAEISCHE ECP 0.00000% 16.02.23-16.08.23	32 000 000.00	31 497 348.48	1.08
米ドル FED CAISSE-REG-S ECP 0.00000% 13.04.23-13.07.23	20 000 000.00	19 783 842.60	0.68
米ドル ING BANK NV-REG-S ECP 0.00000% 15.11.22-14.11.23	10 000 000.00	9 709 271.60	0.33
米ドル JYSKE BANK A/S ECP 0.00000% 02.05.23-02.08.23	25 000 000.00	24 667 150.00	0.85
米ドル KOREA DEVELOPMENT BANK LONDON ECP 0.00000% 14.04.23-14.07.23	25 000 000.00	24 726 837.25	0.85
米ドル KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFB ECP 0.00000% 28.04.23-02.10.23	27 000 000.00	26 407 085.40	0.91
米ドル LA BANQUE POSTALE SA ECP 0.00000% 27.01.23-27.07.23	10 000 000.00	9 871 481.40	0.34
米ドル LA BANQUE POSTALE SA-REG-S ECP 0.00000% 17.01.23-24.07.23	20 000 000.00	19 751 749.80	0.68
米ドル LA BANQUE POSTALE SA-REG-S ECP 0.00000% 27.03.23-27.06.23	40 000 000.00	39 660 333.60	1.36
米ドル LANDESBANK BADEN-WURTTTE ECP 0.00000% 07.02.23-07.06.23	30 000 000.00	29 834 019.30	1.02
米ドル LANDESBANK BADEN-WURTTTE ECP 0.00000% 18.01.23-18.07.23	30 000 000.00	29 656 384.80	1.02
米ドル LANDESKREDITBANK B-WUER-REG-S ECP 0.00000% 16.02.23-16.05.23	20 000 000.00	19 949 726.60	0.68
米ドル LANDWIRT RENTENBK-REG-S ECP 0.00000% 25.04.23-25.05.23	5 000 000.00	4 981 149.15	0.17
米ドル LLOYDS TSB BK PLC ECP 0.00000% 03.01.23-03.07.23	35 000 000.00	34 671 236.95	1.19
米ドル LLOYDS TSB BK PLC ECP 0.00000% 07.11.22-08.05.23	20 000 000.00	19 971 547.40	0.68
米ドル NORDEA BANK ABP-REG-S ECP 0.00000% 26.01.23-26.07.23	50 000 000.00	49 380 703.00	1.69
米ドル NORDEA BANK ABP-REG-S ECP 0.00000% 28.10.22-27.10.23	10 000 000.00	9 745 055.10	0.33
米ドル OP CORPORATE BANK PLC ECP 0.00000% 05.01.23-04.01.24	10 000 000.00	9 647 281.70	0.33
米ドル OP CORPORATE BANK PLC ECP 0.00000% 09.05.22-08.05.23	29 000 000.00	28 962 404.40	0.99
米ドル OP CORPORATE BANK PLC ECP 0.00000% 14.12.22-13.12.23	29 000 000.00	28 066 502.18	0.96
米ドル OP CORPORATE BANK PLC ECP 0.00000% 20.09.22-20.06.23	9 000 000.00	8 937 457.11	0.31
米ドル REGIE AUTONOME DES TRANSPORTS ECP 0.00000% 23.03.23-23.06.23	60 000 000.00	59 526 288.00	2.04
米ドル SBAB BANK AB ECP 0.00000% 03.05.23-03.08.23	24 000 000.00	23 681 664.00	0.81
米ドル SBAB BANK AB ECP 0.00000% 08.02.23-08.05.23	25 000 000.00	24 965 663.75	0.86
米ドル SBAB BANK AB ECP 0.00000% 09.11.22-09.05.23	40 000 000.00	39 939 576.40	1.37
米ドル SKANDINAVISKA ENSKIL BK-REG-S ECP 0.00000% 08.02.23-08.08.23	30 000 000.00	29 560 137.30	1.01
米ドル SKANDINAVISKA ENSKIL BK-REG-S ECP 0.00000% 23.01.23-24.07.23	30 000 000.00	29 626 160.10	1.02
米ドル SKANDINAVISKA ENSKILDA-REG-S ECP 0.00000% 21.02.23-21.08.23	31 000 000.00	30 486 986.89	1.04
米ドル SOCIETE GENERALE-REG-S ECP 0.00000% 05.01.23-05.10.23	20 000 000.00	19 529 327.20	0.67
米ドル SWEDBANK AB-REG-S ECP 0.00000% 26.01.23-26.07.23	22 000 000.00	21 719 071.00	0.74
米ドル SWEDBANK-REG-S ECP 0.00000% 08.11.22-08.05.23	48 000 000.00	47 933 811.84	1.64
米ドル SWEDBANK-REG-S ECP 0.00000% 14.11.22-15.05.23	15 000 000.00	14 964 871.50	0.51
米ドル THE TORONTO-DOMINION BANK ECP 0.00000% 06.04.23-06.10.23	37 000 000.00	36 132 915.36	1.24
米ドル TORONTO DOMINION BANK ECP 0.00000% 30.01.23-30.10.23	26 000 000.00	25 293 344.96	0.87
米ドル TOYOTA FINANCE AUSTRALIA LTD ECP 0.00000% 08.02.23-08.08.23	17 000 000.00	16 753 900.01	0.57
米ドル TOYOTA MOTOR FINANCE BV ECP 0.00000% 17.04.23-17.07.23	12 000 000.00	11 865 116.88	0.41
米ドル ZUR FIN IRE ECP 0.00000% 05.01.23-06.07.23	10 000 000.00	9 899 838.60	0.34
米ドル ZUR FIN IRE-REG-S ECP 0.00000% 04.01.23-05.07.23	20 000 000.00	19 802 722.20	0.68
米ドル ZUR FIN IRE-REG-S ECP 0.00000% 23.02.23-23.08.23	18 000 000.00	17 688 785.04	0.61
米ドル ZURICH FINANCE IRELAND-REG-S ECP 0.00000% 23.02.23-23.05.23	10 000 000.00	9 964 442.00	0.34
米ドル合計		1 974 180 455.18	67.65
ユーロ・コマーシャル・ペーパー、ゼロ・クーポン合計		1 974 180 455.18	67.65
ルクセンブルグ2010年12月17日法（改訂済）の第41条(1)h)に規定されたその他の短期金融商品合計		2 500 255 013.12	85.67

注記は、財務書類と不可分なものです。

## UBS（Lux）マネー・マーケット・ファンド - 米ドル・サステナブル

2023年4月30日現在の中間報告書

銘柄	数量 / 額面	米ドルでの評価額 先物 / 先渡し契約 / スワップにかかる 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
ルクセンブルグ2010年12月17日法（改訂済）の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIS			
<b>投資信託、オープン・エンド型</b>			
アイルランド 米ドル UBS (IRL) SELECT MONEY MARKET FUND-USD-S-DIST	10 863.83	108 638 290.00	3.72
アイルランド合計		108 638 290.00	3.72
<b>投資信託、オープン・エンド型合計</b>		108 638 290.00	3.72
ルクセンブルグ2010年12月17日法（改訂済）の第41条(1)e)に規定された UCITS/その他のUCIS合計			
		108 638 290.00	3.72
<b>投資有価証券合計</b>		2 641 702 863.61	90.52
<b>先渡し替契約</b>			
<b>購入通貨 / 購入額 / 売却通貨 / 売却額 / 満期日</b>			
カナダ・ドル 61 565 000.00	米ドル 45 214 523.88	31.5.2023	205 438.29
先渡し替契約合計			205 438.29
現金預金、要求払預金および預託金勘定ならびにその他の流動資産		11 371 407.79	0.39
定期預金および信託預金		315 000 000.00	10.79
その他の資産および負債		-49 765 170.36	-1.71
<b>純資産総額</b>		2 918 514 539.33	100.00

注記は、財務書類と不可分なものです。

## 財務書類に対する注記

2023年4月30日現在

## 注1 重要な会計方針の要約

財務書類は、ルクセンブルグにおける投資信託に関する一般に公正妥当と認められる会計原則に従って作成されています。重要な会計方針は、以下のとおり要約されます。

## a) 純資産額の計算

各サブ・ファンドまたはクラスの受益証券1口当たり純資産価格、発行価格および買戻価格は、各サブ・ファンドまたはクラス受益証券の基準通貨で表示され、毎営業日に各クラス受益証券に帰属する各サブ・ファンドの純資産総額を各サブ・ファンドの各クラス受益証券の流通している受益証券の口数で除することにより計算されます。純資産価格は、各サブ・ファンドのウェブサイトのパブリック・セクションにおいて、各営業日に公表されます。

「営業日」とは、ルクセンブルグにおける通常の銀行営業日（すなわち、銀行が通常の営業時間に営業を行っている日）をいいます。ただし、12月24日および31日、ルクセンブルグおよびスイスにおける個々の法定外休日ならびに/またはサブ・ファンドの純資産の半分以上を評価している証券取引所および市場がある国々の通常の公休日を除きます。「法定外休日」とは、複数の銀行および金融機関が休業している日です。

ただし、受益証券の純資産価格は、以下の項に記載される通り、受益証券の発行または買戻しを行わない日にも算出されることがあります。受益証券が発行されなかった日に計算された純資産価格は、各サブ・ファンドのウェブサイトのパブリック・セクションにおいて公表されることがありますが、運用実績、統計数値または報酬を算出する目的のためだけに利用することができます。いかなる状況においても購入申込みまたは買戻請求のための根拠として利用されることはありません。

サブ・ファンドの各クラス受益証券に帰属する純資産価格の割合は、受益証券が発行または買い戻されるたびに変動します。この割合は、各クラス受益証券に請求される手数料を考慮して、サブ・ファンドの流通している受益証券の総口数に対する各クラス受益証券の流通している受益証券口数の比率により決定されます。

## b) 評価原則

- 証券取引所に上場されているデリバティブおよびその他の投資対象証券は、市場価格の終値で評価されます。これらのデリバティブまたはその他の投資対象証券が複数の証券取引所に上場されている場合には、同証券の主たる市場である証券取引所の直近の入手可能な価格が適用されます。

証券取引所における取引が頻繁には行われず、また、流通市場が存在し、市場と同水準のプライシングがなされている場合、管理会社は、かかるデリバティブおよびその他の投資対象証券をかかる価格で評価することができるものとします。証券取引所には上場されていないが公認かつ公開で定期的に運営されているその他の規制ある市場において取引されているデリバティブおよびその他の投資対象証券は、同市場における最終の入手可能な価格で評価されます。

- 証券取引所には上場されておらず、その他の規制ある市場においても取引されておらず、また、その適正価格を取得することができない投資対象証券は、管理会社により、類似の販売価格を基準とし誠実に選定されるその他の原則に従い評価されます。この基準は、常にMMF規則に一致するものとします。

- 証券取引所に上場されていないデリバティブ（店頭デリバティブ）は、独立した価格情報源に基づき評価されます。デリバティブに関して一つの価格情報源しか存在しない場合、取得した評価の信頼性は、デリバティブの由来する裏付商品の市場価値に基づき、管理会社が認める計算方法を用いて検証

されます。

この評価は、UBSグローバル評価委員会の専門家のサポートを受けた管理会社の評価専門家による評価に基づいて、管理会社の決定により確定されます。このプロセスで用いられる基準は、常にMMF規則に一致するものとします。

- その他のマネー・マーケット・ファンドの受益証券は、最新の純資産価格で評価されます。他のマネー・マーケット・ファンドの特定の受益証券または投資証券は、対象ファンドのポートフォリオ・マネージャーまたは投資顧問会社から独立している信頼できる業務提供者によって提供された評価額の見積もりに基づいて評価される可能性があります(評価額の見積もり)。
- 証券取引所または公開されているその他の規制ある市場で取引されていない短期金融商品は、関連する利回り曲線に基づき評価されます。利回り曲線に基づく評価は、金利および信用スプレッドの構成要素を基準とします。このプロセスには以下の原則が適用されます。各短期商品について、満期までの残余期間に最も近い金利が補完されます。このように計算された金利は、対象となる借手を反映する信用スプレッドを加算することによって市場価格に換算されます。この信用スプレッドは、借主の信用格付に重大な変更があった場合に調整されます。

注文日から決済日までの間のサブ・ファンドの受取利息は、関連するサブ・ファンドの資産評価に含まれます。従って、当該評価日における受益証券1口当たりの資産価格は、見積り利子所得を含むものとします。

- 該当する各サブ・ファンドの参照通貨以外の通貨建てで、かつ為替取引によりヘッジされていない短期金融商品、デリバティブおよびその他の投資対象証券は、ルクセンブルグにおける為替相場の仲値(売買相場の仲値)または入手できない場合には、当該通貨の代表市場における仲値で評価されます。
- 定期預金および投資信託は、額面価格に経過累積利息を加算した額で評価されます。
- スワップの評価額は、外部のサービス・プロバイダーによって計算され、さらに二つめの第三者による評価額は、その他の外部サービス・プロバイダーから提供されます。当該計算は、イン・フローおよびアウト・フローを含むすべてのキャッシュ・フローの純現在価値に基づいて行われます。ある特定の場合に限り、(ブルームバーグから入手されたモデルおよび市場データに基づく)内部計算および/またはブローカーによって提示された評価額が使用されることがあります。評価手法は、それぞれの投資対象証券に応じて決定され、また適用されるUBSの評価方針に従って決定されます。

異常事態のため上記規則に基づく評価が実行不可能または不正確になる場合、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かつ監査可能な評価基準を適用する権限を付与されます。

異常事態においては、当該日に追加の評価ができます。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公式なものです。

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、直近で取得可能な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ります。これらの費用は、サブ・ファンドの価額にマイナスの影響を与え、「希薄化」と呼ばれます。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に対して希薄化の調整を行うことができます(スイング・プライシング)。

受益証券は、単一価格すなわち受益証券1口当たり純資産価格に基づき発行され、買い戻されます。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、以下に述べる通り、評価日に調整されます。これは、サブ・ファンドが関連する評価日において正味発行または正味買戻ポジションにあるかどうかにかかわらず行われます。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、未調整の受益証券1口当たり純資産価格が適用されます。取締役会は、そのような状況で希薄化の調整を行うべきかどうかを決定する裁量権を有してい

ます。希薄化の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します。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、希薄化の調整をしなければ不利になる可能性がある場合、希薄化の調整を適用する可能性があります。希薄化の調整は、以下の場合に行われる可能性があります。

- (a) サブ・ファンドが、一定して下落(すなわち、買戻しによる純流出)を記録する場合
- (b) サブ・ファンドが、その規模に比して相当量の正味発行を記録する場合
- (c) サブ・ファンドが、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ポジションを示す場合
- (d) 取締役会が受益者の利益のために希薄化の調整が必要であると考え他のすべての場合

評価の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は増額または減額されます。評価の調整の範囲は、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し、特に、それぞれのサブ・ファンドの純資産価格は、( )見積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)調整されます。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、純流入と純流出の調整が異なる可能性があります。調整は、通常、その時点での受益証券1口当たりの純資産価格の1%を上限とします。例外的な状況(例:市場のボラティリティが高い場合および/または流動性が低い場合、異常な市況、市場の混乱など)の下では、取締役会は、いずれかのサブ・ファンドおよび/または評価日に関して、その時点での受益証券1口当たりの純資産価格の1%を超える希薄化の調整を一時的に適用することを決定することができますが、これはその時点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します。この希薄化の調整は、取締役会によって決定された方法に従って計算されます。受益者は、一時的措置が導入された時点およびその一時的措置が終了した時点で通常用いられている連絡経路を通じて通知を受けます。

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ます。しかし、希薄化の調整は、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ます。希薄化の調整は、サブ・ファンドのレベルで行われ、資本取引に関係しますが、個々の投資者取引の特殊な状況には関係しません。

2023年4月30日現在、スイング・プライシングの技法は実施されませんでした。

#### c) 割引短期金融商品および有価証券

割引短期金融商品および有価証券の未実現評価損益は、運用計算書において「利回り評価有価証券および短期金融商品にかかる未実現評価損益」として開示されています。これらの評価益は、満期日に「利回り評価有価証券および短期金融商品にかかる実現損益」へ移されます。

#### d) 有価証券の売却にかかる実現純(損)益

有価証券の売却にかかる実現損益は、売却有価証券の平均取得原価に基づいて計算されます。

#### e) 外貨換算

各サブ・ファンドの基準通貨以外の通貨建てで保有される銀行預金、その他の純資産額および投資有価証券の評価額は、評価日における最終直物相場の仲値で換算されます。各サブ・ファンドの基準通貨以外の通貨建ての収益および費用は、支払日における最終直物相場の仲値で換算されます。外国為替にかかる損益は、運用計算書に含まれます。

各サブ・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、取得日における最終直物相場  
の仲値で換算されます。

f) 投資有価証券取引の計上

投資有価証券取引は、取引日に計上されます。

g) 連結財務書類

連結財務書類は、米ドルで表示されています。ファンドの2023年4月30日現在の連結純資産計算書および連結運用計算書の各種項目は、以下の為替レートで米ドル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合計金額に等しくなっています。

以下の為替レートが、2023年4月30日現在の連結財務書類の換算に使用されました。

為替レート：			
1米ドル	=	1.513203	オーストラリア・ドル
1米ドル	=	0.890050	スイス・フラン
1米ドル	=	0.905797	ユーロ
1米ドル	=	0.795608	英ポンド

h) 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」という項目は、外貨建取引からの未収金を含むことがあります。「有価証券購入未払金」という項目は、外貨建取引からの未払金を含むことがあります。

i) 現金および定期預金

現金は評価日に計上され、定期預金は取引日に計上されます。

注2 報酬

ファンドは、受益証券クラスP、受益証券クラスN、受益証券クラスK - 1、受益証券クラスF、受益証券クラスQ、受益証券クラスINSTITUTIONAL、受益証券クラスPREFERREDおよび受益証券クラスPREMIERに関し、サブ・ファンドの平均純資産額に基づいて下表のとおり計算される、月次上限報酬を支払います。

UBS (Lux) マネー・マーケット・ファンド - オーストラリア・ドル・サステナブル

UBS (Lux) マネー・マーケット・ファンド - スイス・フラン・サステナブル

UBS (Lux) マネー・マーケット・ファンド - ユーロ・サステナブル

UBS (Lux) マネー・マーケット・ファンド - 英ポンド・サステナブル

UBS (Lux) マネー・マーケット・ファンド - 米ドル・サステナブル

UBS (Lux) マネー・マーケット・ファンド	上限報酬	名称の一部に「ヘッジ」を含むクラス受益証券の 上限報酬
名称に「P」が付くクラス受益証券	0.500%	0.550%
名称に「K - 1」が付くクラス受益証券	0.240%	0.270%
名称に「K - B」が付くクラス受益証券	0.035%	0.035%
名称に「K - X」が付くクラス受益証券	0.000%	0.000%
名称に「F」が付くクラス受益証券	0.100%	0.130%

名称に「Q」が付くクラス受益証券	0.240%	0.290%
名称に「QL」が付くクラス受益証券	0.240%	0.290%
名称に「INSTITUTIONAL」が付く クラス受益証券	0.180%	0.210%
名称に「PREFERRED」が付くクラス受益証券	0.140%	0.170%
名称に「PREMIER」が付くクラス受益証券	0.100%	0.130%
名称に「I-B」が付くクラス受益証券	0.035%	0.035%
名称に「I-X」が付くクラス受益証券	0.000%	0.000%
名称に「U-X」が付くクラス受益証券	0.000%	0.000%

下記クラス受益証券に適用される報酬は以下のとおりです。

UBS (Lux) マネー・マーケット・ファンド	2023年4月30日	2022年10月31日
スイス・フラン・サステナブル F - a c c	0.070%	0.050%
スイス・フラン・サステナブル P - a c c	0.350%	0.050%
スイス・フラン・サステナブル Q - a c c	0.170%	0.050%
ユーロ・サステナブル F - a c c	0.100%	0.050%
ユーロ・サステナブル I N S T I T U T I O N A L - a c c	0.180%	0.050%
ユーロ・サステナブル P - a c c	0.500%	0.050%
ユーロ・サステナブル P R E M I E R - a c c	0.100%	0.050%
ユーロ・サステナブル Q - a c c	0.200%	0.050%

上記の報酬は以下のように使用されます。

1. 管理会社は、ファンドの運用、管理事務、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、ファンド資産からファンドの純資産価額に基づく上限報酬を受領します。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、毎月支払われます（上限報酬）。名称の一部に「ヘッジ」を含むクラス受益証券の上限報酬は、通貨リスクをヘッジするための手数料を含むことがあります。対応する各クラス受益証券が設定されるまでは、関連する上限報酬は支払われません。上限報酬の概要は、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」に記載されています。

当該報酬は、運用計算書の「報酬」に表示されています。

2. 上限報酬には、ファンドに請求される以下の報酬および追加の費用は含まれません。

- a) 資産の売買のためのファンド資産の管理に関する一切の追加の費用（市場、手数料、報酬等に合致する買呼値および売呼値のスプレッド、仲介手数料）。かかる費用は、通常、各資産の売買時点で計算されます。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によって生じるかかる追加の費用は、販売目論見書の「純資産価額、発行、買戻しおよび転換価格」の項に記載されているスイング・プライシングの原理の適用によりカバーされます。
- 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への費用ならびに監督官庁およびサブ・ファンドが上場されている証券取引所に関する一切の手数料。
- 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認可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監査人が提供するサービスに関して監査人に支払われるか、または法律によって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（翻訳コストを含みます。）。

- f) ファンドの法的文書に関するコスト（目論見書、主要な投資家向け資料（KIID）、年次報告書および半期報告書ならびに居住国および販売が行われる国で法的に要求されるその他の一切の文書）。
- g) 外国の監督官庁へのファンドの登録に関するコスト（該当する場合、手数料、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みます。）。
- h) ファンドによる議決権または債権者の権利の使用により発生した費用（外部顧問報酬を含みます。）。
- i) ファンドの名義で登録された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た特別措置に関して生じた一切の費用。
- k) 管理会社が投資者の利益につき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た費用（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ます。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ます。ただし、かかるすべての管理事務コストは、証明可能かつ開示されており、ファンドの総費用率（TER）の開示において考慮されます。

これらの手数料および報酬は、運用計算書の「その他の手数料および報酬」に表示されています。

### 3. 管理会社は、ファンドの販売業務をカバーするために手数料を支払うことができます。

ファンドの収益および資産につき徴収されるすべての税金（特に年次税）も、ファンドが負担します。

上限報酬を採用していない各ファンドの運用会社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」という用語を用いています。上限管理報酬は、上限報酬の80%と定められています。

受益証券クラス「I - B」について、報酬は、ファンドの管理事務費用（管理会社、管理事務代行および保管受託銀行の費用からなる）を賄うために請求されます。資産運用および販売に関する費用は、投資者とUBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジーまたは公認の代理人との間で直接結ばれた個別契約に基づき、ファンド外で請求されます。

受益証券クラス「 - X」「K - X」および「U - X」の資産運用、ファンド管理事務（管理会社、管理事務代行および保管受託銀行の費用からなる）および販売について実施された業務に関連する費用は、投資者との個別契約に基づきUBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジーが受け取る権利を有する報酬によって賄われます。

受益証券クラス「K - B」に提供された資産運用業務に関連する費用は、投資者との個別契約に基づきUBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジーまたは公認の販売会社が受け取る権利を有する報酬によって賄われます。

個々のサブ・ファンドに割り当てられるすべての費用は、当該サブ・ファンドに請求されます。クラス受益証券に割り当てられる費用は、当該クラス受益証券に請求されます。複数またはすべてのサブ・ファンド/クラス受益証券に関する費用は、これらの費用について当該サブ・ファンド/クラス受益証券がその純資産価額に比例して請求されます。

各サブ・ファンドの投資方針の条項に基づき他の既存のマナー・マーケット・ファンドに投資することができるサブ・ファンドについて、サブ・ファンドおよび当該対象ファンドの双方において、費用が発生することがあります。サブ・ファンドの資産が投資される対象ファンドの管理報酬の上限は、全ての販売手数料を考慮し3%です。

管理会社自ら、あるいは共同経営もしくは支配または実質的な直接もしくは間接の保有を通じ、直接もしくは間接に運用している投資信託の受益証券への投資の場合、対象ファンドのサブ・ファンドの持分に対して、対象ファンドの発行または買戻手数料が請求されないことがあります。

管理会社の現行の費用(または現行の手数料)の詳細は、K I D sに記載されています。

### 注3 年次税

ファンドはルクセンブルグの法令の適用対象です。ルクセンブルグ大公国の現行法令に従い、ファンドはルクセンブルグの源泉徴収税、所得税、キャピタル・ゲイン税または富裕税を課せられません。しかしながら、各サブ・ファンドは、各四半期末日において、純資産総額に対し年率0.01%に減額された、ルクセンブルグ大公国の年次税を課せられます。この税は、各サブ・ファンドの各四半期末日における純資産総額に基づいて計算されます。

### 注4 収益の分配

約款第10条に従い、年次決算の終了とともに、管理会社は、各サブ・ファンドおよびクラス受益証券毎に分配金の支払を行うべきかおよび分配の程度を決定します。分配金を支払うことによって、ファンドの純資産額が法律の定めるファンド資産の最低額を下回ることがあってはなりません。分配が行われる場合、支払は会計年度の終了から4か月以内に行われます。

取締役会は、中間分配金を支払い、また分配金支払を停止する権限を有しています。

収入調整金は、分配金と実際に収入を受け取る権利が一致するように計算されます。

### 注5 ソフト・コミッション契約

2022年11月1日から2023年4月30日までの会計期間中にUBS(Lux)マネー・マーケット・ファンドのために締結された「ソフト・コミッション契約」はなく、したがって、「ソフト・コミッション契約」の金額も計上されていません。

### 注6 総費用率(TER)

この比率は、スイス・ファンド・アンド・アセット・マネジメント協会(SFAMA)によって公布された「TERおよびPTRの計算および開示のガイドライン」現行版に準拠して計算されており、純資産に対して継続的に課されるすべての費用および手数料(運営費用)を過去に遡って合計したものの純資産に対する比率で表されます。

過去12か月のT E Rは以下のとおりです。

UBS (Lux) マネー・マーケット・ファンド	総費用率(T E R)
オーストラリア・ドル・サステナブル K - 1 - a c c	0.25%
オーストラリア・ドル・サステナブル P - a c c	0.49%
オーストラリア・ドル・サステナブル Q - a c c	0.25%
スイス・フラン・サステナブル F - a c c	0.08%
スイス・フラン・サステナブル P - a c c	0.12%
スイス・フラン・サステナブル Q - a c c	0.09%
スイス・フラン・サステナブル U - X - a c c	0.02%
ユーロ・サステナブル F - a c c	0.11%
ユーロ・サステナブル - B - a c c	0.05%
ユーロ・サステナブル INSTITUTIONAL - a c c	0.10%
ユーロ・サステナブル - X - a c c	0.02%
ユーロ・サステナブル P - a c c	0.16%
ユーロ・サステナブル PREMIER - a c c	0.08%
ユーロ・サステナブル Q - a c c	0.10%
ユーロ・サステナブル U - X - a c c	0.02%
英ポンド・サステナブル F - a c c	0.12%
英ポンド・サステナブル K - 1 - a c c	0.26%
英ポンド・サステナブル P - a c c	0.52%
英ポンド・サステナブル Q - a c c	0.26%
米ドル・サステナブル F - a c c	0.12%
米ドル・サステナブル - B - a c c	0.05%
米ドル・サステナブル INSTITUTIONAL - a c c	0.20%
米ドル・サステナブル - X - a c c	0.02%
米ドル・サステナブル K - 1 - a c c	0.26%
米ドル・サステナブル P - a c c	0.51%
米ドル・サステナブル P R E F E R R E D - a c c	0.16%
米ドル・サステナブル (カナダ・ドル・ヘッジ) P - a c c	0.56%
米ドル・サステナブル Q - a c c	0.26%
米ドル・サステナブル (カナダ・ドル・ヘッジ) Q - a c c	0.31%
米ドル・サステナブル U - X - a c c	0.02%

本報告期間中に、適用される報酬は変動する場合があります(注記2を参照ください。 )。

稼働期間が12か月未満のクラス受益証券のT E Rは、年率換算されています。

取引費用、利息費用、貸付証券費用および通貨ヘッジに関して発生したその他の費用は、T E Rに含まれません。

#### 注7 準拠法、業務地および公式言語

ルクセンブルグ地方裁判所が、受益者、管理会社および保管受託銀行の間に生じるすべての紛争の裁判管轄地であり、ルクセンブルグ法が適用されます。ただし、その他の国の投資家からの請求に関しては、管理会社および/または保管受託銀行は、ファンドの受益証券が売買された国における裁判管轄に服し、またファンドを服させることを選択できます。

本財務書類については、英語版が公式の文書です。しかし、受益証券の購入および売却が可能なその他の国の投資家に対して受益証券が売却される場合、管理会社および保管受託銀行は、自らのおよびファンドの義務として当該国の言語への承認された翻訳（即ち、管理会社および保管受託銀行により承認されたもの）を認めることができます。

#### （2）投資有価証券明細表等

「（1）資産及び負債の状況」の「2023年4月30日現在投資有価証券およびその他の純資産明細表」を参照のこと。

[次へ](#)

#### 4 管理会社の概況

##### (1) 資本金の額

株式資本の1,300万ユーロ（19億5,052万円）は、1株2,000ユーロ（300,080円）の株式6,500株によって表象されます。2023年5月末日現在、全ての株式は全額払込済みです。

（注）ユーロの円貨換算は、2023年5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＝150.04円）によります。

##### (2) 事業の内容及び営業の状況

管理会社の主な目的は、複数の要素から構成され得るルクセンブルグまたはルクセンブルグ外の法律に準拠する、投資信託に関する2010年法の意味の範囲内における投資信託（UCI）またはオルタナティブ投資信託運用者に関する2013年7月12日法の意味の範囲内におけるオルタナティブ投資信託（AIF）を設立、販売、管理、運営しおよびこれに対する助言を行い、当該UCIまたはAIFの証券を表象または記録する証券または確認書を発行することです。

管理会社は、投資信託に関する2010年法第15条に規定する制限の範囲内において、直接または間接的に、当該目的に関連する取引を行うことができます。

管理会社は、ファンドおよび受益者に代わり、組入証券の購入、売却および申込みならびにファンド資産に直接または間接に付随するすべての権利の行使を含む管理・運用業務を行います。

管理会社は、ファンド資産の運用を投資運用会社であるUBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー（チューリッヒ）に委託しており、またファンド資産の保管業務および支払事務代行をUBSヨーロッパSEルクセンブルグ支店に、所在地事務・管理事務代行および登録・名義書換事務代行をノーザン・トラスト・グローバル・サービスSEに委託しています。

管理会社は、2023年5月末日現在、以下の投資信託／投資法人の管理・運用を行っています。

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	404	479,702,090.62オーストラリア・ドル
			1,867,479,434.69カナダ・ドル
			15,154,793,483.70スイス・フラン
			4,388,558,439.29中国元
			483,955,359.27デンマーク・クローネ
			51,586,084,384.31ユーロ
			2,233,969,443.96英ポンド
			274,717,848.66香港ドル
			618,129,235,892.92日本円
			30,411,701.23シンガポール・ドル
115,807,478,280.37米ドル			

##### (3) その他

本書提出前6箇月以内において、訴訟事件その他管理会社に重要な影響を及ぼした事実、または重要な影響を及ぼすことが予想される事実はありません。

[次へ](#)

## (2) その他の訂正

## 第二部 ファンド情報

## 第1 ファンドの状況

## 3 投資リスク

## (3) リスクに関する参考情報

リスクに関する参考情報は、以下の内容に更新されます。

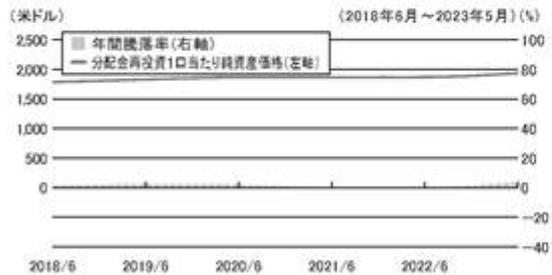
下記グラフは、ファンドの投資リスクをご理解いただくための情報の一つとしてご利用ください。

#### ファンドの分配金再投資1口当たり純資産価格・年間騰落率の推移

2018年6月～2023年5月の5年間に於けるサブ・ファンドのクラスF-acc受益証券の分配金再投資1口当たり純資産価格(各月末時点)と、年間騰落率(各月末時点)の推移を示したものです。

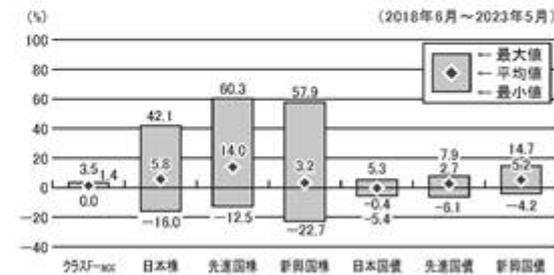
(注)年間騰落率(右軸)は、割合が大変小さいためにグラフでは明確に表示できない場合があります。

#### UBS(Lux)マネー・マーケット・ファンドー米ドル・サステナブル



#### ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較

2018年6月～2023年5月の5年間に於ける年間騰落率(各月末時点)の平均と振れ幅を、サブ・ファンドの受益証券と他の代表的な資産クラスとの間で比較したものです。このグラフは、サブ・ファンドの受益証券と代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。



出所: Bloomberg L.P.および指数提供会社のデータを基に森田松本法律事務所が作成

#### (ご注意)

- 分配金再投資1口当たり純資産価格は、税引前の分配金を分配時にサブ・ファンドの受益証券へ再投資したとみなして算出したものです。なお、クラスF-accでは分配金の支払いが行われていません。
- サブ・ファンドの受益証券の年間騰落率(各月末時点)は、各月末とその1年前における分配金再投資1口当たり純資産価格を対比して、その騰落率を算出したものです。
- 代表的な資産クラスの年間騰落率(各月末時点)は、各月末とその1年前における下記の指数の値を対比して、その騰落率を算出したものです。
- サブ・ファンドの受益証券と他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較は、上記の5年間の各月末時点における年間騰落率を用いて、それらの平均最大・最小をグラフにして比較したものです。
- サブ・ファンドの受益証券の分配金再投資1口当たり純資産価格および年間騰落率は、実際の1口当たり純資産価格およびそれに基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
- サブ・ファンドの受益証券は、代表的な資産クラスの全てに投資するものではありません。
- 代表的な資産クラスを表す指数

- 日本株→TOPIX(配当込み)
- 先進国株→FTSE先進国株価指数(除く日本、円ベース)
- 新興国株→S&P新興国総合指数
- 日本国債→ブルームバーグE1年超日本国債指数
- 先進国債→FTSE世界国債指数(除く日本、円ベース)
- 新興国債→FTSE新興国市場国債指数(円ベース)

(注)S&P新興国総合指数は、Bloomberg L.P.で円換算しています。

TOPIX(東証株価指数)の指数値及びTOPIXに係る商標又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利ノウハウ及びTOPIXに係る商標又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

FTSE先進国株価指数(除く日本、円ベース)、FTSE世界国債指数(除く日本、円ベース)およびFTSE新興国市場国債指数(円ベース)に関するすべての権利は、London Stock Exchange Group plcまたはそのいずれかのグループ企業に帰属します。各指数は、FTSE International Limited、FTSE Fixed Income LLCまたはそれらの関連会社等によって計算されています。London Stock Exchange Group plcおよびそのグループ企業は、指数の使用、依存または誤謬から生じるいかなる負債について、何人に対しても一切の責任を負いません。