

【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】 2024年12月25日

【発行者名】 UBSアセット・マネジメント（ヨーロッパ）エス・エイ
（UBS Asset Management（Europe）S.A.）

【代表者の役職氏名】 メンバー・オブ・ザ・エグゼクティブ・ボード
アンドレア・パパゾーニ（Andrea Papazzoni）
メンバー・オブ・ザ・エグゼクティブ・ボード
オリヴァー・アンペール（Olivier Humbert）

【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外国法共同事業

【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外国法共同事業

【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
15億7,140万オーストラリア・ドル（約1,681億円）
クラスP - a c c 受益証券
36億577万オーストラリア・ドル（約3,858億円）
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
9億1,592万ユーロ（約1,578億円）
クラスP - a c c 受益証券
14億9,200万ユーロ（約2,571億円）
UBS（Lux）ボンド・ファンド - アジア・フレキシブル（米ドル）
（UBS（Lux）Bond Fund-Asia Flexible（USD））
クラスP - a c c 受益証券
7億575万アメリカ合衆国ドル（約1,137億円）

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)

12億9,336万アメリカ合衆国ドル(約2,083億円)

クラスP - m d i s t 受益証券(米ドル・ヘッジ)

6億7,048万アメリカ合衆国ドル(約1,080億円)

クラスP - a c c 受益証券

18億8,480万ユーロ(約3,248億円)

クラスP - m d i s t 受益証券

9億3,832万ユーロ(約1,617億円)

(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、2024年6月28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=107.00円、1ユーロ=172.33円、1米ドル=161.07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、2024年8月30日付をもって提出した有価証券届出書(2024年10月1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、また、「第2 管理及び運営」の「5 受益者の権利等、(3) 本邦における代理人」の記載を訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

なお、本訂正届出書の記載事項のうち外貨数字の円換算については、直近の為替レートを用いていますので、訂正前の換算レートとは異なります。

2【訂正の内容】

原届出書の訂正内容は下記のとおりです。

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

[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13,738,000ユーロ（約24億円）は、1株2,000ユーロ（344,660円）の株式6,869株によって表章される。2024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13,742,000ユーロ（約23億円）は、1株2,000ユーロ（333,460円）の株式6,871株によって表章される。2024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、2024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＝166.73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）

（2024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	319,591,423.20	82.39
	国際機関	14,914,417.00	3.84
	米国	14,174,270.00	3.65
	カナダ	8,330,798.00	2.15
	韓国	6,215,978.00	1.60
	イギリス	3,720,646.00	0.96
	シンガポール	3,622,104.00	0.93
	スウェーデン	3,255,978.00	0.84
	スイス	2,669,128.00	0.69
	ニュージーランド	1,303,991.00	0.34
	ノルウェー	939,980.00	0.24
	小計	378,738,713.20	97.64
投資有価証券合計		378,738,713.20	97.64
現金・その他の資産（負債控除後）		9,160,152.07	2.36
合計 (純資産総額)		387,898,865.27 (約39,120百万円)	100.00

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

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

（注3）オーストラリア・ドル（以下「豪ドル」という。）、ユーロ、アメリカ合衆国ドル（以下「米ドル」という。）の円貨換算は、2024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＝100.85円、1ユーロ＝166.73円、1米ドル＝153.64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）

（2024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	イタリア	11,956,921.00	11.33
	ニュージーランド	9,155,829.05	8.68
	米国	8,921,245.60	8.46
	フランス	8,310,490.97	7.88
	スペイン	7,140,962.60	6.77
	オランダ	6,373,209.88	6.04
	ドイツ	5,713,837.35	5.42
	イギリス	5,043,162.33	4.78
	ルクセンブルグ	4,469,197.09	4.24
	国際機関	4,430,637.91	4.20
	ベルギー	3,400,944.82	3.22
	オーストリア	2,350,469.50	2.23
	スロベニア	2,206,460.95	2.09
	日本	2,160,195.24	2.05
	スイス	1,723,308.08	1.63
	ポルトガル	1,659,349.95	1.57
	オーストラリア	1,330,994.14	1.26
	ギリシャ	1,092,586.00	1.04
	スロバキア	1,070,298.80	1.01
	ポーランド	919,894.15	0.87
	スウェーデン	806,214.10	0.76
	カザフスタン	772,750.00	0.73
	アイルランド	642,436.56	0.61
	ノルウェー	637,169.79	0.60
	ルーマニア	632,526.23	0.60
	チリ	592,593.75	0.56
	ブラジル	562,974.01	0.53
	フィリピン	470,156.25	0.45
	インド	455,858.33	0.43
	サウジアラビア	372,222.17	0.35
	メキシコ	361,349.30	0.34
	インドネシア	347,000.00	0.33
	エジプト	344,750.00	0.33
	ペルー	323,625.00	0.31
	デンマーク	323,113.56	0.31
	中国	311,303.40	0.30
	ラトビア	281,250.00	0.27
	ジャージー	256,454.55	0.24

	トルコ	246,413.85	0.23
	ケイマン諸島	240,219.21	0.23
	ウズベキスタン	184,589.88	0.17
	バミューダ	161,443.50	0.15
	コロンビア	151,245.79	0.14
	フィンランド	93,670.00	0.09
	ロシア連邦	0.26	0.00
	小計	99,001,324.90	93.85
モーゲージ担保証券 / 資産担保証券 / その他割引債	米国	2,185,777.66	2.07
株式	イギリス	203,794.50	0.19
	米国	132,695.07	0.13
	小計	336,489.57	0.32
投資有価証券合計		101,523,592.13	96.24
現金・その他の資産（負債控除後）		3,969,818.28	3.76
合計 （純資産総額）		105,493,410.41 (約17,589百万円)	100.00

（アジア・フレキシブル（米ドル））

（2024年10月末日現在）

資産の種類	国・地域名	時価合計 (米ドル)	投資比率 (%)
債券	韓国	37,326,444.14	12.92
	香港	29,357,239.24	10.16
	英領ヴァージン諸島	28,686,269.97	9.93
	シンガポール	21,431,217.55	7.42
	インドネシア	20,582,285.07	7.13
	インド	16,602,825.31	5.75
	ケイマン諸島	16,241,341.16	5.62
	フィリピン	15,142,257.77	5.24
	イギリス	10,999,869.14	3.81
	中国	10,725,714.30	3.71
	タイ	10,679,814.80	3.70
	米国	7,725,855.73	2.67
	マレーシア	7,436,464.13	2.57
	日本	6,651,589.38	2.30
	オーストラリア	5,418,014.66	1.88
	スリランカ	3,214,971.50	1.11
	モーリシャス	2,684,710.29	0.93
	パキスタン	2,142,234.38	0.74
	オランダ	1,221,933.85	0.42
	モンゴル	917,191.00	0.32
	マカオ	644,975.18	0.22
	チリ	394,160.00	0.14
	ジャージー	378,500.00	0.13
	ニュージーランド	280,056.00	0.10
	ベトナム	199,460.00	0.07
	小計	257,085,394.55	89.00
投資信託	ルクセンブルグ	16,098,691.00	5.57
	香港	12,317,779.60	4.26
	小計	28,416,470.60	9.84
投資有価証券合計		285,501,865.15	98.84
現金・その他の資産（負債控除後）		3,356,395.48	1.16
合計 （純資産総額）		288,858,260.63 (約44,380百万円)	100.00

（ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ））

（2024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	イギリス	282,539,922.94	13.24
	ルクセンブルグ	263,503,409.12	12.35
	イタリア	245,759,993.19	11.52
	フランス	229,172,795.21	10.74
	オランダ	200,567,511.51	9.40
	ドイツ	174,625,491.10	8.18
	スペイン	125,820,907.00	5.90
	スウェーデン	59,293,829.88	2.78
	ジャージー	57,428,983.16	2.69
	アイルランド	49,404,772.00	2.32
	ポルトガル	44,527,715.75	2.09
	ギリシャ	43,101,250.72	2.02
	米国	37,512,545.42	1.76
	オーストリア	29,957,963.20	1.40
	日本	26,769,462.61	1.25
	ベルギー	19,671,246.00	0.92
	イスラエル	14,749,784.14	0.69
	チェコ共和国	10,105,081.50	0.47
	エストニア	8,385,300.00	0.39
	パナマ	8,092,460.50	0.38
	ラトビア	7,357,500.00	0.34
	ノルウェー	6,988,050.00	0.33
	多国籍	5,534,109.00	0.26
	スロベニア	4,792,500.00	0.22
	キプロス	3,595,668.75	0.17
	小計	1,959,258,252.70	91.81
投資信託	ルクセンブルグ	20,975,841.18	0.98
	アイルランド	108,500.00	0.01
	小計	21,084,341.18	0.99
株式	イギリス	10,523,461.24	0.49
投資有価証券合計		1,990,866,055.12	93.29
現金・その他の資産（負債控除後）		143,179,078.45	6.71
合計 （純資産総額）		2,134,045,133.57 (約355,809百万円)	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。

2024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）

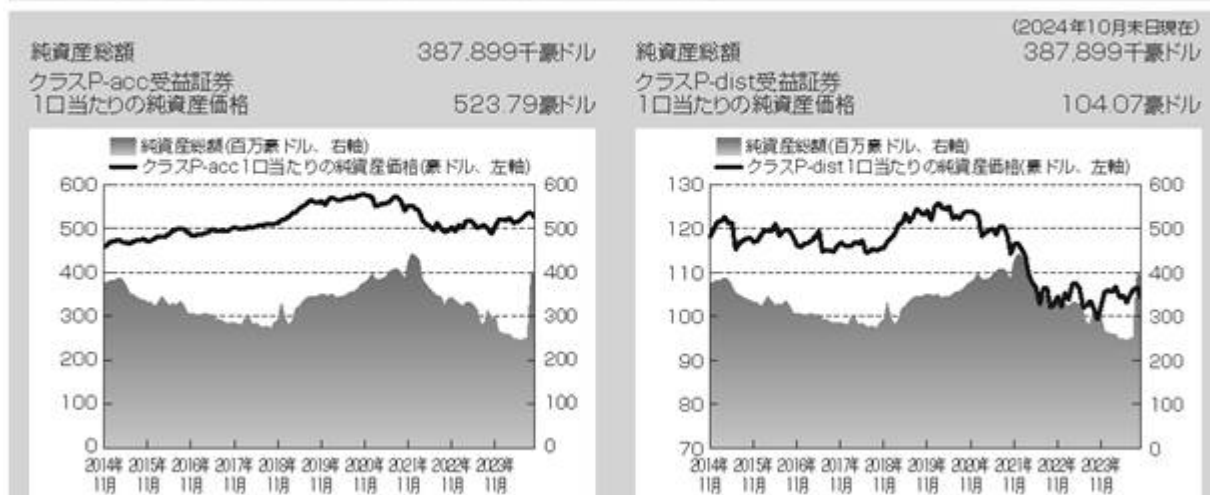
	純資産総額		１口当たり純資産価格		
	千豪ドル	百万円	受益証券の クラス	豪ドル	円
2023年11月末日	300,244	30,280	P - d i s t P - a c c	102.58 504.40	10,345 50,869
12月末日	264,290	26,654	P - d i s t P - a c c	105.70 519.74	10,660 52,416
2024年 1 月末日	262,284	26,451	P - d i s t P - a c c	105.91 520.77	10,681 52,520
2 月末日	258,275	26,047	P - d i s t P - a c c	105.53 518.90	10,643 52,331
3 月末日	259,236	26,144	P - d i s t P - a c c	106.78 525.06	10,769 52,952
4 月末日	247,769	24,988	P - d i s t P - a c c	104.38 513.22	10,527 51,758
5 月末日	248,123	25,023	P - d i s t P - a c c	104.76 515.11	10,565 51,949
6 月末日	245,212	24,730	P - d i s t P - a c c	103.15 519.16	10,403 52,357
7 月末日	247,855	24,996	P - d i s t P - a c c	104.93 528.08	10,582 53,257
8 月末日	251,518	25,366	P - d i s t P - a c c	106.27 534.86	10,717 53,941
9 月末日	398,799	40,219	P - d i s t P - a c c	106.47 535.85	10,737 54,040
10月末日	387,899	39,120	P - d i s t P - a c c	104.07 523.79	10,495 52,824

（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



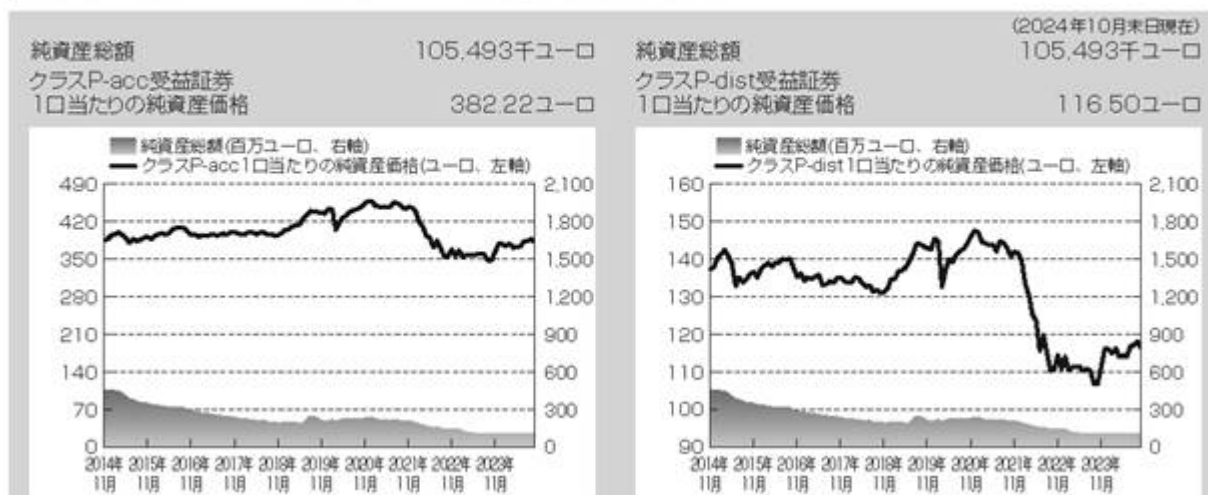
サブ・ファンドの運用実績は、あくまで過去の実績であり将来の運用成果を約束するものではない。

（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
2023年11月末日	108,693	18,122	P - d i s t P - a c c	111.55 363.39	18,599 60,588
12月末日	112,797	18,807	P - d i s t P - a c c	116.25 378.72	19,382 63,144
2024年 1 月末日	111,759	18,634	P - d i s t P - a c c	116.04 378.04	19,347 63,031
2 月末日	110,429	18,412	P - d i s t P - a c c	114.89 374.30	19,156 62,407
3 月末日	110,755	18,466	P - d i s t P - a c c	116.25 378.71	19,382 63,142
4 月末日	107,711	17,959	P - d i s t P - a c c	113.93 371.15	18,996 61,882
5 月末日	107,352	17,899	P - d i s t P - a c c	114.49 373.00	19,089 62,190
6 月末日	106,514	17,759	P - d i s t P - a c c	113.96 373.88	19,001 62,337
7 月末日	108,333	18,062	P - d i s t P - a c c	116.86 383.40	19,484 63,924
8 月末日	107,969	18,002	P - d i s t P - a c c	117.13 384.28	19,529 64,071
9 月末日	107,754	17,966	P - d i s t P - a c c	118.19 387.77	19,706 64,653
10月末日	105,493	17,589	P - d i s t P - a c c	116.50 382.22	19,424 63,728

< 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



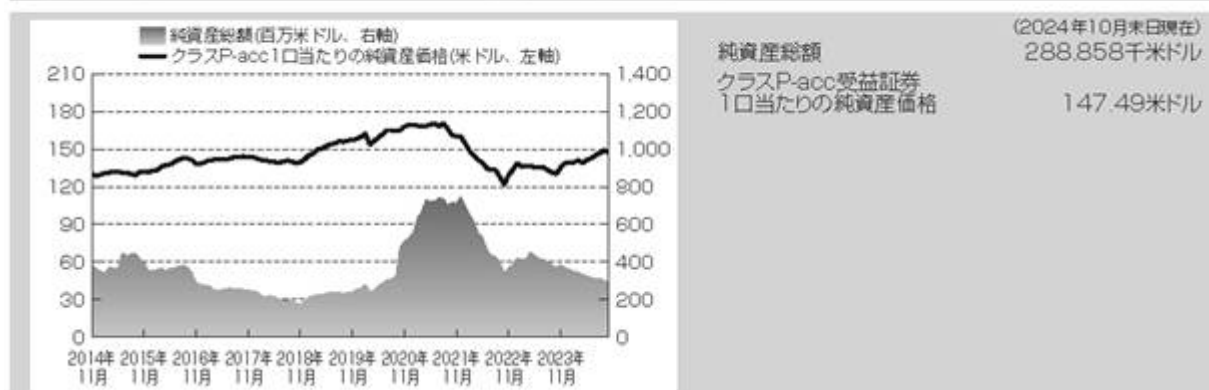
サブ・ファンドの運用実績は、あくまで過去の実績であり将来の運用成果を約束するものではない。

（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
2023年11月末日	383,866	58,977	P - a c c	135.24	20,778
12月末日	367,794	56,508	P - a c c	138.64	21,301
2024年1月末日	360,376	55,368	P - a c c	139.37	21,413
2月末日	348,711	53,576	P - a c c	139.46	21,427
3月末日	344,858	52,984	P - a c c	141.03	21,668
4月末日	334,078	51,328	P - a c c	139.02	21,359
5月末日	323,478	49,699	P - a c c	141.15	21,686
6月末日	317,269	48,745	P - a c c	142.53	21,898
7月末日	308,790	47,442	P - a c c	145.19	22,307
8月末日	312,614	48,030	P - a c c	146.76	22,548
9月末日	302,654	46,500	P - a c c	148.98	22,889
10月末日	288,858	44,380	P - a c c	147.49	22,660

< 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））

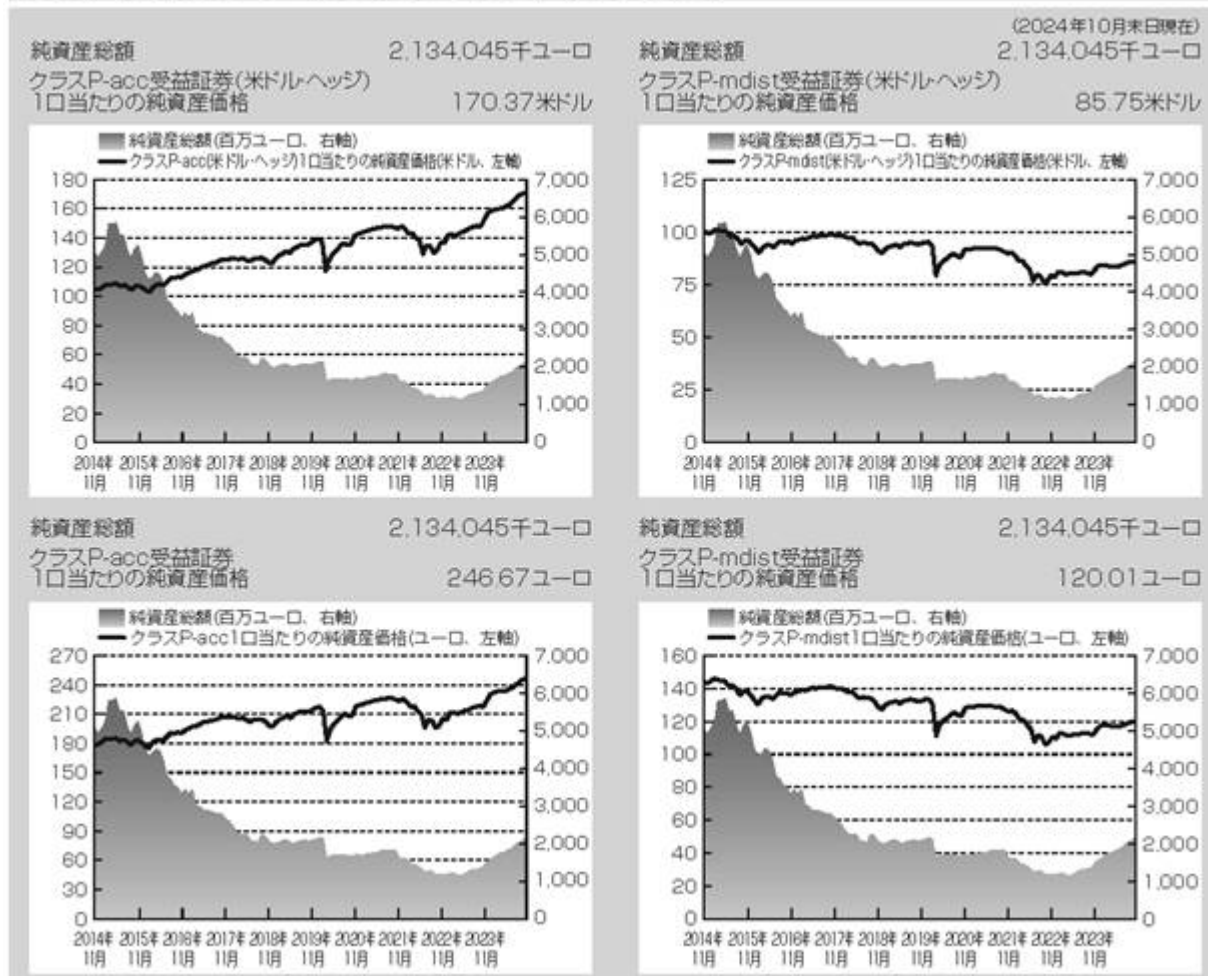
	純資産総額		1口当たり純資産価格		
	千ユーロ	百万円	受益証券の クラス		円
2023年11月末日	1,498,015	249,764	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	152.38米ドル	23,412
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	81.81米ドル	12,569
			P - a c c	223.75ユーロ	37,306
			P - m d i s t	114.48ユーロ	19,087
12月末日	1,566,717	261,219	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	157.02米ドル	24,125
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	83.82米ドル	12,878
			P - a c c	230.18ユーロ	38,378
			P - m d i s t	117.24ユーロ	19,547
2024年 1 月末日	1,628,576	271,532	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	158.61米ドル	24,369
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	84.17米ドル	12,932
			P - a c c	232.27ユーロ	38,726
			P - m d i s t	117.76ユーロ	19,634
2 月末日	1,690,568	281,868	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	159.47米ドル	24,501
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	84.13米ドル	12,926
			P - a c c	233.27ユーロ	38,893
			P - m d i s t	117.73ユーロ	19,629
3 月末日	1,748,876	291,590	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	159.84米ドル	24,558
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	83.83米ドル	12,880
			P - a c c	233.55ユーロ	38,940
			P - m d i s t	117.33ユーロ	19,562
4 月末日	1,765,321	294,332	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	159.96米ドル	24,576
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	83.41米ドル	12,815
			P - a c c	233.43ユーロ	38,920
			P - m d i s t	116.73ユーロ	19,462
5 月末日	1,821,916	303,768	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	161.67米ドル	24,839
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	83.81米ドル	12,877
			P - a c c	235.60ユーロ	39,282
			P - m d i s t	117.29ユーロ	19,556

	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	1,863,047	310,626	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	162.67米ドル	24,993
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	83.83米ドル	12,880
			P - a c c	236.83ユーロ	39,487
			P - m d i s t	117.36ユーロ	19,567
7月末日	1,963,117	327,310	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	165.11米ドル	25,368
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	84.59米ドル	12,996
			P - a c c	240.03ユーロ	40,020
			P - m d i s t	118.40ユーロ	19,741
8月末日	2,012,226	335,498	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	167.35米ドル	25,712
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	85.23米ドル	13,095
			P - a c c	242.82ユーロ	40,485
			P - m d i s t	119.23ユーロ	19,879
9月末日	2,078,969	346,627	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	169.62米ドル	26,060
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	85.88米ドル	13,195
			P - a c c	245.78ユーロ	40,979
			P - m d i s t	120.13ユーロ	20,029
10月末日	2,134,045	355,809	P - a c c (米ドル・ヘッジ)	170.37米ドル	26,176
			P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	85.75米ドル	13,175
			P - a c c	246.67ユーロ	41,127
			P - m d i s t	120.01ユーロ	20,009

（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 >

純資産総額および1口当たりの純資産価格の推移



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

分配の推移

分配の推移については、以下の内容が原届出書に追加されます。

（オーストラリア・ドル）（クラスP - d i s t 受益証券）

期間	1口当たりの分配金額（豪ドル）
第35会計年度	2.4172（約244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35会計年度	0.8075（約135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）
2023年10月	0.4693 （約72円）
11月	0.4813 （約74円）
12月	0.4931 （約76円）
2024年1月	0.4952 （約76円）
2月	0.4950 （約76円）
3月	0.4932 （約76円）
4月	0.4907 （約75円）
5月	0.4945 （約76円）
6月	0.4946 （約76円）
7月	0.4991 （約77円）
8月	0.5029 （約77円）
9月	0.5067 （約78円）
直近1年累計	5.9156 （約909円）
設定来累計	67.8326 （約10,422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）
2023年10月	0.5118 （約85円）
11月	0.5247 （約87円）
12月	0.5374 （約90円）
2024年1月	0.5397 （約90円）
2月	0.5396 （約90円）
3月	0.5378 （約90円）
4月	0.5350 （約89円）
5月	0.5395 （約90円）
6月	0.5399 （約90円）
7月	0.5446 （約91円）
8月	0.5485 （約91円）
9月	0.5526 （約92円）
直近1年累計	6.4511 （約1,076円）
設定来累計	113.4899 （約18,922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。

2024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）	7.24	7.28
（ユーロ・フレキシブル）	9.79	9.80
（アジア・フレキシブル（米ドル））	-	13.38

（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
15.36	14.93	13.54	13.26

（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。

2024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2024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	21,474.6070 (0)	65,576.5190 (520)	453,036.9250 (1,213)
P - a c c	3,580.4560 (0)	29,366.8650 (0)	175,802.5700 (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	9,314.5960 (0)	25,708.2510 (0)	254,387.3920 (854)
P - a c c	4,178.5200 (0)	22,991.6220 (0)	188,716.4520 (913.3610)

（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	3,104.4110 (0)	22,053.9210 (0)	179,924.5450 (12,128.6130)

（ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ））

	販売口数	買戻し口数	発行済口数
P - a c c (米ドル・ヘッジ)	257,640.8030 (0)	239,409.3500 (0)	197,861.6920 (20,963.2970)
P - m d i s t (米ドル・ヘッジ)	565,971.1040 (1,466.3840)	517,771.5720 (0)	1,938,906.3280 (33,881.6960)
P - a c c	532,752.0480 (0)	197,291.3760 (0)	1,064,062.2800 (26,827.9880)
P - m d i s t	209,851.4580 (0)	145,765.0690 (500)	747,017.6630 (5,736.4340)

第2【管理及び運営】

5 受益者の権利等

（3）本邦における代理人

<訂正前>

森・濱田松本法律事務所

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

上記代理人は、管理会社から日本国内において、

管理会社またはファンドに対する、ルクセンブルグおよび日本における法律上の問題ならびに日本証券業協会の規則上の問題について一切の通信、請求、訴状、訴訟関係書類を受領する権限、日本におけるファンド証券の販売、買戻しの取引に関する一切の紛争、見解の相違に関する一切の裁判上、裁判外の行為を行う権限を委任されている。なお日本国財務省関東財務局長に対するファンド証券の募集、継続開示等に関する代理人ならびに金融庁長官に対する届出代理人は、

弁護士 三浦 健

弁護士 大西 信治

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

である。

<訂正後>

森・濱田松本法律事務所外国法共同事業

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

上記代理人は、管理会社から日本国内において、

管理会社またはファンドに対する、ルクセンブルグおよび日本における法律上の問題ならびに日本証券業協会の規則上の問題について一切の通信、請求、訴状、訴訟関係書類を受領する権限、日本におけるファンド証券の販売、買戻しの取引に関する一切の紛争、見解の相違に関する一切の裁判上、裁判外の行為を行う権限を委任されている。なお日本国財務省関東財務局長に対するファンド証券の募集、継続開示等に関する代理人ならびに金融庁長官に対する届出代理人は、

弁護士 三浦 健

弁護士 大西 信治

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外国法共同事業

である。

[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法令に準拠して作成された原文の財務書類を翻訳したものである。これは「特定有価証券の内容等の開示に関する内閣府令」に基づき、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第328条第5項ただし書の規定の適用によるものである（ただし、円換算部分を除く。）。
- 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 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） |
- 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2024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＝100.85円、1ユーロ＝166.73円、1米ドル＝153.64円）を使用して換算された円換算額が併記されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

（１）資産及び負債の状況

UBS（Lux）ボンド・ファンド

純資産計算書

2024年9月30日現在

	UBS（Lux）ボンド・ファンド	
	結 合	
	ユーロ	千 円
資 産		
投資有価証券取得原価	3,272,316,613.14	545,593,349
投資有価証券未実現評価（損）益	(8,558,505.20)	(1,426,960)
投資有価証券合計（注１）	3,263,758,107.94	544,166,389
現金預金、要求払い預金および貯蓄預金	167,095,981.88 *	27,859,913
その他の流動資産（委託証拠金）	5,894,715.45	982,826
定期預金および信託預金	2,285,564.20	381,072
有価証券売却未収金（注１）	19,009,360.57	3,169,431
発行受益証券未収金	5,573,640.76	929,293
未収有価証券利息	44,221,100.13	7,372,984
流動資産に係る未収利息	2,233.11	372
その他の資産	14,590.72	2,433
その他の未収金	150,728.01	25,131
金融先物に係る未実現利益（注１）	525,283.44	87,581
為替予約契約に係る未実現利益（注１）	1,771,454.90	295,355
スワップに係る未実現利益（注１）	3,729,841.05	621,876
資産合計	3,514,032,602.16	585,894,656
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）	(1,897.95)	(316)
金融先物に係る未実現損失（注１）	(236,418.62)	(39,418)
為替予約契約に係る未実現損失（注１）	(1,859,034.60)	(309,957)
スワップに係る未実現損失（注１）	(173,518.64)	(28,931)
当座借越	(8,006,415.64)	(1,334,910)
当座借越に係る未払利息	(111,216.99)	(18,543)
有価証券購入未払金（注１）	(50,421,853.14)	(8,406,836)
買戻受益証券未払金	(4,603,587.07)	(767,556)
その他の未払金	(84,400.46)	(14,072)
報酬引当金（注２）	(2,084,480.39)	(347,545)
年次税引当金（注３）	(284,043.49)	(47,359)
その他の手数料および報酬に係る引当金（注２）	(81,254.10)	(13,547)
引当金合計	(2,449,777.98)	(408,451)
負債合計	(67,948,121.09)	(11,328,990)
期末現在純資産額	3,446,084,481.07	574,565,666

* 2024年9月30日現在、461,718.82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446,123.19ユーロの現金が取引相手方であるユービーエス・エイ・ジー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

2024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	400,642,974.95	40,404,844
投資有価証券未実現評価（損）益	(9,343,586.85)	(942,301)
投資有価証券合計（注1）	391,299,388.10	39,462,543
現金預金、要求払い預金および貯蓄預金	118,790.03	11,980
その他の流動資産（委託証拠金）	1,123,515.41	113,307
定期預金および信託預金	3,676,835.12	370,809
発行受益証券未収金	288,268.82	29,072
未収有価証券利息	3,296,820.30	332,484
資産合計	399,803,617.78	40,320,195
負 債		
金融先物に係る未実現損失（注1）	(277,558.46)	(27,992)
当座借越に係る未払利息	(939.47)	(95)
買戻受益証券未払金	(477,438.26)	(48,150)
報酬引当金（注2）	(178,801.83)	(18,032)
年次税引当金（注3）	(45,701.20)	(4,609)
その他の手数料および報酬に係る引当金（注2）	(24,094.26)	(2,430)
引当金合計	(248,597.29)	(25,071)
負債合計	(1,004,533.48)	(101,307)
期末現在純資産額	398,799,084.30	40,218,888

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

2024年 9月30日現在

U B S（Lux）ボンド・ファンド

- ユーロ・フレキシブル

ユーロ 千 円

資 産		
投資有価証券取得原価	117,007,457.44	19,508,653
投資有価証券未実現評価（損）益	(14,260,037.12)	(2,377,576)
投資有価証券合計（注１）	102,747,420.32	17,131,077
現金預金、要求払い預金および貯蓄預金	4,809,502.35 *	801,888
その他の流動資産（委託証拠金）	688,317.65	114,763
有価証券売却未収金（注１）	1,409,916.62	235,075
発行受益証券未収金	61.29	10
未収有価証券利息	1,091,584.21	182,000
流動資産に係る未収利息	35.90	6
その他の資産	14,590.72	2,433
金融先物に係る未実現利益（注１）	173,335.85	28,900
スワップに係る未実現利益（注１）	1,543,296.65	257,314
資産合計	112,478,061.56	18,753,467
負 債		
為替予約契約に係る未実現損失（注１）	(126,279.83)	(21,055)
当座借越	(2,834,427.48)	(472,584)
当座借越に係る未払利息	(84.77)	(14)
有価証券購入未払金（注１）	(1,447,964.61)	(241,419)
買戻受益証券未払金	(125,018.34)	(20,844)
その他の未払金	(84,400.45)	(14,072)
報酬引当金（注２）	(78,785.50)	(13,136)
年次税引当金（注３）	(26,779.12)	(4,465)
引当金合計	(105,564.62)	(17,601)
負債合計	(4,723,740.10)	(787,589)
期末現在純資産額	107,754,321.46	17,965,878

* 2024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

2024年9月30日現在

	UBS（Lux）ボンド・ファンド - アジア・フレキシブル（米ドル）	
	米ドル	千円
資 産		
投資有価証券取得原価	300,112,188.30	46,109,237
投資有価証券未実現評価（損）益	(6,736,953.84)	(1,035,066)
投資有価証券合計（注１）	293,375,234.46	45,074,171
現金預金、要求払い預金および貯蓄預金	5,318,417.43	817,122
その他の流動資産（委託証拠金）	227,603.37	34,969
有価証券売却未収金（注１）	1,693,676.29	260,216
発行受益証券未収金	475,196.50	73,009
未収有価証券利息	2,848,886.06	437,703
金融先物に係る未実現利益（注１）	61,570.41	9,460
為替予約契約に係る未実現利益（注１）	1,977,032.24	303,751
資産合計	305,977,616.76	47,010,401
負 債		
有価証券購入未払金（注１）	(663,618.75)	(101,958)
買戻受益証券未払金	(2,470,647.43)	(379,590)
報酬引当金（注２）	(165,000.65)	(25,351)
年次税引当金（注３）	(14,933.93)	(2,294)
その他の手数料および報酬に係る引当金（注２）	(9,182.29)	(1,411)
引当金合計	(189,116.87)	(29,056)
負債合計	(3,323,383.05)	(510,605)
期末現在純資産額	302,654,233.71	46,499,796

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

2024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	1,856,817,190.82	309,587,130
投資有価証券未実現評価(損)益	85,969,240.44	14,333,651
投資有価証券合計(注1)	1,942,786,431.26	323,920,782
現金預金、要求払い預金および貯蓄預金	128,250,707.40	21,383,240
その他の流動資産(委託証拠金)	1,548,779.61	258,228
有価証券売却未収金(注1)	16,081,880.85	2,681,332
発行受益証券未収金	4,344,976.18	724,438
未収有価証券利息	33,458,052.92	5,578,461
流動資産に係る未収利息	1,590.73	265
金融先物に係る未実現利益(注1)	296,779.44	49,482
スワップに係る未実現利益(注1)	1,102,692.99	183,852
資産合計	2,127,871,891.38	354,780,080
負 債		
為替予約契約に係る未実現損失(注1)	(1,176,257.37)	(196,117)
当座借越	(2.92)	(0)
当座借越に係る未払利息	(108,150.78)	(18,032)
有価証券購入未払金(注1)	(44,458,360.15)	(7,412,542)
買戻受益証券未払金	(1,600,172.41)	(266,797)
報酬引当金(注2)	(1,365,726.43)	(227,708)
年次税引当金(注3)	(158,923.95)	(26,497)
その他の手数料および報酬に係る引当金(注2)	(35,493.29)	(5,918)
引当金合計	(1,560,143.67)	(260,123)
負債合計	(48,903,087.30)	(8,153,612)
期末現在純資産額	2,078,968,804.08	346,626,469

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2024年4月1日 至2024年9月30日

	UBS（Lux）ボンド・ファンド	
	結 合	
	ユーロ	千 円
収 益		
流動資産に係る利息	2,277,428.00	379,716
有価証券に係る利息	70,969,933.49	11,832,817
配当金	231,649.12	38,623
スワップに係る受取利息（注1）	5,008,501.46	835,067
貸付有価証券に係る純収益（注10）	642,044.37	107,048
その他の収益	1,515,808.19	252,731
収益合計	80,645,364.63	13,446,002
費 用		
スワップに係る支払利息（注1）	(5,025,288.18)	(837,866)
報酬（注2）	(12,544,336.25)	(2,091,517)
年次税（注3）	(530,465.01)	(88,444)
その他の手数料および報酬（注2）	(456,153.78)	(76,055)
現金および当座借越に係る利息	(473,698.76)	(78,980)
費用合計	(19,029,941.98)	(3,172,862)
投資に係る純（損）益	61,615,422.65	10,273,139
実現（損）益（注1）		
オプション無し時価評価有価証券に係る		
実現（損）益	8,565,506.82	1,428,127
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	(29,123.57)	(4,856)
金融先物に係る実現（損）益	1,734,012.68	289,112
為替予約契約に係る実現（損）益	(2,035,384.46)	(339,360)
スワップに係る実現（損）益	(638,659.47)	(106,484)
外国為替に係る実現（損）益	(2,718,843.76)	(453,313)
実現（損）益合計	4,877,508.24	813,227
当期実現純（損）益	66,492,930.89	11,086,366
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	75,648,744.17	12,612,915
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	96,542.72	16,097
T B A モーゲージ・バック証券に係る		
未実現評価（損）益	10,915.56	1,820
金融先物に係る未実現評価（損）益	(292,517.14)	(48,771)
為替予約契約に係る未実現評価（損）益	1,193,049.93	198,917
スワップに係る未実現評価（損）益	(674,896.60)	(112,526)
未実現評価（損）益の変動合計	75,981,838.64	12,668,452
運用の結果による純資産の純増（減）	142,474,769.53	23,754,818

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2024年4月1日 至2024年9月30日

UBS（Lux）ボンド・ファンド - オーストラリア・ドル		
	オーストラリア・ドル	千 円
収 益		
流動資産に係る利息	86,366.95	8,710
有価証券に係る利息	4,717,416.82	475,751
その他の収益	114,611.50	11,559
収益合計	4,918,395.27	496,020
費 用		
報酬（注2）	(810,550.65)	(81,744)
年次税（注3）	(73,190.03)	(7,381)
その他の手数料および報酬（注2）	(63,048.36)	(6,358)
現金および当座借越に係る利息	(318.72)	(32)
費用合計	(947,107.76)	(95,516)
投資に係る純（損）益	3,971,287.51	400,504
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	(1,826,597.80)	(184,212)
金融先物に係る実現（損）益	(67,947.90)	(6,853)
外国為替に係る実現（損）益	(1,465.65)	(148)
実現（損）益合計	(1,896,011.35)	(191,213)
当期実現純（損）益	2,075,276.16	209,292
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	3,742,623.98	377,444
金融先物に係る未実現評価（損）益	(271,942.52)	(27,425)
未実現評価（損）益の変動合計	3,470,681.46	350,018
運用の結果による純資産の純増（減）	5,545,957.62	559,310

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2024年4月1日 至2024年9月30日

UBS（Lux）ボンド・ファンド
- ユーロ・フレキシブル
ユーロ 千 円

収 益		
流動資産に係る利息	105,145.61	17,531
有価証券に係る利息	1,676,110.94	279,458
配当金	4,900.98	817
スワップに係る受取利息（注1）	1,281,244.20	213,622
貸付有価証券に係る純収益（注10）	16,898.02	2,817
収益合計	3,084,299.75	514,245
費 用		
スワップに係る支払利息（注1）	(1,596,480.61)	(266,181)
報酬（注2）	(487,962.54)	(81,358)
年次税（注3）	(27,235.44)	(4,541)
その他の手数料および報酬（注2）	(16,522.21)	(2,755)
現金および当座借越に係る利息	(110,228.46)	(18,378)
費用合計	(2,238,429.26)	(373,213)
投資に係る純（損）益	845,870.49	141,032
実現（損）益（注1）		
オプション無し時価評価有価証券に係る		
実現（損）益	(264,368.57)	(44,078)
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	12,291.92	2,049
金融先物に係る実現（損）益	144,673.09	24,121
為替予約契約に係る実現（損）益	745,065.82	124,225
スワップに係る実現（損）益	(76,148.26)	(12,696)
外国為替に係る実現（損）益	(831,216.15)	(138,589)
実現（損）益合計	(269,702.15)	(44,967)
当期実現純（損）益	576,168.34	96,065
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	2,263,326.11	377,364
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	(9,353.75)	(1,560)
金融先物に係る未実現評価（損）益	(71,640.90)	(11,945)
為替予約契約に係る未実現評価（損）益	(201,482.79)	(33,593)
スワップに係る未実現評価（損）益	(33,447.91)	(5,577)
未実現評価（損）益の変動合計	1,947,400.76	324,690
運用の結果による純資産の純増（減）	2,523,569.10	420,755

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2024年4月1日 至2024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）	
	米ドル	千 円
収 益		
流動資産に係る利息	146,924.02	22,573
有価証券に係る利息	6,258,410.22	961,542
貸付有価証券に係る純収益（注10）	106,063.28	16,296
その他の収益	204,230.95	31,378
収益合計	6,715,628.47	1,031,789
費 用		
報酬（注2）	(1,004,150.29)	(154,278)
年次税（注3）	(30,570.74)	(4,697)
その他の手数料および報酬（注2）	(48,970.32)	(7,524)
現金および当座借越に係る利息	(146.05)	(22)
費用合計	(1,083,837.40)	(166,521)
投資に係る純（損）益	5,631,791.07	865,268
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	(4,781,909.08)	(734,693)
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	35,037.02	5,383
金融先物に係る実現（損）益	(127,105.60)	(19,529)
為替予約契約に係る実現（損）益	5,416,105.81	832,130
外国為替に係る実現（損）益	(1,167,739.69)	(179,412)
実現（損）益合計	(625,611.54)	(96,119)
当期実現純（損）益	5,006,179.53	769,149
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	17,389,885.01	2,671,782
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	38,122.68	5,857
金融先物に係る未実現評価（損）益	10,187.56	1,565
為替予約契約に係る未実現評価（損）益	4,047,235.82	621,817
未実現評価（損）益の変動合計	21,485,431.07	3,301,022
運用の結果による純資産の純増（減）	26,491,610.60	4,070,171

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2024年4月1日 至2024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

収 益		
流動資産に係る利息	1,485,924.08	247,748
有価証券に係る利息	53,212,105.69	8,872,054
配当金	217,813.38	36,316
スワップに係る受取利息（注1）	369,861.12	61,667
貸付有価証券に係る純収益（注10）	501,524.29	83,619
その他の収益	790,190.62	131,748
収益合計	56,577,419.18	9,433,153
費 用		
報酬（注2）	(8,261,699.66)	(1,377,473)
年次税（注3）	(314,732.36)	(52,475)
その他の手数料および報酬（注2）	(239,176.13)	(39,878)
現金および当座借越に係る利息	(137,057.83)	(22,852)
費用合計	(8,952,665.98)	(1,492,678)
投資に係る純（損）益	47,624,753.20	7,940,475
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	13,162,380.63	2,194,564
金融先物に係る実現（損）益	(55,348.79)	(9,228)
為替予約契約に係る実現（損）益	(11,130,744.46)	(1,855,829)
スワップに係る実現（損）益	694.44	116
外国為替に係る実現（損）益	2,293,207.47	382,346
実現（損）益合計	4,270,189.29	711,969
当期実現純（損）益	51,894,942.49	8,652,444
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	48,229,053.27	8,041,230
金融先物に係る未実現評価（損）益	296,779.44	49,482
為替予約契約に係る未実現評価（損）益	(1,558,745.16)	(259,890)
スワップに係る未実現評価（損）益	(247,498.23)	(41,265)
未実現評価（損）益の変動合計	46,719,589.32	7,789,557
運用の結果による純資産の純増（減）	98,614,531.81	16,442,001

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2024年4月1日 至2024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	3,141,343,392.00 *	523,756,184
受益証券発行	701,203,942.95	116,911,733
受益証券買戻し	(508,733,808.24)	(84,821,188)
受益証券発行（買戻し）純額合計	192,470,134.71	32,090,546
支払分配金	(30,203,815.17)	(5,035,882)
純投資（損）益	61,615,422.65	10,273,139
実現（損）益合計	4,877,508.24	813,227
未実現評価（損）益の変動合計	75,981,838.64	12,668,452
運用の結果による純資産の純増（減）	142,474,769.53	23,754,818
期末現在純資産額	3,446,084,481.07	574,565,666

* 2024年9月30日の為替レートを使用して計算された。2024年3月31日の為替レートを使用して計算された当期の期首現在の結合純資産は、3,130,443,842.13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2024年4月1日 至2024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	259,236,128.84	26,143,964
受益証券発行	166,120,368.13	16,753,239
受益証券買戻し	(29,386,649.30)	(2,963,644)
受益証券発行（買戻し）純額合計	136,733,718.83	13,789,596
支払分配金	(2,716,720.99)	(273,981)
純投資（損）益	3,971,287.51	400,504
実現（損）益合計	(1,896,011.35)	(191,213)
未実現評価（損）益の変動合計	3,470,681.46	350,018
運用の結果による純資産の純増（減）	5,545,957.62	559,310
期末現在純資産額	398,799,084.30	40,218,888

発行済受益証券数の変動
自2024年4月1日 至2024年9月30日

クラス	P-acc	P-dist
期首現在発行済受益証券数	188,463.5010	480,485.3200
発行受益証券数	1,399.9500	6,307.3820
買戻受益証券数	(13,166.1260)	(30,375.6460)
期末現在発行済受益証券数	176,697.3250	456,417.0560

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-dist	2024年6月3日	2024年6月6日	オーストラリア・ドル	2.4172

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2024年4月1日 至2024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	110,754,654.40	18,466,124
受益証券発行	1,087,769.83	181,364
受益証券買戻し	(6,393,078.32)	(1,065,918)
受益証券発行（買戻し）純額合計	(5,305,308.49)	(884,554)
支払分配金	(218,593.55)	(36,446)
純投資（損）益	845,870.49	141,032
実現（損）益合計	(269,702.15)	(44,967)
未実現評価（損）益の変動合計	1,947,400.76	324,690
運用の結果による純資産の純増（減）	2,523,569.10	420,755
期末現在純資産額	107,754,321.46	17,965,878

発行済受益証券数の変動
自2024年4月1日 至2024年9月30日

クラス	P-acc	P-dist
期首現在発行済受益証券数	200,399.1020	263,631.9540
発行受益証券数	1,650.5390	4,016.7050
買戻受益証券数	(11,575.3580)	(12,036.7340)
期末現在発行済受益証券数	190,474.2830	255,611.9250

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-dist	2024年6月3日	2024年6月6日	ユーロ	0.8075

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2024年4月1日 至2024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）	
	米ドル	千 円
期首現在純資産額	344,857,628.51	52,983,926
受益証券発行	22,065,696.82	3,390,174
受益証券買戻し	(84,882,726.79)	(13,041,382)
受益証券発行（買戻し）純額合計	(62,817,029.97)	(9,651,208)
支払分配金	(5,877,975.43)	(903,092)
純投資（損）益	5,631,791.07	865,268
実現（損）益合計	(625,611.54)	(96,119)
未実現評価（損）益の変動合計	21,485,431.07	3,301,022
運用の結果による純資産の純増（減）	26,491,610.60	4,070,171
期末現在純資産額	302,654,233.71	46,499,796

発行済受益証券数の変動
自2024年4月1日 至2024年9月30日

クラス	P-acc
期首現在発行済受益証券数	185,265.0370
発行受益証券数	2,628.8950
買戻受益証券数	(7,196.5810)
期末現在発行済受益証券数	180,697.3510

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。

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2024年4月1日 至2024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	1,748,876,315.30	291,590,148
受益証券発行	537,762,891.32	89,661,207
受益証券買戻し	(286,123,225.79)	(47,705,325)
受益証券発行（買戻し）純額合計	251,639,665.53	41,955,881
支払分配金	(20,161,708.56)	(3,361,562)
純投資（損）益	47,624,753.20	7,940,475
実現（損）益合計	4,270,189.29	711,969
未実現評価（損）益の変動合計	46,719,589.32	7,789,557
運用の結果による純資産の純増（減）	98,614,531.81	16,442,001
期末現在純資産額	2,078,968,804.08	346,626,469

発行済受益証券数の変動
自2024年4月1日 至2024年9月30日

クラス	P-acc	P-acc （米ドル・ヘッジ）	P-mdist	P-mdist （米ドル・ヘッジ）
期首現在発行済受益証券数	902,696.1960	261,556.0740	715,637.0310	1,834,380.7470
発行受益証券数	246,449.1730	143,941.9160	106,545.7760	393,213.7120
買戻受益証券数	(127,175.7650)	(204,175.8570)	(77,040.9050)	(319,556.5760)
期末現在発行済受益証券数	1,021,969.6040	201,322.1330	745,141.9020	1,908,037.8830

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-mdist	2024年4月15日	2024年4月18日	ユーロ	0.5378
P-mdist	2024年5月16日	2024年5月21日	ユーロ	0.5350
P-mdist	2024年6月17日	2024年6月20日	ユーロ	0.5395
P-mdist	2024年7月15日	2024年7月18日	ユーロ	0.5399
P-mdist	2024年8月16日	2024年8月21日	ユーロ	0.5446
P-mdist	2024年9月19日	2024年9月24日	ユーロ	0.5485
P-mdist（米ドル・ヘッジ）	2024年4月15日	2024年4月18日	米ドル	0.4932
P-mdist（米ドル・ヘッジ）	2024年5月16日	2024年5月21日	米ドル	0.4907
P-mdist（米ドル・ヘッジ）	2024年6月17日	2024年6月20日	米ドル	0.4945
P-mdist（米ドル・ヘッジ）	2024年7月15日	2024年7月18日	米ドル	0.4946
P-mdist（米ドル・ヘッジ）	2024年8月16日	2024年8月21日	米ドル	0.4991
P-mdist（米ドル・ヘッジ）	2024年9月19日	2024年9月24日	米ドル	0.5029

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られる場合。

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、（ ）見積み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み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。

会計期間末時点で純資産額へのスウィング・プライシング調整があった場合は、サブ・ファンドの最も重要な数字の純資産額の情報から見るができる。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、UBS評価方針に従い選別される。

異常事態のため上記規定に基づく評価が実行不可能または不正確になった場合、管理会社は、純資産の適切な評価を実行するため誠実に他の一般に認められ検証可能な評価基準を適用する権限を付与される。

異常事態においては、追加評価は一日を通じて行うことができる。これらの新評価は、受益証券の爾後の発行および買戻しについて適用されるものとする。

c) 為替予約契約の評価

未決済の為替予約契約に係る未実現（損）益は、評価日の実勢先物為替レートに基づいて評価される。

d) 金融先物契約の評価

金融先物契約は、評価日に適用される入手可能な直近の公表価格に基づいて評価される。実現（損）益および未実現（損）益の変動は運用計算書に計上される。実現（損）益は、（最初に取得された契約が、最初に販売されるものとみなされる）先入れ先出し法に従って計算される。

e) 有価証券売却に係る実現純（損）益

有価証券売却に係る実現純（損）益は、売却有価証券の平均原価に基づいて計算されている。

f) 外貨換算

個々のサブ・ファンドの基準通貨以外の通貨建ての銀行口座、その他の純資産および投資有価証券の評価額は、評価日のスポット・レート終値の仲値で換算されている。個々のサブ・ファンドの通貨以外の通貨建ての収益および費用は支払日のスポット・レート終値の仲値で換算されている。外国為替に係る（損）益は運用計算書に含まれている。

個々のサブ・ファンドの基準通貨以外の通貨建ての有価証券の取得原価は、取得日のスポット・レート終値の仲値で換算されている。

g) 投資有価証券取引の計上

投資有価証券取引は、取引日の翌銀行営業日に計上される。

h) スワップ

ファンドは、当該種類の取引を専門とする一流金融機関との間で取交わされる、金利スワップションおよびクレジット・デフォルト・スワップに係る金利スワップ契約ならびに金利先渡契約を締結することができる。

未実現（損）益の変動は、運用計算書において「スワップに係る未実現評価（損）益」として反映されている。

手仕舞い時または満期時に発生するスワップに係る利益または損失は、運用計算書において「スワップに係る実現（損）益」として記録される。

i) 結合財務書類

結合財務書類はユーロで表示されている。投資会社の2024年9月30日現在の結合純資産計算書、結合運用計算書および結合純資産変動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2024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	=	1.608721	オーストラリア・ドル
1 ユーロ	=	0.941444	スイス・フラン
1 ユーロ	=	1.116050	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。

注２．報酬

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

UBS（Lux）ボンド・ファンド - アジア・フレキシブル（米ドル）

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

UBS（Lux）ボンド・ファンド - オーストラリア・ドル

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

¹ 上限：0.900% / 実効：0.810%。

UBS（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル

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

UBS（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）

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

上述の上限定率報酬には、以下が含まれる。

1. ファンドの運用、管理、ポートフォリオ管理および販売に関して（該当する場合）、また保管受託銀行のすべての職務（ファンド資産の保管および監督、決済取引の取扱いならびに販売目論見書の「保管受託銀行および主たる支払代理人」の項に記載されるその他一切の職務等）に関して、ファンドの純資産価額に基づく上限定率報酬は、以下の規定に従い、ファンドの資産から支払われる。当該報酬は、純資産価額の計算毎に比例按分ベースでファンド資産に対し請求され、毎月支払われる（上限管理報酬）。名称に「ヘッジ」が付くクラス受益証券の上限定率報酬は、通貨リスクをヘッジするための手数料を含むことがある。類似のクラス受益証券が発売されるまでは、関連する上限管理報酬は請求されない。上限管理報酬の概要は、販売目論見書の「サブ・ファンドの投資対象および投資方針」に記載されている。

当該報酬は、運用計算書において「報酬」として表示される。

2. 上限管理報酬は、以下の報酬およびファンドの資産から差引かれる追加の費用を含まない。

- a) 資産の売買のための一切のその他のファンドの資産管理費用（買呼値および売呼値のスプレッド、市場に応じた取次費用、手数料、報酬等）。かかる費用は、通常、各資産の売買時点で計算される。本書の記載にかかわらず、受益証券の発行および買戻しの決済に関する資産の売買を通じて発生する当該追加費用は、販売目論見書の「純資産価額、発行、買戻しおよび転換価格」と称する項に従い、スイング・プライシングの原理の適用によりカバーされる。
- b) ファンドの設立、変更、清算および合併に関する監督官庁に対する費用ならびに監督官庁およびサブ・ファンドが上場している証券取引所に対して支払われる一切の手数料。
- c) ファンドの設立、変更、清算および合併に関する年次監査および承認に関する監査報酬ならびにファンドの管理事務に関して提供される業務のために監査法人に支払われるか、または法律により許可される一切のその他の報酬。
- d) ファンドの設立、販売国における登録、変更、清算および合併に関する法律顧問、税務顧問および公証人に対する報酬ならびに法律で明白に禁止されない限り、ファンドおよびその投資者の利益の全般的な保護に関する手数料。
- e) ファンドの純資産価額の公表に関するコストおよび投資者に対する通知に関する一切のコスト（翻訳コストを含む。）。
- f) ファンドの法的文書に関するコスト（目論見書、K I D、年次報告書および半期報告書ならびに居住国および販売が行われる国で法的に要求されるその他の一切の文書）。
- g) 外国の監督官庁へのファンドの登録に関するコスト。該当する場合、前述の外国の監督官庁に支払われる手数料ならびに翻訳コストおよび外国の代表者または支払代理人に対する報酬を含む。
- h) ファンドによる議決権または債権者の権利の行使により発生する費用（外部顧問に対する報酬を含む。）。
- i) ファンドの名義で登録される知的財産またはファンドの利用者の権利に関するコストおよび手数料。
- j) 管理会社、ポートフォリオ・マネージャーまたは保管受託銀行が投資者の利益の保護のために講じる特別措置に関して生じる一切の費用。
- k) 管理会社が投資者の利益について集団訴訟に関与する場合、管理会社は、第三者に関して生じる費用（例えば、法律コストおよび保管受託銀行に関するコスト）をファンドの資産に対して請求することができる。さらに、管理会社は、すべての管理事務コストを請求することができるが、当該管理事務費用が証明可能でありかつ開示され、ファンドの総費用率（T E R）の公示において考慮される。

当該手数料および報酬は、運用計算書において「その他の手数料および報酬」として表示される。

3. 管理会社は、ファンドの販売のためにサービス手数料を支払うことができる。

クラスⅠ - B 受益証券については、ファンドの管理事務費用（管理会社、管理事務代行会社および保管受託銀行の費用により構成される。）をカバーする手数料が課せられる。資産運用および販売に係る当該費用については、投資家およびUBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジーまたは授権された代理人の一人と別個に締結された契約に基づき、ファンド外で直接課せられる。

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

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

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

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

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

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

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

注3．年次税

ファンドはルクセンブルグ法に従う。ファンドは、ルクセンブルグ大公国の現行法規に基づき、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の対象にならない。ただし、各サブ・ファンドの純資産総額から、年率0.05%（クラスF、I-A1、I-A2、I-A3、I-A4、I-B、I-X、およびU-Xクラスについては年率0.01%に軽減される）のルクセンブルグの年次税を課せられ、各四半期末に支払わなければならない。

かかる税金は、各四半期末に各サブ・ファンドの純資産総額について計算される。管轄当局が投資者の課税上の地位を変更する場合、クラスF、I-A1、I-A2、I-A3、I-A4、I-B、I-XおよびU-Xのすべての投資証券について0.05%は0.05%の税率を課されることがある。

提示される課税金額は、算定時の最新の入手可能なデータに基づく。

受益者は、現行税法上、ルクセンブルグの所得税、贈与税、相続税またはその他の税金を支払う義務を負わない。ただし、当該受益者がルクセンブルグに住所地もしくは居住地を有するか、または恒久的施設を維持しているか、あるいはルクセンブルグに以前居住し、かつファンドの受益証券の10%超を保有する場合は、この限りではない。

上記は税効果に関する概要にすぎず、網羅的であると主張するものではない。受益証券の購入者は、居住地に関連する、またその国籍を有する人に関する受益証券の購入、保有および売却を規定する法律および規則に関する情報を求める責任を負う。

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

2024年4月1日から2024年9月30日までの期間中、いかなる「ソフト・コミッション・アレンジメント」もUBS（Lux）ボンド・ファンドに代わって締結されておらず、「ソフト・コミッション・アレンジメント」の金額もなかった。

注 6．金融先物およびスワップに係る契約債務

2024年9月30日現在のサブ・ファンドおよび各通貨当たりの金融先物およびスワップに係る契約債務は、以下のとおり要約される。

a) 金融先物

UBS (Lux) ボンド・ファンド	債券に係る金融先物（買い）	債券に係る金融先物（売り）
- アジア・フレキシブル（米ドル）	12,306,875.06 米ドル	18,036,218.75 米ドル
- オーストラリア・ドル	48,938,779.37 オーストラリア・ドル	- オーストラリア・ドル
- ユーロ・フレキシブル	57,503,480.39 ユーロ	68,850,985.39 ユーロ
- ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）	190,809,454.40 ユーロ	- ユーロ

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	- ユーロ	4,286,217.16 ユーロ

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

b) スワップ

UBS (Lux) ボンド・ファンド	クレジット・デフォルト・スワップ（買い）	クレジット・デフォルト・スワップ（売り）
- ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）	- ユーロ	15,582,554.10 ユーロ

UBS (Lux) ボンド・ファンド	金利に係るスワップおよび フォワード・スワップ（買い）	金利に係るスワップおよび フォワード・スワップ（売り）
- ユーロ・フレキシブル	76,040,333.02 ユーロ	119,235,405.74 ユーロ

注 7．総経費率（TER）

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

過去12か月におけるTER

UBS (Lux) ボンド・ファンド	総経費率（TER）
- アジア・フレキシブル（米ドル） クラス P - a c c 受益証券	1.38%
- オーストラリア・ドル クラス P - a c c 受益証券	0.90%
- オーストラリア・ドル クラス P - d i s t 受益証券	0.90%
- 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	1.34%
- ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ） クラス P - a c c 受益証券（米ドル・ヘッジ）	1.39%
- 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	1.34%
- 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）	1.39%

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．後発事象

期末後に財務書類において調整または開示を必要とする事象はなかった。

注 9．準拠法、営業地域および言語

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

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

注10．貸付有価証券

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

U B S ヨーロッパ S E 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。

U B S (Lux) ボンド・ファンド	2024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*		2024年 9 月30日現在の 担保の内訳（％）		
	貸付有価証券の 時価	担保 (ユービーエス・ スイス・エイ・ジー)	株式	債券	現金
- アジア・フレキシブル(米ドル)	59,418,040.50 米ドル	61,604,267.78 米ドル	37.50	62.50	0.00
- ユーロ・フレキシブル	13,364,942.60 ユーロ	13,596,937.32 ユーロ	37.50	62.50	0.00
- ユーロ・ハイ・イールド(ユーロ)	271,757,403.91 ユーロ	290,118,184.21 ユーロ	37.50	62.50	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、2024年 9 月30日に証券貸付業者から直接入手されるため、2024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。

	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	U B S（Lux）ボンド・ ファンド - ユーロ・ハイ・ イールド（ユーロ）
貸付証券収益	176,772.13 米ドル	28,163.37 ユーロ	835,873.82 ユーロ
貸付証券コスト*			
ユービーエス・スイス・ エイ・ジー	53,031.64 米ドル	8,449.01 ユーロ	250,762.15 ユーロ
U B S ヨーロッパ S E ルクセンブルグ支店	17,677.21 米ドル	2,816.34 ユーロ	83,587.38 ユーロ
純貸付証券収益	106,063.28 米ドル	16,898.02 ユーロ	501,524.29 ユーロ

* 総収益の30%は証券貸付サービス提供者を務めるユービーエス・スイス・エイ・ジーが費用／報酬として受領し、10%は証券貸付業者を務める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）ボンド・ファンド - オーストラリア・ドル

2024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

固定利付ノート

AUD			
AUD	AUSTRALIAN CAPITAL TERRITORY-REG-S 5.25000% 23-24.10.33	2 400 000.00	2 491 176.00 0.63
AUD	NEW SOUTH WALES TREASURY CORP-REG-S 3.00000% 17-20.04.29	1 500 000.00	1 439 325.00 0.36
AUD	NEW SOUTH WALES TREASURY CORP-REG-S 3.50000% 17-20.11.37	3 500 000.00	2 989 035.00 0.75
AUD	NEW SOUTH WALES TREASURY CORP 2.00000% 20-08.03.33	12 700 000.00	10 408 158.00 2.61
AUD	NEW SOUTH WALES TREASURY CORP-REG-S 1.75000% 21-20.03.34	6 500 000.00	5 026 255.00 1.26
AUD	NEW SOUTH WALES TREASURY CORP-REG-S 4.75000% 22-20.02.35	4 900 000.00	4 873 932.00 1.22
AUD	QUEENSLAND TREASURY CORP-144A-REG-S 3.25000% 18-21.08.29	700 000.00	675 696.00 0.17
AUD	TREASURY CORP OF VICTORIA 1.50000% 20-20.11.30	8 400 000.00	7 145 208.00 1.79
Total AUD			35 048 785.00 8.79

固定利付ノート合計 35 048 785.00 8.79

変動利付ノート

AUD			
AUD	SHINHAN BANK CO LTD-REG-S 3M BBSW+195BP 22-16.11.25	2 900 000.00	2 942 891.00 0.74
Total AUD			2 942 891.00 0.74

変動利付ノート合計 2 942 891.00 0.74

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	2 500 000.00	2 365 750.00 0.59
AUD	AURIZON NETWORK PTY LTD-REG-S 2.90000% 20-02.09.30	3 000 000.00	2 600 880.00 0.65
AUD	AUSGRID FINANCE PTY LTD-REG-S 3.75000% 17-30.10.24	2 400 000.00	2 397 360.00 0.60
AUD	AUSNET SERVICES HOLDINGS PTY LTD 2.60000% 19-31.07.29	500 000.00	446 910.00 0.11
AUD	AUSTRALIAN CAPITAL TERRITORY 2.50000% 22-22.10.32	2 700 000.00	2 330 802.00 0.58
AUD	CLIFFORD CAPITAL PTE LTD-REG-S 4.75300% 23-31.08.28	3 600 000.00	3 681 180.00 0.92
AUD	EUROPEAN INVESTMENT BANK-REG-S 3.10000% 16-17.08.26	800 000.00	788 088.00 0.20
AUD	EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.75000% 21-15.07.27	1 000 000.00	917 340.00 0.23
AUD	HOUSING AUSTRALIA-REG-S 1.52000% 19-27.05.30	1 400 000.00	1 221 640.00 0.31
AUD	INCITEC PIVOT LTD-REG-S 4.30000% 19-18.03.26	1 700 000.00	1 683 221.00 0.42
AUD	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION 4.40000% 23-13.01.28	4 900 000.00	4 968 551.00 1.25
AUD	INTERNATIONAL FINANCE CORP-REG-S 3.20000% 16-22.07.26	2 500 000.00	2 466 375.00 0.62
AUD	KOMMUNALBANKEN AS 0.60000% 20-01.06.26	1 000 000.00	943 610.00 0.24
AUD	LLOYDS BANKING GROUP PLC 5.80200% 23-17.03.29	3 700 000.00	3 779 069.00 0.95
AUD	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 2.90000% 22-25.02.27	2 500 000.00	2 421 425.00 0.61
AUD	TASMANIAN PUBLIC FINANCE-REG-S 2.50000% 21-21.01.33	6 300 000.00	5 387 949.00 1.35
AUD	TREASURY CORP OF VICTORIA 2.50000% 19-22.10.29	1 600 000.00	1 483 152.00 0.37
AUD	TREASURY CORP OF VICTORIA 2.25000% 19-20.11.34	8 500 000.00	6 721 205.00 1.69
AUD	TREASURY CORP OF VICTORIA 1.25000% 20-19.11.27	3 400 000.00	3 139 900.00 0.79
AUD	TREASURY CORP OF VICTORIA 2.00000% 20-20.11.37	3 500 000.00	2 437 400.00 0.61

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 WOOLWORTHS GROUP LTD-REG-S 1.85000% 21-15.11.27	2 000 000.00	1 851 240.00	0.46
Total AUD		54 033 047.00	13.55

固定利付メディアム・ターム・ノート合計	54 033 047.00	13.55
---------------------	---------------	-------

固定利付債券

AUD			
AUD AUSTRALIA-REG-S 1.00000% 20-21.12.30	6 500 000.00	5 516 810.00	1.38
AUD AUSTRALIA-REG-S 2.25000% 16-21.05.28	6 000 000.00	5 738 520.00	1.44
AUD AUSTRALIA-REG-S 2.75000% 18-21.05.41	9 000 000.00	7 297 380.00	1.83
AUD AUSTRALIA-REG-S 2.75000% 18-21.11.29	10 700 000.00	10 259 588.00	2.57
AUD AUSTRALIA-REG-S 3.00000% 16-21.03.47	7 300 000.00	5 722 178.00	1.43
AUD AUSTRALIA-REG-S 3.25000% 15-21.06.39	1 100 000.00	981 948.00	0.25
AUD AUSTRALIA-REG-S 3.75000% 22-21.05.34	14 400 000.00	14 136 480.00	3.55
AUD AUSTRALIA-REG-S 4.25000% 24-21.06.34	6 600 000.00	6 740 382.00	1.69
AUD AUSTRALIA-REG-S 4.50000% 13-21.04.33	800 000.00	832 776.00	0.21
AUD AUSTRALIAN CAPITAL TERRITORY 1.75000% 19-23.10.31	1 300 000.00	1 092 650.00	0.27
AUD AUSTRALIAN CAPITAL TERRITORY 4.50000% 23-23.10.34	3 900 000.00	3 788 304.00	0.95
AUD NEW SOUTH WALES TREASURY CORP 2.00000% 19-20.03.31	4 000 000.00	3 485 960.00	0.87
AUD NORFINA LTD-REG-S 3.25000% 16-24.08.26	2 000 000.00	1 963 860.00	0.49
AUD NORTHERN TERRITORY CORP-REG-S 3.50000% 18-21.05.30	900 000.00	864 414.00	0.22
AUD QUEENSLAND TREASURY CORP-144A-REG-S 1.25000% 20-10.03.31	3 100 000.00	2 573 496.00	0.65
AUD QUEENSLAND TREASURY CORP-144A-REG-S 1.50000% 21-20.08.32	3 800 000.00	3 045 358.00	0.76
AUD SOUTH AUSTRALIAN GOV FIN AUTHOR-REG-S 1.75000% 21-24.05.34	3 700 000.00	2 839 713.00	0.71
AUD SOUTH AUSTRALIAN GOVERNMENT FIN-REG-S 2.00000% 21-23.05.36	3 400 000.00	2 500 054.00	0.63
AUD SOUTH AUSTRALIAN GOV FIN AUTHOR-REG-S 4.75000% 23-24.05.38	1 800 000.00	1 741 644.00	0.44
AUD TASMANIAN PUBLIC FINANCE CORP-REG-S 2.00000% 19-24.01.30	2 800 000.00	2 511 740.00	0.63
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA-REG-S 2.25000% 21-15.09.33	4 300 000.00	3 524 667.00	0.88
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 2.00000% 21-17.09.35	13 200 000.00	9 883 104.00	2.48
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 5.25000% 24-15.09.38	1 300 000.00	1 303 328.00	0.33
Total AUD		98 344 354.00	24.66

固定利付債券合計	98 344 354.00	24.66
----------	---------------	-------

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	190 369 077.00	47.74
---------------------------------------	----------------	-------

他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品

固定利付ノート

AUD			
AUD ING BANK AUSTRALIA LTD-REG-S 1.10000% 21-19.08.26	2 400 000.00	2 262 720.00	0.56
AUD TASMANIAN PUBLIC FINANCE CORP 4.75000% 24-25.01.35	3 700 000.00	3 660 003.00	0.92
Total AUD		5 922 723.00	1.48

固定利付ノート合計	5 922 723.00	1.48
-----------	--------------	------

固定利付メディアム・ターム・ノート

AUD			
AUD AIRSERVICES AUSTRALIA 5.25000% 24-15.05.34	500 000.00	507 100.00	0.13
AUD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BK GRP 4.95000% 24-05.02.29	2 500 000.00	2 553 425.00	0.64
AUD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BK GRP LTD 5.00000% 24-18.06.29	2 220 000.00	2 273 990.40	0.57
AUD AUSTRALIAN UNITY HEALTHCARE PROPERTY 6.78100% 23-08.11.29	2 600 000.00	2 741 102.00	0.69
AUD BANK OF AMERICA NA/AUSTRALIA-REG-S 5.81500% 23-30.10.28	2 900 000.00	3 040 099.00	0.76
AUD BANK OF QUEENSLAND LTD 1.40000% 21-06.05.26	7 330 000.00	6 949 646.30	1.74

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 CIP FUNDING PTY LTD 3.02600% 21-16.12.27	5 100 000.00	4 797 009.00	1.20
AUD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 2.40000% 22-14.01.27	7 600 000.00	7 293 644.00	1.83
AUD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 5.00000% 23-13.01.28	6 000 000.00	6 114 300.00	1.53
AUD COMPUTERSHARE US INC 3.14700% 21-30.11.27	1 100 000.00	1 034 891.00	0.26
AUD CPIF FINANCE PTY LTD-REG-S 2.48500% 20-28.10.30	900 000.00	757 872.00	0.19
AUD CPPIB CAPITAL INC-REG-S 4.45000% 22-01.09.27	2 200 000.00	2 223 804.00	0.56
AUD CPPIB CAPITAL INC-REG-S 4.20000% 23-02.05.28	5 200 000.00	5 217 056.00	1.31
AUD CPPIB CAPITAL INC-REG-S 5.20000% 24-04.03.34	1 000 000.00	1 037 470.00	0.26
AUD DOWNER GROUP FINANCE PTY 3.70000% 19-29.04.26	1 400 000.00	1 370 362.00	0.34
AUD DWPF FINANCE PTY-REG-S 1.90000% 21-04.08.28	1 500 000.00	1 336 800.00	0.34
AUD EDITH COWAN UNIVERSITY 3.00000% 19-11.04.29	1 300 000.00	1 214 291.00	0.30
AUD ELECTRANET PTY LTD 2.47370% 21-15.12.28	1 550 000.00	1 395 899.00	0.35
AUD ENERGY PARTNERSHIP GAS PTY LTD-REG-S 3.64200% 17-11.12.24	1 000 000.00	996 960.00	0.25
AUD GTA FINANCE CO PTY LTD 2.20000% 20-26.08.27	600 000.00	549 600.00	0.14
AUD ING BANK AUSTRALIA LTD 4.83700% 24-22.03.27	3 000 000.00	3 027 660.00	0.76
AUD ING BANK AUSTRALIA LTD-REG-S 4.55400% 24-20.08.27	3 000 000.00	3 009 510.00	0.75
AUD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 1.00000% 21-04.08.28	4 000 000.00	3 579 160.00	0.90
AUD MACQUARIE UNIVERSITY-REG-S 3.50000% 18-07.09.28	990 000.00	947 984.40	0.24
AUD MACQUARIE UNIVERSITY-REG-S 2.25000% 19-22.05.30	3 400 000.00	2 948 276.00	0.74
AUD MIRVAC GROUP FINANCE LTD-REG-S 5.15000% 24-18.03.31	1 500 000.00	1 498 860.00	0.38
AUD MONASH UNIVERSITY 4.05000% 22-06.04.29	600 000.00	582 786.00	0.15
AUD NBN CO LTD-REG-S 1.00000% 20-03.12.25	9 100 000.00	8 729 357.00	2.19
AUD NETWORK FINANCE CO PTY LTD 2.25000% 19-11.11.26	1 200 000.00	1 136 808.00	0.28
AUD NETWORK FINANCE CO PTY LTD 6.06100% 23-19.06.30	3 600 000.00	3 753 108.00	0.94
AUD NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 5.35000% 23-19.09.28	5 100 000.00	5 232 141.00	1.31
AUD NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 5.10000% 24-24.07.29	5 000 000.00	5 089 950.00	1.28
AUD NORFINA LTD 2.50000% 22-25.01.27	900 000.00	862 776.00	0.22
AUD NORFINA LTD 4.75000% 24-19.03.29	3 400 000.00	3 433 082.00	0.86
AUD PACIFIC NATIONAL FINANCE PTY LTD-REG-S 3.80000% 21-08.09.31	3 900 000.00	3 350 256.00	0.84
AUD SVENSK EXPORTKREDIT AB 4.30000% 23-30.05.28	3 300 000.00	3 307 425.00	0.83
AUD TELSTRA GROUP LTD 4.90000% 23-08.03.28	2 800 000.00	2 834 832.00	0.71
AUD TELSTRA GROUP LTD 5.25000% 24-06.09.31	1 800 000.00	1 831 950.00	0.46
AUD TRANSPower NEW ZEALAND LTD-REG-S 4.97700% 22-29.11.28	1 300 000.00	1 324 726.00	0.33
AUD UNIVERSITY OF MELBOURNE 4.67400% 22-22.08.29	2 200 000.00	2 213 970.00	0.56
AUD UNIVERSITY OF TECHNOLOGY SYDNEY-REG-S 3.75000% 17-20.07.27	1 800 000.00	1 766 340.00	0.44
AUD UNIVERSITY OF WOLLONGONG/THE 3.50000% 17-08.12.27	700 000.00	676 914.00	0.17
AUD VICTORIA POWER NETWORKS FINANCE PTY LTD 2.13200% 21-21.04.28	1 400 000.00	1 273 748.00	0.32
AUD WESTCONNEX FIN CO PTY LTD-REG-S 3.15000% 21-31.03.31	3 800 000.00	3 350 726.00	0.84
AUD WESTCONNEX FINANCE CO PTY LTD 6.15000% 23-09.10.30	2 400 000.00	2 523 264.00	0.63
AUD WESTPAC BANKING CORP 4.80000% 23-16.02.28	9 700 000.00	9 832 308.00	2.47
AUD WORLEY FINANCIAL SERVICES PTY LTD-REG-S 5.95000% 23-13.10.28	1 900 000.00	1 929 526.00	0.48
AUD WSO FINANCE PTY LTD-REG-S STEP UP 17-31.03.27	2 200 000.00	2 201 892.00	0.55
Total AUD		135 654 656.10	34.02
固定利付メディアム・ターム・ノート合計		135 654 656.10	34.02
変動利付メディアム・ターム・ノート			
AUD			
AUD AUSTRALIA & NZ BANKING GRP-REG-S 3M BBSW+92BP 22-04.11.25	6 500 000.00	6 536 660.00	1.64
AUD WESTPAC BANKING CORP 3M BBSW+95BP 22-11.11.25	3 000 000.00	3 017 880.00	0.76
Total AUD		9 554 540.00	2.40
変動利付メディアム・ターム・ノート合計		9 554 540.00	2.40

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄		数量 / 額面	評価額 オーストラリア・ドル 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
固定利付債券				
AUD				
AUD	AUSTRALIAN CAPITAL TERRITORY-REG-S 5.25000% 24-23.10.36	4 600 000.00	4 680 362.00	1.17
AUD	BENDIGO & ADELAIDE BANK LTD-REG-S 5.10000% 23-16.06.28	3 500 000.00	3 580 045.00	0.90
AUD	ING BANK AUSTRALIA LTD-REG-S 4.50000% 22-26.05.29	3 700 000.00	3 695 412.00	0.93
AUD	KOREA HOUSING FINANCE CORP-REG-S 4.47500% 23-06.04.26	3 300 000.00	3 287 856.00	0.82
AUD	NORFINA LTD 4.85000% 22-17.10.25	700 000.00	702 422.00	0.18
AUD	NORFINA LTD-REG-S 5.20000% 23-12.07.28	3 000 000.00	3 080 730.00	0.77
AUD	NORTHERN TERRITORY TREASURY CORP 2.50000% 21-21.05.32	2 900 000.00	2 496 378.00	0.63
AUD	NSW ELECTRICITY NETWORKS FIN PTY-REG-S 2.54300% 20-23.09.30	3 500 000.00	3 011 575.00	0.75
AUD	UBS AG AUSTRALIA-REG-S 1.10000% 21-26.02.26	2 800 000.00	2 673 580.00	0.67
AUD	UNITED ENERGY DISTRIBUTION PTY LTD 2.20000% 19-29.10.26	1 700 000.00	1 619 743.00	0.41
Total AUD			28 828 103.00	7.23
固定利付債券合計			28 828 103.00	7.23
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			179 960 022.10	45.13
他の譲渡性のある有価証券				
固定利付ノート				
AUD				
AUD	NEW SOUTH WALES TREASURY CORP-REG-S 4.75000% 24-20.02.37	5 700 000.00	5 563 143.00	1.39
Total AUD			5 563 143.00	1.39
固定利付ノート合計			5 563 143.00	1.39
固定利付ミディアム・ターム・ノート				
AUD				
AUD	BENDIGO & ADELAIDE BANK LTD 5.10000% 24-14.05.27	4 300 000.00	4 364 199.00	1.09
AUD	ETSA UTILITIES FINANCE PTY LTD-REG-S 5.10820% 24-03.06.27	1 800 000.00	1 823 670.00	0.46
AUD	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 4.40000% 23-12.05.28	3 600 000.00	3 607 632.00	0.91
AUD	REGISTRY FINANCE PTY LTD REG-S 5.47200% 24-19.12.31	3 100 000.00	3 167 053.00	0.79
Total AUD			12 962 554.00	3.25
固定利付ミディアム・ターム・ノート合計			12 962 554.00	3.25
固定利付債券				
AUD				
AUD	NORTHERN TERRITORY TREASURY CORP 5.25000% 24-21.03.34	2 400 000.00	2 444 592.00	0.61
Total AUD			2 444 592.00	0.61
固定利付債券合計			2 444 592.00	0.61
他の譲渡性のある有価証券合計			20 970 289.00	5.25
投資有価証券合計			391 299 388.10	98.12

注記は、財務書類と不可分のものである。

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 10YR BOND FUTURE 16.12.24	228.00	-234 374.88	-0.06
AUD	AUSTRALIA 3YR BOND FUTURE 16.12.24	209.00	-43 183.58	-0.01
債券に係る金融先物合計			-277 558.46	-0.07

公認の証券取引所に上場されている派生商品合計	-277 558.46	-0.07
------------------------	-------------	-------

派生商品合計	-277 558.46	-0.07
--------	-------------	-------

銀行預金、要求払い預金および貯蓄預金ならびにその他の流動資産	1 242 305.44	0.31
定期預金および信託預金	3 676 835.12	0.92
その他の資産および負債	2 858 114.10	0.72
純資産合計	398 799 084.30	100.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・フレキシブル

2024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			
株式			
イギリス			
EUR BARCLAYS BANK PLC 4.75%-FRN T1 PERP EUR10000	210 000.00	203 685.30	0.19
イギリス合計		203 685.30	0.19
株式合計			
		203 685.30	0.19
固定利付ノート			
BRL			
BRL BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 10.00000% 20-01.01.31	4 000.00	592 558.13	0.55
Total BRL		592 558.13	0.55
EUR			
EUR ALTICE FRANCE SA-REG-S 5.87500% 18-01.02.27	300 000.00	235 027.80	0.22
EUR ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV-REG-S 3.70000% 20-02.04.40	100 000.00	99 535.00	0.09
EUR AT&T INC 3.95000% 23-30.04.31	250 000.00	260 436.25	0.24
EUR CELANESE US HOLDINGS LLC 4.77700% 22-19.07.26	530 000.00	542 773.00	0.50
EUR CHILE, REPUBLIC OF 0.83000% 19-02.07.31	700 000.00	601 562.50	0.56
EUR CHINA, PEOPLE ' S REPUBLIC OF-REG-S 1.00000% 19-12.11.39	435 000.00	311 296.88	0.29
EUR CORP ANDINA DE FOMENTO-REG-S 0.25000% 21-04.02.26	1 010 000.00	974 116.72	0.90
EUR FISERV INC 4.50000% 23-24.05.31	100 000.00	106 171.00	0.10
EUR GIVAUDAN FINANCE EUROPE BV-REG-S 4.12500% 23-28.11.33	130 000.00	138 437.00	0.13
EUR GTC AURORA LUXEMBOURG SA-REG-S 2.25000% 21-23.06.26	245 000.00	221 323.20	0.21
EUR INDONESIA, REPUBLIC OF 1.40000% 19-30.10.31	400 000.00	348 000.00	0.32
EUR MACIF-REG-S-SUB 0.62500% 21-21.06.27	300 000.00	279 750.00	0.26
EUR PERU, REPUBLIC OF 1.25000% 21-11.03.33	400 000.00	324 750.00	0.30
EUR PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-REG-S 3.75000% 24-27.09.29	520 000.00	523 287.44	0.49
EUR PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-REG-S 4.12500% 24-27.09.32	320 000.00	324 155.84	0.30
EUR SARTORIUS FINANCE BV-REG-S 4.50000% 23-14.09.32	200 000.00	210 921.40	0.20
EUR TAPESTRY INC 5.35000% 23-27.11.25	195 000.00	198 961.43	0.18
EUR TAPESTRY INC 5.37500% 23-27.11.27	165 000.00	171 649.50	0.16
EUR TRITAX EUROBOX PLC-REG-S 0.95000% 21-02.06.26	240 000.00	230 654.40	0.21
EUR VEB FINANCE PLC-REG-S LPN 4.03200% 13-21.02.23	610 000.00	0.06	0.00
EUR VERISURE MIDHOLDING AB-REG-S 5.25000% 21-15.02.29	145 000.00	143 912.50	0.13
EUR VERIZON COMMUNICATIONS INC 0.37500% 21-22.03.29	200 000.00	178 743.20	0.17
Total EUR		6 425 465.12	5.96
GBP			
GBP GREAT PORTLAND ESTATES PLC-REG-S 5.37500% 24-25.09.31	200 000.00	238 890.94	0.22
GBP UNITED KING OF GREAT BRIT & N IRL-REG-S 3.75000% 23-22.10.53	315 000.00	328 501.01	0.31
Total GBP		567 391.95	0.53
USD			
USD CONCENTRIX CORP 6.60000% 23-02.08.28	200 000.00	186 939.63	0.17
USD CONCENTRIX CORP 6.65000% 23-02.08.26	185 000.00	170 305.12	0.16
USD CONCENTRIX CORP 6.85000% 23-02.08.33	120 000.00	111 371.89	0.10
USD PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS-REG-S 9.25000% 21-30.04.26	260 000.00	239 662.20	0.22
USD RAKUTEN GROUP INC-REG-S 9.75000% 24-15.04.29	200 000.00	195 555.76	0.18
USD ROMANIA-REG-S 6.37500% 24-30.01.34	240 000.00	223 377.09	0.21

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 SHIMAO PRPTY HLDG LTD-REG-S *DEFAULTED* 3.45000% 21-11.01.31	200 000.00	8 960.17	0.01
USD SHIMAO PRPTY HLDG LTD-REG-S *DEFAULTED* 5.20000% 21-16.01.27	200 000.00	8 960.17	0.01
USD TAPESTRY INC 7.70000% 23-27.11.30	325 000.00	313 717.63	0.29
Total USD		1 458 849.66	1.35
固定利付ノート合計		9 044 264.86	8.39
変動利付ノート			
EUR			
EUR ALSTOM SA-REG-S-SUB 5.868%/VAR 24-PRP	100 000.00	103 226.00	0.10
EUR BPCE SA-REG-S-SUB 1.500%/VAR 21-13.01.42	400 000.00	378 986.40	0.35
EUR ENI SPA-REG-S-SUB 3.375%/VAR 20-PRP	100 000.00	96 000.00	0.09
EUR MORGAN STANLEY 0.406%VAR 21-29.10.27	300 000.00	284 819.40	0.26
EUR UBS GROUP AG-REG-S 2.125%/VAR 22-13.10.26	520 000.00	514 313.28	0.48
EUR UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD-REG-S-SUB 7.250%/VAR 23-PRP	100 000.00	108 913.80	0.10
EUR VAR ENERGI ASA-REG-S-SUB 7.862%/VAR 23-15.11.83	255 000.00	279 862.50	0.26
EUR WESTPAC BANKING CORP-REG-SUB 0.766%/VAR 21-13.05.31	250 000.00	238 739.06	0.22
EUR WINTERSHALL DEA FINANCE 2 BV-REG-S-SUB 2.498%/VAR 21-PRP	300 000.00	287 940.00	0.27
EUR WINTERSHALL DEA FINANCE 2 BV-REG-S-SUB 3.000%/VAR 21-PRP	100 000.00	92 387.50	0.08
Total EUR		2 385 187.94	2.21
GBP			
GBP BARCLAYS PLC-REG-S 5.851%/VAR 24-21.03.35	200 000.00	243 150.86	0.22
GBP BARCLAYS PLC-REG-S 7.090%/VAR 23-06.11.29	200 000.00	256 957.97	0.24
Total GBP		500 108.83	0.46
USD			
USD UBS GROUP AG-REG-S-SUB COCO 9.250%/VAR 23-PRP	200 000.00	211 340.71	0.20
USD UBS GROUP AG-REG-S-SUB COCO 9.250%/VAR 23-PRP	200 000.00	198 127.51	0.19
Total USD		409 468.22	0.39
変動利付ノート合計		3 294 764.99	3.06
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	447 239.00	0.42
EUR AIR FRANCE-KLM-REG-S 4.62500% 24-23.05.29	200 000.00	203 250.00	0.19
EUR AKER BP ASA-REG-S 4.00000% 24-29.05.32	250 000.00	253 847.00	0.24
EUR AMPRION GMBH-REG-S 3.12500% 24-27.08.30	400 000.00	399 968.00	0.37
EUR ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV-REG-S 1.15000% 18-22.01.27	200 000.00	193 698.80	0.18
EUR AROUNDTOWN SA-REG-S 4.80000% 24-16.07.29	100 000.00	101 297.70	0.09
EUR ASB BANK LTD-REG-S 0.25000% 21-08.09.28	350 000.00	316 177.75	0.29
EUR ASTRAZENECA PLC-REG-S 0.37500% 21-03.06.29	185 000.00	166 851.50	0.16
EUR AUTOROUTES DU SUD DE LA FRANCE SA-REG-S 2.75000% 22-02.09.32	200 000.00	193 911.60	0.18
EUR BANK OF AMERICA CORP-REG-S 4.13400% 23-12.06.28	605 000.00	628 776.50	0.58
EUR BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT-REG-S-SUB 4.37500% 24-11.01.34	200 000.00	201 962.00	0.19
EUR CADENT FINANCE PLC-REG-S 4.25000% 23-05.07.29	240 000.00	251 724.48	0.23
EUR CAIXABANK SA-REG-S 4.25000% 23-06.09.30	300 000.00	319 537.20	0.30
EUR CEPESA FINANCE SA-REG-S 4.12500% 24-11.04.31	500 000.00	500 035.00	0.46
EUR COOPERATIEVE RABOBANK UA-REG-S 4.00000% 23-10.01.30	300 000.00	313 779.00	0.29
EUR CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S STEP UP 19-23.04.27	200 000.00	186 930.00	0.17
EUR CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S 7.00000% 24-07.05.29	200 000.00	206 172.00	0.19
EUR CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S 6.00000% 24-27.01.32	135 000.00	130 106.25	0.12

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 CTP NV-REG-S 4.75000% 24-05.02.30	195 000.00	202 049.05	0.19
EUR DANSKE BANK AS-REG-S-SUB 1.50000% 20-02.09.30	120 000.00	117 840.00	0.11
EUR DEXIA SA-REG-S 0.50000% 18-17.01.25	400 000.00	396 728.00	0.37
EUR EASYJET PLC-REG-S 3.75000% 24-20.03.31	300 000.00	302 326.20	0.28
EUR EDP FINANCE BV-REG-S 3.87500% 22-11.03.30	300 000.00	311 025.00	0.29
EUR EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 6.37500% 19-11.04.31	400 000.00	335 750.00	0.31
EUR ELECTRICITE DE FRANCE-REG-S 1.87500% 16-13.10.36	1 200 000.00	984 168.24	0.91
EUR ELECTRICITE DE FRANCE-REG-S 2.00000% 19-09.12.49	300 000.00	194 777.76	0.18
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S 4.12500% 24-17.06.31	200 000.00	208 120.80	0.19
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S 4.75000% 24-17.06.44	200 000.00	210 459.40	0.20
EUR ELENIA VERKKO OYJ-REG-S 0.37500% 20-06.02.27	100 000.00	93 618.88	0.09
EUR ELLEVIO AB-REG-S 4.12500% 24-07.03.34	245 000.00	255 094.00	0.24
EUR ENBW INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 4.30000% 23-23.05.34	265 000.00	280 900.00	0.26
EUR ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 3.87500% 24-23.01.35	200 000.00	203 798.40	0.19
EUR EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FAC-REG-S 1.80000% 17-10.07.48	1 700 000.00	1 341 089.20	1.24
EUR EUROPEAN STABILITY MECHANISM-REG-S 0.50000% 16-02.03.26	1 100 000.00	1 072 027.00	1.00
EUR FMS WERTMANAGEMENT-REG-S 0.37500% 15-29.04.30	1 800 000.00	1 619 073.00	1.50
EUR GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC-REG-S 4.30000% 23-15.02.29	320 000.00	329 745.92	0.31
EUR GRAND CITY PROPERTIES SA-REG-S 4.37500% 24-09.01.30	100 000.00	101 776.80	0.09
EUR KAZAKHSTAN, REPUBLIC OF-REG-S 2.37500% 18-09.11.28	800 000.00	778 500.00	0.72
EUR KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU-REG-S 0.37500% 15-23.04.30	2 000 000.00	1 795 544.00	1.67
EUR LOGICOR FINANCING SARL-REG-S 4.62500% 24-25.07.28	225 000.00	231 793.65	0.22
EUR LOGICOR FINANCING SARL-REG-S 4.25000% 24-18.07.29	215 000.00	218 707.89	0.20
EUR METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 4.00000% 23-05.04.28	340 000.00	353 192.00	0.33
EUR MOBICO GROUP PLC-REG-S 4.87500% 23-26.09.31	100 000.00	98 497.60	0.09
EUR NATIONAL GRID ELECTRICITY DISTRIB-REG-S 3.94900% 22-20.09.32	105 000.00	108 454.08	0.10
EUR NBN CO LTD-REG-S 4.12500% 23-15.03.29	250 000.00	261 303.97	0.24
EUR NESTLE FINANCE INTERNATIONAL LTD-REG-S 3.25000% 24-23.01.37	200 000.00	200 766.00	0.19
EUR NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.25000% 20-23.01.27	390 000.00	368 772.30	0.34
EUR P3 GROUP SARL-REG-S 0.87500% 22-26.01.26	425 000.00	411 433.15	0.38
EUR P3 GROUP SARL-REG-S 4.62500% 24-13.02.30	145 000.00	150 034.11	0.14
EUR PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 2.87500% 14-03.03.26	500 000.00	498 333.60	0.46
EUR PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 0.87500% 19-17.05.27	500 000.00	470 750.00	0.44
EUR POLAND, REPUBLIC OF-REG-S 2.00000% 19-08.03.49	560 000.00	411 236.00	0.38
EUR PROLOGIS INTERNATIONAL FUNDING II-REG-S 3.12500% 22-01.06.31	300 000.00	292 990.80	0.27
EUR RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S 1.50000% 18-26.04.38	1 500 000.00	1 252 513.50	1.16
EUR REDEXIS GAS FINANCE BV-REG-S 1.87500% 15-27.04.27	300 000.00	289 137.81	0.27
EUR REDEXIS SA-REG-S 4.37500% 24-30.05.31	200 000.00	203 284.80	0.19
EUR ROMANIA-REG-S 4.62500% 19-03.04.49	500 000.00	421 095.00	0.39
EUR SCHAEFFLER AG-REG-S 4.75000% 24-14.08.29	100 000.00	100 470.00	0.09
EUR SEVERN TRENT UTILITIES FINANCE PL-REG-S 4.00000% 24-05.03.34	180 000.00	183 505.32	0.17
EUR SOCIETE GENERALE SA-REG-S-SUB 5.62500% 23-02.06.33	100 000.00	107 700.00	0.10
EUR SWISSCOM FINANCE BV-REG-S 3.50000% 24-29.11.31	435 000.00	448 020.42	0.42
EUR TELEPERFORMANCE SE-REG-S 5.25000% 23-22.11.28	300 000.00	314 280.90	0.29
EUR UBS SWITZERLAND AG-REG-S 3.39000% 22-05.12.25	580 000.00	584 986.84	0.54
EUR VAR ENERGI ASA-REG-S 5.50000% 23-04.05.29	100 000.00	107 717.00	0.10
EUR VF CORP 4.25000% 23-07.03.29	120 000.00	117 975.60	0.11
EUR VONOVIA SE-REG-S 0.37500% 21-16.06.27	300 000.00	280 203.00	0.26
EUR WESTPAC BANKING CORP-REG-S 0.01000% 21-22.09.28	925 000.00	835 476.65	0.78
Total EUR		25 472 307.42	23.64

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
GBP			
GBP EASTERN POWER NETWORKS PLC-REG-S 5.37500% 24-02.10.39	340 000.00	407 083.89	0.38
Total GBP		407 083.89	0.38
USD			
USD FWD GROUP HOLDINGS LTD-REG-S-SUB 7.63500% 24-02.07.31	200 000.00	194 776.23	0.18
USD GREENSAIF PIPELINES BIDCO SARL-REG-S 5.85200% 24-23.02.36	295 000.00	273 246.04	0.25
USD SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 5.75000% 24-17.07.54	420 000.00	380 843.15	0.35
USD SHRIRAM FINANCE LTD-REG-S 6.62500% 24-22.04.27	290 000.00	263 924.55	0.25
Total USD		1 112 789.97	1.03
固定利付ミディアム・ターム・ノート合計		26 992 181.28	25.05
ミディアム・ターム・ノート、ゼロ・クーポン			
EUR			
EUR STEDIN HOLDING NV-REG-S 0.00000% 21-16.11.26	270 000.00	254 634.84	0.24
Total EUR		254 634.84	0.24
ミディアム・ターム・ノート、ゼロ・クーポン合計		254 634.84	0.24
変動利付ミディアム・ターム・ノート			
EUR			
EUR ABANCA CORP BANCARIA SA-REG-S-SUB 8.375%/VAR 23-23.09.33	300 000.00	339 060.00	0.31
EUR ABANCA CORP BANCARIA SA-REG-S 5.875%/VAR 23-02.04.30	300 000.00	329 037.00	0.31
EUR AXA SA-REG-S-SUB 3.250%/VAR 18-28.05.49	100 000.00	98 787.60	0.09
EUR AXA SA-REG-S-SUB 6.375%/VAR 24-PRP	160 000.00	167 246.24	0.16
EUR BANCO DE CREDITO SOCIAL CO SA-REG-S 7.500%/VAR 23-14.09.29	400 000.00	455 330.00	0.42
EUR BANCO DE CREDITO SOC CP SA-REG-S 4.125%/VAR 24-03.09.30	200 000.00	202 618.00	0.19
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S 4.000%/VAR 24-15.01.30	200 000.00	207 116.20	0.19
EUR BARCLAYS PLC-REG-S-SUB 4.973%/VAR 24-31.05.36	210 000.00	218 911.35	0.20
EUR BNP PARIBAS SA-REG-S 0.875%/3M EURIBOR+83BP 22-11.07.30	400 000.00	355 996.00	0.33
EUR BNP PARIBAS SA-REG-S-SUB 4.159%/VAR 24-28.08.34	200 000.00	201 766.00	0.19
EUR COMMONWEALTH BK OF AUSTRALIA-REG-S-SUB 1.936%/VAR 17-03.10.29	200 000.00	199 987.21	0.19
EUR DANSKE BANK A/S-REG-S-SUB 4.625%/VAR 24-14.05.34	200 000.00	207 282.00	0.19
EUR DEUTSCHE BANK AG-REG-S 1.000%/VAR 20-19.11.25	300 000.00	298 972.20	0.28
EUR ING GROEP NV-REG-S-SUB 4.250%/VAR 24-26.08.35	200 000.00	203 038.20	0.19
EUR RAIFFEISEN BANK INT AG-REG-S-SUB 5.250%/VAR 24-02.01.35	300 000.00	301 385.40	0.28
EUR TOTALENERGIES SE-REG-S-SUB 2.625%/VAR 15-PRP	750 000.00	745 312.50	0.69
Total EUR		4 531 845.90	4.21
変動利付ミディアム・ターム・ノート合計		4 531 845.90	4.21
固定利付債券			
EUR			
EUR AIR BALTIC CORP AS-REG-S 14.50000% 24-14.08.29	250 000.00	281 875.00	0.26
EUR ALSTRIA OFFICE REIT-AG-REG-S 1.50000% 20-23.06.26	200 000.00	190 503.40	0.18
EUR ALTRIA GROUP INC 2.20000% 19-15.06.27	400 000.00	392 221.20	0.36
EUR ATHORA HOLDING LTD-REG-S 6.62500% 23-16.06.28	150 000.00	161 577.00	0.15
EUR AUSTRIA, REPUBLIC OF-144A-REG-S 2.40000% 13-23.05.34	1 920 000.00	1 881 398.40	1.75
EUR BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUT-REG-S 0.25000% 21-19.07.28	300 000.00	270 028.80	0.25
EUR BECTON DICKINSON EURO FINANCE SARL 0.33400% 21-13.08.28	350 000.00	317 644.60	0.29
EUR BELGIUM, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.00000% 15-22.06.31	1 100 000.00	1 001 237.60	0.93
EUR BELGIUM, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.90000% 15-22.06.38	2 230 000.00	1 951 009.16	1.81
EUR CHUBB INA HOLDINGS INC 2.50000% 18-15.03.38	200 000.00	180 804.00	0.17
EUR EUROPEAN INVESTMENT BANK-REG-S STEP-UP 16-14.04.32	2 000 000.00	1 800 926.00	1.67
EUR EUROPEAN UNION-REG-S 3.00000% 22-04.03.53	650 000.00	612 146.60	0.57
EUR FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 4.50000% 09-25.04.41	715 000.00	827 641.10	0.77
EUR FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 3.25000% 12-25.05.45	1 150 000.00	1 131 450.50	1.05

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-144A-REG-S 1.50000% 19-25.05.50	700 000.00	469 910.35	0.44
EUR GREECE, HELLENIC REPUBLIC OF-144A-REG-S 1.87500% 19-23.07.26	1 100 000.00	1 095 490.00	1.02
EUR GROUPE VYV 1.62500% 19-02.07.29	100 000.00	92 426.00	0.09
EUR IMPERIAL BRANDS FINANCE PLC-REG-S 1.37500% 17-27.01.25	900 000.00	893 957.40	0.83
EUR IRELAND, REPUBLIC OF-REG-S 1.70000% 17-15.05.37	730 000.00	655 147.99	0.61
EUR ITALY, REPUBLIC OF-BTP 5.00000% 09-01.03.25	2 600 000.00	2 619 557.20	2.43
EUR ITALY, REPUBLIC OF-BTP 2.50000% 14-01.12.24	2 400 000.00	2 396 827.20	2.22
EUR ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 3.250% 14-01.09.46	2 210 000.00	1 997 320.65	1.85
EUR ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 2.70000% 16-01.03.47	1 300 000.00	1 069 289.00	0.99
EUR ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 2.25000% 16-01.09.36	3 370 000.00	2 962 904.00	2.75
EUR ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 2.45000% 20-01.09.50	100 000.00	75 903.50	0.07
EUR JAPAN BANK FOR INTL COOPERATION 3.12500% 23-15.02.28	300 000.00	305 653.17	0.28
EUR LONZA FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 3.87500% 23-25.05.33	200 000.00	208 615.20	0.19
EUR MPT OPERATING PARTNERSHIP LP/FIN CORP 3.32500% 17-24.03.25	200 000.00	194 560.00	0.18
EUR NETHERLANDS, KINGDOM OF THE-144A-REG-S 4.00000% 05-15.01.37	1 200 000.00	1 379 226.00	1.28
EUR PLUXEE NV-REG-S 3.75000% 24-04.09.32	200 000.00	200 788.20	0.19
EUR PORTUGAL, REPUBLIC OF-144A-REG-S 2.25000% 18-18.04.34	500 000.00	483 982.50	0.45
EUR PORTUGAL, REPUBLIC OF-144A-REG-S 1.95000% 19-15.06.29	1 200 000.00	1 187 490.00	1.10
EUR SARTORIUS FINANCE BV-REG-S 4.37500% 23-14.09.29	100 000.00	104 589.00	0.10
EUR SLOVAKIA, REPUBLIC OF-REG-S 3.75000% 23-23.02.35	350 000.00	358 716.75	0.33
EUR SLOVAKIA, REPUBLIC OF-REG-S 0.75000% 19-09.04.30	800 000.00	720 542.00	0.67
EUR SLOVENIA, REPUBLIC OF-REG-S 1.50000% 15-25.03.35	1 800 000.00	1 567 020.60	1.45
EUR SLOVENIA, REPUBLIC OF-REG-S 3.12500% 15-07.08.45	700 000.00	677 302.50	0.63
EUR SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.95000% 15-30.07.30	900 000.00	873 903.60	0.81
EUR SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 2.90000% 16-31.10.46	800 000.00	726 095.20	0.67
EUR SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 2.70000% 18-31.10.48	2 600 000.00	2 246 178.11	2.08
EUR SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.85000% 19-30.07.35	1 000 000.00	896 516.00	0.83
EUR SVENSKA HANDELSBANKEN AB-REG-S 3.25000% 24-27.08.31	410 000.00	412 615.80	0.38
EUR TAURON POLSKA ENERGIA SA-REG-S 2.37500% 17-05.07.27	200 000.00	190 896.00	0.18
EUR TSB BANK PLC-REG-S 3.31900% 24-05.03.29	100 000.00	102 911.00	0.10
EUR UBS SWITZERLAND AG-REG-S 3.30400% 24-05.03.29	205 000.00	211 033.15	0.20
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 3.12500% 20-15.02.26	335 000.00	330 479.17	0.31
EUR WINTERSHALL DEA FINANCE BV-REG-S 1.82300% 19-25.09.31	300 000.00	259 761.00	0.24
Total EUR		38 968 071.60	36.16
GBP			
GBP BERKELEY GROUP PLC/THE-REG-S 2.50000% 21-11.08.31	160 000.00	153 522.40	0.14
GBP ROTHESAY LIFE PLC-REG-S-SUB 3.37500% 19-12.07.26	315 000.00	367 357.13	0.34
Total GBP		520 879.53	0.48
JPY			
JPY JAPAN 0.80000% 18-20.03.58	245 000 000.00	1 039 363.67	0.97
Total JPY		1 039 363.67	0.97
MXN			
MXN MEXICO, UNITED MEXICAN STATES 7.75000% 11-13.11.42	100 000.00	380 544.47	0.35
Total MXN		380 544.47	0.35
NZD			
NZD NEW ZEALAND 1.50000% 19-15.05.31	800 000.00	389 919.40	0.36
NZD NEW ZEALAND 1.75000% 20-15.05.41	5 100 000.00	1 913 779.91	1.77
NZD NEW ZEALAND 2.75000% 21-15.05.51	1 800 000.00	707 047.31	0.66
NZD NEW ZEALAND-REG-S 2.75000% 16-15.04.37	13 400 000.00	6 344 141.93	5.89
Total NZD		9 354 888.55	8.68

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 COLOMBIA, REPUBLIC OF 6.12500% 09-18.01.41	200 000.00	157 363.92	0.15
USD COUNTRY GARDEN HOLD-REG-S *DEFAULTED* 2.70000% 21-12.07.26	200 000.00	12 992.25	0.01
Total USD		170 356.17	0.16
固定利付債券合計		50 434 103.99	46.80
債券、ゼロ・クーポン			
EUR			
EUR GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 20-15.02.30	290 000.00	262 137.38	0.24
Total EUR		262 137.38	0.24
債券、ゼロ・クーポン合計		262 137.38	0.24
変動利付債券			
EUR			
EUR BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S 3.250%/VAR 20-PRP	130 000.00	128 466.00	0.12
EUR BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S-SUB 3.625%/VAR 20-PRP	100 000.00	97 995.50	0.09
EUR IBERCAJA BANCO SA-REG-S 4.375%/VAR 24-30.07.28	200 000.00	206 803.80	0.19
EUR RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S-SUB 3.250%/VAR 19-PRP	200 000.00	188 610.00	0.18
EUR STONEGATE PUB CO FIN-REG-S 3M EURIBOR+662.50BP 24-31.07.29	100 000.00	102 025.00	0.09
EUR UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD-REG-S-SUB 2.875%/VAR 18-PRP	100 000.00	98 020.00	0.09
Total EUR		821 920.30	0.76
GBP			
GBP YORKSHIRE BUILDING SOCIETY-REG-S 7.375%/VAR 23-12.09.27	180 000.00	225 204.04	0.21
Total GBP		225 204.04	0.21
変動利付債券合計		1 047 124.34	0.97
固定利付米国中期国債			
USD			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 15-15.08.45	1 950 000.00	1 420 105.02	1.32
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.00000% 18-15.02.48	1 000 000.00	728 748.99	0.68
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.87500% 24-15.08.34	210 000.00	189 486.64	0.17
Total USD		2 338 340.65	2.17
固定利付米国中期国債合計		2 338 340.65	2.17
変動利付米国中期国債			
USD			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.750%INFLATION LINKED 24-15.01.34	1 200 000.00	1 112 431.28	1.03
Total USD		1 112 431.28	1.03
変動利付米国中期国債合計		1 112 431.28	1.03
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		99 515 514.81	92.35

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 (%)
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			
株式			
アメリカ			
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE	145 000.00	130 889.12	0.12
アメリカ合計		130 889.12	0.12
株式合計		130 889.12	0.12
変動利付モーゲージ・バック証券			
USD			
USD AVENTURA MALL TRUST-144A 4.112%/VAR 18-01.07.40	650 000.00	568 328.13	0.53
USD CMB COMM MORTGAGE TRUST-144A 1M LIBOR+145BP 19-15.12.37	175 000.00	156 607.01	0.14
USD CMB COMM MORTGAGE TRUST-144A 1M LIBOR+175BP 19-15.12.37	430 000.00	384 805.78	0.36
USD CORE TRUST CORE-144A 1M LIBOR+110BP 19-15.12.31	230 000.00	37 594.87	0.03
USD GS MORTGAGE SECURITIES TRUST-144A VAR 17-01.01.43	1 225 000.00	987 060.77	0.92
Total USD		2 134 396.56	1.98
変動利付モーゲージ・バック証券合計		2 134 396.56	1.98
固定利付ノート			
USD			
USD RWE FINANCE US LLC-144A 5.87500% 24-16.04.34	240 000.00	224 833.17	0.21
USD WESTERN MIDSTREAM OPERATING LP 5.45000% 24-15.11.34	175 000.00	157 134.49	0.15
Total USD		381 967.66	0.36
固定利付ノート合計		381 967.66	0.36
固定利付ミディアム・ターム・ノート			
USD			
USD PIRAMAL CAPITAL & HOUSING FINANCE-REG-S 7.80000% 24-29.01.28	200 000.00	183 011.51	0.17
Total USD		183 011.51	0.17
固定利付ミディアム・ターム・ノート合計		183 011.51	0.17
固定利付債券			
RUB			
RUB RUSSIA, FEDERATION OF 7.65000% 19-10.04.30	270 000 000.00	0.26	0.00
Total RUB		0.26	0.00
固定利付債券合計		0.26	0.00
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		2 830 265.11	2.63

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 (%)
他の譲渡性のある有価証券			
固定利付ノート			
USD			
USD WINTERSHALL DEA FINANCE BV-REG-S 4.35700% 24-03.10.32	400 000.00	401 640.40	0.37
Total USD		401 640.40	0.37
固定利付ノート合計		401 640.40	0.37
他の譲渡性のある有価証券合計		401 640.40	0.37
投資有価証券合計		102 747 420.32	95.35

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 06.12.24	11.00	32 340.00	0.03
EUR SHORT EURO BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 06.12.24	5.00	4 250.00	0.00
EUR EURO-BUND FUTURE 06.12.24	59.00	108 630.00	0.10
EUR EURO-BOBL FUTURE 06.12.24	109.00	143 880.00	0.13
EUR EURO-SCHATZ FUTURE 06.12.24	-8.00	-4 920.00	0.00
EUR EURO-BUXL FUTURE 06.12.24	-9.00	-25 380.00	-0.02
EUR EURO-OAT FUTURE 06.12.24	90.00	103 500.00	0.10
GBP LONG GILT FUTURE 27.12.24	45.00	-29 830.48	-0.03
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 19.12.24	-92.00	-27 048.52	-0.04
USD US LONG BOND FUTURE 19.12.24	-9.00	-1 512.03	0.00
USD US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.12.24	-17.00	-840.02	0.00
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.12.24	59.00	17 815.37	0.02
JPY JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 13.12.24	-20.00	-45 101.54	-0.04
CAD CAN 10YR BOND FUTURE 18.12.24	-122.00	-76 870.64	-0.07
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.12.24	39.00	-12 999.22	-0.01
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.12.24	-138.00	-71 485.50	-0.07
CAD CAN 5YR BOND FUTURE 18.12.24	104.00	60 700.61	0.06
債券に係る金融先物合計		175 128.03	0.16
金利に係る金融先物			
USD 30DAY FED FUND FUTURE 31.12.24	-12.00	-1 792.18	0.00
金利に係る金融先物合計		-1 792.18	0.00
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		173 335.85	0.16

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 PAY 1.67500% 24-30.10.29	-18 000 000.00	865 544.92	0.80
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	976 521.90	0.91
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	-139 959.12	-0.13
CNY CITI/INTEREST RATE SWAP REC CNRR007 21-02.04.26			

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄		数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注 1)	純資産 割合 (%)
USD	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 3.19431% 23-10.03.53	-1 800 000.00	63 931.29	0.06
USD	LCH/INTEREST RATE SWAP TP REC SOFR O/N 23-10.03.53			
USD	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 5.26770% 23-27.11.24	-18 000 000.00	14 650.79	0.01
USD	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 5.26770% 23-27.11.24			
CHF	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 1.09000% 24-15.02.29	-1 900 000.00	-51 554.37	-0.05
CHF	LCH/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 24-15.02.29			
CHF	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 1.10500% 24-27.02.29	-2 100 000.00	-59 504.08	-0.06
CHF	LCH/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 24-27.02.29			
CHF	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 1.09000% 24-05.03.29	-2 200 000.00	-61 061.38	-0.06
CHF	LCH/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 24-05.03.29			
CHF	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 1.04400% 24-11.03.27	-3 500 000.00	-49 718.14	-0.05
CHF	LCH/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 24-11.03.27			
CNY	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 2.00500% 24-30.05.29	-11 000 000.00	-1 969.40	0.00
CNY	LCH/INTEREST RATE SWAP REC CNRR007 24-30.05.29			
NZD	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 5.39000% 24-18.06.25	-15 000 000.00	-177 161.28	-0.15
NZD	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 3MFRA 24-18.06.25			
ZAR	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 8.13500% 24-18.06.29	-41 000 000.00	-62 494.02	-0.06
ZAR	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 3M 24-18.06.29			
JPY	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 0.55000% 25-29.09.27	-600 000 000.00	3 335.82	0.00
JPY	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 12M LIBOR 25-29.09.27			
USD	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 2.95895% 25-29.09.27	-4 500 000.00	6 136.57	0.01
USD	LCH/INTEREST RATE SWAP TP REC SOFR O/N 25-29.09.27			
CNY	JPMORGAN/INTEREST RATE SWAP REC 2.23500% 20-10.06.25	50 000 000.00	25 861.01	0.02
CNY	JPMORGAN/INTEREST RATE SWAP PAY CNRR007 20-10.06.25			
MXN	CME/INTEREST RATE SWAP REC 8.07000% 18-26.06.28	75 000 000.00	-62 667.03	-0.06
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	-92 949.41	-0.09
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	-227 166.57	-0.21
NZD	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 3MFRA 21-22.06.26			
NZD	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 4.60500% 22-29.11.27	2 500 000.00	63 258.19	0.06
NZD	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 3MFRA 22-29.11.27			
NZD	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 4.65000% 22-19.12.27	4 000 000.00	107 619.57	0.10
NZD	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 3MFRA 22-19.12.27			
NZD	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 4.67500% 22-19.12.27	4 000 000.00	109 503.57	0.10
NZD	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 3MFRA 22-19.12.27			
BRL	CITI/INTEREST RATE SWAP REC 13.81500% 22-02.01.25	20 000 000.00	102 249.75	0.10
BRL	CITI/INTEREST RATE SWAP PAY BZD 22-02.01.25			
NZD	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 4.56500% 23-11.01.28	2 750 000.00	49 394.19	0.05
NZD	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 3MFRA 23-11.01.28			
BRL	CME/INTEREST RATE SWAP REC 12.727615% 23-02.01.25	29 000 000.00	62 941.00	0.06
BRL	CME/INTEREST RATE SWAP PAY BZD 23-02.01.25			
BRL	CME/INTEREST RATE SWAP REC 12.699287% 23-02.01.25	20 000 000.00	44 929.28	0.04
BRL	CME/INTEREST RATE SWAP PAY BZD 23-02.01.25			
ZAR	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 9.10100% 23-05.04.33	17 500 000.00	54 115.95	0.05
ZAR	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 3MZAR 23-05.04.33			
ZAR	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 9.08000% 23-05.04.33	7 500 000.00	22 569.57	0.02
ZAR	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 3MZAR 23-05.04.33			
BRL	CME/INTEREST RATE SWAP REC 11.724916% 23-02.01.25	30 000 000.00	6 644.52	0.01
BRL	CME/INTEREST RATE SWAP PAY BZD 23-02.01.25			
USD	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 3.76250% 24-03.07.26	10 000 000.00	2 469.07	0.00
USD	LCH/INTEREST RATE SWAP TP PAY SOFR O/N 24-03.07.26			
USD	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 3.95880% 24-27.11.26	10 000 000.00	112 337.36	0.10
USD	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY SOFR O/N 23-27.11.26			
NZD	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 4.65250% 24-23.02.29	4 500 000.00	116 314.01	0.11
NZD	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 3MFRA 24-23.02.29			
GBP	LCH/INTEREST RATE SWAP REC 4.31070% 24-21.02.27	3 500 000.00	21 042.80	0.02
GBP	LCH/INTEREST RATE SWAP PAY SONIA O/N 24-21.02.27			

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 (%)
BRL CME/INTEREST RATE SWAP REC 9.93600% 24-04.01.27	12 000 000.00	-82 823.62	-0.08
BRL CME/INTEREST RATE SWAP PAY BZD 24-04.01.27			
GBP LCH/INTEREST RATE SWAP REC 4.27532% 24-07.03.27	3 500 000.00	19 832.68	0.02
GBP LCH/INTEREST RATE SWAP PAY SONIA O/N 24-07.03.27			
BRL CME/INTEREST RATE SWAP REC 9.84250% 24-02.01.26	20 000 000.00	-90 911.93	-0.08
BRL CME/INTEREST RATE SWAP PAY BZD 24-02.01.26			
BRL CME/INTEREST RATE SWAP REC 10.67000% 24-02.01.26	35 000 000.00	-88 873.82	-0.08
BRL CME/INTEREST RATE SWAP PAY BZD 24-02.01.26			
INR LCH/INTEREST RATE SWAP REC 6.44250% 24-30.05.29	280 000 000.00	570.53	0.00
INR LCH/INTEREST RATE SWAP PAY O/N MIBOR 24-30.05.29			
BRL CME/INTEREST RATE SWAP REC 11.28500% 24-02.01.26	30 000 000.00	-39 765.36	-0.04
BRL CME/INTEREST RATE SWAP PAY BZD 24-02.01.26			
BRL CME/INTEREST RATE SWAP REC 10.59000% 24-02.01.25	60 000 000.00	-5 744.26	-0.01
BRL CME/INTEREST RATE SWAP PAY BZD 24-02.01.25			
GBP LCH/INTEREST RATE SWAP REC 3.38850% 25-25.09.27	7 000 000.00	-13 356.25	-0.01
GBP LCH/INTEREST RATE SWAP PAY SONIA O/N 25-25.09.27			
CNY LCH/INTEREST RATE SWAP REC 1.57750% 24-30.09.26	50 000 000.00	-797.65	0.00
CNY LCH/INTEREST RATE SWAP PAY CNRR007 24-30.09.26			
金利に係るスワップおよびフォワード・スワップ合計		1 543 296.65	1.43
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		1 543 296.65	1.43
派生商品合計		1 716 632.50	1.59

為替予約契約

購入通貨	購入額	売却通貨	売却額	満期日		
NGN	190 325 000.00	USD	115 000.00	13.1.2025	-3 432.69	0.00
KZT	109 020 000.00	USD	225 341.05	4.10.2024	1 207.08	0.00
INR	117 870 000.00	USD	1 404 150.39	4.10.2024	2 096.17	0.00
IDR	7 590 100 000.00	USD	491 520.25	4.10.2024	8 531.18	0.01
BRL	3 710 000.00	USD	655 118.22	4.10.2024	23 333.88	0.02
USD	229 334.32	CLP	210 600 000.00	4.10.2024	-4 668.61	0.00
USD	237 735.35	COP	984 997 000.00	4.10.2024	1 605.23	0.00
EUR	12 618 498.56	USD	13 950 000.00	4.10.2024	119 626.00	0.11
EUR	9 582 324.85	NZD	17 115 000.00	4.10.2024	-174 302.96	-0.16
AUD	1 460 000.00	EUR	890 121.19	4.10.2024	17 408.48	0.02
EUR	1 176 788.45	CHF	1 105 000.00	4.10.2024	2 956.02	0.00
EUR	1 403 000.24	JPY	225 400 000.00	4.10.2024	-9 090.04	-0.01
NOK	29 910 000.00	EUR	2 540 637.22	4.10.2024	3 733.95	0.00
EUR	1 260 620.97	SEK	14 340 000.00	4.10.2024	-6 964.56	-0.01
MXN	18 890 000.00	EUR	859 399.31	4.10.2024	3 874.24	0.00
EUR	1 323 592.32	HUF	521 800 000.00	4.10.2024	9 853.25	0.01
EUR	1 643 400.00	GBP	1 385 000.00	4.10.2024	-21 116.85	-0.02
TRY	8 110 000.00	EUR	208 554.30	4.10.2024	3 741.48	0.00
CAD	160 000.00	EUR	107 052.40	4.10.2024	-934.70	0.00
EUR	436 443.15	ZAR	8 670 000.00	4.10.2024	-14 296.53	-0.01
EUR	1 755 492.93	THB	66 300 000.00	4.10.2024	-90 764.64	-0.08
EUR	454 199.84	CNH	3 565 000.00	8.10.2024	-2 269.83	0.00
PLN	3 195 000.00	EUR	745 725.87	4.10.2024	456.80	0.00
CHF	175 000.00	USD	206 039.33	4.10.2024	1 294.73	0.00
USD	2 023 433.78	EUR	1 820 000.00	4.10.2024	-7 050.83	-0.01
EUR	430 000.00	USD	477 182.87	4.10.2024	2 455.35	0.00
USD	155 417.75	ZAR	2 790 000.00	4.10.2024	-5 797.88	-0.01
COP	1 007 188 850.00	USD	235 000.00	4.10.2024	5 608.98	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 純資産 割合 (%)
	先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)				
為替予約契約 (続き)					
購入通貨	購入額	売却通貨	売却額	満期日	
USD	235 000.00	MXN	4 683 731.19	4.10.2024	-3 492.98 0.00
NZD	775 000.00	USD	478 136.87	4.10.2024	13 400.00 0.01
GBP	350 000.00	EUR	414 076.72	4.10.2024	6 559.31 0.01
USD	670 000.00	EUR	601 827.94	4.10.2024	-1 523.67 0.00
TWD	15 151 924.00	USD	475 000.00	4.10.2024	3 382.80 0.00
USD	475 000.00	CNH	3 365 060.55	8.10.2024	-5 318.18 0.00
CAD	654 353.76	USD	480 000.00	4.10.2024	3 922.18 0.00
CHF	820 579.86	GBP	730 000.00	4.10.2024	-5 631.53 -0.01
EUR	111 838.51	USD	125 000.00	4.10.2024	-158.56 0.00
EUR	251 402.68	GBP	210 000.00	4.10.2024	-978.94 0.00
MXN	4 360 000.00	EUR	201 670.86	4.10.2024	-2 418.73 0.00
CHF	415 785.37	AUD	715 000.00	4.10.2024	-2 755.56 0.00
USD	491 871.58	NZD	775 000.00	4.10.2024	-1 093.47 0.00
TRY	8 243 167.08	EUR	215 000.00	4.10.2024	781.70 0.00
USD	1 408 092.32	INR	117 870 000.00	4.10.2024	1 435.93 0.00
INR	117 870 000.00	USD	1 405 959.25	6.11.2024	-1 500.93 0.00
EUR	430 000.00	CHF	406 012.88	4.10.2024	-1 304.15 0.00
SEK	1 220 000.00	EUR	107 900.90	4.10.2024	-58.90 0.00
TWD	15 200 000.00	USD	485 312.90	6.11.2024	-2 500.09 0.00
USD	481 013.46	TWD	15 151 924.00	4.10.2024	2 005.41 0.00
IDR	7 590 100 000.00	USD	500 263.64	6.11.2024	-1 071.27 0.00
USD	500 831.41	IDR	7 590 100 000.00	4.10.2024	-187.64 0.00
USD	227 290.73	KZT	109 020 000.00	4.10.2024	540.05 0.00
KZT	109 020 000.00	USD	226 299.95	6.11.2024	-668.68 0.00
EUR	891 827.21	CNH	6 935 000.00	6.11.2024	2 583.83 0.00
USD	775 000.00	EUR	692 063.15	4.10.2024	2 318.66 0.00
USD	5 339.92	COP	22 191 850.00	4.10.2024	21.63 0.00
BRL	3 710 000.00	USD	678 853.09	6.11.2024	-436.93 0.00
USD	681 359.05	BRL	3 710 000.00	4.10.2024	178.44 0.00
CLP	210 600 000.00	USD	235 752.43	4.10.2024	-1 082.19 0.00
USD	235 699.66	CLP	210 600 000.00	6.11.2024	1 099.31 0.00
TWD	15 095 328.00	USD	480 000.00	6.11.2024	-716.93 0.00
USD	480 000.00	SGD	614 576.16	4.10.2024	524.75 0.00
NZD	175 000.00	EUR	99 275.46	4.10.2024	485.56 0.00
EUR	266 076.00	JPY	42 500 000.00	4.10.2024	-178.82 0.00
CAD	170 000.00	EUR	112 284.00	4.10.2024	466.06 0.00
為替予約契約合計					-126 279.83 -0.12
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					5 497 820.00* 5.10
当座借越およびその他の短期負債					-2 834 427.48 -2.63
その他の資産および負債					753 155.95 0.71
純資産合計					107 754 321.46 100.00

* 2024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 - アジア・フレキシブル（米ドル）
2024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 AIA GROUP LTD-REG-S 3.37500% 20-07.04.30	725 000.00	689 251.97	0.23
USD AIA GROUP LTD-REG-S 5.62500% 22-25.10.27	200 000.00	208 526.79	0.07
USD AIA GROUP LTD-REG-S 4.95000% 23-04.04.33	400 000.00	408 703.95	0.14
USD AIRPORT AUTHORITY-REG-S 3.25000% 22-12.01.52	1 650 000.00	1 305 915.88	0.43
USD AIRPORT AUTHORITY-REG-S 4.75000% 23-12.01.28	275 000.00	282 119.11	0.09
USD ALIBABA GROUP HOLDING LTD 3.60000% 15-28.11.24	1 400 000.00	1 396 248.00	0.46
USD ALIBABA GROUP HOLDING LTD 3.15000% 21-09.02.51	3 300 000.00	2 355 919.50	0.78
USD APA INFRASTRUCTURE LTD-REG-S 5.12500% 24-16.09.34	1 505 000.00	1 497 240.76	0.49
USD BAIDU INC 4.12500% 15-30.06.25	800 000.00	796 032.00	0.26
USD BAYFRONT INFRASTRUCTURE MANAGEMEN-REG-S 4.25700% 23-16.05.26	2 125 000.00	2 129 398.32	0.70
USD BHARTI AIRTEL LTD-REG-S 4.37500% 15-10.06.25	3 200 000.00	3 189 000.00	1.05
USD CA MAGNUM HOLDINGS-REG-S 5.37500% 21-31.10.26	375 000.00	369 708.75	0.12
USD CHAMPION PATH HOLDINGS-REG-S 4.85000% 21-27.01.28	300 000.00	280 500.00	0.09
USD CHINA HUANENG GP HK TREASURY MGT-REG-S 2.60000% 19-10.12.24	1 050 000.00	1 044 687.00	0.35
USD CHINA OIL AND GAS GROUP LTD-REG-S 4.70000% 21-30.06.26	350 000.00	322 329.00	0.11
USD CIFI HOL GROUP CO LTD REG-S*DEFAULTED* 4.37500% 21-12.04.27	1 500 000.00	138 750.00	0.05
USD CIFI HOL GROUP CO LTD-REG-S *DEFAULTED* 4.45000% 21-17.08.26	400 000.00	37 000.00	0.01
USD CK HUTCHISON INTERNATIONAL 23 LTD-REG-S 4.75000% 23-21.04.28	225 000.00	227 670.75	0.08
USD CK HUTCHISON INTERNATIONAL 20 LTD-REG-S 3.37500% 20-08.05.50	1 000 000.00	761 408.16	0.25
USD CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 5.12500% 18-14.03.28	350 000.00	355 250.00	0.12
USD CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 3.87500% 19-19.06.29	1 100 000.00	1 064 593.75	0.35
USD CNOOC FINANCE 2013 LTD 3.30000% 19-30.09.49	1 800 000.00	1 421 442.00	0.47
USD CNOOC FINANCE 2015 USA LLC 4.37500% 18-02.05.28	1 050 000.00	1 061 161.50	0.35
USD DEVELOPMENT BK OF THE PHILIPPINES-REG-S 2.37500% 21-11.03.31	600 000.00	523 266.00	0.17
USD EHI CAR SERVICES LTD-REG-S 7.00000% 21-21.09.26	200 000.00	139 000.00	0.05
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 4.87500% 23-11.01.26	2 500 000.00	2 520 450.00	0.83
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 5.12500% 23-11.01.33	350 000.00	366 369.50	0.12
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA-REG-S 4.62500% 23-07.06.33	200 000.00	202 452.00	0.07
USD FORTUNE STAR BVI LTD-REG-S 5.05000% 21-27.01.27	300 000.00	276 750.00	0.09
USD FRANSION BRILLIANT LTD-REG-S 4.25000% 19-23.07.29	500 000.00	404 125.00	0.13
USD GS-CALTEX CORP-REG-S 5.37500% 23-07.08.28	500 000.00	513 906.25	0.17
USD HANWHA Q CELLS AMERICAS HOLDINGS-REG-S 5.00000% 23- 27.07.28	775 000.00	791 825.25	0.26
USD HKT CAPITAL NO 6 LTD-REG-S 3.00000% 22-18.01.32	1 600 000.00	1 426 651.20	0.47
USD ICTSI TREASURY BV REG-S 3.50000% 21-16.11.31	250 000.00	228 595.00	0.08
USD INDONESIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.10000% 24-10.02.54	3 300 000.00	3 344 343.75	1.10
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 3.50000% 17-11.01.28	250 000.00	245 468.75	0.08
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 4.65000% 22-20.09.32	5 725 000.00	5 778 671.87	1.91
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 4.85000% 23-11.01.33	500 000.00	510 468.75	0.17
USD INDUSTRIAL BANK OF KOREA-REG-S 5.37500% 23-04.10.28	325 000.00	339 930.50	0.11
USD INTERNATIONAL CONT TERM SERV-REG-S 4.75000% 20-17.06.30	250 000.00	249 452.50	0.08
USD JSW HYDRO ENERGY LTD-REG-S 4.12500% 21-18.05.31	200 000.00	138 795.00	0.05
USD KAISA GROUP HOLDINGS-REG-S *DEFAULTED* 10.50000% 20-15.01.25	1 250 000.00	55 625.00	0.02
USD KOREA DEVELOPMENT BANK 4.37500% 23-15.02.28	1 000 000.00	1 008 980.00	0.33
USD KOREA DEVELOPMENT BANK 4.37500% 23-15.02.33	250 000.00	248 822.50	0.08
USD KOREA DEVELOPMENT BANK/THE 5.37500% 23-23.10.26	1 500 000.00	1 537 290.00	0.51
USD KOREA MINE REHABILITATION & MIN-REG-S 4.12500% 22-20.04.27	300 000.00	297 429.00	0.10

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 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 KOREA, REPUBLIC OF 4.12500% 14-10.06.44	1 200 000.00	1 124 916.00	0.37
USD KWG GROUP HOLDING LTD-REG-S *DEFAULTED* 6.30000% 20-13.02.26	975 000.00	57 281.25	0.02
USD LAI SUN MTN LTD-REG-S 5.00000% 21-28.07.26	1 150 000.00	767 533.00	0.25
USD LENOVO GROUP LTD-REG-S 3.42100% 20-02.11.30	400 000.00	371 250.00	0.12
USD LG ENERGY SOLUTION LTD-REG-S 5.75000% 23-25.09.28	250 000.00	258 437.50	0.09
USD LLPL CAPITAL PTE LTD-REG-S 6.87500% 19-04.02.39	425 000.00	332 200.33	0.11
USD LOGAN PROP HLD CO LTD-REG-S *DEFAULTED* 6.90000% 19-09.06.24	1 125 000.00	94 218.75	0.03
USD MALAYSIA SOVEREIGN SUKUK BHD-REG-S 3.04300% 15-22.04.25	1 250 000.00	1 238 675.00	0.41
USD MARUBENI CORP-REG-S 4.45800% 24-19.09.29	2 035 000.00	2 039 619.43	0.67
USD MEDCO BELL PTE LTD-REG-S 6.37500% 20-30.01.27	200 000.00	199 482.00	0.07
USD MEDCO LAUREL TREE PTE LTD-REG-S 6.95000% 21-12.11.28	300 000.00	299 586.00	0.10
USD MELCO RESORTS FINANCE LTD-REG-S 5.75000% 20-21.07.28	1 550 000.00	1 496 741.07	0.49
USD MGM CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 5.87500% 19-15.05.26	400 000.00	398 777.08	0.13
USD MGM CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 7.12500% 24-26.06.31	200 000.00	205 822.60	0.07
USD MIZUHO FINANCIAL GROUP INC-REG-S 3.47700% 16-12.04.26	1 000 000.00	987 814.76	0.33
USD MODERNLAND OVERSEAS PTE-REG-S (PIK) STEP DOWN/UP 21-30.04.27	15 000.00	4 795.80	0.00
USD MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 7.87500% 23-05.06.29	250 000.00	264 062.50	0.09
USD NEW METRO GLOBAL LTD-REG-S 4.50000% 21-02.05.26	300 000.00	217 500.00	0.07
USD NTT FINANCE CORP-REG-S 1.16200% 21-03.04.26	750 000.00	716 312.22	0.24
USD NTT FINANCE CORP-REG-S 5.11000% 24-02.07.29	1 450 000.00	1 497 702.32	0.49
USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 6.87500% 17-05.12.27	375 000.00	339 843.75	0.11
USD PAKUWON JATI TBK PT-REG-S 4.87500% 21-29.04.28	250 000.00	241 952.50	0.08
USD PERIAMA HOLDINGS LLC/DE-REG-S 5.95000% 20-19.04.26	300 000.00	299 343.75	0.10
USD PERTAMINA PT-REG-S 1.40000% 21-09.02.26	1 500 000.00	1 432 500.00	0.47
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF 2.65000% 20-10.12.45	375 000.00	264 140.62	0.09
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 5.17000% 22-13.10.27	2 475 000.00	2 548 476.57	0.84
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 5.50000% 23-17.01.48	200 000.00	213 342.00	0.07
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 4.62500% 23-17.07.28	1 250 000.00	1 269 712.50	0.42
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 5.60000% 24-14.05.49	1 250 000.00	1 350 390.62	0.45
USD POSCO-REG-S 5.75000% 23-17.01.28	2 600 000.00	2 691 962.00	0.89
USD POWERLONG REAL ESTATE-REG-S *DEFAULTED* 6.25000% 20-10.08.24	200 000.00	16 500.00	0.01
USD REDSUN PROPERTIES GRP-REG-S *DEFAULTED* 9.50000% 21-20.09.23	1 450 000.00	12 064.00	0.00
USD RELIANCE INDUSTRIES LTD-REG-S 2.87500% 22-12.01.32	1 050 000.00	925 554.00	0.31
USD RELIANCE INDUSTRIES LTD-REG-S 3.62500% 22-12.01.52	1 500 000.00	1 134 930.00	0.37
USD RELIANCE INDUSTRIES LTD-REG-S 4.12500% 15-28.01.25	1 000 000.00	997 430.00	0.33
USD RENEW WIND ENER AP2 / RENEW POWER-REG-S 4.50000% 21-14.07.28	700 000.00	655 593.75	0.22
USD RKPF OVERSEAS 2020 A LTD-REG-S 5.20000% 21-12.07.29	900 000.00	339 208.96	0.11
USD SANDS CHINA LTD STEP-UP 21-18.06.30	200 000.00	191 471.86	0.06
USD SANDS CHINA LTD STEP-UP/DOWN 22-08.03.29	1 150 000.00	1 044 517.98	0.35
USD SANDS CHINA LTD STEP-UP/DOWN 22-08.08.31	2 500 000.00	2 196 667.74	0.73
USD SHIMAO PRPTY HLDG LTD-REG-S *DEFAULTED* 5.20000% 21-16.01.27	400 000.00	20 000.00	0.01
USD SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD-REG-S 5.00000% 23-24.07.28	2 400 000.00	2 439 000.00	0.81
USD SINO-OCEAN LAD IV LTD-REG-S *DEFAULTED* 3.25000% 21-05.05.26	450 000.00	29 250.00	0.01
USD SINO-OCEAN LAND LTD-REG-S *DEFAULTED* 4.75000% 19-05.08.29	200 000.00	13 000.00	0.00
USD SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMNT-REG-S 3.25000% 15-28.04.25	1 500 000.00	1 487 160.00	0.49
USD SINOPEC GRP OVERSEAS DEV LTD-REG-S 2.15000% 20-13.05.25	400 000.00	393 416.00	0.13
USD SINOPEC GRP OVERSEAS DEV LTD-REG-S 2.70000% 20-13.05.30	1 250 000.00	1 178 612.50	0.39
USD SK BATTERY AMERICA INC-REG-S 4.87500% 24-23.01.27	1 200 000.00	1 213 080.00	0.40
USD SK HYNIX INC-REG-S 5.50000% 24-16.01.29	1 400 000.00	1 442 437.50	0.48
USD SK HYNIX INC-REG-S 6.37500% 23-17.01.28	900 000.00	945 843.75	0.31
USD SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULTED* 6.75000% 18-18.04.28	850 000.00	479 187.50	0.16
USD SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULTED* 7.85000% 19-14.03.29	1 100 000.00	620 125.00	0.20
USD SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULTED* 7.75000% 19-28.03.30	3 200 000.00	1 788 992.00	0.59
USD STUDIO CITY CO LTD-REG-S 7.00000% 22-15.02.27	200 000.00	201 875.00	0.07
USD STUDIO CITY FINANCE LTD-REG-S 6.50000% 20-15.01.28	550 000.00	537 893.56	0.18
USD SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC-SUB 5.83600% 24-09.07.44	675 000.00	727 386.91	0.24

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 TSMC GLOBAL LTD-REG-S 2.25000% 21-23.04.31	1 800 000.00	1 582 524.00	0.52
USD TSMC GLOBAL LTD-REG-S 4.37500% 22-22.07.27	1 800 000.00	1 806 750.00	0.60
USD VEDANTA RESOURCES FINANCE II PLC-REG-S 10.87500% 24-17.09.29	1 000 000.00	1 014 550.00	0.34
USD WESTPAC BANKING CORP 5.35000% 22-18.10.24	250 000.00	250 019.02	0.08
USD WYNN MACAU LTD-REG-S 5.50000% 17-01.10.27	600 000.00	586 639.56	0.19
USD WYNN MACAU LTD-REG-S 5.12500% 19-15.12.29	200 000.00	187 928.98	0.06
USD WYNN MACAU LTD-REG-S 5.50000% 20-15.01.26	450 000.00	446 564.84	0.15
USD YUZHOU PROPERTIES-REG-S *DEFAULTED* 7.37500% 20-13.01.26	324 000.00	21 060.00	0.01
Total USD		92 643 151.34	30.61
固定利付ノート合計		92 643 151.34	30.61
変動利付ノート			
USD			
USD ANZ BANK NEW ZEALAND LTD-REG-S-SUB 5.898%/VAR 24-10.07.34	275 000.00	284 456.46	0.09
USD CLI OVERSEAS CO LTD/HK-REG-S-SUB 5.350%/VAR 23-15.08.33	2 500 000.00	2 562 225.00	0.85
USD GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES-REG-S-SUB 4.500%/VAR 21-PRP	1 900 000.00	1 263 690.00	0.42
USD KRUNG THAI/CAYMAN ISLANDS-REG-S-SUB COCO 4.400%/VAR 21-PRP	325 000.00	318 069.38	0.11
USD MEIJI YASUDA LIFE INSURANC-REG-S-SUB 5.800%/VAR 24-11.09.54	800 000.00	821 787.20	0.27
USD OVERSEA-CHINESE BKNG-REG-S-SUB 1.832%/VAR 20-10.09.30	626 000.00	607 862.13	0.20
USD STANDARD CHARTERED PLC-REG-S 6.301%/VAR 23-09.01.29	3 950 000.00	4 155 588.41	1.37
USD STANDARD CHARTERED PLC-REG-S 6.097%/VAR 24-11.01.35	300 000.00	322 751.86	0.11
USD STANDARD CHARTERED PLC-REG-S-SUB 7.875%/VAR 24-PRP	1 000 000.00	1 060 894.00	0.35
USD STANDARD CHARTERED PLC-REG-S-SUB 4.866%/VAR 18-15.03.33	1 975 000.00	1 962 590.25	0.65
USD STANDARD CHARTERED PLC-REG-S-SUB 3.603%/VAR 22-12.01.33	550 000.00	492 261.69	0.16
Total USD		13 852 176.38	4.58
変動利付ノート合計		13 852 176.38	4.58
固定利付ミディアム・ターム・ノート			
USD			
USD AIA GROUP LTD-REG-S 3.20000% 15-11.03.25	1 200 000.00	1 190 721.02	0.39
USD BANGKOK BANK PCL/HONG KONG-REG-S 5.50000% 23-21.09.33	750 000.00	778 102.50	0.26
USD BANGKOK BANK PCL/HONG KONG-REG-S 5.65000% 24-05.07.34	1 050 000.00	1 101 271.50	0.36
USD BANK NEGARA INDONESIA PERSERO-REG-S 5.28000% 24-05.04.29	2 000 000.00	2 039 860.00	0.67
USD BANK OF CHINA/HONG KONG-REG-S 3.62500% 19-17.04.29	400 000.00	390 456.00	0.13
USD BOC AVIATION LTD-REG-S 3.50000% 19-10.10.24	450 000.00	449 819.19	0.15
USD BOC AVIATION USA CORP-REG-S 5.75000% 23-09.11.28	575 000.00	601 634.00	0.20
USD BOC AVIATION USA CORP-REG-S 5.25000% 24-14.01.30	3 100 000.00	3 199 386.00	1.06
USD CANARA BANK-REG-S 4.89600% 24-11.09.29	2 645 000.00	2 672 693.15	0.88
USD CDBL FUNDING 1-REG-S 3.50000% 20-24.10.27	608 000.00	593 370.00	0.20
USD CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD-REG-S 3.12500% 20-18.03.30	1 800 000.00	1 638 252.00	0.54
USD CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD-REG-S 3.00000% 21-20.01.31	1 300 000.00	1 144 923.00	0.38
USD CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT-REG-S 5.75000% 24-28.05.29	1 700 000.00	1 752 700.00	0.58
USD CHINA CINDA FINANCE 2017 I LTD-REG-S 4.75000% 18-08.02.28	500 000.00	496 500.00	0.16
USD CHINA CONSTRUCTION BANK CORP/HK-REG-S 1.25000% 20-04.08.25	1 750 000.00	1 699 617.50	0.56
USD CHINA DEVELOPMENT BANK-REG-S 1.00000% 20-27.10.25	1 000 000.00	964 920.00	0.32
USD CHINA GRT WALL INT HLDGS III LTD-REG-S 3.87500% 17-31.08.27	200 000.00	192 312.50	0.06
USD CICC HONG KONG FIN 2016 MTN LTD-REG-S 2.00000% 21-26.01.26	1 425 000.00	1 380 141.00	0.46
USD CITIC LTD-REG-S 3.50000% 22-17.02.32	2 200 000.00	2 054 228.00	0.68
USD CITIC LTD-REG-S 4.00000% 18-11.01.28	850 000.00	842 562.50	0.28
USD CLP POWER HONG KONG FINANCING LTD-REG-S 2.12500% 20-30.06.30	750 000.00	667 924.50	0.22
USD DBS GROUP HOLDINGS-REG-S 1.16900% 21-22.11.24	200 000.00	198 915.60	0.07
USD EXPORT IMPORT BANK OF THAILAND-REG-S 1.45700% 20-15.10.25	1 300 000.00	1 252 849.00	0.41
USD EXPORT IMPORT BANK OF THAILAND-REG-S 5.35400% 24-16.05.29	1 125 000.00	1 167 513.75	0.39
USD EXPORT-IMPORT BANK OF INDIA-REG-S 2.25000% 21-13.01.31	425 000.00	369 218.75	0.12
USD FAR EAST HORIZON LTD-REG-S 4.25000% 21-26.10.26	200 000.00	192 778.00	0.06
USD FAR EAST HORIZON LTD-REG-S 6.62500% 24-16.04.27	375 000.00	378 746.25	0.13
USD FWD GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 7.78400% 23-06.12.33	1 700 000.00	1 963 806.00	0.65
USD GC TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 2.98000% 21-18.03.31	850 000.00	745 078.13	0.25

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	評価額 米ドル 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD HONG KONG GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 5.25000% 23-11.01.53	725 000.00	817 372.25	0.27
USD HONG KONG MORTGAGE CORP LTD-REG-S 4.87500% 23-13.09.28	1 000 000.00	1 033 370.00	0.34
USD HONGKONG ELECTRIC FINANCE LTD-REG-S 1.87500% 20-27.08.30	1 550 000.00	1 354 678.30	0.45
USD HONGKONG LAND FINANCE CO LTD-REG-S 2.25000% 21-15.07.31	250 000.00	214 509.00	0.07
USD HUARONG FINANCE 2017 CO-REG-S 4.25000% 17-07.11.27	1 300 000.00	1 248 000.00	0.41
USD HUARONG FINANCE-REG-S 4.50000% 19-29.05.29	300 000.00	286 500.00	0.09
USD HYSAN MTN LTD-REG-S 3.55000% 20-16.06.35	800 000.00	688 504.00	0.23
USD ICBCIL FINANCE CO LTD-REG-S 1.75000% 20-25.08.25	800 000.00	777 512.00	0.26
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.12500% 15-15.01.45	700 000.00	717 281.25	0.24
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 4.75000% 17-18.07.47	300 000.00	295 406.25	0.10
USD INDUSTRIAL COMMERCIAL BANK CHINA-REG-S 1.20000% 20-09.09.25	2 225 000.00	2 155 813.63	0.71
USD KHAZANAH GLOBAL SUKUK BHD-REG-S 4.68700% 23-01.06.28	1 475 000.00	1 490 210.94	0.49
USD KOREA HOUSING FINANCE CORP-REG-S 4.87500% 24-27.08.27	1 350 000.00	1 380 253.50	0.46
USD KWG GROUP HOLDING LTD-REG-S *DEFAULTED* 7.40000% 19-05.03.24	800 000.00	47 000.00	0.02
USD METROPOLITAN BANK & TRUST CO-REG-S 5.50000% 24-06.03.34	760 000.00	787 312.50	0.26
USD METROPOLITAN BANK & TRUST CO-REG-S 5.37500% 24-06.03.29	1 105 000.00	1 144 365.63	0.38
USD MITSUI & CO LTD-REG-S 4.40000% 24-12.09.29	500 000.00	503 951.32	0.17
USD MUTHOOT FINANCE LTD-REG-S 7.12500% 24-14.02.28	300 000.00	308 250.00	0.10
USD NBN CO LTD-REG-S 5.75000% 23-06.10.28	200 000.00	210 769.87	0.07
USD NONGHYUP BANK-REG-S 4.75000% 24-22.07.29	1 000 000.00	1 018 090.00	0.34
USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 7.37500% 21-08.04.31	1 925 000.00	1 629 031.25	0.54
USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 8.87500% 21-08.04.51	225 000.00	179 718.75	0.06
USD PERTAMINA PERSERO PT-REG-S 4.70000% 19-30.07.49	2 000 000.00	1 804 380.00	0.60
USD PERTAMINA PT-REG-S 6.45000% 14-30.05.44	800 000.00	886 504.00	0.29
USD PERTAMINA PT-REG-S 6.50000% 18-07.11.48	450 000.00	507 447.00	0.17
USD PERU PERS PT PERSUSAHAAN LIST NEG-REG-S 4.00000% 20-30.06.50	1 000 000.00	774 190.00	0.26
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 6.15000% 18-21.05.48	500 000.00	523 135.00	0.17
USD PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 3.50000% 15-18.03.25	2 150 000.00	2 133 445.00	0.71
USD PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 3.50000% 20-21.04.30	750 000.00	718 207.50	0.24
USD PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 4.80000% 20-21.04.60	1 000 000.00	951 820.00	0.31
USD PINGAN REAL ESTATE CAPITAL LTD-REG-S 3.45000% 21-29.07.26	200 000.00	179 437.49	0.06
USD PSA TREASURY PTE LTD-REG-S 2.50000% 16-12.04.26	2 400 000.00	2 341 704.36	0.77
USD PSA TREASURY PTE LTD-REG-S 2.12500% 19-05.09.29	500 000.00	458 710.20	0.15
USD PTT TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 5.87500% 19-03.08.35	2 820 000.00	2 977 778.99	0.98
USD REC LTD-REG-S 2.25000% 21-01.09.26	1 895 000.00	1 810 909.37	0.60
USD REDCO PROPERTIES GRP-REG-S *DEFAULTED* 9.90000% 20-17.02.24	2 050 000.00	12 300.00	0.00
USD RHB BANK BHD-REG-S 1.65800% 21-29.06.26	850 000.00	809 093.75	0.27
USD RIZAL COMMERCIAL BANKING CORP-REG-S 5.50000% 24-18.01.29	600 000.00	619 500.00	0.20
USD SHINHAN BANK CO LTD-REG-S-SUB 5.75000% 24-15.04.34	1 750 000.00	1 814 960.00	0.60
USD SHRIRAM FINANCE LTD-REG-S 6.62500% 24-22.04.27	300 000.00	304 710.00	0.10
USD SINGAPORE AIRLINES LTD-REG-S 3.00000% 21-20.07.26	500 000.00	488 736.50	0.16
USD SINGAPORE AIRLINES-REG-S 3.37500% 22-19.01.29	750 000.00	720 375.00	0.24
USD SINGAPORE EXCHANGE LTD-REG-S 1.23400% 21-03.09.26	2 225 000.00	2 107 557.82	0.70
USD SINGTEL GROUP TREASURY PTE LTD-REG-S 3.25000% 15-30.06.25	2 000 000.00	1 979 835.00	0.65
USD SINOCHEN OFFSHORE CAPITAL CO LTD-REG-S 2.37500% 21-23.09.31	1 000 000.00	857 350.00	0.28
USD SMIC SG HOLDINGS PTE LTD-REG-S 5.37500% 24-24.07.29	1 400 000.00	1 427 566.00	0.47
USD SP GROUP TREASURY PTE LTD-REG-S 3.37500% 19-27.02.29	600 000.00	583 411.63	0.19
USD SP POWERASSETS LTD-REG-S 3.25000% 15-24.11.25	750 000.00	741 223.90	0.25
USD STATE BANK OF INDIA/LONDON-REG-S 1.80000% 21-13.07.26	300 000.00	286 242.00	0.09
USD STATE BANK OF INDIA/LONDON-REG-S 5.00000% 24-17.01.29	1 000 000.00	1 016 990.00	0.34
USD STATE GRID OVERSEAS INVESTMENT-REG-S 3.50000% 17-04.05.27	2 250 000.00	2 224 080.00	0.73
USD STATE GRID OVERSEAS INVESTMENT-REG-S 4.25000% 18-02.05.28	2 007 000.00	2 023 035.93	0.67
USD SUMITOMO CORP-REG-S 5.35000% 24-03.07.34	1 000 000.00	1 043 500.00	0.34
USD SUN HUNG KAI PROP CAP MRKT LTD-REG-S 2.87500% 20-21.01.30	400 000.00	370 099.12	0.12
USD SWIRE PACIFIC MT FINANCING HK LTD-REG-S 2.87500% 20-30.01.30	500 000.00	464 195.00	0.15
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 2.39000% 20-03.06.30	400 000.00	361 887.24	0.12
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.24000% 20-03.06.50	1 210 000.00	883 675.10	0.29
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.84000% 21-22.04.51	2 250 000.00	1 823 203.12	0.60
USD THAI OIL TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 4.87500% 18-23.01.43	500 000.00	451 562.50	0.15
USD THAI OIL TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 3.50000% 19-17.10.49	400 000.00	282 952.00	0.09
USD VANKE REAL ESTAT HONG KONG CO LTD-REG-S 3.97500% 17-09.11.27	500 000.00	333 750.00	0.11
USD WHEELLOCK MTN BVI LTD-REG-S 2.37500% 21-25.01.26	770 000.00	747 060.16	0.25
Total USD		91 254 720.96	30.15
固定利付ミディアム・ターム・ノート合計		91 254 720.96	30.15

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	評価額 米ドル 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
変動利付ミディアム・ターム・ノート			
USD			
USD BANGKOK BANK PCL/HONG KONG-REG-S-SUB COCO 5.000%/VAR 20-PRP	275 000.00	271 700.00	0.09
USD BANK OF EAST ASIA LTD/THE-REG-S-SUB 6.750%/VAR 24-27.06.34	650 000.00	676 006.50	0.22
USD CHINA CITIC BNK INTER-REG-S-SUB 6.000%/VAR 23-05.12.33	1 400 000.00	1 470 306.60	0.49
USD DAH SING BANK LTD-REG-S-SUB 7.375%/VAR 23-15.11.33	250 000.00	267 320.50	0.09
USD KASIKORNBANK PCL-REG-S-SUB COCO 5.275%/VAR 20-PRP	350 000.00	346 937.50	0.11
USD KASIKORNBANK PCL/HONG KONG-REG-S-SUB COCO 4.000%/VAR 21-PRP	400 000.00	383 000.00	0.13
USD KEB HANA BANK-REG-S-SUB 3.500%/VAR 21-PRP	200 000.00	190 625.00	0.06
USD OVERSEA-CHINESE BANKING CRP-REG-S-SUB 5.520%/VAR 24-21.05.34	1 700 000.00	1 763 913.20	0.58
USD SHINHAN FIN GROUP CO LTD-REG-S-SUB 3.340%/VAR 19-05.02.30	1 225 000.00	1 215 996.25	0.40
USD UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S-SUB 2.000%/VAR 21-14.10.31	1 200 000.00	1 137 034.12	0.38
USD WOORI BANK-REG-S-SUB 4.250%/VAR 19-PRP	200 000.00	199 500.00	0.07
USD WOORI BANK-REG-S-SUB 6.375%/VAR 24-PRP	1 325 000.00	1 358 539.06	0.45
Total USD		9 280 878.73	3.07

変動利付ミディアム・ターム・ノート合計		9 280 878.73	3.07
----------------------------	--	---------------------	-------------

固定利付債券

USD			
USD AGILE GROUP HOLDINGS LTD-REG-S *DEFAULTED* 20-13.10.25	700 000.00	44 975.00	0.01
USD AZURE POWER ENERGY LTD-REG-S 3.57500% 21-19.08.26	282 000.00	209 942.03	0.07
USD CHINA OVERSEAS FINANCE-REG-S 5.35000% 12-15.11.42	900 000.00	840 656.25	0.28
USD CHINA SCE GROUP HOLD-REG-S *DEFAULTED* 7.00000% 20-02.05.25	400 000.00	22 000.00	0.01
USD CHINA SCE GROUP HOLD-REG-S *DEFAULTED* 6.00000% 21-04.02.26	700 000.00	36 750.00	0.01
USD CHINA SCE PROPERTY-REG-S *DEFAULTED* 5.95000% 21-29.09.24	375 000.00	19 687.50	0.01
USD CK HUTCHISON INTERNATIONAL 24 LTD-REG-S 5.50000% 24-26.04.34	1 200 000.00	1 260 697.04	0.42
USD CK HUTCHISON INTERNATIONAL 23 LTD-REG-S 4.87500% 23-21.04.33	375 000.00	378 165.00	0.12
USD CMHI FINANCE BVI CO LTD-REG-S 5.00000% 18-06.08.28	1 450 000.00	1 491 234.38	0.49
USD CONTINUUM ENERGY AURA PTE LTD-REG-S 9.50000% 23-24.02.27	400 000.00	419 750.00	0.14
USD COUNTRY GARDEN HOLD-REG-S *DEFAULTED* 4.20000% 20-06.02.26	1 200 000.00	87 000.00	0.03
USD COUNTRY GARDN HOLD-REG-S *DEFAULTED* 6.15000% 19-17.09.25	700 000.00	50 750.00	0.02
USD GARUDA INDONESIA PERSERO-REG-S (PIK) 6.50000% 22-28.12.31	200 000.00	143 221.12	0.05
USD GREENKO DUTCH BV-REG-S 3.85000% 21-29.03.26	615 000.00	531 160.13	0.18
USD GREENKO SOLAR MAURITIUS LTD-REG-S 5.95000% 19-29.07.26	500 000.00	498 281.25	0.16
USD HUTCHISON WHAMPOA INTERNATIONAL14-REG-S 3.62500% 14-31.10.24	222 000.00	221 551.56	0.07
USD HYUNDAI CARD CO LTD-REG-S 5.75000% 24-24.04.29	1 250 000.00	1 298 825.00	0.43
USD INDIA VEHICLE FINANCE-REG-S 5.85000% 24-25.09.30	1 000 000.00	998 750.00	0.33
USD KAISA GROUP HOLDINGS-REG-S *DEFAULTED* 11.70000% 21-11.11.25	1 000 000.00	44 500.00	0.01
USD KASIKORNBANK PCL/HONG KONG-REG-S 5.45800% 23-07.03.28	400 000.00	412 000.00	0.14
USD KOREA EAST-WEST POWER CO LTD-REG-S 4.87500% 23-12.07.28	2 125 000.00	2 159 531.25	0.71
USD KOREA LAND & HOUSING CORP-REG-S 5.75000% 23-06.10.25	2 375 000.00	2 397 633.75	0.79
USD KUBOTA CREDIT CORP USA-REG-S 4.95800% 23-31.05.26	200 000.00	201 571.60	0.07
USD KWG GROUP HOLDINGS LTD *DEFAULTED* 7.87500% 22-30.08.24	200 000.00	11 750.00	0.00
USD LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 4.50000% 18-16.01.28	200 000.00	163 000.00	0.05
USD LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 3.95000% 19-16.09.29	300 000.00	222 000.00	0.07
USD LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 3.85000% 20-13.01.32	200 000.00	138 276.00	0.05
USD LS FINANCE 2017 LTD-REG-S 4.80000% 21-18.06.26	200 000.00	172 500.00	0.06

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 MALAYSIA WAKALA SUKUK BHD-REG-S 3.07500% 21-28.04.51	250 000.00	191 485.00	0.06
USD MINEJESA CAPITAL BV-REG-S 5.62500% 17-10.08.37	500 000.00	480 625.00	0.16
USD MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 3.50000% 21-07.07.27	700 000.00	650 125.00	0.21
USD MUANGTHAI CAPITAL PCL-REG-S 6.87500% 24-30.09.28	1 065 000.00	1 076 981.25	0.36
USD NANSHAN LIFE PTE LTD-REG-S-SUB 5.45000% 24-11.09.34	2 340 000.00	2 337 706.80	0.77
USD NWD FINANCE BVI LTD-REG-S 6.25000% 19-PRP	900 000.00	490 500.00	0.16
USD NWD MTN LTD-REG-S 4.12500% 19-18.07.29	1 100 000.00	830 280.00	0.27
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 5.37500% 18-25.01.29	538 000.00	552 673.95	0.18
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 3.95000% 15-20.01.40	1 025 000.00	927 945.31	0.31
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 3.70000% 16-01.03.41	2 250 000.00	1 955 002.50	0.65
USD POWERLONG REAL ESTATE-REG-S *DEFAULTED* 4.90000% 21-13.05.26	600 000.00	49 500.00	0.02
USD POWERLONG REAL ESTATE *DEFAULTED* 6.95000% 23-06.12.25	200 000.00	16 005.00	0.01
USD RKPf OVERSEAS 2020 A LTD-REG-S 5.12500% 21-26.01.30	1 800 000.00	662 042.37	0.22
USD ROP SUKUK TRUST-REG-S 5.04500% 23-06.06.29	1 175 000.00	1 212 820.31	0.40
USD SAMMAAN CAPITAL LTD-REG-S 9.70000% 24-03.07.27	200 000.00	199 020.00	0.07
USD SHINHAN CARD CO LTD-REG-S 1.37500% 21-23.06.26	300 000.00	284 531.25	0.09
USD SK BROADBAND CO LTD-REG-S 4.87500% 23-28.06.28	600 000.00	607 500.00	0.20
USD SK ON CO LTD-REG-S 5.37500% 23-11.05.26	1 850 000.00	1 873 703.13	0.62
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S (PIK) 6.00000% 23-30.09.25	34 957.00	4 282.24	0.00
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S (PIK) 6.25000% 23-30.09.26	35 000.00	3 806.25	0.00
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S (PIK) 6.50000% 23-30.09.27	1 593 210.00	151 354.95	0.05
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S (PIK) 6.75000% 23-30.09.28	105 253.00	9 209.64	0.00
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S PIK 7.00000% 23-30.09.29	1 105 382.00	85 667.11	0.03
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S (PIK) 7.25000% 23-30.09.30	349 568.00	24 469.76	0.01
USD TALENT YIELD INTERNATIONAL LTD-REG-S 3.12500% 21-06.05.31	200 000.00	183 610.00	0.06
USD VEDANTA RESOURCES FINANCE II PLC-REG-S STEP-UP 21-09.12.28	300 000.00	252 866.88	0.08
USD VIETNAM, SOCIALIST REPUBLIC-REG-S 4.80000% 14-19.11.24	500 000.00	498 250.00	0.16
USD WEST CHINA CEMENT LTD-REG-S 4.95000% 21-08.07.26	500 000.00	383 750.00	0.13
USD XIAOMI BEST TIME INTER LTD-REG-S 4.10000% 21-14.07.51	300 000.00	241 308.00	0.08
USD YUZHOU PROPERTIES-REG-S *DEFAULTED* 8.30000% 19-27.05.25	1 675 000.00	108 875.00	0.04
Total USD		30 822 055.56	10.18
固定利付債券合計		30 822 055.56	10.18
変動利付債券			
USD			
USD BANK NEGARA INDONESIA PERSERO-REG-S-SUB 4.300%/VAR 21-PRP	400 000.00	382 000.00	0.13
USD BANK OF COMMUNICATIONS H/K-REG-S 2.304%/VAR 21-08.07.31	1 350 000.00	1 297 366.20	0.43
USD CHINA TAIPING INSURANCE-REG-S-SUB 6.400%/VAR 23-PRP	350 000.00	369 687.50	0.12
USD GLOBE TELECOM INC-REG-S 4.200%/VAR 21-PRP	300 000.00	292 743.00	0.10
USD NETWORK 121 LTD-REG-S-SUB 5.650%/VAR 19-PRP	400 000.00	399 080.00	0.13
USD NWD FINANCE BVI LTD-REG-S 4.125%/VAR 21-PRP	682 000.00	433 411.00	0.14
USD RIZAL COMMERCIAL BANKING CORP-REG-S-SUB 6.500%/VAR 20-PRP	200 000.00	199 187.50	0.07
USD RKPf OVERSEAS 2019 E LTD-REG-S 7.750%/VAR 19-PRP	1 300 000.00	319 020.00	0.10
USD SAN MIGUEL GLOBAL POWER HOLDNGS CORP-REG-S 8.750%/VAR 24-PRP	1 000 000.00	1 025 000.00	0.34
USD STANDARD CHARTERED PLC-REG-S-SUB COCO 4.300%/VAR 21-PRP	1 000 000.00	909 463.30	0.30
USD UPL CORP LTD-REG-S-SUB 5.250%/VAR 20-PRP	400 000.00	304 625.00	0.10
Total USD		5 931 583.50	1.96
変動利付債券合計		5 931 583.50	1.96
固定利付転換社債			
HKD			
HKD LINK CB LTD REG-S 4.50000% 22-12.12.27	24 000 000.00	3 147 730.93	1.04
Total HKD		3 147 730.93	1.04

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	評価額 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			
USD LG CHEM LTD-REG-S 1.25000% 23-18.07.28	3 200 000.00	3 122 784.00	1.03
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S (PIK) STEP UP 23-30.09.32	98 327.00	5 964.52	0.00
USD WYNN MACAU LTD-144A 4.50000% 23-07.03.29	1 500 000.00	1 589 437.50	0.53
Total USD		4 718 186.02	1.56
固定利付転換社債合計		7 865 916.95	2.60
転換社債、ゼロ・クーポン			
HKD			
HKD CITIGROUP GLOBAL MARKETS HOLDINGS-REG-S 0.00000% 23-26.02.26	4 000 000.00	490 891.54	0.16
Total HKD		490 891.54	0.16
USD			
USD MEITUAN-REG-S 0.00000% 21-27.04.28	3 200 000.00	3 016 384.00	0.99
USD XIAOMI BEST TIME INTER LTD-REG-S 0.00000% 20-17.12.27	3 000 000.00	2 958 750.00	0.98
Total USD		5 975 134.00	1.97
転換社債、ゼロ・クーポン合計		6 466 025.54	2.13
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		258 116 508.96	85.28
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
固定利付ノート			
USD			
USD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BK GROUP LTD 5.08800% 22-08.12.25	1 250 000.00	1 264 265.10	0.42
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 2.85000% 16-18.05.26	1 250 000.00	1 227 610.00	0.40
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK NEW YORK BRANCH 4.96600% 23-12.01.26	500 000.00	505 377.34	0.17
Total USD		2 997 252.44	0.99
固定利付ノート合計		2 997 252.44	0.99
固定利付ミディアム・ターム・ノート			
USD			
USD HDFC BANK LTD/GANDHINAGAR-REG-S 5.68600% 23-02.03.26	1 400 000.00	1 421 252.00	0.47
USD MANAPPURAM FINANCE LTD-REG-S 7.37500% 24-12.05.28	200 000.00	204 500.00	0.07
USD PIRAMAL CAPITAL & HOUSING FINANCE-REG-S 7.80000% 24-29.01.28	405 000.00	413 606.25	0.14
USD SHRIRAM FINANCE LTD-REG-S 6.15000% 24-03.04.28	585 000.00	585 087.75	0.19
Total USD		2 624 446.00	0.87
固定利付ミディアム・ターム・ノート合計		2 624 446.00	0.87
固定利付債券			
USD			
USD ADANI GREEN ENERGY UP LTD-REG-S 6.70000% 24-12.03.42	500 000.00	485 823.00	0.16
USD IRB INFRASTRUCTURE DEVELOPERS LTD-REG-S 7.11000% 24-11.03.32	200 000.00	208 250.00	0.07
Total USD		694 073.00	0.23
固定利付債券合計		694 073.00	0.23

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	評価額 米ドル 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注 1)	純資産 割合 (%)			
変動利付債券						
USD						
USD SCENTRE GROUP TRUST 2-REG-S-SUB 4.750%/VAR 20-24.09.80	262 000.00	260 093.48	0.08			
Total USD		260 093.48	0.08			
変動利付債券合計		260 093.48	0.08			
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		6 575 864.92	2.17			
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	1 370.00	12 411 780.78	4.10			
香港合計		12 411 780.78	4.10			
ルクセンブルグ						
USD UBS (LUX) BD SICAV-ASIAN INVEST GR BDS SUSTAIN (USD) U-X-ACC	1 100.00	14 392 895.00	4.76			
USD UBS (LUX) BOND SICAV - CHINA HIGH YIELD (USD) U-X-ACC	360.00	1 878 184.80	0.62			
ルクセンブルグ合計		16 271 079.80	5.38			
投資信託、オープン・エンド型合計		28 682 860.58	9.48			
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		28 682 860.58	9.48			
投資有価証券合計		293 375 234.46	96.93			
派生商品						
公認の証券取引所に上場されている派生商品						
債券に係る金融先物						
USD US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.12.24	-5.00	781.25	0.00			
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.12.24	-152.00	90 093.75	0.03			
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.12.24	112.00	-29 304.59	-0.01			
債券に係る金融先物合計		61 570.41	0.02			
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		61 570.41	0.02			
派生商品合計		61 570.41	0.02			
為替予約契約						
購入通貨	購入額	売却通貨	売却額	満期日		
GBP	95 302 600.00	USD	125 923 172.90	17.10.2024	1 909 602.13	0.63
SGD	7 337 600.00	USD	5 680 703.52	17.10.2024	47 388.92	0.01
EUR	29 288 600.00	USD	32 652 542.15	17.10.2024	56 394.52	0.02
USD	14 650 863.97	GBP	10 950 800.00	17.10.2024	-37 834.48	-0.01
SGD	391 300.00	USD	303 967.19	17.10.2024	1 500.89	0.00
GBP	1 446 600.00	USD	1 939 906.22	1.10.2024	490.69	0.00
USD	1 939 865.72	GBP	1 446 600.00	17.10.2024	-510.43	0.00
為替予約契約合計					1 977 032.24	0.65
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					5 546 020.80	1.83
その他の資産および負債					1 694 375.80	0.57
純資産合計					302 654 233.71	100.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S（Lux）ボンド・ファンド - ユーロ・ハイ・イールド（ユーロ）
2024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 (%)
株式			
イギリス			
EUR BARCLAYS BANK PLC 4.75%-FRN T1 PERP EUR10000	4 930 000.00	4 781 754.90	0.23
USD BARCLAYS BANK PLC ADR REP 1 PRF SHS SER 1	3 420 000.00	3 254 829.98	0.16
イギリス合計		8 036 584.88	0.39
株式合計		8 036 584.88	0.39
固定利付ノート			
EUR			
EUR ALLWYN ENTERTAINMENT FINANCING UK-REG-S 7.25000% 23-30.04.30	8 120 000.00	8 607 200.00	0.41
EUR ALTICE FINCO SA-REG-S 4.75000% 17-15.01.28	8 305 000.00	5 727 370.22	0.28
EUR ALTICE FRANCE SA-REG-S 5.87500% 18-01.02.27	18 885 000.00	14 795 000.01	0.71
EUR ALTICE FRANCE SA-REG-S 11.50000% 24-01.02.27	400 000.00	329 400.00	0.02
EUR AZELIS FINANCE NV-REG-S 4.75000% 24-25.09.29	5 145 000.00	5 232 722.25	0.25
EUR CARNIVAL CORP-REG-S 5.75000% 24-15.01.30	7 615 000.00	8 154 142.00	0.39
EUR CROWN EUROPEAN HOLDINGS SACA-REG-S 4.75000% 23-15.03.29	12 270 000.00	12 686 811.90	0.61
EUR DUFFRY ONE BV-REG-S 2.50000% 17-15.10.24	6 940 000.00	6 934 448.00	0.33
EUR EDREAMS ODIGEO SA-REG-S 5.50000% 22-15.07.27	14 470 000.00	14 535 115.00	0.70
EUR ELIOR GROUP SA-REG-S 3.75000% 21-15.07.26	5 540 000.00	5 481 830.00	0.26
EUR EP INFRASTRUCTURE AS-REG-S 1.69800% 19-30.07.26	6 000 000.00	5 739 240.00	0.28
EUR FIBER MIDCO SPA-REG-S (PIK) 10.00000% 24-15.06.29	6 505 000.00	6 685 058.40	0.32
EUR FORVIA SE-REG-S 3.75000% 20-15.06.28	11 870 000.00	11 398 594.82	0.55
EUR GRIFOLS SA-REG-S 1.62500% 19-15.02.25	15 410 000.00	6 224 627.27	0.30
EUR GRIFOLS SA-REG-S 3.87500% 21-15.10.28	7 660 000.00	7 119 357.20	0.34
EUR GRUPO ANTOLIN-IRAUSA SA-REG-S 10.37500% 24-30.01.30	2 620 000.00	2 410 400.00	0.12
EUR GTC AURORA LUXEMBOURG SA-REG-S 2.25000% 21-23.06.26	4 100 000.00	3 703 776.00	0.18
EUR IHO VERWALTUNGS GMBH-REG-S (PIK) 3.87500% 19-15.05.27	2 685 000.00	2 671 575.00	0.13
EUR ILIAD HOLDING SASU-REG-S 5.12500% 21-15.10.26	1 331 000.00	1 345 570.45	0.07
EUR ILIAD HOLDING SASU-REG-S 5.62500% 21-15.10.28	4 940 000.00	5 026 450.00	0.24
EUR ILIAD SA-REG-S 5.37500% 24-02.05.31	5 600 000.00	5 859 000.00	0.28
EUR INEOS QUATTRO FINANCE 1 PLC-REG-S 3.75000% 21-15.07.26	7 770 000.00	7 756 635.60	0.37
EUR INEOS QUATTRO FINANCE 2 PLC-REG-S 8.50000% 23-15.03.29	9 800 000.00	10 374 525.00	0.50
EUR KAIXO BONDCO TELECOM SA-REG-S 5.12500% 21-30.09.29	5 200 000.00	5 193 500.00	0.25
EUR LOXAM SAS-REG-S 3.75000% 19-15.07.26	7 355 000.00	7 336 612.50	0.35
EUR LOXAM SAS-REG-S-SUB 5.75000% 19-15.07.27	1 840 000.00	1 837 663.20	0.09
EUR MAHLE GMBH-REG-S 6.50000% 24-02.05.31	6 220 000.00	6 039 620.00	0.29
EUR MOTION BONDCO DAC-REG-S 4.50000% 19-15.11.27	2 343 000.00	2 151 366.03	0.10
EUR NIDDA HEALTHCARE HOLDING GMBH-REG-S 7.50000% 22-21.08.26	28 191 000.00	29 156 259.84	1.40
EUR OI EUROPEAN GROUP BV-REG-S 6.25000% 23-15.05.28	1 790 000.00	1 864 295.74	0.09
EUR OI EUROPEAN GROUP BV-REG-S 5.25000% 24-01.06.29	4 925 000.00	5 029 459.25	0.24
EUR OLYMPUS WATER US HOLDING CORP-REG-S 9.62500% 23-15.11.28	8 480 000.00	9 097 649.28	0.44
EUR ONTEX GROUP N.V-REG-S 3.50000% 21-15.07.26	16 410 000.00	16 263 951.00	0.78
EUR OPTICS BIDCO SPA-REG-S 6.87500% 24-15.02.28	7 998 000.00	8 697 825.00	0.42
EUR PERRIGO FINANCE UNLIMITED CO 5.37500% 24-30.09.32	4 835 000.00	4 919 612.50	0.24
EUR PICARD BONDCO SA-REG-S 5.37500% 21-01.07.27	6 380 000.00	6 301 079.40	0.30
EUR SOFTBANK GROUP CORP REG-S 3.87500% 21-06.07.32	5 640 000.00	5 180 712.24	0.25
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 3.12500% 17-19.09.25	2 340 000.00	2 302 608.17	0.11
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 4.00000% 17-19.09.29	1 650 000.00	1 590 765.00	0.08
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 5.00000% 18-15.04.28	11 475 000.00	11 586 575.25	0.56
EUR SUMMER BC HOLDCO A SARL-REG-S 9.25000% 19-31.10.27	2 930 000.00	2 633 484.00	0.13
EUR SUMMER BIDCO BV-REG-S (PIK)10.00000% 24-15.02.29	12 220 336.00	12 607 720.65	0.61

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 TELECOM ITALIA SPA/MILANO-REG-S 6.87500% 23-15.02.28	6 882 000.00	7 458 126.63	0.36
EUR TELECOM ITALIA SPA/MILANO-REG-S 7.87500% 23-31.07.28	8 838 000.00	9 984 712.82	0.48
EUR TEREOS FINANCE GROUPE I SA-REG-S 5.87500% 24-30.04.30	5 950 000.00	5 990 162.50	0.29
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 4.50000% 18-01.03.25	2 100 000.00	2 098 278.00	0.10
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FIN 6.00000% 20-31.01.25	5 000 000.00	4 999 150.00	0.24
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 3.75000% 21-09.05.27	9 229 000.00	9 144 831.52	0.44
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 4.37500% 21-09.05.30	5 630 000.00	5 597 571.20	0.27
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NETHERLANDS 7.87500% 23-15.09.31	4 450 000.00	5 267 687.50	0.25
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 7.37500% 23-15.09.29	24 815 000.00	27 854 837.50	1.34
EUR TITAN HOLDINGS II BV-REG-S 5.12500% 21-15.07.29	5 000 000.00	5 075 000.00	0.24
EUR TK ELEVATOR HOLDCO GMBH-REG-S 6.62500% 20-15.07.28	6 990 000.00	6 275 272.50	0.30
EUR TUI CRUISES GMBH-REG-S 6.50000% 21-15.05.26	11 799 000.00	10 823 822.67	0.52
EUR VERISURE HOLDING AB-REG-S 9.25000% 22-15.10.27	6 135 000.00	6 434 081.25	0.31
EUR ZIGGO BOND CO BV-REG-S 3.37500% 20-28.02.30	2 380 000.00	2 155 566.00	0.10
Total EUR		407 748 708.26	19.61
GBP			
GBP AA BOND CO LTD-REG-S 6.50000% 21-31.01.26	8 755 000.00	4 682 708.78	0.22
GBP BRACKEN MIDCO1 PLC-REG-S 6.75000% 21-01.11.27	13 050 000.00	15 161 440.82	0.73
GBP CPUK FINANCE LTD-REG-S 6.50000% 20-28.08.26	5 248 000.00	6 269 985.01	0.30
GBP JERROLD FINCO PLC-REG-S 7.87500% 24-15.04.30	9 110 000.00	11 173 242.09	0.54
GBP KIER GROUP PLC-REG-S 9.00000% 24-15.02.29	8 910 000.00	11 458 293.53	0.55
GBP OCADO GROUP PLC-REG-S 3.87500% 21-08.10.26	1 940 000.00	2 191 735.01	0.11
Total GBP		50 937 405.24	2.45
USD			
USD MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-144A 5.75000% 18-15.06.26	1 790 000.00	1 584 520.74	0.07
USD ONEMAIN FINANCE CORP 9.00000% 23-15.01.29	5 000 000.00	4 747 399.32	0.23
USD TRIVIUM PACKAGING FINANCE BV-144A 8.50000% 19-15.08.27	2 500 000.00	2 245 457.20	0.11
Total USD		8 577 377.26	0.41
固定利付ノート合計		467 263 490.76	22.47
変動利付ノート			
EUR			
EUR ABANCA CORP BANCARIA SA-REG-S-SUB COCO 6.000%/VAR 21-PRP	9 200 000.00	9 140 016.00	0.44
EUR ABANCA CORP BANCARIA SA-REG-S-SUB COCO 10.625%/VAR 23-PRP	4 600 000.00	5 226 750.00	0.25
EUR ABERTIS INFRA FINANCE BV-REG-S-SUB 3.248%/VAR 20-PRP	11 300 000.00	11 158 750.00	0.54
EUR ABN AMRO BANK NV-REG-S-SUB 6.875%/VAR 24-PRP	5 300 000.00	5 531 875.00	0.27
EUR ALPHA SERVICES AND HOLDINGS-REG-S-SUB 5.500%/VAR 21-11.06.31	5 590 000.00	5 635 502.60	0.27
EUR ALSTOM SA-REG-S-SUB 5.868%/VAR 24-PRP	4 200 000.00	4 335 492.00	0.21
EUR BANCA MONT DEI PAS DI SIENA-REG-S-SUB 8.000%/VAR 20-22.01.30	1 670 000.00	1 683 777.50	0.08
EUR BANCA MONTE DEI PASCHI DI-REG-S-SUB 8.520%/VAR 20-10.09.30	11 941 000.00	12 317 141.50	0.59
EUR BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENT-REG-S-SUB COCO 8.375%/VAR 23-PRP	6 400 000.00	6 979 520.00	0.34
EUR BANCO BPM SPA-REG-S-SUB COCO 9.500%/VAR 23-PRP	3 500 000.00	3 934 266.00	0.19
EUR BANCO BPM SPA-REG-S-SUB 5.000%/VAR 20-14.09.30	3 590 000.00	3 620 428.84	0.17
EUR BANCO COMERCIAL PORTUGUES-REG-S-SUB COCO 8.125%/VAR 24-PRP	3 000 000.00	3 151 125.00	0.15
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB COCO 5.750%/VAR 21-PRP	4 800 000.00	4 770 216.00	0.23
EUR BANCO SANTANDER SA-REG-S-SUB 7.000%/VAR 24-PRP	7 600 000.00	7 875 500.00	0.38
EUR BANK OF IRELAND GROUP PLC-REG-S-SUB COCO 6.000%/VAR 20-PRP	2 380 000.00	2 398 326.00	0.12
EUR BANKINTER SA-REG-S-SUB COCO 7.375%/VAR 23-PRP	5 000 000.00	5 244 500.00	0.25
EUR BAWAG GROUP AG-REG-S-SUB 7.250%/VAR 24-PRP	5 800 000.00	5 815 312.00	0.28
EUR BAYER AG-REG-S-SUB 5.375%/VAR 22-25.03.82	10 300 000.00	10 211 111.00	0.49

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 (%)
EUR BAYER AG-REG-S-SUB 7.000%/VAR 23-25.09.83	5 900 000.00	6 304 799.00	0.30
EUR BPER BANCA SPA-REG-S-SUB 8.375%/VAR 24-PRP	5 305 000.00	5 689 347.25	0.27
EUR CASTELLUM AB-REG-S 3.125%/VAR 21-PRP	12 610 000.00	12 055 160.00	0.58
EUR COMMERZBANK AG-REG-S-SUB COCO 6.125%/VAR 20-PRP	9 600 000.00	9 627 168.00	0.46
EUR CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S-SUB 4.875%/VAR 20-PRP	10 800 000.00	9 358 740.00	0.45
EUR DEUTSCHE BANK AG-REG-S-SUB 8.125%/VAR 24-PRP	3 800 000.00	3 956 750.00	0.19
EUR DEUTSCHE BANK AG-REG-S-SUB COCO 4.625%/VAR 21-PRP	5 200 000.00	4 690 504.00	0.23
EUR EESTI ENERGIA AS-REG-S-SUB 7.875%/VAR 24-PRP	7 920 000.00	8 217 000.00	0.39
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 3.375%/VAR 20-PRP	14 000 000.00	12 755 400.00	0.61
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 2.875%/VAR 20-PRP	6 400 000.00	6 170 048.00	0.30
EUR EUROFINS SCIENTIFIC SE-REG-S-SUB 6.750%/VAR 23-PRP	4 510 000.00	4 775 188.00	0.23
EUR FINECOBANK BANCA FINECO SPA-REG-S-SUB 7.500%/VAR 24-PRP	5 680 000.00	5 961 444.00	0.29
EUR HEIMSTADEN BOSTAD AB-REG-S-SUB 3.248%/VAR 19-PRP	11 880 000.00	10 870 200.00	0.52
EUR HEIMSTADEN BOSTAD AB-REG-S-SUB 3.000%/VAR 21-PRP	6 163 000.00	5 217 965.58	0.25
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB COCO 9.125%/VAR 23-PRP	4 385 000.00	4 971 493.75	0.24
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB COCO 7.000%/VAR 24-PRP	6 660 000.00	6 884 775.00	0.33
EUR KAPLA HOLDING SAS-REG-S 3M EURIBOR+350BP 24-31.07.30	3 640 000.00	3 653 904.80	0.18
EUR LA BANQUE POSTALE SA-REG-S-SUB COCO 3.000%/VAR 21-PRP	7 400 000.00	5 971 245.00	0.29
EUR NOVO BANCO SA-REG-S-SUB 9.875%/VAR 23-01.12.33	4 500 000.00	5 252 665.50	0.25
EUR PERMANENT TSB GROUP HOLD-REG-S-SUB COCO 7.875%/VAR 20-PRP	2 000 000.00	2 036 400.00	0.10
EUR PERMANENT TSB GRUP HOLDNGS-REG-S-SUB COCO 13.250%/VAR 22-PRP	2 110 000.00	2 500 350.00	0.12
EUR RAIFFEISEN BANK INTER-REG-S-SUB 7.375%/VAR 22-20.12.32	2 500 000.00	2 670 925.00	0.13
EUR RAIFFEISEN BANK INTL AG-REG-S-SUB 2.875%/VAR 20-18.06.32	2 200 000.00	2 087 855.00	0.10
EUR RAIFFEISEN BANK INTL AG-REG-S-SUB COCO 6.000%/VAR 20-PRP	3 400 000.00	3 289 500.00	0.16
EUR RAKUTEN GROUP INC-REG-S-SUB 4.250%/VAR 21-PRP	6 925 000.00	5 925 445.50	0.28
EUR TEAMSYSTEM SPA-REG-S 3M EURIBOR+350BP 24-31.07.31	9 775 000.00	9 817 403.95	0.47
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 2.376%/VAR 21-PRP	2 700 000.00	2 466 990.00	0.12
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 6.135%/VAR 23-PRP	4 900 000.00	5 233 322.50	0.25
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 5.752%/VAR 24-PRP	8 700 000.00	9 109 857.00	0.44
EUR UNICAJA BANCO SA-REG-S-SUB COCO 4.875%/VAR 21-PRP	7 000 000.00	6 599 810.00	0.32
EUR VAR ENERGI ASA-REG-S-SUB 7.862%/VAR 23-15.11.83	6 360 000.00	6 980 100.00	0.34
EUR VODAFONE GROUP PLC-REG-S-SUB 3.000%/VAR 20-27.08.80	4 530 000.00	4 220 986.05	0.20
Total EUR		304 352 352.32	14.64
GBP			
GBP CO-OPRATIVE BNK HOLDNGS LTD/THE-REG-S 9.000%/VAR 20-27.11.25	12 090 000.00	14 618 696.34	0.71
GBP COVENTRY BUILDING SOCIETY-REG-S-SUB 8.750%/VAR 24-PRP	3 705 000.00	4 599 885.23	0.22
GBP MOBICO GROUP PLC-REG-S-SUB 4.250%/VAR 20-PRP	6 460 000.00	7 049 024.11	0.34
GBP ROTHESAY LIFE PLC-REG-S-SUB 5.000%/VAR 21-PRP	1 965 000.00	1 923 304.80	0.09
Total GBP		28 190 910.48	1.36
USD			
USD ROTHESAY LIFE PLC-REG-S-SUB 4.875%/VAR 21-PRP	8 338 000.00	6 919 169.08	0.33
USD SOCIETE GENERALE SA-REG-S-SUB COCO 4.750%/VAR 21-PRP	6 290 000.00	5 277 579.69	0.25
USD SOCIETE GENERALE SA-REG-S-SUB COCO 9.375%/VAR 22-PRP	3 870 000.00	3 642 845.34	0.18
USD UBS GROUP AG-REG-S-SUB 6.850%/VAR 24-PRP	5 990 000.00	5 431 049.62	0.26
Total USD		21 270 643.73	1.02
変動利付ノート合計		353 813 906.53	17.02
固定利付ミディアム・ターム・ノート			
EUR			
EUR AIR FRANCE-KLM-REG-S 4.62500% 24-23.05.29	6 200 000.00	6 300 750.00	0.30
EUR CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S STEP UP 19-23.04.27	4 010 000.00	3 747 946.50	0.18
EUR CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S 2.75000% 20-12.05.26	1 500 000.00	1 440 945.00	0.07
EUR CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S 1.75000% 22-14.01.30	1 900 000.00	1 520 475.00	0.07
EUR CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S 7.00000% 24-07.05.29	6 960 000.00	7 174 785.60	0.34
EUR CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S 6.00000% 24-27.01.32	5 360 000.00	5 165 700.00	0.25
EUR ILLIMITY BANK SPA-REG-S 5.75000% 24-31.05.27	9 685 000.00	9 953 274.50	0.48
EUR LOXAM SAS-REG-S 6.37500% 23-15.05.28	8 655 000.00	8 990 381.25	0.43
EUR MAHLE GMBH-REG-S 2.37500% 21-14.05.28	2 100 000.00	1 817 029.20	0.09
EUR NOVO BANCO SA/LUXEMBOURG 3.50000% 13-02.01.43	3 710 000.00	3 363 100.16	0.16

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	評価額 ユーロ 先物 / 為替予約契約 / スワップに係る 未実現損益 (注1)	純資産 割合 (%)
EUR SCHAEFFLER AG-REG-S 4.75000% 24-14.08.29	1 300 000.00	1 306 110.00	0.06
EUR TELECOM ITALIA SPA-REG-S 3.00000% 16-30.09.25	3 765 000.00	3 741 122.37	0.18
EUR TELECOM ITALIA SPA-REG-S 2.75000% 19-15.04.25	10 000 000.00	9 940 000.00	0.48
EUR ZF EUROPE FINANCE BV-REG-S 6.12500% 23-13.03.29	13 000 000.00	13 248 625.00	0.64
EUR ZF FINANCE GMBH-REG-S 3.75000% 20-21.09.28	6 400 000.00	6 017 830.40	0.29
Total EUR		90 857 666.01	4.37
固定利付ミディアム・ターム・ノート合計		90 857 666.01	4.37
変動利付ミディアム・ターム・ノート			
EUR			
EUR ABANCA CORP BANCARIA SA-REG-S-SUB 8.375%/VAR 23-23.09.33	1 600 000.00	1 808 320.00	0.09
EUR AIB GROUP PLC-REG-S-SUB 4.625%/VAR 24-20.05.35	3 250 000.00	3 326 908.00	0.16
EUR ALPHA BANK SA-REG-S 5.000%/VAR 24-12.05.30	1 835 000.00	1 906 278.74	0.09
EUR AROUNDTOWN SA-REG-S-SUB 1.625%/VAR 21-PRP	3 000 000.00	2 466 600.00	0.12
EUR AXA SA-REG-S-SUB 6.375%/VAR 24-PRP	3 775 000.00	3 945 965.97	0.19
EUR AXA SA-SUB 6.00000%/EUSA10+5BP 04-PRP	4 070 000.00	3 785 100.00	0.18
EUR AXA SA-SUB CMS10+20BP 03-PRP	2 380 000.00	2 218 160.00	0.11
EUR BANCA MONT DEI PAS DI SIENA-REG-S-SUB 5.375%/VAR 18-18.01.28	4 500 000.00	4 899 690.00	0.24
EUR BANCO COMERCIAL PORTUGUES SA-SUB 8.750%/VAR 22-05.03.33	2 200 000.00	2 455 750.00	0.12
EUR BANCO COMERCIAL PORTUGUES-REG-S-SUB 3.871%/VAR 19-27.03.30	2 700 000.00	2 684 610.00	0.13
EUR BANCO DE CREDITO SOC COOP-REG-S-SUB 5.250%/VAR 21-27.11.31	9 600 000.00	9 600 000.00	0.46
EUR BANCO DE CREDITO SOCIAL CO SA-REG-S 7.500%/VAR 23-14.09.29	9 800 000.00	11 155 585.00	0.54
EUR BANCO DE CREDITO SOC CP SA-REG-S 4.125%/VAR 24-03.09.30	3 700 000.00	3 748 433.00	0.18
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 6.000%/VAR 23-16.08.33	3 200 000.00	3 423 302.40	0.16
EUR BANCO SANTANDER SA-REG-S-SUB 5.750%/VAR 23-23.08.33	2 600 000.00	2 769 660.40	0.13
EUR BANK OF CYPRUS PCL-REG-S 7.375%/VAR 23-25.07.28	3 295 000.00	3 591 550.00	0.17
EUR BANK OF IRELAND GROUP PLC-REG-S-SUB 6.750%/VAR 22-01.03.33	2 105 000.00	2 290 408.40	0.11
EUR COMMERZBANK AG-REG-S-SUB 6.750%/VAR 23-05.10.33	7 900 000.00	8 649 085.90	0.42
EUR COMMERZBANK AG-REG-S-SUB 4.000%/VAR 20-05.12.30	3 100 000.00	3 096 881.40	0.15
EUR COMMERZBANK AG-REG-S-SUB 4.875%/VAR 24-16.10.34	4 400 000.00	4 533 072.72	0.22
EUR EDP - ENERGIAS DE PORT SA-REG-S-SUB 5.943%/VAR 23- 23.04.83	13 300 000.00	14 006 602.40	0.67
EUR EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL-REG-S-SUB 4.750%/VAR 24-29.05.54	6 300 000.00	6 372 450.00	0.31
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 5.000%/VAR 14-PRP	200 000.00	201 500.00	0.01
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 7.500%/VAR 22-PRP	3 400 000.00	3 731 840.00	0.18
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 5.625%/VAR 24-PRP	3 200 000.00	3 243 440.00	0.16
EUR ENEL SPA-REG-S-SUB 6.375%/VAR 23-PRP	3 840 000.00	4 105 804.80	0.20
EUR ERBK ERS SRVS AND HLGS SA-REG-S-SUB 6.250%/VAR 24-25.04.34	4 170 000.00	4 383 712.50	0.21
EUR EUROBANK SA-REG-S 4.875%/VAR 24-30.04.31	5 270 000.00	5 502 617.80	0.26
EUR EUROBANK SA-REG-S 4.000%/VAR 24-24.09.30	3 790 000.00	3 813 892.16	0.18
EUR HEIMSTADEN BOSTAD AB-REG-S-SUB 3.625%/VAR 21-PRP	8 150 000.00	7 179 009.00	0.34
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB COCO 5.875%/VAR 20-PRP	4 050 000.00	4 055 062.50	0.19
EUR MEDIUMBANCA BANCA DI CREDITO-REG-S-SUB 5.250%/VAR 24-22.04.34	5 565 000.00	5 880 268.38	0.28
EUR NATIONAL BANK OF GREECE SA-REG-S-SUB 8.000%/VAR 23-03.01.34	1 675 000.00	1 874 090.50	0.09
EUR NATIONAL BANK OF GREECE SA-REG-S-SUB 5.875%/VAR 24-28.06.35	2 760 000.00	2 874 352.32	0.14
EUR NOVA LJUBLJANSKA BANKA DD-REG-S-SUB 6.875%/VAR 24-24.01.34	4 500 000.00	4 781 250.00	0.23
EUR PIRAEUS BANK SA-REG-S 6.750%/VAR 23-05.12.29	2 243 000.00	2 484 795.40	0.12
EUR PIRAEUS FIN HOLD SA-REG-S-SUB 5.375%/VAR 24-18.09.35	2 570 000.00	2 568 715.00	0.12
EUR PIRAEUS FINANCIAL HOLDING-REG-S-SUB 7.250%/VAR 24-17.04.34	7 375 000.00	7 956 150.00	0.38
EUR RAIFFEISEN BANK INT AG-REG-S-SUB 5.250%/VAR 24-02.01.35	8 000 000.00	8 036 944.00	0.39
EUR UNICAJA BANCO SA-REG-S 6.500%/VAR 23-11.09.28	3 200 000.00	3 454 297.60	0.17

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	評価額 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 UNICREDIT SPA-REG-S-SUB 5.375%/VAR 24-16.04.34	2 360 000.00	2 474 566.20	0.12
EUR UNICREDIT SPA-REG-S-SUB COCO 4.450%/VAR 21-PRP	2 700 000.00	2 575 125.00	0.12
EUR VODAFONE GROUP PLC-REG-S-SUB 6.500%/VAR 23-30.08.84	4 120 000.00	4 532 000.00	0.22
Total EUR		188 443 847.49	9.06

変動利付メディアム・ターム・ノート合計 188 443 847.49 9.06

固定利付債券

EUR			
EUR 888 ACQUISITIONS LTD-REG-S 7.5580% 22-15.07.27	3 170 000.00	3 105 411.25	0.15
EUR ACCORINVEST GROUP SA-REG-S 6.37500% 24-15.10.29	7 750 000.00	8 022 735.68	0.39
EUR ADLER FINANCING SARL (PIK) 12.50000% 24-31.12.28	6 290 000.00	6 547 890.00	0.31
EUR AFFLELOU SAS-REG-S 6.00000% 24-25.07.29	6 430 000.00	6 609 075.50	0.32
EUR AIR BALTIC CORP AS-REG-S 14.50000% 24-14.08.29	4 605 000.00	5 192 137.50	0.25
EUR ALTICE FINANCING SA-REG-S 3.00000% 20-15.01.28	23 380 000.00	19 113 150.00	0.92
EUR ALTICE FRANCE SA-REG-S 4.00000% 21-15.07.29	6 730 000.00	4 711 000.00	0.23
EUR AMBER FINCO PLC-REG-S 6.62500% 24-15.07.29	4 735 000.00	4 953 993.75	0.24
EUR APCOA GROUP GMBH-REG-S 6.00000% 24-15.04.31	9 685 000.00	9 648 681.25	0.46
EUR ARDAGH METAL PACKAGING FIN PLC-REG-S 2.00000% 21-01.09.28	4 070 000.00	3 696 374.00	0.18
EUR ARDONAGH FINCO LTD-REG-S 6.87500% 24-15.02.31	8 845 000.00	8 966 618.75	0.43
EUR BANIJAY ENTERTAINMENT SAS-REG-S 7.00000% 23-01.05.29	2 500 000.00	2 628 125.00	0.13
EUR BANIJAY SAS-REG-S 6.50000% 20-01.03.26	7 280 000.00	7 294 996.80	0.35
EUR BERTRAND FRANCHISE FINANCE SAS-REG-S 6.50000% 24-18.07.30	1 855 000.00	1 920 852.50	0.09
EUR CAB SELAS-REG-S 3.37500% 21-01.02.28	4 195 000.00	3 878 529.20	0.19
EUR CANARY WHARF GROUP INVST HOLG PLC-REG-S 1.75000% 21-07.04.26	2 480 000.00	2 297 141.29	0.11
EUR CERVED GROUP SPA-REG-S 6.00000% 22-15.02.29	2 815 000.00	2 615 191.30	0.13
EUR CIDRON AIDA FINCO SARL-REG-S 5.00000% 21-01.04.28	755 000.00	733 369.25	0.03
EUR CIRSA FINANCE INTERNATIONAL SARL-REG-S 10.37500% 22-30.11.27	6 260 000.00	5 962 039.65	0.29
EUR CIRSA FINANCE INTERNATIONAL SARL-REG-S 7.87500% 23-31.07.28	5 810 000.00	6 164 991.00	0.30
EUR CIRSA FINANCE INTERNATIONAL SARL-REG-S 6.50000% 24-15.03.29	5 280 000.00	5 528 740.80	0.27
EUR CROWN EUROPEAN HOLDINGS SACA-REG-S 4.50000% 24-15.01.30	10 845 000.00	11 090 313.90	0.53
EUR CT INVESTMENT GMBH-REG-S 6.37500% 24-15.04.30	4 395 000.00	4 493 887.50	0.22
EUR DUFY ONE BV-REG-S 3.37500% 21-15.04.28	4 175 000.00	4 126 152.50	0.20
EUR EIRCOM FINANCE DAC-REG-S 5.75000% 24-15.12.29	9 120 000.00	9 402 720.00	0.45
EUR EOLO SPA-REG-S 4.87500% 21-21.10.28	5 310 000.00	4 918 960.98	0.24
EUR EP INFRASTRUCTURE AS-REG-S 2.04500% 19-09.10.28	1 240 000.00	1 134 042.00	0.05
EUR EP INFRASTRUCTURE AS-REG-S 1.81600% 21-02.03.31	3 130 000.00	2 685 477.40	0.13
EUR FIBER BIDCO SPA-REG-S 6.12500% 24-15.06.31	7 090 000.00	7 054 550.00	0.34
EUR GOLDSTORY SAS-REG-S 6.75000% 24-01.02.30	4 500 000.00	4 603 140.00	0.22
EUR GRUPO ANTOLIN-IRAUSA SA-REG-S 3.50000% 21-30.04.28	4 084 000.00	3 067 043.16	0.15
EUR IHO VERWALTUNGS GMBH-REG-S (PIK) 3.75000% 16-15.09.26	2 620 000.00	2 612 795.00	0.12
EUR IHO VERWALTUNGS GMBH-REG-S (PIK) 8.75000% 23-15.05.28	11 210 000.00	11 773 638.80	0.57
EUR INEOS FINANCE PLC-REG-S 2.12500% 17-15.11.25	7 115 000.00	7 026 062.50	0.34
EUR INEOS FINANCE PLC-REG-S 6.62500% 23-15.05.28	2 470 000.00	2 558 944.70	0.12
EUR IPD 3 BV-REG-S 8.00000% 23-15.06.28	5 900 000.00	6 252 230.00	0.30
EUR KAPLA HOLDING SAS-REG-S 3.37500% 19-15.12.26	5 290 000.00	5 250 325.00	0.25
EUR LHMC FINCO 2 SARL-REG-S (PIK) 7.25000% 19-02.10.25	30 175 252.00	18 260 772.67	0.88
EUR LORCA TELECOM BONDCO SAU-REG-S 4.00000% 20-18.09.27	12 740 000.00	12 658 846.20	0.61
EUR LOTTOMATICA SPA/ROMA-REG-S 7.12500% 23-01.06.28	5 880 000.00	6 188 755.86	0.30
EUR LOXAM SAS-REG-S 6.37500% 23-31.05.29	6 720 000.00	7 022 400.00	0.34
EUR MARCOLIN SPA-REG-S 6.12500% 21-15.11.26	9 974 000.00	9 998 935.00	0.48
EUR MOBILUX FINANCE SAS-REG-S 7.00000% 24-15.05.30	5 585 000.00	5 672 265.62	0.27
EUR MOTION FINCO SARL-REG-S 7.37500% 23-15.06.30	6 610 000.00	6 688 328.50	0.32
EUR NEOPHARMED GENTILI SPA-REG-S 7.12500% 24-08.04.30	10 160 000.00	10 556 138.40	0.51
EUR NIDDA HEALTHCARE HOLDING GMBH-REG-S 7.00000% 24-21.02.30	6 530 000.00	6 807 525.00	0.33
EUR PAPREC HOLDING SA-REG-S 6.50000% 23-17.11.27	2 875 000.00	3 044 050.00	0.15
EUR PAPREC HOLDING SA-REG-S 7.25000% 23-17.11.29	5 785 000.00	6 145 405.50	0.29
EUR PICARD GROUPE SAS-REG-S 6.37500% 24-01.07.29	5 025 000.00	5 172 986.25	0.25
EUR PINNACLE BIDCO PLC-REG-S 8.25000% 23-11.10.28	15 445 000.00	16 367 838.75	0.79

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 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 RAY FINANCING LLC-REG-S 6.50000% 24-15.07.31	9 305 000.00	9 560 887.50	0.46
EUR ROSSINI SARL-REG-S 6.75000% 24-31.12.29	7 980 000.00	8 390 970.00	0.40
EUR SUMMER BC HOLDCO B SARL-REG-S 5.75000% 19-31.10.26	13 035 000.00	13 034 999.99	0.63
EUR TRIVIMUM PACKAGING FINANCE BV-REG-S 3.75000% 19-15.08.26	13 594 000.00	13 539 624.00	0.65
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 4.62500% 21-15.08.28	1 420 000.00	1 398 700.00	0.07
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 4.00000% 20-15.11.27	4 150 000.00	4 051 645.00	0.19
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 3.12500% 20-15.02.26	1 620 000.00	1 598 138.10	0.08
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 5.25000% 22-01.02.30	1 400 000.00	1 372 000.00	0.07
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 6.75000% 24-15.02.31	3 520 000.00	3 652 000.00	0.17
EUR VERISURE HOLDING AB-REG-S 3.87500% 20-15.07.26	7 190 000.00	7 154 050.00	0.34
EUR VERTICAL MIDCO GMBH-REG-S 4.37500% 20-15.07.27	2 620 000.00	2 598 149.20	0.12
EUR VZ SECURED FINANCING BV-REG-S 3.50000% 22-15.01.32	2 590 000.00	2 387 280.70	0.11
EUR VZ VENDOR FINANCING II BV-REG-S 2.87500% 20-15.01.29	8 330 000.00	7 695 562.21	0.37
Total EUR		398 659 582.36	19.18
GBP			
GBP ASTON MARTIN CAP HOLDINGS LTD-REG-S 10.37500% 24-31.03.29	7 165 000.00	8 572 235.78	0.41
GBP CANARY WHARF GROUP INVESTMENT HOL-REG-S 2.62500% 21-23.04.25	5 430 000.00	6 379 322.85	0.31
GBP CANARY WHARF GRP INVEST HOLD-REG-S 3.37500% 21-23.04.28	472 000.00	468 062.99	0.02
GBP CIDRON AIDA FINCO SARL-REG-S 6.25000% 21-01.04.28	3 815 000.00	4 352 448.19	0.21
GBP CPUK FINANCE LTD-REG-S 7.87500% 24-28.08.29	2 570 000.00	3 163 330.38	0.15
GBP GALAXY BIDCO LTD-REG-S 6.50000% 19-31.07.26	3 870 000.00	4 616 362.90	0.22
GBP GALAXY FINCO LTD-REG-S STEP UP/DOWN 19-31.07.27	10 464 000.00	12 427 050.98	0.60
GBP ICELAND BONDCO PLC-REG-S 4.62500% 17-15.03.25	4 855 000.00	2 330 535.68	0.11
GBP ICELAND BONDCO PLC-REG-S 10.87500% 23-15.12.27	4 360 000.00	5 633 177.24	0.27
GBP JERROLD FINCO PLC-REG-S 5.25000% 21-15.01.27	7 705 000.00	9 109 947.00	0.44
GBP MAISON FINCO PLC-REG-S 6.00000% 21-31.10.27	9 325 000.00	10 815 537.73	0.52
GBP MILLER HOMES GROUP FINCO PLC-REG-S 7.00000% 22-15.05.29	4 220 000.00	4 932 425.36	0.24
GBP OCADO GROUP PLC-REG-S 10.50000% 24-08.08.29	5 190 000.00	6 159 997.21	0.29
GBP PINNACLE BIDCO PLC-REG-S 10.00000% 23-11.10.28	10 500 000.00	13 455 715.77	0.65
GBP TVL FINANCE PLC-REG-S 10.25000% 23-28.04.28	11 050 000.00	13 911 525.99	0.67
GBP VIRGIN MEDIA VENDOR FINANCING-REG-S 4.87500% 20-15.07.28	14 185 000.00	15 750 315.77	0.76
Total GBP		122 077 991.82	5.87
固定利付債券合計		520 737 574.18	25.05

変動利付債券

EUR			
EUR 888 ACQUISITIONS LTD-REG-S 3M EURIBOR+550BP 22-15.07.28	1 200 000.00	1 168 500.00	0.06
EUR AIB GROUP PLC-REG-S-SUB COCO 5.250%/VAR 19-PRP	8 030 000.00	8 034 985.83	0.39
EUR AIB GROUP PLC-REG-S-SUB COCO 7.125%/VAR 24-PRP	6 045 000.00	6 302 214.75	0.30
EUR AROUNDTOWN FINANCE SARL-SUB 5.000%/VAR 24-PRP	9 125 000.00	7 733 364.50	0.37
EUR AROUNDTOWN FINANCE SARL-SUB 7.125%/VAR 24-PRP	9 180 000.00	8 537 400.00	0.41
EUR AROUNDTOWN FINANCE SARL-SUB 7.125%/VAR 24-PRP	3 753 000.00	3 490 290.00	0.17
EUR AROUNDTOWN SA-REG-S-SUB 3.375%/VAR 19-PRP	1 200 000.00	984 000.00	0.05
EUR BANCO BPM SPA-REG-S-SUB 4.250%/VAR 19-01.10.29	2 690 000.00	2 690 000.00	0.13
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB COCO 5.000%/VAR 21-PRP	2 200 000.00	2 114 750.00	0.10
EUR BANCO SANTANDER SA-REG-S-SUB COCO 4.375%/VAR 20-PRP	2 400 000.00	2 337 000.00	0.11
EUR BELFIUS BANK SA-REG-S-SUB COCO 3.625%/VAR 18-PRP	5 200 000.00	5 102 708.00	0.25
EUR BERTRAND FRANCHIS FIN SAS-REG-S 3M EURIBOR+375BP 24-18.07.30	4 395 000.00	4 426 314.37	0.21
EUR CERVED GROUP SPA-REG-S 3M EURIBOR+525BP 22-15.02.29	4 788 000.00	4 660 639.20	0.22
EUR CHEPLAPARM ARZTEL GMBH-REG-S 3M EURIBOR+475BP 23-15.05.30	5 000 000.00	5 054 800.00	0.24
EUR CIRSIA FINANCE INTERNA-REG-S 3M EURIBOR+450BP 23-31.07.28	6 770 000.00	6 837 970.80	0.33
EUR CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S-SUB 4.875%/VAR 19-PRP	19 462 000.00	17 200 710.22	0.83
EUR DUOMO BIDCO SPA-REG-S 3M EUR00+412.5BP 24-15.07.31	7 250 000.00	7 318 875.00	0.35
EUR GOLDEN GOOSE SPA-REG-S 3M EURIBOR+487.5BP 21-14.05.27	14 935 000.00	15 047 012.50	0.72

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 GRAND CITY PROPERTIES FINANCE SARL-SUB 6.125%/VAR 24-PRP	10 614 000.00	10 003 695.00	0.48
EUR HEIMSTADEN BOSTAD AB-REG-S-SUB 3.375%/VAR 20-PRP	4 250 000.00	3 803 750.00	0.18
EUR HEIMSTADEN BOSTAD AB-REG-S-SUB 2.625%/VAR 21-PRP	5 600 000.00	4 796 881.60	0.23
EUR ICELAND BONDCO PLC-REG-S 3M EURIBOR+550BP 23-15.12.27	8 025 000.00	8 165 437.50	0.39
EUR IPD 3 BV-REG-S 3M EURIBOR+337.5BP 24-15.06.31	4 765 000.00	4 775 220.93	0.23
EUR LA DORIA SPA-REG-S 3M EURIBOR+450BP 24-12.11.29	5 590 000.00	5 668 260.00	0.27
EUR LOTTOMATICA SPA/ROMA-REG-S 3M EURIBOR+325BP 24-01.06.31	3 580 000.00	3 607 034.37	0.17
EUR MILLER HOMES GRP FIN PLC-REG-S 3M EURIBOR+525BP 22-15.05.28	6 630 000.00	6 712 875.00	0.32
EUR MOONEY GROUP SPA-REG-S 3M EURIBOR+387.5BP 19-17.12.26	7 110 000.00	7 093 291.50	0.34
EUR PLT VII FINANCE SARL-REG-S 3M EURIBOR+350BP 24-15.06.31	8 830 000.00	8 854 724.00	0.43
EUR RAIFFEISEN BANK INTL AG-REG-S-SUB COCO 6.125%/VAR 17-PRP	7 000 000.00	6 972 129.50	0.34
EUR ROSSINI SARL-REG-S 3M EURIBOR+387.5BP 24-31.12.29	5 370 000.00	5 415 779.25	0.26
EUR STONEGATE PUB CO FIN-REG-S 3M EURIBOR+662.50BP 24-31.07.29	4 900 000.00	4 999 225.00	0.24
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 3.875%/VAR 18-PRP	7 000 000.00	6 968 892.00	0.34
EUR TRIVIMUM PACKAGING FIN BV-REG-S 3M EURIBOR+375BP 19-15.08.26	2 950 000.00	2 957 375.00	0.14
EUR TVL FINANCE PLC-REG-S 3M EURIBOR+375BP 24-30.06.30	10 985 000.00	10 936 249.23	0.53
EUR UNICREDIT SPA-REG-S-SUB COCO 5.375%/VAR 17-PRP	7 500 000.00	7 472 587.50	0.36
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 3M EURIBOR+425BP 24-15.02.31	8 560 000.00	8 554 650.00	0.41
EUR VIVAT NV-REG-S-SUB 7.000%/VAR 18-PRP	5 920 000.00	5 982 515.20	0.29
Total EUR		232 782 107.75	11.19
GBP			
GBP AROUNDTOWN FINANCE SARL-SUB 8.625%/VAR 24-PRP	1 260 000.00	1 423 467.71	0.07
GBP BARCLAYS PLC-SUB COCO 7.125%/VAR 19-PRP	15 340 000.00	18 439 602.98	0.89
Total GBP		19 863 070.69	0.96
USD			
USD AROUNDTOWN FINANCE SARL-SUB 7.875%/VAR 24-PRP	2 050 000.00	1 630 081.09	0.08
Total USD		1 630 081.09	0.08
変動利付債券合計		254 275 259.53	12.23
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		1 883 428 329.38	90.59
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			
変動利付メディアム・ターム・ノート			
USD			
USD INTESA SANPAOLO SPA-144A-SUB 7.700%/VAR 15-PRP	1 615 000.00	1 445 303.06	0.07
Total USD		1 445 303.06	0.07
変動利付メディアム・ターム・ノート合計		1 445 303.06	0.07
固定利付債券			
EUR			
EUR PANTHER BF AGGR 2/PANTHER FIN CO-REG-S 4.37500% 19-15.05.26	5 000 000.00	4 983 250.00	0.24
Total EUR		4 983 250.00	0.24
GBP			
GBP MARKET BIDCO FINCO PLC-REG-S 5.50000% 22-04.11.27	8 960 000.00	10 151 028.16	0.49
Total GBP		10 151 028.16	0.49

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 (%)
USD			
USD CLOUD SOFTWARE GROUP INC-144A 9.00000% 23-30.09.29	16 610 000.00	15 144 935.34	0.73
Total USD		15 144 935.34	0.73
固定利付債券合計		30 279 213.50	1.46
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		31 724 516.56	1.53
他の譲渡性のある有価証券			
固定利付債券			
EUR			
EUR DYNAMO NEWCO II GMBH-REG-S 6.25000% 24-15.10.31	8 400 000.00	8 452 500.00	0.41
Total EUR		8 452 500.00	0.41
固定利付債券合計		8 452 500.00	0.41
他の譲渡性のある有価証券合計		8 452 500.00	0.41
2010年12月17日のルクセンブルグ投信法（改訂済）第41条(1)e)に準拠した投資信託 / その他の投資信託			
投資信託、オープン・エンド型			
アイルランド			
EUR UBS (IRL) SELECT MONEY MARKET FUND-EUR-S-DIST	10.85	108 500.00	0.00
アイルランド合計		108 500.00	0.00
ルクセンブルグ			
EUR UBS (LUX) KEY SEL SICAV-EUR FINCI DEBT SUST (EUR) I-X-ACC	1 642.00	19 072 585.32	0.92
ルクセンブルグ合計		19 072 585.32	0.92
投資信託、オープン・エンド型合計		19 181 085.32	0.92
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			
投資有価証券合計		1 942 786 431.26	93.45
派生商品			
公認の証券取引所に上場されている派生商品			
債券に係る金融先物			
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.12.24	1 938.00	296 779.44	0.02
債券に係る金融先物合計		296 779.44	0.02
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		296 779.44	0.02

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 (%)
----	---------	---	------------------

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

クレジット・デフォルト・スワップ *

EUR	CITI/ALGSCO CREDIT DEFAULT SWAP REC 5.00000% 22-20.12.26	2 000 000.00	197 216.18	0.01
EUR	CITI/ALGSCO CREDIT DEFAULT SWAP REC 5.00000% 21-20.12.26	3 000 000.00	295 824.27	0.01
EUR	JPMORGAN/UNITED GROUP BV CREDIT DEFAULT SWAP REC 5.00000% 22-20.12.27	4 500 000.00	360 016.60	0.02
EUR	JPMORGAN/UNITED GROUP BV CREDIT DEFAULT SWAP REC 5.00000% 22-20.12.25	5 000 000.00	249 635.94	0.01
クレジット・デフォルト・スワップ合計			1 102 692.99	0.05

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

派生商品合計 1 102 692.99 0.05

派生商品合計 1 399 472.43 0.07

為替予約契約

購入通貨	購入額	売却通貨	売却額	満期日		
AUD	53 409 100.00	EUR	32 650 859.17	22.10.2024	532 489.91	0.03
CAD	21 375 400.00	EUR	14 127 414.67	22.10.2024	44 593.34	0.00
CHF	30 962 000.00	EUR	32 846 721.91	22.10.2024	87 814.73	0.00
SGD	40 490 100.00	EUR	28 092 042.32	22.10.2024	212 190.25	0.01
HKD	211 967 400.00	EUR	24 343 701.40	22.10.2024	93 748.78	0.00
EUR	240 349 940.11	GBP	202 445 000.00	22.10.2024	-2 765 947.98	-0.13
GBP	18 554 000.00	EUR	22 027 971.99	22.10.2024	253 497.98	0.01
JPY	23 550 050 700.00	EUR	147 858 586.59	22.10.2024	-55 943.32	0.00
EUR	52 145 170.80	USD	58 330 000.00	22.10.2024	-77 828.52	0.00
USD	330 098 800.00	EUR	295 097 862.26	22.10.2024	440 444.08	0.02
CNH	75 579 200.00	EUR	9 590 473.08	22.10.2024	93 190.43	0.00
EUR	5 071 532.93	HKD	44 096 000.00	22.10.2024	-12 238.46	0.00
EUR	476 662.47	AUD	781 900.00	22.10.2024	-9 136.03	0.00
HKD	2 315 900.00	EUR	266 030.18	22.10.2024	966.97	0.00
GBP	220 000.00	EUR	263 660.96	22.10.2024	536.70	0.00
EUR	224 028.56	HKD	1 941 500.00	22.10.2024	195.51	0.00
USD	21 759 900.00	EUR	19 496 858.67	22.10.2024	-15 164.12	0.00
SGD	424 200.00	EUR	295 959.13	22.10.2024	573.98	0.00
CAD	245 100.00	EUR	162 744.25	22.10.2024	-241.60	0.00
為替予約契約合計					-1 176 257.37	-0.06

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 129 799 487.01 6.24

当座借越およびその他の短期負債 -2.92 0.00

その他の資産および負債 6 159 673.67 0.30

純資産合計 2 078 968 804.08 100.00

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

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	30.9.2024	31.3.2024	31.3.2023
純資産額、オーストラリア・ドル		398,799,084.30	259,236,128.84	330,529,881.20
クラス P - a c c 受益証券	LU0035338325			
発行済受益証券		176,697.3250	188,463.5010	290,447.5070
受益証券 1 口当たりの純資産価格、 オーストラリア・ドル		535.85	525.06	517.55
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		535.53	525.06	517.55
クラス P - d i s t 受益証券	LU0035338242			
発行済受益証券		456,417.0560	480,485.3200	537,911.5800
受益証券 1 口当たりの純資産価格、 オーストラリア・ドル		106.47	106.78	107.32
受益証券 1 口当たり発行および買戻価格、 オーストラリア・ドル ¹		106.41	106.78	107.32

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	83.10	公益、非営利団体	23.28
国際機関	3.78	金融および持株会社	20.98
アメリカ合衆国	3.61	銀行およびその他の金融機関	18.63
カナダ	2.13	国債および中央政府債	14.35
韓国	1.56	その他の非分類会社	3.83
イギリス	0.95	地方債	3.61
シンガポール	0.92	国際機関	3.19
スウェーデン	0.83	通信	2.19
スイス	0.67	ヘルスケアおよび社会福祉	1.30
ニュージーランド	0.33	コンピューター・ハードウェアおよびネットワーク設備	1.17
ノルウェー	0.24	エネルギーおよび水道	1.16
合計	98.12	石油	0.85
		保険	0.69
		電気機器および部品	0.68
		交通および運輸	0.65
		小売業および百貨店	0.46
		化学	0.42
		不動産	0.38
		市および地方自治体	0.17
		航空宇宙産業	0.13
		合計	98.12

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	30.9.2024	31.3.2024	31.3.2023
純資産額、ユーロ		107,754,321.46	110,754,654.40	117,400,339.60
クラス P - a c c 受益証券	LU0033050237			
発行済受益証券		190,474.2830	200,399.1020	225,679.4660
受益証券1口当たりの純資産価格、ユーロ		387.77	378.71	357.65
受益証券1口当たり発行および買戻価格、ユーロ ¹		387.77	378.71	357.65
クラス P - d i s t 受益証券	LU0033049577			
発行済受益証券		255,611.9250	263,631.9540	275,962.6880
受益証券1口当たりの純資産価格、ユーロ		118.19	116.25	111.34
受益証券1口当たり発行および買戻価格、ユーロ ¹		118.19	116.25	111.34

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	10.85	国債および中央政府債	47.37
イタリア	10.41	銀行およびその他の金融機関	13.67
ニュージーランド	8.97	金融および持株会社	10.19
フランス	7.96	国際機関	5.38
オランダ	7.24	エネルギーおよび水道	2.31
スペイン	6.97	不動産	2.28
ドイツ	5.38	モーゲージおよび貸付機関	2.25
イギリス	4.93	石油	1.88
国際機関	4.14	公益、非営利団体	1.50
ルクセンブルグ	4.07	交通および運輸	1.22
ベルギー	3.21	通信	1.16
スロベニア	2.08	保険	1.11
オーストリア	2.03	タバコおよびアルコール飲料	1.10
スイス	1.60	自動車	0.88
ポルトガル	1.55	繊維、衣類および革製品	0.74
日本	1.43	化学	0.50
オーストラリア	1.42	各種サービス	0.47
ギリシャ	1.02	電気機器および部品	0.47
スロバキア	1.00	コンピューター・ハードウェアおよびネットワーク設備	0.44
スウェーデン	0.75	小売業および百貨店	0.18
カザフスタン	0.72	医薬品、化粧品および医療製品	0.15
アイルランド	0.61	インターネット、ソフトウェアおよびITサービス	0.10
ルーマニア	0.60	合計	95.35
ノルウェー	0.59		
ポーランド	0.56		
チリ	0.56		
ブラジル	0.55		
フィリピン	0.44		
インド	0.41		
サウジアラビア	0.35		
メキシコ	0.35		
インドネシア	0.32		
エジプト	0.31		
デンマーク	0.30		
ペルー	0.30		
中国	0.29		
ラトビア	0.26		
トルコ	0.22		
ケイマン諸島	0.21		
バミューダ	0.15		
コロンビア	0.15		
フィンランド	0.09		
合計	95.35		

U B S（Lux）ボンド・ファンド - アジア・フレキシブル（米ドル）

最も重要な数字

	ISIN	30.9.2024	31.3.2024	31.3.2023
純資産額、米ドル		302,654,233.71	344,857,628.51	412,455,055.75
クラス P - a c c 受益証券	LU0464244333			
発行済受益証券		180,697.3510	185,265.0370	221,542.4260
受益証券 1 口当たりの純資産価格、米ドル		148.98	141.03	136.44
受益証券 1 口当たり発行および買戻価格、米ドル ²		148.98	141.03	136.44

² 注記 1 を参照のこと。

投資有価証券の構成

地域別分類	純資産割合%	業種別分類	純資産割合%
香港	14.10	金融および持株会社	23.65
韓国	11.52	銀行およびその他の金融機関	19.27
英領ヴァージン諸島	9.72	投資信託	10.73
シンガポール	7.98	国債および中央政府債	9.60
インドネシア	6.67	インターネット、ソフトウェアおよび IT サービス	4.04
ケイマン諸島	5.84	エネルギーおよび水道	3.45
インド	5.76	化学	2.90
ルクセンブルグ	5.38	保険	2.71
フィリピン	4.82	不動産	2.70
中国	4.37	宿泊、ケータリングおよび娯楽施設	2.51
タイ	3.61	石油	2.40
イギリス	3.46	各種サービス	2.10
日本	2.75	通信	2.02
アメリカ合衆国	2.60	各種貿易会社	2.00
マレーシア	2.49	公益、非営利団体	1.25
オーストラリア	1.72	鉱業、石炭採掘および鉄鋼業	0.99
スリランカ	0.95	建築業および資材	0.94
モーリシャス	0.79	電子および半導体	0.79
パキスタン	0.71	電気機器および部品	0.70
マカオ	0.47	交通および運輸	0.57
オランダ	0.41	市および地方自治体	0.52
モンゴル国	0.30	グラフィック・デザイン、出版およびメディア	0.41
ベトナム	0.16	機械工学および産業機器	0.40
チリ	0.13	コンピューター・ハードウェアおよびネットワーク設備	0.12
ジャージー島	0.13	その他の非分類会社	0.09
ニュージーランド	0.09	モーゲージおよび貸付機関	0.07
合計	96.93	合計	96.93

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	30.9.2024	31.3.2024	31.3.2023
純資産額、ユーロ		2,078,968,804.08	1,748,876,315.30	1,148,200,385.80
クラス P - a c c 受益証券	LU0086177085			
発行済受益証券		1,021,969.6040	902,696.1960	691,314.2040
受益証券 1 口当たりの純資産価格、ユーロ		245.78	233.55	210.32
受益証券 1 口当たり発行および買戻価格、ユーロ ²		245.78	233.55	210.32
クラス P - a c c 受益証券（米ドル・ヘッジ）	LU0994471687			
発行済受益証券		201,322.1330	261,556.0740	173,109.9180
受益証券 1 口当たりの純資産価格、米ドル		169.62	159.84	141.59
受益証券 1 口当たり発行および買戻価格、米ドル ²		169.62	159.84	141.59
クラス P - m d i s t 受益証券	LU0417441200			
発行済受益証券		745,141.9020	715,637.0310	674,816.5100
受益証券 1 口当たりの純資産価格、ユーロ		120.13	117.33	111.29
受益証券 1 口当たり発行および買戻価格、ユーロ ²		120.13	117.33	111.29
クラス P - m d i s t 受益証券（米ドル・ヘッジ）	LU0937166394			
発行済受益証券		1,908,037.8830	1,834,380.7470	1,981,242.5690
受益証券 1 口当たりの純資産価格、米ドル		85.88	83.83	79.93
受益証券 1 口当たり発行および買戻価格、米ドル ²		85.88	83.83	79.93

² 注記 1 を参照のこと。

投資有価証券の構成

地域別分類	純資産割合 %	業種別分類	純資産割合 %
イギリス	13.38	金融および持株会社	36.22
ルクセンブルグ	12.63	銀行およびその他の金融機関	18.06
イタリア	11.14	不動産	5.37
フランス	10.86	通信	5.33
オランダ	9.53	インターネット、ソフトウェアおよび IT サービス	3.01
ドイツ	8.01	各種サービス	2.98
スペイン	5.91	エネルギーおよび水道	2.83
アイルランド	2.85	交通および運輸	2.44
スウェーデン	2.77	ヘルスケアおよび社会福祉	1.92
ジャージー島	2.72	医薬品、化粧品および医療製品	1.69
ポルトガル	2.14	自動車	1.64
ギリシャ	1.88	包装業	1.32
アメリカ合衆国	1.85	化学	1.23
オーストリア	1.39	その他の非分類会社	1.23
ベルギー	1.28	保険	1.19
日本	1.28	不動産	0.99
イスラエル	0.71	投資信託	0.92
チェコ共和国	0.46	石油	0.80
国際機関	0.42	繊維、衣類および革製品	0.72
エストニア	0.39	バイオテクノロジー	0.64
パナマ	0.39	建築業および資材	0.55
ノルウェー	0.34	写真・光学	0.48
スイス	0.26	宿泊、ケータリングおよび娯楽施設	0.47
ラトビア	0.25	各種貿易会社	0.42
スロベニア	0.23	食品および清涼飲料	0.37
ジブラルタル	0.21	農業・漁業	0.29
キプロス	0.17	電気機器および部品	0.21
合計	93.45	グラフィック・デザイン、出版およびメディア	0.13
		合計	93.45

[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13,738,000ユーロ（約24億円）は、1株2,000ユーロ（344,660円）の株式6,869株によって表章される。2024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13,742,000ユーロ（約23億円）は、1株2,000ユーロ（333,460円）の株式6,871株によって表章される。2024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、2024年6月末日現在、以下のとおり、403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	403	421,920,329.22オーストラリア・ドル
			2,007,101,466.90カナダ・ドル
			17,504,040,555.90スイス・フラン
			2,466,834,602.62中国元
			4,103,645,598.18デンマーク・クローネ
			55,001,121,271.43ユーロ
			3,653,354,498.02英ポンド
			208,129,650.25香港ドル
			848,660,780,357.00日本円
			36,301,148.79シンガポール・ドル
			117,828,996,111.96米ドル

<訂正後>

（前略）

管理会社は、2024年10月末日現在、以下のとおり、474本の投資信託／投資法人のサブ・ファンドの管理・運用を行っている。

国別（設立国）	種別（基本的性格）	本数	純資産額の合計（通貨別）
ルクセンブルグ	オープン・エンド型 投資信託／投資法人	474	571,813,492.37オーストラリア・ドル
			2,626,579,865.39カナダ・ドル
			17,643,132,752.46スイス・フラン
			3,067,424,860.72中国元
			4,198,042,789.28デンマーク・クローネ
			65,977,345,974.77ユーロ
			3,542,143,147.84英ポンド
			214,010,010.84香港ドル
			973,739,175,850.92日本円
			28,235,601.94シンガポール・ドル
			137,320,601,839.46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、「特定有価証券の内容等の開示に関する内閣府令」に基づき、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第328条第5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、2024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＝166.73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。
- d . 管理会社の名称は、2024年10月1日付で「UBSファンド・マネジメント（ルクセンブルグ）エス・エイ」から「UBSアセット・マネジメント（ヨーロッパ）エス・エイ」に変更されている。

U B S ファンド・マネジメント（ルクセンブルグ）エス・エイ

貸借対照表

2024年 6 月30日現在

	2024年 6 月30日		2023年12月31日	
	ユーロ	千円	ユーロ	千円
A . 未払込資本	0.00	0	0.00	0
B . 創業費	0.00	0	0.00	0
C . 固定資産	21,262,934.03	3,545,169	22,494,861.26	3,750,568
. 無形資産	21,234,006.99	3,540,346	22,459,045.89	3,744,597
1 . 開発費	0.00	0	0.00	0
2 . 譲許、特許、認可、登録商標 ならびに類似する権利および資産、 以下に該当する場合：	0.00	0	0.00	0
a) 有価約因として取得し、かつ、 C . I . 3 により表示が不要な場 合	0.00	0	0.00	0
b) 関連会社自身による創出	0.00	0	0.00	0
3 . 有価約因として取得された 範囲内ののれん	21,234,006.99	3,540,346	22,459,045.89	3,744,597
. 有形資産	16,179.14	2,698	23,067.47	3,846
1 . 土地および建物	0.00	0	0.00	0
2 . 工場および機械	0.00	0	0.00	0
3 . その他の什器・備品、器具および 機器	16,179.14	2,698	23,067.47	3,846
. 金融資産	12,747.90	2,125	12,747.90	2,125
1 . 関連会社持分	0.00	0	0.00	0
2 . 関連会社に対する債権	0.00	0	0.00	0
3 . 参加持分	0.00	0	0.00	0
4 . 参加持分に連動する 関連会社に対する債権	0.00	0	0.00	0
5 . 固定資産として保有の投資	0.00	0	0.00	0
6 . その他の債権	12,747.90	2,125	12,747.90	2,125
D . 流動資産	133,574,493.23	22,270,875	158,597,265.39	26,442,922
. 棚卸資産	0.00	0	0.00	0
. 債権	98,964,044.39	16,500,275	108,336,736.32	18,062,984
1 . 売掛金	74,593,782.27	12,437,021	74,278,091.26	12,384,386
a) 1 年以内に期限到来	74,593,782.27	12,437,021	74,278,091.26	12,384,386
b) 1 年を超えて期限到来	0.00	0	0.00	0
2 . 関連会社に対する債権	10,038,487.05	1,673,717	10,911,071.05	1,819,203
a) 1 年以内に期限到来	10,038,487.05	1,673,717	10,911,071.05	1,819,203
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	14,331,775.07	2,389,537	23,147,574.01	3,859,395
a) 1 年以内に期限到来	47,231.99	7,875	16,173.48	2,697
b) 1 年を超えて期限到来	14,284,543.08	2,381,662	23,131,400.53	3,856,698
. 投資	168,700.88	28,127	151,653.36	25,285
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	168,700.88	28,127	151,653.36	25,285
. 銀行預金および手元現金	34,441,747.96	5,742,473	50,108,875.71	8,354,653
E . 前払金	2,501,891.58	417,140	1,441,644.37	240,365
資産合計	157,339,318.84	26,233,185	182,533,771.02	30,433,856

	2024年6月30日		2023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	58,140,142.31	9,693,706	69,079,437.44	11,517,615
．払込資本金	13,738,000.00	2,290,537	13,738,000.00	2,290,537
．資本剰余金	22,636,000.00	3,774,100	22,636,000.00	3,774,100
．再評価積立金	0.00	0	0.00	0
．準備金	8,491,175.00	1,415,734	8,668,625.00	1,445,320
1．法定準備金	1,373,800.00	229,054	1,300,000.00	216,749
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	7,117,375.00	1,186,680	7,368,625.00	1,228,571
a) その他の分配可能準備金	150,000.00	25,010	150,000.00	25,010
b) その他の分配不能準備金	6,967,375.00	1,161,670	7,218,625.00	1,203,561
．繰越損益	1,604,973.44	267,597	24,133.30	4,024
．当期損益	11,669,993.87	1,945,738	24,012,679.14	4,003,634
．中間配当金	0.00	0	0.00	0
．資本投資助成金	0.00	0	0.00	0
B．引当金	11,596,975.81	1,933,564	21,183,815.51	3,531,978
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	11,596,975.81	1,933,564	21,183,815.51	3,531,978
3．その他の引当金	0.00	0	0.00	0
C．債務	87,602,200.72	14,605,915	92,270,518.07	15,384,263
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．支払額	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	68,993,277.73	11,503,249	69,684,494.73	11,618,496
a) 1年以内に期限到来	68,993,277.73	11,503,249	69,684,494.73	11,618,496
b) 1年を超えて期限到来	0.00	0	0.00	0
8．その他の債務	18,608,922.99	3,102,666	22,586,023.34	3,765,768
a) 税金債務	1,506,397.54	251,162	1,415,943.20	236,080
b) 社会保障債務	483,986.29	80,695	591,480.08	98,617
c) その他の債務	16,618,539.16	2,770,809	20,578,600.06	3,431,070
) 1年以内に期限到来	16,616,523.94	2,770,473	20,578,600.06	3,431,070
) 1年を超えて期限到来	2,015.22	336	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	157,339,318.84	26,233,185	182,533,771.02	30,433,856

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

2024年6月30日に終了した期間および2023年12月31日に終了した年度

	2024年1月1日から 2024年6月30日まで		2023年1月1日から 2023年12月31日まで	
	ユーロ	千円	ユーロ	千円
1. 純取引高	368,232,021.67	61,395,325	786,338,511.80	131,106,220
4. その他の営業収益	4,619,205.14	770,160	8,658,578.57	1,443,645
5. 原材料および消耗品ならびに その他の外部費用	336,964,000.98	56,182,008	720,501,724.99	120,129,253
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	336,964,000.98	56,182,008	720,501,724.99	120,129,253
6. 人件費	9,044,283.10	1,507,953	17,496,587.50	2,917,206
a) 賃金および給与	7,942,510.05	1,324,255	14,985,495.20	2,498,532
b) 社会保障費	980,434.97	163,468	2,240,347.58	373,533
) 年金に関連するもの	794,207.09	132,418	1,545,672.85	257,710
) その他の社会保障費	186,227.88	31,050	694,674.73	115,823
c) その他の人件費	121,338.08	20,231	270,744.72	45,141
7. 評価額調整	1,231,927.23	205,399	2,070,898.85	345,281
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	1,231,927.23	205,399	2,070,898.85	345,281
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	10,812,033.74	1,802,690	25,118,851.15	4,188,066
11. その他の受取利息および類似収益	759,673.69	126,660	1,565,365.16	260,993
a) 関連会社に関連するもの	470,457.29	78,439	1,175,599.77	196,008
b) その他の受取利息および類似収益	289,216.40	48,221	389,765.39	64,986
14. 支払利息および類似費用	8,431.40	1,406	2,466.51	411
a) 関連会社に関連するもの	821.35	137	0.01	0
b) その他の支払利息および類似費用	7,610.05	1,269	2,466.50	411
15. 損益にかかる税金	3,880,230.18	646,951	7,359,247.39	1,227,007
16. 税引後損益	11,669,993.87	1,945,738	24,012,679.14	4,003,634
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	11,669,993.87	1,945,738	24,012,679.14	4,003,634