

UBS ETF 英国大型株100 (FTSE 100) 信託財産状況報告書

信託契約第 29 条に基づく報告書 (信託財産状況報告書を含みます。)	受益者の皆さまへ
第 7 期	平素は格別のお引き立てにあずかり厚く御礼申し上げます。 受益証券発行信託「UBS ETF 英国大型株 100 (FTSE 100)」 の左記決算における運用状況をご報告申し上げます。今後と も一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。
2021 年 9 月 30 日現在	
2020 年 10 月 1 日～2021 年 9 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	UBS ETF 英国大型株 100 (FTSE 100)
銘柄コード	1389
信託期間	信託設定の日から信託終了の日まで
委託者	UBS 証券株式会社、野村証券株式会社、 エービーエヌ・アムロ・クリアリング証券株式会社
受託者	三菱UFJ 信託銀行株式会社、日本マスタートラスト信託銀行株式会社
信託財産	本信託財産は、FTSE 100 インデックス（トータルリターン）（以下、「本指標」といいます。）に連動する ETF（以下、「受託有価証券」といいます。）およびこれらに係る金銭等ならびに信託契約に基づいて受託者が受領する金銭その他の財産により構成されますが、消費税の授受または信託報酬もしくは信託費用の支払い等のために一時的に本信託財産となる金銭等を除き、受託有価証券のみとなります。なお、受託者は、信託法および信託業法に従い、本信託財産を固有財産および他の信託財産と分別して管理するものとします。また、受託者は、受託有価証券をカストディアンを通じて受託者が適切と判断する方法で分別して管理します。
信託財産の運用	受託者は、本信託財産の運用は行いませんが、東京証券取引所において開示される受託有価証券の 1 口当りの純資産額は、仕組みとして本指標に連動することが企図されています。
収益分配方法	年 2 回の分配を行う予定です。

■信託財産を構成する資産の内容

1. 外国投資証券

資産の種類	外国投資証券
資産の名称	UBS ETF - FTSE 100 UCITS ETF A-DIS クラス
純資産総額	12,214,696,951 円 (2021年9月30日現在) (注1)
1口当りの純資産額	9,879 円 (2021年9月30日現在) (注1)
価額の算出方法	当該外国投資証券の価額は、保有資産等が評価時点で取引されていた取引所または市場の最後に発表された公式の終値または最終取引価格を使用して決定されます。
ファンド資産の運用者、保管者およびその他重要な業務を行う者の名称、住所および役割 (注2)	<ul style="list-style-type: none"> ・ Portfolio Manager (運用者) UBS Asset Management (UK) Ltd 5 Broadgate, London, EC2M 2QS London, UK ・ Depositary Bank (デポジタリーバンク) State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch, 49, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg ・ Company Administrator (受託者) State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch, 49, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg ・ Compliance Administrator (運用監督者) State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch, 49, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg ・ Auditors of the Company (監査法人) PricewaterhouseCoopers, Réviseur d'entreprises agréé, 2, rue Gerhard Mercator B.P. 1443, L-1014 Luxembourg
受託者と上記関係者との間の資本関係および人的関係	該当事項はありません。
ファンド資産に関する外部監査を行う者の氏名・名称 (注2)	PricewaterhouseCoopers
保管機関	受託者の指定するカストディアン

注1：計算期間末日（2021年9月30日）時点における最終の発行体開示情報を記載しております。

注2：「ファンド資産」とは、外国投資証券に係る権利を有する者から出資または拠出を受けた資産をいいます。

2. 金銭

資産の種類	金銭 (注)
価 格	0 円 (2021年9月30日現在)

注：受託者の銀行勘定で預かります。

■受益証券発行信託の状況

(2021年9月30日現在)

本信託の純資産総額 (単位：円) (注)	口数 (単位：口)
273,590,332	27,500

注：受託者の採用する価格に基づく本信託の決算期日末日時点の状況であり、東京証券取引所に日々開示された信託財産である外国ETFの1口当りの純資産額に上場外国ETF信託受益証券の上場受益権口数を乗じたものとは必ずしも一致するものではありません。

■取引の状況 (自 2020年10月1日 至 2021年9月30日)

1. 信託の設定、解約

設定		解約	
口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)	口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)
10,000	80,940	—	—

2. 自己または利害関係人との取引状況

信託財産から受領した外貨建て分配金は、三菱UFJ信託銀行株式会社との外国為替取引により円転し、受益者へ分配するまでの間、現金を日本マスタートラスト信託銀行株式会社の銀行勘定に預入しました。また、1口当りの分配金額の計算上生じた1円未満の端数に相当する金銭の総額および銀行勘定預入利息については、信託契約に基づき、信託報酬として受託者が受領しております。

3. 信託業務の委託の状況

信託業務(信託業法第22条第3項各号に掲げる業務を除きます。)の第三者への委託は行っておりません。カスタディー業務については、ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.に委託しております。

■資産、負債、元本等および損益の状況

<貸借対照表>

当計算期間末（2021年9月30日）現在
（単位：千円）

資産の部	
固定資産	
投資有価証券	273,590
固定資産合計	273,590
資産合計	273,590
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	230,395
元本合計	230,395
留保金	
留保金合計	—
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	43,195
評価・換算差額等合計	43,195
元本等合計	273,590
負債・元本等合計	273,590

<損益計算書（注）>

当計算期間（自 2020年10月1日 至 2021年9月30日）
（単位：千円）

経常収益	8,781
経常費用	284
経常利益	8,497
当期純利益	8,497
前期繰越利益	—
当期末処分利益	8,497
利益処分額	
受益権収益分配金	△8,497
受益権収益分配金合計	△8,497
次期繰越利益	—

注：本損益計算書は、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律施行規則第19条第2項に定める「収支計算書」を兼ねております。

■外貨建て分配金の円転取引について

信託財産から受領した外貨建て分配金は、三菱UFJ信託銀行株式会社との外国為替取引により円転致しました。

金額 (単位 : GBP)	約定日	為替レート	金額 (単位 : 円)
23,798.50	2021年2月8日	140.92	3,353,684
34,883.75	2021年8月10日	148.79	5,190,353

■信託財産の銀行勘定への運用について

円転した分配金を受益者へ分配するまでの間、現金を日本マスタートラスト信託銀行株式会社の銀行勘定にて運用致しました。

金額 (単位 : 円)	期間	利息額 (単位 : 円)
3,353,684	2021年2月10日～2021年2月12日	0
5,190,353	2021年8月12日～2021年8月13日	

■収益の分配の状況について

基準日	支払開始日	1口当たり分配金額 (単位 : 円)
2021年1月29日	2021年3月10日	121
2021年7月30日	2021年9月9日	188

■信託財産の価額の推移

日付	1口当たりの信託財産の価額 (単位 : 円)
2020年10月30日	6,996
2020年11月30日	8,075
2020年12月30日	8,539
2021年1月29日	8,550
2021年2月26日	8,872
2021年3月31日	9,470
2021年4月30日	9,840
2021年5月31日	10,182
2021年6月30日	10,061
2021年7月30日	10,039
2021年8月31日	9,949
2021年9月30日	9,877

(注) 各月末時点の発行体開示情報の外貨建1口当たりの純資産額を三菱UFJ銀行の対顧客公示相場の仲値 (TTM) で円換算した価額を記載しています。