

各位

外国投資法人名 UBS ETF・シキャブ
代表者 取締役
アンドレアス・ハーバーツェト
管理会社名 UBS ファンド・マネジメント
(ルクセンブルク) エス・エイ
代表者名 CEO フランチェスカ・プリム
(管理会社コード：13854)
問合せ先 森・濱田松本法律事務所
担当者 弁護士 大西 信治
(TEL 03-6212-8316)

2020年9月期(2019年10月1日～2020年9月30日)信託財産状況報告書

UBS ETF・シキャブを発行者として上場する下記のETF銘柄について、信託財産状況報告書(以下、「本報告書」といいます)を開示(※注)致します。

掲載番号	銘柄	銘柄コード	上場取引所
1	UBS ETF ユーロ圏大型株 50 (ユーロ・ストックス 50)	1385	東
2	UBS ETF 欧州株 (MSCI ヨーロッパ)	1386	東
3	UBS ETF ユーロ圏株 (MSCI EMU)	1387	東
4	UBS ETF ユーロ圏小型株 (MSCI EMU 小型株)	1388	東
5	UBS ETF 英国大型株 100 (FTSE 100)	1389	東
6	UBS ETF MSCI アジア太平洋株 (除く日本)	1390	東
7	UBS ETF スイス株 (MSCI スイス 20/35)	1391	東
8	UBS ETF 英国株 (MSCI 英国)	1392	東
9	UBS ETF 米国株 (MSCI 米国)	1393	東
10	UBS ETF 先進国株 (MSCI ワールド)	1394	東

※注

本報告書は、信託業法第27条第1項の規定に基づき、受託者たる三菱UFJ信託銀行株式会社が作成し、東京証券取引所の有価証券上場規程に定める上場外国指標連動証券信託受益証券の管理会社が開示致します。

以上

UBS ETF ユーロ圏大型株50 (ユーロ・ストック50) 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 6 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 ユーロ圏大型株 50 (ユーロ・ ストック50)」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。
2020 年 9 月 30 日現在	
2019 年 10 月 1 日～2020 年 9 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	UBS ETF ユーロ圏大型株 50 (ユーロ・ストック50)
銘柄コード	1385
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、ユーロ・ストック50 [®] インデックス (ネットリターン) (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 - ユーロ・ストックス 50 UCITS ETF A-DIS クラス
純資産総額	42,191,582,300 円 (2020 年 9 月 30 日現在) (注 1)
1 口当りの純資産額	3,963 円 (2020 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 Switzerland AG, Zurich Bahnhofstrasse 45, CH-8098 Zurich, Switzerland ・ Depositary Bank (デポジタリーバンク) State Street Bank Luxembourg S.C.A. 49, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg ・ Company Administrator (受託者) State Street Bank Luxembourg S.C.A. 49, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg ・ Compliance Administrator (運用監督者) State Street Bank Luxembourg S.C.A. 49, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg-Kirchberg ・ 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 (2020 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 (2020 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

(2020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)
434,357,707	109,429

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2019年10月1日至2020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)
22,500	77,697	46,071	1,569,864

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。

カスト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（2020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	434,357
固定資産合計	434,357
資産合計	434,357
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	473,680
元本合計	473,680
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	△39,323
評価・換算差額等合計	△39,323
元本等合計	434,357
負債・元本等合計	434,357

<損益計算書（注）>

当計算期間（自 2019年10月1日 至 2020年9月30日）

（単位：千円）

経常収益	9,087
経常費用	172
経常利益	8,915
当期純利益	8,915
前期繰越利益	—
当期末処分利益	8,915
利益処分量	
受益権収益分配金	△8,915
受益権収益分配金合計	△8,915
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: EUR)	約定日	為替レート	金額 (単位: 円)
16,264.42	2020年2月10日	118.60	1,928,960
57,307.97	2020年8月11日	122.98	7,047,734

■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)
1,928,960	2020年2月13日～2020年2月14日	0
7,047,734	2020年8月13日～2020年8月14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)
2020年1月31日	2020年3月13日	22
2020年7月31日	2020年9月8日	64

■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)
2019年10月31日	4,380
2019年11月29日	4,470
2019年12月31日	4,596
2020年1月31日	4,393
2020年2月28日	4,002
2020年3月31日	3,333
2020年4月30日	3,407
2020年5月29日	3,669
2020年6月30日	3,969
2020年7月31日	4,007
2020年8月31日	4,112
2020年9月30日	3,976

(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。

UBS ETF 欧州株 (MSCI ヨーロッパ) 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 6 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 欧州株 (MSCI ヨーロッパ)」 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。
2020 年 9 月 30 日現在	
2019 年 10 月 1 日～2020 年 9 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	UBS ETF 欧州株 (MSCI ヨーロッパ)
銘柄コード	1386
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、MSCI ヨーロッパ・インデックス（ネットリターン）（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 - MSCI ヨーロッパ UCITS ETF A-DIS クラス
純資産総額	43,401,801,920 円 (2020年9月30日現在) (注1)
1口当りの純資産額	7,222 円 (2020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 Switzerland AG, Zurich Bahnhofstrasse 45, CH-8098 Zurich, Switzerland ・ Depositary Bank (デポジタリーバンク) State Street Bank Luxembourg S.C.A. 49, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg ・ Company Administrator (受託者) State Street Bank Luxembourg S.C.A. 49, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg ・ Compliance Administrator (運用監督者) State Street Bank Luxembourg S.C.A. 49, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg-Kirchberg ・ 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（2020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 (2020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

(2020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)
331,390,456	45,519

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2019年10月1日至2020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)
11,000	71,433	8,481	66,176

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。

カスト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（2020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	331,390
固定資産合計	331,390
資産合計	331,390
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	340,783
元本合計	340,783
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	△9,393
評価・換算差額等合計	△9,393
元本等合計	331,390
負債・元本等合計	331,390

<損益計算書（注）>

当計算期間（自 2019年10月1日 至 2020年9月30日）
（単位：千円）

経常収益	6,861
経常費用	114
経常利益	6,747
当期純利益	6,747
前期繰越利益	—
当期末処分利益	6,747
利益処分量	
受益権収益分配金	△6,747
受益権収益分配金合計	△6,747
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: EUR)	約定日	為替レート	金額 (単位: 円)
16,696.84	2020年2月10日	118.60	1,980,245
39,014.33	2020年8月11日	122.98	4,797,982

■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)
1,980,245	2020年2月13日～2020年2月14日	0
4,797,982	2020年8月13日～2020年8月14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)
2020年1月31日	2020年3月13日	57
2020年7月31日	2020年9月8日	105

■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)
2019年10月31日	7,918
2019年11月29日	8,072
2019年12月31日	8,372
2020年1月31日	8,115
2020年2月28日	7,374
2020年3月31日	7,530
2020年4月30日	7,445
2020年5月29日	6,837
2020年6月30日	7,163
2020年7月31日	7,244
2020年8月31日	7,427
2020年9月30日	7,245

(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。

UBS ETF ユーロ圏株 (MSCI EMU) 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 6 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 ユーロ圏株 (MSCI EMU)」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。
2020 年 9 月 30 日現在	
2019 年 10 月 1 日～2020 年 9 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	UBS ETF ユーロ圏株 (MSCI EMU)
銘柄コード	1387
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、MSCI EMU インデックス (ネットリターン) (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 - MSCI EMU UCITS ETF A-DIS クラス
純資産総額	84,368,432,964 円 (2020年9月30日現在) (注1)
1口当りの純資産額	13,889 円 (2020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 Switzerland AG, Zurich Bahnhofstrasse 45, CH-8098 Zurich, Switzerland ・ Depositary Bank (デポジタリーバンク) State Street Bank Luxembourg S.C.A. 49, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg ・ Company Administrator (受託者) State Street Bank Luxembourg S.C.A. 49, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg ・ Compliance Administrator (運用監督者) State Street Bank Luxembourg S.C.A. 49, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg-Kirchberg ・ 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（2020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 (2020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

(2020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)
183,859,929	13,176

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2019年10月1日至2020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	121,983	1,324	20,578

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。

カスト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（2020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	183,859
固定資産合計	183,859
資産合計	183,859
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	171,347
元本合計	171,347
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	12,512
評価・換算差額等合計	12,512
元本等合計	183,859
負債・元本等合計	183,859

<損益計算書（注）>

当計算期間（自 2019年10月1日 至 2020年9月30日）

（単位：千円）

経常収益	2,685
経常費用	37
経常利益	2,648
当期純利益	2,648
前期繰越利益	—
当期末処分利益	2,648
利益処分別	
受益権収益分配金	△2,648
受益権収益分配金合計	△2,648
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: EUR)	約定日	為替レート	金額 (単位: 円)
1,558.78	2020年2月10日	118.60	184,871
20,071.00	2020年8月11日	122.98	2,468,331

■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)
184,871	2020年2月13日～2020年2月14日	0
2,468,331	2020年8月13日～2020年8月14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)
2020年1月31日	2020年3月13日	58
2020年7月31日	2020年9月8日	187

■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)
2019年10月31日	15,187
2019年11月29日	15,478
2019年12月31日	15,904
2020年1月31日	15,345
2020年2月28日	14,076
2020年3月31日	11,584
2020年4月30日	11,972
2020年5月29日	12,887
2020年6月30日	13,746
2020年7月31日	13,899
2020年8月31日	14,344
2020年9月30日	13,936

(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。

UBS ETF ユーロ圏小型株 (MSCI EMU 小型株) 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 6 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 ユーロ圏小型株 (MSCI EMU 小型株)」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。
2020 年 9 月 30 日現在	
2019 年 10 月 1 日～2020 年 9 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	UBS ETF ユーロ圏小型株 (MSCI EMU 小型株)
銘柄コード	1388
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、MSCI EMU 小型株インデックス (ネットリターン) (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 - MSCI EMU 小型株 UCITS ETF A-DIS クラス
純資産総額	16,298,475,759 円 (2020年9月30日現在) (注1)
1口当りの純資産額	11,532 円 (2020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 Switzerland AG, Zurich Bahnhofstrasse 45, CH-8098 Zurich, Switzerland ・ Depositary Bank (デポジタリーバンク) State Street Bank Luxembourg S.C.A. 49, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg ・ Company Administrator (受託者) State Street Bank Luxembourg S.C.A. 49, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg ・ Compliance Administrator (運用監督者) State Street Bank Luxembourg S.C.A. 49, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg-Kirchberg ・ 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（2020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 (2020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

(2020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)
83,042,277	7,242

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2019年10月1日至2020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	104,540	6,558	70,610

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。

カスト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（2020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		83,042
固定資産合計		83,042
資産合計		83,042
負債の部		
負債合計		—
元本等の部		
元本		
受益権		76,808
元本合計		76,808
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		6,234
評価・換算差額等合計		6,234
元本等合計		83,042
負債・元本等合計		83,042

<損益計算書（注）>

当計算期間（自 2019年10月1日 至 2020年9月30日）

（単位：千円）

経常収益	898
経常費用	13
経常利益	885
当期純利益	885
前期繰越利益	—
当期末処分利益	885
利益処分量	
受益権収益分配金	△ 885
受益権収益分配金合計	△ 885
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: EUR)	約定日	為替レート	金額 (単位: 円)
628.21	2020年2月10日	118.60	74,505
6,615.57	2020年8月11日	122.98	813,582

■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)
74,505	2020年2月13日～2020年2月14日	0
813,582	2020年8月13日～2020年8月14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)
2020年1月31日	2020年3月13日	33
2020年7月31日	2020年9月8日	112

■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)
2019年10月31日	11,879
2019年11月29日	12,231
2019年12月31日	12,699
2020年1月31日	12,257
2020年2月28日	11,380
2020年3月31日	8,961
2020年4月30日	9,571
2020年5月29日	10,382
2020年6月30日	10,865
2020年7月31日	11,188
2020年8月31日	11,701
2020年9月30日	11,570

(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。

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 6 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。
2020 年 9 月 30 日現在	
2019 年 10 月 1 日～2020 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	7,907,677,978 円 (2020年9月30日現在) (注1)
1口当りの純資産額	7,412 円 (2020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 Luxembourg S.C.A. 49, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg ・ Company Administrator (受託者) State Street Bank Luxembourg S.C.A. 49, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg ・ Compliance Administrator (運用監督者) State Street Bank Luxembourg S.C.A. 49, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg-Kirchberg ・ 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（2020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 (2020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

(2020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)
130,907,228	17,500

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2019年10月1日至2020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)
12,000	86,772	-	-

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。

カスト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（2020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		130,907
固定資産合計		130,907
資産合計		130,907
負債の部		
負債合計		—
元本等の部		
元本		
受益権		149,455
元本合計		149,455
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		△18,548
評価・換算差額等合計		△18,548
元本等合計		130,907
負債・元本等合計		130,907

<損益計算書（注）>

当計算期間（自 2019年10月1日 至 2020年9月30日）

（単位：千円）

経常収益	3,355
経常費用	102
経常利益	3,253
当期純利益	3,253
前期繰越利益	—
当期末処分利益	3,253
利益処分量	
受益権収益分配金	△3,253
受益権収益分配金合計	△3,253
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)
7,249.00	2020年2月10日	137.42	996,157
16,793.00	2020年8月11日	134.72	2,262,352

■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)
996,157	2020年2月13日～2020年2月14日	0
2,262,352	2020年8月13日～2020年8月14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)
2020年1月31日	2020年3月13日	181
2020年7月31日	2020年9月8日	129

■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)
2019年10月31日	9,510
2019年11月29日	9,739
2019年12月31日	10,151
2020年1月31日	9,767
2020年2月28日	8,609
2020年3月31日	7,037
2020年4月30日	7,297
2020年5月29日	7,514
2020年6月30日	7,637
2020年7月31日	7,574
2020年8月28日	7,760
2020年9月30日	7,392

(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。

UBS ETF MSCI アジア太平洋株 (除く日本) 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 6 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 MSCI アジア太平洋株 (除く日本)」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。
2020 年 9 月 30 日現在	
2019 年 10 月 1 日～2020 年 9 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	UBS ETF MSCI アジア太平洋株 (除く日本)
銘柄コード	1390
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、MSCI パシフィック (除く日本) インデックス (ネットリターン) (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 - MSCI パシフィック (除く日本) UCITS ETF A-DIS クラス
純資産総額	11,247,920,988 円 (2020年9月30日現在) (注1)
1口当りの純資産額	4,043 円 (2020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 • Depository Bank (デポジタリーバンク) State Street Bank Luxembourg S.C.A. 49, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg • Company Administrator (受託者) State Street Bank Luxembourg S.C.A. 49, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg • Compliance Administrator (運用監督者) State Street Bank Luxembourg S.C.A. 49, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg-Kirchberg • 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（2020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 (2020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

(2020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)
136,001,272	33,500

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 2019年10月1日 至 2020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)
2,000	6,789	-	-

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。

カスト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（2020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		136,001
固定資産合計		136,001
資産合計		136,001
負債の部		
負債合計		—
元本等の部		
元本		
受益権		165,878
元本合計		165,878
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		△29,877
評価・換算差額等合計		△29,877
元本等合計		136,001
負債・元本等合計		136,001

<損益計算書（注）>

当計算期間（自 2019年10月1日 至 2020年9月30日）

（単位：千円）

経常収益	4,710
経常費用	78
経常利益	4,632
当期純利益	4,632
前期繰越利益	—
当期末処分利益	4,632
利益処分別	
受益権収益分配金	△4,632
受益権収益分配金合計	△4,632
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: USD)	約定日	為替レート	金額 (単位: 円)
22,906.80	2020年2月10日	108.65	2,488,823
20,625.95	2020年8月11日	105.17	2,169,231

■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)
2,488,823	2020年2月13日～2020年2月14日	0
2,169,231	2020年8月13日～2020年8月14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)
2020年1月31日	2020年3月13日	79
2020年7月31日	2020年9月8日	64

■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)
2019年10月31日	4,737
2019年11月29日	4,775
2019年12月31日	4,892
2020年1月31日	4,787
2020年2月28日	4,361
2020年3月31日	3,460
2020年4月30日	3,795
2020年5月29日	3,802
2020年6月30日	4,115
2020年7月31日	4,096
2020年8月31日	4,294
2020年9月30日	4,053

(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。

UBS ETF スイス株 (MSCI スイス20/35) 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 6 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 スイス株 (MSCI スイス 20/35)」 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。
2020 年 9 月 30 日現在	
2019 年 10 月 1 日～2020 年 9 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	UBS ETF スイス株 (MSCI スイス 20/35)
銘柄コード	1391
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、MSCI スイス 20/35 インデックス (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 - MSCI スイス 20/35 UCITS ETF A-DIS クラス
純資産総額	39,127,971,893 円 (2020年9月30日現在) (注1)
1口当りの純資産額	2,247 円 (2020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 Switzerland AG, Zurich Bahnhofstrasse 45, CH-8098 Zurich, Switzerland ・ Depositary Bank (デポジタリーバンク) State Street Bank Luxembourg S.C.A. 49, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg ・ Company Administrator (受託者) State Street Bank Luxembourg S.C.A. 49, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg ・ Compliance Administrator (運用監督者) State Street Bank Luxembourg S.C.A. 49, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg-Kirchberg ・ 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（2020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 (2020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

(2020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)
174,791,148	77,399

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2019年10月1日至2020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	21,260	8,601	17,460

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。

カスト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（2020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	174,791
固定資産合計	174,791
資産合計	174,791
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	158,084
元本合計	158,084
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	16,707
評価・換算差額等合計	16,707
元本等合計	174,791
負債・元本等合計	174,791

<損益計算書（注）>

当計算期間（自 2019年10月1日 至 2020年9月30日）
（単位：千円）

経常収益	2,856
経常費用	70
経常利益	2,786
当期純利益	2,786
前期繰越利益	—
当期末処分利益	2,786
利益処分量	
受益権収益分配金	△2,786
受益権収益分配金合計	△2,786
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 : CHF)	約定日	為替レート	金額 (単位 : 円)
24,667.06	2020年8月11日	114.90	2,834,245

■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

金額 (単位 : 円)	期間	利息額 (単位 : 円)
2,834,245	2020年8月13日～2020年8月14日	0

■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)
2020年7月31日	2020年9月8日	36

■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)
2019年10月31日	2,154
2019年11月29日	2,198
2019年12月30日	2,278
2020年1月31日	2,288
2020年2月28日	2,124
2020年3月31日	2,028
2020年4月30日	2,047
2020年5月29日	2,139
2020年6月30日	2,208
2020年7月31日	2,245
2020年8月31日	2,269
2020年9月30日	2,249

(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。

UBS ETF 英国株 (MSCI 英国) 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 6 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 英国株 (MSCI 英国)」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。
2020 年 9 月 30 日現在	
2019 年 10 月 1 日～2020 年 9 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	UBS ETF 英国株 (MSCI 英国)
銘柄コード	1392
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、MSCI 英国インデックス (ネットリターン) (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 - MSCI 英国 UCITS ETF A-DIS クラス
純資産総額	3,946,072,724 円 (2020年9月30日現在) (注1)
1口当りの純資産額	1,983 円 (2020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 Luxembourg S.C.A. 49, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg ・ Company Administrator (受託者) State Street Bank Luxembourg S.C.A. 49, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg ・ Compliance Administrator (運用監督者) State Street Bank Luxembourg S.C.A. 49, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg-Kirchberg ・ 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（2020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 (2020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

(2020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)
83,502,264	41,870

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 2019年10月1日 至 2020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)
15,000	29,775	4,130	12,364

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。

カスト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（2020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	83,502
固定資産合計	83,502
資産合計	83,502
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	110,221
元本合計	110,221
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	△26,719
評価・換算差額等合計	△26,719
元本等合計	83,502
負債・元本等合計	83,502

<損益計算書（注）>

当計算期間（自 2019年10月1日 至 2020年9月30日）

（単位：千円）

経常収益	2,877
経常費用	110
経常利益	2,767
当期純利益	2,767
前期繰越利益	—
当期末処分利益	2,767
利益処分別	
受益権収益分配金	△2,767
受益権収益分配金合計	△2,767
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)
9,823.67	2020年2月10日	137.42	1,349,968
10,722.91	2020年8月11日	134.72	1,444,590

■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)
1,349,968	2020年2月13日～2020年2月14日	0
1,444,590	2020年8月13日～2020年8月14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)
2020年1月31日	2020年3月13日	50
2020年7月31日	2020年9月8日	34

■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)
2019年10月31日	2,591
2019年11月29日	2,652
2019年12月31日	2,762
2020年1月31日	2,659
2020年2月28日	2,338
2020年3月31日	1,909
2020年4月30日	1,972
2020年5月29日	2,025
2020年6月30日	2,055
2020年7月31日	2,031
2020年8月28日	2,076
2020年9月30日	1,977

(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。

UBS ETF 米国株 (MSCI 米国) 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 6 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 米国株 (MSCI 米国)」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。
2020 年 9 月 30 日現在	
2019 年 10 月 1 日～2020 年 9 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	UBS ETF 米国株 (MSCI 米国)
銘柄コード	1393
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、MSCI 米国インデックス（ネットリターン）（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 - MSCI 米国 UCITS ETF A-DIS クラス
純資産総額	61,158,378,129 円 (2020年9月30日現在) (注1)
1口当りの純資産額	34,670 円 (2020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 Luxembourg S.C.A. 49, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg ・ Company Administrator (受託者) State Street Bank Luxembourg S.C.A. 49, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg ・ Compliance Administrator (運用監督者) State Street Bank Luxembourg S.C.A. 49, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg-Kirchberg ・ 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（2020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 (2020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

(2020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)
250,408,467	7,300

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2019年10月1日至2020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)
12,277	372,920	9,977	288,408

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。

カスト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（2020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	250,408
固定資産合計	250,408
資産合計	250,408
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	215,802
元本合計	215,802
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	34,606
評価・換算差額等合計	34,606
元本等合計	250,408
負債・元本等合計	250,408

<損益計算書（注）>

当計算期間（自 2019年10月1日 至 2020年9月30日）

（単位：千円）

経常収益	2,475
経常費用	35
経常利益	2,440
当期純利益	2,440
前期繰越利益	—
当期末処分利益	2,440
利益処分数額	
受益権収益分配金	△2,440
受益権収益分配金合計	△2,440
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 : USD)	約定日	為替レート	金額 (単位 : 円)
9,279.50	2020年2月12日	108.85	1,010,073
13,661.22	2020年8月11日	105.17	1,436,750

■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)
1,010,073	2020年2月14日～2020年2月17日	0
1,436,750	2020年8月13日～2020年8月14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)
2020年1月31日	2020年3月13日	202
2020年7月31日	2020年9月8日	196

■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)
2019年10月31日	31,784
2019年11月29日	33,165
2019年12月31日	34,120
2020年1月31日	34,010
2020年2月28日	31,139
2020年3月31日	27,021
2020年4月30日	30,020
2020年5月29日	31,750
2020年6月30日	32,520
2020年7月31日	33,434
2020年8月31日	35,973
2020年9月30日	34,757

(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。

UBS ETF 先進国株 (MSCI ワールド) 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 6 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 先進国株 (MSCI ワールド)」 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。
2020 年 9 月 30 日現在	
2019 年 10 月 1 日～2020 年 9 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	UBS ETF 先進国株 (MSCI ワールド)
銘柄コード	1394
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、MSCI ワールド・インデックス (ネットリターン) (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 - MSCI ワールド UCITS ETF A-DIS クラス
純資産総額	101,818,848,556 円 (2020年9月30日現在) (注1)
1口当りの純資産額	24,986 円 (2020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 Luxembourg S.C.A. 49, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg ・ Company Administrator (受託者) State Street Bank Luxembourg S.C.A. 49, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg ・ Compliance Administrator (運用監督者) State Street Bank Luxembourg S.C.A. 49, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg-Kirchberg ・ 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（2020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 (2020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

(2020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)
320,608,612	12,800

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2019年10月1日至2020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)
10,861	253,514	2,061	45,020

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。

カスト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（2020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	320,608
固定資産合計	320,608
資産合計	320,608
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	295,869
元本合計	295,869
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	24,739
評価・換算差額等合計	24,739
元本等合計	320,608
負債・元本等合計	320,608

<損益計算書（注）>

当計算期間（自 2019年10月1日 至 2020年9月30日）

（単位：千円）

経常収益	3,079
経常費用	47
経常利益	3,032
当期純利益	3,032
前期繰越利益	—
当期末処分利益	3,032
利益処分別	
受益権収益分配金	△3,032
受益権収益分配金合計	△3,032
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: USD)	約定日	為替レート	金額 (単位: 円)
6,024.40	2020年2月12日	108.85	655,755
22,688.00	2020年8月11日	105.17	2,386,096

■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)
655,755	2020年2月14日～2020年2月17日	0
2,386,096	2020年8月13日～2020年8月14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)
2020年1月31日	2020年3月13日	163
2020年7月31日	2020年9月8日	186

■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)
2019年10月31日	24,339
2019年11月29日	25,168
2019年12月31日	25,918
2020年1月31日	25,629
2020年2月28日	23,388
2020年3月31日	20,176
2020年4月30日	21,976
2020年5月29日	23,171
2020年6月30日	23,828
2020年7月31日	24,240
2020年8月31日	25,844
2020年9月30日	25,050

(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。