

各 位

発行者名 三菱UFJ証券ホールディングス株式会社
(発行者コード: 20704)

代表者名 取締役社長 荒木 三 郎

問合せ先 三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社
エクイティソリューション部長 仲田 智 治
TEL 03-6742-6840

2021年10月期(2020年11月24日～2021年10月31日)信託財産状況報告書

三菱UFJ証券ホールディングス株式会社を発行者として東京証券取引所に上場する以下のETN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	スマートESG30女性活躍(ネットリターン)ETN	2070	東
2	スマートESG30総合(ネットリターン)ETN	2071	東
3	トップシェアインデックス(ネットリターン)ETN	2072	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発行者たる三菱UFJ証券ホールディングス株式会社が開示致します。

以 上

掲載番号 1

スマート ESG30女性活躍（ネットリターン） ETN 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。)	受益者の皆様へ
第 1 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「スマート ESG30 女性活躍（ネットリターン） ETN」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 10 月 31 日現在	
2020 年 11 月 24 日～2021 年 10 月 31 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	スマート ESG30 女性活躍（ネットリターン） ETN
銘柄コード	2070
信託期間	信託設定の日から信託終了の日まで
委託者	三菱 UFJ モルガン・スタンレー証券株式会社
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、iSTOXX MUTB ジャパン女性活躍 30 インデックス（ネットリターン）（以下、「本指標」といいます。）に連動する債券（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外国指標連動証券の一証券あたりの償還価額は、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	原則として、信託期間中に分配は行いません。

■信託財産を構成する資産の内容

1. 三菱UFJ証券ホールディングス株式会社発行の外国指標連動証券（外国債券）

資産の種類	外国指標連動証券
資産の名称	iSTOXX MUTB ジャパン女性活躍 30 インデックス（ネットリターン）連動債
数量	700,000 口（2021 年 10 月 31 日時点）
価格	7,377,300,000 円（2021 年 10 月 31 日時点）（注 1）（注 2）
一口あたりの価格	10,539 円（2021 年 10 月 31 日時点）（注 3）
保管機関	受託者の指定するカストディアン

注 1：外国指標連動証券の残存償還価格の総額を記載しております。

注2：計算期間末日（2021年10月31日）時点における外国指標連動証券の価格を記載しております。

注3：外国指標連動証券の一口あたりの償還価格を記載しております。

2. 金銭

資産の種類	金銭（注）
価 格	0円（2021年10月31日現在）

注：上記金銭は、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

本信託の純資産総額（注）
7,377,300,000円

注：決算期日末日時点の状況です。日々の状況につきましては、東京証券取引所の適時開示情報閲覧サービス(TDnet)をご覧ください。

■取引の状況（自2020年11月24日至2021年10月31日）

1. 信託の設定、解約 （千円未満切捨て）

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）
700,000	6,990,500	—	—

2. 自己またはその利害関係人等との取引状況

該当事項はありません。

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、ルクセンブルグ三菱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、純資産価額および損益の状況

<貸借対照表>

当計算期間末（2021年10月31日）現在
 （単位：千円）

資産の部		
固定資産		
投資有価証券		7,377,300
固定資産合計		7,377,300
資産合計		7,377,300
負債の部		
負債合計		—
元本等の部		
元本		
受益権		6,990,500
元本合計		6,990,500
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	386,800
評価・換算差額等合計	386,800
元本等合計	7,377,300
負債・元本等合計	7,377,300

< 損益計算書（注1）（注2） > 当計算期間（自 2020年11月24日 至 2021年10月31日）
（単位：千円）

経常収益	—
経常費用	—
経常利益	—
当期純利益	—
前期繰越利益	—
当期末処分利益	—
利益処分量	—
次期繰越利益	—

注1：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。

注2：当計算期間において損益等の発生する取引は生じておりません。

■信託財産の銀行勘定への運用について

該当事項はございません。

■収益の分配の状況について

分配金はありません。

■信託財産の価額の推移

日付	一口あたりの信託財産の価額（単位：円）
2020年11月30日	9,943
2020年12月30日	10,228
2021年1月29日	10,338
2021年2月26日	9,962
2021年3月31日	10,553
2021年4月30日	10,034
2021年5月31日	9,964
2021年6月30日	10,249
2021年7月30日	9,987
2021年8月31日	10,479
2021年9月30日	10,711
2021年10月29日	10,539

掲載番号 2

スマート ESG30総合（ネットリターン）ETN 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。)	受益者の皆様へ
第 1 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「スマート ESG30 総合（ネットリターン）ETN」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 10 月 31 日現在	
2020 年 11 月 24 日～2021 年 10 月 31 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	スマート ESG30 総合（ネットリターン）ETN
銘柄コード	2071
信託期間	信託設定の日から信託終了の日まで
委託者	三菱 UFJ モルガン・スタンレー証券株式会社
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、iSTOXX MUTB ジャパン ESG 30 インデックス（ネットリターン）（以下、「本指標」といいます。）に連動する債券（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外国指標連動証券の一証券あたりの償還価額は、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	原則として、信託期間中に分配は行いません。

■信託財産を構成する資産の内容

1. 三菱UFJ証券ホールディングス株式会社発行の外国指標連動証券（外国債券）

資産の種類	外国指標連動証券
資産の名称	iSTOXX MUTB ジャパン ESG 30 インデックス（ネットリターン）連動債
数量	1,000,000 口（2021 年 10 月 31 日時点）
価格	12,052,000,000 円（2021 年 10 月 31 日時点）（注 1）（注 2）
一口あたりの価格	12,052 円（2021 年 10 月 31 日時点）（注 3）
保管機関	受託者の指定するカストディアン

注 1：外国指標連動証券の残存償還価格の総額を記載しております。

注 2：計算期間末日（2021 年 10 月 31 日）時点における外国指標連動証券の価格を記載しております。

注3：外国指標連動証券の一口あたりの償還価格を記載しております。

2. 金銭

資産の種類	金銭（注）
価 格	0円（2021年10月31日現在）

注：上記金銭は、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

本信託の純資産総額（注）
12,052,000,000円

注：決算期日末日時点の状況です。日々の状況につきましては、東京証券取引所の適時開示情報閲覧サービス(TDnet)をご覧ください。

■取引の状況（自2020年11月24日至2021年10月31日）

1. 信託の設定、解約 （千円未満切捨て）

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）
1,000,000	10,120,000	—	—

2. 自己またはその利害関係人等との取引状況

該当事項はありません。

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、ルクセンブルグ三菱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、純資産価額および損益の状況

<貸借対照表>

当計算期間末（2021年10月31日）現在
（単位：千円）

資産の部	
固定資産	
投資有価証券	12,052,000
固定資産合計	12,052,000
資産合計	12,052,000
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	10,120,000
元本合計	10,120,000
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	1,932,000
評価・換算差額等合計	1,932,000
元本等合計	12,052,000
負債・元本等合計	12,052,000

< 損益計算書（注1）（注2） > 当計算期間（自 2020年11月24日 至 2021年10月31日）
（単位：千円）

経常収益	—
経常費用	—
経常利益	—
当期純利益	—
前期繰越利益	—
当期末処分利益	—
利益処分額	—
次期繰越利益	—

注1：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。

注2：当計算期間において損益等の発生する取引は生じておりません。

■信託財産の銀行勘定への運用について

該当事項はございません。

■収益の分配の状況について

分配金はありません。

■信託財産の価額の推移

日付	一口あたりの信託財産の価額（単位：円）
2020年11月30日	10,092
2020年12月30日	10,331
2021年1月29日	10,418
2021年2月26日	10,183
2021年3月31日	10,972
2021年4月30日	10,649
2021年5月31日	10,514
2021年6月30日	10,860
2021年7月30日	10,737
2021年8月31日	11,478
2021年9月30日	12,097
2021年10月29日	12,052

掲載番号 3

トップシェアインデックス（ネットリターン）ETN 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。)	受益者の皆様へ
第 1 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「トップシェアインデックス（ネットリターン）ETN」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 10 月 31 日現在	
2020 年 11 月 24 日～2021 年 10 月 31 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	トップシェアインデックス（ネットリターン）ETN
銘柄コード	2072
信託期間	信託設定の日から信託終了の日まで
委託者	三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社
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、iSTOXX MUTB ジャパントップシェアインデックス（ネットリターン）（以下、「本指標」といいます。）に連動する債券（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外国指標連動証券の一証券あたりの償還価額は、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	原則として、信託期間中に分配は行いません。

■信託財産を構成する資産の内容

1. 三菱UFJ証券ホールディングス株式会社発行の外国指標連動証券（外国債券）

資産の種類	外国指標連動証券
資産の名称	iSTOXX MUTB ジャパントップシェアインデックス（ネットリターン）連動債
数量	1,000,000 口（2021 年 10 月 31 日時点）
価格	10,343,000,000 円（2021 年 10 月 31 日時点）（注 1）（注 2）
一口あたりの価格	10,343 円（2021 年 10 月 31 日時点）（注 3）
保管機関	受託者の指定するカストディアン

注 1：外国指標連動証券の残存償還価格の総額を記載しております。

注2：計算期間末日（2021年10月31日）時点における外国指標連動証券の価格を記載しております。

注3：外国指標連動証券の一口あたりの償還価格を記載しております。

2. 金銭

資産の種類	金銭（注）
価 格	0円（2021年10月31日現在）

注：上記金銭は、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

本信託の純資産総額（注）
10,343,000,000円

注：決算期日末日時点の状況です。日々の状況につきましては、東京証券取引所の適時開示情報閲覧サービス(TDnet)をご覧ください。

■取引の状況（自2020年11月24日至2021年10月31日）

1. 信託の設定、解約 （千円未満切捨て）

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）
1,000,000	10,110,400	—	—

2. 自己またはその利害関係人等との取引状況

該当事項はありません。

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、ルクセンブルグ三菱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、純資産価額および損益の状況

<貸借対照表>

当計算期間末（2021年10月31日）現在
 （単位：千円）

資産の部	
固定資産	
投資有価証券	10,343,000
固定資産合計	10,343,000
資産合計	10,343,000
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	10,110,400
元本合計	10,110,400
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	232,600
評価・換算差額等合計	232,600
元本等合計	10,343,000
負債・元本等合計	10,343,000

< 損益計算書 (注1) (注2) > 当計算期間 (自 2020年11月24日 至 2021年10月31日)
(単位: 千円)

経常収益	—
経常費用	—
経常利益	—
当期純利益	—
前期繰越利益	—
当期末処分利益	—
利益処分別	—
次期繰越利益	—

注1: 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。

注2: 当計算期間において損益等の発生する取引は生じておりません。

■信託財産の銀行勘定への運用について

該当事項はございません。

■収益の分配の状況について

分配金はありません。

■信託財産の価額の推移

日付	一口あたりの信託財産の価額 (単位: 円)
2020年11月30日	10,024
2020年12月30日	10,087
2021年1月29日	10,354
2021年2月26日	10,303
2021年3月31日	10,900
2021年4月30日	10,523
2021年5月31日	10,575
2021年6月30日	10,612
2021年7月30日	10,218
2021年8月31日	10,376
2021年9月30日	10,713
2021年10月29日	10,343