

UBS MSCI先進国ESG株式 インデックス・ファンド

愛称：みらいゲート・先進国ESG

*当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/内外/株式/インデックス型	
信託期間	無期限	
運用方針	この投資信託は、先進国の環境、社会、ガバナンスへの取り組み評価が高い企業の株式で構成されるMSCIワールドSRIロー・カーボン・セレクト 5%イシューアード・キャップド・インデックス（税引後配当込み、円換算ベース）に概ね連動する投資成果を目指して運用を行います。	
主な投資対象	ルクセンブルグ籍外国投資信託 UBS ETF (LU) MSCIワールド・ソーシヤリー・レスポンシブルUCITS ETF	MSCIワールドSRIロー・カーボン・セレクト 5%イシューアード・キャップド・インデックスを構成する企業の株式を主要投資対象とします。
	UBS短期円金利プラス・ファンド（適格機関投資家向け）	わが国のコマーシャル・ペーパーを含む短期金融商品および内外の円建ての公社債を実質的な主たる投資対象とし、円定期金利を上回る信託財産の安定的な成長を目指して運用を行います。
主な投資制限	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②株式への直接投資は行いません。 ③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ④デリバティブの直接利用は行いません。ただし、指定上場投資信託においてはデリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）を行う場合があります。その場合は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 ⑤同一銘柄の投資信託証券への投資割合には制限を設けません。ただし、当該投資信託証券が一般社団法人投資信託協会の規則に定めるエクスポーチャーがリックスルーできる場合に該当しないときには、当該投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ⑥一般社団法人投資信託協会規則に定める一者に対する株式等エクスポーチャー、債券等エクスポーチャーおよびデリバティブ等エクスポーチャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。	
分配方針	毎決算時（原則として毎年9月5日。ただし、休業日の場合は翌営業日とします。）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。 ①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②収益分配金額は、上記①の範囲内で、市況動向等を勘案して委託者が決定します。ただし、委託者の判断で、分配を行わないことがあります。 ③収益の分配にあてなかった利益については、運用の基本方針に基づいて元本部分と同一の運用を行います。	

第4期 運用報告書（全体版）
決算日 2022年9月5日

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、「UBS MSCI先進国ESG株式インデックス・ファンド」は、去る9月5日に第4期の決算を行いましたので、期中の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。

UBSアセット・マネジメント株式会社

東京都千代田区大手町一丁目2番1号
Otemachi Oneタワー

<お問い合わせ先>

投信営業部
03-5293-3700

<受付時間>

営業日の午前9時～午後5時、土、日、祝日除く

<http://www.ubs.com/japanfunds>

© UBS 2022. キーシンボル及びUBSの各標章は、UBSの登録又は未登録商標です。UBSは全ての権利を留保します。

設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税 込 分 配 金	期 騰 落 率	ベンチマーク	期 騰 落 率	投資信託 証券組入 率	純 資 産 総 額
				MSCIワールドSRIロー・ カーボン・セレクト5%イ シューア・キャップド・ インデックス(税引後配 当込み、円換算ベース)			
(設定日) 2019年1月29日	円 10,000	円 -	% -	10,000	% -	% -	百万円 10
1期(2019年9月5日)	10,622	0	6.2	10,789	7.9	99.3	35
2期(2020年9月7日)	12,053	0	13.5	12,559	16.4	97.4	171
3期(2021年9月6日)	16,625	0	37.9	17,410	38.6	95.8	880
4期(2022年9月5日)	17,024	0	2.4	17,658	1.4	98.8	1,203

(注1) 基準価額および分配金は1万口当たり。

(注2) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注3) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

(注4) ベンチマークは2020年12月1日までMSCIワールドSRI 5%イシューア・キャップド・インデックス(税引後配当込み、USDベース)、それ以降はMSCIワールドSRIロー・カーボン・セレクト 5%イシューア・キャップド・インデックス(税引後配当込み、USDベース)に基づいて委託会社において円換算したものです。設定日当日を10,000として指数化しています。

(注5) 投資信託証券組入比率は、当ファンドの追加・解約と有価証券売買の計上タイミングがずれること等により、一時的に100%超の数値となる場合があります(以下同じ。)

当期中の基準価額等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベ ン チ マ ー ク		投資信託証券 組入比率
		騰 落 率		騰 落 率	
(期 首) 2021年 9月6日	円 16,625	% -	MSCIワールドSRIロー・ カーボン・セレクト5%イ 슈어・キャップド・ インデックス (税引後配 当込み、円換算ベース)	% -	% 95.8
9月末	16,212	△2.5	17,410	△ 2.7	97.7
10月末	17,611	5.9	18,505	6.3	95.9
11月末	17,658	6.2	18,607	6.9	98.1
12月末	18,152	9.2	19,166	10.1	95.4
2022年 1月末	16,189	△2.6	17,216	△ 1.1	97.1
2月末	16,073	△3.3	16,971	△ 2.5	97.6
3月末	17,809	7.1	18,758	7.7	97.0
4月末	16,936	1.9	17,722	1.8	98.9
5月末	16,612	△0.1	17,450	0.2	97.1
6月末	16,098	△3.2	16,988	△ 2.4	95.7
7月末	16,877	1.5	17,879	2.7	99.5
8月末	16,862	1.4	17,756	2.0	99.3
(期 末) 2022年 9月5日	17,024	2.4	17,658	1.4	98.8

(注1) 基準価額は1万口当たり。

(注2) 騰落率は期首比です。

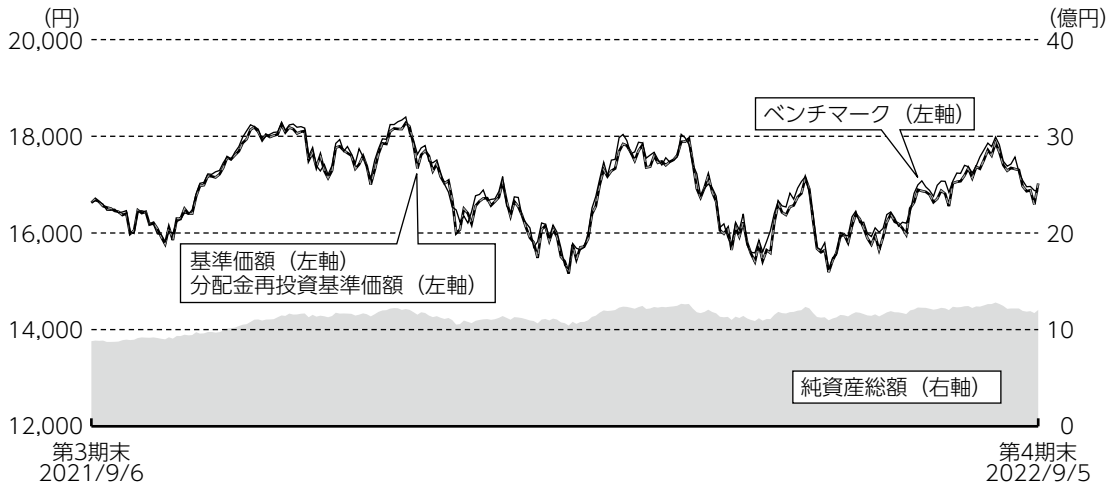
(注3) ベンチマークは2020年12月1日までMSCIワールドSRI 5%イシュー・キャップド・インデックス (税引後配当込み、USDベース)、それ以降はMSCIワールドSRIロー・カーボン・セレクト 5%イシュー・キャップド・インデックス (税引後配当込み、USDベース) に基づいて委託会社において円換算したものです。設定日当日を10,000として指数化しています。

※UBS MSCI先進国ESG株式インデックス・ファンドおよびMSCIワールドSRIロー・カーボン・セレクト 5%イシュー・キャップド・インデックス (税引後配当込み、円換算ベース) に関して、MSCIはスポンサーではなく、またその保証ないし販売促進もしておらず、さらに、それらファンドの責任を負うものではありません。(The funds or securities referred to herein are not sponsored, endorsed, or promoted by MSCI, and MSCI bears no liability with respect to any such funds or securities or any index on which such funds or securities are based.)

運用経過

基準価額等の推移について

(2021年9月6日～2022年9月5日)



第4期首：16,625円

第4期末：17,024円（既払分配金 0円）

騰落率： 2.4%（分配金再投資ベース）

- (注1) 分配金再投資基準価額は、収益分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、各個人のおお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首の値を基準価額と同一となるように指数化しています。

基準価額は期首比で399円値上がりしました。なお、基準価額の騰落率は+2.4%となりました。

ベンチマークについて

ベンチマークとは、ファンドの運用を行うに当たり、運用目標の基準あるいはパフォーマンスを評価するための基準です。なお、当ファンドのベンチマークは「MSCI ワールド SRI ロー・カーボン・セレクト 5% イシューアー・キャップド・インデックス（税引後配当込み、USDベース）」を委託会社において円換算した「MSCI ワールド SRI ロー・カーボン・セレクト 5% イシューアー・キャップド・インデックス（税引後配当込み、円換算ベース）」です。また、当ファンドはベンチマークに概ね連動する投資成果を目指して運用を行います。

※UBS MSCI先進国ESG株式インデックス・ファンドおよびMSCI ワールド SRI ロー・カーボン・セレクト 5% イシューアー・キャップド・インデックス（税引後配当込み、円換算ベース）に関して、MSCIはスポンサーではなく、またその保証ないし販売促進もしておらず、さらに、それらファンドの責任を負うものではありません。（The funds or securities referred to herein are not sponsored, endorsed, or promoted by MSCI, and MSCI bears no liability with respect to any such funds or securities or any index on which such funds or securities are based.）

基準価額の主な変動要因

当ファンドの基準価額は、為替市場における米ドル高・円安の進行が主なプラス要因となり、前期末比で上昇しました。

投資環境について

当期のグローバル株式市場は下落しました。2021年後半の株式市場は、世界的なインフレ圧力の高まりやオミクロン株の感染拡大などの懸念材料はあったものの、堅調な企業業績と新型コロナワクチン接種の普及による経済活動の正常化期待などに下支えされて、概ね上昇基調で推移しました。しかし2022年に入ると、米連邦準備制度理事会（FRB）のタカ派姿勢を警戒した長期金利の急上昇に加え、2月終盤のロシアによるウクライナ侵攻とこれに伴う資源価格の高騰、世界的な金融引き締め加速観測などを背景に、株価は大幅に下落しました。6月半ば以降、米国の利上げ加速観測の後退に加え、値ごろ感から買い戻しの動きも活発化、株価は一時回復に向かいました。しかし期末にかけては、インフレ抑制を重視するパウエルFRB議長のタカ派的発言から米国の大幅利上げ観測が再燃し、再び下落基調に転じました。

為替市場では、主要通貨に対して円が下落しました。世界各国の中央銀行が金融政策の正常化を進めたのに対し、日銀は金融緩和政策を維持したことから金利差拡大が意識され、2022年3月以降、急速に円安が進みました。

ポートフォリオについて

当ファンドのポートフォリオについて

上場投資信託であるUBS ETF (LU) MSCIワールド・ソーシャリー・レスポンシブルUCITS ETF およびUBS短期円金利プラス・ファンド（適格機関投資家向け）を投資対象とします。主として上記上場投資信託への投資を通じて、MSCI ワールド SRI ロー・カーボン・セレクト 5% イシューアー・キャップド・インデックスの騰落率に概ね連動する投資成果を目指して運用を行いました。なお、期初より上記上場投資信託の組入比率は可能な限り高位を維持しました。

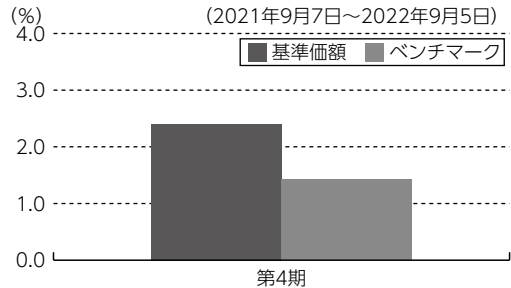
UBS短期円金利プラス・ファンド（適格機関投資家向け）のポートフォリオについて

UBS短期円金利プラス・マザーファンドへの投資を通じて、わが国のコマーシャル・ペーパーを含む短期金融商品および内外の円建ての公社債に投資を行い、利息等収入の確保を目指して運用を行いました。当期におきましては、利回りの優位性を勘案しつつ、コール・ローン等での運用を行いました。

ベンチマークとの差異について

当期中の騰落率は、基準価額の+2.4%に対してベンチマークが+1.4%となり、基準価額の騰落率はベンチマークの騰落率を1.0%上回りました。基準価額の騰落率がベンチマークの騰落率を上回った主な要因は、ベンチマークと上場投資信託の評価基準の差異や、ファンドにおけるキャッシュ保有によるものです。

基準価額とベンチマークの対比（騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金再投資ベース

分配金について

当期は、市場動向等を勘案し、分配は行いませんでした。なお、分配にあてなかった利益につきましては、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

分配原資の内訳

(1万口当たり・税引前)

項目	第4期
	2021年9月7日～2022年9月5日
当期分配金	-円
(対基準価額比率)	(-%)
当期の収益	-円
当期の収益以外	-円
翌期繰越分配対象額	7,024円

(注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は、「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注2) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注3) 「当期の収益」、「当期の収益以外」は小数点以下切捨てで算出しているため、合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。

今後の運用方針

当ファンドの今後の運用方針

UBS ETF (LU) MSCIワールド・ソーシヤリー・レスポンシブルUCITS ETFの投資比率を高位に維持し、ベンチマークに概ね連動する投資成果を目指して運用を行います。

UBS短期円金利プラス・ファンド（適格機関投資家向け）の今後の運用方針

短期金融市場の状況を注視しつつ、UBS短期円金利プラス・マザーファンドへの投資を通じて、コール・ローン等で運用する予定です。

1万口当たりの費用明細

項目	当期 2021/9/7~2022/9/5		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	36円	0.214%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 ※期中の平均基準価額（月末値の平均）は16,924円です。
（投信会社）	（ 4）	（0.022）	委託した資金の運用の対価
（販売会社）	（28）	（0.165）	運用報告書等各種書類の交付、口座内でのファンドに係る管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	（ 5）	（0.027）	運用財産の管理、運用指図実行等の対価
売買委託手数料	18	0.104	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数
（投資信託証券）	（18）	（0.104）	投資信託証券を取引所で売買する際に売買仲介人に支払う手数料
その他費用	18	0.106	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	（ 4）	（0.023）	海外保管銀行等に支払う海外資産等の保管・送金・受渡等に係る費用
（監査費用）	（ 4）	（0.022）	監査法人等に支払うファンド監査に係る費用
（印刷費用等）	（10）	（0.059）	法定開示書類作成の際に業者に支払う作成・印刷・交付等に係る費用（EDINET含む）等
（その他）	（ 0）	（0.001）	受益権の管理事務に関連する費用等
合計	72	0.424	

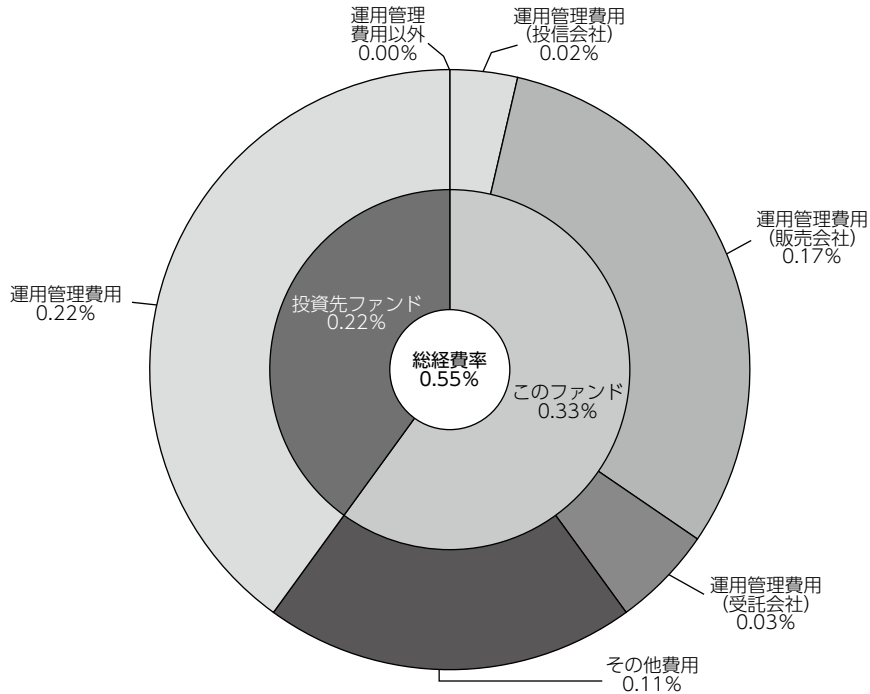
(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は、追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(注4) 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

(参考情報) 総経費率



総経費率 (①+②+③)	0.55%
①このファンドの費用の比率	0.33%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.22%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.00%

(注1) ①の費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) ②・③の費用は、当該投資先ファンドの期中の平均純資産総額で除して算出した概算値です。

(注3) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注4) 各比率は、年率換算した値です。

(注5) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注6) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.55%です。

期中の売買及び取引の状況 (自 2021年9月7日 至 2022年9月5日)

投資信託証券

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
外国				
UBS ETF (LU) MSCI ワールド・ソーシャリー・レスポンシブルUCITS ETF	□ 123,866	千米ドル 3,376	□ 23,338	千米ドル 583

(注1) 金額は受け渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切り捨て。

利害関係人等との取引状況等 (自 2021年9月7日 至 2022年9月5日)

期中の利害関係人等との取引はありません。

(注) 利害関係人等とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人等です。

組入資産明細表 (2022年9月5日現在)

(1) 国内投資信託証券 (邦貨建)

ファンド名	期 首	当 期		末
	□ 数	□ 数	評 価 額	比 率
UBS短期円金利プラス・ファンド (適格機関投資家向け)	□ 10,020	□ 10,020	千円 9	% 0.0
合 計	10,020	10,020	9	0.0

(注) 単位未満は切り捨て。

(2) 外国投資信託証券 (外貨建)

ファンド名	期 首	当 期		末	
	□ 数	□ 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
UBS ETF (LU) MSCIワールド・ソー シャリー・レスポンシブルUCITS ETF	□ 273,528	□ 374,056	千米ドル 8,476	千円 1,189,621	% 98.8
合 計	□ 数 ・ 金 額 273,528	374,056	8,476	1,189,621	
	銘柄数 <比率>	1	1	-	<98.8%>

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=140.35円です。

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 単位未満は切り捨て。

投資信託財産の構成

(2022年9月5日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 9	% 0.0
投 資 証 券	1,189,621	98.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	16,568	1.4
投 資 信 託 財 産 総 額	1,206,198	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切り捨て。

(注2) 当期末における外貨建純資産 (1,189,621千円) の投資信託財産総額 (1,206,198千円) に対する比率は98.6%です。

(注3) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=140.35円です。

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年9月5日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	1,206,198,103円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	16,566,262
投資信託受益証券(評価額)	9,949
投資証券(評価額)	1,189,621,892
(B) 負 債	2,602,912
未 払 解 約 金	835,768
未 払 信 託 報 酬	1,264,714
未 払 利 息	46
そ の 他 未 払 費 用	502,384
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,203,595,191
元 本	706,981,064
次 期 繰 越 損 益 金	496,614,127
(D) 受 益 権 総 口 数	706,981,064口
1万口当たり基準価額(C/D)	17.024円

(注記事項)

期首元本額 529,854,940円

期中追加設定元本額 516,451,628円

期中一部解約元本額 339,325,504円

1口当たり純資産額 17.024円

損益の状況

(自2021年9月7日 至2022年9月5日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 29,653円
支 払 利 息	△ 29,653
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	15,962,823
売 買 益	302,388,737
売 買 損	△286,425,914
(C) 信 託 報 酬 等	△ 3,614,878
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	12,318,292
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	62,983,660
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	421,312,175
(配 当 等 相 当 額)	(144,134,504)
(売 買 損 益 相 当 額)	(277,177,671)
(G) 計 (D+E+F)	496,614,127
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	496,614,127
追 加 信 託 差 損 益 金	421,312,175
(配 当 等 相 当 額)	(144,134,504)
(売 買 損 益 相 当 額)	(277,177,671)
分 配 準 備 積 立 金	75,331,605
繰 越 損 益 金	△ 29,653

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 計算期間末における費用控除後の配当等収益 (0円)、費用控除後の有価証券等損益額 (12,339,495円)、信託約款に規定する収益調整金 (421,282,522円) および分配準備積立金 (62,992,110円) より分配対象収益は496,614,127円 (10,000口当たり7,024円) ですが、分配を行っておりません。

<約款変更（予定）のお知らせ>

当ファンドの主要投資対象である外国上場投資信託の名称に関して、2022年12月の目論見書改訂にあわせて名称変更を行う予定です。

ルクセンブルク籍外国上場投資信託 UBS (Lux) Fund Solutions – MSCI World Socially Responsible UCITS ETFの運用状況

<参考情報>

当ファンドは、「UBS MSCI先進国ESG株式インデックス・ファンド」が投資対象とする外国投資証券です。ご参考として、掲載されている当ファンドの損益計算書、投資明細表は、2021年12月31日現在の現地Annual Reportからの抜粋であり、現地の会計基準に基づき作成され、監査を受けたものです。

損益計算書

計算期間終了日 2021年12月31日
米ドル

収益	
配当金 (外国源泉徴収税控除後)	59,905,468
収益合計	<u>59,905,468</u>
費用	
運用管理報酬	9,555,285
取引手数料	73,480
コール勘定の引き落とし利息	57,285
費用合計	<u>9,686,050</u>
投資純利益 (損失)	<u>50,219,418</u>
実現純利益 (損失) :	
投資	418,119,146
外国通貨取引および為替予約取引	7,194,690
先物取引	1,053,562
未実現利益 (損失) の純変動額 :	
投資	476,113,275
外国通貨取引	(142,345)
先物取引	50,576

2021年12月31日現在の投資明細表（米ドル）

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

銘柄	株数	評価額 (米ドル)	純資産 比率 (%)
普通株式			
広告 (0.10%)			
Interpublic Group of Companies	140,100	5,246,745	0.10
航空・防衛産業 (0.14%)			
Teledyne Technologies	16,561	7,235,335	0.14
農業 (0.09%)			
Bunge	51,077	4,768,549	0.09
アパレル (0.68%)			
adidas	66,145	19,045,723	0.36
Burberry Group	136,023	3,348,496	0.07
Puma	38,466	4,702,429	0.09
VF	117,477	8,601,666	0.16
自動車製造 (4.78%)			
Cummins	50,003	10,907,654	0.20
Tesla	228,088	241,038,837	4.58
自動車部品・装置 (0.70%)			
Aptiv	94,976	15,666,291	0.30
Compagnie Generale des Etablissements Michelin	57,495	9,425,003	0.18
Magna International	100,703	8,159,721	0.15
Stanley Electric	42,600	1,065,046	0.02
Valeo	79,630	2,406,958	0.05
銀行 (5.74%)			
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	2,338,488	13,961,472	0.27
Bank Leumi Le-Israel	512,299	5,505,848	0.10
Bank of New York Mellon	285,209	16,564,939	0.31
Bank of Nova Scotia	423,380	30,015,183	0.57
BOC Hong Kong Holdings	1,285,500	4,212,835	0.08
CaixaBank	1,444,558	3,965,601	0.08
Canadian Imperial Bank of Commerce	155,387	18,138,632	0.34
DBS Group Holdings	638,002	15,456,103	0.29
DNB Bank	330,401	7,568,466	0.14
Hang Seng Bank	266,300	4,874,237	0.09
Huntington Bancshares	516,553	7,965,247	0.15
Intesa Sanpaolo	5,853,315	15,136,627	0.29
KBC Group	88,899	7,628,698	0.14
KeyCorp	333,520	7,714,318	0.15
Macquarie Group	122,187	18,246,929	0.35
National Bank of Canada	117,260	8,952,662	0.17
Northern Trust	69,245	8,282,394	0.16
Oversea-Chinese Banking	1,170,392	9,896,873	0.19
PNC Financial Services Group	148,716	29,820,532	0.57
Regions Financial	332,498	7,248,456	0.14
Resona Holdings	783,700	3,044,830	0.06
Shizuoka Bank	159,800	1,140,685	0.02
State Street	127,100	11,820,300	0.22
Sumitomo Mitsui Trust Holdings	124,800	4,164,877	0.08
SVB Financial Group	20,293	13,763,524	0.26
Truist Financial	465,006	27,226,101	0.52
飲料 (3.35%)			
Coca-Cola	1,430,958	84,727,023	1.61
Coca-Cola Europacific Partners	75,516	4,223,610	0.08
Coca-Cola HBC	70,519	2,440,395	0.04
PepsiCo	481,259	83,599,501	1.59
Suntory Beverage & Food	44,400	1,603,960	0.03

銘柄	株数	評価額 (米ドル)	純資産 比率 (%)
建築資材 (1.39%)			
Carrier Global	288,610	15,654,207	0.30
Daikin Industries	86,700	19,643,116	0.37
Fortune Brands Home & Security	49,789	5,322,444	0.10
James Hardie Industries - CDI	159,038	6,394,261	0.12
Johnson Controls International	248,756	20,226,350	0.38
Lennox International	12,040	3,905,294	0.08
TOTO	49,200	2,260,154	0.04
化学 (2.25%)			
Akzo Nobel	65,922	7,234,265	0.14
Asahi Kasei	449,700	4,221,490	0.08
Croda International	48,800	6,689,033	0.13
Ecolab	90,224	21,165,648	0.40
Givaudan - Registered	3,212	16,892,832	0.32
International Flavors & Fragrances	86,658	13,055,028	0.25
Johnson Matthey	66,065	1,830,797	0.03
Kansai Paint	59,600	1,293,908	0.02
Koninklijke DSM	61,082	13,753,562	0.26
Nitto Denko	51,200	3,952,655	0.07
Novozymes - Class B	73,870	6,067,500	0.12
PPG Industries	82,204	14,175,258	0.27
Sumitomo Chemical	508,500	2,393,357	0.05
Toray Industries	467,900	2,770,303	0.05
Umicore	73,130	2,973,092	0.06
商業サービス (3.64%)			
Ashtead Group	158,252	12,736,347	0.24
Automatic Data Processing	146,982	36,242,822	0.69
Brambles	508,550	3,930,350	0.08
Bureau Veritas	92,977	3,085,301	0.06
Dai Nippon Printing	77,400	1,944,494	0.04
IHS Markit	132,601	17,625,325	0.34
Moody's	58,515	22,854,789	0.43
RELX	682,502	22,204,446	0.42
Ritchie Bros Auctioneers	40,380	2,474,620	0.05
Robert Half International	40,823	4,552,581	0.09
S&P Global	84,121	39,699,224	0.75
Secom	76,400	5,298,340	0.10
SGS - Registered	2,120	7,089,546	0.13
Sohgo Security Services	24,900	988,172	0.02
Transurban Group	1,064,467	10,695,586	0.20
コンピューター (0.38%)			
Computershare	197,055	2,865,377	0.05
Fujitsu	69,300	11,873,466	0.23
Nomura Research Institute	120,000	5,142,634	0.10
化粧品・パーソナルケア (1.48%)			
Beiersdorf	36,526	3,754,146	0.07
Colgate-Palmolive	280,412	23,930,360	0.45
Kao	165,700	8,660,921	0.17
L'Oreal	87,404	41,443,081	0.79
流通・卸売 (1.01%)			
DCC	35,293	2,892,058	0.05
Fastenal	198,674	12,727,057	0.24
Ferguson	76,913	13,652,110	0.26
LKQ	94,273	5,659,208	0.11
Pool	13,763	7,789,858	0.15
Toromont Industries	28,900	2,616,478	0.05
WW Grainger	15,621	8,095,427	0.15

銘柄	株数	評価額 (米ドル)	純資産 比率 (%)
各種金融サービス (3.95%)			
Ally Financial	127,860	6,087,415	0.12
American Express	236,153	38,634,631	0.73
Ameriprise Financial	40,020	12,072,433	0.23
Amundi	22,202	1,831,750	0.03
ASX	65,709	4,438,180	0.08
BlackRock	53,336	48,832,308	0.93
CME Group	125,612	28,697,318	0.55
Deutsche Boerse	66,776	11,170,428	0.21
Hong Kong Exchanges & Clearing	426,172	24,893,697	0.47
Invesco	113,808	2,619,860	0.05
Isracard	0	2	0.00
Schroders	43,829	2,113,365	0.04
Singapore Exchange	262,800	1,812,885	0.03
St James's Place	183,843	4,192,019	0.08
Standard Life Aberdeen	760,812	2,482,431	0.05
T Rowe Price Group	80,053	15,741,622	0.30
TMX Group	19,700	2,000,178	0.04
Tokyo Century	9,200	445,799	0.01
電気 (0.50%)			
AusNet Services	714,813	1,335,642	0.02
Elia Group	10,279	1,352,449	0.03
Eversource Energy	121,043	11,012,492	0.21
Hydro One	116,149	3,026,136	0.06
Mercury	296,529	1,242,474	0.02
Meridian Energy	442,100	1,468,017	0.03
Red Electrica	139,545	3,019,087	0.06
Terna Rete Elettrica Nazionale	486,321	3,934,356	0.07
電気部品・設備 (0.85%)			
Generac Holdings	22,248	7,829,516	0.15
Schneider Electric	188,234	36,916,728	0.70
電子機器 (1.01%)			
Agilent Technologies	104,957	16,756,385	0.32
Allegion	30,892	4,091,336	0.08
Azbil	43,400	1,974,869	0.04
Fortive	120,267	9,175,169	0.17
Mettler-Toledo International	7,942	13,479,242	0.25
Trimble	88,787	7,741,339	0.15
エネルギー代替 (0.23%)			
Ballard Power Systems	91,572	1,151,945	0.02
Vestas Wind Systems	351,071	10,735,706	0.21
土木・建設 (0.30%)			
Auckland International Airport	430,867	2,271,447	0.04
Lendlease	240,265	1,867,379	0.04
Obayashi	227,200	1,755,964	0.03
Shimizu	183,400	1,135,550	0.02
Sydney Airport	445,153	2,809,269	0.06
WSP Global	40,172	5,839,991	0.11
娯楽 (0.08%)			
Vail Resorts	13,486	4,422,059	0.08
環境制御 (0.11%)			
Kurita Water Industries	34,800	1,650,019	0.03
Pentair	59,058	4,313,006	0.08

銘柄	株数	評価額 (米ドル)	純資産 比率 (%)
食品 (1.87%)			
Aeon	224,900	5,290,731	0.10
Campbell Soup	70,167	3,049,458	0.06
Carrefour	208,113	3,811,507	0.07
Danone	226,865	14,083,719	0.27
General Mills	210,774	14,201,952	0.27
George Weston	28,221	3,276,643	0.06
Hormel Foods	105,836	5,165,855	0.10
J Sainsbury	562,142	2,099,923	0.04
Jeronimo Martins	98,979	2,262,434	0.04
Kellogg	90,040	5,800,377	0.11
Kerry Group - Class A	54,567	7,027,568	0.13
Kesko - Class B	94,696	3,159,574	0.06
Kikkoman	49,100	4,123,112	0.08
Kobe Bussan	50,900	1,969,167	0.04
Koninklijke Ahold Delhaize	363,779	12,466,529	0.23
Metro	87,385	4,657,213	0.09
Mowi	148,597	3,516,799	0.07
Orkla	271,826	2,723,716	0.05
林産品・紙製品 (0.42%)			
International Paper	132,557	6,227,528	0.12
Mondi	166,859	4,126,800	0.08
Smurfit Kappa Group	78,118	4,303,205	0.08
Stora Enso - Class R	216,739	3,978,115	0.07
Svenska Cellulosa - Class B	209,658	3,722,452	0.07
ガス (0.22%)			
Atmos Energy	48,282	5,058,505	0.10
Enagas	82,150	1,905,788	0.04
Snam	740,639	4,463,949	0.08
ヘルスケア製品 (3.70%)			
ABIOMED	15,556	5,587,249	0.11
Align Technology	26,350	17,316,693	0.33
Ambu - Class B	58,663	1,551,730	0.03
Cochlear	22,186	3,486,088	0.07
Coloplast - Class B	42,438	7,468,543	0.14
Cooper Companies	17,462	7,315,530	0.14
DENTSPLY SIRONA	73,456	4,098,110	0.08
Edwards Lifesciences	217,349	28,157,563	0.54
EssilorLuxottica	99,661	21,220,745	0.40
Fisher & Paykel Healthcare	202,988	4,552,846	0.09
Henry Schein	48,281	3,743,226	0.07
Hologic	88,504	6,775,866	0.13
IDEXX Laboratories	29,922	19,702,440	0.37
Insulet	23,417	6,230,561	0.12
ResMed	50,520	13,159,450	0.25
Sonova Holding - Registered	19,107	7,503,138	0.14
STERIS	35,263	8,583,367	0.16
Sysmex	58,000	7,832,052	0.15
Waters	21,820	8,130,132	0.15
West Pharmaceutical Services	26,010	12,198,950	0.23
ヘルスケアサービス (1.81%)			
Centene	202,350	16,673,640	0.32
DaVita	22,839	2,598,165	0.05
HCA Healthcare	89,458	22,983,549	0.43
Humana	45,061	20,901,995	0.40
IQVIA Holdings	66,706	18,820,431	0.36
Quest Diagnostics	43,058	7,449,465	0.14
Ryman Healthcare	163,777	1,373,592	0.02
Teladoc Health	51,536	4,732,035	0.09

銘柄	株数	評価額 (米ドル)	純資産 比率 (%)
住宅建設 (0.26%)			
Barratt Developments	347,820	3,523,864	0.07
Berkeley Group Holdings	39,843	2,576,846	0.05
Sekisui House	220,700	4,731,955	0.09
Taylor Wimpey	1,260,663	2,996,672	0.05
住宅用家具 (1.33%)			
Electrolux - Class B	75,026	1,818,917	0.04
GN Store Nord	44,911	2,824,341	0.05
Hoshizaki	15,100	1,134,254	0.02
Panasonic	785,300	8,626,673	0.17
Sony	440,700	55,396,053	1.05
家庭用品 (0.25%)			
Clorox	43,621	7,605,758	0.14
Henkel & Co	37,950	2,964,867	0.06
Newell Brands	130,282	2,845,359	0.05
保険 (3.21%)			
Allianz - Registered	143,933	33,988,270	0.65
AXA	678,596	20,206,943	0.38
CNP Assurances	63,031	1,559,015	0.03
Insurance Australia Group	861,955	2,669,676	0.05
Intact Financial	61,670	8,027,377	0.15
Marsh & McLennan Companies	176,674	30,709,475	0.58
MS&AD Insurance Group Holdings	165,100	5,088,271	0.10
NN Group	95,263	5,157,737	0.10
Prudential Financial	133,802	14,482,728	0.28
Sompo Holdings	109,400	4,616,166	0.09
Sun Life Financial	200,871	11,196,871	0.21
Swiss Life Holding - Registered	11,157	6,844,936	0.13
Swiss Re	105,200	10,421,283	0.20
Travelers Companies	88,288	13,810,892	0.26
インターネット (1.48%)			
eBay	225,773	15,013,904	0.29
SEEK	111,674	2,661,493	0.05
Shopify - Class A	39,671	54,700,221	1.04
Z Holdings	942,300	5,461,257	0.10
鉄鋼 (0.24%)			
Fortescue Metals Group	593,476	8,288,861	0.16
Steel Dynamics	69,550	4,316,969	0.08
レジャー (0.09%)			
Yamaha	47,100	2,319,109	0.04
Yamaha Motor	109,300	2,618,720	0.05
宿泊施設 (0.07%)			
City Developments	163,600	826,404	0.02
Whitbread	70,510	2,860,293	0.05
機械－建設・鉱業 (0.91%)			
Caterpillar	191,335	39,556,598	0.75
Hitachi Construction Machinery	38,000	1,097,217	0.02
Komatsu	312,100	7,300,085	0.14
機械－各種 (0.98%)			
CNH Industrial	362,173	7,030,502	0.13
Dover	49,632	9,013,171	0.17
Husqvarna - Class B	157,104	2,513,463	0.05
IDEX	25,865	6,112,417	0.12
Ingersoll Rand	783	48,444	0.00
Miura	28,900	993,826	0.02
Rockwell Automation	40,355	14,077,842	0.27
Xylem	63,310	7,592,135	0.14
Yaskawa Electric	82,700	4,050,436	0.08

銘柄	株数	評価額 (米ドル)	純資産 比率 (%)
メディア (2.63%)			
Cable One	1,966	3,466,943	0.06
FactSet Research Systems	12,955	6,296,260	0.12
Informa	500,911	3,504,919	0.07
Liberty Global - Class A	54,220	1,504,063	0.03
Liberty Global - Class C	128,031	3,596,391	0.07
Thomson Reuters	59,235	7,093,756	0.13
Vivendi	269,359	3,642,085	0.07
Walt Disney	634,843	98,330,832	1.87
Wolters Kluwer	93,321	10,994,510	0.21
金属加工・金物 (0.12%)			
Omron	63,100	6,279,588	0.12
鉱業 (0.92%)			
Agnico Eagle Mines	82,074	4,365,714	0.08
Antofagasta	138,958	2,519,213	0.05
Boliden	91,162	3,524,103	0.07
Evolution Mining	647,305	1,910,730	0.04
Franco-Nevada	67,755	9,383,731	0.18
Newmont	276,253	17,133,211	0.32
Northern Star Resources	385,914	2,640,247	0.05
Wheaton Precious Metals	159,110	6,837,265	0.13
その他製造 (0.94%)			
AO Smith	45,655	3,919,482	0.07
Illinois Tool Works	110,548	27,283,246	0.52
Orica	143,515	1,428,450	0.03
Trane Technologies	83,728	16,915,568	0.32
事務機器 (0.18%)			
FUJIFILM Holdings	126,100	9,336,361	0.18
石油・ガス (0.61%)			
Ampol	80,575	1,737,544	0.03
Neste	149,464	7,369,918	0.14
Parkland	51,300	1,412,105	0.03
Phillips 66	150,874	10,932,330	0.21
Valero Energy	143,151	10,752,072	0.20
包装・容器 (0.21%)			
Ball	113,686	10,944,551	0.21
医薬品・バイオテクノロジー (8.60%)			
AmerisourceBergen	54,667	7,264,698	0.14
Amgen	197,248	44,374,883	0.84
Amplifon	43,547	2,349,802	0.04
Astellas Pharma	652,000	10,590,647	0.20
Becton Dickinson & Co	99,986	25,144,479	0.48
Biogen	51,680	12,399,066	0.24
Cardinal Health	103,821	5,345,743	0.10
Chugai Pharmaceutical	236,500	7,670,770	0.15
DexCom	33,908	18,206,901	0.35
Eisai	80,400	4,559,875	0.09
Genmab	23,169	9,316,841	0.18
Gilead Sciences	437,527	31,768,836	0.60
Illumina	51,576	19,621,573	0.37
Jazz Pharmaceuticals	20,706	2,637,944	0.05
Merck	45,315	11,697,811	0.22
Novo Nordisk - Class B	588,613	66,148,932	1.26
Orion - Class B	35,647	1,480,439	0.03
Roche Holding	246,294	102,474,955	1.95
Shionogi & Co	92,500	6,526,529	0.12
Vertex Pharmaceuticals	89,929	19,748,408	0.37
Vifor Pharma	18,260	3,251,589	0.06
Zoetis	164,606	40,168,802	0.76

銘柄	株数	評価額 (米ドル)	純資産 比率 (%)
未公開株式 (0.05%)			
Capitaland Investment	933,512	2,361,218	0.05
不動産 (0.65%)			
CBRE Group - Class A	117,056	12,701,747	0.24
FirstService	13,400	2,637,248	0.05
Hulic	122,300	1,159,755	0.02
Mitsui Fudosan	317,800	6,288,110	0.12
REA Group	18,254	2,224,846	0.04
Sumitomo Realty & Development	106,100	3,116,984	0.06
Sun Hung Kai Properties	444,500	5,393,546	0.10
Swire Properties	352,000	882,224	0.02
不動産投資信託 (2.23%)			
British Land - REIT	321,230	2,310,328	0.04
Crown Castle International - REIT	151,443	31,612,212	0.60
Gecina - REIT	15,721	2,197,196	0.04
Mirvac Group - REIT	1,283,387	2,715,282	0.05
Orix JREIT - REIT	929	1,450,516	0.03
Prologis - REIT	258,232	43,475,939	0.83
Segro - REIT	415,350	8,081,330	0.15
Stockland - REIT	832,843	2,567,399	0.05
Unibail-Rodamco-Westfield - REIT - FR	21,805	1,527,969	0.03
Unibail-Rodamco-Westfield - REIT - NL	21,237	1,488,167	0.03
Ventas - REIT	140,338	7,174,079	0.14
Welltower - REIT	148,166	12,708,198	0.24
小売 (6.11%)			
Best Buy	79,019	8,028,330	0.15
Canadian Tire - Class A	19,987	2,870,951	0.05
Coles Group	472,902	6,168,193	0.12
Fast Retailing	20,200	11,456,402	0.22
Home Depot	368,352	152,869,764	2.90
Industria de Diseno Textil	375,661	12,188,061	0.23
JD Sports Fashion	930,280	2,744,319	0.05
Kingfisher	744,330	3,410,598	0.07
Lowe's Companies	242,107	62,579,817	1.19
Pandora	34,830	4,342,400	0.08
Target	170,836	39,538,284	0.75
Tractor Supply	40,159	9,581,937	0.18
Zalando	76,493	6,188,314	0.12
半導体 (9.00%)			
Applied Materials	315,116	49,586,654	0.94
ASML Holding	144,412	116,058,011	2.20
Lam Research	49,568	35,646,827	0.68
NVIDIA	825,781	242,870,450	4.61
Tokyo Electron	52,000	29,929,747	0.57
造船 (0.04%)			
Wartsila	165,003	2,319,247	0.04
ソフトウェア (12.96%)			
Adobe	166,133	94,207,379	1.79
ANSYS	30,774	12,344,067	0.23
Capcom	62,200	1,462,703	0.03
Cerner	102,946	9,560,595	0.18
Electronic Arts	98,758	13,026,180	0.25
HubSpot	15,701	10,349,314	0.20
Intuit	95,456	61,399,208	1.17
Microsoft	777,029	261,330,393	4.96
Roper Technologies	37,361	18,376,382	0.35
salesforce.com	341,038	86,667,987	1.64
SAP	365,558	51,922,486	0.99
ServiceNow	69,198	44,917,114	0.85
Take-Two Interactive Software	41,411	7,359,563	0.14
XERO	45,228	4,650,975	0.09
ZoomInfo Technologies	76,995	4,943,079	0.09

銘柄	株数	評価額 (米ドル)	純資産 比率 (%)
電気通信 (3.13%)			
BT Group	3,035,804	6,971,633	0.13
Cisco Systems	1,468,279	93,044,840	1.77
Elisa	50,106	3,083,786	0.06
KDDI	558,600	16,308,569	0.31
Motorola Solutions	59,967	16,293,034	0.31
Rogers Communications - Class B	127,530	6,080,934	0.11
Singapore Telecommunications - NPV	2,875,400	4,948,209	0.09
Spark New Zealand	647,708	2,004,409	0.04
Swisscom - Registered	8,912	5,033,326	0.10
Tele2 - Class B	185,179	2,640,491	0.05
Telefonica Deutschland Holding	362,434	1,006,082	0.02
Telenor	251,320	3,950,076	0.07
Telia	909,389	3,556,158	0.07
玩具・ゲーム・趣味 (0.09%)			
Hasbro	44,530	4,532,263	0.09
輸送 (1.51%)			
CH Robinson Worldwide	47,864	5,151,602	0.10
Deutsche Post - Registered	346,435	22,274,826	0.42
East Japan Railway	107,600	6,608,960	0.13
Expeditors International of Washington	60,254	8,091,510	0.15
Hankyu Hanshin Holdings	77,900	2,208,706	0.04
Keio	35,700	1,571,786	0.03
Knight-Swift Transportation Holdings	53,980	3,289,541	0.06
Kuehne + Nagel International - Registered	18,564	5,998,180	0.11
Nippon Express	26,200	1,550,545	0.03
Odakyu Electric Railway	101,900	1,890,134	0.04
Old Dominion Freight Line	35,023	12,551,543	0.24
SG Holdings	108,000	2,525,674	0.05
Tokyu	179,000	2,375,164	0.05
West Japan Railway	78,000	3,258,043	0.06
水道 (0.18%)			
Severn Trent	80,994	3,232,928	0.06
Suez	122,943	2,769,651	0.06
United Utilities Group	221,463	3,266,571	0.06
普通株式合計		5,253,044,127	99.76
優先株式			
家庭用品 (0.10%)			
Henkel & Co	63,756	5,157,885	0.10
優先株式合計		5,157,885	0.10
投資合計 (Cost USD 4,059,445,487)		5,258,202,012	99.86
その他純資産		7,321,981	0.14
純資産合計		5,265,523,993	100.00

先物取引

銘柄	相手方	評価額	株数	未実現評価益 (損) (米ドル)	純資産 比率 (%)
FTSE 100 Index Futures 18/03/2022	UBS AG	1,884,799	19	20,716	0.00
S&P 500 E-Mini Index Futures 18/03/2022	UBS AG	3,568,875	15	41,288	0.00
TOPIX Index Futures 10/03/2022	UBS AG	1,383,874	8	25,745	0.00
先物取引合計		6,837,548	42	87,749	0.00

UBS短期円金利プラス・ファンド（適格機関投資家向け）

参考情報

当ファンドは、UBS MSCI先進国ESG株式インデックス・ファンドが投資対象とする国内投資信託証券です。ご参考として第13期決算日（2022年1月20日）の運用状況をご報告申し上げます。

UBS短期円金利プラス・ファンド（適格機関投資家向け）

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額	税 込 配 金	期 騰 落 中 率	債 券 組 入 率	債 券 先 物 率	純 資 産 額
				比	比	
9期（2018年1月22日）	円 9,997	円 0	% △0.1	% —	% —	百万円 40
10期（2019年1月21日）	9,982	0	△0.2	—	—	40
11期（2020年1月20日）	9,967	0	△0.2	—	—	40
12期（2021年1月20日）	9,953	0	△0.1	—	—	15
13期（2022年1月20日）	9,938	0	△0.2	—	—	8

(注1) 基準価額は1万口当たり。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は買建比率－売建比率。

当期中の基準価額等の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	債 券 組 入 率	債 券 先 物 率
			比	比
(期 首) 2021年 1月20日	円 9,953	% —	% —	% —
1月末	9,952	△0.0	—	—
2月末	9,951	△0.0	—	—
3月末	9,950	△0.0	—	—
4月末	9,949	△0.0	—	—
5月末	9,948	△0.1	—	—
6月末	9,947	△0.1	—	—
7月末	9,946	△0.1	—	—
8月末	9,944	△0.1	—	—
9月末	9,943	△0.1	—	—
10月末	9,942	△0.1	—	—
11月末	9,941	△0.1	—	—
12月末	9,940	△0.1	—	—
(期 末) 2022年 1月20日	9,938	△0.2	—	—

(注1) 基準価額は1万口当たり。

(注2) 騰落率は期首比です。

(注3) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注4) 債券先物比率は買建比率－売建比率。

分配原資の内訳 (1万口当たり・税引前)

項目	第13期	
	2021年1月21日～2022年1月20日	
当期分配金	-円	
(対基準価額比率)	(-%)	
当期の収益	-円	
当期の収益以外	-円	
翌期繰越分配対象額	75円	

- (注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売却等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は、「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
- (注2) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。
- (注3) 「当期の収益」、「当期の収益以外」は小数点以下切捨てで算出しているため、合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2021/1/21～2022/1/20		
	金額	比率	
信託報酬	4円	0.044%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 ※期中の平均基準価額(月末値の平均)は9,946円です。
(投信会社)	(1)	(0.011)	委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(0)	(0.001)	運用報告書等各種書類の交付、口座内でのファンドに係る管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(3)	(0.032)	運用財産の管理、運用指図実行等の対価
その他費用	0	0.002	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(その他)	(0)	(0.002)	受益権の管理事務に関連する費用等
合計	4	0.046	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は、追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、その他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

親投資信託受益証券の設定、解約状況 (自 2021年1月21日 至 2022年1月20日)

	設		解	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
UBS短期円金利プラス・マザーファンド	20	20	7,000	7,000

(注) 単位未満は切り捨て。

利害関係人等との取引状況等 (自 2021年1月21日 至 2022年1月20日)

期中の利害関係人等との取引はありません。

(注) 利害関係人等とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人等です。

組入資産明細表

親投資信託残高

(2022年1月20日現在)

項目	期首		期末	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
UBS短期円金利プラス・マザーファンド	15,588		8,608	8,602

(注) 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

投資信託財産の構成

(2022年1月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
UBS短期円金利プラス・マザーファンド	千円 8,602	% 99.8
コール・ローン等、その他	15	0.2
投資信託財産総額	8,617	100.0

(注) 金額の単位未満は切り捨て。

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年1月20日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	8,617,321円
コール・ローン等	14,383
UBS短期円金利プラス・マザーファンド(評価額)	8,602,938
(B) 負 債	1,953
未払信託報酬	1,866
その他未払費用	87
(C) 純資産総額(A-B)	8,615,368
元 本	8,668,768
次期繰越損益金	△ 53,400
(D) 受益権総口数	8,668,768口
1口当たり基準価額(C/D)	9,938円

〈注記事項〉

期首元本額 15,687,365円
 期中追加設定元本額 20,116円
 期中一部解約元本額 7,038,713円
 1口当たり純資産額 0.9938円
 純資産総額が元本を下回っており、その差額は53,400円です。

損益の状況

(自2021年1月21日 至2022年1月20日)

項 目	当 期
(A) 有価証券売買損益	△ 6,803円
売 買 益	3,497
売 買 損	△ 10,300
(B) 信託報酬等	△ 5,413
(C) 当期損益金(A+B)	△ 12,216
(D) 前期繰越損益金	△ 44,285
(E) 追加信託差損益金	3,101
(配当等相当額)	(4,222)
(売買損益相当額)	(△ 1,121)
(F) 計 (C+D+E)	△ 53,400
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	△ 53,400
追加信託差損益金	3,101
(配当等相当額)	(4,221)
(売買損益相当額)	(△ 1,120)
分配準備積立金	60,965
繰越損益金	△117,466

(注1) 損益の状況の中で(A)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(B)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) 損益の状況の中で(E)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(4,221円)および分配準備積立金(60,965円)より分配対象収益は65,186円(10,000口当たり75円)ですが、分配を行っておりません。

UBS短期円金利プラス・マザーファンドの運用状況

参考情報

当ファンドは、UBS短期円金利プラス・ファンド（適格機関投資家向け）が投資対象とする親投資信託で、信託財産の実質的な運用を行っております。

ご参考として、第13期決算日（2022年1月20日）の運用状況をご報告申し上げます。

UBS短期円金利プラス・マザーファンド

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額	期 騰 落 中 率	債 券 組 入 率	債 券 先 物 率	純 資 産 額
			比	比	
9期 (2018年1月22日)	円 10,035	% △0.1	% -	% -	百万円 40
10期 (2019年1月21日)	10,025	△0.1	-	-	40
11期 (2020年1月20日)	10,014	△0.1	-	-	40
12期 (2021年1月20日)	10,004	△0.1	-	-	15
13期 (2022年1月20日)	9,994	△0.1	-	-	8

(注1) 基準価額は1万口当たり。

(注2) 債券先物比率は買建比率-売建比率。

当期中の基準価額等の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	債 券 組 入 率	債 券 先 物 率
			比	比
(期 首) 2021年 1月20日	円 10,004	% -	% -	% -
1月末	10,004	0.0	-	-
2月末	10,003	△0.0	-	-
3月末	10,002	△0.0	-	-
4月末	10,002	△0.0	-	-
5月末	10,001	△0.0	-	-
6月末	10,000	△0.0	-	-
7月末	9,999	△0.0	-	-
8月末	9,998	△0.1	-	-
9月末	9,997	△0.1	-	-
10月末	9,997	△0.1	-	-
11月末	9,996	△0.1	-	-
12月末	9,995	△0.1	-	-
(期 末) 2022年 1月20日	9,994	△0.1	-	-

(注1) 基準価額は1万口当たり。

(注2) 騰落率は期首比です。

(注3) 債券先物比率は買建比率-売建比率。

1万口当たりの費用明細

該当事項はありません。

期中の売買及び取引の状況 (自 2021年1月21日 至 2022年1月20日)

該当事項はありません。

主要な売買銘柄 (自 2021年1月21日 至 2022年1月20日)

該当事項はありません。

利害関係人等との取引状況等 (自 2021年1月21日 至 2022年1月20日)

期中の利害関係人等との取引はありません。

(注) 利害関係人等とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人等です。

組入資産明細表 (2022年1月20日現在)

2022年1月20日現在、有価証券等の組入はありません。

投資信託財産の構成

(2022年1月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	千円 8,603	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	8,603	100.0

(注) 金額の単位未満は切り捨て。

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年1月20日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	8,603,221円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	8,603,221
(B) 負 債	24
未 払 利 息	24
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	8,603,197
元 本	8,608,103
次 期 繰 越 損 益 金	△ 4,906
(D) 受 益 権 総 口 数	8,608,103口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	9,994円

〈注記事項〉

期首元本額	15,588,797円
期中追加設定元本額	20,007円
期中一部解約元本額	7,000,701円
1口当たり純資産額	0.9994円

純資産総額が元本を下回っており、その差額は4,906円です。

[当マザーファンドの当期末における元本の内訳]

UBS短期円金利プラス・ファンド (適格機関投資家向け)	8,608,103円
------------------------------	------------

損益の状況

(自2021年1月21日 至2022年1月20日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△12,393円
支 払 利 息	△12,393
(B) 当 期 損 益 金(A)	△12,393
(C) 前 期 繰 越 損 益 金	6,793
(D) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 7
(E) 解 約 差 損 益 金	701
(F) 計 (B+C+D+E)	△ 4,906
次 期 繰 越 損 益 金(F)	△ 4,906

(注1) 損益の状況の中で(D)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注2) 損益の状況の中で(E)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。