

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)

## 2019年9月期(2018年10月1日～2019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	<a href="#">UBS ETF ユーロ圏大型株 50 (ユーロ・ストックス 50)</a>	1385	東
2	<a href="#">UBS ETF 欧州株 (MSCI ヨーロッパ)</a>	1386	東
3	<a href="#">UBS ETF ユーロ圏株 (MSCI EMU)</a>	1387	東
4	<a href="#">UBS ETF ユーロ圏小型株 (MSCI EMU 小型株)</a>	1388	東
5	<a href="#">UBS ETF 英国大型株 100 (FTSE 100)</a>	1389	東
6	<a href="#">UBS ETF MSCI アジア太平洋株 (除く日本)</a>	1390	東
7	<a href="#">UBS ETF スイス株 (MSCI スイス 20/35)</a>	1391	東
8	<a href="#">UBS ETF 英国株 (MSCI 英国)</a>	1392	東
9	<a href="#">UBS ETF 米国株 (MSCI 米国)</a>	1393	東
10	<a href="#">UBS ETF 先進国株 (MSCI ワールド)</a>	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・ストックス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 5 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・ストックス 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。
2019 年 9 月 30 日現在	
2018 年 10 月 1 日～2019 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・ストックス 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、野村證券株式会社、 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・ストックス 50 <sup>®</sup> 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 - ユーロ・ストックス 50 UCITS ETF A-DIS クラス
純資産総額	48,721,828,195 円 (2019年9月30日現在) (注1)
1口当りの純資産額	4,204 円 (2019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"> <li>• Portfolio Manager (運用者) UBS Asset Management Switzerland AG, Zurich Bahnhofstrasse 45, CH-8098 Zurich, Switzerland</li> <li>• 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</li> <li>• Company Administrator (受託者) State Street Bank Luxembourg S. C. A. 49, Avenue J. F. Kennedy, L-1855 Luxembourg</li> <li>• Compliance Administrator (運用監督者) State Street Bank Luxembourg S. C. A. 49, Avenue J. F. Kennedy, L-1855 Luxembourg-Kirchberg</li> <li>• Auditors of the Company (監査法人) PricewaterhouseCoopers, Réviseur d'entreprises agréé, 2, rue Gerhard Mercator B. P. 1443, L-1014 Luxembourg</li> </ul>
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（2019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 (2019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

(2019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)
558,650,061	133,000

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 2018年10月1日 至 2019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)
28,000	123,249	—	—

### 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（2019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		558,650
固定資産合計		558,650
資産合計		558,650
負債の部		
負債合計		—
元本等の部		
元本		
受益権		605,848
元本合計		605,848
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		△47,198
評価・換算差額等合計		△47,198
元本等合計		558,650
負債・元本等合計		558,650

<損益計算書（注）>

当計算期間（自 2018年10月1日 至 2019年9月30日）

（単位：千円）

経常収益		16,591
経常費用		316
経常利益		16,275
当期純利益		16,275
前期繰越利益		—
当期末処分利益		16,275
利益処分額		
受益権収益分配金		△16,275
受益権収益分配金合計		△16,275
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)
19,488.00	2019年2月7日	123.42	2,405,208
119,048.30	2019年8月8日	117.37	13,972,698

#### ■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)
2,405,208	2019年2月12日～2019年2月13日	0
13,972,698	2019年8月13日～2019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)
2019年1月30日	2019年3月8日	22
2019年7月30日	2019年9月6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) (注)
2018年10月31日	4,105
2018年11月30日	4,099
2018年12月31日	3,819
2019年1月31日	3,948
2019年2月28日	4,153
2019年3月29日	4,178
2019年4月30日	4,398
2019年5月31日	4,077
2019年6月28日	4,350
2019年7月31日	4,192
2019年8月30日	4,025
2019年9月30日	4,211

(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 5 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。
2019 年 9 月 30 日現在	
2018 年 10 月 1 日～2019 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 ヨーロッパ UCITS ETF A-DIS クラス
純資産総額	38,171,584,486 円 (2019年9月30日現在) (注1)
1口当りの純資産額	7,617 円 (2019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"> <li>• Portfolio Manager (運用者) UBS Asset Management Switzerland AG, Zurich Bahnhofstrasse 45, CH-8098 Zurich, Switzerland</li> <li>• 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</li> <li>• Company Administrator (受託者) State Street Bank Luxembourg S. C. A. 49, Avenue J. F. Kennedy, L-1855 Luxembourg</li> <li>• Compliance Administrator (運用監督者) State Street Bank Luxembourg S. C. A. 49, Avenue J. F. Kennedy, L-1855 Luxembourg-Kirchberg</li> <li>• Auditors of the Company (監査法人) PricewaterhouseCoopers, Réviseur d'entreprises agréé, 2, rue Gerhard Mercator B. P. 1443, L-1014 Luxembourg</li> </ul>
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（2019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 (2019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**

(2019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)
328,300,948	43,000

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 2018年10月1日 至 2019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. 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（2019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		328,300
固定資産合計		328,300
資産合計		328,300
負債の部		
負債合計		—
元本等の部		
元本		
受益権		335,527
元本合計		335,527
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		△7,227
評価・換算差額等合計		△7,227
元本等合計		328,300
負債・元本等合計		328,300

<損益計算書（注）>

当計算期間（自 2018年10月1日 至 2019年9月30日）

（単位：千円）

経常収益	10,229
経常費用	167
経常利益	10,062
当期純利益	10,062
前期繰越利益	—
当期末処分利益	10,062
利益処分額	
受益権収益分配金	△10,062
受益権収益分配金合計	△10,062
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)
18,963.00	2019年2月7日	123.42	2,340,413
66,103.90	2019年8月8日	117.37	7,758,614

#### ■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)
2,340,413	2019年2月12日～2019年2月13日	0
7,758,614	2019年8月13日～2019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)
2019年1月30日	2019年3月8日	54
2019年7月30日	2019年9月6日	180

#### ■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)(注)
2018年10月31日	7,661
2018年11月30日	7,638
2018年12月31日	7,094
2019年1月31日	7,368
2019年2月28日	7,729
2019年3月29日	7,846
2019年4月30日	7,983
2019年5月31日	7,526
2019年6月28日	7,908
2019年7月31日	7,660
2019年8月30日	7,328
2019年9月30日	7,629

(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 5 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。
2019 年 9 月 30 日現在	
2018 年 10 月 1 日～2019 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	155,916,797,074 円 (2019年9月30日現在) (注1)
1口当りの純資産額	14,558 円 (2019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"> <li>• Portfolio Manager (運用者) UBS Asset Management Switzerland AG, Zurich Bahnhofstrasse 45, CH-8098 Zurich, Switzerland</li> <li>• 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</li> <li>• Company Administrator (受託者) State Street Bank Luxembourg S. C. A. 49, Avenue J. F. Kennedy, L-1855 Luxembourg</li> <li>• Compliance Administrator (運用監督者) State Street Bank Luxembourg S. C. A. 49, Avenue J. F. Kennedy, L-1855 Luxembourg-Kirchberg</li> <li>• Auditors of the Company (監査法人) PricewaterhouseCoopers, Réviseur d'entreprises agréé, 2, rue Gerhard Mercator B.P. 1443, L-1014 Luxembourg</li> </ul>
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（2019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 (2019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

(2019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)
65,501,129	4,500

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 2018年10月1日 至 2019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. 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インバ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（2019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		65,501
固定資産合計		65,501
資産合計		65,501
負債の部		
負債合計		—
元本等の部		
元本		
受益権		69,943
元本合計		69,943
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		△4,442
評価・換算差額等合計		△4,442
元本等合計		65,501
負債・元本等合計		65,501

<損益計算書（注）>

当計算期間（自 2018年10月1日 至 2019年9月30日）

（単位：千円）

経常収益	1,868
経常費用	32
経常利益	1,836
当期純利益	1,836
前期繰越利益	—
当期末処分利益	1,836
利益処分額	
受益権収益分配金	△1,836
受益権収益分配金合計	△1,836
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)
2,108.70	2019年2月7日	123.42	260,255
13,493.70	2019年8月8日	117.37	1,583,755

#### ■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)
260,255	2019年2月12日～2019年2月13日	0
1,583,755	2019年8月13日～2019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)
2019年1月30日	2019年3月8日	57
2019年7月30日	2019年9月6日	351

#### ■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) (注)
2018年10月31日	14,604
2018年11月30日	14,561
2018年12月31日	13,471
2019年1月31日	14,051
2019年2月28日	14,713
2019年3月29日	14,728
2019年4月30日	15,474
2019年5月31日	14,291
2019年6月28日	15,119
2019年7月31日	14,618
2019年8月30日	14,012
2019年9月30日	14,581

(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 5 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。
2019 年 9 月 30 日現在	
2018 年 10 月 1 日～2019 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 小型株 UCITS ETF A-DIS クラス
純資産総額	11,128,567,522 円 (2019年9月30日現在) (注1)
1口当りの純資産額	11,253 円 (2019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"> <li>• Portfolio Manager (運用者) UBS Asset Management Switzerland AG, Zurich Bahnhofstrasse 45, CH-8098 Zurich, Switzerland</li> <li>• 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</li> <li>• Company Administrator (受託者) State Street Bank Luxembourg S. C. A. 49, Avenue J. F. Kennedy, L-1855 Luxembourg</li> <li>• Compliance Administrator (運用監督者) State Street Bank Luxembourg S. C. A. 49, Avenue J. F. Kennedy, L-1855 Luxembourg-Kirchberg</li> <li>• Auditors of the Company (監査法人) PricewaterhouseCoopers, Réviseur d'entreprises agréé, 2, rue Gerhard Mercator B. P. 1443, L-1014 Luxembourg</li> </ul>
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（2019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 (2019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

(2019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)
42,686,192	3,800

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 2018年10月1日 至 2019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. 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（2019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		42,686
固定資産合計		42,686
資産合計		42,686
負債の部		
負債合計		—
元本等の部		
元本		
受益権		42,878
元本合計		42,878
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		△ 192
評価・換算差額等合計		△ 192
元本等合計		42,686
負債・元本等合計		42,686

<損益計算書（注）>

当計算期間（自 2018年10月1日 至 2019年9月30日）

（単位：千円）

経常収益	929
経常費用	14
経常利益	915
当期純利益	915
前期繰越利益	—
当期末処分利益	915
利益処分額	
受益権収益分配金	△ 915
受益権収益分配金合計	△ 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)
926.82	2019年2月7日	123.42	114,388
6,843.42	2019年8月8日	117.37	803,212

#### ■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)
114,388	2019年2月12日～2019年2月13日	0
803,212	2019年8月13日～2019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)
2019年1月30日	2019年3月8日	30
2019年7月30日	2019年9月6日	211

#### ■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) (注)
2018年10月31日	11,633
2018年11月30日	11,431
2018年12月31日	10,476
2019年1月31日	11,157
2019年2月28日	11,594
2019年3月29日	11,644
2019年4月30日	12,203
2019年5月31日	11,192
2019年6月28日	11,785
2019年7月31日	11,499
2019年8月30日	10,974
2019年9月30日	11,271

(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 5 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。
2019 年 9 月 30 日現在	
2018 年 10 月 1 日～2019 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	8,582,953,377 円 (2019年9月30日現在) (注1)
1口当りの純資産額	9,183 円 (2019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"> <li>• Portfolio Manager (運用者) UBS Asset Management (UK) Ltd. 5 Broadgate, London, EC2M 2QS London, United Kingdom</li> <li>• 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</li> <li>• Company Administrator (受託者) State Street Bank Luxembourg S. C. A. 49, Avenue J. F. Kennedy, L-1855 Luxembourg</li> <li>• Compliance Administrator (運用監督者) State Street Bank Luxembourg S. C. A. 49, Avenue J. F. Kennedy, L-1855 Luxembourg-Kirchberg</li> <li>• Auditors of the Company (監査法人) PricewaterhouseCoopers, Réviseur d'entreprises agréé, 2, rue Gerhard Mercator B. P. 1443, L-1014 Luxembourg</li> </ul>
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（2019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 (2019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

(2019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)
50,644,662	5,500

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 2018年10月1日 至 2019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. 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（2019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		50,644
固定資産合計		50,644
資産合計		50,644
負債の部		
負債合計		—
元本等の部		
元本		
受益権		62,683
元本合計		62,683
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		△12,039
評価・換算差額等合計		△12,039
元本等合計		50,644
負債・元本等合計		50,644

<損益計算書（注）>

当計算期間（自 2018年10月1日 至 2019年9月30日）

（単位：千円）

経常収益		2,166
経常費用		71
経常利益		2,095
当期純利益		2,095
前期繰越利益		—
当期末処分利益		2,095
利益処分額		
受益権収益分配金		△2,095
受益権収益分配金合計		△2,095
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)
6,526.30	2019年2月7日	138.18	901,804
9,601.35	2019年8月8日	124.94	1,199,592

#### ■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)
901,804	2019年2月12日～2019年2月13日	0
1,199,592	2019年8月13日～2019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)
2019年1月30日	2019年3月8日	163
2019年7月30日	2019年9月6日	218

#### ■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) (注)
2018年10月31日	9,571
2018年11月30日	9,488
2018年12月31日	8,867
2019年1月31日	9,176
2019年2月28日	9,696
2019年3月29日	9,831
2019年4月30日	10,002
2019年5月31日	9,286
2019年6月28日	9,564
2019年7月31日	9,217
2019年8月30日	8,686
2019年9月30日	9,149

(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 5 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。
2019 年 9 月 30 日現在	
2018 年 10 月 1 日～2019 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、野村證券株式会社、 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 パシフィック (除く日本) UCITS ETF A-DIS クラス
純資産総額	16,482,496,219 円 (2019年9月30日現在) (注1)
1口当りの純資産額	4,566 円 (2019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"> <li>• Portfolio Manager (運用者) UBS Asset Management (UK) Ltd. 5 Broadgate, London, EC2M 2QS London, United Kingdom</li> <li>• 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</li> <li>• Company Administrator (受託者) State Street Bank Luxembourg S. C. A. 49, Avenue J. F. Kennedy, L-1855 Luxembourg</li> <li>• Compliance Administrator (運用監督者) State Street Bank Luxembourg S. C. A. 49, Avenue J. F. Kennedy, L-1855 Luxembourg-Kirchberg</li> <li>• Auditors of the Company (監査法人) PricewaterhouseCoopers, Réviseur d'entreprises agréé, 2, rue Gerhard Mercator B. P. 1443, L-1014 Luxembourg</li> </ul>
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（2019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 (2019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

(2019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)
143,442,787	31,500

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 2018年10月1日 至 2019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)
3,500	16,259	—	—

### 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（2019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		143,442
固定資産合計		143,442
資産合計		143,442
負債の部		
負債合計		—
元本等の部		
元本		
受益権		159,089
元本合計		159,089
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		△15,647
評価・換算差額等合計		△15,647
元本等合計		143,442
負債・元本等合計		143,442

<損益計算書（注）>

当計算期間（自 2018年10月1日 至 2019年9月30日）

（単位：千円）

経常収益		5,723
経常費用		62
経常利益		5,661
当期純利益		5,661
前期繰越利益		—
当期末処分利益		5,661
利益処分額		
受益権収益分配金		△5,661
受益権収益分配金合計		△5,661
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)
22,591.10	2019年2月8日	108.82	2,458,363
30,583.35	2019年8月8日	105.07	3,213,392

#### ■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)
2,458,363	2019年2月13日～2019年2月14日	0
3,213,392	2019年8月13日～2019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)
2019年1月30日	2019年3月8日	83
2019年7月30日	2019年9月6日	102

#### ■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) (注)
2018年10月31日	4,421
2018年11月30日	4,557
2018年12月31日	4,368
2019年1月31日	4,512
2019年2月28日	4,764
2019年3月29日	4,813
2019年4月30日	4,931
2019年5月31日	4,688
2019年6月28日	4,911
2019年7月31日	4,807
2019年8月30日	4,439
2019年9月30日	4,560

(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 5 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。
2019 年 9 月 30 日現在	
2018 年 10 月 1 日～2019 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	13,308,397,241 円 (2019年9月30日現在) (注1)
1口当りの純資産額	2,103 円 (2019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"> <li>• Portfolio Manager (運用者) UBS Asset Management Switzerland AG, Zurich Bahnhofstrasse 45, CH-8098 Zurich, Switzerland</li> <li>• 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</li> <li>• Company Administrator (受託者) State Street Bank Luxembourg S. C. A. 49, Avenue J. F. Kennedy, L-1855 Luxembourg</li> <li>• Compliance Administrator (運用監督者) State Street Bank Luxembourg S. C. A. 49, Avenue J. F. Kennedy, L-1855 Luxembourg-Kirchberg</li> <li>• Auditors of the Company (監査法人) PricewaterhouseCoopers, Réviseur d'entreprises agréé, 2, rue Gerhard Mercator B. P. 1443, L-1014 Luxembourg</li> </ul>
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（2019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 (2019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

(2019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)
159,898,460	76,000

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 2018年10月1日 至 2019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. 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（2019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		159,898
固定資産合計		159,898
資産合計		159,898
負債の部		
負債合計		—
元本等の部		
元本		
受益権		154,285
元本合計		154,285
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		5,613
評価・換算差額等合計		5,613
元本等合計		159,898
負債・元本等合計		159,898

<損益計算書（注）>

当計算期間（自 2018年10月1日 至 2019年9月30日）

（単位：千円）

経常収益		2,588
経常費用		80
経常利益		2,508
当期純利益		2,508
前期繰越利益		—
当期末処分利益		2,508
利益処分額		
受益権収益分配金		△2,508
受益権収益分配金合計		△2,508
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)
23,788.00	2019年8月8日	107.88	2,566,249

#### ■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)
2,566,249	2019年8月13日～2019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)
2019年7月30日	2019年9月6日	33

#### ■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) (注)
2018年10月31日	1,925
2018年11月30日	1,937
2018年12月31日	1,786
2019年1月31日	1,859
2019年2月28日	1,965
2019年3月29日	2,022
2019年4月30日	2,063
2019年5月31日	2,016
2019年6月28日	2,125
2019年7月31日	2,095
2019年8月30日	2,064
2019年9月30日	2,112

(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 5 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。
2019 年 9 月 30 日現在	
2018 年 10 月 1 日～2019 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	772,304,427 円 (2019年9月30日現在) (注1)
1口当りの純資産額	2,508 円 (2019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"> <li>• Portfolio Manager (運用者) UBS Asset Management (UK) Ltd. 5 Broadgate, London, EC2M 2QS London, United Kingdom</li> <li>• 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</li> <li>• Company Administrator (受託者) State Street Bank Luxembourg S. C. A. 49, Avenue J. F. Kennedy, L-1855 Luxembourg</li> <li>• Compliance Administrator (運用監督者) State Street Bank Luxembourg S. C. A. 49, Avenue J. F. Kennedy, L-1855 Luxembourg-Kirchberg</li> <li>• Auditors of the Company (監査法人) PricewaterhouseCoopers, Réviseur d'entreprises agréé, 2, rue Gerhard Mercator B. P. 1443, L-1014 Luxembourg</li> </ul>
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（2019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 (2019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

(2019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)
78,278,347	31,000

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 2018年10月1日 至 2019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. 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（2019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		78,278
固定資産合計		78,278
資産合計		78,278
負債の部		
負債合計		—
元本等の部		
元本		
受益権		92,811
元本合計		92,811
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		△14,533
評価・換算差額等合計		△14,533
元本等合計		78,278
負債・元本等合計		78,278

<損益計算書（注）>

当計算期間（自 2018年10月1日 至 2019年9月30日）

（単位：千円）

経常収益	3,387
経常費用	132
経常利益	3,255
当期純利益	3,255
前期繰越利益	—
当期末処分利益	3,255
利益処分額	
受益権収益分配金	△3,255
受益権収益分配金合計	△3,255
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)
10,152.50	2019年2月7日	138.18	1,402,872
15,072.20	2019年8月8日	124.94	1,883,120

#### ■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)
1,402,872	2019年2月12日～2019年2月13日	0
1,883,120	2019年8月13日～2019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)
2019年1月30日	2019年3月8日	45
2019年7月30日	2019年9月6日	60

#### ■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) (注)
2018年10月31日	2,626
2018年11月30日	2,606
2018年12月31日	2,431
2019年1月31日	2,518
2019年2月28日	2,659
2019年3月29日	2,694
2019年4月30日	2,735
2019年5月31日	2,543
2019年6月28日	2,619
2019年7月31日	2,519
2019年8月30日	2,372
2019年9月30日	2,499

(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 5 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。
2019 年 9 月 30 日現在	
2018 年 10 月 1 日～2019 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	61,219,710,589 円 (2019年9月30日現在) (注1)
1口当りの純資産額	30,890 円 (2019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"> <li>• Portfolio Manager (運用者) UBS Asset Management (UK) Ltd. 5 Broadgate, London, EC2M 2QS London, United Kingdom</li> <li>• 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</li> <li>• Company Administrator (受託者) State Street Bank Luxembourg S. C. A. 49, Avenue J. F. Kennedy, L-1855 Luxembourg</li> <li>• Compliance Administrator (運用監督者) State Street Bank Luxembourg S. C. A. 49, Avenue J. F. Kennedy, L-1855 Luxembourg-Kirchberg</li> <li>• Auditors of the Company (監査法人) PricewaterhouseCoopers, Réviseur d'entreprises agréé, 2, rue Gerhard Mercator B. P. 1443, L-1014 Luxembourg</li> </ul>
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（2019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 (2019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

(2019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)
154,331,071	5,000

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 2018年10月1日 至 2019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. 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インバ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（2019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		154,331
固定資産合計		154,331
資産合計		154,331
負債の部		
負債合計		—
元本等の部		
元本		
受益権		131,291
元本合計		131,291
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		23,040
評価・換算差額等合計		23,040
元本等合計		154,331
負債・元本等合計		154,331

<損益計算書（注）>

当計算期間（自 2018年10月1日 至 2019年9月30日）

（単位：千円）

経常収益		1,911
経常費用		21
経常利益		1,890
当期純利益		1,890
前期繰越利益		—
当期末処分利益		1,890
利益処分額		
受益権収益分配金		△1,890
受益権収益分配金合計		△1,890
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)
8,772.50	2019年2月18日	109.53	960,851
8,880.00	2019年8月8日	105.07	933,021

#### ■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)
960,851	2019年2月20日～2019年2月21日	0
933,021	2019年8月13日～2019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)
2019年1月30日	2019年3月8日	192
2019年7月30日	2019年9月6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) (注)
2018年10月31日	29,505
2018年11月30日	30,113
2018年12月31日	26,789
2019年1月31日	28,252
2019年2月28日	29,683
2019年3月29日	30,250
2019年4月30日	31,692
2019年5月31日	29,002
2019年6月28日	30,577
2019年7月31日	31,087
2019年8月30日	29,911
2019年9月30日	30,845

(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 5 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。
2019 年 9 月 30 日現在	
2018 年 10 月 1 日～2019 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 ワールド UCITS ETF A-DIS クラス
純資産総額	117,915,650,975 円 (2019年9月30日現在) (注1)
1口当りの純資産額	23,563 円 (2019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"> <li>• Portfolio Manager (運用者) UBS Asset Management (UK) Ltd. 5 Broadgate, London, EC2M 2QS London, United Kingdom</li> <li>• 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</li> <li>• Company Administrator (受託者) State Street Bank Luxembourg S. C. A. 49, Avenue J. F. Kennedy, L-1855 Luxembourg</li> <li>• Compliance Administrator (運用監督者) State Street Bank Luxembourg S. C. A. 49, Avenue J. F. Kennedy, L-1855 Luxembourg-Kirchberg</li> <li>• Auditors of the Company (監査法人) PricewaterhouseCoopers, Réviseur d'entreprises agréé, 2, rue Gerhard Mercator B.P. 1443, L-1014 Luxembourg</li> </ul>
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（2019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 (2019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

(2019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)
94,090,077	4,000

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 2018年10月1日 至 2019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. 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（2019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		94,090
固定資産合計		94,090
資産合計		94,090
負債の部		
負債合計		—
元本等の部		
元本		
受益権		87,376
元本合計		87,376
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		6,714
評価・換算差額等合計		6,714
元本等合計		94,090
負債・元本等合計		94,090

<損益計算書（注）>

当計算期間（自 2018年10月1日 至 2019年9月30日）

（単位：千円）

経常収益		1,602
経常費用		18
経常利益		1,584
当期純利益		1,584
前期繰越利益		—
当期末処分利益		1,584
利益処分額		
受益権収益分配金		△1,584
受益権収益分配金合計		△1,584
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)
5,680.40	2019年2月8日	108.82	618,141
9,230.00	2019年8月9日	104.99	969,057

#### ■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)
618,141	2019年2月13日～2019年2月14日	0
969,057	2019年8月14日～2019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)
2019年1月30日	2019年3月8日	154
2019年7月30日	2019年9月6日	242

#### ■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) (注)
2018年10月31日	22,903
2018年11月30日	23,202
2018年12月31日	20,962
2019年1月31日	22,024
2019年2月28日	23,080
2019年3月29日	23,407
2019年4月30日	24,426
2019年5月31日	22,502
2019年6月28日	23,638
2019年7月31日	23,687
2019年8月30日	22,731
2019年9月30日	23,529

(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。