

\*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 (LUX) ファンド・ソリューションズ MSCIワールド・ソーシヤリー・レスボンシブル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、円短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ジャーがリス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ジャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージ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。	

# 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

第5期 運用報告書（全体版）  
決算日 2023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5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 2023. キーシボル及び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 中 率	ベンチマーク	期 騰 落 中 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
5期 (2023年9月5日)	20,835	0	22.4	22,194	25.7	98.2	1,454

(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) 2022年 9月5日	円 17,024	% -	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)	% -	% 98.8
9月末	15,918	△ 6.5	17,658	△ 4.9	99.6
10月末	17,171	0.9	18,293	3.6	98.6
11月末	16,906	△ 0.7	17,912	1.4	98.8
12月末	15,844	△ 6.9	16,711	△ 5.4	96.3
2023年 1月末	16,718	△ 1.8	17,587	△ 0.4	97.2
2月末	17,304	1.6	18,326	3.8	98.6
3月末	17,297	1.6	18,348	3.9	98.2
4月末	17,391	2.2	18,568	5.2	98.8
5月末	18,661	9.6	19,805	12.2	99.5
6月末	20,125	18.2	21,435	21.4	99.5
7月末	20,467	20.2	21,768	23.3	98.8
8月末	20,822	22.3	22,183	25.6	98.3
(期 末) 2023年 9月5日	20,835	22.4	22,194	25.7	98.2

(注1) 基準価額は1万口当たり。

(注2) 騰落率は期首比です。

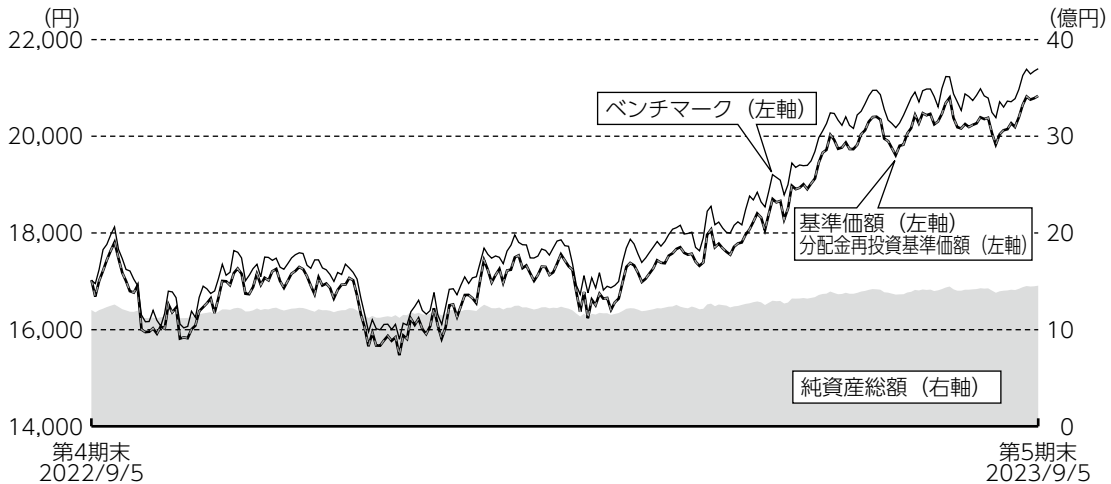
(注3) ベンチマークは2020年12月1日までMSCIワールドSRI 5%イシュー・キャップド・インデックス (税引後配当込み、USDベース)、それ以降はMSCIワールドSRIロー・カーボン・セレクト 5%イシュー・キャップド・インデックス (税引後配当込み、USDベース) に基づいて委託会社において円換算したものです。設定日当日を10,000として指数化しています。

※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

(2022年9月5日～2023年9月5日)



第5期首：17,024円

第5期末：20,835円 (既払分配金 0円)

騰落率： 22.4% (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3,811円値上がりしました。なお、基準価額の騰落率は+22.4%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、株価の上昇に加え、米ドルなどの主要通貨に対する円安の進行もプラス要因となり、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上昇しました。期の序盤、米国をはじめとする主要先進国・地域による積極的な金融引き締めとそれに伴う景気悪化への懸念から、株価は大幅に下落しました。しかし2022年11月に入ると、米国のインフレのピークアウト観測などを手掛かりに株価は反発し、2023年の年明け以降も上昇基調を維持しました。3月には、米中堅地銀の経営破綻をきっかけとした金融システムへの不安が欧州にも波及し、株式への売り圧力が強まる局面もありましたが、欧米当局の迅速な対応により間もなく持ち直しました。4月以降は、主要先進国における利上げの長期化懸念などから値を下げる局面もありましたが、米国の底堅い景気動向と企業業績などに下支えされて概ね上昇基調で推移しました。

為替市場では、主要通貨に対して円が下落しました。世界的に金融引き締めが進む市場環境下で日銀は金融緩和政策を維持したため、日本と他国・地域の金利差拡大が意識されて円安が進みました。

## 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 (LUX) ファンド・ソリューションズ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% イシューアール・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。

なお、ESGを主要要素として選定した有価証券の組入比率は、上記上場投資信託の純資産総額に対して99.6%\*です。

\* 取得できる直近の数値を記載しています。

### 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。

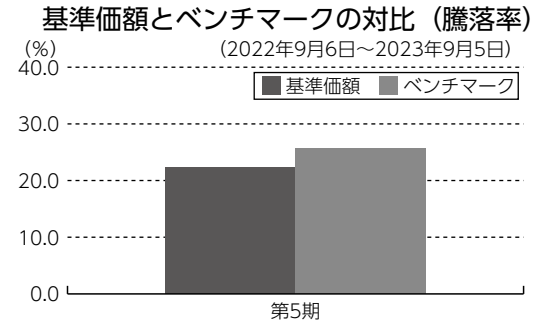
[当社のスチュワードシップ方針および方針に沿って実施した行動]

- ・UBSアセット・マネジメント・グループとして、各国のスチュワードシップ・コードならびに関連規制への準拠を表明しており、当社においても日本版スチュワードシップ・コードの受け入れを表明しています。
- ・企業のESGに関するパフォーマンスを分析し、特定されたりリスクと機会についてエンゲージメントを行い、また一貫して議決権行使を行うことに、資産運用会社として責任を有すると考えています。投資家による積極的なオーナーシップが企業や市場全体の長期的な持続可能性と成功に貢献するものであり、効果的なスチュワードシップは、投資家と企業が直面する環境、社会、ガバナンスの問題を特定し、影響を与える機会を資産運用会社に提供すると考えています。
- ・UBSアセット・マネジメント・グループのスチュワードシップ方針ならびに実施内容等につきましては、以下のホームページをご参照ください。

<http://japan1.ubs.com/am/pages/importance/ssc>

## 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+22.4%に対してベンチマークが+25.7%となり、基準価額の騰落率はベンチマークの騰落率を3.3%下回りました。基準価額の騰落率がベンチマークの騰落率を下回った要因は、ファンドにおけるキャッシュの保有および信託報酬などの費用の負担によるものです。



(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5期
	2022年9月6日~2023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	10,835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 (LUX) ファンド・ソリューションズMSCIワールド・ソーシャリー・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 2022/9/6~2023/9/5		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	38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17,885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）	（30）	（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	1	0.007	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）	（ 1）	（0.007）	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	19	0.108	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）	（0.022）	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）	（ 5）	（0.025）	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）	（0.060）	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	58	0.329	

(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。

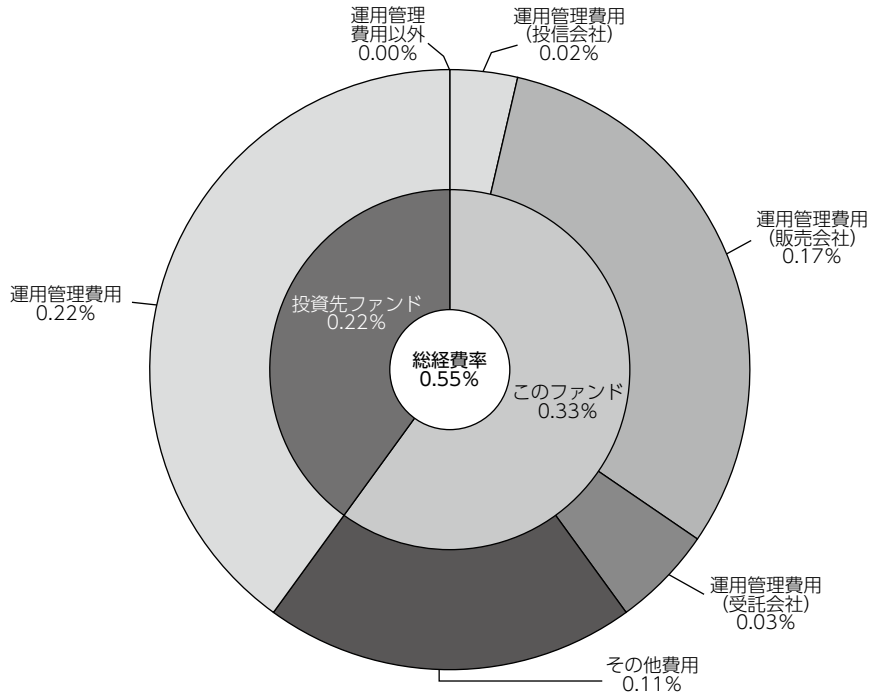
(注2) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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 2022年9月6日 至 2023年9月5日)

### 投資信託証券

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
外国				
UBS (LUX) ファンド・ソリューションズ MSCIワールド・ソーシャリー・レスポンシブルUCITS ETF	□ -	千米ドル -	□ 10,087	千米ドル 249

(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 2022年9月6日 至 2023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 (2023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 (LUX) ファンド・ソリューションズMSCIワールド・ソーシャリー・レスポンシブルUCITS ETF	□ 374,056	□ 363,969	千米ドル 9,744	千円 1,428,133	% 98.2	
合 計	□ 数 ・ 金 額	374,056	363,969	9,744	1,428,133	
	銘柄数 <比率>	1	1	-	<98.2%>	

(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=146.56円です。

(注2) &lt; &gt;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

(2023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	1,428,133	98.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	28,600	2.0
投 資 信 託 財 産 総 額	1,456,742	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 (1,428,133千円) の投資信託財産総額 (1,456,742千円) に対する比率は98.0%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=146.56円です。

## 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年9月5日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	1,456,742,739円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	28,599,397
投資信託受益証券(評価額)	9,934
投資証券(評価額)	1,428,133,408
(B) 負 債	2,309,461
未 払 解 約 金	337,012
未 払 信 託 報 酬	1,409,375
未 払 利 息	82
そ の 他 未 払 費 用	562,992
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,454,433,278
元 本	698,056,435
次 期 繰 越 損 益 金	756,376,843
(D) 受 益 権 総 口 数	698,056,435口
1万口当たり基準価額(C/D)	20,835円

(注記事項)

期首元本額	706,981,064円
期中追加設定元本額	226,460,119円
期中一部解約元本額	235,384,748円
1口当たり純資産額	2.0835円

## 損益の状況

(自2022年9月6日 至2023年9月5日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 19,965円
支 払 利 息	△ 19,965
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	252,799,128
売 買 益	272,301,917
売 買 損	△ 19,502,789
(C) 信 託 報 酬 等	△ 4,048,187
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	248,730,976
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	53,893,312
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	453,752,555
(配 当 等 相 当 額)	( 162,777,110)
(売 買 損 益 相 当 額)	( 290,975,445)
(G) 計 (D+E+F)	756,376,843
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	756,376,843
追 加 信 託 差 損 益 金	453,752,555
(配 当 等 相 当 額)	( 162,777,110)
(売 買 損 益 相 当 額)	( 290,975,445)
分 配 準 備 積 立 金	302,644,253
繰 越 損 益 金	△ 19,965

(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 (248,729,717円) 、信託約款に規定する収益調整金 (453,732,590円) および分配準備積立金 (53,914,536円) より分配対象収益は756,376,843円 (10,000口当たり10,835円) ですが、分配を行っておりません。

<約款変更のお知らせ>

当ファンドが投資対象とする外国投資信託の名称変更が行われたため、次の通り約款を変更いたしました。

変更後) **UBS** (LUX) ファンド・ソリューションズMSCIワールド・ソーシャリー・レスポンシブル UCITS ETF

変更前) **UBS** ETF (LU) MSCIワールド・ソーシャリー・レスポンシブルUCITS ETF

(約款変更実施日：2022年12月6日)

## 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、2022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 2022年12月31日  
米ドル

<b>収益</b>	
配当金 (外国源泉徴収税控除後)	62,279,890
その他収益	576,263
<b>収益合計</b>	<b>62,856,153</b>
<b>費用</b>	
運用管理報酬	9,157,328
コール勘定の引き落とし利息	31,720
<b>費用合計</b>	<b>9,189,048</b>
<b>投資純利益 (損失)</b>	<b>53,667,105</b>
<b>実現純利益 (損失) :</b>	
投資	85,151,338
外国通貨取引および為替予約取引	(42,409,504)
先物取引	(3,327,988)
<b>未実現利益 (損失) の純変動額 :</b>	
投資	(1,380,752,955)
外国通貨取引	(51,488)
先物取引	(446,271)

2022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 (%)
<b>普通株式</b>			
<b>広告 (0.23%)</b>			
Interpublic Group of Companies	125,001	4,163,783	0.11
Publicis Groupe	70,828	4,491,626	0.12
<b>農業 (0.12%)</b>			
Bunge	47,893	4,778,285	0.12
<b>アパレル (0.85%)</b>			
adidas	54,615	7,429,367	0.20
Burberry Group	117,121	2,859,963	0.08
Gildan Activewear	60,716	1,661,574	0.04
Hermes International	10,001	15,423,298	0.40
Puma	35,802	2,166,488	0.06
VF	101,759	2,809,566	0.07
<b>自動車製造 (3.04%)</b>			
Cummins	44,404	10,758,645	0.28
Rivian Automotive - Class A	98,498	1,815,318	0.05
Tesla	840,050	103,477,359	2.71
<b>自動車部品・装置 (0.58%)</b>			
APTIV	85,372	7,950,695	0.21
Compagnie Generale des Etablissements Michelin	211,228	5,857,876	0.15
Lear	18,698	2,318,926	0.06
Magna International	85,153	4,780,056	0.13
Valeo	68,052	1,212,895	0.03
<b>銀行 (5.53%)</b>			
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	1,896,253	11,401,949	0.30
Bank Leumi Le-Israel EM	475,645	3,951,015	0.10
Bank of New York Mellon	240,027	10,926,029	0.29
Bank of Nova Scotia	379,103	18,561,344	0.49
BOC Hong Kong Holdings	1,199,500	4,088,008	0.11
DNB Bank	298,295	5,888,079	0.15
Hang Seng Bank	248,600	4,134,335	0.11
Huntington Bancshares	445,162	6,276,784	0.16
Intesa Sanpaolo	5,202,430	11,537,661	0.30
KBC Group	80,558	5,165,407	0.13
Macquarie Group	116,720	13,215,497	0.35
National Bank of Canada	106,143	7,146,703	0.19
Northern Trust	63,651	5,632,427	0.15
PNC Financialrvice Group	130,375	20,591,427	0.54
Regions Financial	289,459	6,240,736	0.16
State Street	116,097	9,005,644	0.23
SVB Financial Group	18,627	4,286,818	0.11
Toronto-Dominion Bank	572,965	37,072,838	0.97
Truist Financial	416,422	17,918,639	0.47
United Overseas Bank	360,200	8,244,960	0.22
<b>飲料 (4.62%)</b>			
Coca-Cola	1,296,886	82,494,919	2.16
Coca-Cola Europacific Partners	67,282	3,722,040	0.10
Coca-Cola HBC	59,390	1,409,516	0.04
Keurig Dr Pepper	244,318	8,712,380	0.23
PepsiCo	434,708	78,534,347	2.05
Suntory Beverage & Food	44,400	1,514,268	0.04

銘柄	株数	評価額 (米ドル)	純資産 比率 (%)
<b>建築資材 (1.25%)</b>			
Carrier Global	268,194	11,063,003	0.29
Daikin Industries	78,300	11,987,267	0.31
Fortune Brands Innovations	39,134	2,234,943	0.06
James Hardie Industries - CDI	143,473	2,568,620	0.07
Johnson Controls International	218,201	13,964,864	0.37
Lennox International	10,815	2,587,272	0.07
Masco	69,807	3,257,893	0.08
<b>化学 (2.70%)</b>			
Akzo Nobel	56,373	3,763,863	0.10
Asahi Kasei	389,700	2,780,428	0.07
Croda International	43,223	3,433,615	0.09
Ecolab	80,444	11,709,429	0.31
Evonik Industries	66,131	1,265,821	0.03
Givaudan - Registered	2,916	8,928,911	0.23
International Flavors & Fragrances	81,284	8,521,815	0.22
Johnson Matthey	56,819	1,453,754	0.04
Koninklijke DSM	55,143	6,726,708	0.18
Mitsubishi Chemical Holdings	393,200	2,040,426	0.05
Nitto Denko	44,000	2,551,063	0.07
Novozymes - Class B	65,347	3,300,245	0.09
Nutrien	170,278	12,422,584	0.33
PPG Industries	73,843	9,285,019	0.24
Sherwin-Williams	77,099	18,297,906	0.48
Sumitomo Chemical	508,500	1,826,738	0.05
Toray Industries	416,900	2,327,398	0.06
Umicore	66,285	2,427,887	0.06
<b>商業サービス (4.44%)</b>			
Ashtead Group	134,494	7,636,153	0.20
Automatic Data Processing	131,397	31,385,487	0.82
Brambles	433,928	3,551,818	0.09
Bunzl	106,636	3,539,038	0.09
Bureau Veritas	92,977	2,442,042	0.06
Intertek Group	51,562	2,502,046	0.07
MarketAxess Holdings	11,868	3,309,867	0.09
Moody's	52,101	14,516,381	0.38
Quanta Services	44,768	6,379,440	0.17
Recruit Holdings	453,200	14,347,011	0.38
RELX	596,686	16,422,208	0.43
Ritchie Bros Auctioneers	35,380	2,042,193	0.05
Robert Half International	32,884	2,427,826	0.06
Rollins	69,955	2,556,156	0.07
S&P Global	107,451	35,989,638	0.94
SGS - Registered	1,925	4,473,357	0.12
Transurban Group	965,088	8,495,078	0.22
United Rentals	21,910	7,787,252	0.20
<b>コンピューター (0.37%)</b>			
Computershare	164,625	2,924,980	0.08
Fujitsu	61,400	8,197,059	0.21
Nomura Research Institute	127,300	3,005,339	0.08
<b>化粧品・パーソナルケア (1.47%)</b>			
Beiersdorf	31,257	3,576,087	0.09
Colgate-Palmolive	250,743	19,756,041	0.52
Kao	149,400	5,950,184	0.16
L'Oreal	75,720	26,958,928	0.70

銘柄	株数	評価額 (米ドル)	純資産 比率 (%)
<b>流通・卸売 (1.03%)</b>			
Copart	137,099	8,347,958	0.22
D'ieteren Group	7,996	1,529,244	0.04
Fastenal	181,954	8,610,063	0.23
IMCD	17,885	2,541,535	0.07
LKQ	81,606	4,358,576	0.11
Pool	12,817	3,874,964	0.10
Toromont Industries	26,100	1,882,159	0.05
WW Grainger	14,494	8,062,288	0.21
<b>各種金融サービス (3.31%)</b>			
abrdn	662,627	1,508,463	0.04
Ally Financial	94,196	2,303,092	0.06
American Express	201,499	29,771,477	0.78
Ameriprise Financial	34,069	10,608,064	0.28
ASX	61,230	2,824,403	0.07
BlackRock	47,533	33,683,310	0.88
CME Group	113,316	19,055,219	0.50
Deutsche Boerse	59,675	10,279,262	0.27
Invesco	115,322	2,074,643	0.05
Isracard *	0	1	0.00
Schroders	220,370	1,155,763	0.03
Singapore Exchange	262,800	1,753,698	0.05
St James's Place	168,429	2,218,506	0.06
T Rowe Price Group	70,326	7,669,754	0.20
Western Union	124,318	1,711,859	0.04
<b>電気 (0.63%)</b>			
Brookfield Renewable - Class A	34,400	946,225	0.03
EDP Renovaveis	89,060	1,956,113	0.05
Elia Group	10,987	1,557,196	0.04
Eversource Energy	109,563	9,185,762	0.24
Hydro One	105,224	2,816,690	0.07
Mercury	233,918	822,554	0.02
Meridian Energy	437,791	1,450,856	0.04
Red Electrica	122,338	2,122,990	0.06
Terna - Rete Elettrica Nazionale	430,097	3,167,244	0.08
<b>電気部品・設備 (0.75%)</b>			
Generac Holdings	20,120	2,025,279	0.05
Prysmian	80,524	2,978,653	0.08
Schneider Electric	169,359	23,627,419	0.62
<b>電子機器 (1.03%)</b>			
Agilent Technologies	92,910	13,903,982	0.37
Allegion	28,082	2,955,911	0.08
Azbil	43,400	1,093,676	0.03
Fortive	108,173	6,950,115	0.18
Mettler-Toledo International	7,224	10,441,931	0.27
Trimble	76,854	3,885,738	0.10
<b>エネルギー代替 (0.29%)</b>			
Plug Power	163,189	2,018,648	0.05
Vestas Wind Systems	314,493	9,121,757	0.24
<b>土木・建設 (0.19%)</b>			
Acciona	7,749	1,421,633	0.04
Lendlease	237,221	1,261,232	0.03
WSP Global	39,468	4,575,835	0.12
<b>娯楽 (0.08%)</b>			
Vail Resorts	12,469	2,971,986	0.08
<b>環境制御 (0.10%)</b>			
Kurita Water Industries	34,800	1,440,055	0.04
Pentair	49,491	2,226,105	0.06



銘柄	株数	評価額 (米ドル)	純資産 比率 (%)
<b>食品 (2.44%)</b>			
Aeon	200,800	4,235,298	0.11
Coles Group	427,662	4,849,117	0.13
Conagra Brands	150,243	5,814,404	0.15
Danone	201,587	10,591,521	0.28
General Mills	187,152	15,692,695	0.41
George Weston	23,650	2,932,185	0.08
Hormel Foods	95,532	4,351,483	0.11
J Sainsbury	562,142	1,472,089	0.04
Jeronimo Martins	87,074	1,875,321	0.05
Kellogg	78,738	5,609,295	0.15
Kerry Group - Class A	51,294	4,611,592	0.12
Kesko - Class B	94,696	2,083,945	0.05
Kikkoman	44,400	2,335,337	0.06
Kobe Bussan	42,200	1,212,157	0.03
Koninklijke Ahold Delhaize	334,391	9,578,623	0.25
McCormick & Co - Non-Voting Shares	77,826	6,450,997	0.17
Metro	76,334	4,223,595	0.11
Mowi	129,582	2,199,382	0.06
Nissin Foods Holdings	18,800	1,484,679	0.04
Orkla	240,001	1,728,319	0.04
<b>林産品・紙製品 (0.40%)</b>			
Holmen - Class B	31,093	1,235,126	0.03
International Paper	104,651	3,624,064	0.10
Mondi	154,339	2,616,800	0.07
Smurfit Kappa Group	83,631	3,084,658	0.08
Stora Enso - Class R	167,376	2,349,010	0.06
Svenska Cellulosa - Class B	195,580	2,476,777	0.06
<b>ガス (0.24%)</b>			
Atmos Energy	43,736	4,901,494	0.13
Enagas	82,150	1,361,147	0.03
Snam	639,477	3,089,594	0.08
<b>ヘルスケア製品 (3.10%)</b>			
Align Technology	23,469	4,949,612	0.13
Carl Zeiss Meditec	12,656	1,592,488	0.04
Cochlear	20,637	2,856,656	0.07
Coloplast - Class B	36,588	4,263,791	0.11
Coopers	15,650	5,174,985	0.14
Demant	30,364	839,081	0.02
Dentsply Sirona	67,133	2,137,515	0.06
Edwards Lifesciences	196,859	14,687,650	0.38
EssilorLuxottica	89,962	16,245,214	0.43
Hologic	80,005	5,985,174	0.16
IDEXX Laboratories	26,286	10,723,636	0.28
Insulet	22,017	6,481,585	0.17
Novocure	29,753	2,182,382	0.06
ResMed	45,620	9,494,891	0.25
Sonova Holding - Registered	17,269	4,093,268	0.11
STERIS	31,098	5,743,490	0.15
Systemex	53,100	3,218,718	0.08
Terumo	201,800	5,729,227	0.15
Waters	18,913	6,479,215	0.17
West Pharmaceuticalvices	23,225	5,466,004	0.14
<b>ヘルスケアサービス (3.10%)</b>			
BioMerieux	13,440	1,404,548	0.04
Centene	179,337	14,707,427	0.38
DaVita	18,663	1,393,566	0.04
Elevance Health	75,726	38,845,166	1.02
HCA Healthcare	72,361	17,363,746	0.45
Humana	39,648	20,307,309	0.53
IQVIA Holdings	58,968	12,081,954	0.32
Laboratory of America Holdings	28,171	6,633,707	0.17
Quest Diagnostics	37,129	5,808,461	0.15

銘柄	株数	評価額 (米ドル)	純資産 比率 (%)
<b>住宅建設 (0.20%)</b>			
Barratt Developments	309,024	1,475,005	0.04
Berkeley Group Holdings	34,583	1,569,564	0.04
Sekisui House	191,800	3,392,060	0.09
Taylor Wimpey	1,110,661	1,358,059	0.03
<b>住宅用家具 (0.97%)</b>			
Electrolux - Class B	71,932	971,888	0.03
Panasonic Holdings	687,600	5,787,107	0.15
Sony Group	398,800	30,330,501	0.79
<b>家庭用品 (0.60%)</b>			
Clorox	38,222	5,363,693	0.14
Henkel & Co	34,159	2,196,485	0.06
Reckitt Benckiser Group	223,853	15,493,961	0.40
<b>保険 (4.91%)</b>			
AIA Group	3,758,200	41,795,496	1.09
Allianz - Registered	128,747	27,604,700	0.72
AXA	579,214	16,106,312	0.42
Dai-ichi Life Holdings	312,600	7,093,292	0.19
Intact Financial	54,666	7,863,722	0.21
Legal & General Group	1,880,728	5,644,510	0.15
Marsh & McLennan Companies	158,027	26,150,308	0.68
NN Group	90,308	3,677,905	0.10
Prudential Financial	116,768	11,613,745	0.30
QBE Insurance Group	464,083	4,226,661	0.11
Sompo Holdings	98,800	4,387,950	0.11
Suncorp Group	398,910	3,257,071	0.08
Swiss Life Holding - Registered	10,072	5,190,585	0.14
Swiss Re	96,812	9,049,181	0.24
Travelers Companies	75,117	14,083,686	0.37
<b>インターネット (1.00%)</b>			
Gen Digital	182,466	3,910,246	0.10
Just Eat Takeaway.com	59,305	1,250,041	0.03
Prosus	260,522	17,919,806	0.47
Shopify - Class A	377,876	13,110,411	0.34
Z Holdings	807,000	2,030,573	0.06
<b>鉄鋼 (0.41%)</b>			
Fortescue Metals Group	530,028	7,372,084	0.19
Mineral Resources	52,793	2,763,881	0.07
Steel Dynamics	57,299	5,598,112	0.15
<b>レジャー (0.10%)</b>			
Yamaha	47,100	1,756,277	0.04
Yamaha Motor	97,000	2,212,816	0.06
<b>宿泊施設 (0.08%)</b>			
City Developments	163,600	1,003,898	0.03
Whitbread	62,597	1,935,158	0.05
<b>機械 - 建設・鉱業 (1.06%)</b>			
Caterpillar	166,362	39,853,681	1.04
Hitachi Construction Machinery	38,000	852,188	0.02

銘柄	株数	評価額 (米ドル)	純資産 比率 (%)
<b>機械－各種 (1.88%)</b>			
CNH Industrial	326,530	5,215,138	0.14
Daifuku	32,100	1,503,490	0.04
Dover	45,968	6,224,527	0.16
FANUC	60,100	9,034,700	0.24
GEA Group	49,226	2,006,891	0.05
Husqvarna - Class B	129,902	911,602	0.02
IDEX	24,173	5,519,421	0.14
Ingersoll Rand	127,829	6,679,065	0.18
Kubota	318,500	4,386,028	0.12
Omron	57,600	2,796,074	0.07
Otis Worldwide	133,786	10,476,782	0.27
Rockwell Automation	36,616	9,431,183	0.25
Wartsila	165,003	1,385,550	0.04
Xylem	56,629	6,261,469	0.16
<b>メディア (2.08%)</b>			
FactSet Research Systems	11,774	4,723,847	0.12
Informa	465,258	3,467,648	0.09
Liberty Global - Class A	44,369	839,905	0.02
Liberty Global - Class C	84,537	1,642,554	0.04
Pearson	198,855	2,246,592	0.06
Thomson Reuters	52,528	5,988,025	0.16
Vivendi	216,822	2,062,728	0.05
Walt Disney	574,210	49,887,365	1.31
Wolters Kluwer	84,107	8,775,246	0.23
<b>鉱業 (0.46%)</b>			
Antofagasta	127,202	2,364,790	0.06
Boliden	84,796	3,184,071	0.08
Newcrest Mining	275,245	3,852,609	0.10
Northern Star Resources	380,217	2,813,080	0.08
Wheaton Precious Metals	139,272	5,437,462	0.14
<b>その他製造 (0.98%)</b>			
AO Smith	37,662	2,155,773	0.06
Illinois Tool Works	97,819	21,549,526	0.56
Orica	144,789	1,478,721	0.04
Trane Technologies	72,371	12,164,841	0.32
<b>石油・ガス (1.09%)</b>			
Ampol	69,972	1,341,929	0.04
DCC	31,691	1,555,342	0.04
Neste	131,345	6,030,453	0.16
Parkland	51,300	1,124,855	0.03
Phillips 66	151,201	15,737,000	0.41
Valero Energy	124,192	15,754,997	0.41
<b>石油・ガスサービス (0.54%)</b>			
Baker Hughes	319,074	9,422,255	0.25
Halliburton	287,691	11,320,641	0.29
<b>包装・容器 (0.21%)</b>			
Ball	100,599	5,144,633	0.13
Westrock	82,284	2,893,105	0.08

銘柄	株数	評価額 (米ドル)	純資産 比率 (%)
<b>医薬品・バイオテクノロジー (10.24%)</b>			
AmerisourceBergen	48,525	8,041,078	0.21
Amgen	168,523	44,260,881	1.16
Amplifon	36,438	1,081,876	0.03
Astellas Pharma	581,100	8,836,842	0.23
Becton Dickinson & Co	90,060	22,902,258	0.60
Biogen	45,714	12,659,121	0.33
Cardinal Health	85,511	6,573,231	0.17
Daiichi Sankyo	550,500	17,731,820	0.46
DexCom	123,193	13,950,375	0.37
Elanco Animal Health	133,677	1,633,533	0.04
Genmab	20,662	8,721,046	0.23
Gilead Sciences	396,118	34,006,730	0.89
Henry Schein	42,410	3,387,287	0.09
Illumina	48,953	9,898,297	0.26
Jazz Pharmaceuticals	19,073	3,038,520	0.08
Merck	40,486	7,816,447	0.20
Novo Nordisk - Class B	522,730	70,369,015	1.84
Orion - Class B	35,647	1,949,387	0.05
Roche Holding	221,437	69,528,154	1.82
Vertex Pharmaceuticals	80,623	23,282,310	0.61
Zoetis	148,209	21,720,029	0.57
<b>パイプライン (0.16%)</b>			
Pembina Pipeline	175,580	5,955,686	0.16
<b>未公開株式 (0.06%)</b>			
Capitaland Investment	846,912	2,336,396	0.06
<b>不動産 (0.38%)</b>			
CBRE Group - Class A	99,987	7,694,999	0.20
FirstService	13,400	1,639,805	0.04
Hulic	122,300	963,977	0.03
REA Group	15,197	1,141,888	0.03
Sumitomo Realty & Development	98,200	2,322,803	0.06
Swire Properties	352,000	894,776	0.02
<b>不動産投資信託 (2.24%)</b>			
American Tower - REIT	146,692	31,078,167	0.81
British Land - REIT	282,536	1,342,797	0.03
Covivio - REIT	15,805	935,324	0.02
Crown Castle - REIT	137,037	18,587,699	0.49
Dexus - REIT	344,491	1,810,528	0.05
Goodman Group - REIT	524,046	6,169,428	0.16
GPT Group - REIT	611,407	1,741,428	0.05
Klepierre - REIT	69,330	1,593,057	0.04
Mirvac Group - REIT	1,283,387	1,853,800	0.05
Segro - REIT	376,410	3,457,457	0.09
Stockland - REIT	832,843	2,050,197	0.05
Ventas - REIT	125,675	5,661,659	0.15
Welltower - REIT	145,246	9,520,875	0.25
<b>小売 (5.53%)</b>			
Best Buy	64,005	5,133,841	0.13
Canadian Tire - Class A	18,141	1,894,499	0.05
Fast Retailing	18,600	11,352,139	0.30
Home Depot	322,637	101,908,123	2.67
Industria de Diseno Textil	338,172	8,968,711	0.23
Kingfisher	603,872	1,715,025	0.05
Lowe's Companies	195,715	38,994,257	1.02
Pandora	28,100	1,968,413	0.05
Target	144,476	21,532,703	0.56
Tractor Supply	35,145	7,906,571	0.21
UltaLomsmetics & Fragrance	15,834	7,427,254	0.19
Zalando	70,463	2,489,925	0.07

銘柄	株数	評価額 (米ドル)	純資産 比率 (%)
<b>半導体 (7.92%)</b>			
Applied Materials	269,763	26,269,521	0.69
ASML Holding	128,377	69,025,785	1.81
Lam Research	43,083	18,107,785	0.47
NVIDIA	784,723	114,679,419	3.00
NXPMiconductors	81,824	12,930,647	0.34
Texas Instruments	287,950	47,575,099	1.24
Tokyo Electron	47,400	13,967,274	0.37
<b>ソフトウェア (10.20%)</b>			
Adobe	147,504	49,639,521	1.30
ANSYS	27,814	6,719,584	0.18
Autodesk	68,378	12,777,797	0.33
Electronic Arts	87,434	10,682,686	0.28
HubSpot	14,425	4,170,700	0.11
Intuit	84,446	32,868,072	0.86
Microsoft	809,806	194,207,675	5.08
Salesforce	315,242	41,797,937	1.09
ServiceNow	63,370	24,604,670	0.64
Splunk	52,076	4,483,223	0.12
Take-Two Interactive Software	52,318	5,447,873	0.14
ZoomInfo Technologies	81,871	2,465,136	0.07
<b>電気通信 (3.17%)</b>			
BT Group	2,247,924	3,029,864	0.08
Cisco Systems	1,308,789	62,350,708	1.63
Elisa	45,848	2,420,140	0.06
KDDI	505,200	15,246,553	0.40
Motorola Solutions	52,334	13,486,995	0.35
Rogers Communications - Class B	109,558	5,123,946	0.14
Softbank	893,100	10,071,869	0.27
Tele2 - Class B	184,138	1,503,925	0.04
Telefonica Deutschland Holding	362,434	890,818	0.02
Telenor	212,846	1,979,159	0.05
Telia	857,880	2,195,026	0.06
Telus	142,921	2,756,209	0.07
<b>玩具・ゲーム・趣味 (0.07%)</b>			
Hasbro	41,967	2,560,407	0.07
<b>輸送 (0.59%)</b>			
CH Robinson Worldwide	39,660	3,631,270	0.10
Expeditors International of Washington	50,430	5,240,685	0.14
Hankyu Hanshin Holdings	77,900	2,314,358	0.06
Knight-Swift Transportation Holdings	48,934	2,564,631	0.07
Kuehne + Nagel International - Registered	17,591	4,091,638	0.11
Nippon Express Holdings	22,200	1,268,619	0.03
SG Holdings	92,600	1,284,308	0.03
Tokyu	159,200	2,006,515	0.05
<b>水道 (0.46%)</b>			
American Water Works	56,954	8,680,929	0.23
Essential Utilities	76,887	3,669,817	0.09
Severn Trent	79,351	2,530,415	0.07
United Utilities Group	221,463	2,641,069	0.07
<b>普通株式合計</b>		<b>3,801,676,930</b>	<b>99.48</b>
<b>優先株式</b>			
<b>家庭用品 (0.11%)</b>			
Henkel & Co	58,021	4,026,226	0.11
<b>優先株式合計</b>		<b>4,026,226</b>	<b>0.11</b>

公認の証券取引所に上場されていない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 (%)
<b>普通株式</b>			
医薬品・バイオテクノロジー (0.00%)			
Contra Abiomed	14,611	14,903	0.00
<b>普通株式合計</b>		<b>14,903</b>	<b>0.00</b>
投資合計 (Cost USD 3,987,714,489)		3,805,718,059	99.59
その他純資産		15,627,112	0.41
<b>純資産合計</b>		<b>3,821,345,171</b>	<b>100.00</b>

**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 (%)
E-mini S&P 500 ESG Futures 17/03/2023	UBS AG	9,962,150	59	(209,710)	(0.01)
EURO STOXX 50 ESG Index Futures 17/03/2023	UBS AG	4,510,239	273	(148,812)	(0.00)
<b>先物取引合計</b>		<b>14,472,389</b>	<b>332</b>	<b>(358,522)</b>	<b>(0.01)</b>

\*0.5株未満または0.5米ドル未満は切り捨て。

## 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14期決算日（2023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 分 金	期 騰 落 中 率	債 券 組 入 率	債 券 先 物 率	純 資 産 額
				比	比	
10期（2019年1月21日）	円 9,982	円 0	% △0.2	% —	% —	百万円 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
14期（2023年1月20日）	9,924	0	△0.1	—	—	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) 2022年 1月20日	円 9,938	% —	% —	% —
1月末	9,938	0.0	—	—
2月末	9,937	△0.0	—	—
3月末	9,936	△0.0	—	—
4月末	9,935	△0.0	—	—
5月末	9,934	△0.0	—	—
6月末	9,932	△0.1	—	—
7月末	9,931	△0.1	—	—
8月末	9,930	△0.1	—	—
9月末	9,928	△0.1	—	—
10月末	9,927	△0.1	—	—
11月末	9,927	△0.1	—	—
12月末	9,925	△0.1	—	—
(期 末) 2023年 1月20日	9,924	△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) 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14期	
	2022年1月21日～2023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
	2022/1/21～2023/1/20		
	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9,931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 2022年1月21日 至 2023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	100	100	12	12

(注) 単位未満は切り捨て。

## 利害関係人等との取引状況等 (自 2022年1月21日 至 2023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

(2023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	8,608		8,696	8,682

(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

(2023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 8,682	% 99.9
コール・ローン等、その他	12	0.1
投資信託財産総額	8,694	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

(2023年1月20日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	8,694,856円
コール・ローン等	10,546
UBS短期円金利プラス・マザーファンド(評価額)	8,682,310
未 収 入 金	2,000
(B) 負 債	1,946
未 払 信 託 報 酬	1,867
そ の 他 未 払 費 用	79
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	8,692,910
元 本	8,759,458
次 期 繰 越 損 益 金	△ 66,548
(D) 受 益 権 総 口 数	8,759,458口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,924円

(注記事項)

期首元本額	8,668,768円
期中追加設定元本額	100,736円
期中一部解約元本額	10,046円
1口当たり純資産額	0.9924円

純資産総額が元本を下回っており、その差額は66,548円です。

## 損益の状況

(自2022年1月21日 至2023年1月20日)

項 目	当 期
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 8,614円
売 買 益	9
売 買 損	△ 8,623
(B) 信 託 報 酬 等	△ 3,860
(C) 当 期 損 益 金(A+B)	△ 12,474
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 56,436
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,362
(配 当 等 相 当 額)	( 4,972)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 2,610)
(F) 計 (C+D+E)	△ 66,548
(G) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(F+G)	△ 66,548
追 加 信 託 差 損 益 金	2,362
(配 当 等 相 当 額)	( 4,964)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 2,602)
分 配 準 備 積 立 金	60,895
繰 越 損 益 金	△129,805

(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(4,964円)および分配準備積立金(60,895円)より分配対象収益は65,859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14期決算日（2023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	
10期 (2019年1月21日)	円 10,025	% △0.1	% -	% -	百万円 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
14期 (2023年1月20日)	9,984	△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) 2022年 1月20日	円 9,994	% -	% -	% -
1月末	9,994	0.0	-	-
2月末	9,993	△0.0	-	-
3月末	9,992	△0.0	-	-
4月末	9,992	△0.0	-	-
5月末	9,991	△0.0	-	-
6月末	9,990	△0.0	-	-
7月末	9,989	△0.1	-	-
8月末	9,988	△0.1	-	-
9月末	9,987	△0.1	-	-
10月末	9,986	△0.1	-	-
11月末	9,986	△0.1	-	-
12月末	9,985	△0.1	-	-
(期 末) 2023年 1月20日	9,984	△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 2022年1月21日 至 2023年1月20日)

該当事項はありません。

### 主要な売買銘柄 (自 2022年1月21日 至 2023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 2022年1月21日 至 2023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 (2023年1月20日現在)

2023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

(2023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 8,684	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	8,684	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

(2023年1月20日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	8,684,449円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	8,684,449
(B) 負 債	2,024
未 払 解 約 金	2,000
未 払 利 息	24
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	8,682,425
元 本	8,696,224
次 期 繰 越 損 益 金	△ 13,799
(D) 受 益 権 総 口 数	8,696,224口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,984円

〈注記事項〉

期首元本額	8,608,103円
期中追加設定元本額	100,141円
期中一部解約元本額	12,020円
1口当たり純資産額	0.9984円

純資産総額が元本を下回っており、その差額は13,799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)	8,696,224円
------------------------------	------------

## 損益の状況

(自2022年1月21日 至2023年1月20日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 8,772円
支 払 利 息	△ 8,772
(B) 当 期 損 益 金(A)	△ 8,772
(C) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 4,906
(D) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 141
(E) 解 約 差 損 益 金	20
(F) 計 (B+C+D+E)	△ 13,799
次 期 繰 越 損 益 金(F)	△ 13,799

(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。