

【表紙】**【提出書類】**

有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】

関東財務局長

【提出日】

令和3年9月30日

【発行者名】UBS (I r l) E T F ピーエルシー
(UBS (IrI) ETF plc)**【代表者の役職氏名】**ディレクター (Director)
ロバート・バルク (Robert Burke)
ディレクター (Director)
フィリップ・マッケンロー (Philp Mc Enroe)**【本店の所在の場所】**アイルランド共和国、ダブリン2、モールズワース通り 32
(32 Molesworth Street, Dublin 2, Ireland)**【代理人の氏名又は名称】**弁護士 三浦 健
同 大西 信治**【代理人の住所又は所在地】**東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所**【事務連絡者氏名】**弁護士 三浦 健
同 大西 信治**【連絡場所】**東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所**【電話番号】**

03 (6212) 8316

【届出の対象とした募集（売出）外国投資証券に係る外国投資法人の名称】UBS (I r l) E T F ピーエルシー — MSCI ACWI ソーシャリー・レス
ポンシブル UCITS ETF
(UBS (IrI) ETF plc - MSCI ACWI Socially Responsible UCITS ETF)**【届出の対象とした募集（売出）外国投資証券の形態及び金額】**

記名式無額面投資証券

クラス（米ドルヘッジ）A-acc投資証券：13億7,884万米ドル
（約1,527億円）を上限とする。

(注1) クラス（米ドルヘッジ）A-acc投資証券については、上限見込額は、便宜上、ファンドの投資証券の2021年2月末日現在の1口当たりの純資産価格（13.7884米ドル（約1,527円））に1億口を乗じて算出されている。

(注2) 米ドルの円貨換算は、別途記載のない限り、便宜上、2021年3月31日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝110.71円）による。

【縦覧に供する場所】

該当事項なし。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出しましたので、2021年5月14日付をもって提出した有価証券届出書（2021年6月30日付および2021年7月30日付有価証券届出書の訂正届出書により訂正済）（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報により更新および追加するため、また、原届出書に記載の表現等を一部更新するため、本訂正届出書を提出するものです。

なお、本訂正届出書の記載事項のうち外貨数字の円換算については、直近の為替レートを用いておりますので、訂正前の換算レートとは異なっております。

2【訂正箇所および訂正事項】

（1）半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正内容は、下記のとおりです。

原届出書の下記事項については、半期報告書の記載内容と同一内容に更新または追加されます。

原届出書		半期報告書		訂正の方法
第二部 ファンド情報 第1ファンドの状況 1 外国投資法人の概況	(1) 主要な経営指標等の推移	1 外国投資法人の概況	(1) 主要な経営指標等の推移	追加
	(5) 外国投資法人の出資総額		(2) 外国投資法人の出資総額	追加
	(6) 主要な投資主の状況		(3) 主要な投資主の状況	更新
3 投資リスク		2 外国投資法人の運用状況	(3) 投資リスク	追加 または 更新
5 運用状況	(1) 投資状況		(1) 投資状況	更新
	(3) 運用実績		(2) 運用実績	追加 または 更新
第2 財務ハイライト情報		4 外国投資法人の経理状況	(1) 資産及び負債の状況 「財政状態計算書」 「包括利益計算書」 「キャッシュ・フロー計算書」 「重要な会計方針の要約」 の注記	追加
第三部 外国投資法人の詳細情報 第1 外国投資法人の追加情報 2 役員の状況		1 外国投資法人の概況	(4) 役員の状況	更新
5 その他			(5) その他	追加
第4 関係法人の状況 1 資産運用会社の概況	(1) 名称、資本金の額及び事業の内容	3 資産運用会社の概況	(1) 名称及び資本金の額	更新
	(3) 大株主の状況		(2) 大株主の状況	更新
	(4) 役員の状況		(3) 役員の状況	更新
	(5) 事業の内容及び営業の概況		(4) 事業の内容及び営業の概況	更新
第5 外国投資法人の経理状況 1 財務諸表		4 外国投資法人の経理状況		追加
第6 販売及び買戻しの実績		5 販売及び買戻しの実績		追加

＊ 半期報告書の記載内容は、以下のとおりです。

[次へ](#)

1 外国投資法人の概況

UBS (I r l) E T F ピーエルシー — MSCI ACWI ソーシャリー・レスポンシブル UCITS ETF (以下、UBS (I r l) E T F ピーエルシーを「本投資法人」、MSCI ACWI ソーシャリー・レスポンシブル UCITS ETFを「ファンド」または「サブ・ファンド」という場合がある。)の概況は以下のとおりである。

(1) 主要な経営指標等の推移

(MSCI ACWI ソーシャリー・レスポンシブル UCITS

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

ETF)

	2019年6月 末日に終了 する中間 会計年度末	2019年12月 末日に 終了する 会計年度末	2020年6月 末日に終了 する中間 会計年度末	2020年12月 末日に 終了する 会計年度末	2021年6月 末日に終了 する中間 会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	58,920,981	125,400,167	−65,880,834	408,372,022	359,342,185
(b) 経常利益金額 または経常損失金額	58,920,981	125,400,167	−65,880,834	408,372,022	359,342,185
(c) 当期純利益金額 または当期純損失金額	58,920,981	125,400,167	−65,880,834	408,372,022	359,342,185
(d) 出資総額 ⁽²⁾	536,353,522	1,062,060,530	1,335,116,193	2,687,909,645	3,678,300,085
(e) 発行済投資口総数 (クラス(米ドルヘッジ) A-acc投資証券)	11,893,537口	25,981,554口	29,803,629口	50,049,464口	61,023,655口
(f) 純資産額	536,353,522	1,062,060,530	1,335,116,193	2,687,909,645	3,678,300,085
(g) 資産総額	540,286,466	1,074,016,832	1,343,561,400	2,725,412,835	3,731,314,025
(h) 1口当たり純資産価格 (クラス(米ドルヘッジ) A-acc投資証券)	10.4764	11.5564	11.1278	13.6171	15.3849
(i) 1口当たり当期純利益金額 または当期純損失金額 (クラス(米ドルヘッジ) A-acc投資証券)	1.15	1.36	−0.55	2.07	1.50
(j) 分配総額	254,747	1,168,180	1,055,027	2,774,256	1,954,044
(k) 1口当たり分配金額 (クラス(米ドルヘッジ) A-acc投資証券)	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし
(l) 自己資本比率	99.27%	98.89%	99.37%	98.62%	98.58%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾ (クラス(米ドルヘッジ) A-acc投資証券)	9.19%	28.46%	6.22%	17.83%	38.26%

(1) 営業収益には投資収益ならびに実現および未実現利益(損失)を含めている。以下同じ。

(2) ファンドは変動資本を有する会社型投資信託であり、純資産総額を記載している。以下同じ。

(3) 自己資本利益率は、当該会計年度末または当該中間会計年度末の1口当たり純資産価格の前年度末に対する増減の比率である。以下同じ。

(4) 「主要な経営指標等の推移、(e) 発行済投資口総数、(h) 1口当たり純資産価格、(i) 1口当たり当期純利益金額または当期純損失金額、(k) 1口当たり分配金額および(m) 自己資本利益率」は、日本で販売しているクラスのみ記載している。

(注) UBS (I r l) E T F ピーエルシー — MSCI ACWI ソーシャリー・レスポンシブル UCITS ETFおよびファンドのクラス(米ドルヘッジ) A-acc投資証券は2017年12月20日にそれぞれ設定された。

(2) 外国投資法人の出資総額

2021年6月末日現在の出資総額および発行済投資証券総数は以下のとおりである。

なお、本投資法人の発行可能投資口総口数は5,000億口を上限とする。

	出資総額		発行済投資証券総数 (口)	
	米ドル	百万円		
MSCI ACWI ソーシャリー・ レスポンシブル UCITS ETF	3,678,300,085	406,746	クラス(米ドルヘッジ) A-acc投資証券	61,023,655

(3) 主要な投資主の状況

本投資法人は上場投資信託であり、投資証券は上場証券取引所において取引されているため、投資主の情報を開示することはできない。

(4) 役員 の状況

(2021年6月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有投資 口数
アンドレアス・ハーバー ツェト	取締役	UBSアセット・マネジメント・スイス・ エイ・ジー	該当なし
フィリップ・マッケン ロー	取締役	独立取締役 グローバルリーチ（本投資法人と関連性を 有しない。）のヘッド・オブ・インベスト メント・ファンド	該当なし
フランク・ミューゼル	取締役	UBSアセット・マネジメント・スイス・ エイ・ジー	該当なし
イアン・アッシュメント	取締役	UBS アセット・マネジメント・リミテッ ド	該当なし
クレメンス・ロイター	取締役	UBSアセット・マネジメント・スイス・ エイ・ジー	該当なし
ロバート・バルク	取締役	独立取締役	該当なし

(5) その他

a. 定款の変更

本投資法人の定款は、中央銀行の事前の承認なく変更されないものとする。

b. 事業譲渡または事業譲受

本投資法人の全部もしくは一部の事業もしくは財産または本投資法人の資産の他の法人（以下「譲受人」という。）への譲渡が提案された場合、取締役会は、取締役会への一般的な権限または特定の事項に関する権限のいずれかを付与する特別決議により、売却投資証券、ユニット、保険証券その他の持分または投資主間での譲受人の分配に係る資産から報酬を受領すること、または投資主が現金もしくは資産の受領に代わって、またはそれに加えて、譲受人の利益への参加もしくは譲受人からのその他の利益の受領ができる取決めに締結することができる。

c. 出資の状況その他の重要事項

該当事項なし。

d. 訴訟事件その他の重要事項

半期報告書提出前6か月以内において、訴訟事件その他本投資法人に重要な影響を及ぼした事実および重要な影響を及ぼすことが予想される事実はない。

[次へ](#)

2 外国投資法人の運用状況

(1) 投資状況

資産別および地域別の投資状況

(MSCI ACWI ソーシャルリー・レスポンシブル UCITS ETF)

(2021年6月末日現在)

資産の種類	国・地域名	時価合計 (米ドル)	投資比率 (%)
株式	アメリカ合衆国	1,877,693,843	50.32
	日本	237,996,989	6.38
	台湾	167,507,670	4.49
	カナダ	143,269,446	3.84
	ドイツ	130,814,895	3.51
	スイス	122,352,310	3.28
	オランダ	115,927,349	3.11
	フランス	115,897,198	3.11
	ケイマン諸島	95,697,524	2.56
	イギリス	85,803,068	2.30
	デンマーク	69,298,159	1.86
	オーストラリア	63,855,834	1.71
	南アフリカ	46,314,494	1.24
	アイルランド	44,916,408	1.20
	韓国	42,204,955	1.13
	中国	33,789,739	0.91
	インド	32,013,264	0.86
	香港	29,656,383	0.79
	スペイン	26,825,222	0.72
	シンガポール	25,493,828	0.68
	ブラジル	21,657,839	0.58
	チャネル諸島ジャージー	20,213,591	0.54
	スウェーデン	18,915,264	0.51
	イタリア	18,404,674	0.49
	フィンランド	14,016,907	0.38
	マレーシア	12,752,542	0.34
	ノルウェー	12,571,026	0.34
	タイ	11,691,696	0.31
	ニュージーランド	10,898,826	0.29
	バミューダ	10,794,293	0.29
	ベルギー	8,590,928	0.23
	メキシコ	8,441,278	0.23
	カタール	6,753,972	0.18
	アラブ首長国連邦	6,191,609	0.17
	インドネシア	3,925,293	0.11
	イスラエル	2,720,914	0.07

	チリ	1,732,685	0.05
	ポルトガル	1,093,583	0.03
	ポーランド	880,899	0.02
	マン島	693,531	0.02
	サウジアラビア	502,391	0.01
	トルコ	404,545	0.01
	フィリピン	369,772	0.01
	チェコ共和国	296,552	0.01
小計		3,701,843,187	99.21
未決済先渡為替契約	—	11,013,009	0.30
先物契約	—	52,050	0.00
小計		11,065,059	0.30
ポートフォリオ合計		3,712,908,246	99.51
現金・その他資産		18,405,779	0.49
資産総額		3,731,314,025	100.00
負債総額		53,013,940	1.42
合計 (純資産総額)		3,678,300,085 (約406,746百万円)	98.58

(注1) 投資比率とは、ファンドの資産総額に対する当該資産の時価の比率をいう。以下同じ。

(注2) 上記の表において、国・地域名は発行会社の設立地を記載している。

(2) 運用実績

① 純資産等の推移

2021年6月末日までの1年間における各月末の総資産および純資産の推移は以下のとおりである。

(MSCI ACWI ソーシャリー・レスポンシブル UCITS ETF)

	資産総額		純資産総額		1口当たり純資産価格			時価(市場相場) (SIXスイス証券取引所)		
	米ドル	百万円	米ドル	百万円	クラス	表示通貨	円	クラス	表示通貨	円
2020年7月末日	1,506,799,978	166,622	1,505,679,499	166,498	(米ドルヘッジ) A-acc投資証券	11.5957米ドル	1,282	(米ドルヘッジ) A-acc投資証券	11.67米ドル	1,290
8月末日	1,747,760,923	193,267	1,718,183,676	189,997	(米ドルヘッジ) A-acc投資証券	12.3148米ドル	1,362	(米ドルヘッジ) A-acc投資証券	12.30米ドル	1,360
9月末日	1,861,149,357	205,806	1,831,093,677	202,482	(米ドルヘッジ) A-acc投資証券	12.0571米ドル	1,333	(米ドルヘッジ) A-acc投資証券	11.94米ドル	1,320
10月末日	1,900,878,154	210,199	1,892,691,880	209,294	(米ドルヘッジ) A-acc投資証券	11.7223米ドル	1,296	(米ドルヘッジ) A-acc投資証券	11.85米ドル	1,310
11月末日	2,356,605,851	260,593	2,321,246,323	256,683	(米ドルヘッジ) A-acc投資証券	13.0829米ドル	1,447	(米ドルヘッジ) A-acc投資証券	13.07米ドル	1,445
12月末日	2,725,412,835	301,376	2,687,909,645	297,229	(米ドルヘッジ) A-acc投資証券	13.6171米ドル	1,506	(米ドルヘッジ) A-acc投資証券	13.60米ドル	1,504
2021年1月末日	2,932,534,565	324,280	2,919,671,058	322,857	(米ドルヘッジ) A-acc投資証券	13.7366米ドル	1,519	(米ドルヘッジ) A-acc投資証券	13.85米ドル	1,532
2月末日	3,184,455,948	352,137	3,175,929,009	351,194	(米ドルヘッジ) A-acc投資証券	13.7884米ドル	1,525	(米ドルヘッジ) A-acc投資証券	13.85米ドル	1,532
3月末日	3,501,225,101	387,165	3,452,864,960	381,818	(米ドルヘッジ) A-acc投資証券	14.2709米ドル	1,578	(米ドルヘッジ) A-acc投資証券	14.33米ドル	1,585
4月末日	3,775,115,736	417,452	3,756,238,880	415,365	(米ドルヘッジ) A-acc投資証券	14.7708米ドル	1,633	(米ドルヘッジ) A-acc投資証券	14.76米ドル	1,632
5月末日	4,351,929,979	481,236	3,897,946,324	431,035	(米ドルヘッジ) A-acc投資証券	14.9366米ドル	1,652	(米ドルヘッジ) A-acc投資証券	14.98米ドル	1,656
6月末日	3,731,314,025	412,609	3,678,300,085	406,746	(米ドルヘッジ) A-acc投資証券	15.3849米ドル	1,701	(米ドルヘッジ) A-acc投資証券	15.41米ドル	1,704

② 分配の推移

クラス(米ドルヘッジ) A-acc投資証券 該当事項なし。

③ 自己資本利益率(収益率)の推移

2021年6月末日までの1年間の自己資本利益率(収益率)は以下のとおりである。

(MSCI ACWI ソーシャリー・レスポンシブル UCITS ETF)

収益率(%) (注)	
クラス(米ドルヘッジ) A-acc投資証券	38.26

(注) 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$

a = 2021年6月末日現在の1口当たり純資産価格(当該期間の分配金の合計金額を加えた額)

b = 2020年6月末日現在の1口当たり純資産価格(分配落ちの額)

(3) 投資リスク

- ① 当中間計算期間において、2021年6月30日提出の有価証券報告書「第一部ファンド情報 第1
ファンドの状況 3 投資リスク」に記載される投資リスクについて、重要な変更はない。
- ② 本投資法人が将来にわたって営業活動を継続するにあたり重要な疑義を生じさせるような事象ま
たは状況、その他本投資法人の経営に重要な影響を及ぼす事象は、半期報告書提出日現在、存在
しない。

[次へ](#)

3 資産運用会社の概況

(1) 名称及び資本金の額

- ① UBSファンド・マネジメント (ルクセンブルグ) エス・エイ (UBS Fund Management (Luxembourg) S.A.) (「管理会社」)

資本金 (株主資本) の額

2021年6月末日現在の株主資本総額は、13,000,000ユーロ (約17億1,054万円)

(注) ユーロの円貨換算は、特に記載がない限り、2021年6月30日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値 (1ユーロ=131.58円) による。以下同じ。

- ② UBSアセット・マネジメント (UK) リミテッド (UBS Asset Management (UK) Ltd.) (「投資運用会社」)

資本金 (株主資本) の額

2021年6月末日現在の株主資本総額は、125,000,000英ポンド (約191億4,500万円)

(注) 英ポンドの円貨換算は、便宜上、2021年6月30日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値 (1英ポンド=153.16円) による。

(2) 大株主の状況

- ① UBSファンド・マネジメント (ルクセンブルグ) エス・エイ

(2021年6月末日現在)

名 称	住 所	所有株式数 (株)	比率 (%)
ユービーエス・アセット・ マネジメント・エイ・ジー (UBS Asset Management AG)	バーンホフ・シュトラッセ45、CH- 8001チューリッヒ、スイス	6,500	100

- ② UBSアセット・マネジメント (UK) リミテッド

(2021年6月末日現在)

名 称	住 所	所有株式数 (株)	比率 (%)
ユービーエス・アセット・マ ネジメント・ホールディン グ・リミテッド	英国、ロンドン、ブロードゲート5	124,999,999	99.999
フィールドリユー・ノミニ ーズ・リミテッド	英国、ロンドン、ブロードゲート5	1	0.001

(3) 役員の状況

① UBSファンド・マネジメント(ルクセンブルグ) エス・エイ

(2021年6月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有株式
アンドレ・ヴァレンテ (André Valente)	チェアマン	UBSファンド・マネジメント (スイス) エイ・ジー、バーゼル、 チーフ・エグゼクティブ・オフィサー	該当なし
ギルバート・シントゲン (Gilbert Schintgen)	ディレクター/ ボード・メンバー	ルクセンブルグ大公国、 デュドランジュ、 インディペンデント・ディレクター	該当なし
クリスティアン・マウラー (Christian Maurer)	ディレクター/ ボード・メンバー	UBSアセット・マネジメント・ スイス・エイ・ジー、チューリッヒ、 プロダクト・マネジメント・ヘッド	該当なし
フランチェスカ・ジリ・プリム (Francesca Gigli Prym)	ディレクター/ ボード・メンバー	UBSファンド・マネジメント (ルクセンブルグ) エス・エイ、 ルクセンブルグ、チーフ・ エグゼクティブ・オフィサー	該当なし

② UBSアセット・マネジメント(UK) リミテッド

(2021年6月末日現在)

氏名	役職名	シニア・マネジャーおよび 認証レジームの一環としての 金融行為監督機構(FCA) による承認日	所有株式
イアン・アシュメント (Ian Ashment)	ディレクター/ ボード・メンバー	2019年12月9日	非公開
プリシラ・デイヴィス (Priscilla Davies)	ノン・エグゼクティブ・ディレクター	2019年12月9日	非公開
エリック・チャールズ・ スプレイグ・バーン (Eric Charles Sprague Byrne)	ディレクター/ ボード・メンバー	2019年12月9日	非公開
ルース・ビーチイ (Ruth Beechey)	ディレクター/ ボード・メンバー	2019年12月9日	非公開
キース・マーティン・ ジェックス (Keith Martin Jecks)	ディレクター/ ボード・メンバー	2019年12月9日	非公開

(4) 事業の内容及び営業の概況

① UBSファンド・マネジメント(ルクセンブルグ)エス・エイ

管理会社は、本投資法人と管理会社契約を締結し、当該契約に詳述された業務を遂行する。

2021年6月末日現在、管理会社は以下のとおり、405本の投資信託／投資法人のサブ・ファンドの管理・運用を行っている。

国別(設立国)	種類別(基本的性格)	本数	純資産額の合計(通貨別)
ルクセンブルグ	オープン・エンド型 投資信託／投資法人	359	543,959,650.32オーストラリア・ドル
			209,347,146.60カナダ・ドル
			15,051,174,683.69スイス・フラン
			15,052,508,692.48中国元
			586,473,953.83デンマーク・クローネ
			44,816,671,727.98ユーロ
			1,623,491,064.68英ポンド
			261,974,421.63香港ドル
			13,115,538,283.86日本円
			62,970,203.18シンガポール・ドル
			144,409,869,174.58米ドル
アイルランド	オープン・エンド型 投資信託／投資法人	46	459,023,033.40オーストラリア・ドル
			212,016,174.52スイス・フラン
			2,504,596,615.64ユーロ
			2,178,667,586.79英ポンド
			1,828,952,933.98日本円
			32,256,102,571.79米ドル

② UBSアセット・マネジメント(UK)リミテッド

管理会社は、投資運用契約に基づき裁量権を有する投資管理者としてUBSアセット・マネジメント(UK)リミテッドを任命した。投資運用契約の条件に基づき、UBSアセット・マネジメント(UK)リミテッドは、管理会社の全般的な監督および管理に従って、投資目的および投資方針に基づき本投資法人の資産および投資を管理する責任を負う。

UBSアセット・マネジメント(UK)リミテッドは、1981年2月19日に英国で設立され、英国において、金融行為監督機構(FCA)により、金融サービスおよび投資運用業務にかかる認可および規制を受けている。UBSアセット・マネジメント(UK)リミテッドは、UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジーの事業グループであるUBSアセット・マネジメントに属している。

投資運用会社が行う主な活動は、投資運用サービスの提供である。

2021年6月末日現在、UBSアセット・マネジメント(UK)リミテッドは102本のサブ・ファンドを運用しており、そのうち運用資産額上位10位のサブ・ファンドは、以下のとおりである。

	名称	基本的性格	設定日	純資産総額 (ユーロ)
1	UBS (Lux) Fund Solutions - MSCI World Socially Responsible UCITS ETF	変動資本を有する投資法人	2018年2月14日	3,687,780,075.83
2	UBS (Lux) Fund Solutions - MSCI Emerging Markets UCITS ETF	変動資本を有する投資法人	2010年11月12日	3,585,325,635.39
3	UBS (Irl) ETF plc - MSCI ACWI Socially Responsible UCITS ETF	公開有限責任会社	2017年12月20日	3,185,709,088.88
4	UBS (Lux) Fund Solutions - MSCI Japan UCITS ETF	変動資本を有する投資法人	2010年11月12日	2,905,667,388.55
5	UBS (Lux) Fund Solutions - MSCI EMU Socially Responsible UCITS ETF	変動資本を有する投資法人	2011年8月18日	2,697,919,546.08
6	UBS (Irl) ETF plc - MSCI ACWI ESG Universal Low Carbon Select UCITS ETF	公開有限責任会社	2017年12月19日	2,552,938,600.61
7	UBS (Lux) Fund Solutions - MSCI Canada UCITS ETF	変動資本を有する投資法人	2009年9月29日	2,358,630,731.68
8	UBS (Irl) ETF plc - MSCI USA UCITS ETF	公開有限責任会社	2012年4月11日	1,901,675,953.08
9	UBS (Lux) Bond Fund - Euro High Yield (EUR)	契約型投資信託	1998年5月20日	1,822,076,145.54
10	UBS (Lux) Fund Solutions - MSCI USA Socially Responsible UCITS ETF	変動資本を有する投資法人	2020年4月30日	1,803,408,102.78

(注1) 一単位当たり純資産価格は開示していない。

(注2) 上記は管理会社から提供された情報に基づく。

[次へ](#)

4 外国投資法人の経理状況

- a. ファンドの日本語の中間財務書類は、国際会計基準第34号「期中財務報告」に準拠して作成された原文の中間財務書類を翻訳したものである。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。
- b. ファンドの原文の中間財務書類は、UBS (I r l) E T F ピーエルシーおよび全てのサブ・ファンドにつき一括して作成されている。日本語の作成にあたっては関係するサブ・ファンド(MSCI ACWI ソーシャルリー・レスポンシブル UCITS ETF)に関連する部分のみを翻訳している。ただし、「財務書類に対する注記」については、全てまたは一部のサブ・ファンドに関して記載している箇所がある。
- c. ファンドの原文の中間財務書類は、外国監査法人等(公認会計士法(昭和23年法律第103号)第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。)の監査を受けていない。
- d. ファンドの原文の中間財務書類は、米ドル、スイスフラン、ユーロ、英ポンドおよび日本円で表示されている。日本語の中間財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円による金額は、2021年6月30日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=110.58円)で換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されており、日本円に換算された金額は、四捨五入のため合計欄の数値が総数と一致しない場合がある。

(1) 資産及び負債の状況

UBS (I r l) E T F ピーエルシー

財政状態計算書

2021年6月30日現在

MSCI ACWI ソーシャルリー・
レスポンシブル UCITS ETF

	米ドル	千円
流動資産		
損益を通じて公正価値で測定する金融資産：		
譲渡可能証券	3,701,843,187	409,349,820
先物取引	52,050	5,756
先渡為替契約	11,013,009	1,217,819
現金および現金同等物	11,064,024	1,223,460
未決済金融デリバティブ商品に係る取引相手方との証拠金	577,144	63,821
投資売却未収金	—	—
償還可能参加型投資証券の保有者からの未収金	1,977,769	218,702
未収配当金	4,786,842	529,329
その他の未収金	—	—
資産合計	3,731,314,025	412,608,705
流動負債		
損益を通じて公正価値で測定する金融負債：		
先物取引	(40,550)	(4,484)
先渡為替契約	(43,726,737)	(4,835,303)
当座借越	(4,407,556)	(487,388)
ファンド投資証券償還未払金	(1,984,089)	(219,401)
投資購入未払金	(105,050)	(11,616)
未払費用	(2,749,958)	(304,090)
負債合計（償還可能参加型投資証券の保有者に帰属する純資産を除く）	(53,013,940)	(5,862,281)
償還可能参加型投資証券の保有者に帰属する純資産	3,678,300,085	406,746,423

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

UBS (I r l) E T F ピーエルシー

財政状態計算書

2020年12月31日現在

MSCI ACWI ソーシャリー・
レスポンシブル UCITS ETF

	米ドル	千円
流動資産		
損益を通じて公正価値で測定する金融資産：		
譲渡可能証券	2,680,478,025	296,407,260
先物取引	183,983	20,345
先渡為替契約	22,194,937	2,454,316
現金および現金同等物	14,350,044	1,586,828
未決済金融デリバティブ商品に係る取引相手方との証拠金	1,155,117	127,733
投資売却未収金	3,479,643	384,779
償還可能参加型投資証券の保有者からの未収金	1,078,463	119,256
未収配当金	2,492,623	275,634
その他の未収金	—	—
資産合計	2,725,412,835	301,376,151
流動負債		
損益を通じて公正価値で測定する金融負債：		
先物取引	(10,573)	(1,169)
先渡為替契約	(5,902,653)	(652,715)
当座借越	(41,752)	(4,617)
ファンド投資証券償還未払金	(1,078,473)	(119,258)
投資購入未払金	(28,618,869)	(3,164,675)
未払費用	(1,850,870)	(204,669)
負債合計（償還可能参加型投資証券の保有者に帰属する純資産を除く）	(37,503,190)	(4,147,103)
償還可能参加型投資証券の保有者に帰属する純資産	2,687,909,645	297,229,049

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

UBS (I r l) E T F ピーエルシー

包括利益計算書

2021年6月30日に終了した6ヶ月間

	注記	MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF	
		米ドル	千円
収益			
損益を通じて公正価値で測定する金融資産および金融負債に係る純利益		329,348,660	36,419,375
受取配当金		35,592,323	3,935,799
有価証券貸付収益	6	—	—
その他の収益		209	23
純収益合計		364,941,192	40,355,197
費用			
費用	2	(5,599,007)	(619,138)
費用合計		(5,599,007)	(619,138)
営業利益		359,342,185	39,736,059
金融費用			
分配金	5	(1,954,044)	(216,078)
支払利息		(58,941)	(6,518)
税金			
源泉所得税		(4,795,181)	(530,251)
金融費用および税金控除後利益		352,534,019	38,983,212
償還可能参加型投資証券の保有者に帰属する純資産の事業活動による増加		352,534,019	38,983,212

損益は継続事業からのみ発生。包括利益計算書上に記載されている損益以外に認識された損益はない。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

UBS (I r l) E T F ピーエルシー

包括利益計算書

2020年6月30日に終了した6ヶ月間

	注記	MSCI ACWI ソーシャルリー・ レスポンシブル UCITS ETF	
		米ドル	千円
収益			
損益を通じて公正価値で測定する金融資産および金融負債 に係る純損失		(76,601,205)	(8,470,561)
受取配当金		13,299,914	1,470,704
有価証券貸付収益	6	—	—
その他の収益		1,902	210
純損失合計		(63,299,389)	(6,999,646)
費用			
費用	2	(2,581,445)	(285,456)
費用合計		(2,581,445)	(285,456)
営業損失		(65,880,834)	(7,285,103)
金融費用			
分配金	5	(1,055,027)	(116,665)
支払利息		(10,885)	(1,204)
税金			
源泉所得税		(1,824,041)	(201,702)
金融費用および税金控除後損失		(68,770,787)	(7,604,674)
償還可能参加型投資証券の保有者に帰属する純資産の事業 活動による減少		(68,770,787)	(7,604,674)

損益は継続事業からのみ発生。包括利益計算書上に記載されている損益以外に認識された損益はない。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

UBS (I r l) E T F ピーエルシー

償還可能参加型投資証券の保有者に帰属する純資産の変動計算書

2021年6月30日に終了した6ヶ月間

	MSCI ACWI ソーシャリー・ レスポンシブル UCITS ETF	
	米ドル	千円
償還可能参加型投資証券の保有者に帰属する純資産、期首現在	2,687,909,645	297,229,049
投資証券取引		
当会計期間の償還可能参加型投資証券の発行	1,397,000,934	154,480,363
当会計期間の償還可能参加型投資証券の償還	(759,144,513)	(83,946,200)
投資証券取引による純増加	637,856,421	70,534,163
償還可能参加型投資証券の保有者に帰属する純資産の事業活動による増加	352,534,019	38,983,212
償還可能参加型投資証券の保有者に帰属する純資産、期末現在	3,678,300,085	406,746,423

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

UBS (I r l) E T F ピーエルシー

償還可能参加型投資証券の保有者に帰属する純資産の変動計算書

2021年6月30日に終了した6ヶ月間(続き)

MSCI ACWI ソーシャリー・
レスポンシブル UCITS ETF

口数

発行済投資証券口数、期首現在

クラス(スイスフランヘッジ) A-acc	40,926,794
クラス(スイスフランヘッジ) A-dis	1,964,003
クラス(ユーロヘッジ) A-acc	60,789,180
クラス(英ポンドヘッジ) A-dis	19,554,487
クラス(日本円ヘッジ) A-acc	—
クラス(米ドルヘッジ) A-acc	50,049,464
クラス(米ドル) A-acc	12,079,344
クラス(米ドル) A-dis	864,327

当会計期間における投資証券発行口数

クラス(スイスフランヘッジ) A-acc	19,860,754
クラス(スイスフランヘッジ) A-dis	351,000
クラス(ユーロヘッジ) A-acc	24,604,566
クラス(英ポンドヘッジ) A-dis	11,421,797
クラス(日本円ヘッジ) A-acc	108,500
クラス(米ドルヘッジ) A-acc	24,684,811
クラス(米ドル) A-acc	8,726,905
クラス(米ドル) A-dis	1,902,721

当会計期間における投資証券償還口数

クラス(スイスフランヘッジ) A-acc	(12,806,169)
クラス(スイスフランヘッジ) A-dis	—
クラス(ユーロヘッジ) A-acc	(17,964,953)
クラス(英ポンドヘッジ) A-dis	(2,606,781)
クラス(日本円ヘッジ) A-acc	—
クラス(米ドルヘッジ) A-acc	(13,710,620)
クラス(米ドル) A-acc	(2,231,959)
クラス(米ドル) A-dis	(186,204)

発行済投資証券口数、期末現在

クラス(スイスフランヘッジ) A-acc	47,981,379
クラス(スイスフランヘッジ) A-dis	2,315,003
クラス(ユーロヘッジ) A-acc	67,428,793
クラス(英ポンドヘッジ) A-dis	28,369,503

クラス（日本円ヘッジ）A-acc	108,500
クラス（米ドルヘッジ）A-acc	61,023,655
クラス（米ドル）A-acc	18,574,290
クラス（米ドル）A-dis	2,580,844

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

UBS (I r l) E T F ピーエルシー

償還可能参加型投資証券の保有者に帰属する純資産の変動計算書

2020年6月30日に終了した6ヶ月間

	MSCI ACWI ソーシャリー・ レスポンシブル UCITS ETF	
	米ドル	千円
償還可能参加型投資証券の保有者に帰属する純資産、期首現在	1,062,060,530	117,442,653
投資証券取引		
当会計期間の償還可能参加型投資証券の発行	579,608,288	64,093,084
当会計期間の償還可能参加型投資証券の償還	(237,781,838)	(26,293,916)
投資証券取引による純増加	341,826,450	37,799,169
償還可能参加型投資証券の保有者に帰属する純資産の事業活動による減少	(68,770,787)	(7,604,674)
償還可能参加型投資証券の保有者に帰属する純資産、期末現在	1,335,116,193	147,637,149

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

UBS (I r l) E T F ピーエルシー

償還可能参加型投資証券の保有者に帰属する純資産の変動計算書

2020年6月30日に終了した6ヶ月間(続き)

MSCI ACWI ソーシャリー・
レスポンシブル UCITS ETF

	口数
発行済投資証券口数、期首現在	
クラス(スイスフランヘッジ) A-acc	26,190,432
クラス(スイスフランヘッジ) A-dis	1,887,563
クラス(ユーロヘッジ) A-acc	27,127,107
クラス(英ポンドヘッジ) A-dis	8,903,364
クラス(米ドルヘッジ) A-acc	25,981,554
クラス(米ドル) A-acc	—
クラス(米ドル) A-dis	1,190,855
当会計期間における投資証券発行口数	
クラス(スイスフランヘッジ) A-acc	12,221,822
クラス(スイスフランヘッジ) A-dis	182,223
クラス(ユーロヘッジ) A-acc	15,294,025
クラス(英ポンドヘッジ) A-dis	10,537,239
クラス(米ドルヘッジ) A-acc	10,600,939
クラス(米ドル) A-acc	3,191,613
クラス(米ドル) A-dis	10,008
当会計期間における投資証券償還口数	
クラス(スイスフランヘッジ) A-acc	(6,363,736)
クラス(スイスフランヘッジ) A-dis	(389,363)
クラス(ユーロヘッジ) A-acc	(8,026,388)
クラス(英ポンドヘッジ) A-dis	(2,368,904)
クラス(米ドルヘッジ) A-acc	(6,778,864)
クラス(米ドル) A-acc	(133,788)
クラス(米ドル) A-dis	(363,602)
発行済投資証券口数、期末現在	
クラス(スイスフランヘッジ) A-acc	32,048,518
クラス(スイスフランヘッジ) A-dis	1,680,423
クラス(ユーロヘッジ) A-acc	34,394,744
クラス(英ポンドヘッジ) A-dis	17,071,699
クラス(米ドルヘッジ) A-acc	29,803,629
クラス(米ドル) A-acc	3,057,825
クラス(米ドル) A-dis	837,261

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

UBS (I r l) E T F ピーエルシー

キャッシュ・フロー計算書

2021年6月30日に終了した6ヶ月間

MSCI ACWI ソーシャリー・
レスポンシブル UCITS ETF

	米ドル	千円
事業活動によるキャッシュ・フロー		
償還可能参加型投資証券の保有者に帰属する純資産の事業活動による増加	352,534,019	38,983,212
調整:		
その他の収益	(209)	(23)
受取配当金	(35,592,323)	(3,935,799)
有価証券貸付収益	—	—
償還可能参加型投資証券の保有者への分配金	1,954,044	216,078
源泉所得税	4,795,181	530,251
合計	323,690,712	35,793,719
損益を通じて公正価値で測定する金融資産および金融負債に係る純利益	(299,401,963)	(33,107,869)
投資の購入による支払い	(1,755,668,342)	(194,141,805)
投資の売却による収入	1,057,858,073	116,977,946
現金証拠金の変動額	577,973	63,912
未払金の変動額	899,088	99,421
事業活動に使用したキャッシュ	(672,044,459)	(74,314,676)
その他の収益	209	23
受取配当金	33,278,920	3,679,983
有価証券貸付収益	—	—
源泉所得税支払額	(4,795,181)	(530,251)
事業活動に使用したキャッシュ純額	(643,560,511)	(71,164,921)
財務活動		
償還可能参加型投資証券の保有者への分配支払額	(1,954,044)	(216,078)
当会計期間の償還可能参加型投資証券の発行	1,396,101,628	154,380,918
当会計期間の償還可能参加型投資証券の償還	(758,238,897)	(83,846,057)
財務活動により生じたキャッシュ純額	635,908,687	70,318,783
現金および現金同等物の純減少額	(7,651,824)	(846,139)
現金および現金同等物、期首残高	14,308,292	1,582,211
現金および現金同等物、期末残高	6,656,468	736,072

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

UBS (I r l) E T F ピーエルシー

キャッシュ・フロー計算書

2020年6月30日に終了した6ヶ月間

MSCI ACWI ソーシャリー・
レスポンシブル UCITS ETF

	米ドル	千円
事業活動によるキャッシュ・フロー		
償還可能参加型投資証券の保有者に帰属する純資産の事業活動による減少	(68,770,787)	(7,604,674)
調整:		
その他の収益	(1,902)	(210)
受取配当金	(13,299,914)	(1,470,704)
有価証券貸付収益	—	—
償還可能参加型投資証券の保有者への分配金	1,055,027	116,665
源泉所得税	1,824,041	201,702
合計	(79,193,535)	(8,757,221)
損益を通じて公正価値で測定する金融資産および金融負債に係る純損失	79,527,203	8,794,118
投資の購入による支払い	(619,515,195)	(68,505,990)
投資の売却による収入	272,203,158	30,100,225
現金証拠金の変動額	(1,576,652)	(174,346)
未払金の変動額	59,511	6,581
事業活動に使用したキャッシュ	(348,495,510)	(38,536,633)
その他の収益	1,902	210
受取配当金	13,061,707	1,444,364
有価証券貸付収益	—	—
源泉所得税支払額	(1,824,041)	(201,702)
事業活動に使用したキャッシュ純額	(337,255,942)	(37,293,762)
財務活動		
償還可能参加型投資証券の保有者への分配支払額	(1,055,027)	(116,665)
当会計期間の償還可能参加型投資証券の発行	576,471,195	63,746,185
当会計期間の償還可能参加型投資証券の償還	(236,271,285)	(26,126,879)
財務活動により生じたキャッシュ純額	339,144,883	37,502,641
現金および現金同等物の純増加額	1,888,941	208,879
現金および現金同等物、期首残高	7,088,556	783,853
現金および現金同等物、期末残高	8,977,497	992,732

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

[次へ](#)

UBS (I r l) E T F ピーエルシー

2021年6月30日に終了した6ヶ月間に係る財務書類に対する注記

注記1 重要な会計方針の要約

本要約中間財務書類(未監査)の作成に適用した重要な会計方針は以下のとおりである。本会計方針は、特に記載がない限り、当会計期間に一貫して適用される。

(a) 表示基準

2021年6月30日に終了した会計期間に係る本要約中間財務書類(未監査)は、国際会計基準第34号「期中財務報告」(以下「IAS第34号」という。))およびUCITS規則に準拠して表示されている。本財務書類は取得原価ベースで作成され、損益を通じて公正価値で測定するための金融資産および金融負債の再評価により修正されている。

2021年6月30日現在の要約中間財務書類(未監査)は監査を受けていない。2020年12月31日現在の監査済年次財務書類に関する法定監査人による監査報告書は無限定適正意見であったことを記しておく。

本要約中間財務書類(未監査)は、欧州連合(以下「EU」という。))で採用される国際財務報告基準(以下「IFRS」という。))、UCITS規則およびアイルランドの会社法に従って作成された、2020年12月31日に終了した会計年度の本投資法人の監査済年次財務書類と併せて読まれるべきである。本要約中間財務書類(未監査)に適用されている会計方針、会計上の見積りおよび判断、ならびに計算方法は、2020年12月31日に終了した会計年度の本投資法人の監査済年次財務書類に適用されたものと一致している。

公表済であり、2021年1月1日以降開始する会計年度に発効済の新基準、新改訂および新解釈指針

公表済であり、2021年1月1日以降開始する会計年度に発効済の新基準、新改訂および新解釈指針のうち、財務書類に含まれる本投資法人の財政状態、運用成績または開示へ重要な影響を及ぼすものはない。

公表済であるが2021年1月1日以降開始する会計年度に未発効であり、早期適用されていない新基準、新改訂および新解釈指針

IFRS第17号「保険契約」は2017年5月に公表され、2023年1月1日以降開始する会計期間に発効する。当該基準は、企業が発行する保険契約(再保険契約を含む)、企業が保有する再保険契約、および企業が発行する裁量権付有配当投資契約(企業が保険契約も発行する場合)に適用される。保険契約とは、「一方の当事者(発行者)が他方の当事者(保険契約者)から、所定の不確実な将来事象(保険事故)が保険契約者に不利な影響を与えた場合に保険契約者に補償することに同意することにより、重大な保険リスクを引き受ける契約」と定義される。財務書類に含まれる本投資法人の財政状態、運用成績または開示への当該新基準による重要な影響はないと見込まれている。

未発効であり、本投資法人に重要な影響を及ぼすことが見込まれるその他の基準、解釈指針または現行基準の改訂はない。

見積りに関する方針

本要約中間財務書類（未監査）の作成において、経営陣は会計方針の適用ならびに資産・負債および収益・費用の報告金額に影響を及ぼす判断、見積りおよび仮定を行うことが要求される。実際の結果はこれらの見積りとは異なる場合がある。

本要約中間財務書類（未監査）の作成にあたり、本投資法人の会計方針の適用および見積りの主要なソースの不確実性について経営陣が行った重要な判断は、2020年12月31日に終了した会計年度の本投資法人の監査済財務書類に適用されたものと同一である。

比較数値

IAS第34号に準拠し、財政状態計算書、投資明細表および関連する注記に表示されている比較数値は2020年12月31日現在のものである。包括利益計算書、償還可能参加型投資証券の保有者に帰属する純資産の変動計算書、キャッシュ・フロー計算書および関連する注記に表示されている比較数値は、前中間会計期間である2020年6月30日に終了した6ヶ月間のものである。

注記2 報酬および費用

ファンドが支払うすべての報酬および費用は、単一の報酬として支払われる。これを定率報酬という。前述の定率報酬の中から、本投資法人は、本投資法人の資産に関連して発生したすべての費用を負担する。これには、投資運用会社または副投資運用会社、保管会社、管理事務代行会社、取締役、販売会社または副販売会社ならびに会社秘書役の報酬および経費が含まれるが、これらに限定されない。本投資法人は、本投資法人に投資、または業務を提供している者に、またはあらゆるファンドに関する、報酬の一部または全額を支払う場合がある。

以下の報酬および費用も定率報酬から支出される。

- (i) 証券取引所における投資証券の上場および維持に係る費用
- (ii) 取締役会および投資主総会の招集および開催に係る費用
- (iii) 弁護士およびその他のコンサルティング業務に係る報酬および費用
- (iv) 現在および潜在投資主に対する目論見書、補遺、年次および半期報告書ならびにその他の書類の作成、印刷、公表および配布に係る費用および経費
- (v) インデックス・プロバイダーまたは本投資法人が使用する知的財産、商標またはサービスマークのその他のライセンサーに支払う使用許諾から生じる費用および経費またはその他の支払報酬
- (vi) 投資運用会社によって任命された投資顧問に係る費用および経費
- (vii) 本投資法人またはファンドの継続的な運営のために必要ないし適切なものとして取締役により承認された随時発生するその他の費用および経費(非経常的および特別費用および経費を除く)
- (viii) 上記以外の本投資法人およびファンドのあらゆる設定費用

定率報酬には、特別費用および経費が含まれない(これらには、本投資法人の投資に係る取引手数料、印紙税またはポートフォリオ・リバランシングに係る諸税を含むその他の税、源泉徴収税、本投資法人の投資に関連して発生した手数料および仲介手数料、借入金の利息および借入条件の交渉、効力発生または変更において発生した銀行手数料、ファンドへの投資に関連して仲介業者から請求される手数料、ならびに本投資法人に関連した重要な訴訟等の随時発生する特別または例外的な費用(ある場合)が含まれるが、これらに限定されない。これらはすべて関連するファンドの資産とは別に支払われる)。定率報酬は、各ファンドの純資産価額から日々計算および計上され、月次後払いで支払われる。各ファンドの定率報酬は、以下および関連する補遺に記載のとおりである。ファンドの運用に関連したファンドの費用が以下に記載した定率報酬を上回る場合、販売会社またはその関連会社は、自らの資産から不足分を補う。

ファンド	クラス A-dis/acc
MSCI USA UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-acc	0.19%
MSCI USA UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-dis	0.19%
MSCI USA UCITS ETF Class (ir-hedged to GBP) A-acc ¹	0.19%
MSCI USA UCITS ETF Class (USD) A-acc	0.14%
MSCI USA UCITS ETF Class (USD) A-dis	0.14%
MSCI USA UCITS ETF Class (USD) A-UKdis	0.14%
MSCI USA Value UCITS ETF Class (USD) A-dis	0.20%
MSCI World UCITS ETF Class (USD) A-acc	0.30%
MSCI World UCITS ETF Class (USD) A-dis	0.30%
S&P 500 UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-acc	0.22%
S&P 500 UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc	0.22%
S&P 500 UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-dis	0.22%
S&P 500 UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-dis	0.22%
S&P 500 UCITS ETF Class (USD) A-dis	0.12%
Solactive Global Pure Gold Miners UCITS ETF Class (USD) A-dis	0.43%
MSCI Australia UCITS ETF Class (AUD) A-acc	0.40%
MSCI Australia UCITS ETF Class (AUD) A-dis	0.40%
MSCI Australia UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-acc	0.50%
MSCI Australia UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc	0.50%
MSCI Australia UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-acc	0.50%
MSCI Australia UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-dis	0.50%
MSCI Australia UCITS ETF Class (hedged to USD) A-acc	0.50%
MSCI USA hedged to EUR UCITS ETF Class (EUR) A-acc	0.19%
MSCI USA hedged to EUR UCITS ETF Class (EUR) A-dis	0.19%
MSCI USA hedged to CHF UCITS ETF Class (CHF) A-acc	0.19%
S&P Dividend Aristocrats ESG UCITS ETF Class (USD) A-dis	0.30%
MSCI United Kingdom IMI Socially Responsible UCITS ETF Class (GBP) A-dis	0.28%
MSCI United Kingdom IMI Socially Responsible UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-dis	0.38%
MSCI United Kingdom IMI Socially Responsible UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc	0.38%
MSCI United Kingdom IMI Socially Responsible UCITS ETF Class (hedged to USD) A-acc	0.38%
Factor MSCI USA Low Volatility UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-acc	0.35%
Factor MSCI USA Low Volatility UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc	0.35%
Factor MSCI USA Low Volatility UCITS ETF Class (USD) A-dis	0.25%
Factor MSCI USA Prime Value UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-acc	0.35%
Factor MSCI USA Prime Value UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc	0.35%
Factor MSCI USA Prime Value UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-dis	0.35%
Factor MSCI USA Prime Value UCITS ETF Class (USD) A-dis	0.25%
Factor MSCI USA Quality UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-acc	0.35%
Factor MSCI USA Quality UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc	0.35%
Factor MSCI USA Quality UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-dis	0.35%
Factor MSCI USA Quality UCITS ETF Class (USD) A-dis	0.25%
MSCI USA Select Factor Mix UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-acc ²	0.30%
MSCI USA Select Factor Mix UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc ²	0.30%
MSCI USA Select Factor Mix UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-dis ²	0.30%
MSCI USA Select Factor Mix UCITS ETF Class (USD) A-acc ³	0.25%
MSCI USA Select Factor Mix UCITS ETF Class (USD) A-dis ³	0.25%

ファンド	クラス A-dis/acc
MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF クラス (スイスフランヘッジ) A-acc	0.33%
MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF クラス (スイスフランヘッジ) A-dis	0.33%
MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF クラス (ユーロヘッジ) A-acc	0.33%
MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF クラス (英ポンドヘッジ) A-dis	0.33%
MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF クラス (日本円ヘッジ) A-acc ⁴	0.33%
MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF クラス (米ドルヘッジ) A-acc	0.33%
MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF クラス (米ドル) A-acc	0.28%
MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF クラス (米ドル) A-dis	0.28%
MSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETF クラス (スイスフランヘッジ) A-acc	0.33%
MSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETF クラス (スイスフランヘッジ) A-dis	0.33%
MSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETF クラス (ユーロヘッジ) A-acc	0.33%
MSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETF クラス (英ポンドヘッジ) A-acc	0.33%
MSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETF クラス (日本円ヘッジ) A-acc	0.33%
MSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETF クラス (米ドルヘッジ) A-acc	0.33%
MSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETF クラス (米ドル) A-dis	0.28%
Global Gender Equality UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-acc	0.30%
Global Gender Equality UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-dis	0.30%
Global Gender Equality UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc	0.30%
Global Gender Equality UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-acc	0.30%
Global Gender Equality UCITS ETF Class (hedged to USD) A-acc	0.30%
Global Gender Equality UCITS ETF Class (USD) A-acc	0.20%
Global Gender Equality UCITS ETF Class (USD) A-dis	0.20%
S&P 500 ESG UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-acc	0.17%
S&P 500 ESG UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc	0.17%
S&P 500 ESG UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-dis	0.17%
S&P 500 ESG UCITS ETF Class (USD) A-acc	0.12%
S&P 500 ESG UCITS ETF Class (USD) A-dis	0.12%
MSCI USA Socially Responsible UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-acc	0.25%
MSCI USA Socially Responsible UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc	0.25%
MSCI USA Socially Responsible UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-dis ⁵	0.25%
MSCI USA Socially Responsible UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-dis	0.25%
MSCI USA Socially Responsible UCITS ETF Class (USD) A-acc	0.22%
MSCI USA Socially Responsible UCITS ETF Class (USD) A-dis	0.22%
MSCI World Socially Responsible UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-acc	0.27%
MSCI World Socially Responsible UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc	0.27%
MSCI World Socially Responsible UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-dis	0.27%
MSCI World Socially Responsible UCITS ETF Class (USD) A-acc	0.22%
MSCI World Socially Responsible UCITS ETF Class (USD) A-dis	0.22%
S&P 500 ESG ELITE UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-acc ⁶	0.20%
S&P 500 ESG ELITE UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc ⁶	0.20%
S&P 500 ESG ELITE UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-dis ⁶	0.20%
S&P 500 ESG ELITE UCITS ETF Class (USD) A-acc ⁷	0.15%
UBS Climate Aware Global Developed Equity CTB UCITS ETF Class (USD) A-dis ⁸	0.19%
MSCI EMU Climate Paris Aligned UCITS ETF Class (EUR) A-acc ⁹	0.18%
MSCI Europe Climate Paris Aligned UCITS ETF Class (EUR) A-acc ⁹	0.18%
MSCI USA Climate Paris Aligned UCITS ETF Class (USD) A-acc ⁹	0.12%
MSCI Japan Climate Paris Aligned UCITS ETF Class (JPY) A-acc ¹⁰	0.20%
MSCI World Climate Paris Aligned UCITS ETF Class (USD) A-dis ¹⁰	0.20%

- 1 当該投資証券クラスは、2021年4月30日に運用を開始した。
- 2 2021年4月1日より、定率報酬は0.40%から0.30%に変更された。
- 3 2021年4月1日より、定率報酬は0.30%から0.25%に変更された。
- 4 当該投資証券クラスは、2021年5月18日に運用を開始した。
- 5 当該投資証券クラスは、2021年1月20日に運用を開始した。
- 6 当該投資証券クラスは、2021年3月5日に運用を開始した。
- 7 当該ファンドおよびその投資証券クラスは、2021年2月18日に運用を開始した。
- 8 当該ファンドおよびその投資証券クラスは、2021年2月26日に運用を開始した。
- 9 当該ファンドおよびその投資証券クラスは、2021年3月9日に運用を開始した。
- 10 当該ファンドおよびその投資証券クラスは、2021年3月11日に運用を開始した。

2021年6月30日に終了した会計期間および比較対象期間の実際のTERについては、13ページから23ページ（訳注：原文のページ）に掲載されているパフォーマンス表を参照のこと。

注記3 関連当事者

当事者は、財務上または業務上の意思決定に当たり、一方の当事者が他方の当事者に対して重要な影響力を行使できる場合、関連するものと見なされる。

取締役の見解において、投資運用会社、取締役、販売会社および管理会社はIAS第24号「関連当事者との取引」に基づく関連当事者である。

取締役アンドレアス・ハーバーツェト、クレメンス・ロイターおよびフランク・ミューゼルは、販売会社であるUBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジーの従業員である。取締役イアン・アッシュメントは、投資運用会社の従業員である。

2021年6月30日現在、本投資法人の取締役のいずれもファンドの投資証券を有していない(2020年12月31日現在：ゼロ)。

2021年6月30日に終了した会計期間において取締役の報酬18,038米ドル(2020年6月30日に終了した会計期間：82,928米ドル)が定率報酬から支払われた。独立取締役のみが取締役の報酬を受ける権利を有する。

管理会社であるUBSファンド・マネジメント(ルクセンブルグ)エス・エイは、2021年6月30日に終了した会計期間に報酬450,219米ドル(2020年6月30日に終了した会計期間：227,733米ドル)を受け取った。これは、定率報酬から支払われた。

UBSアセット・マネジメント(UK)リミテッドは、本投資法人の投資運用会社および英国のファシリティー・エージェントである。UBSアセット・マネジメント(UK)リミテッドに対する報酬は、当会計期間の定率報酬から支払われた。本投資法人の報酬体系の説明については、注記2「報酬および費用」を参照のこと。すべての取引は、通常の業務で締結された。2021年6月30日に終了した会計期間の投資運用会社の報酬7,631,819米ドル(2020年6月30日に終了した会計期間：4,384,597米ドル)は、定率報酬から支払われた。

UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジーは、本投資法人の販売会社である。販売会社に対する報酬は、当会計期間の定率報酬から支払われた。販売会社に対する手数料および報酬は7,639,098米ドル(2020年6月30日に終了した会計期間：3,492,939米ドル)であった。

Baader Bank、Banca IMI SpA、Bank Julius Baer & Co AG、Citigroup London、Credit Suisse Sec (Europe) Limited、DRW Global Markets Limited、Flow Traders B. V.、Goldman Sachs International、HSBC London、Jane Street Financial Limited、Intesa Sanpaolo S.p.A.、Morgan Stanley & Co International plc、Optiver V.O.F.、RBC Europe Ltd、Societe Generale、Susquehanna International Securities Limited、ユービーエス・エイ・ジー、Unicredit Bank AG およびVirtuは、指定参加者である。これらの銀行の数行は、スイス証券取引所、ドイツ証券取引所 XETRA、ロンドン証券取引所、イタリア証券取引所およびユーロネクスト・アムステルダムマーケット・メーカーでもある。Flow Traders B. V.、Jane Street Financial Limited、Optiver V.O.F.、Societe Generale、Susquehanna International Securities Limitedおよびユービーエス・エイ・ジーは合同の指定参加者であり、2021年6月30日現在、投資証券発行登録におけるファンドの100%(2020年12月31日：100%)を保有しており、その大半を流通市場で転売している。

UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジーは、借手に対するデュー・デリジェンス・チェックの実施およびウェブサイト管理に関して貸付収益の一部を受け取っている。

2021年6月30日および2020年12月31日現在、MSCI World UCITS ETF、MSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETF、UBS Climate Aware Global Developed Equity CTB UCITS ETFおよびMSCI Europe Climate Paris Aligned UCITS ETFは、親会社に関連しているUBSグループに対する株式投資をそれぞれ1つ保有していた。詳細については、当該ファンドの投資明細表および以下の表を参照のこと。

2021年6月30日に終了した会計期間

	MSCI ACWI ESG ユニバーサル・ ロー・カーボン・セレクト UCITS ETF 米ドル
期首公正価値	1,122,039
購入	2,771,030
売却	(172,609)
投資に係る実現損益および未実現損益	95,073
期末公正価値	3,815,533
受取配当金	30,017

2020年12月31日に終了した会計年度

	MSCI ACWI ESG ユニバーサル・ ロー・カーボン・セレクト UCITS ETF 米ドル
期首公正価値	1,158,809
購入	676,659
売却	(675,925)
投資に係る実現損益および未実現損益	(37,504)
期末公正価値	1,122,039
受取配当金	23,007

受取配当金

関係者

UCITS規則第41条「関係者との取引制限」は、責任を有する者が、UCITSと関係者との間のいかなる取引も、a) 独立企業間の原則に基づき、b) UCITSの投資証券保有者の最善の利益のために実行されていることを確保するよう定めている。

中央銀行UCITS規則第81(4)条で要求されているとおり、取締役は、規則第43(1)条に定める義務が、関係当事者とのすべての取引に適用されていることを確保するための取決め(この取決めは文書化された手続によって裏付けられる。)が整備されており、かつ、本報告書に関連する会計期間中に締結された関係当事者とのすべての取引が規則第43(1)条に定める義務を遵守していることを確認している。

取締役は、(i) 中央銀行UCITS規則第81(4)条に定める義務が、(中央銀行UCITS規則第42条で定義される) 関係当事者とのすべての取引に適用されていることを確保するための取決め(この取決めは文書化された手続によって裏付けられる。)が整備されており、かつ、(ii) 本報告書に関連する会計期間中に締結された関係当事者とのすべての取引が中央銀行UCITS規則第43(1)条に定める義務を遵守していることを確認している。

直接的な仲介業務

2021年6月30日に終了した会計期間に利用した直接的な仲介業務はない（2020年6月30日に終了した会計期間：なし）。

注記4 コミッション取引

2021年6月30日に終了した会計期間に、本投資法人に代わって締結されたコミッション・シェアリング・アグリーメント（CSA）はなかった（2020年6月30日に終了した会計期間：なし）。

[次へ](#)

注記5 分配

取締役は、以下を原資とした分配金を宣言する予定である。

- (i) 純収益および／または
- (ii) クラス (米ドル) A-dis投資証券に帰属する実現および未実現損失を控除した実現および未実現利益

6月30日および12月31日に終了した6ヶ月間における期末30暦日以内のもの。当該分配金は、分配宣言後2ヶ月以内に支払う。

以下の表に記載されている分配金の1口当たりレートは、各投資証券クラスの通貨ではなくファンドの機能通貨建てである。

2021年6月30日に終了した会計期間について、以下の分配金が支払われた。

ファンド	権利落ち日	1口当たり レート	現地通貨	現地通貨合計	基準通貨	基準通貨 合計
MSCI ACWI ソーシャリー・レスポンシブル UCITS ETF クラス (米ドル) A-dis	2021年2月1日	0.0831	米ドル	132,329	米ドル	132,329
MSCI ACWI ソーシャリー・レスポンシブル UCITS ETF クラス (スイスフランヘッジ) A-dis	2021年2月1日	0.0603	スイスフラン	106,056	米ドル	118,429
MSCI ACWI ソーシャリー・レスポンシブル UCITS ETF クラス (英ポンドヘッジ) A-dis	2021年2月1日	0.0794	英ポンド	1,246,359	米ドル	1,703,286
						1,954,044
MSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETF クラス (米ドル) A-dis	2021年2月1日	0.0772	米ドル	37,709	米ドル	37,709
MSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETF クラス (スイスフランヘッジ) A-dis	2021年2月1日	0.0716	スイスフラン	334,303	米ドル	373,418
						411,127

2020年6月30日に終了した会計期間について、以下の分配金が支払われた。

ファンド	権利落ち日	1口当たり レート	現地通貨	現地通貨 合計	基準通貨	基準通貨 合計
MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF クラス (米ドル) A-dis	2020年2月3日	0.0907	英ポンド	108,918	米ドル	108,918
MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF クラス (スイスフランヘッジ) A-dis	2020年2月3日	0.0631	スイスフラン	112,555	米ドル	116,621
MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF クラス (英ポンドヘッジ) A-dis	2020年2月3日	0.0857	英ポンド	637,844	米ドル	829,488
						1,055,027
MSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETF クラス (米ドル) A-dis	2020年2月3日	0.0821	米ドル	48,111	米ドル	48,111
MSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETF クラス (スイスフランヘッジ) A-dis	2020年2月3日	0.0731	スイスフラン	74,958	米ドル	77,612
						125,723

[次へ](#)

注記6 有価証券貸付

有価証券貸付とは、有価証券の貸手（本投資法人）から第三者である借手への、任命された貸付機関を通じた一時譲渡である。この貸付有価証券の対価として借手は、有価証券引渡し前に担保を提供し、貸付期間にわたり手数料を支払う。貸付プログラムに基づく貸付はすべて未決済のまま日次で引き継がれ、要求により終了する。

本投資法人は、投資家のコスト純額の削減を目的として、特定の現物複製型ファンドに関する有価証券貸付を実施している。本投資法人との有価証券貸付は常に、すべての資産クラスについて少なくとも105%の委託証拠金で超過担保されている。2014年4月1日に追加的なセーフガードが導入され、貸付残高の上限が各ファンドの運用資産の50%に設定された。「社会的責任投資（socially responsible）」インデックスであるESG、Gender Equalityインデックスまたは複数のパリ協定準拠（Paris Aligned）インデックスに追隨するファンドは有価証券貸付プログラムの対象ではない。

2021年6月30日現在、以下のファンドは有価証券貸付プログラムの対象である。

MSCI USA UCITS ETF
MSCI USA Value UCITS ETF
MSCI World UCITS ETF
S&P 500 UCITS ETF
Solactive Global Pure Gold Miners UCITS ETF
MSCI Australia UCITS ETF
MSCI USA hedged to EUR UCITS ETF
MSCI USA hedged to CHF UCITS ETF
S&P Dividend Aristocrats ESG UCITS ETF
Factor MSCI USA Low Volatility UCITS ETF
Factor MSCI USA Prime Value UCITS ETF
Factor MSCI USA Quality UCITS ETF
MSCI USA Select Factor Mix UCITS ETF

当会計期間末現在、以下のファンドは有価証券貸付プログラムの対象ではなかった。

MSCI United Kingdom IMI Socially Responsible UCITS ETF
MSCI ACWI ソーシャルリー・レスポンシブル UCITS ETF
MSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETF
Global Gender Equality UCITS ETF
S&P 500 ESG UCITS ETF
MSCI USA Socially Responsible UCITS ETF
MSCI World Socially Responsible UCITS ETF
S&P 500 ESG ELITE UCITS ETF
UBS Climate Aware Global Developed Equity CTB UCITS ETF
MSCI EMU Climate Paris Aligned UCITS ETF
MSCI Europe Climate Paris Aligned UCITS ETF
MSCI USA Climate Paris Aligned UCITS ETF

MSCI Japan Climate Paris Aligned UCITS ETF

MSCI World Climate Paris Aligned UCITS ETF

貸付は通常、有価証券貸付代行会社であるステート・ストリート・バンクのみ実施可能であり、ステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニー（以下「ステート・ストリート」という。）が提供する借手の債務不履行に対する補償が付されている。担保は、当該貸付代行会社の貸借対照表とは別の預託勘定にて保有される。委託証拠金の必要水準を常に確実に維持できるよう、日次で時価評価を実施している。ステート・ストリートが借手に係る補償を提供し、可能性のある借手のリストを慎重に選定する一方で、UBS Credit & Riskが付加的レベルの監視を行い、あらかじめ承認された借手のリストを作成する。

有価証券貸付取引に関連する権利移転担保契約によって受け取った非現金担保は、売却、再投資または担保に供することができない。

有価証券貸付は、借手が自身の義務に従い借入有価証券を返却しない場合、また提供された担保価額では有価証券の再購入費用が填補できない場合に、一定のリスクにさらされることに注意が必要である。この場合は一定の条件の下、ステート・ストリートが借手の債務不履行を補償する条項に従い、代替有価証券の購入費用を負担する。

本注記に記載されている金額は、機能通貨が米ドル以外のファンドの金額を含め、すべて米ドル建てで表示されている。

注記7 店頭 (Over the Counter) デリバティブ契約

2021年6月30日現在、本投資法人は以下の店頭（以下「OTC」という。）デリバティブ契約を締結している。

2021年6月30日または2020年12月31日現在、OTCデリバティブ契約に関してファンドが受領または差し入れている担保はない。

金額はすべて、ファンドの表示通貨ではなく、本投資法人の表示通貨である米ドル建てである。

2021年6月30日現在のOTCデリバティブ・エクスポージャー		
	MSCI ACWI ソーシャル・ レスポンシブル UCITS ETF (単位：1,000米ドル)	MSCI ACWI ESG ユニバーサル・ ロー・カーボン・セレクト UCITS ETF (単位：1,000米ドル)
OTC金融デリバティブ商品		
先渡為替契約		
－エクスポージャー総額	698,668	766,305
－未実現損失	(32,714)	(25,542)
OTCデリバティブによる取引相手のエクスポージャー		
－OTC契約のエクスポージャー総額		
バンク・オブ・アメリカ	663,760	6,575
シティバンク	(724)	347,476
ゴールドマン・サックス・インターナショナル	—	87,025
モルガン・スタンレー	—	447,873
ステート・ストリート・バンク・ロンドン	35,632	(122,644)

2020年12月31日現在のOTCデリバティブ・エクスポージャー		
	MSCI ACWI ソーシャル・ レスポンシブル UCITS ETF (単位：1,000米ドル)	MSCI ACWI ESG ユニバーサル・ ロー・カーボン・セレクト UCITS ETF (単位：1,000米ドル)
OTC金融デリバティブ商品		
先渡為替契約		
－エクスポージャー総額	681,940	217,115
－未実現利益	16,292	5,131
OTCデリバティブによる取引相手のエクスポージャー		
－OTC契約のエクスポージャー総額		
バンク・オブ・アメリカ	(110,088)	(4,045)
パークレイズ・バンク	(144)	—
カナダ帝国商業銀行	—	(1)
シティバンク	592,919	124,049
ゴールドマン・サックス・インターナショナル	264,384	142,935
HSBCバンク	(3)	(106)
JPモルガン・チェース銀行	(927)	—
モルガン・スタンレー	1,650	(77)
ステート・ストリート・バンク・ロンドン	(68,452)	(46,342)
ユービーエス・エイ・ジー	(2,124)	(178)
ウエストバック・バンキング・コーポレーション	4,725	880

注記8 為替レート

MSCI USA UCITS ETF、MSCI USA Value UCITS ETF、MSCI World UCITS ETF、S&P 500 UCITS ETF、S&P 500 ESG UCITS ETF、Solactive Global Pure Gold Miners UCITS ETF、S&P Dividend Aristocrats ESG UCITS ETF、Factor MSCI USA Low Volatility UCITS ETF、Factor MSCI USA Prime Value UCITS ETF、Factor MSCI USA Quality UCITS ETF、MSCI USA Select Factor Mix UCITS ETF、MSCI ACWI ソーシャリー・レスポンシブル UCITS ETF、MSCI ACWI ESG ユニバーサル UCITS ETF(訳注:2021年6月23日付でMSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETFに名称変更)、Global Gender Equality UCITS ETF、MSCI USA Socially Responsible UCITS ETF、MSCI World Socially Responsible UCITS ETF、S&P 500 ESG ELITE UCITS ETF、UBS Climate Aware Global Developed Equity CTB UCITS ETF、MSCI USA Climate Paris Aligned UCITS ETFおよびMSCI World Climate Paris Aligned UCITS ETFの財務書類は米ドル建てで作成される。その他の通貨建ての資産および負債の米ドルへの換算に、会計期間/年度の末日における以下の為替レートが使用されている。

	2021年6月30日現在	2020年12月31日現在
豪ドル	1.3320	1.2959
ブラジルリアル	5.0179	5.1942
英ポンド	0.7239	0.7316
カナダドル	1.2383	1.2740
チリペソ	728.1100	710.5000
コロンビアペソ	3,734.0000	3,420.5000
チェココルナ	21.5086	21.4638
デンマーククローネ	6.2706	6.0835
エジプトポンド	15.6950	15.7300
ユーロ	0.8432	0.8173
香港ドル	7.7659	7.7539
ハンガリーフォリント	296.0031	296.4203
インドルピー	74.3300	73.0675
インドネシアルピア	14,500.0000	14,050.0000
イスラエルシェケル	3.2585	3.2108
日本円	110.9900	103.2450
クウェートディナール	0.3013	0.3042
マレーシアリンギット	4.1515	4.0225
メキシコペソ	19.9105	19.9255
ニュージーランドドル	1.4311	1.3889
ノルウェークローネ	8.6052	8.5620
パキスタンルピー	157.6000	159.8000
フィリピンペソ	48.8150	48.0235
ポーランドズロチ	3.8070	3.7260
ロシアルーブル	73.0538	73.9644
カタールリアル	3.6410	3.6410
サウジアール	3.7504	3.7516
シンガポールドル	1.3442	1.3217
南アフリカランド	14.2788	14.6888
韓国ウォン	1,126.1500	1,086.3000
スウェーデンクローナ	8.5522	8.2126
スイスフラン	0.9244	0.8840
台湾ドル	27.8625	28.0980

	2021年6月30日現在	2020年12月31日現在
タイバーツ	32.0500	29.9600
トルコリラ	8.6875	7.4325
アラブ首長国連邦ディルハム	3.6732	3.6732
人民元	6.4615	6.5398

注記9 事業セグメント

投資運用会社はファンドに代わり、戦略的な資源配分を行う。投資運用会社は、各ファンドのポートフォリオ全体について責任を負い、各ファンドが単一の事業セグメントを有するとみなしている。

投資運用会社は、各ファンドに関連する参照指数のパフォーマンスを上げるために単一の統合的な投資戦略に基づいて資産配分を決定し、各ファンドのパフォーマンスは、関連する参照指数を参照して評価される。

ファンドには、非流動に分類される資産はない。各ファンドの投資は、関連する参照指数のパフォーマンスの影響を受ける。

ファンドは極めて幅広い分散投資のポートフォリオを有しており、本投資法人の収入の大半を占める単一の投資はない。

商品およびサービス

本投資法人のすべての収益は、1つの商品グループ、すなわちそれぞれのインデックスのパフォーマンスに追随するためにファンドが投資するポートフォリオ証券から得ている。

地域

本投資法人は、異なる地域からの収益を個別にモニタリングしていない。しかしながら、特定の地域における特定の市場を表すインデックスに追随する性質上、各ファンドの収益は、投資目的に掲げられた地域に帰属するものと見なすことができる。

主要な顧客

本投資法人は投資会社であるため、注目すべき主要な顧客は、ファンドの投資証券の発行市場を構成している指定参加者である。

注記10 公正価値ヒエラルキー

IFRS第13号は、本投資法人に対して、測定に使用されるインプットの重要性を反映する公正価値ヒエラルキーを用いて公正価値測定を分類することを要求している。

公正価値ヒエラルキーは、IFRS第13号で定義する以下のレベルがある。

レベル1 — 同一の資産または負債の活発な市場における(未調整の)公表価格

レベル2 — 当該資産または負債に関して、直接に(価格として)または間接に(価格から算出して)観察可能な、レベル1に含まれる公表価格以外のインプット

レベル3 — 観察可能な市場データに基づかない資産または負債のインプット(観察不能なインプット)

さらに、重要な観察不能なインプット(レベル3)を有する金融商品について、IFRS第13号は、レベル3への振替またはレベル3からの振替、期首残高から期末残高への調整、購入、売却および決済に分けて包括利益計算書において認識した会計期間の利益または損失の合計額、レベル3のポジションの公正価値の算出に用いた仮定の感応度分析について開示することを要求している。

公正価値測定の全体が分類される公正価値ヒエラルキーは、公正価値測定全体にとって重要性のある最も低いレベルのインプットに基づいて決定される。この目的において、インプットの重要性は公正価値測定全体に対して評価される。公正価値測定において、観察不能なインプットに基づく重要な調整を要する観察可能なインプットを使用する場合、かかる測定はレベル3に分類される測定である。公正価値測定全体に対する特定のインプットの重要性を評価するには、資産または負債に固有の要因を考慮した判断が求められる。

何をもって「観察可能」とするかという判断には、本投資法人による重要な判断が必要になる。本投資法人は、観察可能なデータとは、ただちに利用可能であり、定期的に公表ないし更新され、信頼性があり、検証可能であり、専有情報ではなく、関連する市場に積極的に関与している独立した情報源によって提供される市場データであると考えている。

2021年6月30日および2020年12月31日現在、公正価値測定された本投資法人の金融資産および金融負債の大半は、レベル2に分類された先渡為替契約を除き、現在上場されている株式および先物契約であるため、レベル1に分類されている。これに加えて、2021年6月30日現在、MSCI World UCITS ETFで保有されている1つの証券であるNMC Health、MSCI United Kingdom IMI Socially Responsible UCITS ETFで保有されている1つの証券であるNMC Health、MSCI USA Select Factor Mix UCITS ETFで保有されている5つの証券であるAchillion Pharmaceuticals、Alder Biopharmaceuticals、Escrow New York REIT、NewStar FinancialおよびStemline Therapeutics、ならびにMSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETFで保有されている2つの証券であるBrilliance China Automotive HoldingsおよびNMC Healthはレベル3に分類されている。2020年12月31日現在、MSCI World UCITS ETFで保有されている1つの証券であるNMC Health、MSCI United Kingdom IMI Socially Responsible UCITS ETFで保有されている1つの証券であるNMC Health、MSCI USA Select Factor Mix UCITS ETFで保有されている5つの証券であるAchillion Pharmaceuticals、Alder Biopharmaceuticals、Escrow New York REIT、NewStar FinancialおよびStemline Therapeutics、ならびにMSCI ACWI ESG ユニバーサル UCITS ETF(註注：2021年6月23日付でMSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETFに名称変更)で保有されている2つの証券であるLegend HoldingsとNMC Healthはレベル3に分類されている。

2021年6月30日現在、MSCI ACWI ソーシャリー・レスポンシブル UCITS ETFおよびMSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETFで保有されているSuning.com、MSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETFで保有されているBritannia Industriesはレ

ベル2に分類されている。2020年12月31日現在、レベル2に分類されている証券はない。活発な市場における公表価格に基づいた価額を持つ投資は、レベル1に分類され、現在上場されている株式が含まれる。本投資法人はこれらの金融商品の公表価格を調整しない。2021年6月30日および2020年12月31日現在、ファンドの投資明細表に記載されているとおり、ファンドが保有する先物契約はレベル1に分類されている。

活発であるともみなされない市場で取引されているが、公表価格、ディーラー価格または観察可能なインプットに裏付けられる別の価格情報源に基づいて評価されている金融商品はレベル2に分類される。レベル2に分類される投資には、活発な市場で取引されていないおよび／または譲渡制限が課せられるポジションが含まれるため、評価は一般的に入手可能な市場情報に基づいて、流動性が低いことおよび／または譲渡不可能性を反映するように調整される場合がある。レベル3に分類される投資は、取引頻度が少ないため、重要な観察不能なインプットがある。

2021年6月30日に終了した会計期間において、以下のレベル間の証券の振替が生じた。

- レベル1からレベル2：MSCI ACWI ソーシャリー・レスポンシブル UCITS ETFおよびMSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETFで保有されている1つの証券である Suning.com
- レベル1からレベル3：MSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETFで保有されている1つの証券であるBrilliance China Automotive Holdings

2020年12月31日に終了した会計年度において、以下のレベル間の証券の振替が生じた。

- レベル2からレベル3：MSCI USA Select Factor Mix UCITS ETFで保有されている2つの証券であるAlder BiopharmaceuticalsおよびEscrow New York REIT
- レベル1からレベル3：MSCI World UCITS ETF、MSCI United MSCI Kingdom IMI Socially Responsible UCITS ETFおよびMSCI ACWI ESG ユニバーサル UCITS ETF（訳注：2021年6月23日付でMSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETFに名称変更）で保有されている1つの証券であるNMC Health
- レベル2からレベル3：MSCI ACWI ESG ユニバーサル UCITS ETF（訳注：2021年6月23日付でMSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETFに名称変更）で保有されている1つの証券であるLegend Holdings

この振替は主に、公表価格、ディーラー価格または観察可能なインプットに裏付けられる別の価格情報源が入手可能となったためである。これらのポジションについては、投資明細表において別途識別されており、2021年6月30日に終了した会計期間および2020年12月31日に終了した会計年度において本投資法人にとって重要性がなかったため、レベル3の調整表および公正価値算定のために使用した仮定の感応度分析は作成されていない。公正価値ヒエラルキーのレベル間の他の証券の振替はなかった。

IFRS第13号 公正価値測定

財政状態計算書において公正価値で測定しないが、公正価値が開示される資産および負債の各クラスについて、IFRS第13号により、本投資法人は公正価値測定が分類される公正価値ヒエラルキーにおけるレベルならびに評価技法の説明およびその技法において用いたインプットを開示することが求められる。

現金および現金同等物ならびに当座借越は、銀行と活発な市場におけるその他の短期投資において保有され、それらはレベル1に分類される。

投資売却に係る未収入金、未収配当金およびその他の受取債権には、ファンドに対する契約上の取引決済額およびその他の債務が含まれる。投資購入に係る未払金およびその他の支払債務は、取引および費用決済に関するファンドによる契約上の金額および債務を表す。すべての受取債権残高および支払債務残高は、レベル2に分類される。

ファンドの英文目論見書に従い、償還可能投資証券のブック可能価額は、本投資法人における各ファンドの資産合計とその他のすべての負債の差額（純額）に基づいて算定される。ファンドの投資証券は活発な市場で取引される。これらの投資証券は所有者の選択により償還可能であるため、要求払いの特徴を有する。ファンドは、いかなる取引日においても、これらの投資証券を投資証券クラスに帰属するファンドの純資産価額の比率に相当する現金／資産で買戻すことができる。

すべてのファンドの損益を通じて公正価値で測定する金融資産の大部分は、活発な市場における公表価格に基づくものであり、したがって、レベル1に分類される。これにより、これらのファンドにおける償還可能参加型投資証券の所有者に帰属する純資産の最も適切な分類は、レベル1ということになる。

注記11 効率的ポートフォリオ管理

ファンドを代理する本投資法人は、効率的ポートフォリオ管理を目的として本投資法人が投資する譲渡性のある証券、短期金融市場証券および／またはその他の金融商品に関する手法および商品を用いることがある。

ファンドは、レポ契約および有価証券貸付契約を効率的なポートフォリオ管理のために使用することができる。保管銀行と同じグループに属するステート・ストリート・バンク・インターナショナル・ゲーエムベーハー、フランクフルト支店は、ファンドの代理で締結する有価証券貸付取引の証券貸付代理人である。

2021年6月30日に終了した会計期間においてにおいて、本投資法人は、MSCI USA UCITS ETF、MSCI USA Value UCITS ETF、MSCI World UCITS ETF、S&P 500 UCITS ETF、Solactive Global Pure Gold Miners UCITS ETF、MSCI Australia UCITS ETF、MSCI USA hedged to EUR UCITS ETF、MSCI USA hedged to CHF UCITS ETF、S&P Dividend Aristocrats ESG UCITS ETF、Factor MSCI USA Low Volatility UCITS ETF、Factor MSCI USA Prime Value UCITS ETF、Factor MSCI USA Quality UCITS ETFおよびMSCI USA Select Factor Mix UCITS ETFの代理で有価証券貸付契約を締結した。詳細については、注記6を参照のこと。

2020年12月31日に終了した会計年度において、本投資法人は、MSCI USA UCITS ETF、MSCI USA Value UCITS ETF、MSCI World UCITS ETF、S&P 500 UCITS ETF、Solactive Global Pure Gold Miners UCITS ETF、MSCI Australia UCITS ETF、MSCI USA hedged to EUR UCITS ETF、MSCI USA hedged to CHF UCITS ETF、S&P Dividend Aristocrats ESG UCITS ETF、Factor MSCI USA Low Volatility UCITS ETF、Factor MSCI USA Prime Value UCITS ETF、Factor MSCI USA Quality

UCITS ETFおよびMSCI USA Select Factor Mix UCITS ETFの代理で有価証券貸付契約を締結した。詳細については、注記6を参照のこと。

注記12 償還可能参加型投資証券に帰属する純資産合計

ファンド	2021年6月30日現在	2020年12月31日現在	2020年6月30日現在
MSCI USA UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-acc	152,311,251英ポンド	178,842,088英ポンド	54,109,635英ポンド
MSCI USA UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-dis	4,931,116英ポンド	4,648,751英ポンド	3,830,055英ポンド
MSCI USA UCITS ETF Class (ir-hedged to GBP) A-acc ¹	495,219英ポンド	—	—
MSCI USA UCITS ETF Class (USD) A-acc	947,554,621米ドル	894,055,685米ドル	1,327,790,343米ドル
MSCI USA UCITS ETF Class (USD) A-dis	1,002,339,162米ドル	892,071,648米ドル	173,039,550米ドル
MSCI USA UCITS ETF Class (USD) A-UKdis	29,815,393米ドル	35,580,735米ドル	76,672,697米ドル
MSCI USA Value UCITS ETF Class (USD) A-dis	1,390,870,210米ドル	755,041,643米ドル	421,324,261米ドル
MSCI World UCITS ETF Class (USD) A-acc	23,896,849米ドル	37,757,916米ドル	13,899,830米ドル
MSCI World UCITS ETF Class (USD) A-dis	185,784,494米ドル	175,819,784米ドル	141,990,499米ドル
S&P 500 UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-acc	35,160,981 スイスフラン	29,507,397 スイスフラン	26,847,133 スイスフラン
S&P 500 UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc	22,746,231ユーロ	17,232,180ユーロ	16,488,628ユーロ
S&P 500 UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-dis	2,184,970ユーロ	3,147,888ユーロ	2,815,424ユーロ
S&P 500 UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-dis	45,760,078英ポンド	35,330,162英ポンド	23,974,665英ポンド
S&P 500 UCITS ETF Class (USD) A-dis	585,777,038米ドル	482,057,888米ドル	386,035,633米ドル
Solactive Global Pure Gold Miners UCITS ETF Class (USD) A-dis	76,936,441米ドル	102,012,093米ドル	85,801,684米ドル
MSCI Australia UCITS ETF Class (AUD) A-acc	261,804,109豪ドル	280,017,229豪ドル	198,921,041豪ドル
MSCI Australia UCITS ETF Class (AUD) A-dis	20,554,605豪ドル	25,135,815豪ドル	23,550,038豪ドル
MSCI Australia UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-acc	41,081,319 スイスフラン	37,817,619 スイスフラン	11,115,346 スイスフラン
MSCI Australia UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc	30,968,959ユーロ	37,651,311ユーロ	13,219,273ユーロ
MSCI Australia UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-acc	7,834,184英ポンド	6,913,227英ポンド	1,726,658英ポンド
MSCI Australia UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-dis	1,570,325英ポンド	370,193英ポンド	334,047英ポンド
MSCI Australia UCITS ETF Class (hedged to USD) A-acc	38,469,337米ドル	38,403,115米ドル	11,684,502米ドル
MSCI USA hedged to EUR UCITS ETF Class (EUR) A-acc	1,006,748,449ユーロ	1,122,713,683ユーロ	1,373,029,671ユーロ
MSCI USA hedged to EUR UCITS ETF Class (EUR) A-dis	226,898,745ユーロ	215,750,674ユーロ	182,090,108ユーロ
MSCI USA hedged to CHF UCITS ETF Class (CHF) A-acc	212,016,175 スイスフラン	376,091,149 スイスフラン	530,619,580 スイスフラン
S&P Dividend Aristocrats ESG UCITS ETF Class (USD) A-dis	206,003,009米ドル	47,341,976米ドル	38,537,929米ドル
MSCI United Kingdom IMI Socially Responsible UCITS ETF Class (GBP) A-dis	599,044,725英ポンド	401,886,319英ポンド	254,921,227英ポンド
MSCI United Kingdom IMI Socially Responsible UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-dis	15,140,038 スイスフラン	9,630,937 スイスフラン	7,606,849 スイスフラン
MSCI United Kingdom IMI Socially Responsible UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc	24,443,797ユーロ	9,829,930ユーロ	5,122,154ユーロ
MSCI United Kingdom IMI Socially Responsible UCITS ETF Class (hedged to USD) A-acc	5,243,924米ドル	2,592,821米ドル	3,929,988米ドル
Factor MSCI USA Low Volatility UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-acc	8,188,623 スイスフラン	6,201,081 スイスフラン	21,781,482 スイスフラン
Factor MSCI USA Low Volatility UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc	10,308,465ユーロ	11,853,788ユーロ	13,701,493ユーロ
Factor MSCI USA Low Volatility UCITS ETF Class (USD) A-dis	90,219,259米ドル	99,241,073米ドル	89,226,037米ドル
Factor MSCI USA Prime Value UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-acc	10,825,806 スイスフラン	5,576,805 スイスフラン	3,263,446 スイスフラン
Factor MSCI USA Prime Value UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc	127,871,753ユーロ	7,857,901ユーロ	3,021,500ユーロ
Factor MSCI USA Prime Value UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-dis	10,274,853英ポンド	7,690,161英ポンド	7,356,247英ポンド
Factor MSCI USA Prime Value UCITS ETF Class (USD) A-dis	524,327,713米ドル	385,107,425米ドル	32,388,039米ドル
Factor MSCI USA Quality UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-acc	14,285,380 スイスフラン	18,072,384 スイスフラン	14,312,153 スイスフラン
Factor MSCI USA Quality UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc	29,435,289ユーロ	44,096,288ユーロ	25,149,725ユーロ
Factor MSCI USA Quality UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-dis	11,308,745英ポンド	9,899,578英ポンド	9,814,491英ポンド
Factor MSCI USA Quality UCITS ETF Class (USD) A-dis	273,542,068米ドル	197,884,969米ドル	268,270,955米ドル
MSCI USA Select Factor Mix UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-acc	31,275,504 スイスフラン	31,416,999 スイスフラン	31,693,065 スイスフラン

ファンド	2021年 6月30日現在	2020年12月31日現在	2020年 6月30日現在
MSCI USA Select Factor Mix UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc	14,957,580ユーロ	14,312,354ユーロ	13,016,689ユーロ
MSCI USA Select Factor Mix UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-dis	2,197,893英ポンド	1,925,842英ポンド	2,594,958英ポンド
MSCI USA Select Factor Mix UCITS ETF Class (USD) A-acc	124,186,082米ドル	8,469,278米ドル	11,043,896米ドル
MSCI USA Select Factor Mix UCITS ETF Class (USD) A-dis	53,961,047米ドル	50,598,630米ドル	143,824,130米ドル
MSCI ACWI ソーシャリー・レスポンシブル UCITS ETF クラス (スイスフランヘッジ) A-acc	629,890,846 スイスフラン	474,403,089 スイスフラン	309,001,851 スイスフラン
MSCI ACWI ソーシャリー・レスポンシブル UCITS ETF クラス (スイスフランヘッジ) A-dis	28,992,090 スイスフラン	21,821,320 スイスフラン	15,639,959 スイスフラン
MSCI ACWI ソーシャリー・レスポンシブル UCITS ETF クラス (ユーロヘッジ) A-acc	932,596,770ユーロ	742,831,989ユーロ	350,439,182ユーロ
MSCI ACWI ソーシャリー・レスポンシブル UCITS ETF クラス (英ポンドヘッジ) A-dis	390,150,938英ポンド	239,419,729英ポンド	175,753,361英ポンド
MSCI ACWI ソーシャリー・レスポンシブル UCITS ETF クラス (日本円ヘッジ) A-acc ²	114,796,982日本円	—	—
MSCI ACWI ソーシャリー・レスポンシブル UCITS ETF クラス (米ドルヘッジ) A-acc	938,844,329米ドル	681,529,584米ドル	331,648,309米ドル
MSCI ACWI ソーシャリー・レスポンシブル UCITS ETF クラス (米ドル) A-acc	335,070,889米ドル	195,096,858米ドル	39,395,641米ドル
MSCI ACWI ソーシャリー・レスポンシブル UCITS ETF クラス (米ドル) A-dis	45,602,660米ドル	13,744,967米ドル	10,703,704米ドル
MSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETF クラス (スイスフランヘッジ) A-acc	861,789,231 スイスフラン	222,864,256 スイスフラン	151,406,446 スイスフラン
MSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETF クラス (スイスフランヘッジ) A-dis	40,643,863 スイスフラン	18,760,788 スイスフラン	4,600,991 スイスフラン
MSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETF クラス (ユーロヘッジ) A-acc	670,667,973ユーロ	198,977,751ユーロ	119,366,384ユーロ
MSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETF クラス (英ポンドヘッジ) A-acc	118,842,622英ポンド	30,019,951英ポンド	13,293,808英ポンド
MSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETF クラス (日本円ヘッジ) A-acc	1,066,165,974日本円	784,469,219日本円	550,902,784日本円
MSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETF クラス (米ドルヘッジ) A-acc	979,517,769米ドル	273,449,749米ドル	153,460,961米ドル
MSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETF クラス (米ドル) A-dis	17,435,170米ドル	6,212,269米ドル	6,678,301米ドル
Global Gender Equality UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-acc	144,703,250 スイスフラン	89,280,314 スイスフラン	58,702,107 スイスフラン
Global Gender Equality UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-dis	9,647,228 スイスフラン	8,378,714 スイスフラン	8,407,370 スイスフラン
Global Gender Equality UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc	181,439,884ユーロ	117,458,510ユーロ	75,325,760ユーロ
Global Gender Equality UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-acc	37,722,173英ポンド	18,371,994英ポンド	8,102,609英ポンド
Global Gender Equality UCITS ETF Class (hedged to USD) A-acc	238,006,614米ドル	134,975,985米ドル	71,395,560米ドル
Global Gender Equality UCITS ETF Class (USD) A-acc	108,032,513米ドル	27,824,033米ドル	6,331,501米ドル
Global Gender Equality UCITS ETF Class (USD) A-dis	48,052,246米ドル	24,800,095米ドル	12,042,436米ドル
S&P 500 ESG UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-acc	232,121,033 スイスフラン	181,853,085 スイスフラン	79,239,752 スイスフラン
S&P 500 ESG UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc	135,365,889ユーロ	83,797,924ユーロ	28,683,898ユーロ
S&P 500 ESG UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-dis	4,815,332英ポンド	5,019,490英ポンド	3,121,599英ポンド
S&P 500 ESG UCITS ETF Class (USD) A-acc	652,698,792米ドル	686,637,887米ドル	289,348,433米ドル
S&P 500 ESG UCITS ETF Class (USD) A-dis	447,293,210米ドル	391,898,570米ドル	247,952,803米ドル
MSCI USA Socially Responsible UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-acc	3,735,421 スイスフラン	5,184,299 スイスフラン	1,104,719 スイスフラン
MSCI USA Socially Responsible UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc	113,319,073ユーロ	32,179,159ユーロ	1,105,398ユーロ
MSCI USA Socially Responsible UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-dis ³	18,493,715ユーロ	—	—
MSCI USA Socially Responsible UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-dis	176,764,259英ポンド	58,603,164英ポンド	1,106,847英ポンド
MSCI USA Socially Responsible UCITS ETF Class (USD) A-acc	350,703,598米ドル	232,284,384米ドル	2,824,486米ドル
MSCI USA Socially Responsible UCITS ETF Class (USD) A-dis	449,640,155米ドル	314,855,065米ドル	161,388,136米ドル
MSCI World Socially Responsible UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-acc	16,160,039 スイスフラン	7,176,417 スイスフラン	1,120,118 スイスフラン

ファンド	2021年6月30日現在	2020年12月31日現在	2020年6月30日現在
MSCI World Socially Responsible UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc	69,196,870ユーロ	10,444,855ユーロ	4,367,263ユーロ
MSCI World Socially Responsible UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-dis	5,960,995英ポンド	5,503,449英ポンド	1,315,977英ポンド
MSCI World Socially Responsible UCITS ETF Class (USD) A-acc	421,181,212米ドル	55,280,187米ドル	1,537,417米ドル
MSCI World Socially Responsible UCITS ETF Class (USD) A-dis	221,605,161米ドル	84,309,705米ドル	25,560,199米ドル
S&P 500 ESG ELITE UCITS ETF Class (USD) A-acc ⁴	6,475,659米ドル	—	—
S&P 500 ESG ELITE UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-acc ⁵	117,851 スイスフラン	—	—
S&P 500 ESG ELITE UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc ⁵	121,243ユーロ	—	—
S&P 500 ESG ELITE UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-dis ⁵	646,997英ポンド	—	—
UBS Climate Aware Global Developed Equity CTB UCITS ETF Class (USD) A-dis ⁶	33,010,444米ドル	—	—
MSCI EMU Climate Paris Aligned UCITS ETF Class (EUR) A-acc ⁷	5,074,222ユーロ	—	—
MSCI Europe Climate Paris Aligned UCITS ETF Class (EUR) A-acc ⁷	8,148,233ユーロ	—	—
MSCI USA Climate Paris Aligned UCITS ETF Class (USD) A-acc ⁷	6,213,524米ドル	—	—
MSCI Japan Climate Paris Aligned UCITS ETF Class (JPY) A-acc ⁸	1,828,952,934日本円	—	—
MSCI World Climate Paris Aligned UCITS ETF Class (USD) A-dis ⁸	13,357,051米ドル	—	—

¹ 当該投資証券クラスは2021年4月30日に運用を開始した。

² 当該投資証券クラスは2021年5月18日に運用を開始した。

³ 当該投資証券クラスは2021年1月20日に運用を開始した。

⁴ 当該ファンドおよびその投資証券クラスは2021年2月18日に運用を開始した。

⁵ 当該投資証券クラスは2021年3月5日に運用を開始した。

⁶ 当該ファンドおよびその投資証券クラスは2021年2月26日に運用を開始した。

⁷ 当該ファンドおよびその投資証券クラスは2021年3月9日に運用を開始した。

⁸ 当該ファンドおよびその投資証券クラスは2021年3月11日に運用を開始した。

注記13 償還可能参加型投資証券1口当たりの純資産価額

ファンド	2021年6月30日現在	2020年12月31日現在	2020年6月30日現在
MSCI USA UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-acc	18.14英ポンド	15.83英ポンド	12.95英ポンド
MSCI USA UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-dis	17.35英ポンド	15.22英ポンド	12.54英ポンド
MSCI USA UCITS ETF Class (ir-hedged to GBP) A-acc ¹	12.38英ポンド	—	—
MSCI USA UCITS ETF Class (USD) A-acc	24.28米ドル	21.18米ドル	17.11米ドル
MSCI USA UCITS ETF Class (USD) A-dis	106.70米ドル	93.60米ドル	76.14米ドル
MSCI USA UCITS ETF Class (USD) A-UKdis	23.04米ドル	20.10米ドル	16.35米ドル
MSCI USA Value UCITS ETF Class (USD) A-dis	94.77米ドル	82.54米ドル	69.70米ドル
MSCI World UCITS ETF Class (USD) A-acc	25.82米ドル	22.86米ドル	18.60米ドル
MSCI World UCITS ETF Class (USD) A-dis	75.94米ドル	67.61米ドル	55.46米ドル
S&P 500 UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-acc	22.01スイスフラン	19.23スイスフラン	15.97スイスフラン
S&P 500 UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc	21.27ユーロ	18.56ユーロ	15.43ユーロ
S&P 500 UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-dis	20.32ユーロ	17.83ユーロ	14.92ユーロ
S&P 500 UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-dis	22.34英ポンド	19.54英ポンド	16.35英ポンド
S&P 500 UCITS ETF Class (USD) A-dis	69.50米ドル	60.78米ドル	50.23米ドル
Solactive Global Pure Gold Miners UCITS ETF Class (USD) A-dis	16.05米ドル	18.45米ドル	18.73米ドル
MSCI Australia UCITS ETF Class (AUD) A-acc	36.88豪ドル	32.53豪ドル	28.91豪ドル
MSCI Australia UCITS ETF Class (AUD) A-dis	33.21豪ドル	29.62豪ドル	26.72豪ドル
MSCI Australia UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-acc	21.80スイスフラン	19.32スイスフラン	17.19スイスフラン
MSCI Australia UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc	16.72ユーロ	14.80ユーロ	13.17ユーロ
MSCI Australia UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-acc	18.59英ポンド	16.40英ポンド	14.58英ポンド
MSCI Australia UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-dis	15.40英ポンド	13.74英ポンド	12.40英ポンド
MSCI Australia UCITS ETF Class (hedged to USD) A-acc	19.29米ドル	17.01米ドル	15.01米ドル
MSCI USA hedged to EUR UCITS ETF Class (EUR) A-acc	35.23ユーロ	30.83ユーロ	25.22ユーロ
MSCI USA hedged to EUR UCITS ETF Class (EUR) A-dis	32.07ユーロ	28.22ユーロ	23.25ユーロ
MSCI USA hedged to CHF UCITS ETF Class (CHF) A-acc	35.39スイスフラン	31.02スイスフラン	25.36スイスフラン
S&P Dividend Aristocrats ESG UCITS ETF Class (USD) A-dis	10.87米ドル	9.48米ドル	7.63米ドル
MSCI United Kingdom IMI Socially Responsible UCITS ETF Class (GBP) A-dis	16.58英ポンド	15.40英ポンド	14.36英ポンド
MSCI United Kingdom IMI Socially Responsible UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-dis	10.59スイスフラン	9.89スイスフラン	9.24スイスフラン
MSCI United Kingdom IMI Socially Responsible UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc	19.10ユーロ	17.57ユーロ	16.20ユーロ
MSCI United Kingdom IMI Socially Responsible UCITS ETF Class (hedged to USD) A-acc	21.80米ドル	19.98米ドル	18.30米ドル
Factor MSCI USA Low Volatility UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-acc	20.43スイスフラン	18.59スイスフラン	16.06スイスフラン
Factor MSCI USA Low Volatility UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc	24.81ユーロ	22.54ユーロ	19.48ユーロ
Factor MSCI USA Low Volatility UCITS ETF Class (USD) A-dis	27.42米ドル	24.99米ドル	21.54米ドル
Factor MSCI USA Prime Value UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-acc	21.33スイスフラン	18.06スイスフラン	14.78スイスフラン
Factor MSCI USA Prime Value UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc	25.36ユーロ	21.47ユーロ	17.58ユーロ
Factor MSCI USA Prime Value UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-dis	14.64英ポンド	12.49英ポンド	10.32英ポンド
Factor MSCI USA Prime Value UCITS ETF Class (USD) A-dis	29.60米ドル	25.20米ドル	20.62米ドル
Factor MSCI USA Quality UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-acc	27.10スイスフラン	23.73スイスフラン	19.92スイスフラン
Factor MSCI USA Quality UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc	32.54ユーロ	28.46ユーロ	23.91ユーロ
Factor MSCI USA Quality UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-dis	23.19英ポンド	20.30英ポンド	17.14英ポンド
Factor MSCI USA Quality UCITS ETF Class (USD) A-dis	39.11米ドル	34.28米ドル	28.60米ドル
MSCI USA Select Factor Mix UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-acc	20.80スイスフラン	18.20スイスフラン	14.87スイスフラン
MSCI USA Select Factor Mix UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc	21.49ユーロ	18.78ユーロ	15.36ユーロ
MSCI USA Select Factor Mix UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-dis	21.61英ポンド	18.93英ポンド	15.59英ポンド
MSCI USA Select Factor Mix UCITS ETF Class (USD) A-acc	29.53米ドル	25.71米ドル	20.77米ドル

ファンド	2021年6月30日現在	2020年12月31日現在	2020年6月30日現在
MSCI USA Select Factor Mix UCITS ETF Class (USD) A-dis	28.08米ドル	24.60米ドル	20.02米ドル
MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF クラス (スイスフランヘッジ) A-acc	13.13スイスフラン	11.59スイスフラン	9.64スイスフラン
MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF クラス (スイスフランヘッジ) A-dis	12.52スイスフラン	11.11スイスフラン	9.31スイスフラン
MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF クラス(ユーロヘッジ) A-acc	13.83ユーロ	12.22ユーロ	10.19ユーロ
MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF クラス (英ポンドヘッジ) A-dis	13.75英ポンド	12.24英ポンド	10.30英ポンド
MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF クラス (日本円ヘッジ) A-acc ²	1,058.04日本円	—	—
MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF クラス (米ドルヘッジ) A-acc	15.38米ドル	13.62米ドル	11.13米ドル
MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF クラス (米ドル) A-acc	18.04米ドル	16.15米ドル	12.88米ドル
MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF クラス (米ドル) A-dis	17.67米ドル	15.90米ドル	12.78米ドル
MSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETF クラス (スイスフランヘッジ) A-acc	14.78スイスフラン	12.95スイスフラン	10.96スイスフラン
MSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETF クラス (スイスフランヘッジ) A-dis	14.10スイスフラン	12.41スイスフラン	10.58スイスフラン
MSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETF クラス (ユーロヘッジ) A-acc	15.75ユーロ	13.80ユーロ	11.70ユーロ
MSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETF クラス (英ポンドヘッジ) A-acc	16.68英ポンド	14.65英ポンド	12.43英ポンド
MSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETF クラス (日本円ヘッジ) A-acc	1,717.68日本円	1,495.51日本円	1,253.89日本円
MSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETF クラス (米ドルヘッジ) A-acc	17.98米ドル	15.77米ドル	13.13米ドル
MSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETF クラス (米ドル) A-dis	15.60米ドル	13.90米ドル	11.40米ドル
Global Gender Equality UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-acc	16.39スイスフラン	14.35スイスフラン	12.15スイスフラン
Global Gender Equality UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-dis	15.19スイスフラン	13.42スイスフラン	11.51スイスフラン
Global Gender Equality UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc	19.22ユーロ	16.82ユーロ	14.26ユーロ
Global Gender Equality UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-acc	17.96英ポンド	15.68英ポンド	13.28英ポンド
Global Gender Equality UCITS ETF Class (hedged to USD) A-acc	19.64米ドル	17.13米ドル	14.37米ドル
Global Gender Equality UCITS ETF Class (USD) A-acc	17.48米ドル	15.36米ドル	12.34米ドル
Global Gender Equality UCITS ETF Class (USD) A-dis	16.73米ドル	14.85米ドル	12.08米ドル
S&P 500 ESG UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-acc	23.68スイスフラン	20.57スイスフラン	17.18スイスフラン
S&P 500 ESG UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc	24.52ユーロ	21.27ユーロ	17.78ユーロ
S&P 500 ESG UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-dis	25.51英ポンド	22.18英ポンド	18.67英ポンド
S&P 500 ESG UCITS ETF Class (USD) A-acc	29.06米ドル	25.11米ドル	20.72米ドル
S&P 500 ESG UCITS ETF Class (USD) A-dis	28.32米ドル	24.63米ドル	20.48米ドル
MSCI USA Socially Responsible UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-acc	14.53スイスフラン	12.74スイスフラン	10.32スイスフラン
MSCI USA Socially Responsible UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc	15.27ユーロ	13.36ユーロ	10.84ユーロ
MSCI USA Socially Responsible UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-dis ³	10.74ユーロ	—	—
MSCI USA Socially Responsible UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-dis	16.53英ポンド	14.48英ポンド	11.77英ポンド
MSCI USA Socially Responsible UCITS ETF Class (USD) A-acc	14.95米ドル	13.04米ドル	10.44米ドル
MSCI USA Socially Responsible UCITS ETF Class (USD) A-dis	14.84米ドル	13.01米ドル	10.44米ドル
MSCI World Socially Responsible UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-acc	11.57スイスフラン	10.23スイスフラン	8.62スイスフラン
MSCI World Socially Responsible UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc	12.25ユーロ	10.82ユーロ	9.12ユーロ
MSCI World Socially Responsible UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-dis	13.15英ポンド	11.63英ポンド	9.82英ポンド
MSCI World Socially Responsible UCITS ETF Class (USD) A-acc	17.71米ドル	15.80米ドル	12.81米ドル
MSCI World Socially Responsible UCITS ETF Class (USD) A-dis	17.56米ドル	15.76米ドル	12.81米ドル
S&P 500 ESG ELITE UCITS ETF Class (USD) A-acc ⁴	14.39米ドル	—	—

ファンド	2021年6月30日現在	2020年12月31日現在	2020年6月30日現在
S&P 500 ESG ELITE UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-acc ⁵	11.79スイスフラン	—	—
S&P 500 ESG ELITE UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc ⁵	12.12ユーロ	—	—
S&P 500 ESG ELITE UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-dis ⁵	12.94英ポンド	—	—
UBS Climate Aware Global Developed Equity CTB UCITS ETF Class (USD) A-dis ⁶	14.38米ドル	—	—
MSCI EMU Climate Paris Aligned UCITS ETF Class (EUR) A-acc ⁷	12.69ユーロ	—	—
MSCI Europe Climate Paris Aligned UCITS ETF Class (EUR) A-acc ⁷	12.54ユーロ	—	—
MSCI USA Climate Paris Aligned UCITS ETF Class (USD) A-acc ⁷	15.53米ドル	—	—
MSCI Japan Climate Paris Aligned UCITS ETF Class (JPY) A-acc ⁸	1,828.95日本円	—	—
MSCI World Climate Paris Aligned UCITS ETF Class (USD) A-dis ⁸	15.71米ドル	—	—

¹ 当該投資証券クラスは2021年4月30日に運用を開始した。

² 当該投資証券クラスは2021年5月18日に運用を開始した。

³ 当該投資証券クラスは2021年1月20日に運用を開始した。

⁴ 当該ファンドおよびその投資証券クラスは2021年2月18日に運用を開始した。

⁵ 当該投資証券クラスは2021年3月5日に運用を開始した。

⁶ 当該ファンドおよびその投資証券クラスは2021年2月26日に運用を開始した。

⁷ 当該ファンドおよびその投資証券クラスは2021年3月9日に運用を開始した。

⁸ 当該ファンドおよびその投資証券クラスは2021年3月11日に運用を開始した。

注記14 当会計期間における重要な事象

2021年2月1日付で、DJ Global Select Dividend UCITS ETFはS&P Dividend Aristocrats ESG UCITS ETFに名称変更された。ファンドのインデックスは、Dow Jones Global Select Dividend Total Return Net IndexからS&P Developed ESG Dividend Aristocrats Total Return Net Indexに変更された。

2021年6月23日付で、MSCI ACWI ESG ユニバーサル UCITS ETFは、MSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETFに名称変更された。ファンドのインデックスは、MSCI ACWI ESG ユニバーサル・5%・イシュー・キャップド・インデックスからMSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト・5%・イシュー・キャップド・インデックスに変更された。

2021年3月10日より、サステナブル・ファイナンス開示規則 (EU) 2019/2088 (以下「SFDR」という。) が適用されている。ESGインテグレーションの水準を反映するため、補遺およびKIIDが改訂された。ファンドはパッシブ運用されており、インデックスのパフォーマンスに追随することを目指している。サステナビリティに関する特性とリスクは、インデックス選定プロセスの一環として考慮される。インデックス・プロバイダーが環境、社会またはガバナンスの基準に照らしてスクリーニングされることを言明しているインデックスと、インデックス・プロバイダーがインデックスの構成銘柄のサステナビリティに関する特性とリスクを評価するために使用する手法は、各インデックス・プロバイダーのウェブサイトに掲載されている。

環境的特性の推進またはサステナブル投資を目的とするファンドの分類を含む詳細は、各ファンドの補遺に記載されている。また、各ファンドの他の開示情報は本投資法人のウェブサイト (www.ubs.com/etf) に、更新後の方針はwww.ubs.com/fml-policiesに掲載されている。

新型コロナウイルスによる潜在的影響

2020年3月、世界保健機関はCOVID-19の感染拡大をパンデミックであると宣言した。このパンデミックへの対策については、ワクチン開発の継続などを通じて進展が見られたものの、パンデミックが世界や地域で、どれくらいの期間にわたりどの程度経済に深刻な影響を及ぼすかは、依然として不透明である。これにより、本報告書に記載のファンドの資産価格のボラティリティおよび資産評価に関して継続的な不確実性が生じている。

取締役会および投資運用会社は引き続き、各国政府によるパンデミック対策、ひいてはポートフォリオおよびファンドそのものに対する経済的影響をモニタリングしている。

2021年6月30日に終了した会計期間において、以下のファンドが運用を開始した。

ファンド	運用開始日
S&P 500 ESG ELITE UCITS ETF	2021年2月18日
UBS Climate Aware Global Developed Equity CTB UCITS ETF	2021年2月26日
MSCI EMU Climate Paris Aligned UCITS ETF	2021年3月9日
MSCI Europe Climate Paris Aligned UCITS ETF	2021年3月9日
MSCI USA Climate Paris Aligned UCITS ETF	2021年3月11日
MSCI Japan Climate Paris Aligned UCITS ETF	2021年3月11日
MSCI World Climate Paris Aligned UCITS ETF	2021年3月11日

2021年6月30日に終了した会計期間において、以下の投資証券が運用を開始した。

ファンド	運用開始日
MSCI USA Socially Responsible UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-dis	2021年1月20日
UBS Climate Aware Global Developed Equity CTB UCITS ETF Class (USD) A-acc	2021年2月26日
S&P 500 ESG ELITE UCITS ETF Class (USD) A-acc	2021年2月18日
S&P 500 ESG ELITE UCITS ETF Class (hedged to CHF) A-acc	2021年3月5日
S&P 500 ESG ELITE UCITS ETF Class (hedged to EUR) A-acc	2021年3月5日
S&P 500 ESG ELITE UCITS ETF Class (hedged to GBP) A-dis	2021年3月5日
MSCI EMU Climate Paris Aligned UCITS ETF Class (EUR) A-acc	2021年3月9日
MSCI Europe Climate Paris Aligned UCITS ETF Class (EUR) A-acc	2021年3月9日
MSCI USA Climate Paris Aligned UCITS ETF Class (USD) A-acc	2021年3月9日
MSCI Japan Climate Paris Aligned UCITS ETF Class (JPY) A-acc	2021年3月11日
MSCI World Climate Paris Aligned UCITS ETF Class (USD) A-acc	2021年3月11日
MSCI USA UCITS ETF Class (ir-hedged to GBP) A-acc	2021年4月30日
MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF クラス(日本円ヘッジ) A-acc	2021年5月18日

当会計期間において、以下の英文目論見書補遺が発行された。

ファンド	発行日
MSCI USA UCITS ETF	2021年2月19日
MSCI USA Value UCITS ETF	2021年2月19日
MSCI World UCITS ETF	2021年2月19日
S&P 500 UCITS ETF	2021年2月19日
Solactive Global Pure Gold Miners UCITS ETF	2021年2月19日
MSCI Australia UCITS ETF	2021年2月19日
MSCI USA hedged to EUR UCITS ETF	2021年2月19日
MSCI USA hedged to CHF UCITS ETF	2021年2月19日
S&P Dividend Aristocrats ESG UCITS ETF	2021年2月19日
Factor MSCI USA Quality UCITS ETF	2021年2月26日
Factor MSCI USA Prime Value UCITS ETF	2021年2月19日
Factor MSCI USA Low Volatility UCITS ETF	2021年2月19日
MSCI USA Select Factor Mix UCITS ETF	2021年4月8日
MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF	2021年2月19日
MSCI ACWI ESG ユニバーサル・ロー・カーボン・セレクト UCITS ETF	2021年6月23日
Global Gender Equality UCITS ETF	2021年2月19日
S&P 500 ESG UCITS ETF	2021年2月19日
MSCI USA Socially Responsible UCITS ETF	2021年2月19日

ファンド	発行日
MSCI World Socially Responsible UCITS ETF	2021年2月19日
S&P 500 ESG ELITE UCITS ETF	2021年3月4日
UBS Climate Aware Global Developed Equity CTB UCITS ETF	2021年3月4日
MSCI EMU Climate Paris Aligned UCITS ETF	2021年3月4日
MSCI Europe Climate Paris Aligned UCITS ETF	2021年3月4日
MSCI USA Climate Paris Aligned UCITS ETF	2021年3月4日
MSCI Japan Climate Paris Aligned UCITS ETF	2021年3月4日
MSCI World Climate Paris Aligned UCITS ETF	2021年3月4日

6ヶ月間の当会計期間終了後に本投資法人に影響を及ぼすその他の重要な事象はなかった。

注記15 当会計期間終了後の重要な事象

欧州連合（法定監査）（指令2006/43/EC（指令2014/56/EUにより改正済）および規則（EU）第537/2014）規則2016（以下「2016年のS.I. No.312」という。）により、社会的影響度の高い事業体（以下「PIE」という。）の法定監査法人強制ローテーション制度が導入された。本投資法人は、2016年のS.I. No.312に基づきPIEとみなされる。その結果、本投資法人の現任の独立監査人であるプライスウォーターハウスクーパースは本投資法人の次回の定時投資主総会の決議にて退任し、会社法第383条に従って後任の独立監査人が任命される予定である。

2021年6月30日に終了した会計期間の後に、以下のファンドが運用を開始した。

ファンド	運用開始日
MSCI Europe ESG Universal Low Carbon Select UCITS ETF	2021年7月20日
MSCI USA ESG Universal Low Carbon Select UCITS ETF	2021年7月20日
MSCI Japan ESG Universal Low Carbon Select UCITS ETF	2021年7月21日
MSCI EMU ESG Universal Low Carbon Select UCITS ETF	2021年7月22日
MSCI ACWI Climate Paris Aligned UCITS ETF	2021年8月4日
MSCI Emerging Markets Climate Paris Aligned UCITS ETF	2021年8月5日

6ヶ月間の当会計期間終了後に本投資法人に影響を及ぼすその他の重要な事象はなかった。

注記16 財務書類の承認日

本財務書類は2021年8月26日に取締役により承認された。

[次へ](#)

(2) 投資有価証券明細表等

① 投資株式明細表

MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF

投資明細表 2021年6月30日現在

	数量	公正価値 (米ドル)	純資産比率 (%)
普通株式			
広告 (0.09%) (2020年12月31日 : 0.10%)			
Interpublic Group	97,338	3,162,512	0.09
航空宇宙・防衛 (0.13%) (2020年12月31日 : 0.11%)			
Teledyne Technologies	11,588	4,853,402	0.13
農業 (0.07%) (2020年12月31日 : 0.07%)			
Bunge	34,871	2,725,169	0.07
自動車製造 (4.68%) (2020年12月31日 : 5.07%)			
BYD - Class A	26,200	1,017,759	0.03
BYD - Class H	196,000	5,860,427	0.16
Eicher Motors	34,323	1,233,444	0.03
Geely Automobile Holdings	1,480,000	4,659,632	0.13
Guangzhou Automobile Group	846,000	759,301	0.02
Li Auto	116,700	4,077,498	0.11
Mahindra & Mahindra	216,091	2,260,917	0.06
NIO	321,900	17,125,080	0.47
Tesla	192,229	130,658,051	3.55
XPeng	80,300	3,566,926	0.10
Yadea Group Holdings	288,000	619,327	0.02
Yutong Bus	57,200	110,568	0.00
自動車部品・装置 (0.75%) (2020年12月31日 : 0.82%)			
Aptiv	67,633	10,640,700	0.29
Cie Generale des Etablissements Michelin	42,033	6,704,416	0.18
Hankook Tire & Technology	17,470	802,024	0.02
Magna International	71,933	6,667,003	0.18
Stanley Electric	33,200	961,690	0.03
Valeo	58,455	1,758,695	0.05
銀行 (6.47%) (2020年12月31日 : 5.68%)			
Absa Group	177,666	1,688,721	0.05
Abu Dhabi Commercial Bank	688,905	1,288,479	0.04
AMMB Holdings	217,500	154,553	0.00
Axis Bank	564,804	5,686,033	0.15
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	1,675,078	10,385,296	0.28
Banco do Brasil	205,800	1,317,766	0.04
Banco Santander Brasil	114,100	920,922	0.03
Bank Leumi Le-Israel	358,081	2,720,910	0.07
Bank of New York Mellon	208,401	10,676,383	0.29
Bank of Nova Scotia	304,358	19,815,345	0.54
BOC Hong Kong Holdings	929,500	3,153,850	0.09

MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF

投資明細表 2021年6月30日現在(続き)

	数量	公正価値 (米ドル)	純資産比率 (%)
普通株式(続き)			
銀行(6.47%)(2020年12月31日:5.68%)(続き)			
CaixaBank	1,104,117	3,396,514	0.09
Canadian Imperial Bank of Commerce	112,718	12,844,736	0.35
Commercial Bank PSQC	399,068	577,613	0.02
DBS Group Holdings	451,883	10,021,301	0.27
DNB	231,521	5,047,336	0.14
First Abu Dhabi Bank	1,078,439	4,903,130	0.13
FirstRand	1,271,025	4,770,322	0.13
Grupo Financiero Banorte	657,900	4,254,599	0.12
Hang Seng Bank	190,500	3,804,677	0.10
Huntington Bancshares	369,704	5,275,676	0.14
Intesa Sanpaolo	4,140,068	11,437,167	0.31
KBC Groep	62,980	4,802,440	0.13
KeyCorp	239,815	4,952,180	0.13
Malayan Banking	1,040,968	2,033,542	0.06
Moneta Money Bank	78,071	296,552	0.01
National Bank of Canada	83,549	6,259,259	0.17
Natixis	261,300	1,239,503	0.03
Nedbank Group	88,704	1,061,497	0.03
Northern Trust	49,951	5,775,335	0.16
Oversea-Chinese Banking	871,036	7,743,550	0.21
PNC Financial Services Group	106,768	20,367,064	0.55
Public Bank	3,810,700	3,772,607	0.10
Qatar National Bank	1,168,087	5,758,627	0.16
Regions Financial	241,427	4,871,997	0.13
Resona Holdings	534,600	2,057,673	0.06
RHB Bank	407,000	529,399	0.01
Santander Bank Polska	8,104	541,544	0.01
Shanghai Commercial & Savings Bank	848,000	1,377,192	0.04
Shizuoka Bank	99,300	768,526	0.02
Siam Commercial Bank (Non-voting rights)	36,100	110,384	0.00
Siam Commercial Bank (Voting rights)	169,800	519,201	0.01
Standard Bank Group	326,133	2,914,669	0.08
State Street	88,189	7,256,191	0.20
Sumitomo Mitsui Trust Holdings	86,600	2,752,724	0.08
SVB Financial Group	13,165	7,325,401	0.20
Truist Financial	336,700	18,686,850	0.51
飲料(3.17%)(2020年12月31日:1.95%)			
Coca-Cola	1,025,774	55,504,631	1.51
Coca-Cola Europacific Partners	50,212	2,978,576	0.08
Coca-Cola HBC	49,196	1,776,522	0.05
Fomento Economico Mexicano	495,800	4,186,678	0.11
PepsiCo	344,697	51,073,755	1.39
Suntory Beverage & Food	30,900	1,163,726	0.03

MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF

投資明細表 2021年6月30日現在 (続き)

	数量	公正価値 (米ドル)	純資産比率 (%)
普通株式 (続き)			
バイオテクノロジー (0.05%) (2020年12月31日: 0.02%)			
3SBio	391,500	483,965	0.02
CanSino Biologics - Class A	657	79,084	0.00
CanSino Biologics - Class H	21,400	1,136,983	0.03
建築・建設資材 (0.91%) (2020年12月31日: 0.87%)			
China Lesso Group Holdings	317,000	782,107	0.02
Daikin Industries	63,240	11,788,770	0.32
Fortune Brands Home & Security	34,339	3,420,508	0.09
HAP Seng Consolidated	104,900	197,090	0.01
Johnson Controls	182,481	12,523,671	0.34
Lennox International	8,684	3,046,347	0.08
TOTO	34,600	1,792,504	0.05
化学 (3.10%) (2020年12月31日: 2.96%)			
Akzo Nobel	47,551	5,875,917	0.16
Asahi Kasei	315,400	3,468,292	0.09
Asian Paints	95,312	3,837,484	0.10
Croda International	34,251	3,486,247	0.10
Ecolab	64,112	13,205,149	0.36
Givaudan	2,306	10,734,806	0.29
International Flavors & Fragrances	61,971	9,258,467	0.25
Johnson Matthey	50,437	2,141,150	0.06
Kansai Paint	42,500	1,084,039	0.03
Koninklijke DSM	42,627	7,956,788	0.22
LG Chem	11,478	8,663,411	0.24
Lonza Group	18,760	13,309,686	0.36
LyondellBasell Industries	66,872	6,879,123	0.19
Nitto Denko	38,170	2,850,971	0.08
Novozymes	52,706	3,973,196	0.11
PPG Industries	59,275	10,063,117	0.27
Sumitomo Chemical	351,300	1,864,273	0.05
Toray Industries	342,300	2,279,430	0.06
Umicore	48,937	2,988,772	0.08
商業サービス (2.38%) (2020年12月31日: 1.04%)			
Ashtead Group	112,504	8,336,657	0.23
Automatic Data Processing	107,027	21,257,703	0.58
Brambles	369,831	3,176,324	0.09
Bureau Veritas	71,839	2,272,974	0.06
Info Edge India	19,205	1,270,106	0.03
Localiza Rent a Car	151,815	1,936,319	0.05
Moody's	42,204	15,293,464	0.42
RELX	483,945	12,829,396	0.35
Ritchie Bros Auctioneers	27,400	1,626,121	0.04
Robert Half International	27,928	2,484,754	0.07
Secom	54,000	4,108,262	0.11
SGS	1,494	4,612,837	0.13
Sohgo Security Services	19,100	870,763	0.02
Transurban Group	681,421	7,279,740	0.20

MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF

投資明細表 2021年6月30日現在(続き)

	数量	公正価値 (米ドル)	純資産比率 (%)
普通株式(続き)			
コンピュータ(0.67%)(2020年12月31日:2.03%)			
Computershare	131,162	1,664,141	0.05
Fujitsu	49,600	9,295,252	0.25
IHS Markit	95,813	10,794,293	0.29
Nomura Research Institute	89,000	2,946,887	0.08
耐久消費財・アパレル(1.02%)(2020年12月31日:1.01%)			
adidas	47,744	17,772,905	0.48
Burberry Group	102,443	2,923,801	0.08
Gildan Activewear	50,732	1,873,925	0.05
Puma	26,587	3,170,295	0.09
VF	83,250	6,829,830	0.18
Zalando	41,359	5,000,409	0.14
化粧品・パーソナルケア(1.91%)(2020年12月31日:4.76%)			
Amorepacific	7,703	1,723,710	0.05
AMOREPACIFIC Group	7,199	409,125	0.01
Beiersdorf	24,872	3,001,189	0.08
Colgate-Palmolive	202,926	16,508,030	0.45
Colgate-Palmolive India	31,024	703,622	0.02
Dabur India	155,471	1,189,616	0.03
Essity	151,703	5,034,209	0.14
Kao	119,500	7,359,064	0.20
LG Household & Health Care	2,462	3,852,101	0.10
L'Oreal	63,004	28,078,454	0.76
Natura & Co Holding	219,818	2,485,621	0.07
流通・卸売(0.82%)(2020年12月31日:0.65%)			
Fastenal	143,667	7,470,684	0.20
Ferguson	55,634	7,723,988	0.21
LKQ	71,862	3,537,048	0.10
Pool	10,200	4,678,332	0.13
Toromont Industries	19,900	1,735,605	0.05
WW Grainger	11,254	4,929,252	0.13
各種金融サービス(5.76%)(2020年12月31日:5.53%)			
Ally Financial	93,802	4,675,092	0.13
American Express	171,323	28,307,699	0.77
Ameriprise Financial	29,473	7,335,240	0.20
Amundi	15,667	1,381,386	0.04
ASX	46,493	2,712,439	0.07
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	1,531,100	5,132,298	0.14
BlackRock	38,363	33,566,474	0.91
Chailease Holding	311,000	2,260,296	0.06
CME Group	89,572	19,050,173	0.52
CTBC Financial Holding	4,834,000	3,938,333	0.11
Deutsche Boerse	47,304	8,257,602	0.22
E.Sun Financial Holding	2,824,292	2,665,909	0.07
First Financial Holding	2,649,310	2,158,433	0.06
Fubon Financial Holding	1,683,000	4,463,838	0.12

MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF

投資明細表 2021年6月30日現在 (続き)

	数量	公正価値 (米ドル)	純資産比率 (%)
普通株式 (続き)			
各種金融サービス (5.76%) (2020年12月31日: 5.53%) (続き)			
Hong Kong Exchanges and Clearing	301,686	17,978,751	0.49
Invesco	97,141	2,596,579	0.07
Isracard	1	3	0.00
Macquarie Group	86,928	10,208,811	0.28
Mega Financial Holding	2,751,000	3,243,440	0.09
Old Mutual	1,123,436	1,062,165	0.03
Piramal Enterprises	28,507	919,776	0.03
S&P Global	60,123	24,677,485	0.67
Schroders	31,788	1,542,683	0.04
Shinhan Financial Group	114,722	4,135,962	0.11
Singapore Exchange	205,900	1,712,515	0.05
SinoPac Financial Holdings	2,314,000	1,141,947	0.03
Standard Life Aberdeen	537,013	2,010,432	0.05
T Rowe Price Group	57,191	11,322,102	0.31
Taishin Financial Holding	2,561,593	1,402,038	0.04
TMX Group	15,600	1,649,571	0.04
Tokyo Century	6,700	360,384	0.01
電気部品・設備 (0.86%) (2020年12月31日: 0.69%)			
Contemporary Amperex Technology	34,387	2,846,136	0.08
Energy Absolute	372,600	709,161	0.02
Generac Holdings	15,844	6,577,637	0.18
Schneider Electric	134,540	21,169,235	0.57
Xinjiang Goldwind Science & Technology - Class A	34,100	64,174	0.00
Xinjiang Goldwind Science & Technology - Class H	183,600	287,013	0.01
電子機器 (1.09%) (2020年12月31日: 1.27%)			
Agilent Technologies	75,955	11,226,909	0.30
Allegion	22,546	3,140,658	0.09
Azbil	28,700	1,190,770	0.03
Fortive	79,487	5,543,423	0.15
Ibiden	25,200	1,360,014	0.04
Mettler-Toledo International	5,892	8,162,423	0.22
Omron	46,200	3,667,195	0.10
Shenzhen Inovance Technology	31,950	367,194	0.01
Waters	15,549	5,373,890	0.15
エネルギー代替 (0.31%) (2020年12月31日: 0.36%)			
Ballard Power Systems	58,500	1,062,004	0.03
Sungrow Power Supply	18,400	327,652	0.01
Vestas Wind Systems	254,443	9,933,362	0.27
土木・建設 (0.26%) (2020年12月31日: 0.21%)			
Airports of Thailand	1,103,100	2,133,922	0.06
Lendlease	168,360	1,448,502	0.04
Shimizu	145,800	1,119,214	0.03
Sydney Airport	338,611	1,471,889	0.04
WSP Global	28,672	3,350,431	0.09

MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF

投資明細表 2021年6月30日現在 (続き)

	数量	公正価値 (米ドル)	純資産比率 (%)
普通株式 (続き)			
娯楽 (0.09%) (2020年12月31日: 0.08%)			
Vail Resorts	10,204	3,229,770	0.09
環境管理 (0.04%) (2020年12月31日: なし)			
Kurita Water Industries	27,400	1,315,812	0.04
食品 (2.47%) (2020年12月31日: 2.23%)			
Aeon	164,700	4,429,494	0.12
Ajinomoto	115,400	2,998,591	0.08
Associated British Foods	87,133	2,667,397	0.07
Campbell Soup	48,303	2,202,134	0.06
Carrefour	151,771	2,985,056	0.08
CJ CheilJedang	2,082	852,286	0.02
Coles Group	332,603	4,267,403	0.12
Danone	164,409	11,575,531	0.31
General Mills	152,363	9,283,478	0.25
George Weston	19,167	1,828,782	0.05
Hormel Foods	72,228	3,448,887	0.09
ICA Gruppen	23,511	1,094,980	0.03
J Sainsbury	389,971	1,464,256	0.04
Jeronimo Martins	59,958	1,093,583	0.03
Kellogg	64,422	4,144,267	0.11
Kerry Group	41,175	5,752,110	0.16
Kesko	68,330	2,524,165	0.07
Kikkoman	36,800	2,430,345	0.07
Kobe Bussan	32,900	1,037,481	0.03
Koninklijke Ahold Delhaize	261,547	7,775,930	0.21
Marico	140,405	1,002,650	0.03
Metro	60,776	2,916,836	0.08
Mowi	110,011	2,799,750	0.08
Nestle India	8,411	1,995,307	0.05
Nestle Malaysia	23,800	764,191	0.02
Orkla	183,795	1,873,149	0.05
PPB Group	161,800	713,222	0.02
Shoprite Holdings	138,434	1,507,007	0.04
SPAR Group	44,517	563,963	0.01
Wm Morrison Supermarkets	605,563	2,063,781	0.06
Woolworths Holdings	255,881	966,089	0.03
林産品・紙製品 (0.31%) (2020年12月31日: 0.17%)			
International Paper	93,310	5,720,836	0.15
Mondi	122,762	3,223,898	0.09
Svenska Cellulosa	156,474	2,566,077	0.07
フルライン保険 (3.76%) (2020年12月31日: 3.91%)			
Allianz	103,601	25,837,560	0.70
AXA	484,118	12,277,467	0.33
Cathay Financial Holding	2,022,000	3,911,559	0.11
CNP Assurances	45,046	766,578	0.02
Fosun International	658,500	948,001	0.03

MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF

投資明細表 2021年6月30日現在(続き)

	数量	公正価値 (米ドル)	純資産比率 (%)
普通株式(続き)			
フルライン保険(3.76%)(2020年12月31日:3.91%)(続き)			
Insurance Australia Group	624,702	2,420,015	0.07
Intact Financial	39,362	5,353,270	0.14
Marsh & McLennan	126,608	17,811,213	0.48
MS&AD Insurance Group Holdings	113,600	3,283,438	0.09
NN Group	69,505	3,278,907	0.09
Ping An Insurance Group Co of China - Class A	171,400	1,705,127	0.05
Ping An Insurance Group Co of China - Class H	1,581,000	15,482,536	0.42
Prudential Financial	99,285	10,173,734	0.28
Sompo Holdings	79,700	2,948,448	0.08
St James's Place	131,491	2,682,945	0.07
Sun Life Financial	147,301	7,603,553	0.21
Swiss Life Holding	7,897	3,841,068	0.10
Swiss Re	75,030	6,776,118	0.18
Travelers	62,976	9,428,137	0.26
Voya Financial	29,785	1,831,777	0.05
ヘルスケア製品(3.92%)(2020年12月31日:3.68%)			
ABIOMED	11,426	3,566,169	0.10
Align Technology	18,722	11,439,142	0.31
Ambu	40,275	1,548,557	0.04
Becton Dickinson	72,594	17,654,135	0.48
China Medical System Holdings	304,000	800,531	0.02
Cochlear	15,985	3,020,227	0.08
Coloplast	29,936	4,912,511	0.13
Cooper	12,131	4,807,151	0.13
DENTSPLY SIRONA	54,282	3,433,879	0.09
Edwards Lifesciences	157,809	16,344,278	0.45
EssilorLuxottica	72,119	13,311,261	0.36
Fisher & Paykel Healthcare	140,045	3,045,293	0.08
GN Store Nord	32,280	2,820,005	0.08
Henry Schein	35,623	2,642,870	0.07
Hologic	63,726	4,251,799	0.12
IDEXX Laboratories	21,385	13,505,697	0.37
Insulet	16,677	4,578,003	0.13
Microport Scientific	159,000	1,426,032	0.04
ResMed	36,406	8,974,807	0.24
Sonova Holding	13,738	5,172,093	0.14
STERIS	24,744	5,104,687	0.14
Sysmex	42,500	5,054,509	0.14
West Pharmaceutical Services	18,532	6,654,841	0.18
ヘルスケア・サービス(2.36%)(2020年12月31日:2.19%)			
Bangkok Dusit Medical Services	2,510,300	1,801,463	0.05
Bumrungrad Hospital	107,100	429,402	0.01
Centene	145,884	10,639,320	0.29
DaVita	17,746	2,137,151	0.06
Dr Sulaiman Al Habib Medical Services Group	11,531	502,391	0.01
Genscript Biotech	306,000	1,335,771	0.04

MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF

投資明細表 2021年6月30日現在 (続き)

	数量	公正価値 (米ドル)	純資産比率 (%)
普通株式 (続き)			
ヘルスケア・サービス (2.36%) (2020年12月31日: 2.19%) (続き)			
HCA Healthcare	67,825	14,022,140	0.38
Humana	32,187	14,249,829	0.39
IHH Healthcare	559,500	737,195	0.02
IQVIA Holdings	47,888	11,604,220	0.32
Jinxin Fertility Group	276,000	696,588	0.02
Quest Diagnostics	32,944	4,347,620	0.12
Ryman Healthcare	124,394	1,141,264	0.03
Teladoc Health	33,855	5,629,748	0.15
WuXi AppTec	82,228	1,919,679	0.05
Wuxi Biologics Cayman	845,500	15,492,786	0.42
住宅建設 (0.26%) (2020年12月31日: 0.47%)			
Barratt Developments	255,021	2,449,181	0.07
Berkeley Group Holdings	30,865	1,959,237	0.05
Sekisui House	153,500	3,151,183	0.09
Taylor Wimpey	914,428	2,007,915	0.05
住宅用家具 (1.20%) (2020年12月31日: 1.36%)			
Coway	16,428	1,148,056	0.03
Electrolux	55,217	1,532,129	0.04
Hangzhou Robam Appliances	16,800	120,902	0.00
LG Electronics	27,129	3,938,722	0.11
Panasonic	555,900	6,438,503	0.17
Sony	316,200	30,810,911	0.84
TCL Technology Group	237,100	280,713	0.01
家庭用品 (0.80%) (2020年12月31日: 0.87%)			
Clorox	31,202	5,613,552	0.15
Henkel	26,452	2,435,837	0.07
Hindustan Unilever	206,512	6,866,045	0.19
Kimberly-Clark	84,107	11,251,834	0.30
Newell Brands	95,289	2,617,589	0.07
Unilever Indonesia	1,948,700	665,246	0.02
インターネット (3.57%) (2020年12月31日: 2.71%)			
eBay	169,487	11,899,682	0.32
HengTen Networks Group	684,000	546,964	0.02
Meituan	901,400	37,189,562	1.01
Naspers	108,877	22,861,520	0.62
NAVER	30,977	11,484,170	0.31
SEEK	82,045	2,041,268	0.06
Shopify	28,203	41,289,165	1.12
Tongcheng-Elong Holdings	257,600	644,842	0.02
Z Holdings	657,900	3,300,466	0.09
鉄・鉄鋼 (0.30%) (2020年12月31日: 0.11%)			
Fortescue Metals Group	421,982	7,394,184	0.20
Kumba Iron Ore	14,521	651,458	0.02
Steel Dynamics	52,710	3,141,516	0.08

MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF

投資明細表 2021年6月30日現在 (続き)

	数量	公正価値 (米ドル)	純資産比率 (%)
普通株式 (続き)			
レジャー (0.13%) (2020年12月31日: 0.10%)			
Hero MotoCorp	27,428	1,071,068	0.03
Yamaha	32,100	1,743,968	0.05
Yamaha Motor	69,100	1,880,188	0.05
宿泊施設 (0.09%) (2020年12月31日: 0.11%)			
City Developments	102,100	553,719	0.01
Minor International	744,600	696,974	0.02
Whitbread	50,308	2,169,727	0.06
機械-各種 (1.40%) (2020年12月31日: 2.08%)			
CNH Industrial	259,654	4,287,839	0.12
Cummins	36,917	9,000,734	0.24
Husqvarna	102,620	1,364,323	0.04
IDEX	18,906	4,160,265	0.11
Miura	20,300	880,660	0.02
Rockwell Automation	29,080	8,317,462	0.23
Roper Technologies	26,278	12,355,916	0.33
WEG	416,100	2,793,708	0.08
Xylem	44,938	5,390,762	0.15
Yaskawa Electric	59,700	2,920,723	0.08
機械-建設・鉱業 (0.98%) (2020年12月31日: 0.94%)			
Caterpillar	136,526	29,712,153	0.81
Hitachi Construction Machinery	23,100	706,591	0.02
Komatsu	219,600	5,461,806	0.15
メディア (2.88%) (2020年12月31日: 3.02%)			
Cable One	1,433	2,741,057	0.07
FactSet Research Systems	9,682	3,249,376	0.09
Informa	380,356	2,635,621	0.07
Liberty Global - Class A	43,837	1,190,613	0.03
Liberty Global - Class C	90,601	2,449,851	0.07
MultiChoice Group	110,034	904,238	0.02
Vivendi	177,655	5,968,598	0.16
Walt Disney	455,186	80,008,043	2.18
Wolters Kluwer	67,960	6,827,907	0.19
鉱業 (1.10%) (2020年12月31日: 1.12%)			
Agnico Eagle Mines	62,522	3,784,745	0.10
Antofagasta	96,292	1,909,539	0.05
Boliden	68,766	2,645,418	0.07
Franco-Nevada	47,649	6,922,053	0.19
Newcrest Mining	200,308	3,801,639	0.10
Newmont	199,027	12,614,331	0.34
Northern Star Resources	277,586	2,038,130	0.06
Polymetal International	84,968	1,848,904	0.05
Wheaton Precious Metals	113,864	5,024,250	0.14

MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF

投資明細表 2021年6月30日現在(続き)

	数量	公正価値 (米ドル)	純資産比率 (%)
普通株式(続き)			
その他製造(1.14%) (2020年12月31日:1.77%)			
FUJIFILM Holdings	89,800	6,666,026	0.18
Hartalega Holdings	482,700	854,594	0.02
Hiwin Technologies	57,000	808,075	0.02
Illinois Tool Works	79,317	17,732,108	0.48
Kossan Rubber Industries	259,200	201,042	0.01
Pentair	41,020	2,768,440	0.07
Supermax	328,560	261,170	0.01
Trane Technologies	59,490	10,954,489	0.30
Wartsila	114,724	1,702,681	0.05
石油・ガス(0.64%) (2020年12月31日:0.65%)			
Ampol	60,903	1,289,844	0.04
Cosan	240,700	1,149,331	0.03
DCC	23,887	1,952,863	0.05
Neste	105,053	6,433,436	0.18
Parkland	36,900	1,193,745	0.03
Petronas Dagangan	79,900	357,977	0.01
Phillips 66	108,954	9,350,432	0.25
S-Oil	13,054	1,188,150	0.03
Ultrapar Participacoes	207,600	760,836	0.02
包装・容器(0.21%) (2020年12月31日:0.27%)			
Ball	80,890	6,553,708	0.18
Klabin	191,200	1,003,658	0.03
医薬品(7.83%) (2020年12月31日:7.61%)			
AmerisourceBergen	38,291	4,383,937	0.12
Amgen	144,332	35,180,925	0.96
Amplifon	29,671	1,465,181	0.04
Astellas Pharma	464,800	8,101,231	0.22
Biogen	38,150	13,210,200	0.36
Cardinal Health	72,914	4,162,660	0.11
China National Medicines	16,800	85,957	0.00
Chugai Pharmaceutical	167,300	6,635,324	0.18
Dexcom	24,029	10,260,383	0.28
Eisai	60,100	5,915,781	0.16
Genmab	16,478	6,743,036	0.18
Gilead Sciences	313,279	21,572,392	0.59
Illumina	36,506	17,275,004	0.47
Jazz Pharmaceuticals	15,309	2,719,491	0.08
Kalbe Farma	4,167,600	402,389	0.01
Merck	32,159	6,166,814	0.17
Novo Nordisk	429,842	36,015,818	0.98
Orion	26,498	1,139,120	0.03
Roche Holding	175,925	66,337,057	1.80
Shionogi	65,300	3,407,084	0.09
Vertex Pharmaceuticals	65,700	13,247,091	0.36
Vifor Pharma	11,844	1,534,396	0.04
Zoetis	118,692	22,119,441	0.60

MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF

投資明細表 2021年6月30日現在(続き)

	数量	公正価値 (米ドル)	純資産比率 (%)
普通株式(続き)			
パイプライン(0.02%)(2020年12月31日:0.16%)			
Koninklijke Vopak	18,038	819,286	0.02
不動産(0.72%)(2020年12月31日:0.41%)			
A-Living Smart City Services	141,500	704,234	0.02
Asset World	2,209,000	299,128	0.01
CapitaLand	677,901	1,871,011	0.05
CBRE Group	83,277	7,139,337	0.19
Central Pattana	595,500	975,468	0.03
Country Garden Services Holdings	365,000	3,943,355	0.11
FirstService	9,800	1,682,612	0.04
Greentown Service Group	382,000	593,228	0.02
Hulic	57,900	652,086	0.02
Mitsui Fudosan	228,100	5,287,875	0.14
NEPI Rockcastle	97,834	693,531	0.02
REA Group	12,560	1,593,855	0.04
Shenzhen Investment	682,000	209,891	0.00
Swire Properties	324,400	967,036	0.03
不動産投資信託(1.14%)(2020年12月31日:1.58%)			
British Land	219,464	1,500,431	0.04
Gecina	11,186	1,713,901	0.05
GPT Group	495,702	1,823,527	0.05
Growthpoint Properties	808,444	843,618	0.02
Mirvac Group	1,049,794	2,301,349	0.06
Orix JREIT	610	1,175,043	0.03
Prologis	184,648	22,070,975	0.60
Segro	296,476	4,482,709	0.12
Stockland	596,846	2,088,063	0.06
Unibail-Rodamco-Westfield (France listed)	24,606	2,129,868	0.06
Unibail-Rodamco-Westfield (Netherlands listed)	6,453	558,564	0.02
Vicinity Centres	1,008,101	1,169,305	0.03
小売(5.57%)(2020年12月31日:5.84%)			
Best Buy	58,281	6,701,149	0.18
Bidvest Group	72,193	962,961	0.03
Canadian Tire	14,380	2,277,946	0.06
Clicks Group	59,212	1,018,843	0.03
Fast Retailing	14,800	11,151,671	0.30
Home Depot	269,207	85,847,420	2.34
Home Product Center	1,541,800	692,728	0.02
Hotai Motor	72,000	1,586,649	0.04
Industria de Diseno Textil	272,559	9,603,100	0.26
JD Sports Fashion	129,649	1,645,962	0.05
Kingfisher	522,791	2,632,454	0.07
Lojas Renner	223,150	1,966,963	0.05
Lowe's	182,788	35,455,388	0.97
Pandora	24,931	3,351,673	0.09
President Chain Store	170,000	1,604,666	0.04
Shanghai Pharmaceuticals Holding	199,200	435,037	0.01

MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF

投資明細表 2021年6月30日現在 (続き)

	数量	公正価値 (米ドル)	純資産比率 (%)
普通株式 (続き)			
小売 (5.57%) (2020年12月31日: 5.84%) (続き)			
Suning.com	95,600	82,707	0.00
Target	125,117	30,245,784	0.82
Titan	88,162	2,054,899	0.06
Tractor Supply	28,960	5,388,298	0.15
半導体 (10.55%) (2020年12月31日: 8.13%)			
ASML Holding	105,115	72,225,652	1.96
NVIDIA	154,901	123,936,290	3.37
Taiwan Semiconductor Manufacturing	6,161,000	131,567,340	3.58
Texas Instruments	229,918	44,213,231	1.20
Tokyo Electron	37,600	16,288,026	0.44
ソフトウェア (6.87%) (2020年12月31日: 8.24%)			
Capcom	48,100	1,408,460	0.04
Cerner	77,601	6,065,294	0.16
Electronic Arts	71,369	10,265,003	0.28
Microsoft	718,131	194,541,688	5.29
SAP	262,300	36,966,576	1.01
Xero	32,556	3,350,919	0.09
電気通信 (3.36%) (2020年12月31日: 1.70%)			
Advanced Info Service	280,400	1,496,050	0.04
Axiata Group	571,832	515,152	0.01
BT Group	2,240,783	6,005,328	0.16
Chunghwa Telecom	976,000	3,993,324	0.11
Cisco Systems	1,055,835	55,959,255	1.52
DiGi.Com	760,600	756,661	0.02
Elisa	37,160	2,217,505	0.06
Far EastOne Telecommunications	458,000	1,061,886	0.03
Globe Telecom	9,810	369,772	0.01
Indus Towers	155,457	499,123	0.01
Intouch Holdings	567,000	1,149,922	0.03
KDDI	404,600	12,631,219	0.34
Maxis	472,300	499,433	0.01
MTN Group	427,143	3,088,083	0.08
Ooredoo	208,494	417,732	0.01
Orange Polska	192,394	339,355	0.01
Rogers Communications	87,106	4,635,618	0.13
Singapore Telecommunications	2,108,300	3,591,733	0.10
SK Telecom	10,181	2,892,972	0.08
Spark New Zealand	419,338	1,406,460	0.04
Swisscom	6,361	3,634,857	0.10
Taiwan Mobile	491,000	1,797,470	0.05
Tele2	130,060	1,773,238	0.05
Telefonica Brasil	124,800	1,044,591	0.03
Telefonica Deutschland Holding	263,908	696,355	0.02
Telekom Malaysia	276,800	404,715	0.01
Telenor	169,067	2,850,790	0.08
Telia	654,109	2,904,891	0.08

MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF

投資明細表 2021年6月30日現在(続き)

	数量	公正価値 (米ドル)	純資産比率 (%)
普通株式(続き)			
電気通信(3.36%)(2020年12月31日:1.70%)(続き)			
Telkom Indonesia Persero	13,154,300	2,857,658	0.08
TRUE	2,587,600	256,742	0.01
Turkcell Iletisim Hizmetleri	218,291	404,545	0.01
Vodacom Group	160,711	1,449,339	0.04
繊維(0.02%)(2020年12月31日:0.03%)			
Far Eastern New Century	684,000	785,572	0.02
玩具・ゲーム・趣味(0.08%)(2020年12月31日:0.65%)			
Hasbro	32,339	3,056,682	0.08
輸送(1.23%)(2020年12月31日:0.95%)			
BTS Group Holdings	1,417,900	413,646	0.01
CH Robinson Worldwide	33,215	3,111,249	0.08
Deutsche Post	247,605	16,842,899	0.46
Expeditors International of Washington	41,900	5,304,540	0.14
Hankyu Hanshin Holdings	58,300	1,799,058	0.05
Keio	26,000	1,529,687	0.04
Kuehne Nagel International	13,497	4,622,870	0.13
MTR	367,592	2,047,214	0.06
Nippon Express	18,700	1,425,372	0.04
Odakyu Electric Railway	75,700	1,913,814	0.05
SG Holdings	80,200	2,104,898	0.06
Sinotrans	149,133	116,556	0.00
Tokyu	126,200	1,718,067	0.05
West Japan Railway	40,000	2,282,728	0.06
公益事業—電気(0.50%)(2020年12月31日:0.58%)			
Adani Green Energy	94,039	1,423,173	0.04
AusNet Services	491,074	645,179	0.02
Elia Group	7,577	799,716	0.02
Energisa	45,300	420,694	0.01
Eversource Energy	85,391	6,851,774	0.19
Hydro One	77,409	1,872,869	0.05
Mercury	151,680	706,929	0.02
Meridian Energy	335,083	1,247,962	0.03
Red Electrica	101,778	1,889,537	0.05
Terna Rete Elettrica Nazionale	349,302	2,603,068	0.07
公益事業—電気・ガス(0.21%)(2020年12月31日:0.14%)			
Atmos Energy	32,239	3,098,490	0.09
Enagas	67,112	1,550,775	0.04
Snam	501,492	2,899,259	0.08
水道(0.17%)(2020年12月31日:0.11%)			
Severn Trent	61,948	2,140,308	0.06
Suez	84,354	2,005,711	0.05
United Utilities Group	168,858	2,272,972	0.06
普通株式合計		3,693,597,146	100.42

MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF

投資明細表 2021年6月30日現在(続き)

	数量	公正価値 (米ドル)	純資産比率 (%)
優先株式			
銀行(なし) (2020年12月31日: 0.18%)			
化学(0.07%) (2020年12月31日: 0.06%)			
LG Chem	2,145	730,460	0.02
Sociedad Quimica y Minera de Chile	36,462	1,732,685	0.05
化粧品・パーソナルケア(0.01%) (2020年12月31日: 0.01%)			
LG Household & Health Care	565	383,808	0.01
電子機器(なし) (2020年12月31日: 0.12%)			
家庭用品(0.12%) (2020年12月31日: 0.16%)			
Henkel	44,193	4,666,453	0.12
公益事業—電気(0.02%) (2020年12月31日: 0.02%)			
Cia Energetica de Minas Gerais	299,122	723,088	0.02
優先株式合計		8,236,494	0.22
ライツ			
石油・ガス(0.00%) (2020年12月31日: なし)			
Ultrapar Participacoes	256,079	2,041	0.00
ライツ合計		2,041	0.00
ワラント			
宿泊施設(0.00%) (2020年12月31日: なし)			
Minor International THB28	25,676	4,166	0.00
Minor International THB31	23,269	3,340	0.00
輸送(なし) (2020年12月31日: 0.00%)			
ワラント合計		7,506	0.00

MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF

投資明細表 2021年6月30日現在(続き)

金融デリバティブ商品

未決済先渡為替契約* ((0.89)%) (2020年12月31日: 0.60%)

決済日		購入額		売却額	未実現利益 ／ (損失) (米ドル)	ファンド (%)
02/07/2021	AUD	3,140,000	CHF	2,172,601	6,947	0.00
02/07/2021	AUD	52,000	CHF	36,176	(98)	(0.00)
02/07/2021	AUD	152,000	CHF	105,889	(441)	(0.00)
02/07/2021	AUD	3,482,000	EUR	2,199,602	5,603	0.00
02/07/2021	AUD	4,463,000	USD	3,355,266	(4,667)	(0.00)
02/07/2021	CAD	6,018,000	CHF	4,471,880	22,025	0.00
02/07/2021	CAD	291,400	CHF	217,387	144	0.00
02/07/2021	CAD	99,000	CHF	73,879	23	0.00
02/07/2021	CAD	6,675,000	EUR	4,528,531	20,067	0.00
02/07/2021	CAD	8,555,000	USD	6,907,290	1,376	0.00
02/07/2021	CHF	13,154,789	AUD	18,908,900	35,534	0.00
02/07/2021	CHF	502,724	AUD	722,623	1,358	0.00
02/07/2021	CHF	313,203	AUD	450,000	998	0.00
02/07/2021	CHF	59,798	AUD	86,000	128	0.00
02/07/2021	CHF	29,942	AUD	43,000	110	0.00
02/07/2021	CHF	25,752	AUD	37,000	82	0.00
02/07/2021	CHF	24,967	AUD	36,000	(17)	0.00
02/07/2021	CHF	85,846	AUD	123,800	(71)	(0.00)
02/07/2021	CHF	54,591	AUD	79,000	(251)	(0.00)
02/07/2021	CHF	71,057	AUD	103,000	(455)	(0.00)
02/07/2021	CHF	52,247	CAD	70,000	(6)	0.00
02/07/2021	CHF	16,376	CAD	22,000	(50)	(0.00)
02/07/2021	CHF	52,109	CAD	70,000	(156)	(0.00)
02/07/2021	CHF	60,924	CAD	82,000	(309)	(0.00)
02/07/2021	CHF	122,689	CAD	165,000	(518)	(0.00)
02/07/2021	CHF	112,729	CAD	152,000	(794)	(0.00)
02/07/2021	CHF	175,587	CAD	237,300	(1,676)	(0.00)
02/07/2021	CHF	642,427	CAD	863,000	(1,920)	(0.00)
02/07/2021	CHF	145,988	CAD	198,000	(1,961)	(0.00)
02/07/2021	CHF	1,030,317	CAD	1,385,172	(3,968)	(0.00)
02/07/2021	CHF	26,960,389	CAD	36,245,900	(103,832)	(0.00)
02/07/2021	CHF	12,934,255	DKK	87,511,900	36,794	0.00
02/07/2021	CHF	494,295	DKK	3,344,354	1,406	0.00
02/07/2021	CHF	307,430	DKK	2,085,000	83	0.00
02/07/2021	CHF	24,943	DKK	169,000	33	0.00
02/07/2021	CHF	25,066	DKK	170,000	7	0.00
02/07/2021	CHF	28,990	DKK	197,000	(55)	(0.00)
02/07/2021	CHF	53,839	DKK	366,000	(123)	(0.00)
02/07/2021	CHF	58,540	DKK	398,000	(140)	(0.00)
02/07/2021	CHF	69,876	DKK	477,000	(475)	(0.00)
02/07/2021	CHF	83,998	DKK	572,900	(491)	(0.00)
02/07/2021	CHF	83,816,258	EUR	76,239,500	263,421	0.01
02/07/2021	CHF	3,203,121	EUR	2,913,568	10,067	0.00
02/07/2021	CHF	1,991,399	EUR	1,816,000	782	0.00
02/07/2021	CHF	161,343	EUR	147,000	220	0.00
02/07/2021	CHF	162,296	EUR	148,000	65	0.00
02/07/2021	CHF	51,519	EUR	47,000	(2)	0.00
02/07/2021	CHF	188,218	EUR	172,000	(353)	(0.00)

MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF

投資明細表 2021年6月30日現在(続き)

金融デリバティブ商品(続き)

未決済先渡為替契約* ((0.89)%) (2020年12月31日: 0.60%) (続き)

決済日		購入額		売却額	未実現利益 ／(損失) (米ドル)	ファンド (%)
02/07/2021	CHF	348,948	EUR	319,000	(796)	(0.00)
02/07/2021	CHF	379,576	EUR	347,000	(866)	(0.00)
02/07/2021	CHF	453,185	EUR	416,000	(3,061)	(0.00)
02/07/2021	CHF	544,255	EUR	499,100	(3,085)	(0.00)
02/07/2021	CHF	4,090,000	EUR	3,734,195	(3,654)	(0.00)
02/07/2021	CHF	17,654,383	GBP	13,819,900	7,738	0.00
02/07/2021	CHF	674,679	GBP	528,141	296	0.00
02/07/2021	CHF	74,050	GBP	58,000	(14)	0.00
02/07/2021	CHF	34,442	GBP	27,000	(39)	(0.00)
02/07/2021	CHF	34,341	GBP	27,000	(148)	(0.00)
02/07/2021	CHF	39,419	GBP	31,000	(180)	(0.00)
02/07/2021	CHF	80,259	GBP	63,000	(204)	(0.00)
02/07/2021	CHF	94,895	GBP	75,000	(947)	(0.00)
02/07/2021	CHF	114,627	GBP	90,500	(1,014)	(0.00)
02/07/2021	CHF	418,449	GBP	329,000	(1,802)	(0.00)
02/07/2021	CHF	23,889	HKD	202,000	(167)	(0.00)
02/07/2021	CHF	10,878	HKD	94,000	(336)	(0.00)
02/07/2021	CHF	25,496	HKD	220,000	(746)	(0.00)
02/07/2021	CHF	30,547	HKD	264,000	(948)	(0.00)
02/07/2021	CHF	36,560	HKD	316,800	(1,241)	(0.00)
02/07/2021	CHF	133,428	HKD	1,153,000	(4,123)	(0.00)
02/07/2021	CHF	214,164	HKD	1,849,565	(6,475)	(0.00)
02/07/2021	CHF	5,604,052	HKD	48,397,700	(169,424)	(0.01)
02/07/2021	CHF	1,105	ILS	4,000	(32)	(0.00)
02/07/2021	CHF	21,476	ILS	77,627	(590)	(0.00)
02/07/2021	CHF	561,960	ILS	2,031,300	(15,433)	(0.00)
02/07/2021	CHF	196,747	JPY	23,609,000	136	0.00
02/07/2021	CHF	28,294	JPY	3,459,000	(555)	(0.00)
02/07/2021	CHF	89,291	JPY	10,882,000	(1,446)	(0.00)
02/07/2021	CHF	104,548	JPY	12,729,000	(1,582)	(0.00)
02/07/2021	CHF	89,870	JPY	10,969,000	(1,604)	(0.00)
02/07/2021	CHF	210,695	JPY	25,665,000	(3,299)	(0.00)
02/07/2021	CHF	251,286	JPY	30,798,000	(5,633)	(0.00)
02/07/2021	CHF	302,002	JPY	36,957,400	(6,262)	(0.00)
02/07/2021	CHF	1,101,868	JPY	134,491,000	(19,694)	(0.00)
02/07/2021	CHF	1,772,769	JPY	215,756,586	(26,074)	(0.00)
02/07/2021	CHF	46,388,127	JPY	5,645,713,400	(682,274)	(0.02)
02/07/2021	CHF	2,527,792	NOK	23,400,600	15,314	0.00
02/07/2021	CHF	96,602	NOK	894,275	585	0.00
02/07/2021	CHF	60,186	NOK	557,000	383	0.00
02/07/2021	CHF	11,462	NOK	106,000	81	0.00
02/07/2021	CHF	4,862	NOK	45,000	31	0.00
02/07/2021	CHF	1,465,140	NZD	2,239,700	20,059	0.00
02/07/2021	CHF	55,992	NZD	85,593	767	0.00
02/07/2021	CHF	34,475	NZD	53,000	263	0.00
02/07/2021	CHF	2,602	NZD	4,000	20	0.00
02/07/2021	CHF	3,783,476	SEK	34,902,800	11,947	0.00
02/07/2021	CHF	90,250	SEK	831,000	467	0.00

MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF

投資明細表 2021年6月30日現在(続き)

金融デリバティブ商品(続き)

未決済先渡為替契約* ((0.89)%) (2020年12月31日: 0.60%) (続き)

決済日	購入額	売却額	未実現利益 ／ (損失) (米ドル)	ファンド (%)
02/07/2021	CHF 144,589 SEK	1,333,844	457	0.00
02/07/2021	CHF 17,257 SEK	159,000	78	0.00
02/07/2021	CHF 7,385 SEK	68,000	38	0.00
02/07/2021	CHF 20,481 SEK	190,000	(59)	(0.00)
02/07/2021	CHF 15,684 SEK	146,000	(104)	(0.00)
02/07/2021	CHF 9,504 SGD	14,000	(133)	(0.00)
02/07/2021	CHF 21,169 SGD	31,000	(160)	(0.00)
02/07/2021	CHF 23,074 SGD	34,000	(331)	(0.00)
02/07/2021	CHF 27,060 SGD	40,000	(482)	(0.00)
02/07/2021	CHF 32,710 SGD	48,400	(619)	(0.00)
02/07/2021	CHF 119,485 SGD	176,000	(1,670)	(0.00)
02/07/2021	CHF 192,261 SGD	282,638	(2,269)	(0.00)
02/07/2021	CHF 5,030,910 SGD	7,395,800	(59,362)	(0.00)
02/07/2021	CHF 221,878 USD	248,000	(7,963)	(0.00)
02/07/2021	CHF 1,555,444 USD	1,694,000	(11,256)	(0.00)
02/07/2021	CHF 705,911 USD	781,000	(17,317)	(0.00)
02/07/2021	CHF 706,634 USD	787,000	(22,534)	(0.00)
02/07/2021	CHF 5,242,000 USD	5,695,715	(24,703)	(0.00)
02/07/2021	CHF 819,426 USD	913,000	(26,511)	(0.00)
02/07/2021	CHF 1,654,845 USD	1,841,000	(50,720)	(0.00)
02/07/2021	CHF 1,983,876 USD	2,209,000	(62,761)	(0.00)
02/07/2021	CHF 2,374,213 USD	2,651,200	(82,678)	(0.00)
02/07/2021	CHF 8,662,726 USD	9,648,000	(276,305)	(0.01)
02/07/2021	CHF 13,908,929 USD	15,477,634	(430,380)	(0.01)
02/07/2021	CHF 363,950,770 USD	405,004,000	(11,267,029)	(0.31)
02/07/2021	DKK 14,531,000 CHF	2,140,230	1,951	0.00
02/07/2021	DKK 703,600 CHF	103,597	131	0.00
02/07/2021	DKK 238,000 CHF	35,058	28	0.00
02/07/2021	DKK 16,115,000 EUR	2,167,035	62	0.00
02/07/2021	DKK 20,654,000 USD	3,305,406	(11,596)	(0.00)
02/07/2021	EUR 99,440 AUD	156,400	509	0.00
02/07/2021	EUR 65,462 AUD	103,000	304	0.00
02/07/2021	EUR 50,515 AUD	79,400	296	0.00
02/07/2021	EUR 52,780 AUD	83,000	280	0.00
02/07/2021	EUR 38,180 AUD	60,000	232	0.00
02/07/2021	EUR 33,024 AUD	52,000	124	0.00
02/07/2021	EUR 23,520 AUD	37,000	114	0.00
02/07/2021	EUR 37,914 AUD	60,000	(83)	(0.00)
02/07/2021	EUR 125,589 AUD	199,000	(463)	(0.00)
02/07/2021	EUR 18,515,553 AUD	29,258,333	(8,093)	(0.00)
02/07/2021	EUR 103,691 CAD	152,200	57	0.00
02/07/2021	EUR 67,438 CAD	99,000	26	0.00
02/07/2021	EUR 48,943 CAD	72,000	(102)	(0.00)
02/07/2021	EUR 77,527 CAD	114,000	(122)	(0.00)
02/07/2021	EUR 56,795 CAD	83,700	(239)	(0.00)
02/07/2021	EUR 77,403 CAD	114,000	(270)	(0.00)
02/07/2021	EUR 203,755 CAD	299,800	(473)	(0.00)

MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF

投資明細表 2021年6月30日現在（続き）

金融デリバティブ商品（続き）

未決済先渡為替契約* ((0.89)%) (2020年12月31日：0.60%)（続き）

決済日	購入額	売却額	未実現利益 ／（損失） （米ドル）	ファンド （%）
02/07/2021	EUR 134,348	CAD 198,000	(573)	(0.00)
02/07/2021	EUR 108,374	CAD 160,000	(688)	(0.00)
02/07/2021	EUR 257,382	CAD 380,000	(1,643)	(0.00)
02/07/2021	EUR 37,945,506	CAD 56,084,331	(291,794)	(0.01)
02/07/2021	EUR 12,659,000	CHF 13,865,377	12,178	0.00
02/07/2021	EUR 168,802	CHF 183,700	1,448	0.00
02/07/2021	EUR 613,000	CHF 671,224	799	0.00
02/07/2021	EUR 89,962	CHF 98,000	666	0.00
02/07/2021	EUR 110,821	CHF 121,000	520	0.00
02/07/2021	EUR 212,965	CHF 233,000	487	0.00
02/07/2021	EUR 47,044	CHF 51,300	291	0.00
02/07/2021	EUR 208,000	CHF 227,856	163	0.00
02/07/2021	EUR 63,969	CHF 70,000	131	0.00
02/07/2021	EUR 85,207	CHF 93,300	111	0.00
02/07/2021	EUR 40,224	CHF 44,000	100	0.00
02/07/2021	EUR 55,684	CHF 61,000	44	0.00
02/07/2021	EUR 63,777	CHF 70,000	(96)	(0.00)
02/07/2021	EUR 31,261,262	CHF 34,368,037	(108,013)	(0.00)
02/07/2021	EUR 37,114	DKK 276,000	(1)	0.00
02/07/2021	EUR 37,115	DKK 276,000	(1)	0.00
02/07/2021	EUR 97,333	DKK 723,800	(1)	0.00
02/07/2021	EUR 64,278	DKK 478,000	(2)	0.00
02/07/2021	EUR 32,138	DKK 239,000	(2)	0.00
02/07/2021	EUR 49,418	DKK 367,500	(2)	0.00
02/07/2021	EUR 23,261	DKK 173,000	(4)	0.00
02/07/2021	EUR 51,902	DKK 386,000	(8)	0.00
02/07/2021	EUR 123,576	DKK 919,000	(9)	0.00
02/07/2021	EUR 18,204,267	DKK 135,409,786	(6,111)	(0.00)
02/07/2021	EUR 44,423	GBP 38,000	187	0.00
02/07/2021	EUR 133,263	GBP 114,300	136	0.00
02/07/2021	EUR 31,446	GBP 27,000	(8)	0.00
02/07/2021	EUR 67,525	GBP 58,000	(46)	(0.00)
02/07/2021	EUR 70,971	GBP 61,000	(104)	(0.00)
02/07/2021	EUR 168,813	GBP 145,000	(115)	(0.00)
02/07/2021	EUR 51,137	GBP 44,000	(140)	(0.00)
02/07/2021	EUR 51,130	GBP 44,000	(149)	(0.00)
02/07/2021	EUR 87,048	GBP 75,000	(379)	(0.00)
02/07/2021	EUR 24,848,224	GBP 21,383,934	(73,316)	(0.00)
02/07/2021	EUR 55,185	HKD 508,000	29	0.00
02/07/2021	EUR 21,905	HKD 203,200	(188)	(0.00)
02/07/2021	EUR 16,069	HKD 152,000	(517)	(0.00)
02/07/2021	EUR 22,638	HKD 213,000	(581)	(0.00)
02/07/2021	EUR 27,907	HKD 264,000	(900)	(0.00)
02/07/2021	EUR 42,583	HKD 400,300	(1,048)	(0.00)
02/07/2021	EUR 7,887,529	HKD 74,887,159	(289,312)	(0.01)
02/07/2021	EUR 791,027	ILS 3,143,065	(26,495)	(0.00)
02/07/2021	EUR 453,410	JPY 59,267,000	3,714	0.00

MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF

投資明細表 2021年6月30日現在(続き)

金融デリバティブ商品(続き)

未決済先渡為替契約* ((0.89)%) (2020年12月31日: 0.60%) (続き)

決済日		購入額		売却額	未実現利益 ／ (損失) (米ドル)	ファンド (%)
02/07/2021	EUR	29,156	JPY	3,907,000	(626)	(0.00)
02/07/2021	EUR	116,387	JPY	15,409,000	(809)	(0.00)
02/07/2021	EUR	83,627	JPY	11,143,000	(1,223)	(0.00)
02/07/2021	EUR	179,060	JPY	23,706,100	(1,240)	(0.00)
02/07/2021	EUR	97,716	JPY	13,039,700	(1,604)	(0.00)
02/07/2021	EUR	133,458	JPY	17,781,000	(1,936)	(0.00)
02/07/2021	EUR	132,933	JPY	17,781,000	(2,558)	(0.00)
02/07/2021	EUR	186,805	JPY	24,894,000	(2,759)	(0.00)
02/07/2021	EUR	231,055	JPY	30,821,000	(3,684)	(0.00)
02/07/2021	EUR	351,215	JPY	46,696,100	(4,217)	(0.00)
02/07/2021	EUR	65,290,210	JPY	8,735,784,371	(1,280,153)	(0.04)
02/07/2021	EUR	3,557,793	NOK	36,208,385	11,455	0.00
02/07/2021	EUR	19,151	NOK	193,500	225	0.00
02/07/2021	EUR	9,705	NOK	98,300	86	0.00
02/07/2021	EUR	23,846	NOK	246,000	(308)	(0.00)
02/07/2021	EUR	2,062,156	NZD	3,465,565	23,949	0.00
02/07/2021	EUR	5,570	NZD	9,400	38	0.00
02/07/2021	EUR	28,659	SEK	288,700	229	0.00
02/07/2021	EUR	18,958	SEK	191,000	148	0.00
02/07/2021	EUR	5,325,044	SEK	54,006,123	55	0.00
02/07/2021	EUR	14,483	SEK	146,600	34	0.00
02/07/2021	EUR	35,743	SEK	366,000	(409)	(0.00)
02/07/2021	EUR	48,884	SGD	78,000	(55)	(0.00)
02/07/2021	EUR	19,391	SGD	31,100	(141)	(0.00)
02/07/2021	EUR	10,598	SGD	17,100	(153)	(0.00)
02/07/2021	EUR	20,525	SGD	33,000	(210)	(0.00)
02/07/2021	EUR	38,089	SGD	61,200	(359)	(0.00)
02/07/2021	EUR	24,781	SGD	40,000	(369)	(0.00)
02/07/2021	EUR	7,080,898	SGD	11,443,744	(116,182)	(0.00)
02/07/2021	EUR	3,585,596	USD	4,252,000	160	0.00
02/07/2021	EUR	924,698	USD	1,105,000	(8,400)	(0.00)
02/07/2021	EUR	228,535	USD	280,000	(8,980)	(0.00)
02/07/2021	EUR	1,422,844	USD	1,700,600	(13,249)	(0.00)
02/07/2021	EUR	656,573	USD	799,000	(20,369)	(0.00)
02/07/2021	EUR	768,173	USD	935,400	(24,423)	(0.00)
02/07/2021	EUR	1,050,813	USD	1,276,000	(29,840)	(0.00)
02/07/2021	EUR	1,046,539	USD	1,276,000	(34,909)	(0.00)
02/07/2021	EUR	1,473,308	USD	1,786,000	(38,803)	(0.00)
02/07/2021	EUR	1,813,505	USD	2,211,000	(60,363)	(0.00)
02/07/2021	EUR	2,765,086	USD	3,349,800	(70,682)	(0.00)
02/07/2021	EUR	17,994,000	USD	21,414,515	(75,420)	(0.00)
02/07/2021	EUR	512,253,084	USD	626,675,056	(19,193,821)	(0.52)
02/07/2021	GBP	6,664,038	AUD	12,237,000	19,107	0.00
02/07/2021	GBP	156,066	AUD	285,000	1,633	0.00
02/07/2021	GBP	77,379	AUD	141,600	589	0.00
02/07/2021	GBP	22,436	AUD	41,000	214	0.00
02/07/2021	GBP	19,848	AUD	36,400	92	0.00

MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF

投資明細表 2021年6月30日現在(続き)

金融デリバティブ商品(続き)

未決済先渡為替契約* ((0.89)%) (2020年12月31日: 0.60%) (続き)

決済日	購入額	売却額	未実現利益 ／(損失) (米ドル)	ファンド (%)
02/07/2021	GBP 29,300	AUD 54,000	(63)	(0.00)
02/07/2021	GBP 21,140	AUD 39,000	(76)	(0.00)
02/07/2021	GBP 107,496	AUD 199,000	(900)	(0.00)
02/07/2021	GBP 158,878	CAD 271,500	230	0.00
02/07/2021	GBP 46,237	CAD 79,000	77	0.00
02/07/2021	GBP 40,627	CAD 69,700	(163)	(0.00)
02/07/2021	GBP 319,024	CAD 546,000	(211)	(0.00)
02/07/2021	GBP 43,630	CAD 75,000	(295)	(0.00)
02/07/2021	GBP 59,906	CAD 103,000	(422)	(0.00)
02/07/2021	GBP 221,033	CAD 381,000	(2,334)	(0.00)
02/07/2021	GBP 13,657,817	CAD 23,456,700	(75,070)	(0.00)
02/07/2021	GBP 263,450	CHF 335,000	1,527	0.00
02/07/2021	GBP 130,528	CHF 166,400	299	0.00
02/07/2021	GBP 33,650	CHF 42,700	291	0.00
02/07/2021	GBP 111,100	CHF 141,633	254	0.00
02/07/2021	GBP 38,526	CHF 49,000	211	0.00
02/07/2021	GBP 36,112	CHF 46,000	122	0.00
02/07/2021	GBP 49,355	CHF 63,000	25	0.00
02/07/2021	GBP 38,000	CHF 48,665	(153)	(0.00)
02/07/2021	GBP 181,909	CHF 233,000	(771)	(0.00)
02/07/2021	GBP 11,252,085	CHF 14,374,100	(6,300)	(0.00)
02/07/2021	GBP 2,295,000	CHF 2,939,599	(9,751)	(0.00)
02/07/2021	GBP 6,552,260	DKK 56,633,800	19,908	0.00
02/07/2021	GBP 152,524	DKK 1,318,000	516	0.00
02/07/2021	GBP 22,142	DKK 191,000	129	0.00
02/07/2021	GBP 75,711	DKK 655,500	54	0.00
02/07/2021	GBP 20,904	DKK 181,000	13	0.00
02/07/2021	GBP 19,410	DKK 168,300	(25)	(0.00)
02/07/2021	GBP 28,783	DKK 250,000	(107)	(0.00)
02/07/2021	GBP 105,671	DKK 919,000	(579)	(0.00)
02/07/2021	GBP 42,458,948	EUR 49,338,800	144,009	0.00
02/07/2021	GBP 987,916	EUR 1,148,000	3,343	0.00
02/07/2021	GBP 143,983	EUR 167,000	860	0.00
02/07/2021	GBP 490,456	EUR 571,000	392	0.00
02/07/2021	GBP 134,854	EUR 157,000	107	0.00
02/07/2021	GBP 125,825	EUR 146,700	(150)	(0.00)
02/07/2021	GBP 186,642	EUR 218,000	(690)	(0.00)
02/07/2021	GBP 684,947	EUR 801,000	(3,686)	(0.00)
02/07/2021	GBP 2,545,000	EUR 2,976,236	(13,729)	(0.00)
02/07/2021	GBP 9,330	HKD 100,000	12	0.00
02/07/2021	GBP 12,741	HKD 138,000	(169)	(0.00)
02/07/2021	GBP 8,493	HKD 93,100	(255)	(0.00)
02/07/2021	GBP 33,566	HKD 362,500	(309)	(0.00)
02/07/2021	GBP 47,002	HKD 508,000	(483)	(0.00)
02/07/2021	GBP 66,319	HKD 729,000	(2,256)	(0.00)
02/07/2021	GBP 2,838,925	HKD 31,320,800	(111,311)	(0.00)
02/07/2021	GBP 284,721	ILS 1,314,600	(10,109)	(0.00)

MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF

投資明細表 2021年6月30日現在(続き)

金融デリバティブ商品(続き)

未決済先渡為替契約* ((0.89)%) (2020年12月31日: 0.60%) (続き)

決済日	購入額	売却額	未実現利益 ／(損失) (米ドル)	ファンド (%)
02/07/2021	GBP 76,597	JPY 11,657,000	787	0.00
02/07/2021	GBP 104,806	JPY 16,115,000	(409)	(0.00)
02/07/2021	GBP 70,055	JPY 10,860,100	(1,070)	(0.00)
02/07/2021	GBP 79,523	JPY 12,345,000	(1,369)	(0.00)
02/07/2021	GBP 274,357	JPY 42,286,600	(1,984)	(0.00)
02/07/2021	GBP 384,899	JPY 59,311,000	(2,662)	(0.00)
02/07/2021	GBP 549,240	JPY 85,034,000	(7,393)	(0.00)
02/07/2021	GBP 23,499,665	JPY 3,653,652,700	(455,140)	(0.01)
02/07/2021	GBP 1,280,569	NOK 15,143,800	9,199	0.00
02/07/2021	GBP 30,015	NOK 352,000	558	0.00
02/07/2021	GBP 14,866	NOK 175,300	166	0.00
02/07/2021	GBP 20,566	NOK 246,000	(177)	(0.00)
02/07/2021	GBP 742,204	NZD 1,449,400	12,550	0.00
02/07/2021	GBP 17,351	NZD 34,000	212	0.00
02/07/2021	GBP 12,056	NZD 24,000	(116)	(0.00)
02/07/2021	GBP 1,916,648	SEK 22,587,500	6,604	0.00
02/07/2021	GBP 44,928	SEK 526,000	561	0.00
02/07/2021	GBP 22,182	SEK 261,400	78	0.00
02/07/2021	GBP 8,423	SEK 100,000	(56)	(0.00)
02/07/2021	GBP 30,936	SEK 367,000	(176)	(0.00)
02/07/2021	GBP 8,074	SGD 15,000	(5)	0.00
02/07/2021	GBP 11,228	SGD 21,000	(112)	(0.00)
02/07/2021	GBP 29,670	SGD 55,400	(226)	(0.00)
02/07/2021	GBP 41,622	SGD 78,000	(528)	(0.00)
02/07/2021	GBP 59,194	SGD 111,000	(804)	(0.00)
02/07/2021	GBP 2,548,543	SGD 4,786,200	(39,945)	(0.00)
02/07/2021	GBP 605,504	USD 836,000	473	0.00
02/07/2021	GBP 828,576	USD 1,156,000	(11,364)	(0.00)
02/07/2021	GBP 551,571	USD 779,100	(17,133)	(0.00)
02/07/2021	GBP 2,180,080	USD 3,033,500	(21,829)	(0.00)
02/07/2021	GBP 625,470	USD 886,000	(21,945)	(0.00)
02/07/2021	GBP 3,057,304	USD 4,255,000	(31,487)	(0.00)
02/07/2021	GBP 3,262,000	USD 4,539,921	(33,630)	(0.00)
02/07/2021	GBP 4,305,443	USD 6,100,000	(152,245)	(0.01)
02/07/2021	GBP 184,374,156	USD 262,100,400	(7,396,691)	(0.20)
02/07/2021	HKD 8,036,000	CHF 952,396	4,445	0.00
02/07/2021	HKD 8,912,000	EUR 964,317	4,005	0.00
02/07/2021	HKD 11,423,000	USD 1,470,973	(45)	(0.00)
02/07/2021	ILS 337,000	CHF 95,136	500	0.00
02/07/2021	ILS 374,000	EUR 96,389	469	0.00
02/07/2021	ILS 479,000	USD 146,926	74	0.00
02/07/2021	JPY 937,445,000	CHF 7,792,657	15,793	0.00
02/07/2021	JPY 45,392,800	CHF 375,438	2,816	0.00
02/07/2021	JPY 15,383,000	CHF 127,285	896	0.00
02/07/2021	JPY 1,039,651,000	EUR 7,890,287	9,973	0.00
02/07/2021	JPY 1,332,483,000	USD 12,034,792	(29,359)	(0.00)
02/07/2021	NOK 3,886,000	CHF 416,129	1,402	0.00

MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF

投資明細表 2021年6月30日現在 (続き)

金融デリバティブ商品 (続き)

未決済先渡為替契約* ((0.89)%) (2020年12月31日: 0.60%) (続き)

決済日		購入額		売却額	未実現利益 ／ (損失) (米ドル)	ファンド (%)
02/07/2021	NOK	4,309,000	EUR	421,276	1,153	0.00
02/07/2021	NOK	5,523,000	USD	642,613	(791)	(0.00)
02/07/2021	NZD	372,000	CHF	239,362	984	0.00
02/07/2021	NZD	412,000	EUR	242,048	840	0.00
02/07/2021	NZD	529,000	USD	369,842	(204)	(0.00)
02/07/2021	SEK	5,795,000	CHF	625,700	700	0.00
02/07/2021	SEK	6,427,000	EUR	633,559	169	0.00
02/07/2021	SEK	8,238,000	USD	966,456	(3,190)	(0.00)
02/07/2021	SGD	1,228,000	CHF	839,361	5,499	0.00
02/07/2021	SGD	1,362,000	EUR	849,960	5,274	0.00
02/07/2021	SGD	1,746,000	USD	1,296,719	2,195	0.00
02/07/2021	USD	19,706,212	AUD	25,454,500	596,241	0.02
02/07/2021	USD	441,944	AUD	573,800	11,164	0.00
02/07/2021	USD	159,824	AUD	206,000	5,169	0.00
02/07/2021	USD	114,110	AUD	147,000	3,750	0.00
02/07/2021	USD	96,789	AUD	126,000	2,194	0.00
02/07/2021	USD	48,060	AUD	62,000	1,514	0.00
02/07/2021	USD	40,914	AUD	52,800	1,274	0.00
02/07/2021	USD	33,973	AUD	44,000	940	0.00
02/07/2021	USD	34,688	AUD	45,000	905	0.00
02/07/2021	USD	27,848	AUD	36,000	821	0.00
02/07/2021	USD	26,942	AUD	36,000	(85)	(0.00)
02/07/2021	USD	40,386,209	CAD	48,792,800	983,156	0.03
02/07/2021	USD	905,594	CAD	1,099,900	17,360	0.00
02/07/2021	USD	326,162	CAD	394,000	7,983	0.00
02/07/2021	USD	234,620	CAD	282,000	6,889	0.00
02/07/2021	USD	198,678	CAD	242,000	3,249	0.00
02/07/2021	USD	98,660	CAD	119,000	2,561	0.00
02/07/2021	USD	83,718	CAD	101,200	1,993	0.00
02/07/2021	USD	69,224	CAD	84,000	1,389	0.00
02/07/2021	USD	57,905	CAD	70,000	1,376	0.00
02/07/2021	USD	71,434	CAD	87,000	1,176	0.00
02/07/2021	USD	56,223	CAD	70,000	(306)	(0.00)
02/07/2021	USD	33,272,130	CHF	29,899,900	925,184	0.02
02/07/2021	USD	67,249,000	CHF	61,892,012	291,666	0.01
02/07/2021	USD	3,256,300	CHF	2,983,259	28,887	0.00
02/07/2021	USD	750,268	CHF	674,000	21,107	0.00
02/07/2021	USD	1,104,000	CHF	1,012,059	9,113	0.00
02/07/2021	USD	269,635	CHF	242,000	7,830	0.00
02/07/2021	USD	193,367	CHF	173,000	6,209	0.00
02/07/2021	USD	164,795	CHF	148,000	4,682	0.00
02/07/2021	USD	81,302	CHF	73,000	2,328	0.00
02/07/2021	USD	69,233	CHF	62,000	2,158	0.00
02/07/2021	USD	58,980	CHF	53,000	1,642	0.00
02/07/2021	USD	56,748	CHF	51,000	1,574	0.00
02/07/2021	USD	47,837	CHF	43,000	1,318	0.00
02/07/2021	USD	46,608	CHF	43,000	89	0.00

MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF

投資明細表 2021年6月30日現在(続き)

金融デリバティブ商品(続き)

未決済先渡為替契約* ((0.89)%) (2020年12月31日: 0.60%) (続き)

決済日		購入額		売却額	未実現利益 ／(損失) (米ドル)	ファンド (%)
02/07/2021	USD	19,375,049	DKK	117,805,200	587,989	0.02
02/07/2021	USD	432,612	DKK	2,655,500	9,124	0.00
02/07/2021	USD	156,087	DKK	952,000	4,266	0.00
02/07/2021	USD	112,349	DKK	682,000	3,587	0.00
02/07/2021	USD	95,260	DKK	584,000	2,126	0.00
02/07/2021	USD	40,037	DKK	244,200	1,093	0.00
02/07/2021	USD	34,392	DKK	211,000	743	0.00
02/07/2021	USD	32,946	DKK	202,000	732	0.00
02/07/2021	USD	27,654	DKK	169,000	703	0.00
02/07/2021	USD	26,790	DKK	168,000	(2)	0.00
02/07/2021	USD	125,555,217	EUR	102,630,700	3,845,409	0.10
02/07/2021	USD	74,581,000	EUR	62,668,264	262,668	0.01
02/07/2021	USD	2,802,562	EUR	2,313,400	59,099	0.00
02/07/2021	USD	1,010,758	EUR	829,000	27,647	0.00
02/07/2021	USD	727,766	EUR	594,000	23,341	0.00
02/07/2021	USD	617,425	EUR	509,000	13,802	0.00
02/07/2021	USD	304,111	EUR	249,000	8,822	0.00
02/07/2021	USD	259,443	EUR	212,800	7,083	0.00
02/07/2021	USD	221,840	EUR	183,000	4,820	0.00
02/07/2021	USD	213,460	EUR	176,000	4,742	0.00
02/07/2021	USD	178,888	EUR	147,000	4,560	0.00
02/07/2021	USD	174,321	EUR	147,000	(7)	0.00
02/07/2021	USD	26,446,381	GBP	18,603,800	746,158	0.02
02/07/2021	USD	592,408	GBP	419,400	13,027	0.00
02/07/2021	USD	212,521	GBP	150,000	5,304	0.00
02/07/2021	USD	153,060	GBP	108,000	3,863	0.00
02/07/2021	USD	129,611	GBP	92,000	2,518	0.00
02/07/2021	USD	63,744	GBP	45,000	1,579	0.00
02/07/2021	USD	54,621	GBP	38,600	1,297	0.00
02/07/2021	USD	45,184	GBP	32,000	978	0.00
02/07/2021	USD	38,266	GBP	27,000	967	0.00
02/07/2021	USD	46,543	GBP	33,000	956	0.00
02/07/2021	USD	37,278	GBP	27,000	(21)	(0.00)
02/07/2021	USD	8,394,810	HKD	65,151,100	5,375	0.00
02/07/2021	USD	189,248	HKD	1,468,600	138	0.00
02/07/2021	USD	67,797	HKD	526,000	64	0.00
02/07/2021	USD	48,592	HKD	377,000	47	0.00
02/07/2021	USD	41,613	HKD	323,000	21	0.00
02/07/2021	USD	841,789	ILS	2,734,400	2,630	0.00
02/07/2021	USD	69,488,712	JPY	7,600,049,900	1,013,624	0.03
02/07/2021	USD	1,560,962	JPY	171,315,600	17,439	0.00
02/07/2021	USD	561,864	JPY	61,397,000	8,688	0.00
02/07/2021	USD	402,241	JPY	43,995,000	5,854	0.00
02/07/2021	USD	342,581	JPY	37,708,000	2,838	0.00
02/07/2021	USD	168,583	JPY	18,475,000	2,127	0.00
02/07/2021	USD	144,012	JPY	15,756,500	2,048	0.00
02/07/2021	USD	99,420	JPY	10,886,000	1,339	0.00

MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF

投資明細表 2021年6月30日現在(続き)

金融デリバティブ商品(続き)

未決済先渡為替契約* ((0.89)%) (2020年12月31日: 0.60%) (続き)

決済日		購入額		売却額	未実現利益 ／(損失) (米ドル)	ファンド (%)
02/07/2021	USD	123,569	JPY	13,584,000	1,179	0.00
02/07/2021	USD	118,579	JPY	13,040,000	1,091	0.00
02/07/2021	USD	98,578	JPY	10,866,000	678	0.00
02/07/2021	USD	3,786,684	NOK	31,501,000	125,990	0.00
02/07/2021	USD	85,138	NOK	710,100	2,618	0.00
02/07/2021	USD	30,685	NOK	254,000	1,168	0.00
02/07/2021	USD	21,945	NOK	182,000	795	0.00
02/07/2021	USD	2,194,754	NZD	3,015,000	88,023	0.00
02/07/2021	USD	48,469	NZD	68,000	954	0.00
02/07/2021	USD	5,667,478	SEK	46,984,800	173,561	0.00
02/07/2021	USD	127,362	SEK	1,059,100	3,522	0.00
02/07/2021	USD	45,986	SEK	380,000	1,553	0.00
02/07/2021	USD	32,967	SEK	272,000	1,163	0.00
02/07/2021	USD	27,966	SEK	233,000	721	0.00
02/07/2021	USD	7,536,222	SGD	9,955,900	129,661	0.00
02/07/2021	USD	169,193	SGD	224,400	2,253	0.00
02/07/2021	USD	60,446	SGD	80,000	931	0.00
02/07/2021	USD	43,899	SGD	58,000	751	0.00
02/07/2021	USD	36,905	SGD	49,000	452	0.00
未決済先渡為替契約に係る未実現利益					11,013,009	0.27
未決済先渡為替契約に係る未実現(損失)					(43,726,737)	(1.16)
未決済先渡為替契約に係る未実現純(損失)					(32,713,728)	(0.89)

先物契約(0.00%) (2020年12月31日: 0.01%)

原契約	取引相手	総額エクスポージャー	数量	未実現利益 ／(損失) (米ドル)	資産合計に 占める割合 (%)
Euro Stoxx 50 17/09/2021	UBS AG	1,515,551	31	(24,632)	(0.00)
FTSE 100 Index Fut 17/09/2021	UBS AG	587,213	6	(8,620)	(0.00)
S&P 500 E-Mini Index Futures 17/09/2021	UBS AG	4,236,550	20	52,050	0.00
Topix Index Futures 09/09/2021	UBS AG	1,057,663	6	(7,298)	(0.00)
先物契約に係る未実現利益		4,236,550	20	52,050	0.00
先物契約に係る未実現(損失)		3,160,427	43	(40,550)	(0.00)
先物契約に係る未実現純利益				11,500	0.00

金融デリバティブ商品合計	(32,702,228)	(0.89)
--------------	--------------	--------

	公正価値 (米ドル)	資産合計に 占める割合 (%)
損益を通じて公正価値で測定する金融資産	3,669,140,959	99.75
その他純資産	9,159,126	0.25
純資産合計	3,678,300,085	100.00

MSCI ACWI ソーシャル・レスポンシブル UCITS ETF

投資明細表 2021年6月30日現在(続き)

資産合計の内訳	資産合計に 占める割合 (%)
公認の証券取引所に上場している譲渡可能有価証券	99.24
規制市場で取引される金融デリバティブ商品	0.00
店頭金融デリバティブ商品	0.27
流動資産	0.49
	100.00

* 未決済先渡為替契約の取引相手方は、バンク・オブ・アメリカ、カナダ帝国商業銀行、シティバンク、ゴールドマン・サックス・インターナショナル、モルガン・スタンレーおよびステート・ストリート・バンク・ロンドンである。

② 株式以外の投資有価証券明細表

「（２）投資有価証券明細表等」の「① 投資株式明細表」を参照のこと。

③ 投資不動産明細表

該当なし

④ その他投資資産明細表

該当なし

⑤ 借入金明細表

該当なし

[次へ](#)

5 販売及び買戻しの実績

2021年6月末日前1年間における販売および買戻しの実績ならびに2021年6月末日現在の発行済口数は以下のとおりである。

(MSCI ACWI ソーシャルリー・レスポンシブル UCITS ETF)

クラス	販売口数	買戻し口数	発行済口数
クラス (米ドルヘッジ) A-acc投資証券	45,316,071 (74,150)	14,096,045 (0)	61,023,655 (74,150)

(注) () 内の数字は日本における販売会社を取り扱った売買取引口数および日本における販売会社が保管する口数である。

[次へ](#)

(2) その他の記載事項の訂正

(注) 下線または傍線部は訂正部分を示します。

第一部 証券情報

第1 外国投資証券(外国新投資口予約権証券及び外国投資法人債券を除く。)

(10) 申込取扱場所

<訂正前>

UBS証券株式会社^(※) 東京都千代田区丸の内一丁目4番1号
丸の内永楽ビルディング
ホームページ・アドレス www.ubs.com/jp/ja
電話番号 0120-073-533

(以下「UBS証券」または「日本における販売会社」という。)

(注) 上記販売会社の本支店において申込みの取扱いを行う。

(※) UBS証券株式会社のウェルス・マネジメント本部の事業が会社分割され、2021年8月10日からは分割先であるUBS SuMi TRUSTウェルス・マネジメント株式会社が承継した業務を開始する予定である。このため、同日以降、本書におけるUBS証券株式会社に関する記載は、UBS SuMi TRUSTウェルス・マネジメント株式会社と読み替えられるものとする。また、申込取扱場所は、以下の通り変更となる予定である。以下同じ。

UBS SuMi TRUSTウェルス・マネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内一丁目4番1号

丸の内永楽ビルディング

電話番号 03-5293-3100

ホームページ・アドレス <https://www.ubs-sumitrust.com/>

(以下「UBS SuMi TRUST」または「日本における販売会社」という。)

(注) 上記日本における販売会社の本支店において申込みの取扱いを行う。

<訂正後>

UBS証券株式会社^(※) 東京都千代田区丸の内一丁目4番1号
丸の内永楽ビルディング
ホームページ・アドレス www.ubs.com/jp/ja
電話番号 0120-073-533

(以下「UBS証券」または「日本における販売会社」という。)

(注) 上記販売会社の本支店において申込みの取扱いを行う。

(※) UBS証券株式会社のウェルス・マネジメント本部の事業が会社分割され、2021年8月10日からは分割先であるUBS SuMi TRUSTウェルス・マネジメント株式会社が承継した業務を開始した。このため、同日以降、本書におけるUBS証券株式会社に関する記載は、UBS SuMi TRUSTウェルス・マネジメント株式会社と読み替えられるものとする。また、申込取扱場所は、以下の通り変更となった。以下同じ。

UBS SuMi TRUSTウェルス・マネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内一丁目4番1号

丸の内永楽ビルディング

電話番号 03-5293-3100

ホームページ・アドレス <https://www.ubs-sumitrust.com/>

(以下「UBS SuMi TRUST」または「日本における販売会社」という。)

(注) 上記日本における販売会社の本支店において申込みの取扱いを行う。

(12) 払込取扱場所

<訂正前>

UBS証券会社 東京都千代田区大手町一丁目2番1号
Otemachi Oneタワー

日本における現金による申込みおよび買戻しは、日本の投資主を代表してUBS証券が、下記のとおり取引期限前の営業日に受理する。認定参加者は、かかる申込みを管理事務代行会社に行い、当該取引日に係る評価時点における投資証券1口当たり純資産価格で当該申込みの手続きを行う。

(注)「取引期限」とは、関連する取引日の1営業日前の午後4時(ダブリン時間)をいう。

(※)2021年8月10日以降、払込取扱場所は、以下の通り変更となる予定である。以下同じ。

UBS SuMi TRUSTウェルス・マネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内一丁目4番1号

丸の内永楽ビルディング

<訂正後>

UBS証券会社

東京都千代田区大手町一丁目2番1号

Otemachi Oneタワー

日本における現金による申込みおよび買戻しは、日本の投資主を代表してUBS証券が、下記のとおり取引期限前の営業日に受理する。認定参加者は、かかる申込みを管理事務代行会社に行い、当該取引日に係る評価時点における投資証券1口当たり純資産価格で当該申込みの手続きを行う。

(注)「取引期限」とは、関連する取引日の1営業日前の午後4時(ダブリン時間)をいう。

(※)2021年8月10日以降、払込取扱場所は、以下の通り変更となった。以下同じ。

UBS SuMi TRUSTウェルス・マネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内一丁目4番1号

丸の内永楽ビルディング

第三部 外国投資法人の詳細情報

第4 関係法人の状況

2 その他の関係法人の概況

(1) 名称、資本金の額及び事業の内容

<訂正前>

(前略)

④ UBS証券株式会社(「代行協会員」「日本における販売会社」)

a. 資本金(株主資本)の額

2021年4月末日現在、321億円

b. 事業の内容

金融商品取引法に基づき、日本における金融商品取引業者としての業務を行う。

(※)UBS証券株式会社のウェルス・マネジメント本部の事業が会社分割され、2021年8月10日からは分割先であるUBS SuMi TRUSTウェルス・マネジメント株式会社が承継した業務を開始する予定である。このため、同日以降、本書におけるUBS証券株式会社に関する記載は、UBS SuMi TRUSTウェルス・マネジメント株式会社と読み替えられるものとする。分割先の商号、資本金の額および事業の内容は、以下のとおりである。

UBS SuMi TRUSTウェルス・マネジメント株式会社

a. 資本金(株主資本)の額

2021年6月末日現在、5,000万円

b. 事業の内容

金融商品取引法に基づき、日本における金融商品取引業者としての業務を行う。

<訂正後>

(前略)

④ UBS証券株式会社(「代行協会員」「日本における販売会社」)

a. 資本金(株主資本)の額

2021年4月末日現在、321億円

b. 事業の内容

金融商品取引法に基づき、日本における金融商品取引業者としての業務を行う。

(※) UBS証券株式会社のウェルス・マネジメント本部の事業が会社分割され、2021年8月10日からは分割先であるUBS SuMi TRUSTウェルス・マネジメント株式会社が承継した業務を開始した。このため、同日以降、本書におけるUBS証券株式会社に関する記載は、UBS SuMi TRUSTウェルス・マネジメント株式会社と読み替えられるものとする。分割先の商号、資本金の額および事業の内容は、以下のとおりである。

UBS SuMi TRUSTウェルス・マネジメント株式会社

a. 資本金(株主資本)の額

2021年8月10日現在、5,165百万円

b. 事業の内容

金融商品取引法に基づき、日本における金融商品取引業者としての業務を行う。

交付目論見書の概要

<訂正前>

(前略)

日本における 販売会社	UBS証券株式会社 (※) UBS証券株式会社のウェルス・マネジメント本部の事業が会社分割され、2021年8月10日からは分割先であるUBS SuMi TRUSTウェルス・マネジメント株式会社が承継した業務を開始する予定です。
----------------	---

(後略)

<訂正後>

(前略)

日本における 販売会社	UBS証券株式会社 (※) UBS証券株式会社のウェルス・マネジメント本部の事業が会社分割され、2021年8月10日からは分割先であるUBS SuMi TRUSTウェルス・マネジメント株式会社が承継した業務を開始しました。
----------------	---

(後略)