

*当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | | |
|--------|---|--|
| 商品分類 | 追加型投信／内外／株式 | |
| 信託期間 | 信託設定日（2021年5月21日）から原則として無期限 | |
| 運用方針 | この投資信託は、先進的な技術やサービスで気候変動問題への対応を行う企業や低炭素社会実現を牽引する企業の株式を中心に実質的に投資を行うことにより、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。 | |
| 主要運用対象 | ペピーファンド | <UBS気候変動関連グローバル成長株式ファンド（年4回決算・予想分配金提示型）> UBS気候変動関連グローバル成長株式マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 |
| | マザーファンド | <UBS気候変動関連グローバル成長株式マザーファンド> 先進的な技術やサービスで気候変動問題への対応を行う企業や低炭素社会実現を牽引する企業の株式を中心に投資を行います。 |
| 組入制限 | ペピーファンド | マザーファンドへの投資割合には制限を設けません。 |
| | マザーファンド | 株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 |
| 分配方針 | P.4の「分配方針」をご覧ください。 | |

UBS

気候変動関連グローバル成長株式ファンド (年4回決算・予想分配金提示型)

愛称：クールアース

運用報告書（全体版）（第3作成期）

第4期 決算日 2022年5月20日
第5期 決算日 2022年8月22日

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、「UBS気候変動関連グローバル成長株式ファンド（年4回決算・予想分配金提示型）」は、去る8月22日に第5期の決算を行いましたので、第4期～第5期（第3作成期）の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、
お願い申し上げます。

UBSアセット・マネジメント株式会社

東京都千代田区大手町一丁目2番1号

Otemachi Oneタワー

<お問い合わせ先>

投信営業部

03-5293-3700

<受付時間>

営業日の午前9時～午後5時、土、日、祝日除く

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

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

設定以来の運用実績

| 作成期 | 決算期(決算日) | 基準価額 (分配落) | 税込み 分配金 | 期騰落率 | 株式組入比 | 株式先物比率 | 投資信託証券比率 | 純資産額 |
|-------|---------------------|---------------|------------|--------|--------|--------|----------|-----------|
| 第1作成期 | (設定日) 2021年5月21日 | 円 10,000 | 円 - | % - | % - | % - | % - | 百万円 10 |
| | 1期(2021年8月20日) | 10,232 | 250 | 4.8 | 95.3 | - | 2.0 | 674 |
| 第2作成期 | 2期(2021年11月22日) | 10,762 | 500 | 10.1 | 92.0 | - | 2.2 | 943 |
| | 3期(2022年2月21日) | 9,618 | 0 | △10.6 | 96.1 | - | 1.4 | 1,073 |
| 第3作成期 | 4期(2022年5月20日) | 9,130 | 0 | △5.1 | 96.6 | - | 0.8 | 992 |
| | 5期(2022年8月22日) | 10,283 | 0 | 12.6 | 93.5 | - | 0.9 | 1,120 |

(注1) 基準価額は1万口当たり。基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注3) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

(注4) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「投資信託証券比率」は実質比率を記載しております。

(注5) 株式先物比率は買建比率－売建比率。

(注6) 当ファンドの投資対象市場の値動きを示す適切な指標がないため、運用の目標となるベンチマークや投資対象資産の市場動向を説明する代表的な指標（参考指標）はありません。

当作成期中の基準価額等の推移

| 決算期 | 年月日 | 基 準 価 額 | | 株式組入比 | 株式先物比率 | 投資信託証券比率 |
|-----|--------------------|------------|--------|-----------|--------|----------|
| | | | 騰落率 | | | |
| 第4期 | (期首) 2022年2月21日 | 円 9,618 | % - | % 96.1 | % - | % 1.4 |
| | 2月末 | 9,518 | △1.0 | 96.2 | - | 1.4 |
| | 3月末 | 10,280 | 6.9 | 97.8 | - | 1.3 |
| | 4月末 | 9,727 | 1.1 | 98.0 | - | 1.1 |
| | (期末) 2022年5月20日 | 9,130 | △5.1 | 96.6 | - | 0.8 |
| 第5期 | (期首) 2022年5月20日 | 9,130 | - | 96.6 | - | 0.8 |
| | 5月末 | 9,782 | 7.1 | 97.3 | - | 0.8 |
| | 6月末 | 9,525 | 4.3 | 97.9 | - | 0.9 |
| | 7月末 | 9,858 | 8.0 | 97.0 | - | 0.9 |
| | (期末) 2022年8月22日 | 10,283 | 12.6 | 93.5 | - | 0.9 |

(注1) 基準価額は1万口当たりです。

(注2) 謄落率は期首比です。

(注3) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「投資信託証券比率」は実質比率を記載しております。

運用経過

基準価額等の推移について

(2022年2月21日～2022年8月22日)



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

当作成期の基準価額は665円値上がりしました。なお、基準価額の騰落率は+6.9%となりました。

基準価額の主な変動要因

当ファンドの基準価額の上昇要因は、組入れていたマザーファンドの基準価額が上昇したことです。マザーファンドの基準価額は、株式市場が全般に下落する中でも、米ドルやユーロなど多くの通貨が対円で上昇したことが主なプラス要因となり、前作成期末比で上昇しました。

投資環境について

当成期のグローバル株式市場は下落しました。作成期の序盤、ロシアのウクライナ侵攻と共に伴う資源価格の高騰などを嫌気して、グローバル株式市場は下落基調で始まりました。その後、ウクライナ情勢の改善期待などを背景に、株価は一時持ち直す局面もありましたが、インフレ高進と金融引き締めの加速観測から再び下落に転じました。6月半ば以降は、値ごろ感から買い戻しの動きが見られた上、米国の利上げ加速観測の後退も下支えとなり、株価は回復基調に転じました。

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

ポートフォリオについて

当ファンドのポートフォリオについて

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、気候変動問題への対応に優れ、低炭素社会への長期的な移行から恩恵を受けると判断される世界各国の企業の株式を中心に実質的な投資を行つていまいりました。マザーファンドの組入れは、作成期を通じて高位に維持しました。

マザーファンドのポートフォリオについて

当ファンドは、気候変動問題への対応に優れ、低炭素社会への長期的な移行から恩恵を受けると判断される世界各国の企業の株式を中心に投資を行いました。

●期中の主な動き

当ファンドの投資対象である「炭素削減技術を有する企業（ソリューション・プロバイダー企業）」および「事業活動を通じて脱炭素社会を実現する企業（リーディング企業）」に幅広く、かつバランスよく投資を行いました。

(1) 投資比率を引き上げた主な業種・銘柄

コミュニケーション・サービスでは、企業向けクラウドサービスの提供を通じ、環境負荷の可視化にも取り組む米アルファベットについて、また公益事業では、植物由来の燃料の使用によるCO₂排出量の正味ゼロの実現と、排ガスからのCO₂回収に注力する英大手電力会社、ドラッグストアの新規組み入れ等により、それぞれセクターウェイトを引き上げました。

(2) 投資比率を引き下げた主な業種・銘柄

資本財・サービスでは、鉄道車両や商用車向けブレーキシステムを主力とする独クノール・ブルムゼや、産業用施設向け冷暖房・換気制御システム等を手掛ける蘭アルバーツについて、また金融では、グループ全体で温暖化ガス排出量削減に積極的に取り組む仏銀行大手のソシエテ・ジェネラルをそれぞれ全売却とすることにより、セクターウェイトを引き下げました。3社とも、インフレ圧力と景気後退懸念の高まる欧州への依存度の高さを踏まえての判断です。

※ソリューション・プロバイダー企業、およびリーディング企業の分類は、当ファンドの運用方針に基づき当社が独自に分類したものです。

ベンチマークとの差異について

当ファンドの投資対象市場の値動きを示す適切な指標がないため、運用の目標となるベンチマークや投資対象資産の市場動向を説明する代表的な指標（参考指標）はありません。

分配金について

基準価額の水準や市況動向等を勘案し、第4期、第5期ともに分配を行いませんでした。分配にあてなかった利益については、運用の基本方針に基づいて元本部分と同一の運用を行います。

分配方針

毎決算時（毎年2月、5月、8月、11月の20日。ただし、休業日の場合は翌営業日とします。）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）および売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額をいいます。）等の全額とします。

②収益分配金額は、原則として、上記の分配対象額の範囲内で、以下の方針に基づき分配します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。また、計算期末の前営業日から当該計算期末までに基準価額*が急激に変動した場合等には、下記の分配を行わないことがあります。

*基準価額は1万口当たりとし、既払分配金を加算しません。

<計算期末の前営業日の基準価額> <分配金額（1万口当たり、税引き前）>

| | 配当等収益相当分（経費控除後）の範囲内 |
|--------------------|---------------------|
| 10,500円未満 | |
| 10,500円以上11,000円未満 | 250円 |
| 11,000円以上11,500円未満 | 500円 |
| 11,500円以上12,000円未満 | 750円 |
| 12,000円以上 | 1,000円 |

*基準価額に応じて、毎月の分配金額は変動します。基準価額が上記の一定水準に一度でも到達すれば、その水準に応じた分配を継続するというものではありません。

*分配金を支払うことにより基準価額は下落します。このため、基準価額に影響を与え、次期以降の分配金額は変動する場合があります。また、あらかじめ一定の分配金額を保証するものではありません。

③収益の分配にあてなかった利益については、運用の基本方針に基づいて元本部分と同一の運用を行います。

分配原資の内訳

(1万口当たり・税引前)

| 項目 | 第4期 | 第5期 |
|--------------------|---------------------------|---------------------------|
| | 2022年2月22日～ 2022年5月20日 | 2022年5月21日～ 2022年8月22日 |
| 当期分配金 (対基準価額比率) | －円 (- %) | －円 (- %) |
| 当期の収益 | －円 | －円 |
| 当期の収益以外 | －円 | －円 |
| 翌期繰越分配対象額 | 391円 | 442円 |

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

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

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

今後の運用方針

投資環境の見通し

株式市場は軟調な展開を予想します。米国では、米連邦準備制度理事会（FRB）の積極利上げ姿勢が米国株式の上値を抑制しており、実質金利が上昇する中で弱い地合いが続くと見てています。今後の利上げ軌道は物価・雇用等のデータ次第とみられますが、消費者や企業に痛みを伴う金融引き締めが継続し、株価の重石となりそうです。欧州では、高インフレの深刻化や欧州中央銀行（ECB）による積極的なインフレ抑制姿勢への警戒が一段と強まっており、欧州の景気および企業業績の悪化が危惧されています。また、エネルギー供給不安に加え、英国やイタリアでの政治イベントの行方も、欧州株式の変動を高める可能性があります。

当ファンドの今後の運用方針

今後も引き続きマザーファンドを高位に組入れ、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

マザーファンドの今後の運用方針

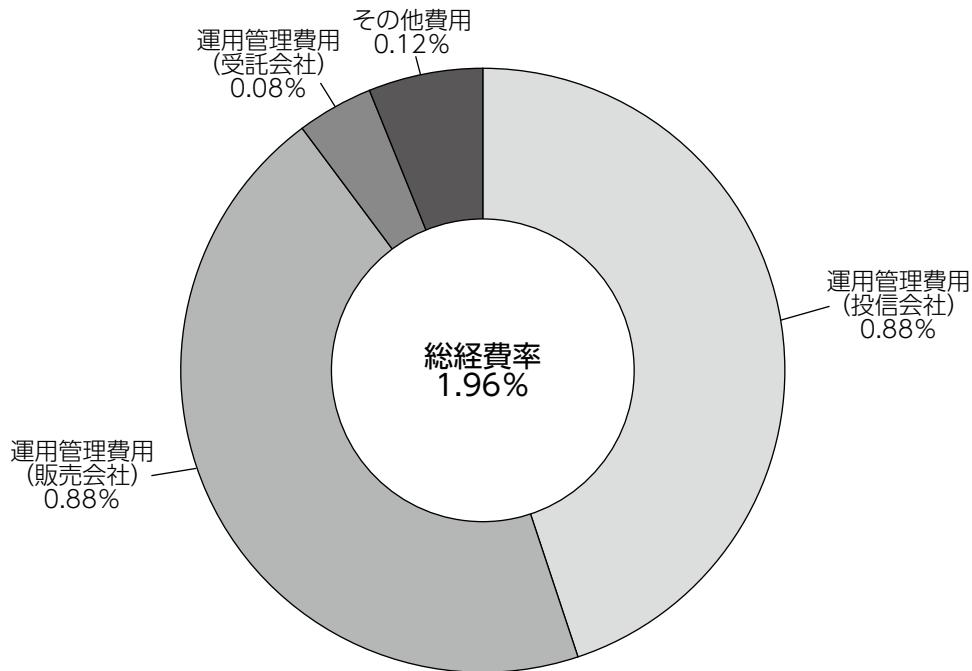
引き続き、気候変動問題への対応に優れ、低炭素社会への長期的な移行から恩恵を受けると判断される世界各国の企業の株式を中心に、投資を行ってまいります。

1万口当たりの費用明細

| 項目 | 第4期～第5期 2022/2/22～2022/8/22 | | 項目の概要 |
|----------|--------------------------------|---------|--|
| | 金額 | 比率 | |
| 信託報酬 | 90円 | 0.916% | 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 ※期中の平均基準価額（月末値の平均）は9,781円です。 |
| (投信会社) | (43) | (0.439) | 委託した資金の運用の対価 |
| (販売会社) | (43) | (0.439) | 運用報告書等各種書類の交付、口座内でのファンドに係る管理、購入後の情報提供等の対価 |
| (受託会社) | (4) | (0.038) | 運用財産の管理、運用指図実行等の対価 |
| 売買委託手数料 | 1 | 0.011 | 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 |
| (株式) | (1) | (0.011) | 株式などを取引所で売買する際に売買仲介人に支払う手数料 |
| (投資信託証券) | (0) | (0.000) | 投資信託証券を取引所で売買する際に売買仲介人に支払う手数料 |
| 有価証券取引税 | 1 | 0.009 | 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 |
| (株式) | (1) | (0.009) | 有価証券売買の都度発生する取引に関する税金 |
| (投資信託証券) | (0) | (0.000) | |
| その他費用 | 6 | 0.061 | その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| (保管費用) | (2) | (0.019) | 海外保管銀行等に支払う海外資産等の保管・送金・受渡等に係る費用 |
| (監査費用) | (1) | (0.012) | 監査法人等に支払うファンド監査に係る費用 |
| (印刷費用等) | (2) | (0.029) | 法定開示書類作成の際に業者に支払う作成・印刷・交付等に係る費用（EDINET含む）等 |
| (その他) | (0) | (0.002) | 受益権の管理事務に関連する費用等 |
| 合計 | 98 | 0.997 | |

- (注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は、追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。
- (注2) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しております。
- (注3) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しております。

(参考情報) 総経費率



(注1) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注2) 各比率は、年率換算した値です。

(注3) 上記の費用は、1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

当分成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.96%です。

親投資信託受益証券の設定、解約状況（自 2022年2月22日 至 2022年8月22日）

| | 第 4 期 ～ 第 5 期 | | | |
|---------------------------|---------------|--------------|--------------|--------------|
| | 設 定 | | 解 約 | |
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| UBS気候変動関連グローバル成長株式マザーファンド | 千口 12,995 | 千円 18,000 | 千口 57,726 | 千円 78,300 |

(注) 単位未満は切り捨て。

親投資信託の株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 第 4 期 ～ 第 5 期 |
|-------------------------------|---------------------------|
| | UBS気候変動関連グローバル成長株式マザーファンド |
| (a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額 | 1,446,118千円 |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 4,983,708千円 |
| (c) 売 買 高 比 率 (a)/(b) | 0.29 |

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

利害関係人等との取引状況等（自 2022年2月22日 至 2022年8月22日）

当作成期中の利害関係人等との取引はありません。

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

組入資産明細表

親投資信託残高

(2022年8月22日現在)

| 項 目 | 第 2 作 成 期 末 | | | 第 3 作 成 期 末 (第 5 期 末) | |
|---------------------------|-------------|---------------|-----------------|-----------------------|-------|
| | □ 数 | 千 口 | □ 数 | 千 口 | 評 価 額 |
| UBS気候変動関連グローバル成長株式マザーファンド | 790,262 | 千円 745,531 | 千円 1,087,506 | | |

(注) □数・評価額の単位未満は切り捨て。

投資信託財産の構成

(2022年8月22日現在)

| 項 目 | 第3作成期末 (第5期末) | |
|---------------------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| UBS気候変動関連グローバル成長株式マザーファンド | 千円 1,087,506 | % 96.6 |
| コール・ローン等、その他 | 38,278 | 3.4 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 1,125,784 | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切り捨て。

(注2) UBS気候変動関連グローバル成長株式マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建て純資産（5,048,944千円）の投資信託財産総額（5,214,951千円）に対する比率は96.8%です。

(注3) 外貨建資産は、当作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1オフショア元=20.0572円、1米ドル=137.17円、1カナダ・ドル=105.48円、1ブラジル・レアル=26.532円、1ユーロ=137.55円、1イギリス・ポンド=162.08円、1スイス・フラン=142.96円、1スウェーデン・クローネ=12.95円、1ノルウェー・クローネ=13.95円、1デンマーク・クローネ=18.50円、1香港ドル=17.48円、100韓国ウォン=10.26円、1新台湾ドル=4.5679円です。

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年5月20日) (2022年8月22日)

| 項 目 | 第4期 末 | 第5期 末 |
|--------------------------------|----------------|----------------|
| (A) 資 産 | 997,700,597円 | 1,125,784,533円 |
| コール・ローン等 | 5,430,695 | 5,278,225 |
| UBS気候変動関連グローバル成長株式マザーファンド(評価額) | 987,269,902 | 1,087,506,308 |
| 未 収 入 金 | 5,000,000 | 33,000,000 |
| (B) 負 債 | 4,917,055 | 5,365,999 |
| 未 払 解 約 金 | 14,254 | 149,357 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 4,687,848 | 4,983,096 |
| 未 払 利 息 | 15 | 14 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 214,938 | 233,532 |
| (C) 純 資 産 総 額(A - B) | 992,783,542 | 1,120,418,534 |
| 元 本 | 1,087,330,288 | 1,089,540,623 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | △ 94,546,746 | 30,877,911 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 1,087,330,288口 | 1,089,540,623口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 9,130円 | 10,283円 |

(注1) 当ファンドの第4期首先本額は1,115,831,608円、第4～5期中追加設定元本額は30,704,594円、第4～5期中一部解約元本額は56,995,579円です。

(注2) 1口当たり純資産額は、第4期0.9130円、第5期1.0283円です。

損益の状況

第4期 (自2022年2月22日 至2022年5月20日)

第5期 (自2022年5月21日 至2022年8月22日)

| 項 目 | 第4期 | 第5期 |
|---------------------------------------|---|---|
| (A) 配 当 等 収 益 支 払 利 息 | △ 1,384円 △ 1,384 | △ 1,369円 △ 1,369 |
| (B) 有 債 証 券 売 買 損 益 売 買 益 売 買 損 | △ 47,984,076 △ 2,856,128 △ 50,840,204 | 129,832,152 130,592,565 △ 760,413 |
| (C) 信 託 報 酉 等 | △ 4,902,786 | △ 5,216,628 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 52,888,246 | 124,614,155 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | △ 81,301,748 | △ 132,872,055 |
| (F) 追加信託差損益金 (配当等相当額) | △ 39,643,248 (10,782,554) | 39,135,811 (11,201,664) |
| (G) 計 | △ 94,546,746 | 30,877,911 |
| (H) 収 益 分 配 金 | 0 | 0 |
| 次期繰越損益金(G+H) | △ 94,546,746 | 30,877,911 |
| 追加信託差損益金 (配当等相当額) | △ 39,643,248 (10,803,641) | 39,135,811 (11,222,482) |
| (I) (売買損益相当額) | △ 28,860,694 | (27,934,147) |
| (J) 分 配 準 備 積 立 金 | 31,724,351 | 36,937,059 |
| 繰 越 損 益 金 | △ 165,914,345 | △ 45,194,959 |

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

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

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

(注4) 第4期計算期間末における費用控除後の配当等収益(906,377円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(10,803,641円)および分配準備積立金(30,817,974円)より分配対象収益は42,527,992円(10,000口当たり391円)ですが、当計算期間に分配した金額はありません。

(注5) 第5期計算期間末における費用控除後の配当等収益(5,524,293円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(11,222,482円)および分配準備積立金(31,412,766円)より分配対象収益は48,159,541円(10,000口当たり442円)ですが、当計算期間に分配した金額はありません。

UBS気候変動関連グローバル成長株式マザーファンド

第15期（2022年8月22日決算）

(計算期間：2021年8月21日～2022年8月22日)

《運用報告書》

受益者のみなさまへ

「UBS気候変動関連グローバル成長株式マザーファンド」は、<UBS気候変動関連グローバル成長株式ファンド（年4回決算・予想分配金提示型）>が投資対象とする親投資信託で、信託財産の実質的な運用を行っております。

ここにマザーファンドの第15期の運用状況をご報告申し上げます。

*当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|--|
| 運用方針 | この投資信託は、先進的な技術やサービスで気候変動問題への対応を行う企業や低炭素社会実現を牽引する企業の株式を中心に投資を行い、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。 |
| 主要運用対象 | 先進的な技術やサービスで気候変動問題への対応を行う企業や低炭素社会実現を牽引する企業の株式を中心に投資を行います。 |
| 組入制限 | 株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 |

UBSアセット・マネジメント株式会社

東京都千代田区大手町一丁目2番1号
Otemachi Oneタワー

<お問い合わせ先>

投信営業部

03-5293-3700

<受付時間>

営業日の午前9時～午後5時、土、日、祝日除く

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

UBS気候変動関連グローバル成長株式マザーファンド

最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | 期騰落率 | 株式組入率 | 株式先物比率 | 投資信託証券比率 | 純資産額 |
|------------------|---------|--------|--------|--------|----------|-----------|
| 11期 (2018年8月20日) | 円 8,309 | % 11.0 | % 95.7 | % — | % — | 百万円 2,593 |
| 12期 (2019年8月20日) | 7,848 | △ 5.5 | 99.6 | — | — | 2,173 |
| 13期 (2020年8月20日) | 9,714 | 23.8 | 95.3 | — | 1.7 | 2,309 |
| 14期 (2021年8月20日) | 13,612 | 40.1 | 95.8 | — | 2.0 | 4,408 |
| 15期 (2022年8月22日) | 14,587 | 7.2 | 96.3 | — | 0.9 | 5,134 |

(注1) 基準価額は1万口当たりです。

(注2) 株式先物比率は買建比率－売建比率。

(注3) 当ファンドの投資対象市場の値動きを示す適切な指標がないため、運用の目標となるベンチマークや投資対象資産の市場動向を説明する代表的な指数（参考指數）はありません。

当期中の基準価額等の推移

| 年月日 | 基準価額 | 騰落率 | 株式組入率 | 株式先物比率 | 投資信託比率 | |
|---------------------|----------|-------|--------|--------|--------|-----|
| | | | | | 比 | 率 |
| (期首) 2021年 8月20日 | 円 13,612 | % — | % 95.8 | % — | % — | 2.0 |
| 8月末 | 13,996 | 2.8 | 94.8 | — | — | 2.7 |
| 9月末 | 13,745 | 1.0 | 95.9 | — | — | 2.0 |
| 10月末 | 14,675 | 7.8 | 96.6 | — | — | 1.5 |
| 11月末 | 14,563 | 7.0 | 94.3 | — | — | 2.4 |
| 12月末 | 15,099 | 10.9 | 95.2 | — | — | 2.9 |
| 2022年 1月末 | 13,662 | 0.4 | 98.5 | — | — | 1.5 |
| 2月末 | 13,374 | △ 1.7 | 96.7 | — | — | 1.5 |
| 3月末 | 14,473 | 6.3 | 98.1 | — | — | 1.3 |
| 4月末 | 13,712 | 0.7 | 98.2 | — | — | 1.1 |
| 5月末 | 13,814 | 1.5 | 97.8 | — | — | 0.8 |
| 6月末 | 13,472 | △ 1.0 | 98.2 | — | — | 0.9 |
| 7月末 | 13,964 | 2.6 | 97.2 | — | — | 0.9 |
| (期末) 2022年 8月22日 | 14,587 | 7.2 | 96.3 | — | — | 0.9 |

(注1) 基準価額は1万口当たりです。

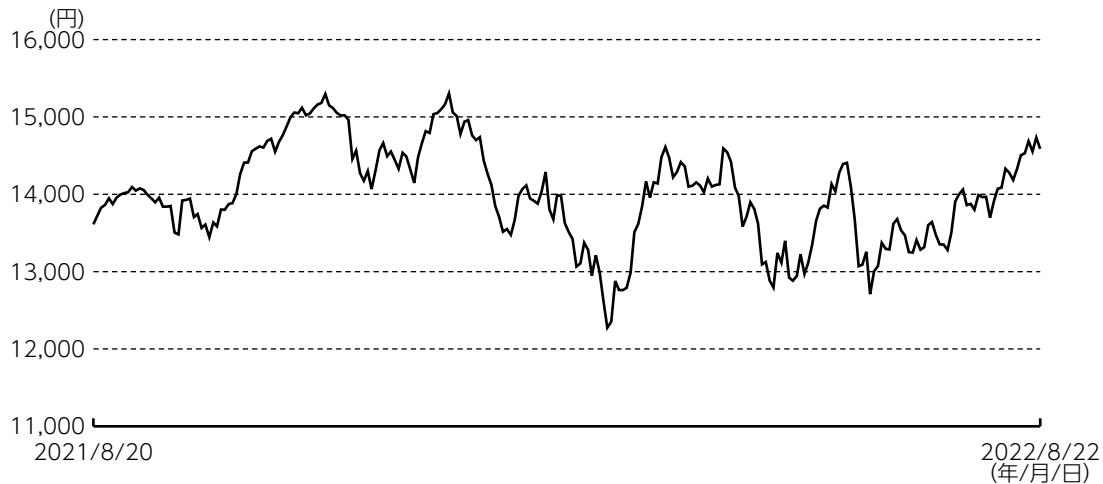
(注2) 謄落率は期首比です。

(注3) 株式先物比率は買建比率－売建比率。

運用経過

基準価額の推移について

(2021年8月20日～2022年8月22日)



基準価額は期首比で975円値上がりしました。なお、基準価額の騰落率は+7.2%となりました。

基準価額の主な変動要因

当ファンドの基準価額は、株式市場が全般に下落する中でも、米ドルやユーロなど多くの通貨が対円で上昇したことが主なプラス要因となり、前期末比で上昇しました。

投資環境について

3ページをご参照ください。

ポートフォリオについて

当ファンドは、気候変動問題への対応に優れ、低炭素社会への長期的な移行から恩恵を受けると判断される世界各国の企業の株式を中心に投資を行いました。

●期中の主な動き

当ファンドの投資対象である「炭素削減技術を有する企業（ソリューション・プロバイダー企業）」および「事業活動を通じて脱炭素社会を実現する企業（リーディング企業）」に幅広く、かつバランスよく投資を行いました。

(1) 投資比率を引き上げた主な業種・銘柄

情報技術では、ネットゼロ目標の実現に向けた明確な工程表の開示を評価する、企業向けデータ解析ソフトの米スプランク、独自開発のCAD（図面設計ソフト）により、設計プロセスの効率化と環境負荷の低減を両立させた米オートデスクの新規組み入れ等により、セクターウェイトを引き上げました。

(2) 投資比率を引き下げた主な業種・銘柄

資本財・サービスでは、鉄道車両や商用車向けブレーキシステムを主力とする独フノール・ブルムゼや、産業用施設向け冷暖房・換気制御システム等を手掛ける蘭アルバーツを全売却する等の取引により、セクターウェイトを引き下げました。インフレ圧力と景気後退懸念の高まる欧州への依存度の高さを踏まえての判断です。

※ソリューション・プロバイダー企業、およびリーディング企業の分類は、当ファンドの運用方針に基づき当社が独自に分類したものです。

ベンチマークとの差異について

当ファンドの投資対象市場の値動きを示す適切な指数がないため、運用の目標となるベンチマークや投資対象資産の市場動向を説明する代表的な指標（参考指標）はありません。

今後の運用方針

投資環境の見通し

5ページをご参照ください。

今後の運用方針

引き続き、気候変動問題への対応に優れ、低炭素社会への長期的な移行から恩恵を受けると判断される世界各国の企業の株式を中心に、投資を行ってまいります。

1万口当たりの費用明細

| 項目 | 当期 2021/8/21～2022/8/22 | | 項目の概要 |
|-----------------------------|---------------------------|------------------------------|---|
| | 金額 | 比率 | |
| 売買委託手数料 (株式) (投資信託証券) | 4円 (3) (0) | 0.025% (0.024) (0.002) | 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 株式などを取引所で売買する際に売買仲介人に支払う手数料 投資信託証券を取り扱う際に売買仲介人に支払う手数料 |
| 有価証券取引税 (株式) (投資信託証券) | 3 (3) (0) | 0.023 (0.023) (0.000) | 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券売買の都度発生する取引に関する税金 |
| その他費用 (保管費用) (その他) | 10 (9) (0) | 0.068 (0.067) (0.001) | その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 海外保管銀行等に支払う海外資産等の保管・送金・受渡等に係る費用 外国株式の配当金に係る手数料等 |
| 合 計 | 17 | 0.116 | |

※期中の平均基準価額は14,045円です。

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

期中の売買及び取引の状況 (自 2021年8月21日 至 2022年8月22日)

(1) 株 式

| | 買付 | | 売付 | |
|---------|----------------|------------------------|---------------|-------------------------|
| | 株数 | 金額 | 株数 | 金額 |
| 国内 | 千株 | 千円 | 千株 | 千円 |
| 上場 | 8 | 48,957 | 6 | 33,430 |
| 外国 | 百株 | | 百株 | |
| アメリカ | 1,563 (60) | 千米ドル 11,883 (-) | 1,931 (-) | 千米ドル 11,200 (57) |
| カナダ | 307 | 千カナダ・ドル 2,267 | 43 | 千カナダ・ドル 198 |
| ブラジル | 350 | 千ブラジル・レアル 2,204 | 20 | 千ブラジル・レアル 98 |
| ユーロ | | 千ユーロ | | 千ユーロ |
| ドイツ | 42 | 944 | 85 | 630 |
| イタリア | 641 | 228 | 170 | 49 |
| フランス | 372 (218) | 1,195 (745) | 127 (54) | 297 (745) |
| オランダ | 12 (117) | 64 (100) | 139 (58) | 441 (50) |
| スペイン | 270 (797) | 261 (29) | 26 (791) | 28 (11) |
| フィンランド | 772 | 671 | 48 | 38 |
| その他 | 33 | 151 | 15 | 68 |
| イギリス | 639 | 千イギリス・ポンド 609 | 3,643 | 千イギリス・ポンド 944 |
| イスイス | 1,330 | 千スイス・フラン 57 | 3,986 | 千スイス・フラン 176 |
| ノルウェー | 61 | 千ノルウェー・クローネ 1,383 | 143 | 千ノルウェー・クローネ 3,396 |
| デンマーク | 8 | 千デンマーク・クローネ 202 | 68 | 千デンマーク・クローネ 1,255 |
| 韓国 | 14 | 千韓国ウォン 998,148 | 5 | 千韓国ウォン 273,656 |
| 台湾 | 360 | 千新台湾ドル 9,290 | 20 | 千新台湾ドル 442 |
| 中国オフショア | 189 | 千中国・オフショア人民元 723 | 85 | 千中国・オフショア人民元 275 |

(注1) 金額は受け渡し代金。

(注2) 単位未満は切り捨て。

(注3) () 内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(2) 投資信託証券

| | 買付 | | 売付 | |
|-----------------------|----------|---------------|----------|---------------|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| 外国 | | | | |
| アメリカ | | | | |
| ISHARES MSCI ACWI ETF | 千口 34 | 千米ドル 3,575 | 千口 36 | 千米ドル 3,818 |
| PROLOGIS INC | 0.6 | 85 | 2 | 346 |
| 小計 証券数・金額 | 34 | 3,660 | 39 | 4,165 |

(注1) 金額は受け渡し代金。

(注2) 単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項目 | 当期 |
|-------------------|-------------|
| (a) 期中の株式売買金額 | 4,328,416千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 4,941,673千円 |
| (c) 売買高比率 (a)/(b) | 0.87 |

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

主要な売買銘柄 (自 2021年8月21日 至 2022年8月22日)

(1) 株 式

| 買付 | | | | 売付 | | | |
|-----------------------------------|----------|---------------|------------|------------------------------------|---------|---------------|-------------|
| 銘柄 | 株数 | 金額 | 平均単価 | 銘柄 | 株数 | 金額 | 平均単価 |
| SOCIETE GENERALE SA(ユーロ・フランス) | 千株 35 | 千円 129,588 | 円 3,674 | WASTE MANAGEMENT INC(アメリカ) | 千株 5 | 千円 113,777 | 円 19,010 |
| ROYAL BANK OF CANADA(カナダ) | 9 | 111,554 | 12,017 | BARCLAYS PLC(イギリス) | 358 | 109,165 | 304 |
| ADIDAS AG(ユーロ・ドイツ) | 3 | 107,566 | 35,831 | LYONDELLBASELL INDU-CL A(アメリカ) | 9 | 99,861 | 10,559 |
| ALPHABET INC-CL A(アメリカ) | 0.322 | 107,329 | 333,321 | KNORR-BREMSE AG(ユーロ・ドイツ) | 8 | 81,502 | 9,707 |
| SPLUNK INC(アメリカ) | 7 | 101,519 | 13,577 | STARBUCKS CORP(アメリカ) | 5 | 74,834 | 13,217 |
| F5 INC(アメリカ) | 3 | 96,020 | 24,266 | YANDEX NV-A(アメリカ) | 13 | 73,029 | 5,293 |
| LG CHEM LTD(韓国) | 1 | 95,975 | 68,505 | MICROSOFT CORP(アメリカ) | 1 | 71,840 | 37,069 |
| METSO OUTOTEC OYJ(ユーロ・フィンランド) | 77 | 87,764 | 1,135 | FORD MOTOR CO(アメリカ) | 31 | 65,392 | 2,091 |
| AUTODESK INC(アメリカ) | 2 | 78,459 | 26,650 | MONTROSE ENVIRONMENTAL GROUP(アメリカ) | 7 | 61,330 | 8,301 |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD(カナダ) | 8 | 69,964 | 8,602 | NVIDIA CORP(アメリカ) | 2 | 58,512 | 24,543 |

(注) 金額は受け渡し代金。

(2) 投資信託証券

| 買付 | | | | 売付 | | | | |
|-----------------------------|----------|---------------|-----------------------------|----------|---------------|--------------------|----|--------|
| 銘柄 | 口数 | 金額 | 銘柄 | 口数 | 金額 | 銘柄 | 口数 | |
| ISHARES MSCI ACWI ETF(アメリカ) | 千口 34 | 千円 405,024 | ISHARES MSCI ACWI ETF(アメリカ) | 千口 36 | 千円 434,056 | PROLOGIS INC(アメリカ) | 2 | 42,881 |
| PROLOGIS INC(アメリカ) | 0.6 | 9,641 | PROLOGIS INC(アメリカ) | | | | | |

(注) 金額は受け渡し代金。 (株式からの転換および償還等による増減は含まれておりません。)

利害関係人等との取引状況等 (自 2021年8月21日 至 2022年8月22日)

期中の利害関係人等との取引はありません。

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

組入資産明細表 (2022年8月22日現在)

(1) 国内株式

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|----------------|----------|------|------------|
| | | 株数 | 評価額 |
| 電気機器 (60.5%) | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日本電気 | 16.6 | 18.2 | 90,545 |
| 情報・通信業 (39.5%) | | | |
| ソフトバンクグループ | 10.2 | 10.3 | 59,111 |
| 合計 | 株数・金額 | 26 | 28 149,656 |
| | 銘柄数 <比率> | 2 | <2.9%> |

(注1) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

(注2) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨て。

(2) 外国株式

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 | |
|-----------------------------|---------|-----|--------|-------|------------------------|--|
| | | 株数 | 評価額 | 外貨建金額 | | |
| | | | 邦貨換算金額 | | | |
| (アメリカ) | | 百株 | 千米ドル | 千円 | | |
| EMERSON ELECTRIC CO | | — | 34 | 306 | 資本財 | |
| ECOLAB INC | | 49 | 54 | 931 | 素材 | |
| MICROSOFT CORP | | 68 | 60 | 1,744 | ソフトウェア・サービス | |
| MICRON TECHNOLOGY INC | | 76 | 84 | 508 | 半導体・半導体製造装置 | |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | | 20 | 19 | 1,062 | ヘルスケア機器・サービス | |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | | 62 | 58 | 923 | 公益事業 | |
| AUTODESK INC | | — | 27 | 620 | ソフトウェア・サービス | |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR | | 44 | 67 | 588 | 半導体・半導体製造装置 | |
| UNIVERSAL DISPLAY CORP | | — | 31 | 380 | 半導体・半導体製造装置 | |
| DANAHER CORP | | 40 | 44 | 1,293 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| PATHWARD FINANCIAL INC | | 143 | 189 | 694 | 銀行 | |
| F5 INC | | — | 36 | 630 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| BLACKROCK INC | | 10 | 11 | 811 | 各種金融 | |
| REGAL REXNORD CORP | | 79 | 82 | 1,199 | 資本財 | |
| VAIL RESORTS INC | | 15 | 23 | 551 | 消費者サービス | |
| INFOSYS LTD-SP ADR | | 378 | 208 | 412 | ソフトウェア・サービス | |
| NVIDIA CORP | | 20 | — | — | 半導体・半導体製造装置 | |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | | 23 | 25 | 1,099 | ソフトウェア・サービス | |
| STARBUCKS CORP | | 55 | — | — | 消費者サービス | |
| VISA INC-CLASS A SHARES | | 35 | 51 | 1,088 | ソフトウェア・サービス | |
| VMWARE INC-CLASS A | | 62 | 89 | 1,087 | ソフトウェア・サービス | |
| WASTE MANAGEMENT INC | | 52 | — | — | 商業・専門サービス | |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A | | 86 | — | — | 素材 | |
| SPLUNK INC | | — | 71 | 784 | ソフトウェア・サービス | |
| NXP SEMICONDUCTORS NV | | 19 | — | — | 半導体・半導体製造装置 | |
| YANDEX NV-A | | 103 | — | — | メディア・娯楽 | |
| TESLA INC | | 9 | 10 | 946 | 自動車・自動車部品 | |
| GENERAC HOLDINGS INC | | 7 | 7 | 201 | 資本財 | |
| APTIV PLC | | 49 | 33 | 350 | 自動車・自動車部品 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | | | 業種等 | |
|------------------------------|---------|-------|-----------|---------|-----------|-------------|--|
| | | 株数 | 株数 | 評価額 | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (アメリカ) | | | | | | | |
| PTC INC | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | | | |
| BLOOM ENERGY CORP- A | 21 | — | — | — | — | ソフトウェア・サービス | |
| NVENT ELECTRIC PLC | 97 | 68 | 175 | 24,134 | | 資本財 | |
| CNH INDUSTRIAL NV | 131 | — | — | — | — | 資本財 | |
| EVOQUA WATER TECHNOLOGIES CO | 256 | 359 | 450 | 61,752 | | 資本財 | |
| BEYOND MEAT INC | 102 | — | — | — | — | 資本財 | |
| LYFT INC-A | — | 67 | 197 | 27,064 | | 食品・飲料・タバコ | |
| AZEK CO INC/THE | 92 | 224 | 373 | 51,220 | | 運輸 | |
| VOYA FINANCIAL INC | 284 | 301 | 615 | 84,476 | | 資本財 | |
| MONROSE ENVIRONMENTAL GROUP | 132 | 133 | 870 | 119,459 | | 各種金融 | |
| SHOALS TECHNOLOGIES GROUP -A | 120 | 80 | 354 | 48,613 | | 商業・専門サービス | |
| APPHARVEST INC | 172 | 153 | 392 | 53,775 | | 資本財 | |
| LI AUTO INC - ADR | 137 | — | — | — | — | 食品・飲料・タバコ | |
| ALPHABET INC-CL A | 93 | 76 | 227 | 31,257 | | 自動車・自動車部品 | |
| LINDE PLC | — | 61 | 715 | 98,154 | | メディア・娯楽 | |
| | 27 | 24 | 735 | 100,871 | | 素材 | |
| 小計 | 株数・金額 | 3,183 | 2,875 | 23,326 | 3,199,642 | | |
| | 銘柄数<比率> | 37 | 34 | — | <62.3%> | | |
| (カナダ) | | | | | | | |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | — | 76 | 806 | 85,086 | | 運輸 | |
| ROYAL BANK OF CANADA | — | 86 | 1,111 | 117,214 | | 銀行 | |
| PRIMO WATER CORP | 444 | 547 | 1,015 | 107,095 | | 食品・飲料・タバコ | |
| 小計 | 株数・金額 | 444 | 709 | 2,933 | 309,397 | | |
| | 銘柄数<比率> | — | 1 | 3 | <6.0%> | | |
| (ブラジル) | | | | | | | |
| SUZANO SA | — | 330 | 千ブラジル・レアル | | | | |
| | | | 1,649 | 43,751 | | 素材 | |
| 小計 | 株数・金額 | — | 330 | 1,649 | 43,751 | | |
| | 銘柄数<比率> | — | 1 | — | <0.9%> | | |
| (ユーロ…ドイツ) | | | | | | | |
| ADIDAS AG | — | 28 | 千ユーロ | | | | |
| KNORR-BREMSE AG | 71 | — | 470 | 64,735 | | 耐久消費財・アパレル | |
| 小計 | 株数・金額 | 71 | 28 | 470 | 64,735 | | |
| | 銘柄数<比率> | — | 1 | — | <1.3%> | | |
| (ユーロ…イタリア) | | | | | | | |
| HERA SPA | 1,457 | 1,929 | 530 | 73,024 | | 公益事業 | |
| 小計 | 株数・金額 | 1,457 | 1,929 | 530 | 73,024 | | |
| | 銘柄数<比率> | — | 1 | — | <1.4%> | | |
| (ユーロ…フランス) | | | | | | | |
| DANONE | 123 | 118 | 633 | 87,152 | | 食品・飲料・タバコ | |
| MICHELIN (CGDE) | 38 | — | — | — | | 自動車・自動車部品 | |
| SOCIETE GENERALE SA | — | 246 | 555 | 76,441 | | 銀行 | |
| MICHELIN (CGDE) | — | 206 | 532 | 73,197 | | 自動車・自動車部品 | |
| 小計 | 株数・金額 | 162 | 571 | 1,721 | 236,791 | | |
| | 銘柄数<比率> | — | 2 | 3 | — | <4.6%> | |

| 銘柄 | | 期首(前期末) 株 数 | 当 期 末 | | 業種等 |
|-----------------------------------|------------------|----------------|-------------|---------------------|--------------------|
| | | | 株 数 | 評価額 外貨建金額 邦貨換算金額 | |
| (ユーロ…オランダ) AALBERTS NV | | 百株 68 | 百株 — | 千ユーロ — | 千円 — |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 68 1 | — — | — — | 資本財 <-%> |
| (ユーロ…スペイン) IBERDROLA SA | | 243 | 493 | 539 | 74,236 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 243 1 | 493 1 | 539 — | 74,236 <1.4%> |
| (ユーロ…フィンランド) METSO OUTOTEC OYJ | | — | 724 | 591 | 81,405 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | — — | 724 1 | 591 — | 81,405 <1.6%> |
| (ユーロ…その他) UNILEVER PLC | | 188 | 206 | 972 | 133,827 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 188 1 | 206 1 | 972 — | 133,827 <2.6%> |
| ユーロ計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 2,191 7 | 3,953 8 | 4,827 — | 664,021 <12.9%> |
| (イギリス) | | | 千イギリス・ポンド | | |
| SPECTRIS PLC | | 248 | 276 | 809 | 131,217 |
| ASTRAZENECA PLC | | 71 | 71 | 801 | 129,953 |
| BARCLAYS PLC | | 3,367 | — | — | — |
| DRAX GROUP PLC | | — | 334 | 245 | 39,822 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 3,686 3 | 682 3 | 1,857 — | 300,993 <5.9%> |
| (スイス) | | | 千スイス・フラン | | |
| MEYER BURGER TECHNOLOGY AG | | 7,453 | 4,797 | 260 | 37,306 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 7,453 1 | 4,797 1 | 260 — | 37,306 <0.7%> |
| (ノルウェー) | | | 千ノルウェー・クローネ | | |
| MOWI ASA | | 343 | 261 | 5,782 | 80,671 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 343 1 | 261 1 | 5,782 — | 80,671 <1.6%> |
| (デンマーク) | | | 千デンマーク・クローネ | | |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S | | 59 | — | — | — |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 59 1 | — — | — — | 資本財 <-%> |
| (香港) | | | 千香港ドル | | |
| CHINA METAL RECYCLING | | 10,488 | 10,488 | — | — |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 10,488 1 | 10,488 1 | — — | 素材 <-%> |
| (韓国) | | | 千韓国ウォン | | |
| LG CHEM LTD | | — | 8 | 545,280 | 55,945 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | — — | 8 1 | 545,280 — | 55,945 <1.1%> |

| 銘柄 | | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 |
|-----------|------------------------------|--------------|--------------|-----------------------|----------------------|------------|
| | | | 株数 | 株数 | 評価額 | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (台湾) | MERIDA INDUSTRY CO LTD | 百株 - | 百株 340 | 千新台灣ドル 7,531 | 千円 34,400 | 耐久消費財・アパレル |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | - | 340 | 7,531 | 34,400 | <0.7%> |
| (中国オフショア) | GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A | 1,063 | 1,167 | 千中國・オフショア人民元 3,554 | 71,296 | 耐久消費財・アパレル |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 1,063 | 1,167 | 3,554 | 71,296 | <1.4%> |
| 合計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 28,914 53 | 25,612 55 | - | 4,797,427 <93.4%> | |

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

(注2) 邦貨換算金額欄の<>内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

(注3) 株数・評価額の単位未満は切り捨て。

(注4) -印は組み入れなし。

(3) 外国投資信託証券

| 銘柄 | | 期首 | 当期末 | | | 比 率 |
|--------|-----------------------|---------|---------|-----------|---------|--------|
| | | | □数 | □数 | 評価額 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (アメリカ) | ISHARES MSCI ACWI ETF | 千□ 2 | 千□ - | 千米ドル - | 千円 - | % - |
| | PROLOGIS INC | 4 | 2 | 343 | 47,174 | 0.9 |
| 合計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 6 | 2 | 343 | 47,174 | |
| | | 2 | 1 | - | <0.9%> | |

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

(注2) <>内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) □数・評価額の単位未満は切り捨て。

(注4) -印は組み入れなし。

(2022年8月22日現在)

投資信託財産の構成

| 項 目 | 当期末 | |
|--------------|-----------------|-----------|
| | 評価額 | 比率 |
| 株式 | 千円 4,947,084 | % 94.9 |
| 投資証券 | 47,174 | 0.9 |
| コール・ローン等、その他 | 220,693 | 4.2 |
| 投資信託財産総額 | 5,214,951 | 100.0 |

(注1) 金額の単位未満は切り捨て。

(注2) 当期末における外貨建純資産(5,048,944千円)の投資信託財産総額(5,214,951千円)に対する比率は96.8%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したもので、1オフショア元=20.0572円、1米ドル=137.17円、1カナダ・ドル=105.48円、1ブラジル・レアル=26.532円、1ユーロ=137.55円、1イギリス・ポンド=162.08円、1スイス・フラン=142.96円、1スウェーデン・クローネ=12.95円、1ノルウェー・クローネ=13.95円、1デンマーク・クローネ=18.50円、1香港ドル=17.48円、100韓国ウォン=10.26円、1新台湾ドル=4.5679円です。

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年8月22日現在)

| 項 目 | 当期末 |
|-----------------|----------------|
| (A) 資産 | 5,289,947,511円 |
| コール・ローン等 | 16,046,005 |
| 株式(評価額) | 4,947,084,127 |
| 投資証券(評価額) | 47,174,847 |
| 未収入金 | 273,895,352 |
| 未収配当金 | 5,747,180 |
| (B) 負債 | 154,995,655 |
| 未払金 | 74,995,626 |
| 未払解約金 | 80,000,000 |
| 未払利息 | 29 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 5,134,951,856 |
| 元本 | 3,520,343,767 |
| 次期繰越損益金 | 1,614,608,089 |
| (D) 受益権総口数 | 3,520,343,767口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 14,587円 |

〔注記事項〕

| | |
|-----------|----------------|
| 期首元本額 | 3,238,526,914円 |
| 期中追加設定元本額 | 811,583,767円 |
| 期中一部解約元本額 | 529,766,914円 |
| 1口当たり純資産額 | 1.4587円 |

〔当マザーファンドの当期末における元本の内訳〕

| | |
|--|----------------|
| UBS気候変動関連グローバル成長株式ファンド | 2,774,812,603円 |
| UBS気候変動関連グローバル成長株式ファンド(年4回決算・予想分配金提示型) | 745,531,164円 |

損益の状況

(自2021年8月21日 至2022年8月22日)

| 項 目 | 当期 |
|------------------|-----------------|
| (A) 配当等収益 | 120,161,568円 |
| 受取配当金 | 114,784,152 |
| 受取利息 | △ 923 |
| その他収益金 | 5,401,435 |
| 支払利息 | △ 23,096 |
| (B) 有価証券売買損益 | 189,163,336 |
| 売買益 | 1,201,530,847 |
| 売買損 | △ 1,012,367,511 |
| (C) 信託報酬等 | △ 3,507,019 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 305,817,885 |
| (E) 前期繰越損益金 | 1,169,707,057 |
| (F) 追加信託差損益金 | 349,616,233 |
| (G) 解約差損益金 | △ 210,533,086 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 1,614,608,089 |
| 次期繰越損益金(H) | 1,614,608,089 |

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

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

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

(注4) 損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。