

日経平均参照デリバティブ投信・分配追求型0707

単体型／国内／株式／特殊型(条件付運用型)

報告基準日：平成22年6月30日

設定・運用：UBSグローバル・アセット・マネジメント株式会社

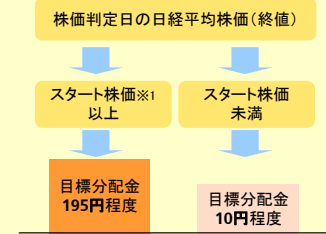
※ 当レポートにおける分配金については全て1口当たり、かつ税引前の金額です。また、基準価額の記載については全て信託報酬控除後としております。

ファンドの特徴

ファンドの特徴1

第1期の決算日には、日経平均株価の水準にかかわらず780円程度の収益分配を目指します(1口当たり、課税前)。

第2期決算日以降は、日経平均株価の水準により、以下の収益分配を目指します(1口当たり、課税前)。



ファンドの特徴2

ファンドは、日経平均株価が一定の条件を満たした場合、繰上償還します。2008年7月の決算日(第1期)～2010年4月の決算日(第8期)までの株価判定日※2の日経平均株価(終値)が、スタート株価の110%以上となった場合、ファンドは繰上償還し、当該決算日に元本と目標分配金を確保することを目指します。

ファンドの特徴3

繰上償還されなかった場合、ファンドは、2010年7月30日に満期償還となります。目標とする満期償還額は、エンド株価(2010年7月20日の日経平均株価(終値))により変動します。

目標とする満期償還額の目安

$$10,000円 \times \frac{\text{エンド株価}}{\text{スタート株価}} + \text{目標分配金}$$

※1 2007年7月31日から2007年8月6日までの5営業日の日経平均株価の終値の平均値(円未満切捨て)です。
 ※2 2008年7月以降の毎年1月、4月、7月、10月の各20日(休業日の場合は前営業日)。第1回株価判定日は2008年7月18日とします。

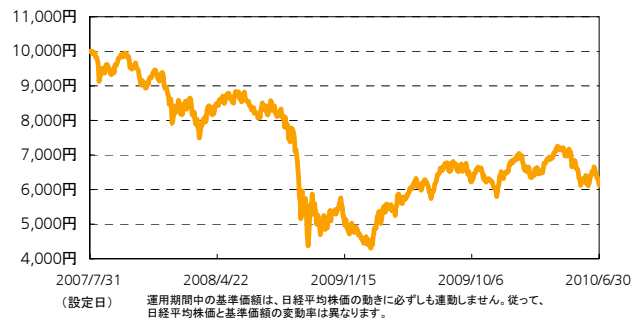
ファンドのデータ

基準価額	5,491円
純資産総額	2.0億円
当初設定元本	7.2億円
設定日	2007年7月31日
信託終了日	2010年7月30日
決算日	原則として、毎年1月、4月、7月および10月の各30日(休業日の場合は翌営業日) ただし、第1期の決算日は2008年7月30日
信託報酬(年率)	元本総額に対して年0.903%※(税抜年0.86%)の率を乗じて得た額とします。この他に、法定書類等の作成に要する費用、監査報酬等が信託財産から差し引かれます。 ※消費税相当額を含みます。なお、消費税率に応じて変更となる場合があります。

ファンドのスケジュール

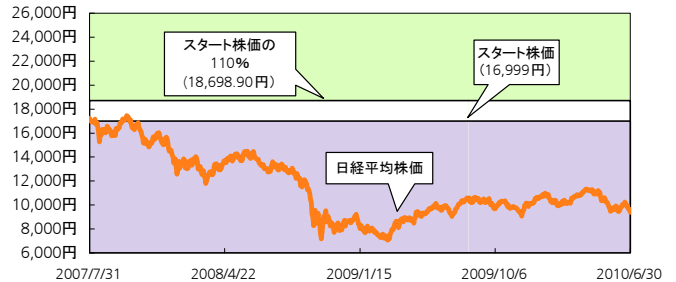
株価判定日	決算日	分配金
第1回 2008年7月18日	第1期 2008年7月30日	780円程度
第2回 2008年10月20日	第2期 2008年10月30日	195円程度 または 10円程度
第3回 2009年1月20日	第3期 2009年1月30日	195円程度 または 10円程度
第4回 2009年4月20日	第4期 2009年4月30日	195円程度 または 10円程度
第5回 2009年7月17日	第5期 2009年7月30日	195円程度 または 10円程度
第6回 2009年10月20日	第6期 2009年10月30日	195円程度 または 10円程度
第7回 2010年1月20日	第7期 2010年2月1日	195円程度 または 10円程度
第8回 2010年4月20日	第8期 2010年4月30日	195円程度 または 10円程度
第9回 2010年7月20日	第9期 2010年7月30日	195円程度 または 10円程度

基準価額(税金控除前、分配金再投資)の推移(日次)



※2010年7月より、基準価額の計算方法を分配金加算から分配金再投資へ変更しました。
 ※基準価額(分配金再投資)は、ファンドの分配金(1万口当たり、課税前)でファンドを購入(再投資)した場合の価額です。

日経平均株価の推移



ファンドの騰落率

%	1ヶ月	6ヶ月	1年	設定来
ファンド	-2.95%	-9.42%	-2.45%	-38.69%

分配金の実績

第1期決算日	780円	第4期決算日	10円	第7期決算日	10円
第2期決算日	10円	第5期決算日	10円	第8期決算日	10円
第3期決算日	10円	第6期決算日	10円	第9期決算日	-
				分配金累計	850円

資産の内訳

	比率
債券	98.94%
コールローン・その他	1.06%
合計	100%

組入れ債券の発行体格付け

発行体	S&P	Moody's
UBS AG	A+	Aa3

日経平均株価の情報

スタート株価	16,999円
スタート株価の110%の価格	18,698.90円
報告基準日現在の日経平均株価(終値)	9,382.64円
スタート株価からの日経平均の変動率	-44.80%
ファンド設定来の日経平均株価最高値(2007年10月11日)	17,458.98円
ファンド設定来の日経平均株価最安値(2009年3月10日)	7,054.98円

本資料はUBSグローバル・アセット・マネジメント株式会社で作成した資料であり、金融商品取引法に基づく開示書類ではありません。本資料は本ファンドの情報提供を目的として作成されたものであり、有価証券の取得の勧誘を目的とするものではありません。投資信託は株式・債券など価値のある証券(外国証券)には為替リスクがあります。に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、元本が保証されているものではありません。投資信託の運用による損益はすべて投資信託をご購入されたお客様に帰属します。本資料に記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を保証するものではありません。本資料に記載されたグラフ・数値等は過去の実績であり、将来の市場の動向等を保証するものではありません。投資信託は、預金保険機構、貯蓄保険機構、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。金融商品取引業者以外の金融機関で購入いただいた投資信託は投資者保護基金の保護の対象ではありません。