

日経平均参照デリバティブ投信・元本重視型0707

単位型/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

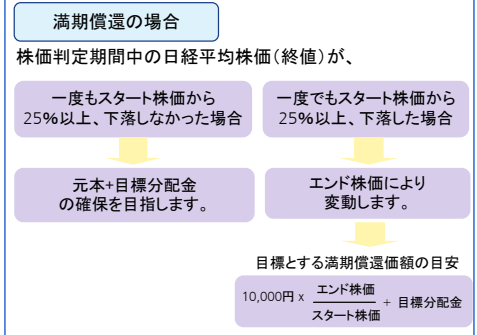
毎決算期に収益の分配を行います。日経平均株価の水準にかかわらず、第1期決算日には**434円**程度、第2期決算日以降は半年毎に**217円**程度の収益分配を目指します(1口当たり、課税前)。

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)から2010年2月の決算日(第4期)までの株価判定日※1の日経平均株価(終値)がスタート株価※2以上となった場合、当該決算日にファンドは繰上償還し、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には、ファンドは、2010年7月30日に満期償還となります。2008年7月から2010年1月までの株価判定日(計4回)の日経平均株価(終値)が一度もスタート株価に達しなかった場合、ファンドは2010年7月30日に満期償還となります。目標とする償還額は、株価判定期間※3中の日経平均株価(終値)の動きやエンド株価※4によって決まりますので、日経平均株価の推移やエンド株価によっては、元本割れる場合があります。



※1 2008年7月以降の毎年1月、7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。

※2 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。

※3 2007年8月13日から2010年7月20日までです。

※4 2010年7月20日の日経平均株価の終値です。

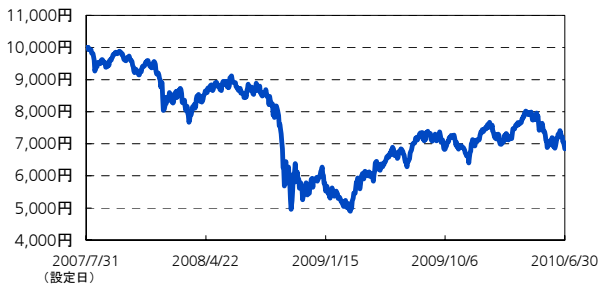
ファンドのデータ

基準価額	5,810円
純資産総額	6.2億円
当初設定元本	37.6億円
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月および7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ことがあります。

ファンドのスケジュール

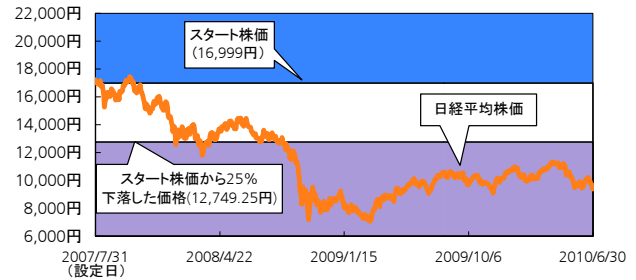
株価判定日	決算日	分配金
第1回 2008年7月18日	第1期 2008年7月30日	434円程度
第2回 2009年1月20日	第2期 2009年1月30日	217円程度
第3回 2009年7月17日	第3期 2009年7月30日	217円程度
第4回 2010年1月20日	第4期 2010年2月1日	217円程度
第5回 2010年7月20日	第5期 2010年7月30日	217円程度

基準価額(税金控除前、分配金再投資)の推移(日次)



運用期間中の基準価額は、日経平均株価の動きに必ずしも連動しません。従って、日経平均株価と基準価額の変動率は異なります。※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



日経平均株価に関する知的財産権その他一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。当ファンドの運用を日本経済新聞社が保証しているものではありません。日本経済新聞社は、日経平均株価の内容を要する権利および公表を停止する権利を有しています。尚、日経平均株価の構成銘柄が変更されることがあります。

ファンドの騰落率

%	1ヶ月	6ヶ月	1年	設定来
ファンド	-3.57%	-7.33%	0.01%	-31.62%

分配金の実績

第1期決算日	434円	第2期決算日	217円	第3期決算日	217円
第4期決算日	217円	第5期決算日	-	分配金累計	1,085円

資産の内訳

	比率
債券	94.47%
コールローン・その他	5.53%
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
スタート株価から25%下落した価格	12,749.25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%
株価判定期間中の日経平均株価最高値	17,458.98円 (2007年10月11日)
株価判定期間中の日経平均株価最安値	7,054.98円 (2009年3月10日)
スタート株価からの日経平均の最大下落率	-58.50%

※ 株価判定期間中とは、2007年8月13日から2010年7月20日までの期間とします。

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)を為替リスクを伴って投資しますので、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障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。投資信託は金融機関の預金と異なり、元本および利息の保証はありません。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ご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。