

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／海外／債券	
信託期間	2022年6月10日まで（2012年7月12日設定）	
運用方針	アジア・ハイールド債券マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として日本を除くアジアの米ドル建てハイールド債券等に投資を行い、値上がり益の獲得および利子収益の確保をめざします。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 マザーファンドの債券等の運用にあたっては、モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インクに運用指図に関する権限を委託します。	
主要運用対象	ベビーフンド	アジア・ハイールド債券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	日本を除くアジアの米ドル建てハイールド債券等を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーフンド	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	マザーファンド	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。なお、第1計算期末は、収益の分配は行いません。	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。
※公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。
詳しくは販売会社にお問い合わせください。

運用報告書（全体版）

三菱UFJ アジア・ハイールド 債券ファンド ＜為替ヘッジなし＞（毎月決算型）

愛称：アジアブーケ

第48期（決算日：2016年7月11日）
第49期（決算日：2016年8月10日）
第50期（決算日：2016年9月12日）
第51期（決算日：2016年10月11日）
第52期（決算日：2016年11月10日）
第53期（決算日：2016年12月12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、お手持ちの「三菱UFJ アジア・ハイールド債券ファンド＜為替ヘッジなし＞（毎月決算型）」は、去る12月12日に第53期の決算を行いましたので、法令に基づいて第48期～第53期の運用状況をまとめてご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
URL:<http://www.am.mufg.jp/>

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

お客さま専用フリーダイヤル TEL. 0120-151034
(9:00～17:00、土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く)
お客さまのお取引内容につきましては、お取り扱いの販売会社にお尋ねください。

◆目次

三菱UFJ アジア・ハイールド債券ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型) のご報告

◇最近30期の運用実績	1
◇当作成期中の基準価額と市況等の推移	2
◇運用経過	3
◇今後の運用方針	9
◇1万口当たりの費用明細	10
◇売買及び取引の状況	10
◇利害関係人との取引状況等	11
◇組入資産の明細	11
◇投資信託財産の構成	11
◇資産、負債、元本及び基準価額の状況	12
◇損益の状況	13
◇分配金のお知らせ	14
◇お知らせ	14

マザーファンドのご報告

◇アジア・ハイールド債券マザーファンド	17
---------------------	----

本資料の表記にあたって

- ・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

○最近30期の運用実績

決算期	基準価額			(参考指数)		新株予約権付社債 (転換社債) 組入比率	債券 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税金 込 分 配	み 金 騰 落	期 中 騰 落 率 (円換算ベース)	期 中 騰 落 率				
24期(2014年7月10日)	円 13,658	円 70	% 0.7	40,793.86	% 1.0	% 5.1	% 91.0	% -	百万円 1,441
25期(2014年8月11日)	13,616	70	0.2	40,958.78	0.4	5.5	91.9	-	1,359
26期(2014年9月10日)	14,327	70	5.7	43,231.48	5.5	-	96.8	-	1,368
27期(2014年10月10日)	14,162	70	△0.7	43,398.56	0.4	-	95.5	-	1,243
28期(2014年11月10日)	14,984	70	6.3	46,210.70	6.5	-	95.3	-	1,261
29期(2014年12月10日)	15,292	70	2.5	47,923.65	3.7	-	91.6	-	1,235
30期(2015年1月13日)	14,362	70	△5.6	45,414.50	△5.2	-	93.4	-	1,181
31期(2015年2月10日)	14,585	70	2.0	47,140.01	3.8	-	95.0	-	1,170
32期(2015年3月10日)	15,292	70	5.3	48,931.15	3.8	-	92.4	-	1,167
33期(2015年4月10日)	15,055	70	△1.1	49,092.28	0.3	-	94.0	-	1,191
34期(2015年5月11日)	15,207	70	1.5	49,113.01	0.0	-	95.2	-	1,223
35期(2015年6月10日)	15,744	70	4.0	51,210.81	4.3	-	93.6	-	1,167
36期(2015年7月10日)	15,118	70	△3.5	49,831.37	△2.7	-	92.1	-	1,113
37期(2015年8月10日)	15,534	70	3.2	51,483.25	3.3	-	94.6	-	1,095
38期(2015年9月10日)	14,553	70	△5.9	48,482.03	△5.8	-	92.7	-	994
39期(2015年10月13日)	14,681	70	1.4	49,044.92	1.2	-	93.5	-	974
40期(2015年11月10日)	15,315	70	4.8	51,574.11	5.2	-	94.8	-	977
41期(2015年12月10日)	14,792	70	△3.0	50,352.52	△2.4	-	93.9	-	899
42期(2016年1月12日)	14,080	70	△4.3	48,698.05	△3.3	-	93.5	-	820
43期(2016年2月10日)	13,331	70	△4.8	46,952.79	△3.6	-	92.2	-	764
44期(2016年3月10日)	13,377	70	0.9	47,336.27	0.8	-	94.5	-	777
45期(2016年4月11日)	13,062	70	△1.8	46,637.25	△1.5	-	91.2	-	727
46期(2016年5月10日)	13,336	70	2.6	47,504.18	1.9	-	92.3	-	724
47期(2016年6月10日)	13,319	70	0.4	47,932.93	0.9	-	93.8	-	707
48期(2016年7月11日)	12,696	70	△4.2	45,825.91	△4.4	-	93.4	-	652
49期(2016年8月10日)	12,952	70	2.6	46,987.77	2.5	-	93.9	-	659
50期(2016年9月12日)	13,155	70	2.1	47,991.08	2.1	-	95.0	-	656
51期(2016年10月11日)	13,307	70	1.7	49,063.57	2.2	-	93.4	-	653
52期(2016年11月10日)	13,439	70	1.5	49,800.21	1.5	-	95.2	-	637
53期(2016年12月12日)	14,573	70	9.0	54,403.92	9.2	-	94.7	-	674

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 基準価額動向の理解に資するため、参考指数を掲載しておりますが、当ファンドのベンチマークではありません。

(注) 参考指数は、BofAメリルリンチ アジアン ダラー ハイイールド コーポレート インデックス (円換算ベース) です。

BofAメリルリンチ アジアン ダラー ハイイールド コーポレート インデックスとは、BofAメリルリンチ社が算出するアジアのハイイールド債券の値動きを表す指数です。BofAメリルリンチ アジアン ダラー ハイイールド コーポレート インデックス (円換算ベース) は、BofAメリルリンチ アジアン ダラー ハイイールド コーポレート インデックス (米ドルベース) をもとに、委託会社が計算したものです。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「新株予約権付社債 (転換社債) 組入比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「債券先物比率」は買建比率-売建比率。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基準 価 額		(参 考 指 数) B o f A メリルリンチ アジアン グラウ ハイールド コーポレート インデックス (円換算ベース)		新株子約権付社債 (転換社債) 組入比率	債 券 組入比率	債 券 先物比率
		騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
第48期	(期首) 2016年6月10日	円 13,319	% —	47,932.93	% —	% —	% 93.8	% —
	6月末	12,895	△3.2	46,195.99	△3.6	—	92.1	—
	(期末) 2016年7月11日	12,766	△4.2	45,825.91	△4.4	—	93.4	—
第49期	(期首) 2016年7月11日	12,696	—	45,825.91	—	—	93.4	—
	7月末	13,361	5.2	48,238.80	5.3	—	93.6	—
	(期末) 2016年8月10日	13,022	2.6	46,987.77	2.5	—	93.9	—
第50期	(期首) 2016年8月10日	12,952	—	46,987.77	—	—	93.9	—
	8月末	13,250	2.3	48,152.15	2.5	—	94.3	—
	(期末) 2016年9月12日	13,225	2.1	47,991.08	2.1	—	95.0	—
第51期	(期首) 2016年9月12日	13,155	—	47,991.08	—	—	95.0	—
	9月末	12,983	△1.3	47,481.60	△1.1	—	93.0	—
	(期末) 2016年10月11日	13,377	1.7	49,063.57	2.2	—	93.4	—
第52期	(期首) 2016年10月11日	13,307	—	49,063.57	—	—	93.4	—
	10月末	13,441	1.0	49,510.07	0.9	—	92.9	—
	(期末) 2016年11月10日	13,509	1.5	49,800.21	1.5	—	95.2	—
第53期	(期首) 2016年11月10日	13,439	—	49,800.21	—	—	95.2	—
	11月末	14,204	5.7	52,766.01	6.0	—	92.8	—
	(期末) 2016年12月12日	14,643	9.0	54,403.92	9.2	—	94.7	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「新株子約権付社債(転換社債)組入比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

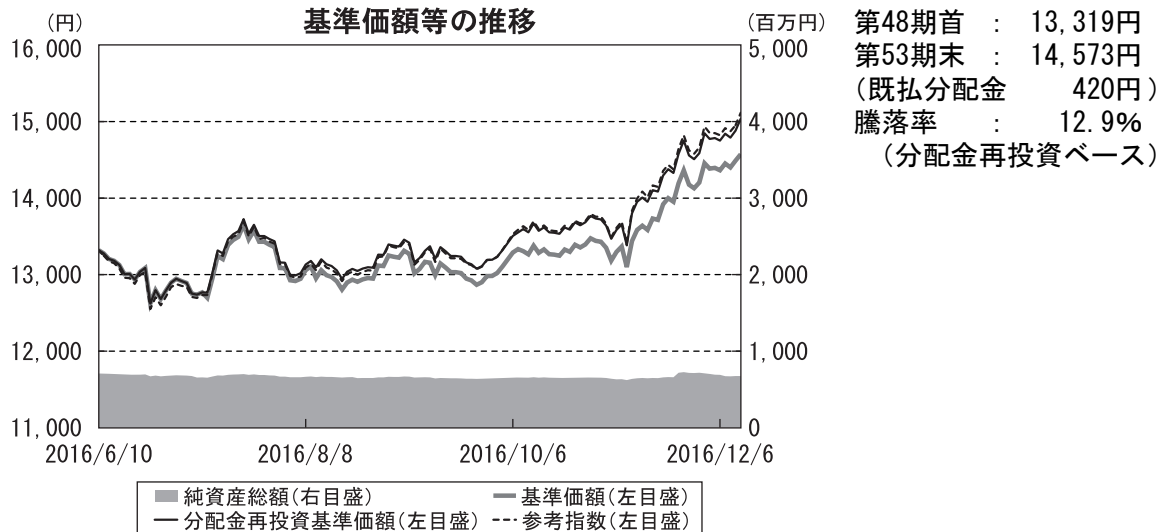
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当作成期中の基準価額等の推移について (第48期～第53期：2016/6/11～2016/12/12)

基準価額の動き

基準価額は当作成期首に比べ12.9% (分配金再投資ベース) の上昇となりました。



- ・ 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。
- ・ 実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なるため、お客さまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の主な変動要因

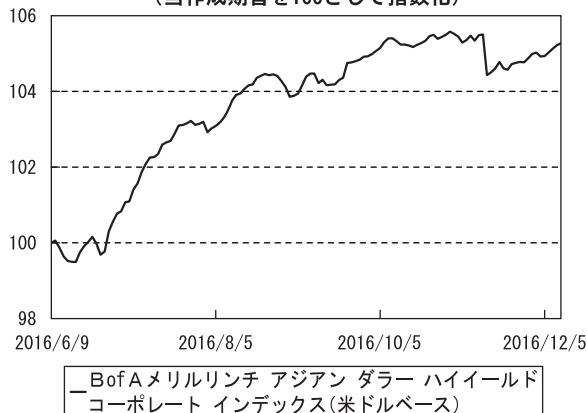
上昇要因

債券の利子収入を獲得したことや保有していたインドの金属関連銘柄が上昇したこと、円安・米ドル高が進行したことなどが、基準価額の上昇要因となりました。

投資環境について

(第48期～第53期：2016/6/11～2016/12/12)

債券市況の推移
(当作成期首を100として指数化)



(注) 現地日付ベースで記載しております。

為替市況の推移
(当作成期首を100として指数化)



◎債券市況

- ・当作成期首から2016年10月末にかけては、米国の利上げ観測が後退する局面が見られたこと、原油価格が底堅く推移したことなどを背景に市場心理が改善したことなどが影響し、アジア・ハイールド債券市況は上昇（利回りは低下）しました。その後、米国大統領選挙で拡張的な財政政策や保護主義的な貿易政策を主張していた候補が勝利したことなどを受け、米国金利が上昇し、新興国経済への影響や新興国からの資金流出に対する懸念が高まったことなどから、アジア・ハイールド債券市況は下落する局面がありました。
- ・当作成期を通じて見ると、アジア・ハイールド債券市況は上昇しました。

◎為替市況

- ・当作成期首から2016年11月上旬にかけては、もみ合いながら推移していたものの、その後は米国大統領選挙の結果を受け、次期大統領が掲げる拡張的な財政政策がインフレや米国金利の上昇の加速につながるとの観測が高まったことなどから、円安・米ドル高が進行しました。
- ・当作成期を通じて見ると、米ドルは対円で上昇しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

<三菱UFJ アジア・ハイイールド債券ファンド<為替ヘッジなし>（毎月決算型）>

- ・アジア・ハイイールド債券マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本を除くアジアの米ドル建てハイイールド債券等を高位に組み入れる運用を行いました。

<アジア・ハイイールド債券マザーファンド>

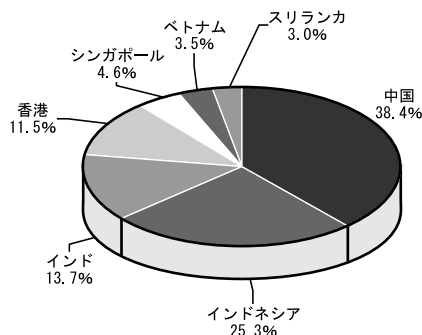
基準価額は当作成期首に比べ14.3%の上昇となりました。

- ・国別では、ファンダメンタルズと比べて割安感があるとする中国の組入比率を高めとした一方、利回りの観点から魅力度の劣るフィリピンや韓国は非保有としました。格付配分では、B格相当の銘柄への投資を多めとしました。セクター別では、不動産関連セクターなどの組入比率を高め維持するとともに、アジア新興国の消費市場拡大による恩恵が期待できる小売関連セクターなどへの配分を市場平均対比多めとする一方、利回り水準が低く金利感応度の高い公益セクターなどへの配分を市場平均対比少なめとしました。
- ・前記の運用を行った結果、債券の利子収入を獲得したことや保有していたインドの金属関連銘柄が上昇したこと、円安・米ドル高が進行したことなどがプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。

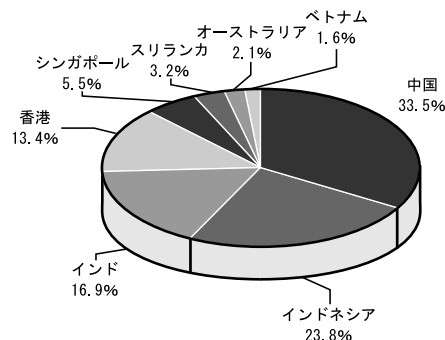
（ご参考）

国別構成比

作成期首（2016年6月10日）



作成期末（2016年12月12日）



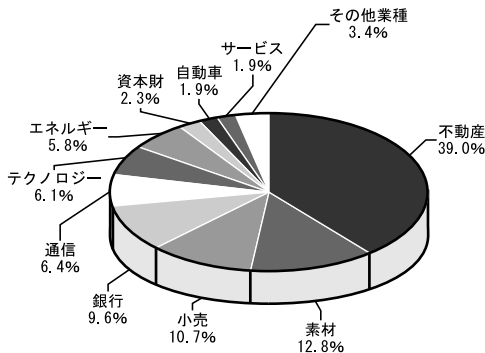
（注）比率は現物債券評価額に対する割合です。

（注）国名は、BloombergのCountry of Riskの分類を採用しています。

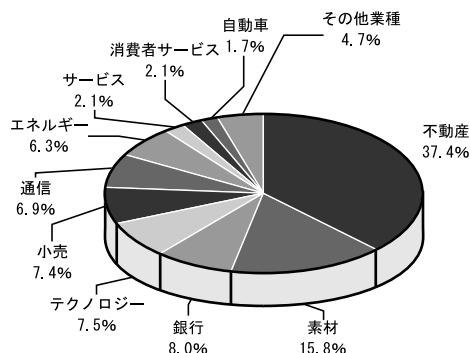
(ご参考)

業種別構成比

作成期首 (2016年6月10日)



作成期末 (2016年12月12日)



(注) 比率は現物債券評価額に対する割合です。

(注) 業種はB of Aメリルリンチの業種区分に基づいておりますが、一部モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インクの判断に基づき分類したものが含まれます。

(注) その他は、米国債等です。

(ご参考)

利回り・デュレーション (平均回収期間や金利感応度)

作成期首 (2016年6月10日)

最終利回り	6.8%
直接利回り	7.3%
デュレーション	2.0年

作成期末 (2016年12月12日)

最終利回り	5.8%
直接利回り	6.9%
デュレーション	2.1年

・数値は債券現物部分で計算しております。

・最終利回りとは、個別債券等について満期まで保有した場合の複利利回りを加重平均したものです。

・直接利回りとは、個別債券等についての表面利率を加重平均したものです。

・利回りは、計算日時点の評価にもとづくものであり、売却や償還による差損益等を考慮した後のファンドの「期待利回り」を示すものではありません。

・デュレーションは、債券価格の弾力性を示す指標として用いられ金利の変化に対する債券価格の変動率を示します。

・デュレーション調整のため、債券先物を組み入れることがあります。この場合、デュレーションについては債券先物を含めて計算しています。

(ご参考)

債券の格付分布

作成期首 (2016年6月10日)

格付種類	比率	銘柄数
AAA格	0.0%	0
AA格	0.0%	0
A格	0.0%	0
BBB格	1.6%	1
BB格	35.0%	17
B格	52.5%	24
CCC格以下	6.0%	2

作成期末 (2016年12月12日)

格付種類	比率	銘柄数
AAA格	0.0%	0
AA格	0.0%	0
A格	0.0%	0
BBB格	1.7%	1
BB格	28.3%	13
B格	61.9%	29
CCC格以下	3.7%	2

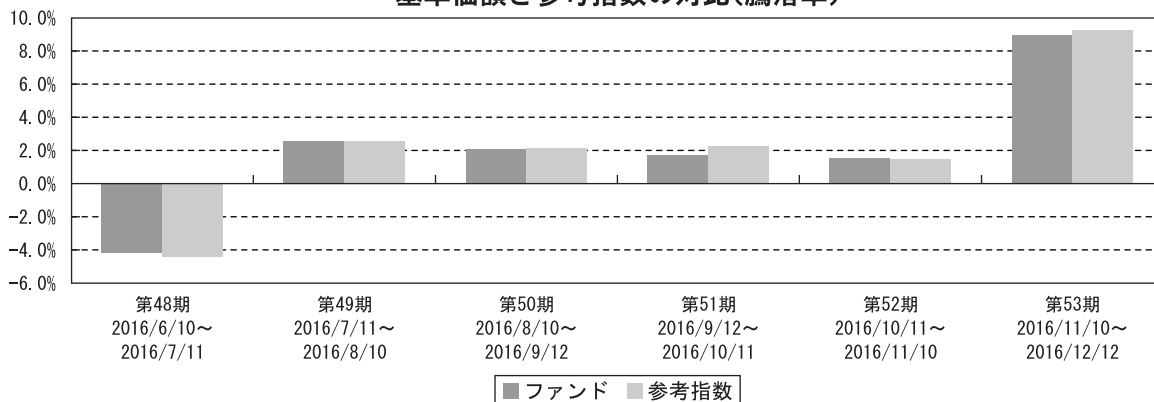


- ・比率は純資産総額に対する割合です。
- ・格付の振分基準は以下の通りです。
- ・AAA格 (AAA、Aaa)
- ・AA格 (AA+、AA、AA-、Aa1、Aa2、Aa3)
- ・A格 (A+、A、A-、A1、A2、A3)
- ・BBB格 (BBB+、BBB、BBB-、Baa1、Baa2、Baa3)
- ・BB格 (BB+、BB、BB-、Ba1、Ba2、Ba3)
- ・B格 (B+、B、B-、B1、B2、B3)
- ・CCC格 (CCC+、CCC、CCC-、Caa1、Caa2、Caa3)
- ・原則として、個別銘柄格付を採用しておりますが、例外的に国債、地方債ならびに政府保証のある債券などについては、弊社の分類基準に基づいて、ソブリン格付 (国の発行体格付) を採用しているものがあります。
- ・格付の表示にあたっては、S&P社、Moody's社、フィッチ・レーティングス社の3社のうち最も低い格付を表示しています。
- ・上記3社の格付を取得していない場合は、モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インクによる独自の格付を採用しています。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

(第48期～第53期：2016/6/11～2016/12/12)

基準価額と参考指数の対比(騰落率)



・ファンドの騰落率は分配金込みで計算しています。

- ・当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。上記のグラフは当ファンド（ベビーファンド）の基準価額と参考指数の騰落率との対比です。
- ・参考指数はBofAメリルリンチ アジアン ドラール ハイイールド コーポレート インデックス（円換算ベース）です。

分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

【分配原資の内訳】

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項 目	第48期	第49期	第50期	第51期	第52期	第53期
	2016年6月11日～ 2016年7月11日	2016年7月12日～ 2016年8月10日	2016年8月11日～ 2016年9月12日	2016年9月13日～ 2016年10月11日	2016年10月12日～ 2016年11月10日	2016年11月11日～ 2016年12月12日
当期分配金	70	70	70	70	70	70
(対基準価額比率)	0.548%	0.538%	0.529%	0.523%	0.518%	0.478%
当期の収益	56	70	70	63	67	70
当期の収益以外	13	—	—	6	2	—
翌期繰越分配対象額	6,009	6,011	6,016	6,010	6,008	6,027

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

(注) 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

<三菱UFJ アジア・ハイイールド債券ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型) >

◎今後の運用方針

- ・ マザーファンドへの投資を通じて、日本を除くアジアの米ドル建てハイイールド債券等を高位に組み入れ、利子収入の確保および値上がり益の獲得をめざす運用を行います。

<アジア・ハイイールド債券マザーファンド>

◎運用環境の見通し

- ・ 米国では、次期大統領が掲げる財政政策などに対する思惑などが影響し、インフレおよび利上げ観測が高まっているものの、FRB（米連邦準備制度理事会）は世界経済の動向を確認しながら緩やかなペースで利上げを実施するとの見方を維持しています。また、日本やユーロ圏などの他の先進国では緩和的な金融政策が継続され、低金利環境の長期化が見込まれることなどから、アジア・ハイイールド債券市場には相対的に高い利回りを求める投資家からの資金流入が期待できるとの見方を維持しています。
- ・ アジア地域では、原油価格が中長期的な観点から見て低水準で推移していることなどを背景にインフレリスクが抑制されていることから、景気が減速しても緩和的な金融政策による景気下支えが期待できると見えています。中国では、経済成長ペースがやや鈍化すると想定されるものの、政府が景気刺激策の実施などによって景気を下支えすると見ており、また構造改革にも着手していることなどから中長期的な経済成長が期待できると考えます。インドやインドネシアでは、構造改革の進展が中長期的な経済成長に寄与すると考えます。こうした中、アジア各国では今後も中間層および富裕層の拡大などを通じて相対的に高い経済成長を継続できると考えます。

◎今後の運用方針

- ・ 国別では中国を中心とする組み入れを維持します。セクター別では、アジア新興国の消費市場拡大による恩恵が期待できる小売関連セクターに加え、不動産関連セクターなどを選択して運用する方針です。中国の不動産関連セクターについては、政府が都市化プロセスの一環として、経済構造的に重要なセクターと位置付け、政策対応が期待できると見えますが、短期的には市場変動が大きくなるリスクもあることから、個別銘柄の動向に注視しながら銘柄分散に留意して運用を継続します。

○1万口当たりの費用明細

(2016年6月11日～2016年12月12日)

項 目	第48期～第53期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 117	% 0.874	(a)信託報酬＝作成期中の平均基準価額×信託報酬率× (作成期中の日数÷年間日数)
(投 信 会 社)	(71)	(0.528)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(43)	(0.325)	交付運用報告書等各种書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(3)	(0.022)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) そ の 他 費 用	2	0.016	(b)その他費用＝作成期中のその他費用÷作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(2)	(0.013)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(監 査 費 用)	(0)	(0.002)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
(そ の 他)	(0)	(0.001)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	119	0.890	
作成期中の平均基準価額は、13,355円です。			

(注) 作成期間の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は、追加・解約により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) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 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)を作成期間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。

○売買及び取引の状況

(2016年6月11日～2016年12月12日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第48期～第53期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アジア・ハイイールド債券マザーファンド	千口 19,941	千円 40,000	千口 81,890	千円 154,100

○利害関係人との取引状況等

(2016年6月11日～2016年12月12日)

利害関係人との取引状況

<三菱UFJ アジア・ハイイールド債券ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)>

該当事項はございません。

<アジア・ハイイールド債券マザーファンド>

区 分	第48期～第53期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	135	54	40.0	337	8	2.4

平均保有割合 43.8%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

利害関係人とは、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であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱東京UFJ銀行です。

○組入資産の明細

(2016年12月12日現在)

親投資信託残高

銘 柄	第47期末		第53期末	
	口 数		口 数	評 価 額
	千口		千口	千円
アジア・ハイイールド債券マザーファンド	384,301		322,351	667,976

○投資信託財産の構成

(2016年12月12日現在)

項 目	第53期末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
アジア・ハイイールド債券マザーファンド	667,976	97.8
コール・ローン等、その他	14,824	2.2
投資信託財産総額	682,800	100.0

(注) アジア・ハイイールド債券マザーファンドにおいて、作成期末における外貨建純資産(1,516,800千円)の投資信託財産総額(1,524,344千円)に対する比率は99.5%です。

(注) 外貨建資産は、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。なお、作成期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1アメリカドル=115.47円			
-----------------	--	--	--

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第48期末	第49期末	第50期末	第51期末	第52期末	第53期末
	2016年7月11日現在	2016年8月10日現在	2016年9月12日現在	2016年10月11日現在	2016年11月10日現在	2016年12月12日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	675,023,980	664,051,452	665,609,182	662,545,106	641,300,930	682,800,944
コール・ローン等	34,713,227	14,292,407	15,168,112	21,809,203	14,147,927	14,824,286
アジア・ハイールド債券マザーファンド(評価額)	640,310,753	649,759,045	650,441,070	640,735,903	627,153,003	667,976,658
(B) 負債	22,158,485	4,539,406	8,977,775	9,189,244	4,250,423	8,260,977
未払収益分配金	3,599,532	3,564,445	3,493,961	3,436,995	3,318,106	3,240,111
未払解約金	17,542,770	—	4,442,756	4,855,427	—	3,980,768
未払信託報酬	1,013,498	972,424	1,038,345	894,487	929,889	1,037,389
未払利息	60	20	23	16	19	20
その他未払費用	2,625	2,517	2,690	2,319	2,409	2,689
(C) 純資産総額(A-B)	652,865,495	659,512,046	656,631,407	653,355,862	637,050,507	674,539,967
元本	514,218,905	509,206,571	499,137,314	490,999,375	474,015,201	462,873,082
次期繰越損益金	138,646,590	150,305,475	157,494,093	162,356,487	163,035,306	211,666,885
(D) 受益権総口数	514,218,905口	509,206,571口	499,137,314口	490,999,375口	474,015,201口	462,873,082口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,696円	12,952円	13,155円	13,307円	13,439円	14,573円

○損益の状況

項 目	第48期	第49期	第50期	第51期	第52期	第53期
	2016年6月11日～ 2016年7月11日	2016年7月12日～ 2016年8月10日	2016年8月11日～ 2016年9月12日	2016年9月13日～ 2016年10月11日	2016年10月12日～ 2016年11月10日	2016年11月11日～ 2016年12月12日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	△ 786	△ 572	△ 596	△ 524	△ 508	△ 699
受取利息	4	6	—	34	—	—
支払利息	△ 790	△ 578	△ 596	△ 558	△ 508	△ 699
(B) 有価証券売買損益	△ 27,398,320	17,265,089	14,614,374	11,781,149	10,544,791	55,076,443
売買益	992,948	18,048,292	14,704,414	11,797,019	10,688,817	58,770,320
売買損	△ 28,391,268	△ 783,203	△ 90,040	△ 15,870	△ 144,026	△ 3,693,877
(C) 信託報酬等	△ 1,016,123	△ 974,941	△ 1,041,035	△ 896,806	△ 932,298	△ 1,040,078
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 28,415,229	16,289,576	13,572,743	10,883,819	9,611,985	54,035,666
(E) 前期繰越損益金	△ 7,334,030	△ 38,574,195	△ 25,107,197	△ 14,723,481	△ 6,993,357	△ 634,061
(F) 追加信託差損益金	177,995,381	176,154,539	172,522,508	169,633,144	163,734,784	161,505,391
(配当等相当額)	(194,991,841)	(194,233,779)	(191,414,317)	(188,744,321)	(182,684,953)	(185,550,886)
(売買損益相当額)	(△ 16,996,460)	(△ 18,079,240)	(△ 18,891,809)	(△ 19,111,177)	(△ 18,950,169)	(△ 24,045,495)
(G) 計(D+E+F)	142,246,122	153,869,920	160,988,054	165,793,482	166,353,412	214,906,996
(H) 収益分配金	△ 3,599,532	△ 3,564,445	△ 3,493,961	△ 3,436,995	△ 3,318,106	△ 3,240,111
次期繰越損益金(G+H)	138,646,590	150,305,475	157,494,093	162,356,487	163,035,306	211,666,885
追加信託差損益金	177,995,381	176,154,539	172,522,508	169,633,144	163,734,784	161,505,391
(配当等相当額)	(195,001,242)	(194,257,235)	(191,431,356)	(188,752,676)	(182,695,328)	(185,741,475)
(売買損益相当額)	(△ 17,005,861)	(△ 18,102,696)	(△ 18,908,848)	(△ 19,119,532)	(△ 18,960,544)	(△ 24,236,084)
分配準備積立金	114,037,936	111,842,688	108,863,747	106,342,048	102,105,772	93,236,627
繰越損益金	△153,386,727	△137,691,752	△123,892,162	△113,618,705	△102,805,250	△ 43,075,133

(注) (B) 有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (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) (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。

<注記事項>

- ①作成期首(前作成期末)元本額 531,098,330円
 作成期中追加設定元本額 52,259,771円
 作成期中一部解約元本額 120,485,019円
 また、1口当たり純資産額は、作成期末1,4573円です。

②分配金の計算過程

項 目	2016年6月11日～ 2016年7月11日	2016年7月12日～ 2016年8月10日	2016年8月11日～ 2016年9月12日	2016年9月13日～ 2016年10月11日	2016年10月12日～ 2016年11月10日	2016年11月11日～ 2016年12月12日
費用控除後の配当等収益額	2,903,664円	3,614,076円	3,724,895円	3,124,201円	3,222,041円	3,920,294円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	—円	—円	—円	—円	—円	—円
収益調整金額	195,001,242円	194,257,235円	191,431,356円	188,752,676円	182,695,328円	185,741,475円
分配準備積立金額	114,733,804円	111,793,057円	108,632,813円	106,654,842円	102,201,837円	92,556,444円
当ファンドの分配対象収益額	312,638,710円	309,664,368円	303,789,064円	298,531,719円	288,119,206円	282,218,213円
1万円当たり収益分配対象額	6,079円	6,081円	6,086円	6,080円	6,078円	6,097円
1万円当たり分配金額	70円	70円	70円	70円	70円	70円
収益分配金金額	3,599,532円	3,564,445円	3,493,961円	3,436,995円	3,318,106円	3,240,111円

- ③「アジア・ハイイールド債券マザーファンド」の信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の57.5以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

○分配金のお知らせ

	第48期	第49期	第50期	第51期	第52期	第53期
1万円当たり分配金(税込み)	70円	70円	70円	70円	70円	70円

◆分配金は各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

◆分配金を再投資される方のお手取分配金は、各決算日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。

◆課税上の取り扱い

- ・分配金は、分配後の基準価額と個々の受益者の個別元本との差により、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」に分かれます。
- ・分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、全額が普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、残りの額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金(特別分配金)が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・個人受益者が支払いを受ける収益分配金のうち普通分配金については配当所得として課税され、原則として、20.315%(所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%)の税率で源泉徴収(申告不要)されます。確定申告を行い、総合課税・申告分離課税を選択することもできます。

※法人受益者に対する課税は異なります。

※課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

※NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。

*三菱UFJ国際投信では本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ(<http://www.am.mufg.jp/>)をご覧ください。

[お知らせ]

- ①信用リスクを適正に管理する方法を新たに定める(分散型に分類)ため、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
(2016年9月10日)
- ②2014年1月1日から、2037年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税15%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、20.315%(所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%(法人受益者は15.315%の源泉徴収が行われます。))の税率が適用されます。

○ (参考情報) 親投資信託の組入資産の明細

(2016年12月12日現在)

<アジア・ハイールド債券マザーファンド>

下記は、アジア・ハイールド債券マザーファンド全体(731,240千口)の内容です。

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	第53期末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	12,323	12,552	1,449,433	95.7	93.9	26.5	54.1	15.1
合 計	12,323	12,552	1,449,433	95.7	93.9	26.5	54.1	15.1

(注) 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) 組入比率は、親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	利 率	額面金額	第53期末			償還年月日
			評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ	%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
普通社債券	10.0	300	237	27,452	2019/2/1	
	10.25	200	217	25,060	2019/7/21	
	10.75	200	212	24,509	2020/1/22	
	11.25	300	328	37,906	2019/6/4	
	4.625	200	203	23,498	2018/4/3	
	4.7	200	191	22,055	2021/9/6	
	4.875	200	191	22,089	2023/8/16	
	5.0	250	254	29,415	2020/5/7	
	5.0	200	201	23,213	2019/8/9	
	5.25	250	251	29,027	2022/2/10	
	5.325	400	403	46,534	2018/4/16	
	5.75	200	212	24,490	2024/10/30	
	5.95	400	393	45,379	2024/7/31	
	6.125	250	261	30,145	2020/2/4	
	6.125	200	207	24,004	2026/10/31	
	6.25	400	413	47,702	2020/2/24	
	6.5	280	275	31,838	2023/10/5	
	6.5	300	310	35,895	2019/1/18	
	6.5	200	207	23,967	2019/9/11	
	6.75	200	227	26,300	2021/4/15	
	6.75	400	410	47,414	2019/9/19	
	6.875	250	261	30,166	2022/4/1	
	6.875	300	250	28,940	2018/2/6	
	6.95	325	330	38,184	2020/3/27	
	7.0	400	411	47,486	2022/4/11	
	7.125	200	211	24,386	2019/7/2	
	7.375	200	198	22,950	2021/10/4	
	7.5	400	421	48,650	2023/1/10	
	7.625	350	356	41,123	2017/6/26	
	8.0	450	447	51,623	2021/4/15	
	8.0	275	291	33,661	2019/8/1	
	8.0	200	203	23,528	2017/5/17	
	8.125	200	216	25,010	2021/1/22	
	8.125	350	351	40,535	2018/4/22	
	8.25	400	419	48,381	2021/6/7	
	8.5	250	257	29,698	2020/11/24	
	8.5	250	260	30,094	2020/12/1	
	8.625	293	307	35,524	2020/2/5	
	8.75	200	209	24,190	2020/1/24	
	8.875	200	210	24,345	2019/1/27	
	9.75	250	266	30,816	2019/8/5	
	9.75	200	210	24,336	2018/7/25	
	6.375	400	402	46,446	2022/4/30	
	8.25	250	251	29,033	2049/1/29	
	5.35	200	194	22,415	2049/12/29	
合 計				1,449,433		

(注) 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。

アジア・ハイールド債券マザーファンド

《第4期》決算日2016年6月10日

[計算期間：2015年6月11日～2016年6月10日]

「アジア・ハイールド債券マザーファンド」は、6月10日に第4期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第4期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	日本を除くアジアの米ドル建てハイールド債券等を主要投資対象とし、値上がり益の獲得および利子収益の確保をめざします。また、ファンドの流動性等を勘案して、一部、米国債等に投資する場合があります。債券への投資にあたっては、マクロ要因を含む社債市場の分析、発行体のファンダメンタルズ分析等の信用リスク分析を行い、債券のバリュエーションを考慮して銘柄選定を行います。投資する債券は、原則として取得時においてCCC格相当以上の格付けを取得しているもの、もしくは運用委託先の格付基準によりCCC格相当以上の格付けを付与されているものに限り、デュレーション調整等のため、債券先物取引等を利用する場合があります。債券等の運用にあたっては、モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インクに運用指図に関する権限を委託します。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
主要運用対象	日本を除くアジアの米ドル建てハイールド債券等を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		(参考指数) BofAメリルリンチ アジアンダラーハイールド コーポレートインデックス (円換算ベース)		新株予約権付社債 (転換社債) 組入比率	債券 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	期騰落率	中率	期騰落率	中率				
(設定日)	円	%	%	%	%	%	%	百万円
2012年7月12日	10,000	—	26,201.80	—	—	—	—	2,010
1期(2013年6月10日)	14,004	40.0	36,109.49	37.8	4.9	91.5	—	13,524
2期(2014年6月10日)	15,944	13.9	40,402.54	11.9	4.7	89.8	—	4,431
3期(2015年6月10日)	19,869	24.6	51,210.81	26.8	—	95.1	—	2,463
4期(2016年6月10日)	18,130	△ 8.8	47,932.93	△ 6.4	—	95.2	—	1,516

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 基準価額動向の理解に資するため、参考指数を掲載しておりますが、当ファンドのベンチマークではありません。

(注) 参考指数は、BofAメリルリンチ アジアンダラーハイールドコーポレートインデックス(円換算ベース)です。

BofAメリルリンチ アジアンダラーハイールドコーポレートインデックスとは、BofAメリルリンチ社が算出するアジアのハイールド債券の値動きを表す指数です。BofAメリルリンチ アジアンダラーハイールドコーポレートインデックス(円換算ベース)は、BofAメリルリンチ アジアンダラーハイールドコーポレートインデックスをもとに、委託会社が計算したものです。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		(参 考 指 数) B o f A メリルリンチ アジアン ダラー ハイイールド コーポレート インデックス (円換算ベース)		新株予約権付社債 (転換社債) 組 入 比 率	債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	円	騰 落 率 %	円	騰 落 率 %			
(期 首) 2015年6月10日	19,869	—	51,210.81	—	—	95.1	—
6月末	19,657	△ 1.1	50,764.59	△0.9	—	93.5	—
7月末	19,833	△ 0.2	51,433.68	0.4	—	95.6	—
8月末	18,878	△ 5.0	49,008.34	△4.3	—	93.7	—
9月末	18,361	△ 7.6	47,827.81	△6.6	—	96.1	—
10月末	19,550	△ 1.6	50,573.80	△1.2	—	93.4	—
11月末	19,755	△ 0.6	51,201.57	△0.0	—	95.6	—
12月末	18,942	△ 4.7	49,747.04	△2.9	—	93.9	—
2016年1月末	18,492	△ 6.9	49,033.57	△4.3	—	93.3	—
2月末	17,565	△11.6	46,809.39	△8.6	—	94.7	—
3月末	18,016	△ 9.3	48,000.89	△6.3	—	92.8	—
4月末	18,144	△ 8.7	47,888.97	△6.5	—	95.2	—
5月末	18,632	△ 6.2	49,229.29	△3.9	—	96.3	—
(期 末) 2016年6月10日	18,130	△ 8.8	47,932.93	△6.4	—	95.2	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

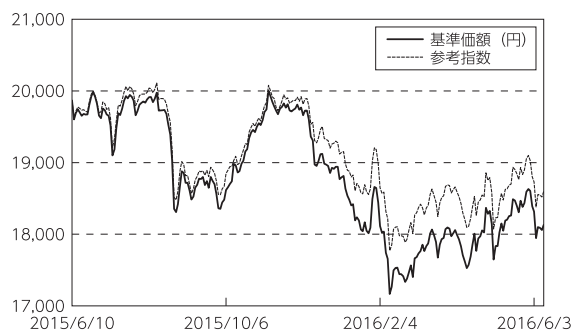
○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ8.8%の下落となりました。

基準価額の推移



(注) 参考指数は期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

●投資環境について

◎債券市況

- ・期首から2016年2月中旬にかけては、中国経済に対する不透明感が高まったこと、商品市況が下落したことなどを背景にリスク回避の動きが強まり、アジア・ハイイールド債券のスプレッド（国債金利に対する上乗せ金利）が拡大し、アジア・ハイイールド債券市況はもみ合う展開となりながらも軟調に推移（利回りは上昇）しました。
- ・2月中旬から期末にかけては、米国の利上げペースが緩やかなものになるとの見方が広がったこと、商品市況が上昇したことなどを背景にリスク回避の動きが後退し、アジア・ハイイールド債券のスプレッドが縮小し、アジア・ハイイールド債券市況は上昇しました。
- ・期を通じてみると、アジア・ハイイールド債券市況は上昇しました。

◎為替市況

- ・期首から2015年10月中旬にかけては中国の景気減速懸念の高まりなどを背景に投資家のリスク回避的な動きが強まり、米ドルは対円で下落しました。その後、12月中旬から2016年1月中旬にかけては中国経済に対する不透明感が高まったこと、原油価格が下落したことなどを背景にリスク回避の動きが強まり、さらに円高・米ドル安が進行しました。1月中旬から期末にかけては米国の利上げペースが緩やかなものになるとの見方が広がったことなどが材料視され、一段と円高・米ドル安の進行が継続しました。
- ・その結果、期を通じて見ると、米ドルは対円で下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・国別では、ファンダメンタルズと比べて割安感があると考えられる中国の組入比率を高めとした一方、利回りの観点から魅力度の劣るフィリピンや韓国は非保有としました。格付配分では、B格相当の銘柄への投資を多めとしました。セク

ター別では、不動産関連セクターなどの組入比率を高めに維持するとともに、アジア新興国の消費市場拡大による恩恵が期待できる小売関連セクターなどへの配分を市場平均対比多めとする一方、利回り水準が低く金利感応度の高い公益セクターなどへの配分を市場平均対比少なめとしました。

- ・前記の運用を行った結果、保有していた不動産関連銘柄が概ね上昇したことなどが基準価額にプラスに寄与したものの、円高・米ドル安が進行したことなどがマイナスに影響し、基準価額は下落しました。

◎今後の運用方針

◎運用環境の見通し

- ・米国では世界経済の動向を確認しながら緩やかなペースで追加利上げが実施される可能性が高いと予想していること、日本やユーロ圏などの他の先進国では緩和的な金融政策が維持されると見ていることなどから、アジア・ハイイールド債券市況には相対的に高い利回りを求める投資家からの資金流入が期待できると見えています。
- ・アジア各国では、原油価格が中長期的な観点から見て低水準で推移していることなどを背景にインフレ懸念が後退していることから、景気が減速しても緩和的な金融政策による景気下支えが期待できると考えます。また、中長期的には中間層および富裕層の拡大などを通じて相対的に高い経済成長を継続できると考えます。中国では、経済成長ペースがやや鈍化すると想定されるものの、政府が景気刺激策の実施などによって景気を下支えすると見ており、また構造改革にも着手していることなどから中長期的な経済成長も期待できると考えます。インドやインドネシアでは、構造改革の進展が中長期的な経済成長に寄与すると考えます。

◎今後の運用方針

- ・国別では中国を中心とする組み入れを維持します。セクター別では、アジア新興国の消費市場

拡大による恩恵が期待できる小売関連セクターに加え、不動産関連セクターなどを選好して運用する方針です。中国の不動産関連セクターについては、政府が都市化プロセスの一環として、経済構造的に重要なセクターと位置付け、政策対応が期待できると見ていますが、短期的には市況変動が大きくなるリスクもあることから、個別銘柄の動向に注視しながら銘柄分散に留意して運用を継続します。

○1万口当たりの費用明細

(2015年6月11日～2016年6月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円	%	(a)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)	6	0.032	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(そ の 他)	(6)	(0.031)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	(0)	(0.001)	
期中の平均基準価額は、18,818円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 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。

○売買及び取引の状況

(2015年6月11日～2016年6月10日)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外 国	アメリカ	社債券	千アメリカドル 2,796	千アメリカドル 6,564 (1,122)

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

○利害関係人との取引状況等

(2015年6月11日～2016年6月10日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 64	百万円 48	% 75.0	百万円 833	百万円 102	% 12.2

利害関係人とは、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であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2016年6月10日現在)

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	13,511	13,477	1,443,387	95.2	93.6	16.9	62.3	16.0
合 計	13,511	13,477	1,443,387	95.2	93.6	16.9	62.3	16.0

(注) 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) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	利率	当期末			償還年月日
			額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
普通社債券	10 GLOBAL A&T ELE 190201	10.0	500	357	38,288	2019/2/1
	10.25 FUTURE LAND 190721	10.25	200	219	23,545	2019/7/21
	10.75 FANTASIA HL 200122	10.75	400	425	45,573	2020/1/22
	11.25 LOGAN PROPE 190604	11.25	300	332	35,621	2019/6/4
	11.625 VINGROUP 180507	11.625	250	270	28,983	2018/5/7
	4.625 TATA MOTORS 200430	4.625	250	261	28,000	2020/4/30
	4.625 TBG GLOBAL 180403	4.625	200	204	21,926	2018/4/3
	5 CHINA OIL AND G 200507	5.0	250	248	26,587	2020/5/7
	5.25 TBG GLOBAL P 220210	5.25	250	250	26,832	2022/2/10
	5.325 BANK OF CEY 180416	5.325	400	400	42,840	2018/4/16
	5.95 ABJA INVESTM 240731	5.95	400	384	41,126	2024/7/31
	6.125 CAR INC 200204	6.125	250	259	27,843	2020/2/4
	6.25 SOLUSI TUNAS 200224	6.25	400	405	43,417	2020/2/24
	6.5 TEXHONG TEXT 190118	6.5	300	313	33,614	2019/1/18
	6.5 WEST CHINA 190911	6.5	200	210	22,588	2019/9/11
	6.75 FRANSHION DE 210415	6.75	200	229	24,541	2021/4/15
	6.75 MPM GLOBAL 190919	6.75	400	400	42,898	2019/9/19
	6.875 MIE HOLDIN 180206	6.875	300	238	25,581	2018/2/6
	6.875 SPARKLE ASS 200130	6.875	300	314	33,696	2020/1/30
	6.95 ALAM SYNERGY 200327	6.95	325	299	32,109	2020/3/27
	6.95 LISTRINDO 190221	6.95	200	208	22,319	2019/2/21
	7 THETA CAPITAL 220411	7.0	400	408	43,792	2022/4/11
	7.125 PAKUWON PRI 190702	7.125	200	211	22,674	2019/7/2
	7.25 361 DEGREES 210603	7.25	200	203	21,845	2021/6/3
	7.5 COUNTRY GAR 230110	7.5	400	426	45,685	2023/1/10
	7.5 JABABEKA INTE 190924	7.5	480	495	53,110	2019/9/24
	7.625 CHINA HONGQ 170626	7.625	350	359	38,493	2017/6/26
	8 BCP SINGAPORE 210415	8.0	250	206	22,089	2021/4/15
	8 GREENKO DUTCH B 190801	8.0	275	298	31,919	2019/8/1
	8 VN JSC BK FOR I 170517	8.0	200	207	22,196	2017/5/17
	8.125 SHIMAO PPTY 210122	8.125	200	220	23,650	2021/1/22
	8.125 YINGDE GASE 180422	8.125	350	271	29,050	2018/4/22
	8.25 VEDANTA RESO 210607	8.25	600	495	53,014	2021/6/7
	8.5 STATS CHIPPAC 201124	8.5	250	256	27,511	2020/11/24
	8.5 STUDIO CITY F 201201	8.5	250	250	26,808	2020/12/1
	8.625 KWG PROP 200205	8.625	293	313	33,539	2020/2/5
	8.75 CAIFU HOLDIN 200124	8.75	200	212	22,733	2020/1/24
	8.75 YUZHOU PROPE 181004	8.75	200	212	22,708	2018/10/4
	8.875 CIFI HOLDIN 190127	8.875	400	430	46,158	2019/1/27
	9.375 SUNAC CHINA 180405	9.375	300	315	33,768	2018/4/5
	9.75 PACIFIC EMER 180725	9.75	500	521	55,825	2018/7/25
	STEP ICICI BANK 220430	6.375	400	408	43,753	2022/4/30
	VAR AGILE PROPERT 490129	8.25	250	235	25,175	2049/1/29

銘柄		当 期 末				
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	普通社債券 VAR BANK OF EAS 491229	5.5	288	279	29,946	2049/12/29
合	計				1,443,387	

(注) 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。

○投資信託財産の構成

(2016年6月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 1,443,387	% 95.2
コール・ローン等、その他	72,885	4.8
投資信託財産総額	1,516,272	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (1,508,718千円) の投資信託財産総額 (1,516,272千円) に対する比率は99.5%です。

(注) 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す。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル=107.10円		
------------------	--	--

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年6月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,516,272,811
コール・ローン等	45,589,559
公社債(評価額)	1,443,387,799
未収利息	26,641,280
前払費用	654,173
(B) 負債	18
未払利息	9
その他未払費用	9
(C) 純資産総額(A-B)	1,516,272,793
元本	836,328,253
次期繰越損益金	679,944,540
(D) 受益権総口数	836,328,253口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,130円

<注記事項>

- ①期首元本額 1,239,981,915円
 期中追加設定元本額 47,299,272円
 期中一部解約元本額 450,952,934円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.8130円です。

②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

三菱UFJ アジア・ハイイールド債券ファンド<為替ヘッジあり>(毎月決算型)	452,027,205円
三菱UFJ アジア・ハイイールド債券ファンド<為替ヘッジなし>(毎月決算型)	384,301,048円
合計	836,328,253円

○損益の状況 (2015年6月11日～2016年6月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	138,201,119
受取利息	136,854,675
その他収益金	1,347,281
支払利息	△ 837
(B) 有価証券売買損益	△ 311,355,798
売買益	61,463,142
売買損	△ 372,818,940
(C) 保管費用等	△ 551,170
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 173,705,849
(E) 前期繰越損益金	1,223,746,727
(F) 追加信託差損益金	35,700,728
(G) 解約差損益金	△ 405,797,066
(H) 計(D+E+F+G)	679,944,540
次期繰越損益金(H)	679,944,540

- (注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
 (注) (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) (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。

[お知らせ]

2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三菱UFJ国際投信株式会社へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。(2015年7月1日)