

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	2016年11月9日[当初、2020年12月10日]まで (2011年1月14日設定)	
運用方針	主として、アバディーン アジア・ボンド・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公社債を実質的な主要投資対象とし、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。 マザーファンドを通じて、外国通貨間において外国為替予約取引および直物為替先渡取引等を実質的に活用し、相対的な魅力度に応じて通貨配分を調整します。 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、原則として対円で為替ヘッジを行いません。アバディーン・アセット・マネジメント・アジア・リミテッドに外貨建て資産、外国為替予約取引および直物為替先渡取引等の運用の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	アバディーン アジア・ボンド・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公社債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。	

※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。

## 償還報告書 (全体版)

[繰上償還]

# アバディーン アジア・ ボンド・オープン (毎月決算型)

愛称：アジアンスパイス



第64期 (決算日：2016年7月11日)

第65期 (決算日：2016年8月10日)

第66期 (決算日：2016年9月12日)

第67期 (決算日：2016年10月11日)

信託終了日：2016年11月9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、「アバディーン アジア・ボンド・オープン (毎月決算型)」は、約款の規定に基づき、先般ご案内申し上げました予定通り、11月9日に繰り上げて償還させていただきました。ここに謹んで運用経過と償還内容を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

## アバディーン アジア・ボンド・オープン（毎月決算型）のご報告

◇最近29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
◇1万口当たりの費用明細	11
◇売買及び取引の状況	11
◇利害関係人との取引状況等	12
◇自社による当ファンドの設定・解約状況	12
◇組入資産の明細	12
◇投資信託財産の構成	13
◇特定資産の価格等の調査	13
◇資産、負債、元本及び基準（償還）価額の状況	13
◇損益の状況	14
◇投資信託財産運用総括表	15
◇分配金のお知らせ	17
◇償還金のお知らせ	17
◇お知らせ	17

## マザーファンドのご報告

◇アバディーン アジア・ボンド・マザーファンド	18
-------------------------	----

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29期の運用実績

決算期	基準価額			(参考指数) HSBCアジア・ローカル・ ボンド・インデックス		(参考指数) Markit iBoxxアジア・ ローカル・ボンド・インデックス		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 分 配	み 金 騰 落	中 期 騰 落	中 期 騰 落	中 期 騰 落	中 期 騰 落			
	円 銭	円	%	(円換算ベース)	%	(円換算ベース)	%	%	%	百万円
40期(2014年7月10日)	11,278	40	△0.3	26,468.13	△0.1			90.4	—	1,144
41期(2014年8月11日)	11,215	40	△0.2	26,495.05	0.1			92.1	—	1,116
42期(2014年9月10日)	11,647	40	4.2	27,821.16	5.0			90.0	—	1,145
43期(2014年10月10日)	11,596	40	△0.1	27,907.48	0.3			90.1	—	1,123
44期(2014年11月10日)	12,193	40	5.5	29,555.31	5.9			90.5	—	1,176
45期(2014年12月10日)	12,522	40	3.0	30,638.50	3.7			93.4	—	1,156
46期(2015年1月13日)	12,386	40	△0.8	30,531.78	△0.3			92.4	—	1,118
47期(2015年2月10日)	12,459	40	0.9	30,927.43	1.3			93.9	—	1,111
48期(2015年3月10日)	12,466	40	0.4	31,098.38	0.6			92.3	—	1,110
49期(2015年4月10日)	12,560	40	1.1	31,548.31	1.4			94.5	—	1,096
50期(2015年5月11日)	12,186	40	△2.7	30,977.02	△1.8			94.3	—	1,058
51期(2015年6月10日)	12,425	40	2.3	31,668.85	2.2			92.6	—	1,073
52期(2015年7月10日)	12,159	40	△1.8	31,083.89	△1.8			88.3	—	1,009
53期(2015年8月10日)	12,232	40	0.9	31,278.44	0.6			89.5	—	1,009
54期(2015年9月10日)	11,334	40	△7.0	29,234.89	△6.5			90.0	—	908
55期(2015年10月13日)	11,696	40	3.5	30,330.68	3.7			93.3	—	919
56期(2015年11月10日)	11,778	40	1.0	30,547.81	0.7			91.5	—	922
57期(2015年12月10日)	11,537	40	△1.7	30,225.68	△1.1			92.3	—	884
58期(2016年1月12日)	11,083	40	△3.6	28,978.80	△4.1			92.2	—	842
59期(2016年2月10日)	10,922	40	△1.1	28,954.98	△0.1			89.8	—	832
60期(2016年3月10日)	10,795	40	△0.8	29,009.29	0.2			89.3	—	816
61期(2016年4月11日)	10,573	40	△1.7			28,701.85		92.4	—	795
62期(2016年5月10日)	10,454	40	△0.7			28,566.97	△0.5	93.5	—	781
63期(2016年6月10日)	10,385	40	△0.3			28,502.64	△0.2	94.9	—	774
64期(2016年7月11日)	9,848	40	△4.8			27,062.53	△5.1	96.0	—	734
65期(2016年8月10日)	10,028	40	2.2			27,816.29	2.8	96.5	—	735
66期(2016年9月12日)	10,052	40	0.6			28,168.73	1.3	93.4	—	740
67期(2016年10月11日)	10,035	40	0.2			28,298.34	0.5	94.3	—	721
(償還時) 68期(2016年11月9日)	(償還価額) 9,924.53	—	△1.1			27,385.41	△3.2	—	—	699

- (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) Markit iBoxx アジア・ローカル・ボンド・インデックスとは、日本を除くアジア各国・地域の、比較的流動性があり、海外の投資家が参加できるマーケットの現地通貨建て債券で構成される指数です。Markit iBoxx アジア・ローカル・ボンド・インデックス(円換算ベース)は、Markit iBoxx アジア・ローカル・ボンド・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。ただし、設定から2016年3月31日まではHSBCアジア・ローカル・ボンド・インデックス(円換算ベース)です。参考指数はこれらを連続させて指数化したものです。  
(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、「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 ) Markit iBorxx アジア・ ローカル・ボンド・インデックス (円換算ベース)		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64期	(期 首) 2016年6月10日	円 銭 10,385	% —	28,502.64	% —	94.9	—
	6 月 末	10,050	△3.2	27,451.82	△3.7	95.2	—
	(期 末) 2016年7月11日	9,888	△4.8	27,062.53	△5.1	96.0	—
第65期	(期 首) 2016年7月11日	9,848	—	27,062.53	—	96.0	—
	7 月 末	10,281	4.4	28,392.92	4.9	95.7	—
	(期 末) 2016年8月10日	10,068	2.2	27,816.29	2.8	96.5	—
第66期	(期 首) 2016年8月10日	10,028	—	27,816.29	—	96.5	—
	8 月 末	10,073	0.4	28,119.78	1.1	93.0	—
	(期 末) 2016年9月12日	10,092	0.6	28,168.73	1.3	93.4	—
第67期	(期 首) 2016年9月12日	10,052	—	28,168.73	—	93.4	—
	9 月 末	9,872	△1.8	27,687.80	△1.7	93.0	—
	(期 末) 2016年10月11日	10,075	0.2	28,298.34	0.5	94.3	—
第68期	(期 首) 2016年10月11日	10,035	—	28,298.34	—	94.3	—
	10 月 末	9,932	△1.0	28,070.58	△0.8	—	—
	(償還時) 2016年11月9日	(償還価額) 9,924.53	△1.1	27,385.41	△3.2	—	—

(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合わせるので、「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

### 設定来の基準価額等の推移について

（第1期～第68期：2011/1/14～2016/11/9）

#### 基準価額の動き

償還価額は設定時に比べ24.0%（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

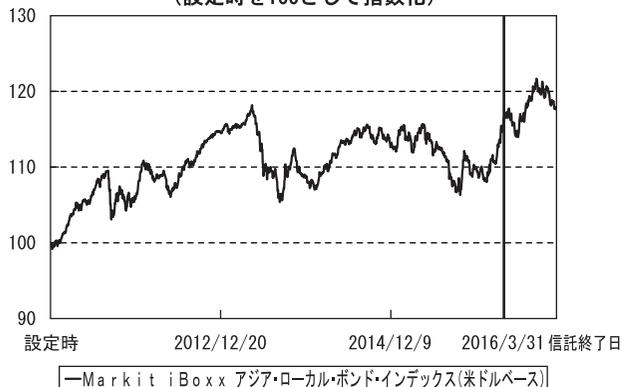
#### 上昇要因

債券利子収入を享受したほか、アジア債券市況が上昇（利回りは低下）したこと、アジア通貨が概ね対円で上昇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1期～第68期：2011/1/14～2016/11/9）

債券市況の推移  
（設定時を100として指数化）



（注）現地日付ベースで記載しております。

（注）設定時から2016年3月31日まではHSBCアジア・ローカル・ボンド・インデックス（米ドルベース）です。グラフはこれらを連続させて指数化したものです。

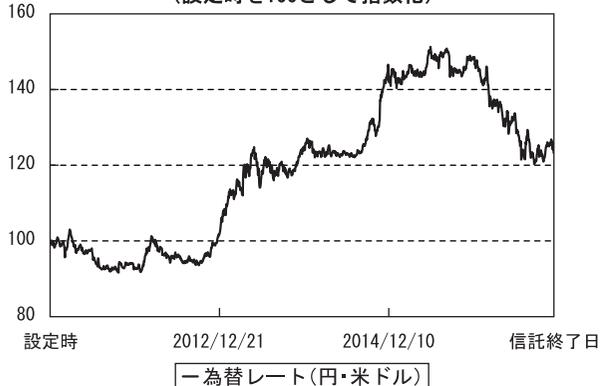
◎債券市況

・HSBCアジア・ローカル・ボンド・インデックス（米ドルベース）およびMarkit iBoxx アジア・ローカル・ボンド・インデックス（米ドルベース）で見ると、アジア債券市況は上昇しました。インドネシアを中心にアジア債券市況は上昇しました。インドネシアでは、2013年5月から2015年12月にかけて米国の金融引き締め観測が高まったことなどが影響し、債券利回りが上昇する局面がありました。その後は構造改革に対する進展期待やインドネシア銀行（中央銀行）の政策金利引き下げなどが影響し、信託期間を通じて見ると、債券利回りは低下しました。

為替市況の推移  
(設定時を100として指数化)



為替市況の推移  
(設定時を100として指数化)



◎為替市況

- ・ 設定時から2015年前半にかけては、2012年12月の衆議院選挙で自民党が勝利したこと、日銀が追加金融緩和策を実施したこと、米国で2013年5月以降金融引き締め観測が高まったことなどにより日米の金融政策の方向感の違いなどが意識されたことなどが影響し、円安・米ドル高が進行しました。こうした中、アジア通貨は円安・米ドル高が進行したことなどが影響し、対円で概ね上昇しました。
- ・ 2015年後半から信託終了日にかけては、原油価格が下落したこと、中国景気減速懸念が高まったこと、英国のEU（欧州連合）離脱問題に対する懸念が高まったこと、日本政府が発表した経済対策に対する失望感が高まったことなどを背景に、円高が進行し、アジア通貨は対円で下落しました。
- ・ その結果、信託期間を通じて見ると、マレーシアリングgitなど一部通貨を除き、アジア通貨は対円で概ね上昇しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

<アバディーン アジア・ボンド・オープン（毎月決算型）>

- ・ 主要投資対象であるアバディーン アジア・ボンド・マザーファンド受益証券への投資を通じて、アジア債券を高位に組み入れた運用を行いました。

<第1作成期（第1期～第3期：設定時～2011年6月10日）>

基準価額は設定時に比べ2.5%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。

＜第2作成期（第4期～第9期：2011年6月11日～2011年12月12日＞  
基準価額は当作成期首に比べ4.2%（分配金再投資ベース）の下落となりました。

＜第3作成期（第10期～第15期：2011年12月13日～2012年6月11日＞  
基準価額は当作成期首に比べ2.1%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。

＜第4作成期（第16期～第21期：2012年6月12日～2012年12月10日＞  
基準価額は当作成期首に比べ9.6%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。

＜第5作成期（第22期～第27期：2012年12月11日～2013年6月10日＞  
基準価額は当作成期首に比べ15.9%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。

＜第6作成期（第28期～第33期：2013年6月11日～2013年12月10日＞  
基準価額は当作成期首に比べ0.4%（分配金再投資ベース）の下落となりました。

＜第7作成期（第34期～第39期：2013年12月11日～2014年6月10日＞  
基準価額は当作成期首に比べ1.3%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。

＜第8作成期（第40期～第45期：2014年6月11日～2014年12月10日＞  
基準価額は当作成期首に比べ12.5%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。

＜第9作成期（第46期～第51期：2014年12月11日～2015年6月10日＞  
基準価額は当作成期首に比べ1.2%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。

＜第10作成期（第52期～第57期：2015年6月11日～2015年12月10日＞  
基準価額は当作成期首に比べ5.2%（分配金再投資ベース）の下落となりました。

＜第11作成期（第58期～第63期：2015年12月11日～2016年6月10日＞  
基準価額は当作成期首に比べ7.9%（分配金再投資ベース）の下落となりました。

＜第12作成期（第64期～第68期：2016年6月11日～信託終了日＞  
償還価額は当作成期首に比べ2.9%（分配金再投資ベース）の下落となりました。

＜アバディーン アジア・ボンド・マザーファンド＞  
償還価額は設定時に比べ37.3%の上昇となりました。

◎組入比率

- ・現物債券の組入比率は、繰上償還に備えてポジションを解消するまでの期間、高水準を維持しました。2016年10月下旬のポジション解消後は、現金で保有しました。

◎国別配分・金利戦略等

- ・債券戦略（国別配分等）では、相対的にファンダメンタルズが良好である韓国などを中心に運用しました。

◎為替戦略

- ・バリュエーションに基づいた戦略的な通貨配分を実施して運用しました。
- ・信託期間を通じて見ると、債券利子収入を享受したほか、アジア債券市況が上昇したこと、アジア通貨が概ね対円で上昇したことなどが基準価額の上昇要因となりました。

<第1作成期（第1期～第3期：設定時～2011年6月10日）>

基準価額は設定時に比べ3.2%の上昇となりました。

- ・アジア通貨の内、一部の通貨が円に対して下落したものの、アジア債券市況が上昇したことから、基準価額は上昇しました。

<第2作成期（第4期～第9期：2011年6月11日～2011年12月12日）>

基準価額は当作成期首に比べ3.4%の下落となりました。

- ・アジア債券市況が上昇したものの、アジア通貨が円に対して下落したことなどから、基準価額は下落しました。

<第3作成期（第10期～第15期：2011年12月13日～2012年6月11日）>

基準価額は当作成期首に比べ3.0%の上昇となりました。

- ・アジア債券市況が上昇し、アジア通貨が円に対して上昇したことなどから、基準価額は上昇しました。

<第4作成期（第16期～第21期：2012年6月12日～2012年12月10日）>

基準価額は当作成期首に比べ10.6%の上昇となりました。

- ・アジア債券市況が上昇し、アジア通貨が円に対して上昇したことなどから、基準価額は上昇しました。

<第5作成期（第22期～第27期：2012年12月11日～2013年6月10日）>

基準価額は当作成期首に比べ17.2%の上昇となりました。

- ・フィリピンなどの一部のアジア債券市況が上昇したこと、アジア通貨が円に対して上昇したことなどから、基準価額は上昇しました。

<第6作成期（第28期～第33期：2013年6月11日～2013年12月10日）>

基準価額は当作成期首に比べ0.5%の上昇となりました。

- ・アジア債券市況は下落したものの、アジア通貨が円に対して概ね上昇したことなどから、基準価額は上昇しました。

＜第7作成期（第34期～第39期：2013年12月11日～2014年6月10日＞

基準価額は当作成期首に比べ2.2%の上昇となりました。

- ・アジア債券市況が上昇したこと、アジア通貨の中で韓国ウォンなどが円に対して上昇したことなどが寄与し、基準価額は上昇しました。

＜第8作成期（第40期～第45期：2014年6月11日～2014年12月10日＞

基準価額は当作成期首に比べ13.8%の上昇となりました。

- ・アジア通貨が対円で上昇したこと、韓国やインドネシアをはじめとするアジア債券市況が概ね上昇したことが寄与し、基準価額は上昇しました。

＜第9作成期（第46期～第51期：2014年12月11日～2015年6月10日＞

基準価額は当作成期首に比べ2.1%の上昇となりました。

- ・アジア通貨が対円で概ね上昇したこと、韓国の債券市況が上昇したことなどが寄与し、基準価額は上昇しました。

＜第10作成期（第52期～第57期：2015年6月11日～2015年12月10日＞

基準価額は当作成期首に比べ4.5%の下落となりました。

- ・アジア通貨が対円で下落したこと、フィリピンの債券市況が下落したことなどが影響し、基準価額は下落しました。

＜第11作成期（第58期～第63期：2015年12月11日～2016年6月10日＞

基準価額は当作成期首に比べ7.3%の下落となりました。

- ・インドネシア債券市況が上昇したことなどがプラスに寄与したものの、アジア通貨が対円で下落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。

＜第12作成期（第64期～第68期：2016年6月11日～信託終了日＞

償還価額は当作成期首に比べ2.3%の下落となりました。

◎組入比率

- ・現物債券の組入比率は、繰上償還に備えてポジションを解消するまでの期間、高水準を維持しました。2016年10月下旬のポジション解消後は、現金で保有しました。

◎国別配分・金利戦略等

- ・債券戦略（国別配分等）では、相対的にファンダメンタルズが良好である韓国等を中心に運用しました。

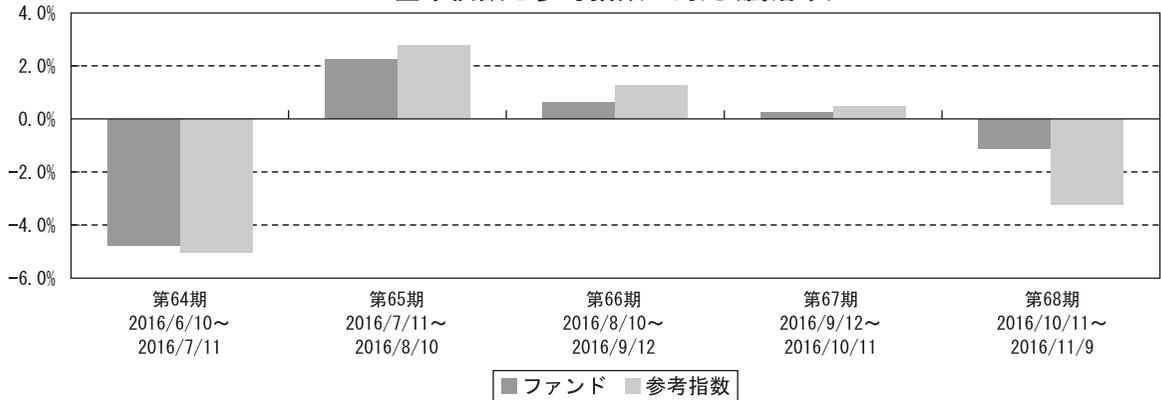
◎為替戦略

- ・為替戦略では、バリュエーションに基づいた戦略的な通貨配分を実施して運用しました。
- ・当作成期間を通じて見ると、アジア通貨が対円で下落したことなどが基準価額の下落要因となりました。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

（第64期～第68期：2016/6/11～信託終了日）

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Market iBoxx アジア・ローカル・ボンド・インデックス（円換算ベース）です。ただし、設定時から2016年3月31日まではHSBCアジア・ローカル・ボンド・インデックス（円換算ベース）です。参考指数はこれらを連続させて指数化したものです。
- ・なお、設定以来の基準価額は24.0%（分配金再投資ベース）の上昇、参考指数は45.3%の上昇となりました。

## 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、第1期に20円、第2期から第22期までは30円、第23期から第67期までは40円の分配とさせていただきます。信託期間中、累計で2,450円の分配を行わせていただきました。

### 【分配原資の内訳】

（単位：円、1万口当たり、税込み）

項 目	第64期	第65期	第66期	第67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
当期分配金 (対基準価額比率)	40 0.405%	40 0.397%	40 0.396%	40 0.397%
当期の収益	13	25	22	17
当期の収益以外	26	14	17	22
翌期繰越分配対象額	2,482	2,468	2,450	2,429

（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。

## 償還価額

<アバディーン アジア・ボンド・オープン（毎月決算型）>

償還価額は9,924円53銭となりました。

信託期間中はご愛顧を賜り、誠にありがとうございました。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年6月11日～2016年11月9日)

項 目	第64期～第68期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	70	0.698	(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 ）	(41)	(0.406)	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 ）	(27)	(0.270)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
（ 受 託 会 社 ）	( 2)	(0.023)	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	28	0.280	(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 ）	( 5)	(0.048)	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 ）	(23)	(0.230)	信託事務の処理等に要するその他諸費用（主に、取引主体識別コードの登録（更新）手数料、インドネシアの公社債売却にかかる取引税）
合 計	98	0.978	
作成期中の平均基準価額は、10,041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11月9日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第64期～第68期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アバディーン アジア・ボンド・マザーファンド	千口 —	千円 —	千口 541,620	千円 743,771

○利害関係人との取引状況等

(2016年6月11日～2016年11月9日)

利害関係人との取引状況

<アバディーン アジア・ボンド・オープン（毎月決算型）>

該当事項はございません。

<アバディーン アジア・ボンド・マザーファンド>

区 分	第64期～第68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	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 2,077	百万円 —	% —	百万円 2,816	百万円 42	% 1.5

平均保有割合 100.0%

※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、三菱UFJ信託銀行です。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

作成期首残高(元本)	当作成期設定元本	当作成期解約元本	作成期末残高(元本)	取引の理由
百万円 410	百万円 —	百万円 —	百万円 410	当初設定時における取得

○組入資産の明細

(2016年11月9日現在)

信託終了日現在、有価証券等の組入れはございません。

親投資信託残高

銘	柄	第63期末	
		口	数
アバディーン アジア・ボンド・マザーファンド			千口 541,620

○投資信託財産の構成

（2016年11月9日現在）

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コール・ローン等、その他	千円 701,734	% 100.0
投資信託財産総額	701,734	100.0

○特定資産の価格等の調査

アバディーン アジア・ボンド・マザーファンド（2016年6月11日～2016年11月8日）

特 定 資 産 の 種 類	件 数
直物為替先渡取引	23

当作成期に、アバディーン アジア・ボンド・オープン（毎月決算型）の主要投資対象であるアバディーン アジア・ボンド・マザーファンドにおいて行った取引のうち、「投資信託及び投資法人に関する法律」第11条に基づき価格等の調査が必要とされた資産の取引については、PwCあらた監査法人へその調査を委託し、調査報告書を受領しました。当該取引については、取引相手方の名称、通貨の種類、売買別、想定元本、満期日、その他当該取引の内容に関することについて調査を依頼しました。

○資産、負債、元本及び基準（償還）価額の状況

項 目	第64期末	第65期末	第66期末	第67期末	償 還 時
	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9日現在
	円	円	円	円	円
(A) 資産	738,192,220	739,833,568	744,932,684	730,978,592	701,734,082
コール・ローン等	13,287,701	11,551,573	18,803,003	10,029,782	701,734,082
アバディーンアジア・ボンド・マザーファンド(詳細)	724,904,519	728,281,995	726,129,681	706,948,810	—
未収入金	—	—	—	14,000,000	—
(B) 負債	4,049,994	3,974,091	4,067,184	9,535,628	2,698,535
未払収益分配金	2,981,983	2,935,175	2,948,016	2,875,778	—
未払解約金	—	—	—	5,692,007	1,754,854
未払信託報酬	1,065,113	1,036,102	1,116,126	965,228	940,186
未払利息	23	16	29	7	957
その他未払費用	2,875	2,798	3,013	2,608	2,538
(C) 純資産総額(A-B)	734,142,226	735,859,477	740,865,500	721,442,964	699,035,547
元本	745,495,867	733,793,791	737,004,128	718,944,520	704,351,107
次期繰越損益金	△ 11,353,641	2,065,686	3,861,372	2,498,444	—
償還差損金	—	—	—	—	△ 5,315,560
(D) 受益権総口数	745,495,867口	733,793,791口	737,004,128口	718,944,520口	704,351,107口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,848円	10,028円	10,052円	10,035円	—
1万口当たり償還価額(C/D)	—	—	—	—	9,924円53銭

## ○損益の状況

項 目	第64期	第65期	第66期	第67期	第68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9日
	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	△ 670	△ 407	△ 746	△ 418	△ 1,338
受取利息	8	5	—	29	—
支払利息	△ 678	△ 412	△ 746	△ 447	△ 1,338
(B) 有価証券売買損益	△ 35,995,568	17,185,618	5,872,224	2,522,515	△ 6,862,066
売買益	21,800	17,677,035	5,918,165	2,606,066	107,542
売買損	△ 36,017,368	△ 491,417	△ 45,941	△ 83,551	△ 6,969,608
(C) 信託報酬等	1,067,988	△ 1,038,900	△ 1,119,139	△ 967,836	△ 942,724
(D) 当期損益金 (A+B+C)	△ 37,064,226	16,146,311	4,752,339	1,554,261	△ 7,806,128
(E) 前期繰越損益金	12,215,605	△ 27,351,426	△ 14,050,540	△ 11,888,043	△ 12,893,478
(F) 追加信託差損益金	16,476,963	16,205,976	16,107,589	15,708,004	15,384,046
(配当等相当額)	( 36,063,042)	( 35,563,661)	( 37,159,069)	( 36,318,553)	( 35,635,471)
(売買損益相当額)	(△ 19,586,079)	(△ 19,357,685)	(△ 21,051,480)	(△ 20,610,549)	(△ 20,251,425)
(G) 計 (D+E+F)	△ 8,371,658	5,000,861	6,809,388	5,374,222	—
(H) 収益分配金	△ 2,981,983	△ 2,935,175	△ 2,948,016	△ 2,875,778	—
次期繰越損益金 (G+H)	△ 11,353,641	2,065,686	3,861,372	2,498,444	—
償還差損金 (D+E+F+H)	—	—	—	—	△ 5,315,560
追加信託差損益金	16,476,963	16,205,976	16,107,589	15,708,004	—
(配当等相当額)	( 36,063,535)	( 35,564,213)	( 37,172,328)	( 36,319,133)	( —)
(売買損益相当額)	(△ 19,586,572)	(△ 19,358,237)	(△ 21,064,739)	(△ 20,611,129)	( —)
分配準備積立金	148,970,873	145,547,707	143,432,051	138,325,975	—
繰越損益金	△ 176,801,477	△ 159,687,997	△ 155,678,268	△ 151,535,535	—

(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 746,193,042円  
 作成期中追加設定元本額 8,478,828円  
 作成期中一部解約元本額 50,320,763円  
 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.992453円です。
- ② 純資産総額が元本額を下回っており、その差額は5,315,560円です。
- ③ 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
費用控除後の配当等収益額	996,038円	1,886,559円	1,623,099円	1,288,221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
収益調整金額	36,063,535円	35,564,213円	37,172,328円	36,319,133円
分配準備積立金額	150,956,818円	146,596,323円	144,756,968円	139,913,532円
当ファンドの分配対象収益額	188,016,391円	184,047,095円	183,552,395円	177,520,886円
1万口当たり収益分配対象額	2,522円	2,508円	2,490円	2,469円
1万口当たり分配金額	40円	40円	40円	40円
収益分配金金額	2,981,983円	2,935,175円	2,948,016円	2,875,778円

- ④ 「アバディーン アジア・ボンド・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51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。

○投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2011年1月14日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2016年11月9日		資産総額	701,734,082円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減または追加信託	負債総額	2,698,535円
受益権口数	1,048,920,906口	704,351,107口	△344,569,799口	純資産総額	699,035,547円
元本額	1,048,920,906円	704,351,107円	△344,569,799円	受益権口数	704,351,107口
				1万円当たり償還金	9,924円53銭
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万円当たり分配金	
				金額	分配率
第1期	2,073,788,253円	2,210,023,055円	10,657円	20円	0.2%
第2期	2,349,159,673	2,379,873,794	10,131	30	0.3
第3期	2,529,410,141	2,573,163,087	10,173	30	0.3
第4期	2,546,687,787	2,619,190,148	10,285	30	0.3
第5期	2,584,044,131	2,564,037,388	9,923	30	0.3
第6期	2,520,082,665	2,515,795,029	9,983	30	0.3
第7期	2,504,547,986	2,380,277,389	9,504	30	0.3
第8期	2,464,087,487	2,381,452,117	9,665	30	0.3
第9期	2,397,849,392	2,294,420,098	9,569	30	0.3
第10期	2,293,359,261	2,156,243,855	9,402	30	0.3
第11期	2,250,294,332	2,226,480,917	9,894	30	0.3
第12期	2,200,634,284	2,261,872,781	10,278	30	0.3
第13期	2,230,011,851	2,248,460,911	10,083	30	0.3
第14期	2,162,859,167	2,113,310,463	9,771	30	0.3
第15期	2,145,880,069	2,059,481,407	9,597	30	0.3
第16期	2,122,485,744	2,043,745,453	9,629	30	0.3
第17期	2,100,991,224	2,037,213,293	9,696	30	0.3
第18期	2,072,500,054	1,991,280,744	9,608	30	0.3
第19期	2,015,511,143	1,952,090,084	9,685	30	0.3
第20期	1,883,780,867	1,871,924,019	9,937	30	0.3
第21期	1,763,520,709	1,821,266,867	10,327	30	0.3
第22期	1,636,084,118	1,804,015,482	11,026	30	0.3
第23期	1,572,265,645	1,837,422,902	11,686	40	0.4
第24期	1,549,835,644	1,843,229,980	11,893	40	0.4
第25期	1,581,018,332	1,940,407,422	12,273	40	0.4
第26期	1,510,548,122	1,900,249,490	12,580	40	0.4
第27期	1,482,363,590	1,740,493,024	11,741	40	0.4
第28期	1,430,874,634	1,651,337,324	11,541	40	0.4
第29期	1,402,968,471	1,548,849,957	11,040	40	0.4
第30期	1,323,791,203	1,458,760,917	11,020	40	0.4
第31期	1,246,352,697	1,367,262,371	10,970	40	0.4

アバディーン アジア・ボンド・オープン（毎月決算型）

計 算 期	元 本 額	純資産総額	基準価額	1 万口当たり分配金	
				金 額	分 配 率
第32期	1,219,320,129円	1,360,393,592円	11,157円	40円	0.4%
第33期	1,165,848,961	1,334,864,647	11,450	40	0.4
第34期	1,133,741,821	1,293,369,652	11,408	40	0.4
第35期	1,121,323,971	1,242,242,450	11,078	40	0.4
第36期	1,100,857,318	1,248,106,682	11,338	40	0.4
第37期	1,058,052,054	1,201,001,936	11,351	40	0.4
第38期	1,047,046,661	1,183,368,555	11,302	40	0.4
第39期	1,025,079,425	1,164,177,718	11,357	40	0.4
第40期	1,014,681,375	1,144,400,334	11,278	40	0.4
第41期	995,536,533	1,116,463,626	11,215	40	0.4
第42期	983,766,954	1,145,805,487	11,647	40	0.4
第43期	968,726,119	1,123,288,555	11,596	40	0.4
第44期	964,967,760	1,176,614,826	12,193	40	0.4
第45期	923,859,905	1,156,892,157	12,522	40	0.4
第46期	903,176,294	1,118,633,009	12,386	40	0.4
第47期	892,536,479	1,111,992,613	12,459	40	0.4
第48期	891,076,001	1,110,813,196	12,466	40	0.4
第49期	873,194,334	1,096,730,895	12,560	40	0.4
第50期	868,624,982	1,058,541,091	12,186	40	0.4
第51期	863,847,072	1,073,350,057	12,425	40	0.4
第52期	830,301,807	1,009,580,243	12,159	40	0.4
第53期	824,959,284	1,009,126,972	12,232	40	0.4
第54期	801,406,675	908,304,633	11,334	40	0.4
第55期	786,144,522	919,455,733	11,696	40	0.4
第56期	783,228,664	922,517,948	11,778	40	0.4
第57期	766,537,869	884,379,025	11,537	40	0.4
第58期	759,889,993	842,150,791	11,083	40	0.4
第59期	762,536,179	832,832,400	10,922	40	0.4
第60期	756,035,936	816,174,788	10,795	40	0.4
第61期	752,558,310	795,677,662	10,573	40	0.4
第62期	747,411,328	781,377,693	10,454	40	0.4
第63期	746,193,042	774,909,534	10,385	40	0.4
第64期	745,495,867	734,142,226	9,848	40	0.4
第65期	733,793,791	735,859,477	10,028	40	0.4
第66期	737,004,128	740,865,500	10,052	40	0.4
第67期	718,944,520	721,442,964	10,035	40	0.4

## ○分配金のお知らせ

	第64期	第65期	第66期	第67期
1万口当たり分配金（税込み）	40円	40円	40円	40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。

## ○償還金のお知らせ

1万口当たり償還金（税込み）	9,924円53銭
----------------	-----------

◆償還金は償還日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

◆課税上の取り扱い

- ・個人受益者の場合、償還価額から取得費（申込手数料（税込）を含みます。）を控除した利益（譲渡益）が譲渡所得等として課税され、原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。
- ・特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

※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。

### 【お知らせ】

- ①2014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。
- ②受益権の口数が投資信託約款に定められた口数を下回っており、投資信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認められるため、繰上償還しました。  
(2016年11月9日)

# アバディーン アジア・ボンド・マザーファンド

## 《繰上償還(第6期)》信託終了日2016年11月8日

〔計算期間：2015年12月11日～2016年11月8日〕

「アバディーン アジア・ボンド・マザーファンド」は、この度、約款の規定に基づき、11月8日に繰り上げて償還させていただきました。

以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第6期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	主として日本を除くアジアの公社債を主要投資対象とし、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。トップダウン分析による金利、クレジット、通貨見通しを基に資産配分を策定したうえで、ボトムアップ分析により銘柄選定を行い、ポートフォリオを構築します。アジアの米ドル建て公社債に投資した場合は、原則として、実質的に日本円を除くアジア通貨建てとなるように外国為替予約取引および直物為替先渡取引等を行います。また、外国通貨間において外国為替予約取引および直物為替先渡取引等を活用し、相対的な魅力度に応じて通貨配分を調整します。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。アバディーン・アセット・マネジメント・アジア・リミテッドに外貨建て資産、外国為替予約取引および直物為替先渡取引等の運用の指図に関する権限を委託します。組入外貨建て資産については、原則として対円で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公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建て資産への投資割合に制限を設けません。

### ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(参考指数) HSBCアジア・ローカル・ ボンド・インデックス (円換算ベース)		(参考指数) Markit iBoxx アジア・ ローカル・ボンド・インデックス (円換算ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円 銭	%		%		%	%	%	百万円
2期(2012年12月10日)	11,357	13.9	21,529.21	15.4			96.6	—	1,798
3期(2013年12月10日)	13,368	17.7	25,578.81	18.8			94.6	—	1,320
4期(2014年12月10日)	15,549	16.3	30,638.50	19.8			94.5	—	1,143
5期(2015年12月10日)	15,163	△ 2.5	30,225.68	△ 1.3			92.9	—	878
(償還時)	(償還価額)								
6期(2016年11月8日)	13,726.24	△ 9.5			27,953.16	△ 7.5	—	—	691

(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) Markit iBoxx アジア・ローカル・ボンド・インデックスとは、日本を除くアジア各国・地域の、比較的流動性があり、海外の投資家が参加できるマーケットの現地通貨建て債券で構成される指数です。Markit iBoxx アジア・ローカル・ボンド・インデックス (円換算ベース) は、Markit iBoxx アジア・ローカル・ボンド・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。ただし、設定から2016年3月31日まではHSBCアジア・ローカル・ボンド・インデックス (円換算ベース) です。参考指数はこれらを連続させて指数化したものです。

(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。

## ○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 ) HSBCアジア・ローカル・ ボンド・インデックス		( 参 考 指 数 ) Markit iBoxx アジア・ ローカル・ボンド・インデックス		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	円 銭	騰 落 率	(円換算ベース)	騰 落 率	(円換算ベース)	騰 落 率		
(期 首)		%		%		%	%	%
2015年12月10日	15,163	—	30,225.68	—			92.9	—
12月末	15,081	△ 0.5	30,123.92	△ 0.3			95.1	—
2016年1月末	14,995	△ 1.1	29,960.17	△ 0.9			91.5	—
2月末	14,232	△ 6.1	28,552.71	△ 5.5			91.9	—
3月末	14,701	△ 3.0	29,745.60	△ 1.6			92.5	—
4月末	14,358	△ 5.3			29,090.81		94.7	—
5月末	14,253	△ 6.0			28,778.13	△ 4.8	95.2	—
6月末	13,601	△ 10.3			27,451.82	△ 9.2	96.9	—
7月末	13,991	△ 7.7			28,392.92	△ 6.1	97.1	—
8月末	13,781	△ 9.1			28,119.78	△ 7.0	95.3	—
9月末	13,574	△ 10.5			27,687.80	△ 8.4	94.6	—
10月末	13,731	△ 9.4			28,070.58	△ 7.1	—	—
(償還時)	(償還価額)							
2016年11月8日	13,726.24	△ 9.5			27,953.16	△ 7.5	—	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

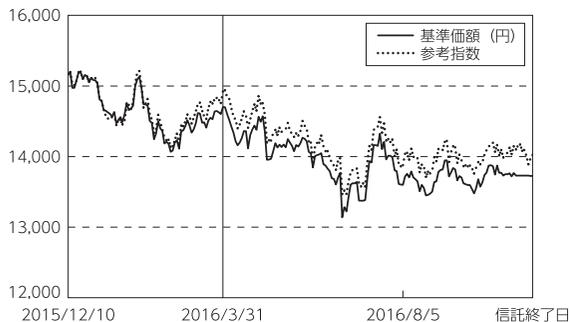
## ○運用経過

### ●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9.5%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

・当期のMarkit iBoxx アジア・ローカル・ボンド・インデックス（米ドルベース）は上昇しました。インドネシアやインドを中心にアジア債券市況は上昇（利回りは低下）しました。インドネシアでは、構造改革に対する進展期待やインドネシア銀行（中央銀行）の政策金利引き下げなどが影響し、債券利回りは低下しました。

### ◎為替市況

・アジア通貨は対円で下落しました。2016年4月に日銀が追加金融緩和の実施を見送ったこと、6月に英国のEU（欧州連合）離脱問題に対する懸念が高まりリスク回避の動きが強まったこと、8月に日本政府が発表した経済対策に対する失望感が高まったことなどが影響し、円高が進行した結果、期を通じて見ると、アジア通貨は総じて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

◎組入比率

- ・現物債券の組入比率は、繰上償還に備えてポジションを解消するまでの期間、高水準を維持しました。2016年10月下旬のポジション解消後は、現金で保有しました。

◎国別配分・金利戦略等

- ・国別では、相対的にファンダメンタルズが良好である韓国の組入比率を高めにして運用しました。マレーシアについては、原油価格の下落によって経常収支などに悪影響が出るとの見方などから、期前半に組入比率を引き下げましたが、その後投資妙味が増したとの判断から組入比率を引き上げました。その他、バリュエーション面から相対的に割安と判断したインドネシアの組入比率を引き上げた一方、韓国、フィリピン、中国の組入比率を引き下げました。

◎為替戦略

- ・期前半はアジア通貨に対して米ドル高が進行しやすい展開になるとの見方などから、相対的に米ドルとの連動性が高い香港ドルの組入比率を高めにして運用しました。その後、バリュエーション面で相対的に割安と判断したインドルピー、インドネシアルピア、マレーシアリングットなどの組入比率を引き上げ、香港ドルの組入比率を引き下げました。
- ・期を通じて見ると、債券市況が上昇したインドネシア債券の組入比率を引き上げたことなどはプラスに寄与したものの、アジア通貨が対円で総じて下落したことなどが基準価額にマイナスに影響しました。

●償還価額

償還価額は、13,726円24銭となりました。

## ○1万口当たりの費用明細

(2015年12月11日～2016年11月8日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 63	% 0.446	(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 )	(20)	(0.139)	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 )	(44)	(0.307)	信託事務の処理等に要するその他諸費用(主に、取引主体識別コードの登録(更新)手数料、インドネシアの公社債売却にかかる取引税)
合 計	63	0.446	
期中の平均基準価額は、14,208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12月11日～2016年11月8日)

## 公社債

			買 付 額	売 付 額
外	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 104	千シンガポールドル 1,419
	マレーシア	国債証券	千マレーシアリングット 5,827	千マレーシアリングット 7,179
	タイ	国債証券	千タイバーツ -	千タイバーツ 7,393
	フィリピン	国債証券	千フィリピンペソ -	千フィリピンペソ 34,513 ( 9,000)
国	インドネシア	国債証券	千インドネシアルピア 10,521,069	千インドネシアルピア 21,233,443
	韓国	国債証券	千韓国ウォン 827,395	千韓国ウォン 4,445,419
	中国オフショア	国債証券	千オフショア元 -	千オフショア元 4,025

(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。

## スワップ及び先渡取引状況

種 類	取 引 契 約 金 額
直物為替先渡取引	百万円 2,582

## ○利害関係人との取引状況等

(2015年12月11日～2016年11月8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 4,140	百万円 —	% —	百万円 4,910	百万円 73	% 1.5

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信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2016年11月8日現在)

信託終了日現在、有価証券等の組入れはございません。

## ○投資信託財産の構成

(2016年11月8日現在)

項 目	債 還 時	
	評 価 額	比 率
コール・ローン等、その他	千円 691,972	% 100.0
投資信託財産総額	691,972	100.0

## ○特定資産の価格等の調査

(2015年12月11日～2016年11月8日)

特 定 資 産 の 種 類	件 数
直物為替先渡取引	67

当期に、当ファンドにおいて行った取引のうち、「投資信託及び投資法人に関する法律」第11条に基づき価格等の調査が必要とされた資産の取引については、PwCあらた監査法人へその調査を委託し、調査報告書を受領しました。当該取引については、取引相手方の名称、通貨の種類、売買別、想定元本、満期日、その他当該取引の内容に関することについて調査を依頼しました。

○資産、負債、元本及び償還価額の状況 (2016年11月8日現在)

項 目	償 還 時
	円
(A) 資産	691,972,890
コール・ローン等	691,972,890
(B) 負債	920
未払利息	920
(C) 純資産総額(A－B)	691,971,970
元本	504,123,643
償還差益金	187,848,327
(D) 受益権総口数	504,123,643口
1万口当たり償還価額(C/D)	13,726円24銭

<注記事項>

- ①期首元本額 579,561,799円  
 期中追加設定元本額 0円  
 期中一部解約元本額 75,438,156円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1.372624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)  
 アバディーン アジア・ボンド・オープン(毎月決算型) 504,123,643円

[お 知 ら せ]

当該投資信託を投資対象とする全ての投資信託が償還となるため、繰上償還しました。  
 (2016年11月8日)

○損益の状況 (2015年12月11日～2016年11月8日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	21,205,416
受取利息	21,195,201
その他収益金	23,427
支払利息	△ 13,212
(B) 有価証券売買損益	△ 91,398,577
売買益	73,349,313
売買損	△164,747,890
(C) 先物取引等取引損益	△ 6,148,646
取引益	34,409,483
取引損	△ 40,558,129
(D) 保管費用等	△ 3,408,474
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 79,750,281
(F) 前期繰越損益金	299,225,602
(G) 解約差損益金	△ 31,626,994
償還差益金(E+F+G)	187,848,327

(注) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(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。