

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   | 2019年5月16日[当初、2022年6月10日]まで<br>(2012年7月12日設定)  |                                     |
| 運用方針   | 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、主として日本を除くアジアの米ドル建てハイ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。<br>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。<br>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。

## 償還報告書 (全体版)

[繰上償還]

# 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)

愛称：アジアブーケ



第78期 (決算日：2019年1月10日)

第79期 (決算日：2019年2月12日)

第80期 (決算日：2019年3月11日)

第81期 (決算日：2019年4月10日)

第82期 (決算日：2019年5月10日)

信託終了日：2019年5月16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、「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)」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、5月16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  
ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客様専用  
フリーダイヤル **0120-151034**  
(受付時間：営業日の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、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

## 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<br>(転換社債)<br>組入比率 | 債券<br>組入比率 | 債券<br>先物比率 | 純資<br>産額 |
|------------------|-----------|----------|------------------|-------------|--------|----------------------------|------------|------------|----------|
|                  | (分配額)     | 税込<br>分配 | み<br>金<br>騰<br>落 | 期<br>騰<br>落 | 中<br>率 |                            |            |            |          |
|                  | 円         | 円        | 円                | 円           | %      | %                          | %          | %          | 百万円      |
| 54期(2017年1月10日)  | 14,648    | 70       | 1.0              | 55,194.64   | 1.5    | —                          | 93.4       | —          | 569      |
| 55期(2017年2月10日)  | 14,394    | 130      | △0.8             | 54,848.61   | △0.6   | —                          | 93.5       | —          | 559      |
| 56期(2017年3月10日)  | 14,398    | 130      | 0.9              | 55,763.60   | 1.7    | —                          | 91.2       | —          | 595      |
| 57期(2017年4月10日)  | 13,953    | 130      | △2.2             | 54,572.29   | △2.1   | —                          | 92.1       | —          | 621      |
| 58期(2017年5月10日)  | 14,176    | 130      | 2.5              | 56,128.77   | 2.9    | —                          | 90.4       | —          | 648      |
| 59期(2017年6月12日)  | 13,533    | 130      | △3.6             | 53,888.25   | △4.0   | —                          | 91.5       | —          | 609      |
| 60期(2017年7月10日)  | 13,839    | 130      | 3.2              | 55,672.72   | 3.3    | —                          | 91.0       | —          | 683      |
| 61期(2017年8月10日)  | 13,330    | 130      | △2.7             | 54,114.31   | △2.8   | —                          | 88.6       | —          | 727      |
| 62期(2017年9月11日)  | 13,082    | 130      | △0.9             | 53,926.24   | △0.3   | —                          | 92.1       | —          | 853      |
| 63期(2017年10月10日) | 13,523    | 130      | 4.4              | 56,336.25   | 4.5    | —                          | 95.0       | —          | 841      |
| 64期(2017年11月10日) | 13,552    | 130      | 1.2              | 57,131.32   | 1.4    | —                          | 92.8       | —          | 869      |
| 65期(2017年12月11日) | 13,401    | 130      | △0.2             | 57,126.63   | △0.0   | —                          | 93.6       | —          | 911      |
| 66期(2018年1月10日)  | 13,184    | 130      | △0.6             | 56,933.21   | △0.3   | —                          | 93.4       | —          | 922      |
| 67期(2018年2月13日)  | 12,510    | 130      | △4.1             | 54,592.79   | △4.1   | —                          | 91.0       | —          | 918      |
| 68期(2018年3月12日)  | 12,198    | 130      | △1.5             | 53,761.63   | △1.5   | —                          | 93.5       | —          | 912      |
| 69期(2018年4月10日)  | 12,005    | 130      | △0.5             | 53,516.76   | △0.5   | —                          | 94.3       | —          | 904      |
| 70期(2018年5月10日)  | 11,965    | 130      | 0.7              | 53,786.38   | 0.5    | —                          | 94.9       | —          | 902      |
| 71期(2018年6月11日)  | 11,762    | 130      | △0.6             | 53,362.98   | △0.8   | —                          | 91.9       | —          | 895      |
| 72期(2018年7月10日)  | 11,497    | 130      | △1.1             | 52,586.69   | △1.5   | —                          | 91.1       | —          | 858      |
| 73期(2018年8月10日)  | 11,659    | 130      | 2.5              | 54,236.77   | 3.1    | —                          | 93.9       | —          | 872      |
| 74期(2018年9月10日)  | 11,461    | 130      | △0.6             | 54,155.58   | △0.1   | —                          | 94.9       | —          | 839      |
| 75期(2018年10月10日) | 11,606    | 130      | 2.4              | 55,513.48   | 2.5    | —                          | 93.8       | —          | 734      |
| 76期(2018年11月12日) | 11,359    | 130      | △1.0             | 54,899.71   | △1.1   | —                          | 93.9       | —          | 710      |
| 77期(2018年12月10日) | 11,068    | 130      | △1.4             | 54,379.00   | △0.9   | —                          | 92.6       | —          | 693      |
| 78期(2019年1月10日)  | 10,629    | 130      | △2.8             | 53,055.73   | △2.4   | —                          | 91.5       | —          | 667      |
| 79期(2019年2月12日)  | 11,073    | 130      | 5.4              | 56,168.69   | 5.9    | —                          | 95.3       | —          | 713      |
| 80期(2019年3月11日)  | 11,197    | 130      | 2.3              | 57,492.40   | 2.4    | —                          | 95.6       | —          | 726      |
| 81期(2019年4月10日)  | 11,282    | 130      | 1.9              | 58,716.60   | 2.1    | —                          | 91.3       | —          | 655      |
| 82期(2019年5月10日)  | 11,336    | 0        | 0.5              | 58,359.39   | △0.6   | —                          | —          | —          | 623      |
| (償還時)            | (償還価額)    |          |                  |             |        |                            |            |            |          |
| 83期(2019年5月16日)  | 11,331.74 | —        | △0.0             | 57,908.78   | △0.8   | —                          | —          | —          | 621      |

(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) ICE BofAML アジアン・ダラー・ハイ・イールド・コーポレート指数とは、ICE Data Indices, LLC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。同指数は、ICE Data Indices, LLC、ICE Dataまたはその第三者の財産であり、三菱UFJ国際投信は許諾に基づき使用しています。ICE Dataおよびその第三者は、使用に関して一切の責任を負いません。ICE BofAML アジアン・ダラー・ハイ・イールド・コーポレート指数(円換算ベース)は、ICE BofAML アジアン・ダラー・ハイ・イールド・コーポレート指数をもとに、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 )<br>ICE BofAML アジアン・ダラー・<br>ハイ・イールド・コーポレート指数<br>(円換算ベース) |           | 新株予約権付社債<br>( 転 換 社 債 )<br>組 入 比 率 | 債<br>組 入 比 率 | 債<br>先 物 比 率 |
|--------------------|---------------------|---------------------|--------|---|-----------|------------------------------------|--------------|--------------|
|                    |                     |                     | 騰 落 率  |   | 騰 落 率     |                                    |              |              |
| 第78期               | (期首)<br>2018年12月10日 | 円 銭                 | %      |   | %         | %                                  | %            | %            |
|                    |                     | 11,068              | —      | 54,379.00   | —         | —                                  | 92.6         | —            |
|                    | 12月末                | 10,991              | △0.7   | 54,073.98   | △0.6      | —                                  | 92.6         | —            |
| 第79期               | (期末)<br>2019年1月10日  |                     |        |   |           |                                    |              |              |
|                    |                     | 10,759              | △2.8   | 53,055.73   | △2.4      | —                                  | 91.5         | —            |
|                    | 2019年1月10日          | 10,629              | —      | 53,055.73   | —         | —                                  | 91.5         | —            |
| 第79期               | 1月末                 | 10,953              | 3.0    | 54,880.97   | 3.4       | —                                  | 89.8         | —            |
|                    | (期末)<br>2019年2月12日  | 11,203              | 5.4    | 56,168.69   | 5.9       | —                                  | 95.3         | —            |
|                    | 第80期                | (期首)<br>2019年2月12日  | 11,073 | —   | 56,168.69 | —                                  | —            | 95.3         |
| 2月末                |                     | 11,222              | 1.3    | 56,875.42   | 1.3       | —                                  | 94.8         | —            |
| (期末)<br>2019年3月11日 |                     | 11,327              | 2.3    | 57,492.40   | 2.4       | —                                  | 95.6         | —            |
| 第81期               | (期首)<br>2019年3月11日  | 11,197              | —      | 57,492.40   | —         | —                                  | 95.6         | —            |
|                    | 3月末                 | 11,417              | 2.0    | 58,664.32   | 2.0       | —                                  | 93.6         | —            |
|                    | (期末)<br>2019年4月10日  | 11,412              | 1.9    | 58,716.60   | 2.1       | —                                  | 91.3         | —            |
| 第82期               | (期首)<br>2019年4月10日  | 11,282              | —      | 58,716.60   | —         | —                                  | 91.3         | —            |
|                    | 4月末                 | 11,344              | 0.5    | 59,370.09   | 1.1       | —                                  | —            | —            |
|                    | (期末)<br>2019年5月10日  | 11,336              | 0.5    | 58,359.39   | △0.6      | —                                  | —            | —            |
| 第83期               | (期首)<br>2019年5月10日  | 11,336              | —      | 58,359.39   | —         | —                                  | —            | —            |
|                    | (償還時)<br>2019年5月16日 | (償還価額)<br>11,331.74 | △0.0   | 57,908.78   | △0.8      | —                                  | —            | —            |

(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。

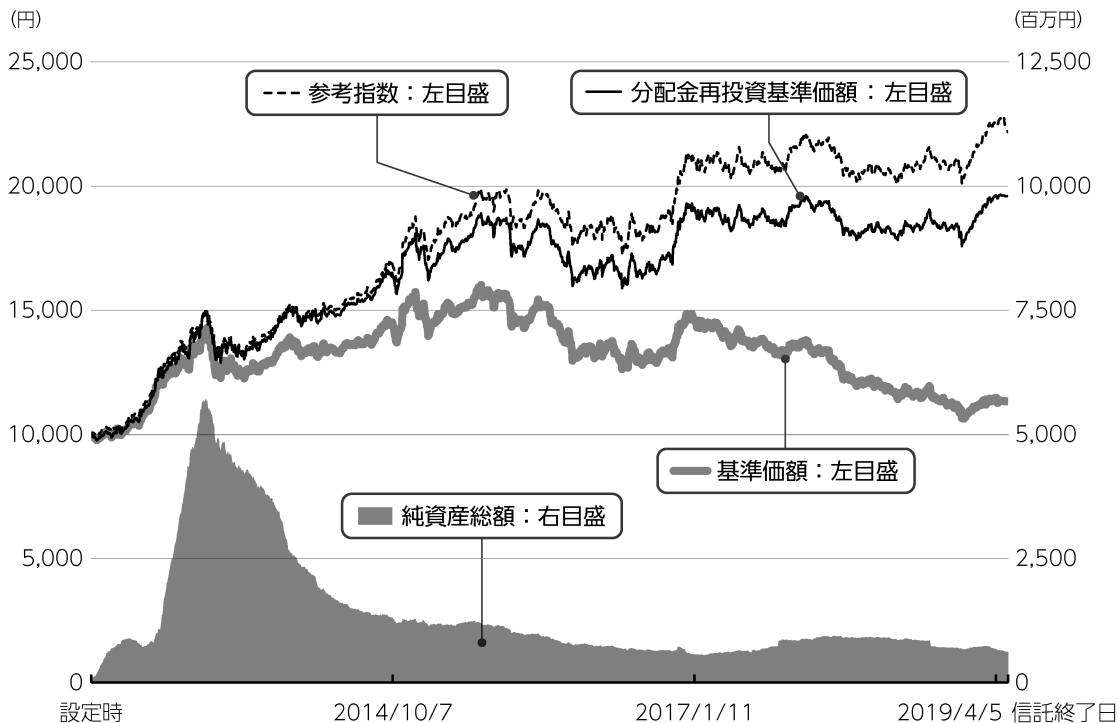
(注) 「債券先物比率」は買建比率-売建比率。

# 運用経過

第1期～第83期：2012年7月12日～2019年5月16日

## 設定来の基準価額等の推移について

### 基準価額等の推移



|      |         |
|------|---------|
| 第1期首 | 10,000円 |
|------|---------|

|       |            |
|-------|------------|
| 第83期末 | 11,331.74円 |
|-------|------------|

|       |        |
|-------|--------|
| 既払分配金 | 7,120円 |
|-------|--------|

|     |       |
|-----|-------|
| 騰落率 | 96.0% |
|-----|-------|

(分配金再投資ベース)

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、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、受益者のみなさま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。従って、各個人の受益者のみな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。

### 基準価額の動き

償還価額は設定時に比べ96.0% (分配金再投資ベース) の上昇となりました。

## ▶ 基準価額の主な変動要因

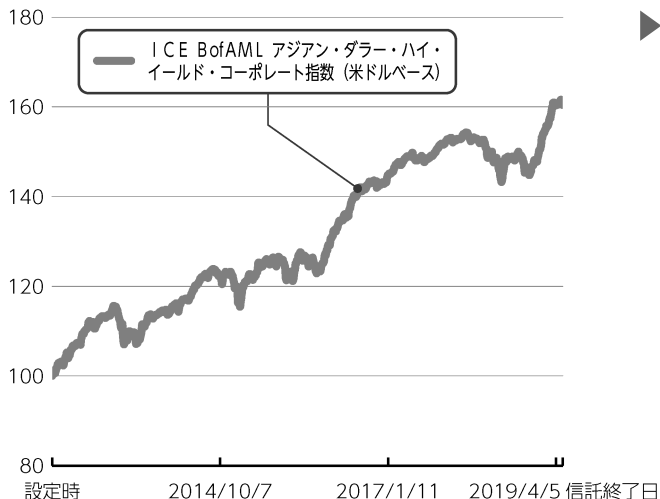
### 上昇要因

債券の利子収益や、米ドルが対円で上昇したこと等が基準価額の上昇要因となりました。

第1期～第83期：2012年7月12日～2019年5月16日

## 投資環境について

## 債券市況の推移 (設定時を100として指数化)



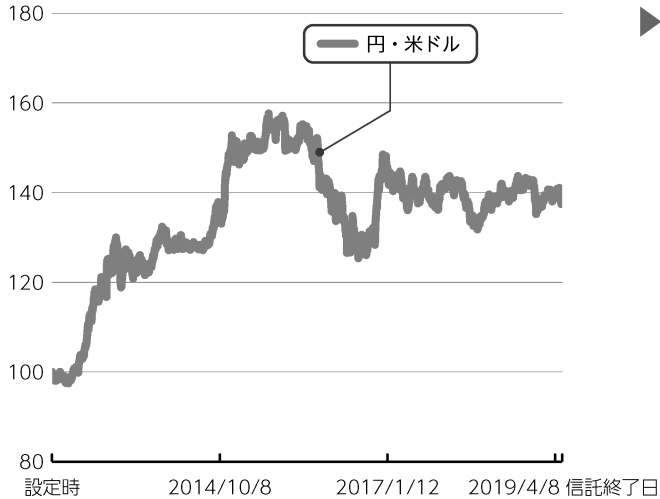
(注) 現地日付ベースで記載しております。

## ▶ 債券市況

設定来のアジア・ハイイールド債券市況は上昇しました。

アジア・ハイイールド債券市況は、2013年に米連邦準備制度理事会（F R B）議長が量的緩和策縮小の可能性に言及したことや、2014年に中東情勢の緊迫化が危惧されたこと、2018年に米中貿易摩擦の激化懸念が高まったこと等を背景に下落する局面もあったものの、比較的堅調な企業業績等を背景にスプレッド（米国債に対する上乗せ金利）が縮小したことや、堅調な利子収入を享受したこと等を背景に上昇しました。

## 為替市況の推移 (設定時を100として指数化、対円)



### ▶ 為替市況

設定来の為替市況は、米ドルは対円で上昇しました。

日本では2013年に日本銀行により量的・質的金融緩和策が導入された一方、米国では2015年にF R Bにより利上げが開始されたこと等を受け、日米の金利差が拡大したこと等を背景に、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)

信託期間を通じて、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。

最終作成期 (2018年12月11日～信託終了日) は、上記の運用を維持し、信託終了日にかけてマザーファンドの組み入れを解消し、資金化をはかりました。

### ▶ アジア・ハイイールド債券マザーファンド

信託期間を通じて、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運用を行ってまいりました。

原則として、設定時や償還時を除き、設定来から債券現物の高位組み入れを維持しました。

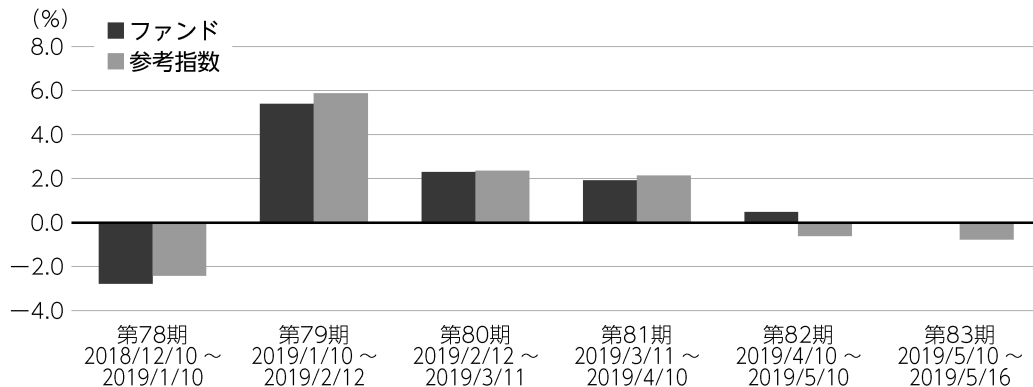
最終作成期 (2018年12月11日～信託終了日) は、上記の運用を維持し、繰上償還実施決定以降、保有銘柄の売却を行いました。



第78期～第83期：2018年12月11日～信託終了日

## 当該投資信託のベンチマークとの差異について

### 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ICE BofAML アジアン・ダラー・ハイ・イールド・コーポレート指数（円換算ベース）です。

なお、設定来の基準価額は96.0%（分配金再投資ベース）の上昇、参考指数は121.9%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2期から第6期までは各50円、第7期から第54期までは各70円、第55期から第81期までは各130円、第82期の分配は見送りとさせていただきます。なお、信託約款の規定に従い第1期の収益分配は行っていません。信託期間中、累計で7,120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78期<br>2018年12月11日~<br>2019年1月10日 | 第79期<br>2019年1月11日~<br>2019年2月12日 | 第80期<br>2019年2月13日~<br>2019年3月11日 | 第81期<br>2019年3月12日~<br>2019年4月10日 | 第82期<br>2019年4月11日~<br>2019年5月10日 |
|--------------------|------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| 当期分配金<br>(対基準価額比率) | 130<br>(1.208%)                    | 130<br>(1.160%)                   | 130<br>(1.148%)                   | 130<br>(1.139%)                   | —<br>(—%)                         |
| 当期の収益              | 46                                 | 61                                | 53                                | 59                                | —                                 |
| 当期の収益以外            | 84                                 | 69                                | 77                                | 70                                | —                                 |
| 翌期繰越分配対象額          | 4,160                              | 4,092                             | 4,016                             | 3,945                             | 3,956                             |

(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

### 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)

償還価額は、11,331円74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。

2018年12月11日～2019年5月16日

## 1万口当たりの費用明細

| 項目          | 第78期～第83期 |         | 項目の概要   |
|-------------|-----------|---------|---|
|             | 金額 (円)    | 比率 (%)  |   |
| (a) 信託報酬    | 84        | 0.747   | (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 ) | (50)      | (0.451) | 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 ) | (31)      | (0.278) | 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)       | (0.019) | 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         | 0.017   | (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)       | (0.015) | 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)       | (0.000) | 信託事務の処理等に要するその他諸費用                                |
| 合 計         | 86        | 0.764   |   |

作成期中の平均基準価額は、11,176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

(2018年12月11日～2019年5月16日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘                  | 柄 | 第78期～第83期 |        |         |         |
|--------------------|---|-----------|--------|---------|---------|
|                    |   | 設 定       |        | 解 約     |         |
|                    |   | 口 数       | 金 額    | 口 数     | 金 額     |
|                    |   | 千口        | 千円     | 千口      | 千円      |
| アジア・ハイールド債券マザーファンド |   | 5,810     | 12,000 | 333,714 | 747,011 |

## ○利害関係人との取引状況等

(2018年12月11日～2019年5月16日)

## 利害関係人との取引状況

&lt;三菱UFJ アジア・ハイールド債券ファンド&lt;為替ヘッジなし&gt; (毎月決算型) &gt;

該当事項はございません。

&lt;アジア・ハイールド債券マザーファンド&gt;

| 区 分    | 第78期～第83期          |          |                    |              |           |          |
|--------|--------------------|----------|--------------------|--------------|-----------|----------|
|        | 買付額等<br>A          |          |                    | 売付額等<br>C    |           |          |
|        | うち利害関係人<br>との取引状況B | B<br>A   | うち利害関係人<br>との取引状況D | D<br>C       |           |          |
| 為替直物取引 | 百万円<br>31          | 百万円<br>— | %<br>—             | 百万円<br>1,348 | 百万円<br>72 | %<br>5.3 |

平均保有割合 55.4%

※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モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

## ○組入資産の明細

(2019年5月16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77期末 |               |
|--------------------|---|-------|---------------|
|                    |   | 口     | 数             |
| アジア・ハイールド債券マザーファンド |   |       | 千口<br>327,903 |

## ○投資信託財産の構成

(2019年5月16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<br>623,683 | %<br>100.0 |
| 投資信託財産総額     | 623,683       | 100.0      |

## ○資産、負債、元本及び基準(償還)価額の状況

| 項 目                      | 第78期末        | 第79期末        | 第80期末        | 第81期末        | 第82期末        | 債 還 時        |
|--------------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
|                          | 2019年1月10日現在 | 2019年2月12日現在 | 2019年3月11日現在 | 2019年4月10日現在 | 2019年5月10日現在 | 2019年5月16日現在 |
|                          | 円            | 円            | 円            | 円            | 円            | 円            |
| (A) 資産                   | 678,768,309  | 723,222,212  | 736,435,242  | 675,830,316  | 631,322,763  | 623,683,970  |
| コール・ローン等                 | 17,834,897   | 17,550,174   | 20,959,654   | 21,840,771   | 20,266,943   | 623,683,970  |
| アジア・ハイイールド債券マザーファンド(評価額) | 655,933,412  | 705,672,038  | 715,475,588  | 641,989,545  | 611,055,820  | —            |
| 未収入金                     | 5,000,000    | —            | —            | 12,000,000   | —            | —            |
| (B) 負債                   | 10,824,156   | 9,853,740    | 9,530,372    | 20,487,945   | 7,594,396    | 2,114,836    |
| 未払収益分配金                  | 8,169,329    | 8,375,168    | 8,439,912    | 7,551,432    | —            | —            |
| 未払解約金                    | 1,628,783    | 377,702      | 151,109      | 11,923,165   | 6,673,830    | 1,935,014    |
| 未払信託報酬                   | 1,023,232    | 1,097,948    | 936,911      | 1,010,692    | 918,161      | 178,226      |
| 未払利息                     | 35           | 30           | 13           | 37           | 23           | 1,134        |
| その他未払費用                  | 2,777        | 2,892        | 2,427        | 2,619        | 2,382        | 462          |
| (C) 純資産総額(A-B)           | 667,944,153  | 713,368,472  | 726,904,870  | 655,342,371  | 623,728,367  | 621,569,134  |
| 元本                       | 628,409,967  | 644,243,699  | 649,224,065  | 580,879,411  | 550,227,685  | 548,520,269  |
| 次期繰越損益金                  | 39,534,186   | 69,124,773   | 77,680,805   | 74,462,960   | 73,500,682   | —            |
| 償還差益金                    | —            | —            | —            | —            | —            | 73,048,865   |
| (D) 受益権総口数               | 628,409,967口 | 644,243,699口 | 649,224,065口 | 580,879,411口 | 550,227,685口 | 548,520,269口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D)          | 10,629円      | 11,073円      | 11,197円      | 11,282円      | 11,336円      | —            |
| 1万口当たり償還価額(C/D)          | —            | —            | —            | —            | —            | 11,331円74銭   |

## ○損益の状況

| 項 目              | 第78期                       | 第79期                      | 第80期                      | 第81期                      | 第82期                      | 第83期                      |
|------------------|----------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
|                  | 2018年12月11日～<br>2019年1月10日 | 2019年1月11日～<br>2019年2月12日 | 2019年2月13日～<br>2019年3月11日 | 2019年3月12日～<br>2019年4月10日 | 2019年4月11日～<br>2019年5月10日 | 2019年5月11日～<br>2019年5月16日 |
|                  | 円                          | 円                         | 円                         | 円                         | 円                         | 円                         |
| (A) 配当等収益        | △ 942                      | △ 944                     | △ 641                     | △ 802                     | △ 760                     | △ 1,212                   |
| 受取利息             | —                          | —                         | 2                         | —                         | —                         | —                         |
| 支払利息             | △ 942                      | △ 944                     | △ 643                     | △ 802                     | △ 760                     | △ 1,212                   |
| (B) 有価証券売買損益     | △ 18,295,688               | 37,712,924                | 17,245,360                | 13,513,000                | 3,877,644                 | △ 43,829                  |
| 売買益              | 63,731                     | 37,738,626                | 17,303,548                | 14,993,343                | 4,068,540                 | 169                       |
| 売買損              | △ 18,359,419               | △ 25,702                  | △ 58,188                  | △ 1,480,343               | △ 190,896                 | △ 43,998                  |
| (C) 信託報酬等        | △ 1,026,009                | △ 1,100,792               | △ 939,338                 | △ 1,013,311               | △ 920,543                 | △ 178,688                 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 19,322,639               | 36,611,188                | 16,305,381                | 12,498,887                | 2,956,341                 | △ 223,729                 |
| (E) 前期繰越損益金      | △ 95,505,228               | △ 117,321,231             | △ 83,949,757              | △ 63,105,388              | △ 50,905,160              | △ 47,800,025              |
| (F) 追加信託差損益金     | 162,531,382                | 158,209,984               | 153,765,093               | 132,620,893               | 121,449,501               | 121,072,619               |
| (配当等相当額)         | ( 266,647,972)             | ( 267,983,400)            | ( 265,645,546)            | ( 233,235,324)            | ( 217,095,173)            | ( 216,426,900)            |
| (売買損益相当額)        | (△104,116,590)             | (△109,773,416)            | (△111,880,453)            | (△100,614,431)            | (△ 95,645,672)            | (△ 95,354,281)            |
| (G) 計(D+E+F)     | 47,703,515                 | 77,499,941                | 86,120,717                | 82,014,392                | 73,500,682                | —                         |
| (H) 収益分配金        | △ 8,169,329                | △ 8,375,168               | △ 8,439,912               | △ 7,551,432               | 0                         | —                         |
| 次期繰越損益金(G+H)     | 39,534,186                 | 69,124,773                | 77,680,805                | 74,462,960                | 73,500,682                | —                         |
| 償還差益金(D+E+F+H)   | —                          | —                         | —                         | —                         | —                         | 73,048,865                |
| 追加信託差損益金         | 157,252,738                | 153,764,702               | 148,766,068               | 128,554,737               | 121,449,501               | —                         |
| (配当等相当額)         | ( 261,395,731)             | ( 263,606,725)            | ( 260,676,804)            | ( 229,188,772)            | ( 217,100,607)            | ( —)                      |
| (売買損益相当額)        | (△104,142,993)             | (△109,842,023)            | (△111,910,736)            | (△100,634,035)            | (△ 95,651,106)            | ( —)                      |
| 分配準備積立金          | 48,072                     | 62,274                    | 61,627                    | 24,472                    | 622,768                   | —                         |
| 繰越損益金            | △ 117,766,624              | △ 84,702,203              | △ 71,146,890              | △ 54,116,249              | △ 48,571,587              | —                         |

(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。

## &lt;注記事項&gt;

- ①作成期首(前作成期末)元本額 626,414,310円  
 作成期中追加設定元本額 44,945,665円  
 作成期中一部解約元本額 122,839,706円  
 また、1口当たり純資産額は、作成期末1,133,174円です。

## ②分配金の計算過程

| 項 目                       | 2018年12月11日～<br>2019年1月10日 | 2019年1月11日～<br>2019年2月12日 | 2019年2月13日～<br>2019年3月11日 | 2019年3月12日～<br>2019年4月10日 | 2019年4月11日～<br>2019年5月10日 |
|---------------------------|----------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | 2,911,520円                 | 3,944,249円                | 3,440,747円                | 3,455,038円                | 599,736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                        |
| 収益調整金額                    | 266,674,375円               | 268,052,007円              | 265,675,829円              | 233,254,928円              | 217,100,607円              |
| 分配準備積立金額                  | 27,237円                    | 47,911円                   | 61,767円                   | 54,710円                   | 23,032円                   |
| 当ファンドの分配対象収益額             | 269,613,132円               | 272,044,167円              | 269,178,343円              | 236,764,676円              | 217,723,375円              |
| 1万口当たり収益分配対象額             | 4,290円                     | 4,222円                    | 4,146円                    | 4,075円                    | 3,956円                    |
| 1万口当たり分配金額                | 130円                       | 130円                      | 130円                      | 130円                      | —円                        |
| 収益分配金金額                   | 8,169,329円                 | 8,375,168円                | 8,439,912円                | 7,551,432円                | —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。

## ○投資信託財産運用総括表

| 信託期間     | 投資信託契約締結日     | 2012年7月12日    |              | 投資信託契約終了時の状況 |              |
|----------|---------------|---------------|--------------|--------------|--------------|
|          | 投資信託契約終了日     | 2019年5月16日    |              | 資産総額         | 623,683,970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         | 2,114,836円   |
|          |               |               |              | 純資産総額        | 621,569,134円 |
| 受益権口数    | 73,934,084口   | 548,520,269口  | 474,586,185口 | 受益権口数        | 548,520,269口 |
| 元本額      | 73,934,084円   | 548,520,269円  | 474,586,185円 | 1万円当たり償還金    | 11,331円74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      | 414,216,437円  | 413,071,096円  | 9,972円       | －円           | －%           |
| 第2期      | 706,313,195   | 704,649,385   | 9,976        | 50           | 0.5          |
| 第3期      | 856,137,864   | 871,244,773   | 10,176       | 50           | 0.5          |
| 第4期      | 762,450,800   | 792,229,778   | 10,391       | 50           | 0.5          |
| 第5期      | 701,165,171   | 768,617,912   | 10,962       | 50           | 0.5          |
| 第6期      | 875,092,442   | 1,052,382,349 | 12,026       | 50           | 0.5          |
| 第7期      | 1,807,481,843 | 2,268,724,252 | 12,552       | 70           | 0.7          |
| 第8期      | 2,590,616,904 | 3,374,328,384 | 13,025       | 70           | 0.7          |
| 第9期      | 3,472,381,821 | 4,662,249,706 | 13,427       | 70           | 0.7          |
| 第10期     | 4,017,795,495 | 5,618,703,258 | 13,985       | 70           | 0.7          |
| 第11期     | 3,972,510,593 | 5,164,916,229 | 13,002       | 70           | 0.7          |
| 第12期     | 3,649,998,211 | 4,657,414,126 | 12,760       | 70           | 0.7          |
| 第13期     | 3,457,581,024 | 4,275,796,738 | 12,366       | 70           | 0.7          |
| 第14期     | 3,345,481,188 | 4,194,602,765 | 12,538       | 70           | 0.7          |
| 第15期     | 3,114,546,280 | 3,929,211,760 | 12,616       | 70           | 0.7          |
| 第16期     | 2,867,235,467 | 3,703,807,839 | 12,918       | 70           | 0.7          |
| 第17期     | 2,365,479,597 | 3,206,910,935 | 13,557       | 70           | 0.7          |
| 第18期     | 1,871,327,241 | 2,571,043,970 | 13,739       | 70           | 0.7          |
| 第19期     | 1,753,135,734 | 2,332,647,982 | 13,306       | 70           | 0.7          |
| 第20期     | 1,592,740,921 | 2,156,616,172 | 13,540       | 70           | 0.7          |
| 第21期     | 1,350,346,787 | 1,808,848,257 | 13,395       | 70           | 0.7          |
| 第22期     | 1,248,427,567 | 1,658,532,475 | 13,285       | 70           | 0.7          |
| 第23期     | 1,152,402,936 | 1,571,673,921 | 13,638       | 70           | 0.7          |
| 第24期     | 1,055,593,603 | 1,441,696,075 | 13,658       | 70           | 0.7          |
| 第25期     | 998,573,143   | 1,359,697,904 | 13,616       | 70           | 0.7          |
| 第26期     | 955,425,003   | 1,368,822,134 | 14,327       | 70           | 0.7          |
| 第27期     | 878,372,033   | 1,243,965,559 | 14,162       | 70           | 0.7          |
| 第28期     | 841,730,760   | 1,261,254,790 | 14,984       | 70           | 0.7          |
| 第29期     | 808,207,426   | 1,235,931,769 | 15,292       | 70           | 0.7          |
| 第30期     | 822,743,842   | 1,181,608,198 | 14,362       | 70           | 0.7          |
| 第31期     | 802,458,225   | 1,170,410,289 | 14,585       | 70           | 0.7          |

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)

| 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  | 763,381,079円 | 1,167,352,448円 | 15,292円 | 70円       | 0.7%  |
| 第33期  | 791,413,189  | 1,191,469,665  | 15,055  | 70        | 0.7   |
| 第34期  | 804,354,451  | 1,223,161,306  | 15,207  | 70        | 0.7   |
| 第35期  | 741,600,765  | 1,167,596,833  | 15,744  | 70        | 0.7   |
| 第36期  | 736,614,665  | 1,113,618,820  | 15,118  | 70        | 0.7   |
| 第37期  | 705,219,564  | 1,095,502,089  | 15,534  | 70        | 0.7   |
| 第38期  | 683,397,140  | 994,559,489    | 14,553  | 70        | 0.7   |
| 第39期  | 663,451,975  | 974,040,567    | 14,681  | 70        | 0.7   |
| 第40期  | 638,318,407  | 977,557,840    | 15,315  | 70        | 0.7   |
| 第41期  | 608,435,572  | 899,993,053    | 14,792  | 70        | 0.7   |
| 第42期  | 582,534,345  | 820,191,838    | 14,080  | 70        | 0.7   |
| 第43期  | 573,701,739  | 764,775,508    | 13,331  | 70        | 0.7   |
| 第44期  | 581,028,293  | 777,222,258    | 13,377  | 70        | 0.7   |
| 第45期  | 556,638,673  | 727,078,849    | 13,062  | 70        | 0.7   |
| 第46期  | 543,480,627  | 724,767,423    | 13,336  | 70        | 0.7   |
| 第47期  | 531,098,330  | 707,387,013    | 13,319  | 70        | 0.7   |
| 第48期  | 514,218,905  | 652,865,495    | 12,696  | 70        | 0.7   |
| 第49期  | 509,206,571  | 659,512,046    | 12,952  | 70        | 0.7   |
| 第50期  | 499,137,314  | 656,631,407    | 13,155  | 70        | 0.7   |
| 第51期  | 490,999,375  | 653,355,862    | 13,307  | 70        | 0.7   |
| 第52期  | 474,015,201  | 637,050,507    | 13,439  | 70        | 0.7   |
| 第53期  | 462,873,082  | 674,539,967    | 14,573  | 70        | 0.7   |
| 第54期  | 388,817,704  | 569,553,226    | 14,648  | 70        | 0.7   |
| 第55期  | 389,034,116  | 559,970,343    | 14,394  | 130       | 1.3   |
| 第56期  | 413,664,457  | 595,579,682    | 14,398  | 130       | 1.3   |
| 第57期  | 445,647,778  | 621,796,353    | 13,953  | 130       | 1.3   |
| 第58期  | 457,631,631  | 648,747,040    | 14,176  | 130       | 1.3   |
| 第59期  | 450,302,467  | 609,385,817    | 13,533  | 130       | 1.3   |
| 第60期  | 493,549,087  | 683,018,980    | 13,839  | 130       | 1.3   |
| 第61期  | 545,856,635  | 727,632,977    | 13,330  | 130       | 1.3   |
| 第62期  | 652,159,710  | 853,145,164    | 13,082  | 130       | 1.3   |
| 第63期  | 622,456,372  | 841,776,816    | 13,523  | 130       | 1.3   |
| 第64期  | 641,881,497  | 869,858,726    | 13,552  | 130       | 1.3   |
| 第65期  | 679,937,866  | 911,154,417    | 13,401  | 130       | 1.3   |
| 第66期  | 699,458,797  | 922,145,102    | 13,184  | 130       | 1.3   |
| 第67期  | 733,830,336  | 918,050,314    | 12,510  | 130       | 1.3   |
| 第68期  | 748,327,900  | 912,782,424    | 12,198  | 130       | 1.3   |
| 第69期  | 753,574,321  | 904,691,110    | 12,005  | 130       | 1.3   |
| 第70期  | 754,632,088  | 902,941,910    | 11,965  | 130       | 1.3   |
| 第71期  | 761,252,716  | 895,388,716    | 11,762  | 130       | 1.3   |



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)

| 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72期  | 746,402,254円 | 858,136,838円 | 11,497円 | 130円       | 1.3%  |
| 第73期  | 748,738,179  | 872,976,766  | 11,659  | 130        | 1.3   |
| 第74期  | 732,582,441  | 839,593,274  | 11,461  | 130        | 1.3   |
| 第75期  | 632,793,677  | 734,405,665  | 11,606  | 130        | 1.3   |
| 第76期  | 625,146,627  | 710,106,077  | 11,359  | 130        | 1.3   |
| 第77期  | 626,414,310  | 693,300,089  | 11,068  | 130        | 1.3   |
| 第78期  | 628,409,967  | 667,944,153  | 10,629  | 130        | 1.3   |
| 第79期  | 644,243,699  | 713,368,472  | 11,073  | 130        | 1.3   |
| 第80期  | 649,224,065  | 726,904,870  | 11,197  | 130        | 1.3   |
| 第81期  | 580,879,411  | 655,342,371  | 11,282  | 130        | 1.3   |
| 第82期  | 550,227,685  | 623,728,367  | 11,336  | 0          | 0.0   |

## ○分配金のお知らせ

|                | 第78期 | 第79期 | 第80期 | 第81期 | 第82期 |
|----------------|------|------|------|------|------|
| 1万口当たり分配金(税込み) | 130円 | 130円 | 130円 | 130円 | 0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) | 11,331円74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]

- ①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。  
(2019年5月16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。

## アジア・ハイイールド債券マザーファンド

### 《繰上償還(第7期)》信託終了日2019年5月15日

[計算期間：2018年6月12日～2019年5月15日]

「アジア・ハイイールド債券マザーファンド」は、この度、約款の規定に基づき、5月15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7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。   |

### ○最近5期の運用実績

| 決 算 期          | 基 準 価 額   |       | ( 参 考 指 数 )<br>ICE BofAML アジアン・ダラー・<br>ハイ・イールド・コーポレート指数<br>(円換算ベース) |       | 新株予約権付社債<br>(転換社債)<br>組入比率 | 債 券 組 入 比 率 | 債 券 先 物 比 率 | 純 資 産 額 |
|----------------|-----------|-------|---|-------|----------------------------|-------------|-------------|---------|
|                | 期 騰 落     | 中 率   | 期 騰 落   | 中 率   |                            |             |             |         |
|                | 円 銭       | %     |   | %     | %                          | %           | %           | 百万円     |
| 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   |
| 5期(2017年6月12日) | 20,417    | 12.6  | 53,888.25   | 12.4  | —                          | 93.4        | —           | 1,355   |
| 6期(2018年6月11日) | 20,395    | △ 0.1 | 53,362.98   | △ 1.0 | —                          | 93.8        | —           | 1,553   |
| (償還時)          | (償還価額)    |       |   |       |                            |             |             |         |
| 7期(2019年5月15日) | 22,428.38 | 10.0  | 57,906.00   | 8.5   | —                          | —           | —           | 1,120   |

(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) ICE BofAML アジアン・ダラー・ハイ・イールド・コーポレート指数とは、ICE Data Indices, LLCが算出するアジアのハイイールド債券の動向きを表す指数です。同指数は、ICE Data Indices, LLC、ICE Dataまたはその第三者の財産であり、三菱UFJ国際投信は許諾に基づき使用しています。ICE Dataおよびその第三者は、使用に関して一切の責任を負いません。ICE BofAML アジアン・ダラー・ハイ・イールド・コーポレート指数(円換算ベース)は、ICE BofAML アジアン・ダラー・ハイ・イールド・コーポレート指数をもとに、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。

## ○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 )<br>ICE BofAML アジアン・ダラー・<br>ハイ・イールド・コーポレート指数<br>(円換算ベース) |       | 新株予約権付社債<br>(転換社債)<br>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 |                            |             |             |
| (期首)<br>2018年6月11日  | 円 銭                 | %     |   | %     | %                          | %           | %           |
|                     | 20,395              | —     | 53,362.98   | —     | —                          | 93.8        | —           |
| 6月末                 | 20,352              | △ 0.2 | 53,272.98   | △ 0.2 | —                          | 94.5        | —           |
| 7月末                 | 20,769              | 1.8   | 54,233.60   | 1.6   | —                          | 94.9        | —           |
| 8月末                 | 20,775              | 1.9   | 54,416.62   | 2.0   | —                          | 96.8        | —           |
| 9月末                 | 21,333              | 4.6   | 55,925.05   | 4.8   | —                          | 95.2        | —           |
| 10月末                | 20,844              | 2.2   | 54,534.01   | 2.2   | —                          | 95.2        | —           |
| 11月末                | 20,786              | 1.9   | 54,353.95   | 1.9   | —                          | 93.8        | —           |
| 12月末                | 20,586              | 0.9   | 54,073.98   | 1.3   | —                          | 94.6        | —           |
| 2019年1月末            | 20,806              | 2.0   | 54,880.97   | 2.8   | —                          | 91.9        | —           |
| 2月末                 | 21,614              | 6.0   | 56,875.42   | 6.6   | —                          | 97.0        | —           |
| 3月末                 | 22,288              | 9.3   | 58,664.32   | 9.9   | —                          | 94.4        | —           |
| 4月末                 | 22,432              | 10.0  | 59,370.09   | 11.3  | —                          | —           | —           |
| (償還時)<br>2019年5月15日 | (償還価額)<br>22,428.38 | 10.0  | 57,906.00   | 8.5   | —                          | —           | —           |

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

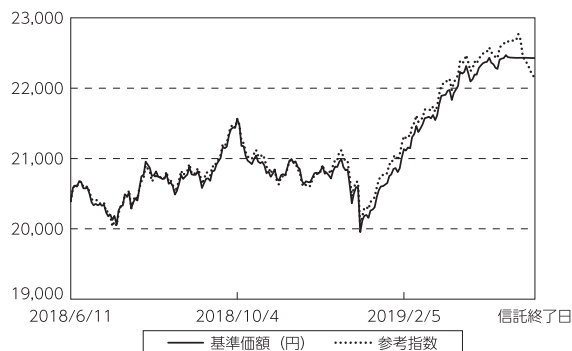
## ○運用経過

## ●当期中の基準価額等の推移について

## ◎基準価額の動き

償還価額は期首に比べ10.0%の上昇となりました。

## 基準価額等の推移



(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

- ・アジア・ハイイールド債券市況では、スプレッド（米国債に対する上乗せ金利）は拡大したものの、米国金利の低下等を背景に上昇しました。

◎為替市況

- ・為替市況は、米ドルは対円で若干上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・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運用を行ってまいりました。
- ・期首から2019年4月中旬にかけて、債券現物の高位組み入れを維持しました。4月中旬以降は、繰上償還日に向けて保有債券の売却を行いました。

●償還価額

償還価額は22,428円38銭となりました。

## ○1万口当たりの費用明細

(2018年6月12日～2019年5月15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 )           | (9) | (0.042) | 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 )             | (0) | (0.001) | 信託事務の処理等に要するその他諸費用              |
| 合 計                   | 9   | 0.043   |                                 |
| 期中の平均基準価額は、21,089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

(2018年6月12日～2019年5月15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<br>3,768 | 千アメリカドル<br>16,742<br>( 469) |

(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

(2018年6月12日～2019年5月15日)

## 利害関係人との取引状況

| 区 分    | 買付額等<br>A | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C    | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|-----------|--------------------|---------------|--------------|--------------------|---------------|
|        |           |                    |               |              |                    |               |
| 為替直物取引 | 百万円<br>38 | 百万円<br>6           | %<br>15.8     | 百万円<br>1,713 | 百万円<br>105         | %<br>6.1      |

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

(2019年5月15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

(2019年5月15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<br>1,120,974 | %<br>100.0 |
| 投資信託財産総額     | 1,120,974       | 100.0      |

## ○資産、負債、元本及び償還価額の状況 (2019年5月15日現在)

| 項 目             | 償 還 時         |
|-----------------|---------------|
|                 | 円             |
| (A) 資産          | 1,120,974,407 |
| コール・ローン等        | 1,120,974,407 |
| (B) 負債          | 837           |
| 未払利息            | 837           |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 1,120,973,570 |
| 元本              | 499,801,482   |
| 償還差益金           | 621,172,088   |
| (D) 受益権総口数      | 499,801,482口  |
| 1万口当たり償還価額(C/D) | 22,428円38銭    |

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 761,597,830円  
 期中追加設定元本額 22,708,620円  
 期中一部解約元本額 284,504,968円  
 また、1口当たり純資産額は、期末2.242838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) | 227,373,564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) | 272,427,918円 |
| 合計                                      | 499,801,482円 |

## ○損益の状況 (2018年6月12日~2019年5月15日)

| 項 目              | 当 期          |
|------------------|--------------|
|                  | 円            |
| (A) 配当等収益        | 78,538,550   |
| 受取利息             | 78,294,351   |
| その他収益金           | 299,036      |
| 支払利息             | △ 54,837     |
| (B) 有価証券売買損益     | 51,185,644   |
| 売買益              | 78,963,301   |
| 売買損              | △ 27,777,657 |
| (C) 保管費用等        | △ 567,408    |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 129,156,786  |
| (E) 前期繰越損益金      | 791,718,954  |
| (F) 追加信託差損益金     | 23,791,380   |
| (G) 解約差損益金       | △323,495,032 |
| 償還差益金(D+E+F+G)   | 621,172,088  |

- (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】

①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。  
 (2019年5月15日)

②本資料内におけるBofAメリルリンチ(The BofA Merrill Lynch) インデックスは、ICE BofAMLインデックスの名称に変更しています。