

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 | 無期限（2009年9月28日設定） | |
| 運用方針 | ファミリーファンド方式により、日本を除くアジア諸国・地域のソブリン債券（国債、政府保証債等）および準ソブリン債券（政府の出資比率が50%を超えている企業の発行する債券）を中心に投資を行い、安定したインカムゲインの確保と信託財産の成長を目指して運用を行います。 | |
| 主要運用対象 | ベビーファンド | アジア・ソブリン・オープン マザーファンド |
| | マザーファンド | 日本を除くアジア諸国・地域のソブリン債券および準ソブリン債券 |
| 運用方法 | <ul style="list-style-type: none"> 日本を除くアジア諸国・地域のソブリン債券および準ソブリン債券を主要投資対象とし分散投資を行います。 ソブリン債券・準ソブリン債券からの安定した利子収入の確保および信託財産の成長を目指して運用を行います。 | |
| 主な組入制限 | ベビーファンド | <ul style="list-style-type: none"> マザーファンドへの投資割合は、制限を設けません。 外貨建資産への実質投資は、制限を設けません。 ソブリン債券以外への実質投資は、取得時において、当ファンドの純資産総額の35%以内とします。 同一企業が発行する債券への実質投資は、当ファンドの純資産総額の10%以内とします。 同一国・地域が発行する債券への実質投資は、取得時において、当ファンドの純資産総額の35%以内とします。 |
| | マザーファンド | <ul style="list-style-type: none"> 外貨建資産への投資は、制限を設けません。 ソブリン債券以外への投資は、取得時において、信託財産の純資産総額の35%以内とします。 同一企業が発行する債券への投資は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 同一国・地域が発行する債券への投資は、取得時において、信託財産の純資産総額の35%以内とします。 |
| 分配方針 | 毎月22日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、収益分配方針に基づいて分配を行います。分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益と売得益（評価益を含みます。）等の全額とします。基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。原則として、配当等収益や分配対象額の水準等を考慮し、安定した分配を継続することをめざします。（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もあります。） | |

※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。
 ※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）

アジア・ソブリン・オープン
（毎月決算型）

第161期（決算日：2023年2月22日）
 第162期（決算日：2023年3月22日）
 第163期（決算日：2023年4月24日）
 第164期（決算日：2023年5月22日）
 第165期（決算日：2023年6月22日）
 第166期（決算日：2023年7月24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「アジア・ソブリン・オープン（毎月決算型）」は、去る7月24日に第166期の決算を行いましたので、法令に基づいて第161期～第166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
 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）

お客様の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 (分配落) | 価 額 | | | 参 考 指 数 | | 債 券 組 入 比 率 | 債 券 先 物 比 率 | 純 資 産 総 額 | 産 額 |
|-------------------|--------------|-------|-----|-------|---------|--------|----------------|----------------|--------------|-------|
| | | 税 分 配 | み 金 | 期 騰 落 | 中 率 | 期 騰 落 | | | | |
| | 円 | | 円 | | % | | % | | 百万円 | |
| 137期(2021年2月22日) | 8,008 | | 25 | | 0.6 | 21,186 | 0.6 | 97.7 | — | 2,089 |
| 138期(2021年3月22日) | 7,947 | | 25 | △0.4 | | 21,058 | △0.6 | 97.0 | — | 2,065 |
| 139期(2021年4月22日) | 7,865 | | 25 | △0.7 | | 21,119 | 0.3 | 97.2 | — | 2,031 |
| 140期(2021年5月24日) | 7,976 | | 25 | 1.7 | | 21,433 | 1.5 | 97.4 | — | 2,035 |
| 141期(2021年6月22日) | 8,014 | | 25 | 0.8 | | 21,688 | 1.2 | 97.5 | — | 2,022 |
| 142期(2021年7月26日) | 7,935 | | 25 | △0.7 | | 21,537 | △0.7 | 97.1 | — | 1,981 |
| 143期(2021年8月23日) | 7,851 | | 25 | △0.7 | | 21,371 | △0.8 | 96.4 | — | 1,953 |
| 144期(2021年9月22日) | 7,830 | | 25 | 0.1 | | 21,363 | △0.0 | 97.0 | — | 1,915 |
| 145期(2021年10月22日) | 8,043 | | 25 | 3.0 | | 21,954 | 2.8 | 95.1 | — | 1,947 |
| 146期(2021年11月22日) | 8,028 | | 25 | 0.1 | | 22,007 | 0.2 | 96.4 | — | 1,900 |
| 147期(2021年12月22日) | 7,989 | | 25 | △0.2 | | 22,063 | 0.3 | 96.3 | — | 1,554 |
| 148期(2022年1月24日) | 7,918 | | 25 | △0.6 | | 21,868 | △0.9 | 96.0 | — | 1,517 |
| 149期(2022年2月22日) | 7,939 | | 25 | 0.6 | | 21,993 | 0.6 | 95.9 | — | 1,515 |
| 150期(2022年3月22日) | 8,126 | | 25 | 2.7 | | 22,464 | 2.1 | 96.5 | — | 1,542 |
| 151期(2022年4月22日) | 8,403 | | 25 | 3.7 | | 23,307 | 3.8 | 95.7 | — | 1,577 |
| 152期(2022年5月23日) | 8,065 | | 25 | △3.7 | | 22,589 | △3.1 | 94.8 | — | 1,517 |
| 153期(2022年6月22日) | 8,428 | | 25 | 4.8 | | 23,571 | 4.3 | 95.2 | — | 1,582 |
| 154期(2022年7月22日) | 8,418 | | 25 | 0.2 | | 23,616 | 0.2 | 96.4 | — | 1,563 |
| 155期(2022年8月22日) | 8,526 | | 25 | 1.6 | | 24,070 | 1.9 | 95.6 | — | 1,582 |
| 156期(2022年9月22日) | 8,594 | | 25 | 1.1 | | 24,318 | 1.0 | 94.4 | — | 1,591 |
| 157期(2022年10月24日) | 8,422 | | 25 | △1.7 | | 24,009 | △1.3 | 96.8 | — | 1,556 |
| 158期(2022年11月22日) | 8,398 | | 25 | 0.0 | | 24,013 | 0.0 | 97.1 | — | 1,549 |
| 159期(2022年12月22日) | 8,099 | | 25 | △3.3 | | 23,384 | △2.6 | 97.2 | — | 1,491 |
| 160期(2023年1月23日) | 8,286 | | 25 | 2.6 | | 24,011 | 2.7 | 97.7 | — | 1,526 |
| 161期(2023年2月22日) | 8,337 | | 25 | 0.9 | | 24,231 | 0.9 | 98.1 | — | 1,525 |
| 162期(2023年3月22日) | 8,236 | | 25 | △0.9 | | 24,066 | △0.7 | 96.6 | — | 1,507 |
| 163期(2023年4月24日) | 8,381 | | 25 | 2.1 | | 24,552 | 2.0 | 97.2 | — | 1,529 |
| 164期(2023年5月22日) | 8,589 | | 25 | 2.8 | | 25,307 | 3.1 | 97.0 | — | 1,565 |
| 165期(2023年6月22日) | 8,781 | | 25 | 2.5 | | 25,894 | 2.3 | 96.3 | — | 1,591 |
| 166期(2023年7月24日) | 8,819 | | 25 | 0.7 | | 26,146 | 1.0 | 96.5 | — | 1,600 |

(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、F T S E 世界国債インデックスの現地通貨建て国別サブインデックス（シンガポール、マレーシア、フィリピン、インドネシア、韓国、台湾、タイ、中国）の基準日前営業日の各指数とJ.P. Morgan GBI-EM Broad India（インド・ルピー建て、ヘッジなし）の基準日前営業日の指数を基準日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により三菱UFJ 国際投信が円換算したうえ等ウエイトで合成し、当ファンド設定日を10,000として指数化したものです。なお、2022年8月1日以降、参考指数の国別サブインデックスの内、台湾を外し中国を追加して連続させて指数化しています。

各国の国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、各国国債の総合収益率を指数化した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っていません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

J.P. Morgan GBI-EM Broad India（インド・ルピー建て、ヘッジなし）：情報は、信頼性があると信じられる情報源から取得したものです。J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2015, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

(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 | 騰 落 率 | 債 券 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 |
|-------|----------------------|---------|-------|---------|-------|-------------|-----------|
| | | 円 | 騰 落 率 | | | | |
| 第161期 | (期 首) 2023年 1月23日 | 8,286 | — | 24,011 | — | 97.7 | — |
| | 1月末 | 8,350 | 0.8 | 24,257 | 1.0 | 97.7 | — |
| | (期 末) 2023年 2月22日 | 8,362 | 0.9 | 24,231 | 0.9 | 98.1 | — |
| 第162期 | (期 首) 2023年 2月22日 | 8,337 | — | 24,231 | — | 98.1 | — |
| | 2月末 | 8,345 | 0.1 | 24,312 | 0.3 | 97.9 | — |
| | (期 末) 2023年 3月22日 | 8,261 | △0.9 | 24,066 | △0.7 | 96.6 | — |
| 第163期 | (期 首) 2023年 3月22日 | 8,236 | — | 24,066 | — | 96.6 | — |
| | 3月末 | 8,395 | 1.9 | 24,505 | 1.8 | 96.5 | — |
| | (期 末) 2023年 4月24日 | 8,406 | 2.1 | 24,552 | 2.0 | 97.2 | — |
| 第164期 | (期 首) 2023年 4月24日 | 8,381 | — | 24,552 | — | 97.2 | — |
| | 4月末 | 8,429 | 0.6 | 24,681 | 0.5 | 96.9 | — |
| | (期 末) 2023年 5月22日 | 8,614 | 2.8 | 25,307 | 3.1 | 97.0 | — |
| 第165期 | (期 首) 2023年 5月22日 | 8,589 | — | 25,307 | — | 97.0 | — |
| | 5月末 | 8,638 | 0.6 | 25,422 | 0.5 | 96.9 | — |
| | (期 末) 2023年 6月22日 | 8,806 | 2.5 | 25,894 | 2.3 | 96.3 | — |
| 第166期 | (期 首) 2023年 6月22日 | 8,781 | — | 25,894 | — | 96.3 | — |
| | 6月末 | 8,905 | 1.4 | 26,245 | 1.4 | 96.2 | — |
| | (期 末) 2023年 7月24日 | 8,844 | 0.7 | 26,146 | 1.0 | 96.5 | — |

(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、「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161期～第166期：2023年1月24日～2023年7月24日

▶ 当作成期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



| | |
|-------------|--------|
| 第161期首 | 8,286円 |
| 第166期末 | 8,819円 |
| 既払分配金 | 150円 |
| 騰落率 | 8.3% |
| (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

基準価額は期間の初めに比べ8.3%（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

全ての投資通貨が対円で上昇したことやインドネシアやインドなどの金利が低下したことが、基準価額の上昇要因となりました。

下落要因

シンガポールやタイなどの金利が上昇したことが、基準価額の下落要因となりました。

第161期～第166期：2023年1月24日～2023年7月24日

投資環境について

▶ 債券市況

投資対象国・地域の金利はまちまちな動きでした。

インドネシアでは、インフレ率が低下傾向にあり、中銀が2023年1月に利上げを行った後、政策金利を維持したことなどから、金利は低下しました。

タイでは、中銀が利上げを行ったことや観光業の回復などから景気回復期待が高止まり、金利は上昇しました。

▶ 為替市況

投資対象国・地域の通貨は対円で上昇しました。

インドネシアルピアは、インフレ率が低下傾向にあり、経常収支の黒字が継続していることなどから、対円で上昇しました。

インドルピーは、原油などの輸入価格が安定的に推移したことやインフレ率が低下傾向にあることなどから、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

▶ アジア・ソブリン・オープン（毎月決算型）

アジア・ソブリン・オープン マザーファンド受益証券を主要投資対象としており、実質的な運用はマザーファンドで行っています。

▶ アジア・ソブリン・オープン マザーファンド

日本を除くアジア諸国・地域のソブリン債券（国債、政府保証債、国際機関債などをいいます。）および準ソブリン債券（政府の出資比率が50%を超えている企業の発行する債券をいいます。）を主要投資対象とし、これらの債券を高位に組み

入れて運用しました。

インドネシアやインド、タイなどの債券組入比率を高めとしました。

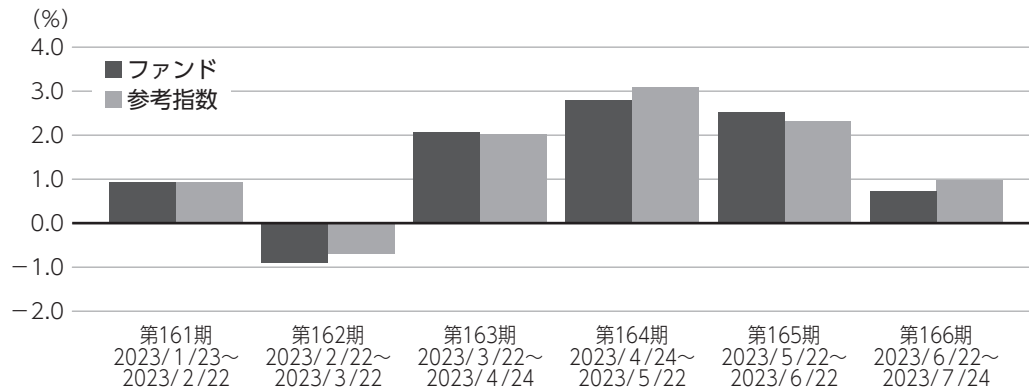
外貨建資産について、対円で為替ヘッジは行いませんでした。なお、米ドル建債券等の外国通貨建債券に投資した場合には、実質的に債券発行国（アジア諸国・地域）の自国通貨建てとなるように為替予約、直物為替先渡取引（NDF）などによる為替取引を行いました。

※直物為替先渡取引とは、一種の外国為替先渡取引であり、決済時に元本の受け渡しを行わずに、取引時に決定した取引レートと決済レートの差および元本により計算した額を、米ドルなどに換算して、受け渡しを行う取引です。

第161期～第166期：2023/1/24～2023/7/24

▶ 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、アジア国債インデックス（円ベース）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161期 | 第162期 | 第163期 | 第164期 | 第165期 | 第166期 |
|--------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| | 2023年1月24日~ 2023年2月22日 | 2023年2月23日~ 2023年3月22日 | 2023年3月23日~ 2023年4月24日 | 2023年4月25日~ 2023年5月22日 | 2023年5月23日~ 2023年6月22日 | 2023年6月23日~ 2023年7月24日 |
| 当期分配金 （対基準価額比率） | 25 (0.299%) | 25 (0.303%) | 25 (0.297%) | 25 (0.290%) | 25 (0.284%) | 25 (0.283%) |
| 当期の収益 | 25 | 15 | 25 | 25 | 25 | 25 |
| 当期の収益以外 | - | 9 | - | - | - | - |
| 翌期繰越分配対象額 | 222 | 213 | 216 | 217 | 396 | 435 |

（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 （作成対象期間末での見解です。）

▶ アジア・ソブリン・オープン（毎月決算型）

引き続き、アジア・ソブリン・オープンマザーファンド受益証券を主要投資対象として運用を行います。マザーファンドの組入比率を引き続き高位に保ち運用を行っていく方針です。

▶ アジア・ソブリン・オープン マザーファンド

相対的に高金利国のインドネシアやインド、観光業が回復傾向にあるタイなどの債券組入比率を高く維持し、安定的な利子収入の確保を目指します。

利息収入と債券価格の変動を考慮して、当面のデュレーション（平均回収期間や金利感応度）は期間末と概ね同程度とする予定です。デュレーションを調整するために、債券先物を使用する場合があります。

外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジは行いません。外国通貨建債券に投資した場合には、原則として、実質的に債券発行国（アジア諸国・地域）の自国通貨建となるように為替予約、直物為替先渡取引などの為替取引を行います。

2023年1月24日～2023年7月24日

1万口当たりの費用明細

| 項目 | 第161期～第166期 | | 項目の概要 |
|-----------|-------------|---------|---|
| | 金額 (円) | 比率 (%) | |
| (a) 信託報酬 | 70 | 0.821 | (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） | (40) | (0.471) | 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） | (28) | (0.328) | 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) | (0.022) | 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 | 8 | 0.092 | (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） | (8) | (0.089) | 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 | 78 | 0.913 | |

作成期中の平均基準価額は、8,504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。

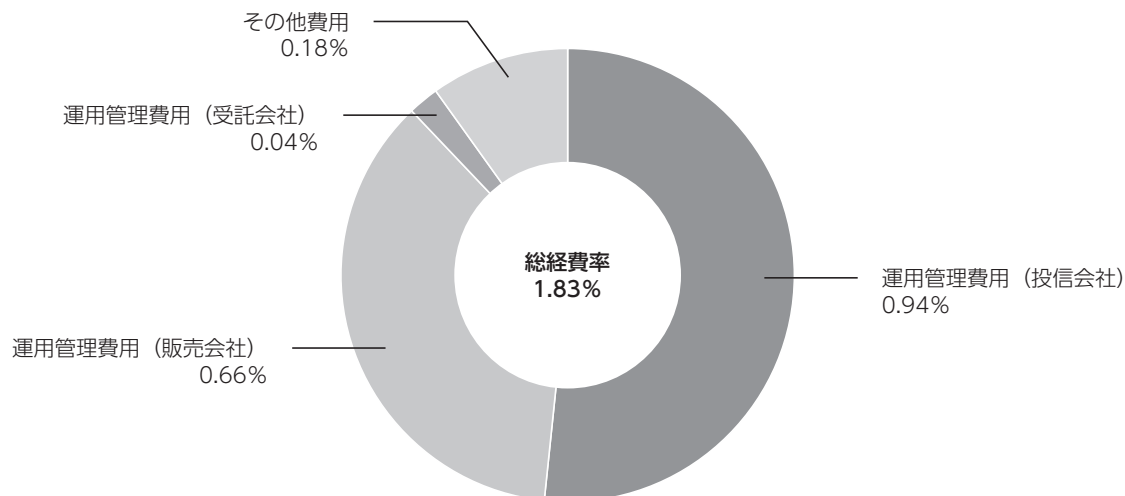
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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。

（参考情報）

■ 総経費率

当作成対象期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成期中の平均受益権口数に作成期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は1.83%**です。



(注) 費用は、1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 前記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2023年1月24日～2023年7月24日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘柄 | 第161期～第166期 | | | |
|-----------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| | 設定 | | 解約 | |
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| アジア・ソブリン・オープン マザーファンド | 千口 12,163 | 千円 30,486 | 千口 37,686 | 千円 94,278 |

○利害関係人との取引状況等

(2023年1月24日～2023年7月24日)

該当事項はございません。

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す。

○組入資産の明細

(2023年7月24日現在)

親投資信託残高

| 銘柄 | 第160期末 | 第166期末 | |
|-----------------------|---------------|---------------|-----------------|
| | 口数 | 口数 | 評価額 |
| アジア・ソブリン・オープン マザーファンド | 千口 630,368 | 千口 604,845 | 千円 1,595,400 |

○投資信託財産の構成

(2023年7月24日現在)

| 項目 | 第166期末 | |
|-----------------------|-----------------|-----------|
| | 評価額 | 比率 |
| アジア・ソブリン・オープン マザーファンド | 千円 1,595,400 | % 99.1 |
| コール・ローン等、その他 | 14,276 | 0.9 |
| 投資信託財産総額 | 1,609,676 | 100.0 |

(注) アジア・ソブリン・オープン 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（1,594,649千円）の投資信託財産総額（1,596,233千円）に対する比率は99.9%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=141.83円 | 1 シンガポールドル=106.60円 | 1 マレーシアリンギット=31.0347円 | 1 タイバーツ=4.11円 |
| 1 フィリピンペソ=2.5905円 | 100 インドネシアルピア=0.95円 | 100 韓国ウォン=11.04円 | 1 インドルピー=1.74円 |
| 1 中国元=19.7227円 | | | |

○特定資産の価格等の調査

(2023年1月24日～2023年7月24日)

<アジア・ソブリン・オープン マザーファンド>

| 特定資産の種類 | 件数 |
|----------|----|
| 直物為替先渡取引 | 7 |

当作成期に、アジア・ソブリン・オープン（毎月決算型）の主要投資対象であるアジア・ソブリン・オープン 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あらた有限責任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、元本及び基準価額の状況

| 項目 | 第161期末 | 第162期末 | 第163期末 | 第164期末 | 第165期末 | 第166期末 |
|---------------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| | 2023年2月22日現在 | 2023年3月22日現在 | 2023年4月24日現在 | 2023年5月22日現在 | 2023年6月22日現在 | 2023年7月24日現在 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 資産 | 1,537,575,416 | 1,514,288,474 | 1,537,929,067 | 1,573,145,043 | 1,609,965,568 | 1,609,676,051 |
| コール・ローン等 | 12,058,736 | 10,996,059 | 11,901,553 | 11,757,878 | 14,879,528 | 13,989,042 |
| アジア・ソブリン・オープン マザーファンド(詳細) | 1,520,582,834 | 1,503,190,550 | 1,525,082,234 | 1,560,453,030 | 1,586,331,886 | 1,595,400,600 |
| 未収入金 | 4,933,846 | 101,865 | 945,280 | 934,135 | 8,754,154 | 286,409 |
| (B) 負債 | 12,421,587 | 6,572,005 | 8,248,017 | 7,975,922 | 18,870,958 | 9,507,432 |
| 未払収益分配金 | 4,573,180 | 4,576,845 | 4,562,809 | 4,555,980 | 4,529,946 | 4,535,967 |
| 未払解約金 | 5,761,670 | 66,597 | 1,409,403 | 1,447,728 | 12,123,218 | 2,667,266 |
| 未払信託報酬 | 2,081,175 | 1,923,423 | 2,269,742 | 1,966,957 | 2,211,881 | 2,298,056 |
| 未払利息 | 21 | 19 | 21 | 20 | 26 | 24 |
| その他未払費用 | 5,541 | 5,121 | 6,042 | 5,237 | 5,887 | 6,119 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 1,525,153,829 | 1,507,716,469 | 1,529,681,050 | 1,565,169,121 | 1,591,094,610 | 1,600,168,619 |
| 元本 | 1,829,272,096 | 1,830,738,237 | 1,825,123,739 | 1,822,392,392 | 1,811,978,493 | 1,814,387,081 |
| 次期繰越損益金 | △ 304,118,267 | △ 323,021,768 | △ 295,442,689 | △ 257,223,271 | △ 220,883,883 | △ 214,218,462 |
| (D) 受益権総口数 | 1,829,272,096口 | 1,830,738,237口 | 1,825,123,739口 | 1,822,392,392口 | 1,811,978,493口 | 1,814,387,081口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 8,337円 | 8,236円 | 8,381円 | 8,589円 | 8,781円 | 8,819円 |

○損益の状況

| 項 目 | 第161期 | 第162期 | 第163期 | 第164期 | 第165期 | 第166期 |
|-----------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| | 2023年1月24日～ 2023年2月22日 | 2023年2月23日～ 2023年3月22日 | 2023年3月23日～ 2023年4月24日 | 2023年4月25日～ 2023年5月22日 | 2023年5月23日～ 2023年6月22日 | 2023年6月23日～ 2023年7月24日 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 322 | △ 311 | △ 351 | △ 294 | △ 353 | △ 379 |
| 支払利息 | △ 322 | △ 311 | △ 351 | △ 294 | △ 353 | △ 379 |
| (B) 有価証券売買損益 | 16,036,187 | △ 12,127,419 | 33,382,698 | 44,214,000 | 41,418,743 | 13,783,148 |
| 売買益 | 16,195,002 | 18,856 | 33,619,229 | 44,478,273 | 41,908,027 | 14,008,077 |
| 売買損 | △ 158,815 | △ 12,146,275 | △ 236,531 | △ 264,273 | △ 489,284 | △ 224,929 |
| (C) 信託報酬等 | △ 2,086,716 | △ 1,928,544 | △ 2,275,784 | △ 1,972,194 | △ 2,217,768 | △ 2,304,175 |
| (D) 当期損益金 (A + B + C) | 13,949,149 | △ 14,056,274 | 31,106,563 | 42,241,512 | 39,200,622 | 11,478,594 |
| (E) 前期繰越損益金 | △ 58,308,351 | △ 48,629,355 | △ 65,871,405 | △ 39,081,952 | △ 1,368,103 | 33,173,843 |
| (F) 追加信託差損益金 | △255,185,885 | △255,759,294 | △256,115,038 | △255,826,851 | △254,186,456 | △254,334,932 |
| (配当等相当額) | (39,751,353) | (39,810,127) | (38,796,386) | (38,751,444) | (38,554,420) | (38,832,725) |
| (売買損益相当額) | (△294,937,238) | (△295,569,421) | (△294,911,424) | (△294,578,295) | (△292,740,876) | (△293,167,657) |
| (G) 計 (D + E + F) | △299,545,087 | △318,444,923 | △290,879,880 | △252,667,291 | △216,353,937 | △209,682,495 |
| (H) 収益分配金 | △ 4,573,180 | △ 4,576,845 | △ 4,562,809 | △ 4,555,980 | △ 4,529,946 | △ 4,535,967 |
| 次期繰越損益金 (G + H) | △304,118,267 | △323,021,768 | △295,442,689 | △257,223,271 | △220,883,883 | △214,218,462 |
| 追加信託差損益金 | △255,185,885 | △256,674,663 | △256,115,038 | △255,826,851 | △254,186,456 | △254,334,932 |
| (配当等相当額) | (39,771,683) | (38,915,289) | (38,806,074) | (38,765,113) | (38,590,624) | (38,851,640) |
| (売買損益相当額) | (△294,957,568) | (△295,589,952) | (△294,921,112) | (△294,591,964) | (△292,777,080) | (△293,186,572) |
| 分配準備積立金 | 976,335 | 108,230 | 736,255 | 954,696 | 33,302,573 | 40,116,470 |
| 繰越損益金 | △ 49,908,717 | △ 66,455,335 | △ 40,063,906 | △ 2,351,116 | — | — |

(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 1,842,147,869円
 作成期中追加設定元本額 70,656,446円
 作成期中一部解約元本額 98,417,234円
 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.8819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214,218,462円です。
- ③ 分配金の計算過程

| 項 目 | 2023年1月24日～ 2023年2月22日 | 2023年2月23日～ 2023年3月22日 | 2023年3月23日～ 2023年4月24日 | 2023年4月25日～ 2023年5月22日 | 2023年5月23日～ 2023年6月22日 | 2023年6月23日～ 2023年7月24日 |
|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| 費用控除後の配当等収益額 | 5,146,357円 | 2,782,475円 | 5,182,372円 | 4,775,843円 | 5,418,511円 | 5,032,642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 | 31,471,036円 | 6,445,952円 |
| 収益調整金額 | 39,771,683円 | 39,830,658円 | 38,806,074円 | 38,765,113円 | 38,590,624円 | 38,851,640円 |
| 分配準備積立金額 | 403,158円 | 987,231円 | 116,692円 | 734,833円 | 942,972円 | 33,173,843円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | 45,321,198円 | 43,600,364円 | 44,105,138円 | 44,275,789円 | 76,423,143円 | 83,504,077円 |
| 1万円当たり収益分配対象額 | 247円 | 238円 | 241円 | 242円 | 421円 | 460円 |
| 1万円当たり分配金額 | 25円 | 25円 | 25円 | 25円 | 25円 | 25円 |
| 収益分配金金額 | 4,573,180円 | 4,576,845円 | 4,562,809円 | 4,555,980円 | 4,529,946円 | 4,535,967円 |

○分配金のお知らせ

| | 第161期 | 第162期 | 第163期 | 第164期 | 第165期 | 第166期 |
|-----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 1 万口当たり分配金（税込み） | 25円 | 25円 | 25円 | 25円 | 25円 | 25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。
- ・分配時において、外国税控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※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（<https://www.am.mufg.jp/>）をご覧ください。

【お知らせ】

三菱UFJ国際投信株式会社は、2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更します。

アジア・ソブリン・オープン マザーファンド

《第28期》決算日2023年7月24日

[計算期間：2023年1月24日～2023年7月24日]

「アジア・ソブリン・オープン マザーファンド」は、7月24日に第28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28期の運用状況をご報告申し上げます。

| | |
|--------|---|
| 運用方針 | 日本を除くアジア諸国・地域のソブリン債券（国債、政府保証債等）および準ソブリン債券（政府の出資比率が50%を超えている企業の発行する債券）を中心に投資を行い、安定したインカムゲインの確保と信託財産の成長を目指して運用を行います。 |
| 主要運用対象 | 日本を除くアジア諸国・地域のソブリン債券および準ソブリン債券 |
| 主な組入制限 | <ul style="list-style-type: none"> ・外貨建資産への投資は、制限を設けません。 ・ソブリン債券以外への投資は、取得時において、信託財産の純資産総額の35%以内とします。 ・同一企業が発行する債券への投資は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ・同一国・地域が発行する債券への投資は、取得時において、信託財産の純資産総額の35%以内とします。 |

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | 参考指数 | | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 | 純 資 産 額 |
|-----------------|-------------|--------|-------------|--------|-----------------------|-----------------------|------------------|
| | 期 騰 落 | 中 率 | 期 騰 落 | 中 率 | | | |
| | 円 | % | | % | % | % | 百万円 |
| 24期(2021年7月26日) | 21,338 | 2.1 | 21,537 | 2.3 | 97.3 | — | 1,975 |
| 25期(2022年1月24日) | 21,881 | 2.5 | 21,868 | 1.5 | 96.2 | — | 1,512 |
| 26期(2022年7月22日) | 23,890 | 9.2 | 23,616 | 8.0 | 96.7 | — | 1,558 |
| 27期(2023年1月23日) | 24,142 | 1.1 | 24,011 | 1.7 | 98.0 | — | 1,521 |
| 28期(2023年7月24日) | 26,377 | 9.3 | 26,146 | 8.9 | 96.8 | — | 1,595 |

(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、FTSE E世界国債インデックスの現地通貨建て国別サブインデックス（シンガポール、マレーシア、フィリピン、インドネシア、韓国、台湾、タイ、中国）の基準日前営業日の各指数とJ.P. Morgan GBI-EM Broad India（インド・ルビー建て、ヘッジなし）の基準日前営業日の指数を基準日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により三菱UFJ国際投信が円換算したうえ等ウエイトで合成し、当ファンド設定日を10,000として指数化したものです。なお、2022年8月1日以降、参考指数の国別サブインデックスの内、台湾を外し中国を追加して連続させて指数化しています。

各国の国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、各国国債の総合収益率を指数化した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

J.P. Morgan GBI-EM Broad India（インド・ルビー建て、ヘッジなし）：情報は、信頼性があると信じられる情報源から取得したものです。J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2015, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

(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 | | 債 組 入 比 | 券 率 | 債 先 物 比 | 券 率 |
|-------------------------|-------------|--------|---------|--------|---------|-----|---------|-----|
| | 騰 落 率 | 率 | 騰 落 率 | 率 | | | | |
| (期 首) 2023年 1 月 23 日 | 円 24,142 | % — | 24,011 | % — | 98.0 | % | — | % |
| 1 月 末 | 24,337 | 0.8 | 24,257 | 1.0 | 98.0 | — | — | |
| 2 月 末 | 24,427 | 1.2 | 24,312 | 1.3 | 98.2 | — | — | |
| 3 月 末 | 24,682 | 2.2 | 24,505 | 2.1 | 96.8 | — | — | |
| 4 月 末 | 24,888 | 3.1 | 24,681 | 2.8 | 97.2 | — | — | |
| 5 月 末 | 25,620 | 6.1 | 25,422 | 5.9 | 97.2 | — | — | |
| 6 月 末 | 26,528 | 9.9 | 26,245 | 9.3 | 96.5 | — | — | |
| (期 末) 2023年 7 月 24 日 | 26,377 | 9.3 | 26,146 | 8.9 | 96.8 | — | — | |

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

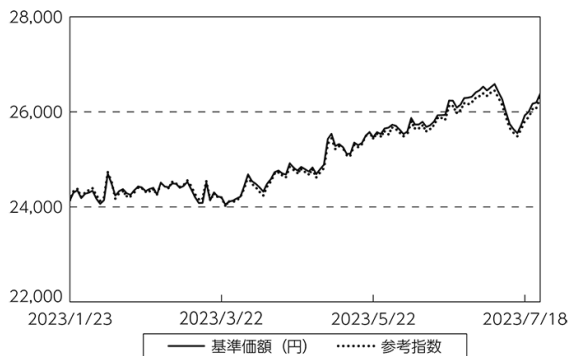
○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ9.3%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。

●基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

全ての投資通貨が対円で上昇したことやインドネシアやインドなどの金利が低下したことが、基準価額の上昇要因となりました。

(下落要因)

シンガポールやタイなどの金利が上昇したことが、基準価額の下落要因となりました。

●投資環境について

◎債券市況

- ・投資対象国・地域の金利はまちまちな動きでした。
- ・インドネシアでは、インフレ率が低下傾向にあり、中銀が2023年1月に利上げを行った後、政策金利を維持したことなどから、金利は低下しました。
- ・タイでは、中銀が利上げを行ったことや観光業の回復などから景気回復期待が高止まり、金利は上昇しました。

◎為替市況

- ・投資対象国・地域の通貨は対円で上昇しました。
- ・インドネシアルピアは、インフレ率が低下傾向にあり、経常収支の黒字が継続していることなどから、対円で上昇しました。
- ・インドルピーは、原油などの輸入価格が安定的に推移したことやインフレ率が低下傾向にあることなどから、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

- ・日本を除くアジア諸国・地域のソブリン債券（国債、政府保証債、国際機関債などをいいます。）および準ソブリン債券（政府の出資比率が50%を超えている企業の発行する債券をいいます。）を主要投資対象とし、これらの債券を高位に組み入れて運用しました。
- ・インドネシアやインド、タイなどの債券組入比率を高めとしました。
- ・外貨建資産について、対円で為替ヘッジは行いませんでした。なお、米ドル建債券等の外国通貨建債券に投資した場合には、実質的に債券発行国（アジア諸国・地域）の自国通貨建てとなるように為替予約、直物為替先渡取引（NDF）などによる為替取引を行いました。

※直物為替先渡取引とは、一種の外国為替先渡取引であり、決済時に元本の受け渡しを行わずに、取引時に決定した取引レートと決済レートの差および元本により計算した額を、米ドルなどに換算して、受け渡しを行う取引です。

○今後の運用方針

- ・相対的に高金利国のインドネシアやインド、観光業が回復傾向にあるタイなどの債券組入比率を高く維持し、安定的な利子収入の確保を目指します。
- ・利息収入と債券価格の変動を考慮して、当面のデュレーション（平均回収期間や金利感応度）は期間末と概ね同程度とする予定です。デュレーションを調整するために、債券先物を使用する場合があります。
- ・外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジは行いません。外国通貨建債券に投資した場合には、原則として、実質的に債券発行国（アジア諸国・地域）の自国通貨建てとなるように為替予約、直物為替先渡取引などの為替取引を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年 1 月24日～2023年 7 月24日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|---------|------------|---------------------------------|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) そ の 他 費 用 | 円 23 | % 0.090 | (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 ） | (22) | (0.089) | 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 | 23 | 0.090 | |
| 期中の平均基準価額は、25,077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

(2023年1月24日～2023年7月24日)

公社債

| | | | 買付額 | 売付額 |
|--------|--------|------|-------------------------|-----------------------|
| 外 国 | アメリカ | 特殊債券 | 千アメリカドル 397 | 千アメリカドル - |
| | シンガポール | 国債証券 | 千シンガポールドル 184 | 千シンガポールドル 533 |
| | マレーシア | 国債証券 | 千マレーシアリングギット - | 千マレーシアリングギット 1,009 |
| | タイ | 国債証券 | 千タイバーツ 9,706 | 千タイバーツ 9,887 |
| | インドネシア | 国債証券 | 千インドネシアルピア 1,930,000 | 千インドネシアルピア - |
| | 韓国 | 国債証券 | 千韓国ウォン 1,006,476 | 千韓国ウォン 1,276,003 |
| | インド | 特殊債券 | 千インドルピー 6,967 | 千インドルピー - |
| | 中国 | 国債証券 | 千中国元 1,996 | 千中国元 4,046 |

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分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 169 |

○利害関係人との取引状況等

(2023年1月24日～2023年7月24日)

該当事項はございません。

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す。

○組入資産の明細

(2023年7月24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 |
| アメリカ | 千アメリカドル 600 | 千アメリカドル 570 | 千円 80,957 | % 5.1 | % — | % 5.1 | % — | % — |
| シンガポール | 千シンガポールドル 1,300 | 千シンガポールドル 1,312 | 139,884 | 8.8 | — | 8.8 | — | — |
| マレーシア | 千マレーシアリンギット 6,000 | 千マレーシアリンギット 6,192 | 192,179 | 12.0 | — | 10.1 | 2.0 | — |
| タイ | 千タイバーツ 50,000 | 千タイバーツ 50,742 | 208,552 | 13.1 | — | 13.1 | — | — |
| フィリピン | 千フィリピンペソ 80,000 | 千フィリピンペソ 79,740 | 206,567 | 12.9 | — | 7.9 | 5.0 | — |
| インドネシア | 千インドネシアルピア 26,000,000 | 千インドネシアルピア 26,485,662 | 251,613 | 15.8 | — | 13.4 | 1.2 | 1.2 |
| 韓国 | 千韓国ウォン 1,600,000 | 千韓国ウォン 1,537,959 | 169,790 | 10.6 | — | 10.6 | — | — |
| インド | 千インドルピー 106,990 | 千インドルピー 110,925 | 193,010 | 12.1 | — | 12.1 | — | — |
| 中国 | 千中国元 5,000 | 千中国元 5,150 | 101,583 | 6.4 | — | 5.1 | 1.2 | — |
| 合 計 | — | — | 1,544,139 | 96.8 | — | 86.2 | 9.4 | 1.2 |

(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 | |
| | 特殊債券 5.5 EX-IM BK IND 330118 | 5.5 | 400 | 400 | 56,758 | 2033/1/18 |
| | 社債券 3 PERUSAHAAN 300630 | 3.0 | 200 | 170 | 24,198 | 2030/6/30 |
| 小 | 計 | | | | 80,957 | |
| シンガポール | | | 千シンガポールドル | 千シンガポールドル | | |
| | 国債証券 2.375 SINGAPORGOV 390701 | 2.375 | 300 | 286 | 30,510 | 2039/7/1 |
| | 2.625 SINGAPORGOV 320801 | 2.625 | 100 | 97 | 10,382 | 2032/8/1 |
| | 2.875 SINGAPORGOVT 300901 | 2.875 | 100 | 99 | 10,585 | 2030/9/1 |
| | 3.375 SINGAPORGOV 330901 | 3.375 | 800 | 829 | 88,406 | 2033/9/1 |
| 小 | 計 | | | | 139,884 | |
| マレーシア | | | 千マレーシアリンギット | 千マレーシアリンギット | | |
| | 国債証券 3.828 MALAYSIAGOV 340705 | 3.828 | 1,000 | 984 | 30,564 | 2034/7/5 |
| | 3.899 MALAYSIAGOV 271116 | 3.899 | 1,000 | 1,011 | 31,394 | 2027/11/16 |
| | 4.232 MALAYSIAGOV 310630 | 4.232 | 2,000 | 2,052 | 63,709 | 2031/6/30 |
| | 4.498 MALAYSIAGOV 300415 | 4.498 | 1,000 | 1,044 | 32,411 | 2030/4/15 |
| | 4.893 MALAYSIAGOV 380608 | 4.893 | 1,000 | 1,098 | 34,099 | 2038/6/8 |
| 小 | 計 | | | | 192,179 | |
| タイ | | | 千タイバーツ | 千タイバーツ | | |
| | 国債証券 1.585 THAILAND 351217 | 1.585 | 10,000 | 8,851 | 36,378 | 2035/12/17 |
| | 2 THAILAND 311217 | 2.0 | 10,000 | 9,623 | 39,550 | 2031/12/17 |
| | 2.875 THAILAND 281217 | 2.875 | 10,000 | 10,241 | 42,091 | 2028/12/17 |
| | 3.775 THAILAND 320625 | 3.775 | 20,000 | 22,027 | 90,532 | 2032/6/25 |
| 小 | 計 | | | | 208,552 | |
| フィリピン | | | 千フィリピンペソ | 千フィリピンペソ | | |
| | 国債証券 5.75 PHILIPPINE 280307 | 5.75 | 15,000 | 14,762 | 38,241 | 2028/3/7 |
| | 6.25 PHILIPPI(GL) 360114 | 6.25 | 50,000 | 48,760 | 126,314 | 2036/1/14 |
| | 8.625 PHILIPPINE 270906 | 8.625 | 15,000 | 16,217 | 42,011 | 2027/9/6 |
| 小 | 計 | | | | 206,567 | |
| インドネシア | | | 千インドネシアルピア | 千インドネシアルピア | | |
| | 国債証券 5.125 INDONESIA 270415 | 5.125 | 2,000,000 | 1,956,069 | 18,582 | 2027/4/15 |
| | 6.5 INDONESIA 250615 | 6.5 | 2,000,000 | 2,018,093 | 19,171 | 2025/6/15 |
| | 6.625 INDONESIA 330515 | 6.625 | 22,000,000 | 22,511,500 | 213,859 | 2033/5/15 |
| 小 | 計 | | | | 251,613 | |
| 韓国 | | | 千韓国ウォン | 千韓国ウォン | | |
| | 国債証券 1.375 KOREA TREAS 291210 | 1.375 | 300,000 | 261,271 | 28,844 | 2029/12/10 |
| | 2.375 KOREA TREAS 281210 | 2.375 | 300,000 | 281,801 | 31,110 | 2028/12/10 |
| | 3.25 KOREA TREASU 330610 | 3.25 | 100,000 | 96,578 | 10,662 | 2033/6/10 |
| | 3.25 KOREA TREASU 530310 | 3.25 | 400,000 | 373,517 | 41,236 | 2053/3/10 |
| | 4.25 KOREA TREASU 321210 | 4.25 | 500,000 | 524,789 | 57,936 | 2032/12/10 |
| 小 | 計 | | | | 169,790 | |
| インド | | | 千インドルピー | 千インドルピー | | |
| | 国債証券 7.26 INDIA GOVT 290114 | 7.26 | 50,000 | 50,350 | 87,609 | 2029/1/14 |
| | 8.28 INDIA GOVT 320215 | 8.28 | 50,000 | 53,600 | 93,264 | 2032/2/15 |
| | 特殊債券 7.1 INTL FINAN 310321 | 7.1 | 6,990 | 6,975 | 12,137 | 2031/3/21 |
| 小 | 計 | | | | 193,010 | |

| 銘柄 | 当期 | | | | | 償還年月日 |
|------|------------------------|------|-------|--------|-----------|-----------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| 中国 | % | 千中国元 | 千中国元 | 千円 | | |
| 国債証券 | 2.5 CHINA GOVT 270725 | 2.5 | 1,000 | 1,004 | 19,815 | 2027/7/25 |
| | 2.62 CHINA GOVT 290925 | 2.62 | 1,000 | 1,002 | 19,776 | 2029/9/25 |
| | 2.75 CHINA GOVT 320217 | 2.75 | 1,000 | 1,006 | 19,848 | 2032/2/17 |
| | 2.76 CHINA GOVT 320515 | 2.76 | 1,000 | 1,006 | 19,856 | 2032/5/15 |
| | 3.72 CHINA GOVT 510412 | 3.72 | 1,000 | 1,129 | 22,286 | 2051/4/12 |
| 小計 | | | | | 101,583 | |
| 合計 | | | | | 1,544,139 | |

(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) 社債券には政府の出資比率が50%を超えている企業の発行する債券が含まれております。

スワップ及び先渡取引残高

| 種類 | 取引契約残高 |
|----------|-----------|
| | 当期末想定元本額 |
| 直物為替先渡取引 | 百万円 79 |

○投資信託財産の構成

(2023年7月24日現在)

| 項目 | 当期末 | |
|--------------|-----------------|-----------|
| | 評価額 | 比率 |
| 公社債 | 千円 1,544,139 | % 96.7 |
| コール・ローン等、その他 | 52,094 | 3.3 |
| 投資信託財産総額 | 1,596,233 | 100.0 |

(注) 期末における外貨建純資産 (1,594,649千円) の投資信託財産総額 (1,596,233千円) に対する比率は99.9%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=141.83円 | 1 シンガポールドル=106.60円 | 1 マレーシアリングギット=31.0347円 | 1 タイバーツ=4.11円 |
| 1 フィリピンペソ=2.5905円 | 100インドネシアルピア=0.95円 | 100韓国ウォン=11.04円 | 1 インドルピー=1.74円 |
| 1 中国元=19.7227円 | | | |

○特定資産の価格等の調査

(2023年1月24日～2023年7月24日)

| 特定資産の種類 | 件数 |
|----------|----|
| 直物為替先渡取引 | 7 |

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あらた有責任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事について調査を依頼しました。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年7月24日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|---------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 1,633,311,980 |
| コール・ローン等 | 18,763,631 |
| 公社債(評価額) | 1,544,139,718 |
| 未収入金 | 57,543,032 |
| 未収利息 | 11,616,303 |
| 前払費用 | 1,249,296 |
| (B) 負債 | 37,932,140 |
| 未払金 | 37,645,730 |
| 未払解約金 | 286,409 |
| 未払利息 | 1 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 1,595,379,840 |
| 元本 | 604,845,358 |
| 次期繰越損益金 | 990,534,482 |
| (D) 受益権総口数 | 604,845,358口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 26,377円 |

○損益の状況 (2023年1月24日～2023年7月24日)

| 項 目 | 当 期 |
|--------------------|--------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 34,150,637 |
| 受取利息 | 34,153,469 |
| 支払利息 | △ 2,832 |
| (B) 有価証券売買損益 | 103,792,354 |
| 売買益 | 116,306,891 |
| 売買損 | △ 12,514,537 |
| (C) 先物取引等取引損益 | 833,475 |
| 取引益 | 1,668,087 |
| 取引損 | △ 834,612 |
| (D) 保管費用等 | △ 1,434,132 |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | 137,342,334 |
| (F) 前期繰越損益金 | 891,461,270 |
| (G) 追加信託差損益金 | 18,323,215 |
| (H) 解約差損益金 | △ 56,592,337 |
| (I) 計(E+F+G+H) | 990,534,482 |
| 次期繰越損益金(I) | 990,534,482 |

<注記事項>

- ①期首元本額 630,368,354円
 期中追加設定元本額 12,163,444円
 期中一部解約元本額 37,686,440円
 また、1口当たり純資産額は、期末2.6377円です。

(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)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) (H)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。

- 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)
 アジア・ソブリン・オープン(毎月決算型) 604,845,358円

[お 知 ら せ]

三菱UFJ国際投信株式会社は、2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更します。