

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／株式 |
| 信託期間 | 無期限(2012年9月28日設定) |
| 運用方針 | 主にフィリピンの企業の株式等を投資対象とする投資信託証券に投資を行い、信託財産の成長を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 外国投資法人「イーストスプリング・インベストメンツ - フィリピン・エクイティ・ファンド クラス J」の投資証券(米ドル建て)およびわが国の証券投資信託「イーストスプリング国内債券ファンド(国債)追加型 I (適格機関投資家向け)」の受益証券(振替受益権を含みます。)を主要投資対象とします。 |
| 組入制限 | <ul style="list-style-type: none">・投資信託証券への投資割合には制限を設けません。・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。・株式への直接投資は行いません。 |
| 分配方針 | 毎決算時(毎年3月7日および9月7日。休業日の場合は翌営業日。)に、基準価額水準および市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は、分配を行わないことがあります。 |

運用報告書(全体版)

イーストスプリング・フィリピン株式オープン

第23期(決算日 2024年3月7日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のお引立てにあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「イーストスプリング・フィリピン株式オープン」は、上記の決算を行いましたので、ここに期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申し上げます。

イーストスプリング・インベストメンツ株式会社

〔お問い合わせ先〕

電話番号:03-5224-3400

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時まで)

ホームページアドレス: <https://www.eastspring.co.jp/>

〒100-6905

東京都千代田区丸の内2-6-1丸の内パークビルディング

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準 (分配) | 価額 | | | 投資 組入 | 信託 比率 | 純資 産額 |
|----------------|------------|--------|--------|------------------|----------|-----------|--------------|
| | | 税 分 | 込 配 | み 金 騰 落 | | | |
| 19期(2022年3月7日) | 円 8,840 | | 円 0 | | 8.1 | % 93.0 | 百万円 1,178 |
| 20期(2022年9月7日) | 9,089 | | 0 | | 2.8 | 93.5 | 1,214 |
| 21期(2023年3月7日) | 8,948 | | 0 | | △ 1.6 | 92.5 | 1,229 |
| 22期(2023年9月7日) | 8,896 | | 0 | | △ 0.6 | 91.8 | 1,255 |
| 23期(2024年3月7日) | 9,883 | | 0 | | 11.1 | 91.9 | 1,296 |

(注) 純資産総額の単位未満は切捨てです。

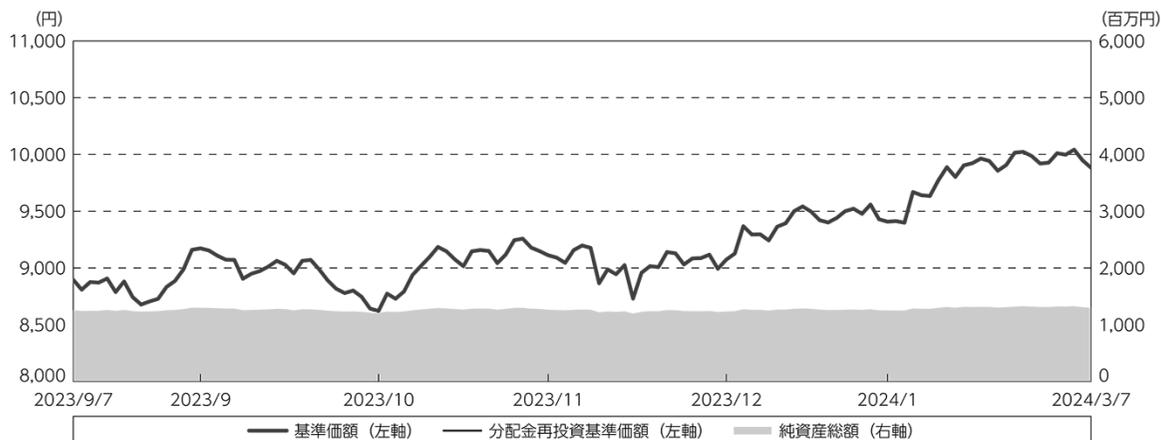
(注) 当ファンドは公表されている適切な指数が存在しないためベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

○当期中の基準価額等の推移

| 年 月 日 | 基準 | 価額 | | 投資 組入 | 信託 比率 | 託 券 率 |
|-------------------|------------|--------|--------|----------|----------|-------------|
| | | 騰 落 | 率 | | | |
| (期首) 2023年9月7日 | 円 8,896 | | % - | | | % 91.8 |
| 9月末 | 9,173 | | 3.1 | | | 91.9 |
| 10月末 | 8,622 | | △ 3.1 | | | 92.3 |
| 11月末 | 9,112 | | 2.4 | | | 91.6 |
| 12月末 | 9,074 | | 2.0 | | | 93.6 |
| 2024年1月末 | 9,408 | | 5.8 | | | 92.5 |
| 2月末 | 9,928 | | 11.6 | | | 93.6 |
| (期末) 2024年3月7日 | 9,883 | | 11.1 | | | 91.9 |

(注) 騰落率は期首比です。

基準価額等の推移について



期 首：8,896円

期 末：9,883円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率：11.1% (分配金再投資ベース)

(注) 分配金再投資基準価額は、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、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様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。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) 分配金再投資基準価額は、期首(2023年9月7日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

(注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

(注) 当ファンドにおいては、運用の基本方針に適合した、公表されている指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は上昇しました。

(上昇要因)

- ・保有株式が上昇したこと。
- ・通貨ペソが対円で上昇したこと。

投資環境について

フィリピン株式市場

当期のフィリピン株式市場は上昇しました。期初から2023年9月末にかけては、8月のインフレ指標が予想を上回ったものの、フィリピン中央銀行が政策金利を据え置いたことなどを好感し、株式市場は上昇しました。しかし、10月には中国経済の低迷、中東情勢の緊迫化に加え、9月のインフレ指標が予想を上回ったことなどを受け、中央銀行が政策金利を引き上げたことなどを嫌気し、株式市場は下落しました。その後期末にかけてインフレ指標の落ち着きから中央銀行が金利を据え置いたことや米国の金融引き締め政策が転換されるとの見通しが強まる中、投資家の買い意欲が高まり、フィリピン株式市場は上昇基調をたどりました。

為替市場

フィリピンペソは、期初から2023年10月末にかけては、米ドルに対し横ばいで推移していましたが、11月以降年末にかけては米国長期金利が低下する中、上昇しました。その後期末にかけては、米国長期金利の動きにフィリピンペソも連動し、対米ドルで55～56フィリピンペソ台で推移しました。円は期中、概ね日米の長期金利差の動きに連動して推移し、通期ではフィリピンペソは円に対して上昇しました。

国内債券市場

国内債券市場は、米国長期金利が上昇する中、10年国債利回りは上昇し、2023年11月初めには0.95%を付けました。しかし、その後米国長期金利が低下したことから年末にかけて日本の10年国債利回りも低下し、0.5%台を付けました。しかし、2024年年明け以降は、米国長期金利の上昇につれて再び10年国債利回りは上昇し、0.7%台で終わりました。

ポートフォリオについて

当ファンド

主要な投資対象の一つであるイーストスプリング・インベストメンツ・フィリピン・エクイティ・ファンドクラスJ（以下「フィリピン・エクイティ」ということがあります。）の組入比率を高位に保つよう運用しました。

フィリピン・エクイティ

フィリピン株式を主要投資対象とし、長期的な成長を目指した運用を行いました。個別銘柄調査とバリュエーションを重視し、市場全体およびセクター内で割安に評価されている銘柄を中心に投資を行い、割高となった銘柄の組入れを減らしました。当期はコロナ禍後の貿易量の増加や設備投資の拡大などから収益が好調な伸びを示していることなどから株価が上昇した港湾運営企業（INTL CONTAINER TERMINAL SERVICES, INC.）などの保有がプラス要因となる一方、販管費の大幅な増加によりホテルビジネスの収益率が低下していることなどを嫌気され株価が下落した複合企業（ALLIANCE GLOBAL GROUP, INC.）などの保有がマイナス要因となりました。

イーストスプリング国内債券ファンド（国債）追加型I（適格機関投資家向け）

主としてデュレーションをコントロールすることによって、ベンチマークであるICE BofA 国債インデックス（1-10年債）を中長期的に上回ることを目指して運用を行いました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドにおいては、運用の基本方針に適合した、公表されている指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

分配金について

分配金額は、基準価額水準・市況動向等を勘案して、以下の通りとさせていただきます。なお、留保益の運用につきましては、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

〇分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

| 項 目 | 第23期 |
|--------------------|-------------------------|
| | 2023年9月8日～ 2024年3月7日 |
| 当期分配金 (対基準価額比率) | — —% |
| 当期の収益 | — |
| 当期の収益以外 | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 1,947 |

(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。

〇今後の運用方針について

当ファンド

主要な投資対象の一つであるフィリピン・エクイティの組入比率を高位に保つことを基本とします。

フィリピン・エクイティ

フィリピンのインフレ率は、2024年1月には2023年12月から大幅に低下(-1.1%)し前年比+2.8%となり、2ヵ月連続でフィリピン中央銀行のインフレターゲットである2～4%のレンジ内に収まっています。米国の金融政策の動向にもよりますが、市場関係者の間では今年度中に中央銀行が利下げを行う可能性があるだろうとの見方が支配的になってきています。

フィリピン株式市場は、①インフラプロジェクトの進展、②米国における金融政策の転換によるフィリピン中央銀行の金融政策への影響、③国内インフレの安定、④フィリピンペソの安定などが契機となり、株式市場の再評価が期待されます。

セクター別では、堅調なファンダメンタルズにも関わらず割安な消費関連、安定したキャッシュ創出力と設備投資の抑制による高配当利回りである通信関連、また高金利がしばらく続くことが想定されることから銀行セクターなどを強気に見ています。一方、資本財サービス・セクターおよび不動産株などについては弱気に見ています。今後とも投資環境の変化に対する市場の反応などに留意しつつ、下落局面では割安となったファンダメンタルズの強固な優良銘柄に選別投資を行います。

イーストスプリング国内債券ファンド(国債)追加型I(適格機関投資家向け)

今後もファンダメンタルズ分析、金利動向予測、イールドカーブ分析等を行い、ベンチマークであるICE BofA 国債インデックス(1-10年債)を中長期的に上回ることを目指した運用を行っていく所存です。

○1万口当たりの費用明細

(2023年9月8日～2024年3月7日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|----------------------|------|---------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 63 | 0.684 | (a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| （ 投 信 会 社 ） | (24) | (0.263) | 委託した資金の運用の対価 |
| （ 販 売 会 社 ） | (38) | (0.410) | 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の 情報提供等の対価 |
| （ 受 託 会 社 ） | (1) | (0.011) | 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価 |
| (b) そ の 他 費 用 | 4 | 0.040 | (b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| （ 監 査 費 用 ） | (4) | (0.040) | 監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 |
| （ そ の 他 ） | (0) | (0.000) | 金銭信託に係る手数料等 |
| 合 計 | 67 | 0.724 | |
| 期中の平均基準価額は、9,219円です。 | | | |

(注) 期中の費用（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。

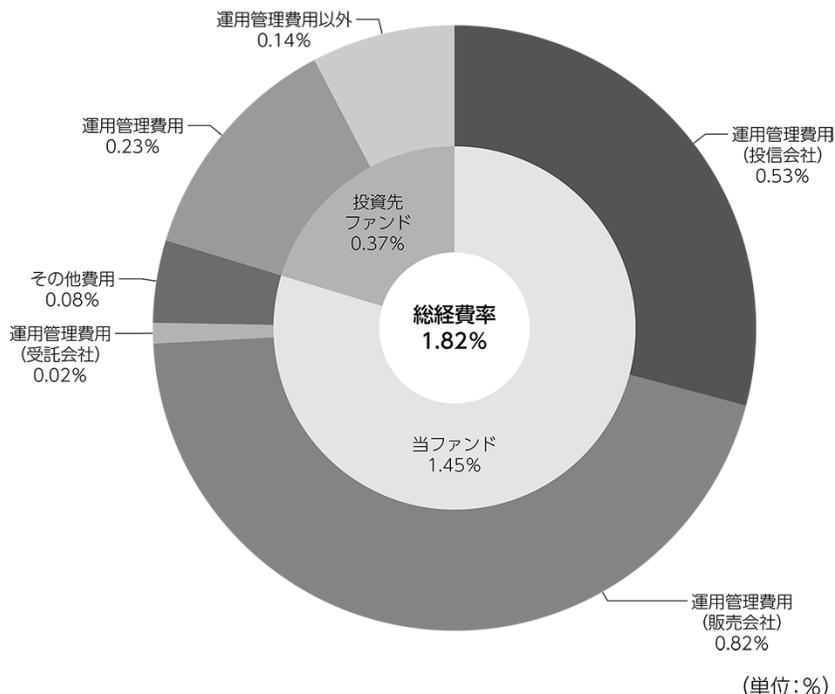
(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(注) 各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

(参考情報)

○総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に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1.82%です。



| 総経費率(①+②+③) | 1.82 |
|----------------------|------|
| ①当ファンドの費用の比率 | 1.45 |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.23 |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.14 |

(注) ①の費用は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、売買委託手数料およ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) 投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券です。

(注) ①の費用は、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) 上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9月8日～2024年3月7日)

投資信託証券

| 銘柄 | | 買付 | | 売付 | |
|----|--|----|------|----|------|
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| 外国 | 米ドル建 ルクセンブルグ籍 | 千口 | 千米ドル | 千口 | 千米ドル |
| | イーストスプリング・インベストメンツ - フィリピン・エクイティ・ファンド クラス J | — | — | 38 | 700 |

(注) 金額は受渡し代金です。

(注) 単位未满是切捨てです。

○利害関係人との取引状況等

(2023年9月8日～2024年3月7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

(2024年3月7日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

| 銘柄 | | 期首(前期末) | 当 期 末 | | 比 率 |
|----|---|---------|-------|-------|-----|
| | | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | |
| | | 千口 | 千口 | 千円 | % |
| | イーストスプリング国内債券ファンド (国債) 追加型 I (適格機関投資家向け) | 4,636 | 4,636 | 4,900 | 0.4 |
| | 合 計 | 4,636 | 4,636 | 4,900 | 0.4 |

(注) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注) 口数・評価額の単位未满是切捨てです。

ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

| 銘柄 | | 期首(前期末) 口 数 | 当 期 末 | | | 比 率 |
|----|--|----------------|-------|-------|-----------|------|
| | | | 口 数 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | | 千口 | 千米ドル | 千円 | % | |
| | イーストスプリング・インベストメンツ - フィリピン・エクイティ・ファンド クラス J | 464 | 426 | 7,964 | 1,186,879 | 91.6 |
| | 合 計 | 464 | 426 | 7,964 | 1,186,879 | 91.6 |

(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) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注) 口数・評価額の単位未满是切捨てです。

○投資信託財産の構成

(2024年3月7日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 投資信託受益証券 | 4,900 | 0.4 |
| 投資証券 | 1,186,879 | 90.2 |
| コール・ローン等、その他 | 124,771 | 9.4 |
| 投資信託財産総額 | 1,316,550 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切捨てです。

(注) 外貨建純資産(1,186,879千円)の投資信託財産総額(1,316,550千円)に対する比率は90.2%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、2024年3月7日における邦貨換算レートは、1米ドル=149.02円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年3月7日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 1,316,550,661 |
| コール・ローン等 | 124,770,583 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 4,900,161 |
| 投資証券(評価額) | 1,186,879,917 |
| (B) 負債 | 20,295,805 |
| 未払解約金 | 11,134,267 |
| 未払信託報酬 | 8,659,050 |
| 未払利息 | 365 |
| その他未払費用 | 502,123 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 1,296,254,856 |
| 元本 | 1,311,661,086 |
| 次期繰越損益金 | △ 15,406,230 |
| (D) 受益権総口数 | 1,311,661,086口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 9,883円 |

(注) 元本の状況

期首元本額 1,411,123,566円

期中追加設定元本額 114,351,278円

期中一部解約元本額 213,813,758円

(注) 1口当たり純資産額は0.9883円です。

(注) 上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

○損益の状況 (2023年9月8日~2024年3月7日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 48,073 |
| 支払利息 | △ 48,073 |
| (B) 有価証券売買損益 | 134,794,601 |
| 売買益 | 142,661,398 |
| 売買損 | △ 7,866,797 |
| (C) 信託報酬等 | △ 9,163,774 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 125,582,754 |
| (E) 前期繰越損益金 | △ 36,158,301 |
| (F) 追加信託差損益金 | △104,830,683 |
| (配当等相当額) | (166,020,337) |
| (売買損益相当額) | (△270,851,020) |
| (G) 計(D+E+F) | △ 15,406,230 |
| (H) 収益分配金 | 0 |
| 次期繰越損益金(G+H) | △ 15,406,230 |
| 追加信託差損益金 | △104,830,683 |
| (配当等相当額) | (166,020,337) |
| (売買損益相当額) | (△270,851,020) |
| 分配準備積立金 | 89,472,526 |
| 繰越損益金 | △ 48,073 |

(注) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 分配金の計算過程
計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後の有価証券売買等損益(68,618,110円)、信託約款に規定する収益調整金(166,020,337円)および分配準備積立金(20,854,416円)より分配対象収益は255,492,863円(10,000口当たり1,947円)ですが、当期に分配した金額はありません。

○分配金のお知らせ

当期の分配金は、基準価額水準および市況動向等を勘案し、見送らせていただきました。

○お知らせ

2023年12月7日付で約款変更を行い、投資対象ファンドにおけるデリバティブの使用目的を、投資の対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび為替相場の変動リスクを減じる目的に限定することを明確化しました。なお、かかる変更は、運用の実態に即した記載内容に変更するものであり、実際の運用の基本方針、運用体制等につきましては、一切変更はございません。

<参考情報>

■投資対象とする投資信託証券の仕組み

| | | |
|------------|--|-----------------------------------|
| ファンド名 | イーストスプリング・インベストメンツ - フィリピン・エクイティ・ファンド クラスJ | |
| 形態 | ルクセンブルグ籍外国投資法人／オープン・エンド型 | |
| 表示通貨 | 米ドル | |
| 運用の基本方針 | 主として、フィリピンの企業の株式または株式関連証券に投資を行い、長期的な成長を目指した運用を行います。 | |
| 主な投資対象 | フィリピンで設立または上場している企業ならびにフィリピンにおいて主に事業展開を行っている企業の株式および株式関連証券 | |
| ベンチマーク | PSEi Index (フィリピン総合指数) *1 | |
| ファンドの関係法人 | 運用会社 | イーストスプリング・インベストメンツ (シンガポール) リミテッド |
| | 管理会社 | イーストスプリング・インベストメンツ (ルクセンブルグ) S.A. |
| 申込手数料 | ありません。 | |
| 運用報酬 | 年率0.25% | |
| 管理費用等 | 年率0.15%程度 | |
| その他の費用・手数料 | 組入有価証券の売買時に発生する売買委託手数料等がかかります。 | |
| 設立日 | 2007年7月2日 | |
| 決算日 | 毎年12月31日 | |

| | | |
|------------|--|-----------------------------------|
| ファンド名 | イーストスプリング国内債券ファンド (国債) 追加型 I (適格機関投資家向け) | |
| 形態 | 国内籍証券投資信託／適格機関投資家私募 | |
| 表示通貨 | 日本円 | |
| 運用の基本方針 | わが国の国債を中心に、国債、政府保証債、地方債等の公共債を主要投資対象とし、安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指した運用を行います。 | |
| 主な投資対象 | 日本の国債、政府保証債、地方債 | |
| ベンチマーク | ICE BofA 国債インデックス (1-10年債) *2 | |
| ファンドの関係法人 | 委託会社 | イーストスプリング・インベストメンツ株式会社 |
| | 投資顧問会社 | イーストスプリング・インベストメンツ (シンガポール) リミテッド |
| | 受託会社 | 三菱UFJ信託銀行株式会社 |
| 主な投資制限 | <ul style="list-style-type: none"> ・株式 (新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。) への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。 ・投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 | |
| 申込手数料 | ありません。 | |
| 信託報酬 | 年率0.22% (税抜0.2%) | |
| その他の費用・手数料 | 監査費用、有価証券売買時の売買委託手数料等がかかります。 | |
| 設定日 | 2002年8月26日 | |
| 決算日 | 毎年2月25日 (休業日の場合は翌営業日) | |

*1 PSEi Index (フィリピン総合指数) は、フィリピン証券取引所が公表している指数です。

*2 ICE の指数データは、ICE Data Indices, LLC、その関係会社 (以下「ICE Data」) 及び／またはその第三者サプライヤーの財産です。ICE Data 及びその第三者サプライヤーは、その使用に関して一切の責任を負いません。

「イーストスプリング・フィリピン株式オープン」が主要投資対象とする「イーストスプリング・インベストメンツ - フィリピン・エクイティ・ファンド クラス J」を含む「イーストスプリング・インベストメンツ - フィリピン・エクイティ・ファンド」の情報をご報告申し上げます。法令等に則り、2022年12月31日を基準日とするAnnual Report（監査済み）を基に、委託会社が抜粋、翻訳したものを記載しております。

損益計算書及び純資産変動計算書

| 2022年12月31日に終了した事業年度 | 米ドル |
|---------------------------|--------------------|
| 期初純資産 | 33,650,267 |
| 収益 | |
| 配当金 | 464,974 |
| 預金利息 | 1,070 |
| 収益合計 | 466,044 |
| 費用 | |
| 運用報酬 | 165,915 |
| 運営費用及びサービス費用 | 11,007 |
| 管理費用 | 4,807 |
| 保管銀行費用 | 14,267 |
| 取引手数料 | 43,260 |
| 管理・名義書換代行事務費用 | 10,225 |
| 監査費用、公告・印刷費用 | 214 |
| 税金 | 1,805 |
| 借越利息 | 32 |
| 役員報酬 | 1 |
| その他費用 | (3,557) |
| 費用合計 | 247,976 |
| 純投資収益（損） | 218,068 |
| 投資有価証券の売却に係る実現純利益（損） | (1,939,671) |
| 外国為替に係る実現純利益（損） | (53,010) |
| 実現純利益（損） | (1,992,681) |
| 投資有価証券に係る未実現評価益（損）の変動額 | (2,853,146) |
| 外国為替に係る未実現評価益（損）の変動額 | 4,897 |
| 未実現評価益（損）の純変動額 | (2,848,249) |
| 運用による純資産の純増加額（減少額） | (4,622,862) |
| 資本金の変動 | |
| 投資証券の発行 | 6,835,652 |
| 投資証券の解約 | (6,690,700) |
| 当期の純資産の変動額 | (4,477,910) |
| 期末純資産 | 29,172,357 |

投資有価証券明細表（2022年12月31日現在）
（米ドル表示）

| 銘柄 | 数量 | 通貨 | 取得金額 | 評価金額 | 対純資産比率 (%) |
|--|------------|-----|-------------------|-------------------|---------------|
| 公認の証券取引所に上場されているまたは他の規制ある市場 で取引されている譲渡可能な有価証券 | | | | | |
| 株式 | | | | | |
| Philippines | | | | | |
| Aboitiz Equity Ventures Inc | 1,167,820 | PHP | 1,300,666 | 1,209,521 | 4.15 |
| Aboitiz Power Corp | 1,061,000 | PHP | 738,171 | 648,867 | 2.22 |
| ACEN Corp | 1,820,187 | PHP | 319,946 | 249,808 | 0.86 |
| Alliance Global Group Inc | 1,976,300 | PHP | 610,269 | 423,261 | 1.45 |
| Ayala Corp | 114,869 | PHP | 1,618,216 | 1,439,884 | 4.94 |
| Ayala Land Inc | 3,386,250 | PHP | 2,502,066 | 1,883,849 | 6.46 |
| Bank of the Philippine Islands | 1,118,847 | PHP | 1,913,434 | 2,047,874 | 7.02 |
| BDO Unibank Inc | 1,153,740 | PHP | 2,183,143 | 2,192,651 | 7.52 |
| Century Pacific Food Inc | 685,300 | PHP | 294,503 | 317,458 | 1.09 |
| Converge Information and Communications Technology Solutions Inc | 318,100 | PHP | 150,096 | 91,263 | 0.31 |
| Cosco Capital Inc | 2,898,811 | PHP | 353,013 | 243,368 | 0.83 |
| Filinvest Land Inc | 15,819,126 | PHP | 445,684 | 256,046 | 0.88 |
| First Philippine Holdings Corp | 83,340 | PHP | 134,180 | 90,703 | 0.31 |
| Globe Telecom Inc | 16,810 | PHP | 663,474 | 659,702 | 2.26 |
| GT Capital Holdings Inc | 61,765 | PHP | 922,018 | 484,407 | 1.66 |
| International Container Terminal Services Inc | 389,405 | PHP | 1,057,134 | 1,398,192 | 4.79 |
| JG Summit Holdings Inc | 1,420,708 | PHP | 1,633,098 | 1,285,921 | 4.41 |
| Jollibee Foods Corp | 275,520 | PHP | 1,159,916 | 1,138,710 | 3.90 |
| Manila Electric Co | 127,560 | PHP | 758,640 | 685,004 | 2.35 |
| Megaworld Corp | 10,393,100 | PHP | 607,272 | 374,859 | 1.29 |
| Metro Pacific Investments Corp | 6,553,300 | PHP | 653,557 | 402,619 | 1.38 |
| Metropolitan Bank & Trust Co | 1,286,691 | PHP | 1,478,509 | 1,248,923 | 4.28 |
| Monde Nissin Corp '144A' | 1,998,200 | PHP | 608,232 | 397,951 | 1.36 |
| PLDT Inc | 43,620 | PHP | 1,492,982 | 1,032,456 | 3.54 |
| Puregold Price Club Inc | 715,110 | PHP | 598,007 | 449,422 | 1.54 |
| Robinsons Land Corp | 1,687,213 | PHP | 650,394 | 453,396 | 1.55 |
| San Miguel Corp | 77,570 | PHP | 182,966 | 129,467 | 0.44 |
| SM Investments Corp | 170,468 | PHP | 2,830,132 | 2,755,636 | 9.45 |
| SM Prime Holdings Inc | 4,390,275 | PHP | 2,775,132 | 2,797,869 | 9.59 |
| Universal Robina Corp | 541,610 | PHP | 1,446,671 | 1,322,889 | 4.53 |
| Wilcon Depot Inc | 676,000 | PHP | 355,211 | 358,132 | 1.23 |
| | | | 32,436,732 | 28,470,108 | 97.59 |
| 株式合計 | | | 32,436,732 | 28,470,108 | 97.59 |
| 投資総額 | | | 32,436,732 | 28,470,108 | 97.59 |
| その他資産 | | | | 702,249 | 2.41 |
| 純資産 | | | | 29,172,357 | 100.00 |

「イーストスプリング国内債券ファンド（国債）追加型 I（適格機関投資家向け）」の直近の決算にかかる運用状況をご報告申し上げます。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年2月28日～2024年2月26日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|------|---------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 23 | 0.219 | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| （ 投 信 会 社 ） | (15) | (0.143) | 委託した資金の運用の対価 |
| （ 販 売 会 社 ） | (2) | (0.022) | 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の 情報提供等の対価 |
| （ 受 託 会 社 ） | (6) | (0.055) | 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価 |
| (b) そ の 他 費 用 | 2 | 0.014 | (b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| （ 監 査 費 用 ） | (2) | (0.014) | 監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 |
| （ そ の 他 ） | (0) | (0.000) | 金銭信託に係る手数料等 |
| 合 計 | 25 | 0.233 | |
| 期中の平均基準価額は、10,610円です。 | | | |

(注) 期中の費用（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) 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。

○組入資産の明細

(2024年2月26日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

| 区 分 | 当 期 | | 期 末 | | 残存期間別組入比率 | | |
|------|---------------|---------------|-----------|---------------------|-----------|-----------|-----------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 組 入 比 率 | うちB B格以下 組 入 比 率 | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| | | | | | % | % | % |
| 国債証券 | 千円 654,500 | 千円 669,730 | % 92.9 | % — | % 43.8 | % 34.6 | % 14.5 |
| 合 計 | 654,500 | 669,730 | 92.9 | — | 43.8 | 34.6 | 14.5 |

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 額面金額・評価額の単位未満は切捨てです。

(注) —印は組入れなしです。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘 柄 | 当 期 | | 期 末 | | 償 還 年 月 日 |
|-----------------|-----|---------|---------|---------|-----------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 額 面 金 額 | |
| 国債証券 | % | 千円 | 千円 | | |
| 第351回利付国債 (10年) | 0.1 | 50,000 | 49,616 | | 2028/6/20 |
| 第354回利付国債 (10年) | 0.1 | 59,000 | 58,281 | | 2029/3/20 |
| 第359回利付国債 (10年) | 0.1 | 175,000 | 172,032 | | 2030/6/20 |
| 第67回利付国債 (20年) | 1.9 | 45,000 | 45,055 | | 2024/3/20 |
| 第75回利付国債 (20年) | 2.1 | 20,000 | 20,438 | | 2025/3/20 |
| 第80回利付国債 (20年) | 2.1 | 38,000 | 39,011 | | 2025/6/20 |
| 第87回利付国債 (20年) | 2.2 | 55,000 | 57,318 | | 2026/3/20 |
| 第91回利付国債 (20年) | 2.3 | 135,000 | 142,406 | | 2026/9/20 |
| 第117回利付国債 (20年) | 2.1 | 77,500 | 85,570 | | 2030/3/20 |
| 合 計 | | 654,500 | 669,730 | | |

(注) 額面金額・評価額の単位未満は切捨てです。