

運用報告書（全体版）

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／資産複合 |
| 信託期間 | 約10年間（2007年3月30日から2017年3月15日まで） |
| 運用方針 | 信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指してファンド・オブ・ファンズ形式で運用を行います。 |
| 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 - アジアン・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・アジア・ソブリン・ファンド（適格機関投資家専用）」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 | 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 | 原則として毎決算時（毎月15日（休業日の場合は翌営業日））に、主に配当等収益から安定的に分配を行うことを目指します。また、売買益等がある場合は、これを付加して分配を行う場合があります。ただし、分配対象額が少額の場合は、収益分配を行わないこともあります。 |

イーストスプリング・ アジア・インカム・プラス 【愛称:アジアンドリーム】

第20作成期

| | |
|-----------|--------------|
| 第113期（決算日 | 2016年9月15日） |
| 第114期（決算日 | 2016年10月17日） |
| 第115期（決算日 | 2016年11月15日） |
| 第116期（決算日 | 2016年12月15日） |
| 第117期（決算日 | 2017年1月16日） |
| 第118期（決算日 | 2017年2月15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・アジア・インカム・プラス」は、2017年2月15日に決算を行いましたので、ここに当作成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われますよう、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: <http://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作成期の運用実績

| 決 算 期 | | 基準価額 (分配落) | 税 込 | | 投資信託証券 組入比率 | 純 資 産 額 |
|------------|--------------------|---------------|-----|------|----------------|---------|
| | | | 分 配 | 金 | | |
| | | 円 | 円 | % | % | 百万円 |
| 第16 作成期 | 89期 (2014年9月16日) | 8,964 | 15 | 3.1 | 95.3 | 323 |
| | 90期 (2014年10月15日) | 8,713 | 15 | △2.6 | 96.4 | 305 |
| | 91期 (2014年11月17日) | 9,442 | 15 | 8.5 | 95.7 | 322 |
| | 92期 (2014年12月15日) | 9,514 | 15 | 0.9 | 96.2 | 318 |
| | 93期 (2015年1月15日) | 9,523 | 15 | 0.3 | 96.7 | 312 |
| | 94期 (2015年2月16日) | 9,679 | 15 | 1.8 | 97.0 | 312 |
| 第17 作成期 | 95期 (2015年3月16日) | 9,574 | 15 | △0.9 | 96.0 | 303 |
| | 96期 (2015年4月15日) | 9,823 | 15 | 2.8 | 96.1 | 304 |
| | 97期 (2015年5月15日) | 9,661 | 15 | △1.5 | 95.5 | 296 |
| | 98期 (2015年6月15日) | 9,644 | 15 | △0.0 | 95.1 | 290 |
| | 99期 (2015年7月15日) | 9,488 | 15 | △1.5 | 97.5 | 278 |
| | 100期 (2015年8月17日) | 9,088 | 15 | △4.1 | 96.7 | 264 |
| 第18 作成期 | 101期 (2015年9月15日) | 8,504 | 15 | △6.3 | 95.2 | 244 |
| | 102期 (2015年10月15日) | 8,801 | 15 | 3.7 | 95.7 | 252 |
| | 103期 (2015年11月16日) | 8,732 | 15 | △0.6 | 96.8 | 244 |
| | 104期 (2015年12月15日) | 8,448 | 15 | △3.1 | 95.1 | 235 |
| | 105期 (2016年1月15日) | 8,104 | 15 | △3.9 | 96.2 | 223 |
| | 106期 (2016年2月15日) | 7,911 | 15 | △2.2 | 96.1 | 217 |
| 第19 作成期 | 107期 (2016年3月15日) | 8,322 | 15 | 5.4 | 96.4 | 229 |
| | 108期 (2016年4月15日) | 8,290 | 15 | △0.2 | 96.6 | 228 |
| | 109期 (2016年5月16日) | 7,948 | 15 | △3.9 | 96.5 | 218 |
| | 110期 (2016年6月15日) | 7,794 | 15 | △1.7 | 96.9 | 213 |
| | 111期 (2016年7月15日) | 8,117 | 15 | 4.3 | 96.2 | 222 |
| | 112期 (2016年8月15日) | 7,963 | 15 | △1.7 | 96.6 | 217 |
| 第20 作成期 | 113期 (2016年9月15日) | 7,914 | 15 | △0.4 | 97.1 | 214 |
| | 114期 (2016年10月17日) | 7,941 | 15 | 0.5 | 97.2 | 215 |
| | 115期 (2016年11月15日) | 7,781 | 15 | △1.8 | 96.8 | 209 |
| | 116期 (2016年12月15日) | 8,445 | 15 | 8.7 | 97.4 | 226 |
| | 117期 (2017年1月16日) | 8,302 | 15 | △1.5 | 96.1 | 216 |
| | 118期 (2017年2月15日) | 8,491 | 15 | 2.5 | 95.4 | 217 |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 純資産総額の単位未満は切捨てです。

(注3) 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。

当作成期中の基準価額等の推移

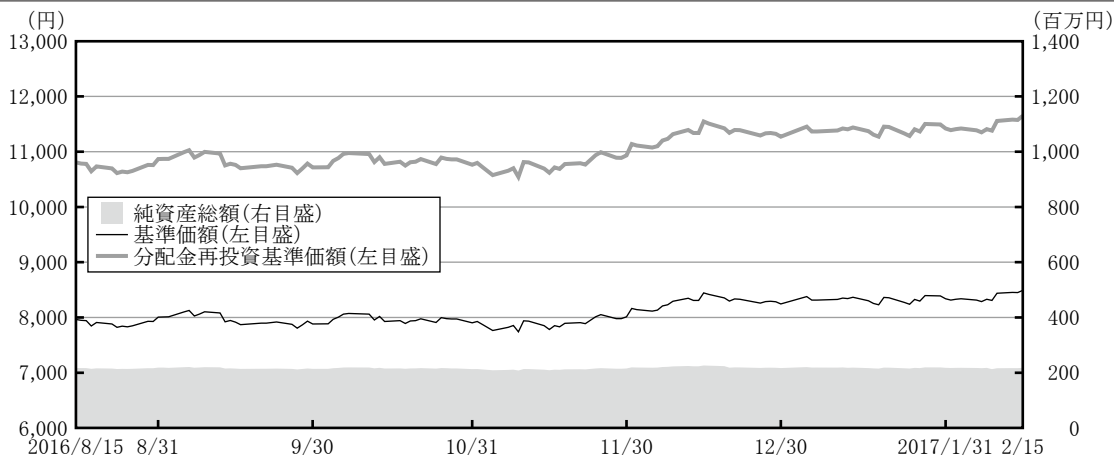
| 決算期 | 年 月 日 | 基準価額 | 騰落率 | | 投資信託証券 組入比率 |
|-------|-------------------|------------|--------|-----------|----------------|
| | | | | | |
| 第113期 | (期 首) 2016年8月15日 | 円 7,963 | % — | % 96.6 | |
| | 8月末 | 8,007 | 0.6 | 96.6 | |
| | (期 末) 2016年9月15日 | 7,929 | △0.4 | 97.1 | |
| 第114期 | (期 首) 2016年9月15日 | 7,914 | — | 97.1 | |
| | 9月末 | 7,882 | △0.4 | 97.2 | |
| | (期 末) 2016年10月17日 | 7,956 | 0.5 | 97.2 | |
| 第115期 | (期 首) 2016年10月17日 | 7,941 | — | 97.2 | |
| | 10月末 | 7,903 | △0.5 | 97.9 | |
| | (期 末) 2016年11月15日 | 7,796 | △1.8 | 96.8 | |
| 第116期 | (期 首) 2016年11月15日 | 7,781 | — | 96.8 | |
| | 11月末 | 8,012 | 3.0 | 96.9 | |
| | (期 末) 2016年12月15日 | 8,460 | 8.7 | 97.4 | |
| 第117期 | (期 首) 2016年12月15日 | 8,445 | — | 97.4 | |
| | 12月末 | 8,245 | △2.4 | 95.3 | |
| | (期 末) 2017年1月16日 | 8,317 | △1.5 | 96.1 | |
| 第118期 | (期 首) 2017年1月16日 | 8,302 | — | 96.1 | |
| | 1月末 | 8,337 | 0.4 | 96.1 | |
| | (期 末) 2017年2月15日 | 8,506 | 2.5 | 95.4 | |

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 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。

運用経過

基準価額等の推移について(第113期～第118期:2016年8月16日から2017年2月15日まで)



| | |
|--------|------------------|
| 第113期首 | 7,963円 |
| 第118期末 | 8,491円(既払分配金90円) |
| 騰落率 | 7.8%(分配金再投資ベース) |

(注1) 分配金再投資基準価額は、収益分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注2) 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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。

基準価額の主な変動要因

当作成期の前半は、米国の金融政策を巡る不透明感や2016年11月の米国大統領選挙を前にしたアジアの債券、株式市場がともに小動きとなり、為替市場もほぼ横ばいで推移したため、当ファンドの基準価額は狭い値幅での推移となりました。米国大統領選挙後はトランプ新政権の政策による成長期待を背景に米金利が上昇したことから、アジアの債券、株式市場ともに下落しました。しかし、為替市場において円安が大幅に進行したため、基準価額は期末にかけて上昇し、当作成期初比でも上昇しました。

投資環境について

○海外債券市況

アジア債券市場は当作成期初から米国の金融政策を巡る不透明感や2016年11月の米国大統領選挙を前にして小動きとなりました。しかし、米国大統領選挙後は新政権による政策期待から米国債の利回りが急上昇(価格は下落)し、米国債と連動性の高いシンガポール、韓国などの国債利回りは大幅に上昇しました。また、外国人投資家の投資比率の高いインドネシア、マレーシアなどは通貨が対米ドルで大幅安となったため、債券売りが加速しました。一方、インドは高額紙幣廃止を受けて急増した銀行の手元資金が債券市場に流入したため、国債利回りは急低下(価格は上昇)しました。12月中旬以降は米国債の利回り上昇に一服感がみられ、アジアの債券市場もインドを除き当作成期末にかけて落ち着いた動きとなりました。インドは2017年2月の金融政策決定会合で利下げを見送ったため利回りは大幅上昇(価格は下落)となりました。

○海外株式市況

アジア株式市場は、米国の金融政策や米国大統領選挙などの影響を受けました。当作成期初から2016年10月にかけては米国の利上げ時期を見極めたいとの見方から株式市場は概ね横ばいで推移しました。11月の米国大統領選挙後は、米国債の利回りが急上昇したことを背景にアジア新興国からの資金流出懸念が高まり、株式市場も調整しました。その後は持ち直しを見せましたが、12月の米連邦公開市場委員会(FOMC)において2017年の利上げ回数予想が引き上げられたことを受けて再度下落しました。12月末から当作成期末にかけては、アジア新興国からの資金流出懸念が一巡したことや、米国新政権への期待感から米国の株式市場が堅調に推移したことを受けて、アジアの株式市場も反発しました。

○為替市況

米国の金利先高感から米ドルが堅調となったため、アジア通貨は概ね対米ドルで弱含みとなりました。特に米国大統領選挙後は新政権の政策期待から米国債利回りが大幅上昇し米ドル高が進行したため、アジア通貨は対米ドルで下落しました。一方、大幅な円安を背景にすべてのアジア通貨は対円で上昇しました。特にインドルピー、インドネシアルピアなどが堅調となりましたが、マレーシアリングgitは小幅の上昇にとどまりました。

ポートフォリオについて

○当ファンド

当ファンドは基本配分に従い、「イーストスプリング・アジア・ソブリン・ファンド(適格機関投資家専用)」を通じてアジア債券に7割程度、「イーストスプリング・インベストメンツ - アジアン・エクイティ・ファンド クラスJ」(以下「アジアン・エクイティ」と言うことがあります。))を通じてアジア株式に3割程度の投資を行いました。

○イーストスプリング・アジア・ソブリン・ファンド(適格機関投資家専用)

イーストスプリング・アジア・ソブリン・オープン 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政府、政府機関および国際機関の発行する現地通貨建債券に投資を行い、安定的な利子収入の確保および中長期的な値上がり益の獲得を目指して運用を行いました。当作成期は、租税恩赦法施行後、海外からの資金還流期待から通貨ルピアが堅調となったインドネシアの債券の保有が最もプラスに寄与した一方で、海外投資家による資金流出を背景にパフォーマンスが振るわなかったマレーシアの債券の保有は小幅なプラスにとどまりました。

○アジアン・エクイティ

当作成期の投資行動としては、ポートフォリオの特性を大きく変更するような銘柄の入れ替えは行いませんでした。国・地域別のパフォーマンスでは、主要企業の業績見通しの改善を背景に上昇した台湾、経済指標の改善や資源・素材価格の上昇が好感された中国などの株式の保有がプラスに寄与しました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドの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。

分配原資の内訳

(1万口当たり、税引前)

| 項目 | 第113期 | 第114期 | 第115期 | 第116期 | 第117期 | 第118期 |
|---------------|---------------------------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------------------|---------------------------|
| | 2016年8月16日 ～2016年9月15日 | 2016年9月16日 ～2016年10月17日 | 2016年10月18日 ～2016年11月15日 | 2016年11月16日 ～2016年12月15日 | 2016年12月16日 ～2017年1月16日 | 2017年1月17日 ～2017年2月15日 |
| 当期分配金 (円) | 15 | 15 | 15 | 15 | 15 | 15 |
| (対基準価額比率) (%) | 0.189 | 0.189 | 0.192 | 0.177 | 0.180 | 0.176 |
| 当期の収益 (円) | 8 | 14 | 9 | 15 | 8 | 15 |
| 当期の収益以外 (円) | 6 | 0 | 5 | — | 6 | — |
| 翌期繰越分配対象額 (円) | 132 | 131 | 126 | 132 | 126 | 132 |

(注1)「当期の収益」と「当期の収益以外」は円未満は切捨てて表示しているため、合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。

(注2)当期分配金の「対基準価額比率」は当期分配金(税引前)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3)一印は該当がないことを示しています。

今後の運用方針について

○当ファンド

原則として基本配分に従い、「イーストスプリング・アジア・ソブリン・ファンド(適格機関投資家専用)」を通じてアジア債券に7割程度、「アジア・エクイティ」を通じてアジア株式に3割程度の投資を行っていく予定です。また、当ファンドは3月15日に信託期間が満了となりますので、信託終了日に向けての対応を行ってまいります。

○イーストスプリング・アジア・ソブリン・ファンド(適格機関投資家専用)

2016年の年末以来、米国大統領の政策期待を背景とした米国の株高、債券安、通貨高の動きに一服感が見られ、市場のセンチメントは概ね落ち着いたものとなっています。米国の金融政策には注意が必要ですが、アジアも含めた中央銀行による緩和的な金融政策が維持される中で、今後しばらくはリスク選好姿勢が持続し、アジアの金利水準は低位で推移するとみています。一方で、市場の変動性は中国の景気先行き懸念や今後の欧州情勢などを材料に高まる可能性があります。世界的に穏やかな経済成長と低インフレの環境下では債券市場におけるリスクは限定的であり、市場の調整局面では割安な水準で債券を組み入れる好機と考えています。

「イーストスプリング・アジア・ソブリン・ファンド(適格機関投資家専用)」は当ファンドの信託期間の満了に伴い、イーストスプリング・アジア・ソブリン・オープン マザーファンド受益証券の全解約を予定しており、順次対応を行ってまいります。

○アジア・エクイティ

米国の新政権による政策は不透明な状況が続いていますが、アジアの株式市場は景況感の改善や堅調に推移する資源・素材価格などに支えられる形で良好な相場環境を維持しています。米国の利上げ時期については定かではありませんが、利上げのペースは引き続き緩慢になるとみています。アジア各国はインフレ率が比較的低位に落ち着いており、緩和的な金融政策を維持するものと見られます。足元のアジア株式市場は過去の水準や先進国と比較して割安な状態にあると見ており、引き続き割安な銘柄を中心としたポートフォリオの構築を行って参ります。

1 万口当たりの費用明細

| 項目 | 第113期～第118期 2016/8/16 ～2017/2/15 | | 項目の概要 |
|-----------|--|---------|--|
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 54円 | 0.670% | (a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率 作成期間の平均基準価額は、8,064円です。 |
| （投信会社） | (22) | (0.272) | 委託した資金の運用の対価 |
| （販売会社） | (31) | (0.381) | 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) | (0.016) | 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 | 0.050 | (b) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数 |
| （監査費用） | (4) | (0.050) | 監査費用は、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) | 余資運用に係る費用（マイナス金利相当額） |
| 合計 | 58 | 0.720 | |

- (注1) 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2) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
(注3) 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。
(注4) 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。

売買及び取引の状況

(2016年8月16日から2017年2月15日まで)

投資信託証券

| 決 算 期 | | 第 113 期 ～ 第 118 期 | | | |
|-------|--|-------------------|-----------|--------------|-------------|
| | | 買 付 | | 売 付 | |
| | | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 国内 | イーストスプリング・アジア・ソブリン・ファンド (適 格 機 関 投 資 家 専 用) | 千口 — | 千円 — | 千口 11,025 | 千円 9,000 |
| 外国 | 米ドル建 ルクセンブルグ イーストスプリング・ インベストメンツ - アジアン・ エクイティ・ファンド クラスJ | 千口 — | 千米ドル — | 千口 5 | 千米ドル 70 |

- (注1) 金額は受渡し代金です。
(注2) 単位未満は切捨てです。

利害関係人との取引状況等

(2016年8月16日から2017年2月15日まで)

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

- (注) 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

(2017年2月15日現在)

(1) 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

| ファンド名 | 前作成期末 (第112期末) | 当作成期末 (第118期末) | | |
|--|-------------------|----------------|---------------|-----------|
| | 口数 | 口数 | 評価額 | 比率 |
| イーストスプリング・アジア・ソブリン・ファンド (適格機関投資家専用) | 千口 185,849 | 千口 174,823 | 千円 144,841 | % 66.6 |
| 合計 | 185,849 | 174,823 | 144,841 | 66.6 |

(注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) 口数・評価額の単位未満は切捨てです。

(2) 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

| ファンド名 | 前作成期末 (第112期末) | 当作成期末 (第118期末) | | | |
|---|-------------------|----------------|-------------|--------------|-----------|
| | | 口数 | 口数 | 評価額 | |
| | 外貨建金額 | | | 邦貨換算金額 | |
| イーストスプリング・インベストメンツ - アジア・エクイティ・ファンド クラスJ | 千口 47 | 千口 41 | 千米ドル 547 | 千円 62,697 | % 28.8 |
| 合計 | 47 | 41 | 547 | 62,697 | 28.8 |

(注1) 邦貨換算金額は当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。

(注2) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 口数・評価額の単位未満は切捨てです。

投資信託財産の構成

(2017年2月15日現在)

| 項目 | 当作成期末 (第118期末) | |
|--------------|----------------|-----------|
| | 評価額 | 比率 |
| 投資信託受益証券 | 千円 144,841 | % 66.3 |
| 投資証券 | 62,697 | 28.7 |
| コール・ローン等、その他 | 10,796 | 5.0 |
| 投資信託財産総額 | 218,334 | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切捨てです。

(注2) 外貨建純資産 (62,697千円) の投資信託財産総額 (218,334千円) に対する比率は28.7%です。

(注3) 外貨建資産は、当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、2017年2月15日における邦貨換算レートは、1米ドル=114.50円です。

資産、負債、元本及び基準価額の状況

| | (2016年9月15日) | (2016年10月17日) | (2016年11月15日) | (2016年12月15日) | (2017年1月16日) | (2017年2月15日)現在 |
|-----------------|--------------|---------------|---------------|---------------|--------------|----------------|
| 項 目 | 第113期末 | 第114期末 | 第115期末 | 第116期末 | 第117期末 | 第118期末 |
| (A) 資 産 | 215,594,282円 | 216,245,448円 | 209,729,028円 | 227,625,453円 | 218,565,719円 | 218,334,276円 |
| コール・ローン等 | 6,982,053 | 6,727,571 | 7,374,516 | 7,332,032 | 10,286,040 | 10,794,671 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 148,511,983 | 148,140,284 | 142,275,258 | 152,726,499 | 143,425,598 | 144,841,673 |
| 投 資 証 券(評価額) | 60,100,246 | 61,377,593 | 60,079,254 | 67,566,922 | 64,854,081 | 62,697,932 |
| (B) 負 債 | 668,925 | 694,245 | 681,720 | 1,481,934 | 1,824,402 | 730,081 |
| 未払収益分配金 | 407,350 | 407,185 | 403,001 | 401,652 | 391,597 | 384,403 |
| 未払解約金 | — | — | — | 772,096 | 1,086,625 | — |
| 未払信託報酬 | 244,592 | 250,942 | 225,258 | 236,784 | 255,485 | 237,070 |
| 未払利息 | 17 | 16 | 17 | 18 | 25 | 26 |
| その他未払費用 | 16,966 | 36,102 | 53,444 | 71,384 | 90,670 | 108,582 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 214,925,357 | 215,551,203 | 209,047,308 | 226,143,519 | 216,741,317 | 217,604,195 |
| 元 本 | 271,567,007 | 271,457,058 | 268,667,844 | 267,768,453 | 261,064,891 | 256,269,311 |
| 次期繰越損益金 | △ 56,641,650 | △ 55,905,855 | △ 59,620,536 | △ 41,624,934 | △ 44,323,574 | △ 38,665,116 |
| (D) 受益権総口数 | 271,567,007口 | 271,457,058口 | 268,667,844口 | 267,768,453口 | 261,064,891口 | 256,269,311口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 7,914円 | 7,941円 | 7,781円 | 8,445円 | 8,302円 | 8,491円 |

(注1) 元本の状況

当ファンドの第113期首元本額は272,708,400円、第113～118期中追加設定元本額は769,407円、第113～118期中一部解約元本額は17,208,496円です。

(注2) 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

第113期（自2016年8月16日至2016年9月15日）、第114期（自2016年9月16日至2016年10月17日）
 第115期（自2016年10月18日至2016年11月15日）、第116期（自2016年11月16日至2016年12月15日）
 第117期（自2016年12月16日至2017年1月16日）、第118期（自2017年1月17日至2017年2月15日）

| 項目 | 第 113 期 | 第 114 期 | 第 115 期 | 第 116 期 | 第 117 期 | 第 118 期 |
|---------------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| (A) 配 当 等 收 益 | 501,257円 | 482,714円 | 509,372円 | 562,171円 | 505,376円 | 541,337円 |
| 受 取 配 当 金 | 501,792 | 483,208 | 509,817 | 562,658 | 506,033 | 541,954 |
| 支 払 利 息 | △ 535 | △ 494 | △ 445 | △ 487 | △ 657 | △ 617 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △ 1,164,846 | 906,718 | △ 4,158,196 | 17,888,882 | △ 3,595,800 | 4,934,949 |
| 売 買 益 | 601,395 | 1,278,138 | 2,150,556 | 17,924,942 | 1,644,543 | 4,976,316 |
| 売 買 損 | △ 1,766,241 | △ 371,420 | △ 6,308,752 | △ 36,060 | △ 5,240,343 | △ 41,367 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 261,558 | △ 270,078 | △ 242,600 | △ 254,724 | △ 274,771 | △ 255,132 |
| (D) 当 期 繰 越 損 益 金 (A+B+C) | △ 925,147 | 1,119,354 | △ 3,891,424 | 18,196,329 | △ 3,365,195 | 5,221,154 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | △ 48,870,600 | △ 50,154,954 | △ 48,902,487 | △ 52,989,588 | △ 34,283,639 | △ 37,315,030 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | △ 6,438,553 | △ 6,463,070 | △ 6,423,624 | △ 6,430,023 | △ 6,283,143 | △ 6,186,837 |
| (配 当 等 相 当 額) | (1,907) | (1,814) | (1,787) | (1,727) | (3,073) | (1,408) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△ 6,440,460) | (△ 6,464,884) | (△ 6,425,411) | (△ 6,431,750) | (△ 6,286,216) | (△ 6,188,245) |
| (G) 計 (D+E+F) | △ 56,234,300 | △ 55,498,670 | △ 59,217,535 | △ 41,223,282 | △ 43,931,977 | △ 38,280,713 |
| (H) 収 益 分 配 金 | △ 407,350 | △ 407,185 | △ 403,001 | △ 401,652 | △ 391,597 | △ 384,403 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G+H) | △ 56,641,650 | △ 55,905,855 | △ 59,620,536 | △ 41,624,934 | △ 44,323,574 | △ 38,665,116 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | △ 6,440,460 | △ 6,464,884 | △ 6,425,411 | △ 6,430,023 | △ 6,286,216 | △ 6,186,837 |
| (配 当 等 相 当 額) | (-) | (-) | (-) | (1,727) | (-) | (1,408) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△ 6,440,460) | (△ 6,464,884) | (△ 6,425,411) | (△ 6,431,750) | (△ 6,286,216) | (△ 6,188,245) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 3,593,115 | 3,573,933 | 3,406,730 | 3,546,829 | 3,315,110 | 3,391,946 |
| 繰 越 損 益 金 | △ 53,794,305 | △ 53,014,904 | △ 56,601,855 | △ 38,741,740 | △ 41,352,468 | △ 35,870,225 |

(注1) 損益の状況の中で(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2) 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3) 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引いた差額分をいいます。

(注4) 分配金の計算過程

第113期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(239,699円)、費用控除後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定する収益調整金(1,907円)および分配準備積立金(3,758,859円)より、分配対象収益は4,000,465円(10,000口当たり147円)であり、うち407,350円(10,000口当たり15円)を分配金額としております。

第114期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(388,889円)、費用控除後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定する収益調整金(1,814円)および分配準備積立金(3,590,415円)より、分配対象収益は3,981,118円(10,000口当たり146円)であり、うち407,185円(10,000口当たり15円)を分配金額としております。

第115期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(266,772円)、費用控除後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定する収益調整金(1,787円)および分配準備積立金(3,541,172円)より、分配対象収益は3,809,731円(10,000口当たり141円)であり、うち403,001円(10,000口当たり15円)を分配金額としております。

第116期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(554,402円)、費用控除後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定する収益調整金(1,727円)および分配準備積立金(3,394,079円)より、分配対象収益は3,950,208円(10,000口当たり147円)であり、うち401,652円(10,000口当たり15円)を分配金額としております。

第117期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(230,605円)、費用控除後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定する収益調整金(3,073円)および分配準備積立金(3,473,029円)より、分配対象収益は3,706,707円(10,000口当たり141円)であり、うち391,597円(10,000口当たり15円)を分配金額としております。

第118期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(516,104円)、費用控除後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定する収益調整金(1,408円)および分配準備積立金(3,260,245円)より、分配対象収益は3,777,757円(10,000口当たり147円)であり、うち384,403円(10,000口当たり15円)を分配金額としております。

分配金のお知らせ

| 決算期 | 第113期 | 第114期 | 第115期 | 第116期 | 第117期 | 第118期 |
|----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 1万口当たり分配金(税引前) | 15円 | 15円 | 15円 | 15円 | 15円 | 15円 |

- ◇分配金のお支払いは決算日から起算して5営業日までに開始いたします。
- ◇分配金には、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)」があります。分配落ち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普通分配金となり、分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合は、下回る部分の額が元本払戻金(特別分配金)、残りの部分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、個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額がその後の新たな個別元本となります。
- ◇個人の受益者については、原則として20.315%の税率で源泉徴収(申告不要)されます。
- ◇「自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合、分配金は、税金を差引いた後、決算日の基準価額に基づいて自動的に無手数料で再投資いたしました。

復興特別所得税について

2013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、所得税額に対して2.1%の税率で復興特別所得税が付加されます。

なお、復興特別所得税に係る記載がされた目論見書の再交付をご希望される受益者の方につきましては、お申し出頂ければ再度、送付させていただきますので、その旨を販売会社までお申し出下さい。

上記は、当ファンドの直近決算日時点のもので、今後税法が改正された場合等には税率等が変更される場合があります。

※法人の受益者に対する課税は異なります。

※税金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。

※少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」をご利用の場合は、毎年、年間120万円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5年間非課税となります。

お知らせ

該当事項はありません。

<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 - アジアン・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、日本を除くアジア・パシフィック地域の企業の株式に投資を行い、長期的な成長を目指した運用を行います。 | |
| 主な投資対象 | 日本を除くアジア・パシフィック地域（韓国、台湾、香港、フィリピン、タイ、マレーシア、シンガポール、インドネシア、中国、インド、オーストラリア、ニュージーランド等）の企業の株式等を主要投資対象とします。 | |
| ベンチマーク | MSCI AC Asia ex Japan Index (MSCI ACアジア指数 (除く日本)) * | |
| 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. |
| 手数料等 | 申込手数料 | ありません。 |
| | 運用報酬 | 年率0.325% |
| | 管理報酬等 | 年率0.1%程度 |
| | このほか、有価証券売買時の売買委託手数料等がかかります。 | |
| 設立日 | 2007年3月22日 | |
| 決算日 | 毎年12月31日 | |

| | | |
|-----------|--|-----------------------------------|
| ファンド名 | イーストスプリング・アジア・ソブリン・ファンド (適格機関投資家専用) | |
| 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 | 日本を除くアジアの政府、政府機関および国際機関の発行する現地通貨建債券を実質的な主要投資対象とし、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。 | |
| 主な投資対象 | イーストスプリング・アジア・ソブリン・オープン マザーファンドの受益証券 | |
| ベンチマーク | ありません。 | |
| 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 |
| | マザーファンドの投資顧問会社 | 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 | 三井住友信託銀行株式会社 |
| 主な投資制限 | <ul style="list-style-type: none"> ・外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 | |
| 手数料等 | 申込手数料 | ありません。 |
| | 信託報酬 | 年率0.3024% (税抜0.28%) |
| | このほか、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 | 2007年4月2日 | |
| 決算日 | 毎月11日 (休業日の場合は翌営業日) | |

※ MSCI指数はMSCI Inc. が算出している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また MSCI Inc. は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

「イーストスプリング・アジア・インカム・プラス」が組み入れている「イーストスプリング・アジア・ソブリン・ファンド（適格機関投資家専用）」の直近の決算にかかる運用状況をご報告申し上げます。

イーストスプリング・アジア・ソブリン・ファンド（適格機関投資家専用）

最近5作成期の運用実績

| 決 算 期 | | 基 準 価 額 (分配落) | 税 込 分配金 | 期 中 騰 落 率 | 債 券 組 入 比 率 | 純 資 産 総 額 |
|------------|--------------------|------------------|------------|--------------|----------------|--------------|
| | | 円 | 円 | % | % | 百万円 |
| 第16 作成期 | 89期 (2014年9月11日) | 8,877 | 36 | 4.6 | 96.8 | 215 |
| | 90期 (2014年10月14日) | 8,740 | 35 | △1.1 | 95.5 | 207 |
| | 91期 (2014年11月11日) | 9,346 | 33 | 7.3 | 95.6 | 216 |
| | 92期 (2014年12月11日) | 9,470 | 36 | 1.7 | 95.7 | 214 |
| | 93期 (2015年1月13日) | 9,459 | 36 | 0.3 | 95.2 | 210 |
| | 94期 (2015年2月12日) | 9,667 | 35 | 2.6 | 94.7 | 210 |
| 第17 作成期 | 95期 (2015年3月11日) | 9,491 | 30 | △1.5 | 93.6 | 203 |
| | 96期 (2015年4月13日) | 9,614 | 38 | 1.7 | 94.5 | 206 |
| | 97期 (2015年5月11日) | 9,413 | 31 | △1.8 | 94.8 | 196 |
| | 98期 (2015年6月11日) | 9,409 | 35 | 0.3 | 96.0 | 196 |
| | 99期 (2015年7月13日) | 9,363 | 36 | △0.1 | 95.2 | 195 |
| | 100期 (2015年8月11日) | 9,326 | 32 | △0.1 | 94.4 | 190 |
| 第18 作成期 | 101期 (2015年9月11日) | 8,583 | 32 | △7.6 | 94.4 | 169 |
| | 102期 (2015年10月13日) | 8,906 | 35 | 4.2 | 95.2 | 175 |
| | 103期 (2015年11月11日) | 8,834 | 31 | △0.5 | 96.1 | 171 |
| | 104期 (2015年12月11日) | 8,737 | 32 | △0.7 | 96.5 | 164 |
| | 105期 (2016年1月12日) | 8,362 | 33 | △3.9 | 96.0 | 157 |
| | 106期 (2016年2月12日) | 8,266 | 30 | △0.8 | 93.8 | 155 |
| 第19 作成期 | 107期 (2016年3月11日) | 8,447 | 29 | 2.5 | 94.1 | 159 |
| | 108期 (2016年4月11日) | 8,366 | 30 | △0.6 | 96.4 | 157 |
| | 109期 (2016年5月11日) | 8,281 | 28 | △0.7 | 96.1 | 155 |
| | 110期 (2016年6月13日) | 8,084 | 34 | △2.0 | 95.8 | 152 |
| | 111期 (2016年7月11日) | 7,864 | 26 | △2.4 | 97.4 | 146 |
| | 112期 (2016年8月12日) | 8,129 | 32 | 3.8 | 96.8 | 151 |
| 第20 作成期 | 113期 (2016年9月12日) | 8,102 | 27 | 0.0 | 96.4 | 150 |
| | 114期 (2016年10月11日) | 8,055 | 26 | △0.3 | 96.8 | 149 |
| | 115期 (2016年11月11日) | 7,928 | 28 | △1.2 | 96.4 | 144 |
| | 116期 (2016年12月12日) | 8,258 | 31 | 4.6 | 96.2 | 150 |
| | 117期 (2017年1月11日) | 8,252 | 29 | 0.3 | 97.4 | 144 |
| | 118期 (2017年2月13日) | 8,249 | 31 | 0.3 | 96.0 | 144 |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 純資産総額の単位未満は切捨てです。

(注3) 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注4) 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。

1 万口当たりの費用明細

| 項目 | 第113期～第118期 2016/8/13 ～2017/2/13 | | 項目の概要 |
|-----------|--|---------|--|
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 12円 | 0.153% | (a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率 作成期間の平均基準価額は、8,051円です。 |
| (投信会社) | (11) | (0.137) | 委託した資金の運用の対価 |
| (販売会社) | (0) | (0.005) | 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 | 14 | 0.171 | (b) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数 |
| (保管費用) | (7) | (0.083) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| (監査費用) | (4) | (0.052) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 |
| (その他1) | (3) | (0.037) | キャピタルゲイン税 |
| (その他) | (0) | (0.000) | 余資運用に係る費用(マイナス金利相当額) |
| 合計 | 26 | 0.324 | |

- (注1) 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2) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
(注3) 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。
(注4) その他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンド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。

売買及び取引の状況

(2016年8月13日から2017年2月13日まで)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 決 算 期 | 第 113 期 ～ 第 118 期 | | | |
|---------------------------------|-------------------|---------|-------------|--------------|
| | 設 定 | | 解 約 | |
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| イーストスプリング・アジア・ソブリン・オープン マザーファンド | 千口 — | 千円 — | 千口 8,155 | 千円 12,424 |

(注) 単位未満は切捨てです。

利害関係人との取引状況等

(2016年8月13日から2017年2月13日まで)

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(注) 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

(2017年2月13日現在)

親投資信託残高

| | 前作成期末 (第112期末) | 当 作 成 期 末 (第 118 期 末) | |
|---------------------------------|-------------------|-----------------------|---------------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| イーストスプリング・アジア・ソブリン・オープン マザーファンド | 千口 101,046 | 千口 92,890 | 千円 144,863 |

(注1) 単位未満は切捨てです。

(注2) マザーファンドの2017年2月13日現在の受益権総口数は、834,636千口です。

<参考情報>

下記は、イーストスプリング・アジア・ソブリン・オープン マザーファンド全体 (834,636千口) の内容です。

公社債

(A) 種類別開示

外国 (外貨建) 公社債

組入有価証券明細表

(2017年2月13日現在)

| 区 分 | 当 作 成 期 末 (第 118 期 末) | | | | | | | |
|--------|--------------------------|--------------------------|---------------|-----------|--------------------|------------|------------|------------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 組 入 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 |
| シンガポール | 千シンガポールドル 1,910 | 千シンガポールドル 2,006 | 千円 160,565 | % 12.3 | % - | % 10.4 | % 1.3 | % 0.7 |
| マレーシア | 千マレーシアリンギット 8,910 | 千マレーシアリンギット 8,910 | 228,387 | 17.5 | - | 8.7 | 8.4 | 0.4 |
| フィリピン | 千フィリピンペソ 80,689 | 千フィリピンペソ 95,401 | 217,516 | 16.7 | - | 15.0 | 1.7 | - |
| インドネシア | 千インドネシアルピア 27,535,000 | 千インドネシアルピア 30,564,510 | 262,854 | 20.2 | 20.2 | 16.3 | 3.9 | - |
| 韓国 | 千韓国ウォン 2,150,000 | 千韓国ウォン 2,347,634 | 232,650 | 17.9 | - | 7.8 | 3.8 | 6.3 |
| インド | 千インドルピー 78,000 | 千インドルピー 82,567 | 142,015 | 10.9 | - | 7.4 | 1.5 | 2.0 |
| 合計 | - | - | 1,243,989 | 95.6 | 20.2 | 65.6 | 20.6 | 9.4 |

(注1) 邦貨換算金額は、当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。

(注2) 組入比率は、当ファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。

(注3) 額面金額・評価額の単位未満は切捨てです。

(注4) -印は組入れなしです。

(注5) BB格以下組入比率の計算においては、S&Pの格付け等をもとに、当社が独自の基準で採用した格付けを用いています。なお、無格付けの債券組入比率は2.0%です。

(B) 個別銘柄開示
 外国（外貨建）公社債
 組入有価証券明細表

(2017年2月13日現在)

| 銘柄 | | 当 作 成 期 末 (第 118 期 末) | | | | |
|--------------------------|--------------------------|-------------------------|-------------|-------------|-----------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (シンガポール) | | % | 千シンガポールドル | 千シンガポールドル | 千円 | |
| 国債証券 | 0.5% SINGAPORE GOVT | 0.5 | 110 | 109 | 8,755 | 2018/4/1 |
| | 2.125% SINGAPORE GOVT | 2.125 | 150 | 148 | 11,884 | 2026/6/1 |
| | 2.25% SINGAPORE GOVT | 2.25 | 200 | 204 | 16,398 | 2021/6/1 |
| | 2.375% SINGAPORE GOVT | 2.375 | 100 | 101 | 8,115 | 2025/6/1 |
| | 2.75% SINGAPORE GOVT | 2.75 | 180 | 188 | 15,089 | 2023/7/1 |
| | 2.75% SINGAPORE GOVT | 2.75 | 200 | 207 | 16,614 | 2042/4/1 |
| | 2.875% SINGAPORE GOVT | 2.875 | 140 | 146 | 11,727 | 2030/9/1 |
| | 3% SINGAPORE GOVT | 3.0 | 250 | 265 | 21,227 | 2024/9/1 |
| | 3.125% SINGAPORE GOVT | 3.125 | 220 | 235 | 18,821 | 2022/9/1 |
| | 3.375% SINGAPORE GOVT | 3.375 | 110 | 122 | 9,833 | 2033/9/1 |
| 3.5% SINGAPORE GOVT 2027 | 3.5 | 250 | 276 | 22,098 | 2027/3/1 | |
| 小 計 | — | — | — | — | 160,565 | — |
| (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 | 千円 | |
| 国債証券 | 3.733% MALAYSIAN GOVT | 3.733 | 1,000 | 938 | 24,042 | 2028/6/15 |
| | 3.795% MALAYSIAN GOVT | 3.795 | 500 | 498 | 12,768 | 2022/9/30 |
| | 3.8% MALAYSIA GOVERNMENT | 3.8 | 1,000 | 993 | 25,462 | 2023/8/17 |
| | 3.889% MALAYSIAN GOVT | 3.889 | 700 | 705 | 18,079 | 2020/7/31 |
| | 3.955% MALAYSIA GOVT | 3.955 | 500 | 492 | 12,633 | 2025/9/15 |
| | 4.048% MALAYSIAN GOVT | 4.048 | 500 | 505 | 12,948 | 2021/9/30 |
| | 4.24% MALAYSIAN GOVT | 4.24 | 210 | 211 | 5,430 | 2018/2/7 |
| | 4.284% MALAYSIA INVEST | 4.284 | 1,000 | 1,016 | 26,049 | 2020/6/15 |
| | 4.39% MALAYSIA INVESTMNT | 4.39 | 1,000 | 1,018 | 26,104 | 2023/7/7 |
| | 4.492% MALAYSIA INVESTMN | 4.492 | 1,000 | 1,023 | 26,225 | 2020/4/30 |
| 4.498% MALAYSIAN GOVT | 4.498 | 500 | 498 | 12,776 | 2030/4/15 | |
| 特殊債券 (除く金融債) | 4.16% DANAINFRA NASIONAL | 4.16 | 1,000 | 1,009 | 25,865 | 2021/11/26 |
| 小 計 | — | — | — | — | 228,387 | — |
| (フィリピン) | | % | 千フィリピンペソ | 千フィリピンペソ | 千円 | |
| 国債証券 | 3.5% PHILIPPINE GOVT | 3.5 | 10,000 | 9,905 | 22,584 | 2021/3/20 |
| | 3.625% PHILIPPINE GOVT | 3.625 | 5,000 | 4,787 | 10,914 | 2025/9/9 |
| | 4.125% PHILIPPINE GOVT | 4.125 | 16,689 | 16,538 | 37,706 | 2024/8/20 |
| | 4.625% PHILIPPINE GOVT | 4.625 | 5,000 | 4,929 | 11,238 | 2040/9/9 |
| | 5.375% PHILIPPINE GOVT | 5.375 | 10,000 | 10,911 | 24,878 | 2027/3/1 |
| | 6.125% PHILIPPINE GOVT | 6.125 | 5,000 | 5,939 | 13,542 | 2037/10/24 |
| | 8% PHILIPPINE GOVT | 8.0 | 1,000 | 1,389 | 3,168 | 2031/7/19 |
| | 8.125% PHILIPPINE GOVT | 8.125 | 5,000 | 7,281 | 16,601 | 2035/12/16 |
| | 8.75% PHILIPPINE GOVT | 8.75 | 16,000 | 22,879 | 52,165 | 2030/5/27 |
| | 9.25% PHILIPPINE GOVT | 9.25 | 7,000 | 10,839 | 24,715 | 2034/11/5 |
| 小 計 | — | — | — | — | 217,516 | — |
| (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 | 千円 | |
| 国債証券 | 10% INDONESIA GOVT | 10.0 | 1,500,000 | 1,713,451 | 14,735 | 2024/9/15 |
| | 10% INDONESIA GOVT | 10.0 | 1,000,000 | 1,149,551 | 9,886 | 2028/2/15 |

| 銘柄 | | | 当 作 成 期 末 (第 118 期 末) | | | | 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 | |
| (インドネシア) | | | % | 千インドネシアピア | 千インドネシアピア | 千円 | |
| | 国債証券 | 10.25% INDONESIA GOVT | 10.25 | 1,000,000 | 1,170,482 | 10,066 | 2027/7/15 |
| | | 10.5% INDONESIA GOVT | 10.5 | 1,285,000 | 1,552,125 | 13,348 | 2030/8/15 |
| | | 10.5% INDONESIA GOVT | 10.5 | 1,500,000 | 1,818,900 | 15,642 | 2038/7/15 |
| | | 11% INDONESIA GOVT 2020 | 11.0 | 2,000,000 | 2,257,200 | 19,411 | 2020/11/15 |
| | | 11% INDONESIA GOVT 2025 | 11.0 | 1,500,000 | 1,813,927 | 15,599 | 2025/9/15 |
| | | 11.75% INDONESIA GOVT | 11.75 | 500,000 | 609,675 | 5,243 | 2023/8/15 |
| | | 12.8% INDONESIA GOVT | 12.8 | 3,000,000 | 3,601,932 | 30,976 | 2021/6/15 |
| | | 5.625% INDONESIA GOVT | 5.625 | 200,000 | 182,370 | 1,568 | 2023/5/15 |
| | | 6.375% INDONESIA GOVT | 6.375 | 500,000 | 399,660 | 3,437 | 2042/4/15 |
| | | 6.625% INDONESIA GOVT | 6.625 | 450,000 | 394,384 | 3,391 | 2033/5/15 |
| | | 8.25% INDONESIA GOVT | 8.25 | 2,200,000 | 2,241,441 | 19,276 | 2032/6/15 |
| | | 8.375% INDONESIA GOVT | 8.375 | 2,500,000 | 2,620,000 | 22,532 | 2024/3/15 |
| | | 8.375% INDONESIA GOVT | 8.375 | 2,400,000 | 2,543,244 | 21,871 | 2026/9/15 |
| | | 8.375% INDONESIA GOVT | 8.375 | 2,000,000 | 2,062,000 | 17,733 | 2034/3/15 |
| | | 9% INDONESIA GOVT | 9.0 | 1,800,000 | 1,957,680 | 16,836 | 2029/3/15 |
| | | 9.5% INDONESIA GOVT | 9.5 | 1,000,000 | 1,105,859 | 9,510 | 2023/7/15 |
| | | 9.75% INDONESIA GOVT | 9.75 | 1,200,000 | 1,370,625 | 11,787 | 2037/5/15 |
| 小 | 計 | — | — | — | — | 262,854 | — |
| (韓国) | | | % | 千韓国ウォン | 千韓国ウォン | 千円 | |
| | 国債証券 | 1.875% KOREA TREASURY BO | 1.875 | 150,000 | 146,787 | 14,546 | 2026/6/10 |
| | | 2.25% KOREA TREASURY BOND | 2.25 | 200,000 | 201,541 | 19,972 | 2025/6/10 |
| | | 2.625% KOREA TREASURY BO | 2.625 | 100,000 | 106,762 | 10,580 | 2035/9/10 |
| | | 2.75% KOREA TREASURY BOND | 2.75 | 300,000 | 302,316 | 29,959 | 2017/9/10 |
| | | 3% KOREA TREASURY BOND | 3.0 | 100,000 | 116,195 | 11,514 | 2042/12/10 |
| | | 3.25% KOREA TREASURY BOND | 3.25 | 200,000 | 205,285 | 20,343 | 2018/9/10 |
| | | 4% KOREA TREASURY BOND | 4.0 | 100,000 | 123,297 | 12,218 | 2031/12/10 |
| | | 4.25% KOREA TREASURY BOND | 4.25 | 300,000 | 329,939 | 32,696 | 2021/6/10 |
| | | 4.75% KOREA TREASURY BOND | 4.75 | 100,000 | 130,853 | 12,967 | 2030/12/10 |
| | | 5% KOREA TREASURY BOND | 5.0 | 150,000 | 165,842 | 16,434 | 2020/6/10 |
| | | 5.5% KOREA TREASURY BOND | 5.5 | 150,000 | 199,441 | 19,764 | 2028/3/10 |
| | | 5.75% KOREA TREASURY BOND | 5.75 | 300,000 | 319,373 | 31,649 | 2018/9/10 |
| 小 | 計 | — | — | — | — | 232,650 | — |
| (インド) | | | % | 千インドルピー | 千インドルピー | 千円 | |
| | 国債証券 | 8.07% INDIA GOVT | 8.07 | 5,000 | 5,034 | 8,659 | 2017/7/3 |
| | | 8.12% INDIA GOVT | 8.12 | 11,000 | 11,533 | 19,837 | 2020/12/10 |
| | | 8.15% INDIA GOVT | 8.15 | 20,000 | 21,097 | 36,286 | 2022/6/11 |
| | | 8.24% INDIA GOVT | 8.24 | 10,000 | 10,203 | 17,550 | 2018/4/22 |
| | | 8.28% INDIA GOVT | 8.28 | 10,000 | 10,989 | 18,901 | 2027/9/21 |
| | | 8.3% INDIA GOVT | 8.3 | 22,000 | 23,709 | 40,779 | 2040/7/2 |
| 小 | 計 | — | — | — | — | 142,015 | — |
| 合 | 計 | — | — | — | — | 1,243,989 | — |

(注1) 邦貨換算金額は、当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。

(注2) 額面金額・評価額の単位未満は切捨てです。

投資信託財産の構成

(2017年2月13日現在)

| 項 目 | 当 作 成 期 末 (第 118 期 末) | |
|---------------------------------|-----------------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| イーストスプリング・アジア・ソブリン・オープン マザーファンド | 144,863 | 100.0 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 144,863 | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切捨てです。

(注2) イーストスプリング・アジア・ソブリン・オープン マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建純資産(1,280,727千円)の投資信託財産総額(1,302,829千円)に対する比率は98.3%です。

(注3) 外貨建資産は、当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、2017年2月13日における邦貨換算レートは、1米ドル=113.96円、1シンガポールドル=80.03円、1マレーシアリングギット=25.63円、1フィリピンペソ=2.28円、100インドネシアルピア=0.86円、100韓国ウォン=9.91円、1インドルピー=1.72円です。

資産、負債、元本及び基準価額の状況

| 項 目 | (2016年9月12日) | (2016年10月11日) | (2016年11月11日) | (2016年12月12日) | (2017年1月11日) | (2017年2月13日)現在 |
|--------------------------------------|--------------|---------------|---------------|---------------|--------------|----------------|
| | 第113期末 | 第114期末 | 第115期末 | 第116期末 | 第117期末 | 第118期末 |
| (A) 資 産 | 151,118,820円 | 150,237,741円 | 144,929,833円 | 151,002,297円 | 144,877,474円 | 144,863,492円 |
| イーストスプリング・アジア・ソブリン・オープン マザーファンド(評価額) | 151,118,820 | 150,237,741 | 144,929,833 | 151,002,297 | 144,877,474 | 144,863,492 |
| (B) 負 債 | 551,679 | 542,294 | 583,907 | 651,120 | 605,207 | 656,770 |
| 未払収益分配金 | 501,792 | 483,207 | 509,816 | 564,439 | 506,989 | 541,954 |
| 未払信託報酬 | 38,475 | 35,611 | 37,719 | 37,413 | 36,470 | 39,277 |
| その他未払費用 | 11,412 | 23,476 | 36,372 | 49,268 | 61,748 | 75,539 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A-B) | 150,567,141 | 149,695,447 | 144,345,926 | 150,351,177 | 144,272,267 | 144,206,722 |
| 元 本 | 185,849,059 | 185,849,059 | 182,077,372 | 182,077,372 | 174,823,987 | 174,823,987 |
| 次期繰越損益金 | △ 35,281,918 | △ 36,153,612 | △ 37,731,446 | △ 31,726,195 | △ 30,551,720 | △ 30,617,265 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 185,849,059口 | 185,849,059口 | 182,077,372口 | 182,077,372口 | 174,823,987口 | 174,823,987口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 8,102円 | 8,055円 | 7,928円 | 8,258円 | 8,252円 | 8,249円 |

(注1) 元本の状況

当ファンドの第113期首元本額は185,849,059円、第113～118期中追加設定元本額は0円、第113～118期中一部解約元本額は11,025,072円です。

(注2) 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

第113期（自2016年8月13日至2016年9月12日）、第114期（自2016年9月13日至2016年10月11日）
 第115期（自2016年10月12日至2016年11月11日）、第116期（自2016年11月12日至2016年12月12日）
 第117期（自2016年12月13日至2017年1月11日）、第118期（自2017年1月12日至2017年2月13日）

| 項目 | 第113期 | 第114期 | 第115期 | 第116期 | 第117期 | 第118期 |
|----------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| (A) 有価証券売買損益 | 40,239円 | △ 340,812円 | △ 1,751,124円 | 6,619,999円 | 466,504円 | 529,477円 |
| 売 買 益 | 40,239 | — | 37,302 | 6,619,999 | 477,029 | 529,477 |
| 売 買 損 | — | △ 340,812 | △ 1,788,426 | — | △ 10,525 | — |
| (B) 信託報酬等 | △ 49,887 | △ 47,675 | △ 50,615 | △ 50,309 | △ 48,950 | △ 53,068 |
| (C) 当期損益金(A+B) | △ 9,648 | △ 388,487 | △ 1,801,739 | 6,569,690 | 417,554 | 476,409 |
| (D) 前期繰越損益金 | △32,207,099 | △32,718,539 | △32,908,535 | △35,220,090 | △28,050,977 | △28,140,412 |
| (E) 追加信託差損益金 | △ 2,563,379 | △ 2,563,379 | △ 2,511,356 | △ 2,511,356 | △ 2,411,308 | △ 2,411,308 |
| (売買損益相当額) | (△ 2,563,379) | (△ 2,563,379) | (△ 2,511,356) | (△ 2,511,356) | (△ 2,411,308) | (△ 2,411,308) |
| (F) 計 (C+D+E) | △34,780,126 | △35,670,405 | △37,221,630 | △31,161,756 | △30,044,731 | △30,075,311 |
| (G) 収益分配金 | △ 501,792 | △ 483,207 | △ 509,816 | △ 564,439 | △ 506,989 | △ 541,954 |
| 次期繰越損益金(F+G) | △35,281,918 | △36,153,612 | △37,731,446 | △31,726,195 | △30,551,720 | △30,617,265 |
| 追加信託差損益金 | △ 2,563,379 | △ 2,563,379 | △ 2,511,356 | △ 2,511,356 | △ 2,411,308 | △ 2,411,308 |
| (売買損益相当額) | (△ 2,563,379) | (△ 2,563,379) | (△ 2,511,356) | (△ 2,511,356) | (△ 2,411,308) | (△ 2,411,308) |
| 分配準備積立金 | 1,540,655 | 1,536,495 | 1,502,330 | 1,499,907 | 1,437,677 | 1,434,926 |
| 繰越損益金 | △34,259,194 | △35,126,728 | △36,722,420 | △30,714,746 | △29,578,089 | △29,640,883 |

(注1) 損益の状況の中で(A)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2) 損益の状況の中で(B)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3) 損益の状況の中で(E)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引いた差額分をいいます。

(注4) 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要する費用として、信託財産の純資産総額に年10,000分の25以内の率を乗じて得た金額を委託者報酬の中から支弁しています。

(注5) 分配金の計算過程

第113期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(510,388円)、費用控除後の有価証券売買等損益(0円)、および分配準備積立金(1,532,059円)より、分配対象収益は2,042,447円(10,000口当たり109円)であり、うち501,792円(10,000口当たり27円)を分配金額としております。

第114期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(479,047円)、費用控除後の有価証券売買等損益(0円)、および分配準備積立金(1,540,655円)より、分配対象収益は2,019,702円(10,000口当たり108円)であり、うち483,207円(10,000口当たり26円)を分配金額としております。

第115期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(506,834円)、費用控除後の有価証券売買等損益(0円)、および分配準備積立金(1,505,312円)より、分配対象収益は2,012,146円(10,000口当たり110円)であり、うち509,816円(10,000口当たり28円)を分配金額としております。

第116期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(562,016円)、費用控除後の有価証券売買等損益(0円)、および分配準備積立金(1,502,330円)より、分配対象収益は2,064,346円(10,000口当たり113円)であり、うち564,439円(10,000口当たり31円)を分配金額としております。

第117期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(504,513円)、費用控除後の有価証券売買等損益(0円)、および分配準備積立金(1,440,153円)より、分配対象収益は1,944,666円(10,000口当たり111円)であり、うち506,989円(10,000口当たり29円)を分配金額としております。

第118期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(539,203円)、費用控除後の有価証券売買等損益(0円)、および分配準備積立金(1,437,677円)より、分配対象収益は1,976,880円(10,000口当たり113円)であり、うち541,954円(10,000口当たり31円)を分配金額としております。

「イーストスプリング・アジア・ソブリン・ファンド（適格機関投資家専用）」が組み入れている「イーストスプリング・アジア・ソブリン・オープン マザーファンド」の直前の決算にかかる運用状況をご報告申し上げます。

売買及び取引の状況

(2015年4月21日から2016年4月20日まで)

公社債

| | | | 買付額 | 売付額 |
|---|--------|-------|---------------------|---------------------------------|
| 外 | シンガポール | 国債証券 | 千シンガポールドル 470 | 千シンガポールドル 450 |
| | | 特殊債証券 | — | 502 |
| | マレーシア | 国債証券 | 千マレーシアリングgit 984 | 千マレーシアリングgit 1,536 (700) |
| 国 | フィリピン | 国債証券 | 千フィリピンペソ 36,359 | 千フィリピンペソ 37,021 (9) |
| | インドネシア | 国債証券 | 千インドネシアルピア — | 千インドネシアルピア 1,853,600 |
| | 韓国 | 国債証券 | 千韓国ウォン 317,832 | 千韓国ウォン 593,316 (130,000) |
| | インド | 国債証券 | 千インドルピー — | 千インドルピー — (10,000) |

(注1) 金額は受渡し代金です(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 単位未満は切捨てです。

(注3) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

組入資産の明細

(2016年4月20日現在)

公社債

(A) 種類別開示

外国（外貨建）公社債

組入有価証券明細表

| 区 分 | 当 期 末 | | | | | | | |
|--------|--------------------------|--------------------------|---------------|-----------|--------------------|------------|------------|------------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 組 入 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 |
| シンガポール | 千シンガポールドル 2,010 | 千シンガポールドル 2,158 | 千円 176,078 | % 12.1 | % - | % 10.6 | % 0.9 | % 0.6 |
| マレーシア | 千マレーシアリンギット 7,910 | 千マレーシアリンギット 8,050 | 227,982 | 15.7 | 2.0 | 7.8 | 7.5 | 0.4 |
| フィリピン | 千フィリピンペソ 90,692 | 千フィリピンペソ 109,083 | 258,526 | 17.8 | - | 15.4 | 2.5 | 0.0 |
| インドネシア | 千インドネシアルピア 31,785,000 | 千インドネシアルピア 35,205,869 | 292,208 | 20.1 | 20.1 | 16.9 | 3.2 | - |
| 韓国 | 千韓国ウォン 2,150,000 | 千韓国ウォン 2,437,074 | 235,908 | 16.3 | - | 8.4 | 5.9 | 2.0 |
| インド | 千インドルピー 104,000 | 千インドルピー 106,848 | 177,368 | 12.2 | - | 6.2 | 2.5 | 3.6 |
| 合 計 | - | - | 1,368,073 | 94.3 | 22.1 | 65.2 | 22.4 | 6.7 |

(注1) 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2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注3) 額面金額・評価額の単位未満は切捨てです。

(注4) -印は組入れなしです。

(B) 個別銘柄開示
 外国（外貨建）公社債
 組入有価証券明細表

| 銘柄 | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
|-----------------------|--------------------------|-------|--------------|--------------|------------|------------|
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (シンガポール) | | % | 千シンガポールドル | 千シンガポールドル | 千円 | |
| 国債証券 | 0.5% SINGAPORE GOVT | 0.5 | 110 | 109 | 8,901 | 2018/04/01 |
| | 2.25% SINGAPORE GOVT | 2.25 | 300 | 310 | 25,316 | 2021/06/01 |
| | 2.375% SINGAPORE GOVT | 2.375 | 100 | 104 | 8,486 | 2025/06/01 |
| | 2.75% SINGAPORE GOVT | 2.75 | 180 | 190 | 15,556 | 2023/07/01 |
| | 2.75% SINGAPORE GOVT | 2.75 | 200 | 211 | 17,227 | 2042/04/01 |
| | 2.875% SINGAPORE GOVT | 2.875 | 140 | 150 | 12,277 | 2030/09/01 |
| | 3% SINGAPORE GOVT | 3.0 | 250 | 271 | 22,115 | 2024/09/01 |
| | 3.125% SINGAPORE GOVT | 3.125 | 220 | 238 | 19,452 | 2022/09/01 |
| | 3.25% SINGAPORE GOVT | 3.25 | 150 | 162 | 13,220 | 2020/09/01 |
| | 3.375% SINGAPORE GOVT | 3.375 | 110 | 125 | 10,274 | 2033/09/01 |
| | 3.5% SINGAPORE GOVT 2027 | 3.5 | 250 | 285 | 23,247 | 2027/03/01 |
| 小計 | — | — | — | — | 176,078 | — |
| (マレーシア) | | % | 千マレーシアリングギット | 千マレーシアリングギット | 千円 | |
| 国債証券 | 3.733% MALAYSIAN GOVT | 3.733 | 1,000 | 960 | 27,194 | 2028/06/15 |
| | 3.795% MALAYSIAN GOVT | 3.795 | 500 | 501 | 14,195 | 2022/09/30 |
| | 3.889% MALAYSIAN GOVT | 3.889 | 700 | 709 | 20,086 | 2020/07/31 |
| | 3.955% MALAYSIA GOVT | 3.955 | 500 | 505 | 14,326 | 2025/09/15 |
| | 4.048% MALAYSIAN GOVT | 4.048 | 500 | 508 | 14,403 | 2021/09/30 |
| | 4.24% MALAYSIAN GOVT | 4.24 | 210 | 214 | 6,066 | 2018/02/07 |
| | 4.284% MALAYSIA INVEST | 4.284 | 1,000 | 1,023 | 28,985 | 2020/06/15 |
| | 4.492% MALAYSIA INVESTMN | 4.492 | 1,000 | 1,031 | 29,203 | 2020/04/30 |
| | 4.498% MALAYSIAN GOVT | 4.498 | 500 | 518 | 14,680 | 2030/04/15 |
| 5.734% MALAYSIAN GOVT | 5.734 | 1,000 | 1,071 | 30,339 | 2019/07/30 | |
| 特殊債券 | 4.16% DANAINFRA NASIONAL | 4.16 | 1,000 | 1,006 | 28,500 | 2021/11/26 |
| 小計 | — | — | — | — | 227,982 | — |
| (フィリピン) | | % | 千フィリピンペソ | 千フィリピンペソ | 千円 | |
| 国債証券 | 2.125% PHILIPPINE GOVT | 2.125 | 5,000 | 4,949 | 11,731 | 2018/05/23 |
| | 3.5% PHILIPPINE GOVT | 3.5 | 10,000 | 10,057 | 23,836 | 2021/03/20 |
| | 3.625% PHILIPPINE GOVT | 3.625 | 5,000 | 5,010 | 11,874 | 2025/09/09 |
| | 4.125% PHILIPPINE GOVT | 4.125 | 16,689 | 17,200 | 40,764 | 2024/08/20 |
| | 4.625% PHILIPPINE GOVT | 4.625 | 10,000 | 10,091 | 23,917 | 2040/09/09 |
| | 5.375% PHILIPPINE GOVT | 5.375 | 10,000 | 11,248 | 26,659 | 2027/03/01 |
| | 6.125% PHILIPPINE GOVT | 6.125 | 5,000 | 6,112 | 14,487 | 2037/10/24 |
| | 8% PHILIPPINE GOVT | 8.0 | 1,000 | 1,469 | 3,482 | 2031/07/19 |
| | 8.125% PHILIPPINE GOVT | 8.125 | 5,000 | 7,432 | 17,615 | 2035/12/16 |
| | 8.75% PHILIPPINE GOVT | 8.75 | 16,000 | 24,339 | 57,684 | 2030/05/27 |

| 銘柄 | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
|----------------------|---------------------------|-----------|------------|------------|------------|------------|
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (フィリピン) | | % | 千フィリピンペソ | 千フィリピンペソ | 千円 | |
| 国債証券 | 9.125% PHILIPPINE GOVT | 9.125 | 2 | 2 | 5 | 2016/09/04 |
| | 9.25% PHILIPPINE GOVT | 9.25 | 7,000 | 11,167 | 26,467 | 2034/11/05 |
| 小計 | | — | — | — | 258,526 | — |
| (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 | 千円 | |
| 国債証券 | 10% INDONESIA GOVT | 10.0 | 1,500,000 | 1,728,973 | 14,350 | 2024/09/15 |
| | 10% INDONESIA GOVT | 10.0 | 1,000,000 | 1,179,970 | 9,793 | 2028/02/15 |
| | 10.25% INDONESIA GOVT | 10.25 | 1,000,000 | 1,200,463 | 9,963 | 2027/07/15 |
| | 10.5% INDONESIA GOVT | 10.5 | 1,285,000 | 1,597,840 | 13,262 | 2030/08/15 |
| | 10.5% INDONESIA GOVT | 10.5 | 1,500,000 | 1,867,875 | 15,503 | 2038/07/15 |
| | 11% INDONESIA GOVT 2020 | 11.0 | 2,000,000 | 2,286,940 | 18,981 | 2020/11/15 |
| | 11% INDONESIA GOVT 2025 | 11.0 | 1,500,000 | 1,845,975 | 15,321 | 2025/09/15 |
| | 11.75% INDONESIA GOVT | 11.75 | 500,000 | 618,437 | 5,133 | 2023/08/15 |
| | 12.8% INDONESIA GOVT | 12.8 | 3,000,000 | 3,686,784 | 30,600 | 2021/06/15 |
| | 5.25% INDONESIA GOVT | 5.25 | 1,000,000 | 966,500 | 8,021 | 2018/05/15 |
| | 5.625% INDONESIA GOVT | 5.625 | 500,000 | 451,025 | 3,743 | 2023/05/15 |
| | 6.375% INDONESIA GOVT | 6.375 | 500,000 | 408,835 | 3,393 | 2042/04/15 |
| | 6.625% INDONESIA GOVT | 6.625 | 1,000,000 | 898,850 | 7,460 | 2033/05/15 |
| | 7% INDONESIA GOVT | 7.0 | 1,500,000 | 1,443,486 | 11,980 | 2027/05/15 |
| | 7.875% INDONESIA GOVT | 7.875 | 2,300,000 | 2,345,540 | 19,467 | 2019/04/15 |
| | 8.25% INDONESIA GOVT | 8.25 | 2,200,000 | 2,312,112 | 19,190 | 2032/06/15 |
| | 8.375% INDONESIA GOVT | 8.375 | 2,500,000 | 2,641,950 | 21,928 | 2024/03/15 |
| | 8.375% INDONESIA GOVT | 8.375 | 1,000,000 | 1,066,997 | 8,856 | 2026/09/15 |
| | 8.375% INDONESIA GOVT | 8.375 | 2,000,000 | 2,133,654 | 17,709 | 2034/03/15 |
| | 9% INDONESIA GOVT | 9.0 | 1,800,000 | 1,990,800 | 16,523 | 2029/03/15 |
| 9.5% INDONESIA GOVT | 9.5 | 1,000,000 | 1,112,586 | 9,234 | 2023/07/15 | |
| 9.75% INDONESIA GOVT | 9.75 | 1,200,000 | 1,420,275 | 11,788 | 2037/05/15 | |
| 小計 | | — | — | — | 292,208 | — |
| (韓国) | | % | 千韓国ウォン | 千韓国ウォン | 千円 | |
| 国債証券 | 2.25% KOREA TREASURY BOND | 2.25 | 200,000 | 207,232 | 20,060 | 2025/06/10 |
| | 2.625% KOREA TREASURY BO | 2.625 | 100,000 | 111,831 | 10,825 | 2035/09/10 |
| | 2.75% KOREA TREASURY BOND | 2.75 | 300,000 | 305,108 | 29,534 | 2017/09/10 |
| | 3% KOREA TREASURY BOND | 3.0 | 100,000 | 122,717 | 11,879 | 2042/12/10 |
| | 3.25% KOREA TREASURY BOND | 3.25 | 200,000 | 208,134 | 20,147 | 2018/09/10 |
| | 4% KOREA TREASURY BOND | 4.0 | 100,000 | 128,396 | 12,428 | 2031/12/10 |
| | 4.25% KOREA TREASURY BOND | 4.25 | 300,000 | 338,463 | 32,763 | 2021/06/10 |
| | 4.75% KOREA TREASURY BOND | 4.75 | 100,000 | 136,566 | 13,219 | 2030/12/10 |
| | 5% KOREA TREASURY BOND | 5.0 | 300,000 | 340,809 | 32,990 | 2020/06/10 |
| | 5.5% KOREA TREASURY BOND | 5.5 | 150,000 | 208,162 | 20,150 | 2028/03/10 |
| | 5.75% KOREA TREASURY BOND | 5.75 | 300,000 | 329,653 | 31,910 | 2018/09/10 |
| 小計 | | — | — | — | 235,908 | — |

| 銘柄 | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
|-------|------------------|------|---------|---------|-----------|------------|
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (インド) | | % | 千インドルピー | 千インドルピー | 千円 | |
| 国債証券 | 8.07% INDIA GOVT | 8.07 | 31,000 | 31,372 | 52,078 | 2017/07/03 |
| | 8.12% INDIA GOVT | 8.12 | 11,000 | 11,297 | 18,753 | 2020/12/10 |
| | 8.15% INDIA GOVT | 8.15 | 20,000 | 20,536 | 34,090 | 2022/06/11 |
| | 8.24% INDIA GOVT | 8.24 | 10,000 | 10,219 | 16,963 | 2018/04/22 |
| | 8.28% INDIA GOVT | 8.28 | 10,000 | 10,372 | 17,218 | 2027/09/21 |
| | 8.3% INDIA GOVT | 8.3 | 22,000 | 23,050 | 38,263 | 2040/07/02 |
| 小計 | — | — | — | — | 177,368 | — |
| 合計 | — | — | — | — | 1,368,073 | — |

(注1) 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2) 額面金額・評価額の単位未満は切捨てです。

投資信託財産の構成

(2016年4月20日現在)

| 項目 | 当期末 | |
|--------------|-----------|-------|
| | 評価額 | 比率 |
| 公社債 | 千円 | % |
| コール・ローン等、その他 | 1,368,073 | 94.2 |
| 投資信託財産総額 | 83,581 | 5.8 |
| | 1,451,654 | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切捨てです。

(注2) 外貨建純資産(1,424,045千円)の投資信託財産総額(1,451,654千円)に対する比率は98.1%です。

(注3) 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、2016年4月20日における邦貨換算レートは、1米ドル=109.20円、1シンガポールドル=81.57円、1マレーシアリンギット=28.32円、1フィリピンペソ=2.37円、100インドネシアルピア=0.83円、100韓国ウォン=9.68円、1インドルピー=1.66円です。

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2016年4月20日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-------------------------|----------------|
| (A) 資 産 | 1,479,379,765円 |
| コール・ローン等 | 51,823,413 |
| 公 社 債(評価額) | 1,368,073,033 |
| 未 収 入 金 | 42,155,422 |
| 未 収 利 息 | 17,166,148 |
| 前 払 費 用 | 161,749 |
| (B) 負 債 | 28,183,155 |
| 未 払 金 | 27,826,191 |
| 未 払 解 約 金 | 356,803 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 161 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A-B) | 1,451,196,610 |
| 元 本 | 937,993,378 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 513,203,232 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 937,993,378口 |
| 1 万 口 当 ち 基 準 価 額 (C/D) | 15,471円 |

(注1) 元本の状況

| | |
|-------------------------------------|----------------|
| 期首元本額 | 1,096,171,330円 |
| 期中追加設定元本額 | 9,705,013円 |
| 期中一部解約元本額 | 167,882,965円 |
| 期末における元本の内訳 | |
| イーストスプリング・アジア・ソブリン・オープン | 834,389,195円 |
| イーストスプリング・アジア・ソブリン・ファンド (適格機関投資家専用) | 103,604,183円 |

(注2) 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

当期(自2015年4月21日 至2016年4月20日)

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------|--------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 70,055,844円 |
| 受 取 利 息 | 70,055,844 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △185,741,829 |
| 売 買 益 | 29,475,548 |
| 売 買 損 | △215,217,377 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 2,823,551 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A+B+C) | △118,509,536 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 723,746,653 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 5,169,820 |
| (G) 解 約 差 損 益 金 | △ 97,203,705 |
| (H) 計 (D+E+F+G) | 513,203,232 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (H) | 513,203,232 |

(注1) 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2) 損益の状況の中で(C)信託報酬等は保管費用等です。

(注3) 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引いた差額分をいいます。

(注4) 損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、一部解約の際、元本から解約価額を差引いた差額分をいいます。

「イーストスプリング・アジア・インカム・プラス」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 - アジアン・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 - アジアン・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、2015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。

損益計算書および純資産変動計算書

| 2015年12月31日に終了した事業年度 | 米ドル |
|--------------------------|---------------|
| 期初純資産 | 783,734,049 |
| 収益 | |
| 配当金 | 18,062,248 |
| 預金利息 | 29 |
| 収益合計 | 18,062,277 |
| 費用 | |
| 運用報酬 | 775,047 |
| 管理費用 | 30,546 |
| 保管銀行費用 | 332,806 |
| 取引手数料 | 51,800 |
| 管理・名義書換代行事務費用 | 138,644 |
| 監査費用、公告・印刷費用 | 9,064 |
| 税金 | 72,907 |
| 借越利息 | 11,157 |
| 役員報酬 | 3,257 |
| その他費用 | 37,656 |
| 費用合計 | 1,462,884 |
| 純投資収益（損） | 16,599,393 |
| 投資有価証券の売却に係る実現純利益（損） | (8,877,622) |
| 外国為替先渡取引に係る実現純利益（損） | (15,717) |
| 外国為替に係る実現純利益（損） | (356,000) |
| 実現純利益（損） | (9,249,339) |
| 投資有価証券に係る未実現評価益（損）の変動額 | (123,403,049) |
| 外国為替先渡取引に係る未実現評価益（損）の変動額 | (9,952) |
| 外国為替に係る未実現評価益（損）の変動額 | 2,114 |
| 未実現評価益（損）の純変動額 | (123,410,887) |
| 運用による純資産の純増加額（減少額） | (116,060,833) |
| 資本金の変動 | |
| 投資証券の発行 | 91,322,816 |
| 投資証券の解約 | (139,781,352) |
| 配当金および分配金 | |
| 当期の配当金および分配金 | (5,931) |
| 当期の純資産の変動額 | (164,525,300) |
| 期末純資産 | 619,208,749 |

投資有価証券明細表 (2015年12月31日現在)

(単位:米ドル)

| 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 | | | | | |
| バミューダ諸島 | | | | | |
| Huabao International Holdings Ltd | 7,395,000 | 香港ドル | 6,003,433 | 2,700,012 | 0.44 |
| Jardine Matheson Holdings Ltd | 280,560 | 米ドル | 15,022,435 | 13,671,688 | 2.20 |
| Li & Fung Ltd | 9,112,000 | 香港ドル | 10,476,253 | 6,195,343 | 1.00 |
| Noble Group Ltd | 35,665,373 | シンガポールドル | 28,185,828 | 10,074,568 | 1.63 |
| | | | 59,687,949 | 32,641,611 | 5.27 |
| ケイマン諸島 | | | | | |
| Baidu Inc ADR | 50,500 | 米ドル | 9,274,390 | 9,702,565 | 1.56 |
| CK Hutchison Holdings Ltd | 300,000 | 香港ドル | 4,155,520 | 4,048,498 | 0.65 |
| Hengan International Group Co Ltd | 856,000 | 香港ドル | 9,272,012 | 8,083,992 | 1.31 |
| Longfor Properties Co Ltd | 4,727,500 | 香港ドル | 6,544,270 | 7,050,670 | 1.14 |
| Parkson Retail Group Ltd | 16,517,000 | 香港ドル | 12,704,877 | 2,152,254 | 0.35 |
| Sands China Ltd | 1,292,800 | 香港ドル | 5,939,791 | 4,428,299 | 0.72 |
| Tencent Holdings Ltd | 1,226,200 | 香港ドル | 23,348,764 | 24,125,270 | 3.89 |
| | | | 71,239,624 | 59,591,548 | 9.62 |
| 中国 | | | | | |
| Bank of China Ltd 'H' | 41,602,800 | 香港ドル | 19,327,200 | 18,571,188 | 3.00 |
| China Construction Bank Corp 'H' | 37,716,620 | 香港ドル | 29,026,702 | 25,838,561 | 4.16 |
| China Merchants Bank Co Ltd 'H' | 5,731,385 | 香港ドル | 11,446,648 | 13,531,679 | 2.19 |
| China Pacific Insurance Group Co Ltd 'H' | 2,268,400 | 香港ドル | 8,438,654 | 9,335,796 | 1.51 |
| China Shenhua Energy Co Ltd 'H' | 3,706,500 | 香港ドル | 13,077,283 | 5,824,415 | 0.94 |
| Dongfeng Motor Group Co Ltd 'H' | 7,640,000 | 香港ドル | 10,236,245 | 10,211,608 | 1.65 |
| | | | 91,552,732 | 83,313,247 | 13.45 |
| 香港 | | | | | |
| AIA Group Ltd | 1,070,600 | 香港ドル | 7,086,838 | 6,436,565 | 1.04 |
| BOC Hong Kong Holdings Ltd | 2,622,000 | 香港ドル | 8,660,086 | 8,017,188 | 1.29 |
| China Merchants Holdings International Co Ltd | 2,934,222 | 香港ドル | 9,624,637 | 9,331,488 | 1.51 |
| China Mobile Ltd | 2,062,200 | 香港ドル | 22,363,215 | 23,279,834 | 3.77 |
| China Resources Power Holdings Co Ltd | 5,451,807 | 香港ドル | 12,350,256 | 10,606,762 | 1.71 |
| Hang Seng Bank Ltd | 378,700 | 香港ドル | 6,157,533 | 7,206,566 | 1.16 |
| Sino Land Co Ltd | 6,254,753 | 香港ドル | 9,715,041 | 9,167,048 | 1.48 |
| Sun Hung Kai Properties Ltd | 1,139,339 | 香港ドル | 14,792,659 | 13,758,461 | 2.22 |
| Wharf Holdings Ltd | 2,510,000 | 香港ドル | 18,613,999 | 13,924,616 | 2.25 |
| | | | 109,364,264 | 101,728,528 | 16.43 |
| インド | | | | | |
| Cairn India Ltd | 1,662,970 | インドルピー | 8,584,945 | 3,471,421 | 0.56 |
| Housing Development Finance Corp Ltd | 713,290 | インドルピー | 12,095,630 | 13,625,628 | 2.20 |
| Infosys Ltd | 858,001 | インドルピー | 12,264,893 | 14,336,281 | 2.33 |
| Punjab National Bank | 1,425,123 | インドルピー | 3,279,433 | 2,492,384 | 0.40 |
| Reliance Industries Ltd | 308,778 | インドルピー | 4,189,632 | 4,735,550 | 0.76 |
| Tata Motors Ltd 'A' | 1,040,347 | インドルピー | 2,727,331 | 4,550,205 | 0.73 |
| Vedanta Ltd | 3,704,484 | インドルピー | 12,320,226 | 5,062,038 | 0.82 |
| | | | 55,462,090 | 48,273,507 | 7.80 |
| インドネシア | | | | | |
| Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT | 14,484,200 | インドネシアルピア | 5,570,567 | 5,243,101 | 0.85 |
| Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT | 7,978,300 | インドネシアルピア | 6,198,844 | 6,612,410 | 1.06 |
| Perusahaan Gas Negara Persero Tbk PT | 24,498,200 | インドネシアルピア | 5,163,031 | 4,878,314 | 0.79 |
| Salim Ivomas Pratama Tbk PT | 45,753,700 | インドネシアルピア | 6,009,223 | 1,101,939 | 0.18 |
| | | | 22,941,665 | 17,835,764 | 2.88 |
| マレーシア | | | | | |
| AMMB Holdings Bhd | 2,325,300 | マレーシアリングギット | 4,430,136 | 2,453,380 | 0.40 |
| CIMB Group Holdings Bhd | 5,336,844 | マレーシアリングギット | 8,558,837 | 5,643,232 | 0.91 |
| Genting Malaysia Bhd | 8,814,000 | マレーシアリングギット | 10,323,294 | 8,991,554 | 1.45 |
| | | | 23,312,267 | 17,088,166 | 2.76 |

| 銘柄 | 数量 | 通貨 | 取得金額 | 評価金額 | 対純資産比率(%) |
|---|------------|----------|-------------|-------------|-----------|
| フィリピン | | | | | |
| First Gen Corp | 7,537,500 | フィリピンペソ | 3,042,801 | 3,620,178 | 0.58 |
| シンガポール | | | | | |
| Asian Pay Television Trust | 5,182,600 | シンガポールドル | 3,915,229 | 2,342,326 | 0.38 |
| CapitaLand Ltd | 3,365,200 | シンガポールドル | 8,963,109 | 7,961,142 | 1.29 |
| DBS Group Holdings Ltd | 675,546 | シンガポールドル | 7,883,396 | 7,962,160 | 1.28 |
| Oversea-Chinese Banking Corp Ltd | 1,001,400 | シンガポールドル | 7,506,790 | 6,223,145 | 1.01 |
| Singapore Telecommunications Ltd | 2,128,400 | シンガポールドル | 6,325,202 | 5,516,187 | 0.89 |
| | | | 34,593,726 | 30,004,960 | 4.85 |
| 韓国 | | | | | |
| Hana Financial Group Inc | 452,712 | 韓国ウォン | 14,048,687 | 9,111,767 | 1.47 |
| Hyundai Engineering & Construction Co Ltd | 45,987 | 韓国ウォン | 2,104,570 | 1,119,721 | 0.18 |
| Hyundai Motor Co | 137,264 | 韓国ウォン | 24,257,137 | 17,442,613 | 2.82 |
| Hyundai Steel Co | 117,280 | 韓国ウォン | 7,606,626 | 4,996,065 | 0.81 |
| KT Corp | 395,659 | 韓国ウォン | 12,103,737 | 9,532,528 | 1.54 |
| LG Corp | 196,366 | 韓国ウォン | 12,339,444 | 11,856,818 | 1.91 |
| Samsung Electronics Co Ltd | 35,652 | 韓国ウォン | 29,615,118 | 38,310,962 | 6.19 |
| SK Innovation Co Ltd | 84,343 | 韓国ウォン | 9,523,730 | 9,351,063 | 1.51 |
| | | | 111,599,049 | 101,721,537 | 16.43 |
| 台湾 | | | | | |
| Compal Electronics Inc | 13,781,000 | 台湾ドル | 10,141,785 | 7,761,703 | 1.25 |
| CTBC Financial Holding Co Ltd | 11,922,577 | 台湾ドル | 6,071,161 | 6,134,249 | 0.99 |
| HON HAI Precision Industry Co Ltd | 7,239,871 | 台湾ドル | 17,078,257 | 17,809,297 | 2.88 |
| MediaTek Inc | 645,000 | 台湾ドル | 6,803,531 | 4,909,127 | 0.79 |
| Nan Ya Plastics Corp | 2,001,000 | 台湾ドル | 4,473,049 | 3,716,050 | 0.60 |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | 8,183,808 | 台湾ドル | 23,094,769 | 35,628,379 | 5.75 |
| Uni-President Enterprises Corp | 5,803,793 | 台湾ドル | 9,356,219 | 9,700,382 | 1.57 |
| | | | 77,018,771 | 85,659,187 | 13.83 |
| タイ | | | | | |
| Bangkok Bank PCL (Foreign Market) | 2,407,500 | タイバーツ | 13,812,817 | 10,336,495 | 1.67 |
| PTT Exploration & Production PCL (Foreign Market) | 3,772,700 | タイバーツ | 16,240,136 | 6,002,142 | 0.97 |
| | | | 30,052,953 | 16,338,637 | 2.64 |
| イギリス | | | | | |
| Standard Chartered Plc | 1,584,936 | 香港ドル | 26,754,899 | 13,373,051 | 2.16 |
| 株式合計 | | | 716,622,790 | 611,189,921 | 98.70 |
| その他の譲渡可能な有価証券 | | | | | |
| 株式 | | | | | |
| 香港 | | | | | |
| RREEF China Commercial Trust (REIT) | 8,195,000 | 香港ドル | 5,452,495 | — | — |
| 株式合計 | | | 5,452,495 | — | — |
| その他の譲渡可能な有価証券合計 | | | 5,452,495 | — | — |
| 投資総額 | | | 722,075,285 | 611,189,921 | 98.70 |
| その他資産 | | | | 8,018,828 | 1.30 |
| 純資産 | | | | 619,208,749 | 100.00 |