

フィリピン株式オープン

運用報告書(全体版) 第8期

(決算日 2021年8月23日)
(作成対象期間 2021年2月23日～2021年8月23日)

★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	5年間(2017年8月23日～2022年8月22日)	
運用方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	フィリピン株式マザーファンドの受益証券
	フィリピン株式マザーファンド	イ. フィリピンの金融商品取引所上場株式および店頭登録株式(上場予定および店頭登録予定を含みます。)。 ロ. フィリピン企業のDR(預託証券)
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率	
	マザーファンドの株式組入上限比率	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とし、原則として、基準価額の水準およびポートフォリオの流動性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には、分配を行なわないことがあります。	

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、フィリピンの株式に投資し、信託財産の成長をめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
お問い合わせ先(コールセンター)
TEL 0120-106212
(営業日の9:00～17:00)
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			MSCIフィリピン指数 (配当込み、円換算)		株式 組入比率	株式 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
4期末 (2019年8月22日)	8,710	0	△ 6.6	9,667	△ 2.8	94.8	—	3,446
5期末 (2020年2月25日)	8,338	0	△ 4.3	9,482	△ 1.9	95.6	—	2,703
6期末 (2020年8月24日)	6,859	0	△ 17.7	8,023	△ 15.4	96.2	—	1,948
7期末 (2021年2月22日)	7,642	10	11.6	9,124	13.7	94.2	—	1,700
8期末 (2021年8月23日)	7,588	0	△ 0.7	8,967	△ 1.7	96.2	—	1,320

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) MSCIフィリピン指数(配当込み、円換算)は、MSCI Inc. の承諾を得て、MSCIフィリピン指数(配当込み、フィリピン・ペソベース)をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。MSCIフィリピン指数(配当込み、フィリピン・ペソベース)は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有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。

(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

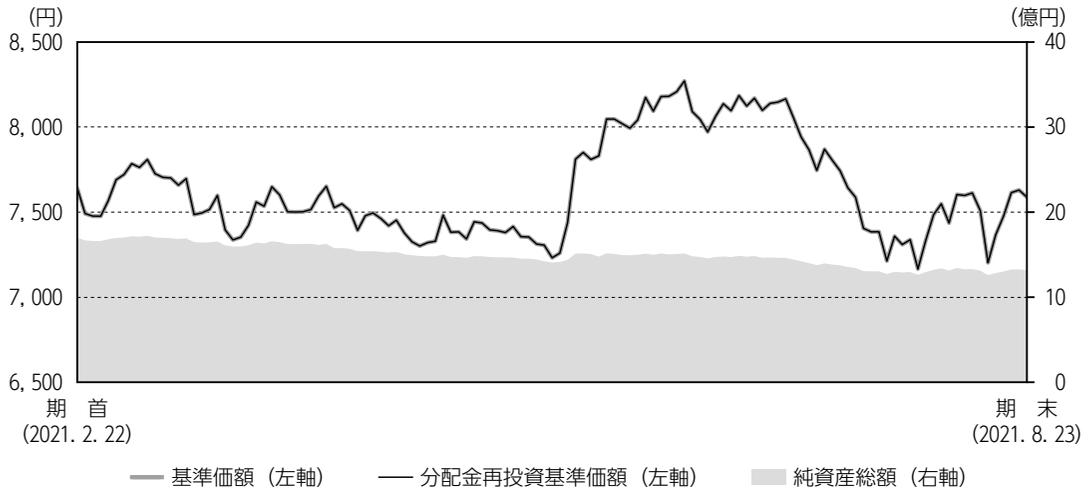
(注5) 株式および株式先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注6) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



* 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。

* 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。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、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

基準価額・騰落率

期首：7,642円

期末：7,588円（分配金0円）

騰落率：△0.7%（分配金込み）

基準価額の主な変動要因

フィリピン株式に投資した結果、基準価額はおおむね横ばいとなりました。フィリピン株式市況は下落したものの、銘柄選択の結果として保有株式はわずかながら上昇しました。また、フィリピン・ペソは円に対して横ばいとなりました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

フィリピン株式オープン

年 月 日	基 準 価 額		M S C I フィリピン指数 (配 当 込 み、 円 換 算)		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率
		騰 落 率	(参 考 指 数)	騰 落 率		
(期 首) 2021年 2月22日	円 7,642	% —	9,124	% —	% 94.2	% —
2 月 末	7,476	△ 2.2	8,873	△ 2.8	93.7	—
3 月 末	7,602	△ 0.5	9,107	△ 0.2	94.8	—
4 月 末	7,482	△ 2.1	8,957	△ 1.8	96.1	—
5 月 末	7,851	2.7	9,390	2.9	95.8	—
6 月 末	8,170	6.9	9,767	7.0	95.5	—
7 月 末	7,338	△ 4.0	8,671	△ 5.0	94.8	—
(期 末) 2021年 8月23日	7,588	△ 0.7	8,967	△ 1.7	96.2	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2021. 2. 23 ~ 2021. 8. 23)

■フィリピン株式市況

フィリピン株式市況は下落しました。

フィリピン株式市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスの感染拡大や米国長期金利の上昇への懸念から軟調に推移しました。2021年5月末以降は、ワクチン接種の進展や行動制限措置の緩和への期待から大きく反発しました。その後はレンジ内での推移となり、7月には大手格付会社による格付け見通しの下方修正やフィリピン国内における新型コロナウイルスのデルタ型の感染確認などを嫌気し、下落しました。8月前半は値動きの荒い展開となったものの、当作成期末にかけてはマニラ首都圏などでの行動制限の緩和期待などを背景に持ち直しました。

■為替相場

フィリピン・ペソは円に対して横ばいとなりました。

フィリピン・ペソは、当作成期首より2021年5月にかけて、米国長期金利の上昇などを背景とした円安米ドル高を受けて、対円で上昇（円安）しました。6月は円安米ドル高が進行したものの、米国の利上げ時期の前倒し観測を受けて対米ドルで下落したため、対円では弱含む動きとなりました。7月から当作成期末にかけては、新型コロナウイルスの感染拡大を受けて投資家心理が悪化する中、対円で下落（円高）しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

フィリピン株式マザーファンドの受益証券を通じて、フィリピンの株式、ETF（上場投資信託証券）および株価指数先物に投資することにより、信託財産の成長をめざして運用を行います。

■フィリピン株式マザーファンド

引き続き個別企業選択を重視し、長期的な利益成長性が高いと見込まれる銘柄を中心に投資することにより、中長期的なフィリピン経済の高成長を享受することをめざして運用を行ってまいります。

セクターでは、株価バリュエーション面で投資妙味があり財務基盤が堅固な複合企業を中心に資本財・サービスセクター、経済活動の段階的な正常化を背景に業績の回復が期待される銀行大手を中心に金融セクターなどに注目しています。

ポートフォリオについて

(2021. 2. 23 ~ 2021. 8. 23)

■当ファンド

フィリピン株式マザーファンドの受益証券を通じて、フィリピンの株式に投資することにより、信託財産の成長をめざして運用を行いました。

■フィリピン株式マザーファンド

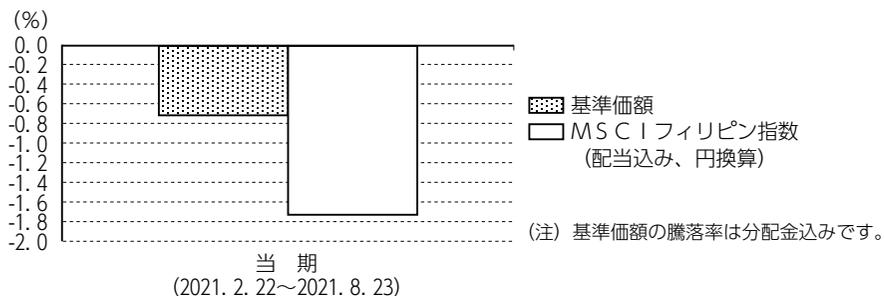
当ファンドの運用にあたっては、個別企業選択を重視し、長期的な利益成長性が高いと見込まれる銘柄を中心に投資して、ポートフォリオを構築しました。

セクターでは、銀行や不動産事業などを傘下に持ち、中長期的にフィリピン経済の高成長を享受できると見込まれた複合企業を中心に資本財・サービスや、住宅やオフィスに対する中長期的な需要拡大の恩恵が期待された不動産などのセクターを高位に組み入れました。

個別銘柄では、不動産開発で長年にわたる実績を持つ不動産大手の AYALA LAND INC（不動産）、小売りや不動産事業に強みを持つ複合企業の SM INVESTMENTS CORP（資本財・サービス）などを高位に組み入れました。また、ブロードバンドの普及率上昇の恩恵が期待された通信会社の CONVERGE ICT SOLUTIONS INC（コミュニケーション・サービス）などを買い付けました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。



分配金について

当作成期は、基準価額の水準等を勘案し、収益分配を見送らせていただきました。
 なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

分配原資の内訳（1万口当たり）

項 目	当 期	
	2021年2月23日 ～2021年8月23日	
当期分配金（税込み）	(円)	—
対基準価額比率	(%)	—
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	116

- (注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
- (注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。
- (注3) 当期分配金の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、ファンドの収益率とは異なります。



今後の運用方針

当ファンド

フィリピン株式マザーファンドの受益証券を通じて、フィリピンの株式、ETF（上場投資信託証券）および株価指数先物に投資することにより、信託財産の成長をめざして運用を行います。

フィリピン株式マザーファンド

引き続き個別企業選択を重視し、長期的な利益成長性が高いと見込まれる銘柄を中心に投資することにより、中長期的なフィリピン経済の高成長を享受することをめざして運用を行ってまいります。

セクターでは、株価バリュエーション面で投資妙味があり財務基盤が堅固な複合企業を中心に、資本財・サービスセクターや、経済活動の段階的な正常化を背景に業績の回復が期待される銀行大手を中心に金融セクターなどに注目しています。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2021. 2. 23~2021. 8. 23)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	68円	0. 894%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は7, 636円です。
(投 信 会 社)	(34)	(0. 439)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(34)	(0. 439)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(1)	(0. 016)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	11	0. 139	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(11)	(0. 139)	
有 価 証 券 取 引 税	15	0. 196	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(15)	(0. 196)	
そ の 他 費 用	5	0. 070	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(5)	(0. 067)	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および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(0)	(0. 003)	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)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	99	1. 298	

(注1) 当作成期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の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を四捨五入してあります。

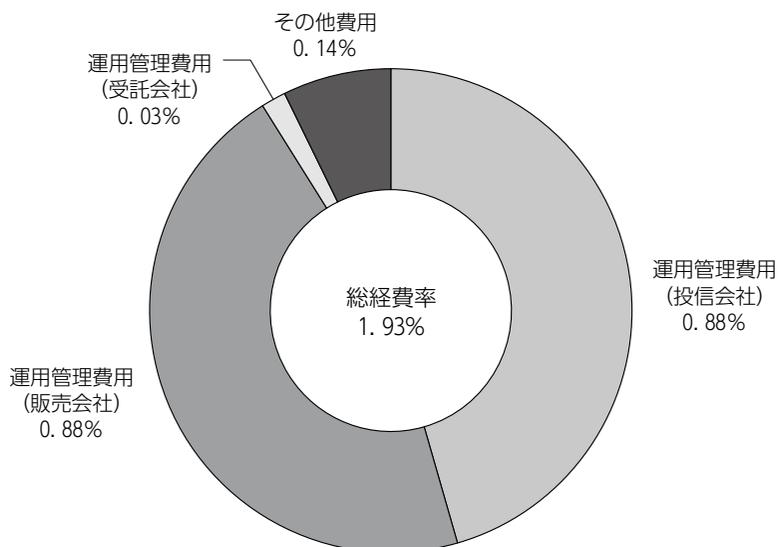
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.93%です。



(注1) 1万口当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2) 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3) 各比率は、年率換算した値です。

フィリピン株式オープン

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2021年2月23日から2021年8月23日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
フィリピン株式マザーファンド	16,134	13,000	483,079	394,000

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2021年2月23日から2021年8月23日まで)

項 目	当 期
	フィリピン株式マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	596,267千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,442,809千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.41

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
フィリピン株式マザーファンド	2,082,378	1,615,433	1,315,608

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年8月23日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
フィリピン株式マザーファンド	1,315,608	98.5
コール・ローン等、その他	19,875	1.5
投資信託財産総額	1,335,483	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、8月23日における邦貨換算レートは、1フィリピン・ペソ＝2.18円です。

(注3) フィリピン株式マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(1,307,357千円)の投資信託財産総額(1,334,221千円)に対する比率は、98.0%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年8月23日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,335,483,929円
コール・ローン等	19,875,009
フィリピン株式マザーファンド (評価額)	1,315,608,920
(B) 負債	14,857,652
未払解約金	1,477,715
未払信託報酬	13,339,109
その他未払費用	40,828
(C) 純資産総額 (A - B)	1,320,626,277
元本	1,740,416,575
次期繰越損益金	△ 419,790,298
(D) 受益権総口数	1,740,416,575口
1万口当り基準価額 (C / D)	7,588円

* 期首における元本額は2,225,680,179円、当作成期間中における追加設定元本額は28,401,346円、同解約元本額は513,664,950円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は7,588円です。

* 当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は419,790,298円です。

■損益の状況

当期 自2021年2月23日 至2021年8月23日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 2,164円
受取利息	192
支払利息	△ 2,356
(B) 有価証券売買損益	4,410,170
売買益	14,826,821
売買損	△ 10,416,651
(C) 信託報酬等	△ 13,379,963
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 8,971,957
(E) 前期繰越損益金	△ 435,499,200
(F) 追加信託差損益金	24,680,859
(配当等相当額)	(965,158)
(売買損益相当額)	(23,715,701)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 419,790,298
次期繰越損益金 (G)	△ 419,790,298
追加信託差損益金	24,680,859
(配当等相当額)	(965,158)
(売買損益相当額)	(23,715,701)
分配準備積立金	8,180,930
繰越損益金	△ 452,652,087

- (注1) 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おりません。
- (注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。
- (注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程(総額)」をご参照ください。
- (注4) 投資信託財産(親投資信託)の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用: 3,547,843円(未監査)

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	3,679,437円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	12,029,465
(d) 分配準備積立金	4,501,493
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	20,210,395
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	20,210,395
(h) 受益権総口数	1,740,416,575口

フィリピン株式マザーファンド

運用報告書 第8期 (決算日 2021年8月23日)

(作成対象期間 2021年2月23日～2021年8月23日)

フィリピン株式マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	イ. フィリピンの金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。） ロ. フィリピン企業のDR（預託証券）
株式組入制限	無制限

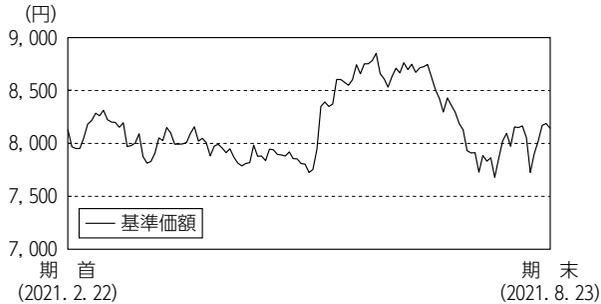
大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

<https://www.daiwa-am.co.jp/>

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基準 価 額		MSCI フィリピン指数 (配当込み、円換算)		株 組 比	式 入 率	株 先 比	式 率
	円	騰落率 %	参考指数	騰落率 %				
(期首) 2021年 2月22日	8,128	—	9,124	—	94.6	—	—	—
2月末	7,952	△ 2.2	8,873	△ 2.8	94.2	—	—	—
3月末	8,100	△ 0.3	9,107	△ 0.2	95.3	—	—	—
4月末	7,983	△ 1.8	8,957	△ 1.8	96.6	—	—	—
5月末	8,392	3.2	9,390	2.9	96.2	—	—	—
6月末	8,748	7.6	9,767	7.0	96.0	—	—	—
7月末	7,864	△ 3.2	8,671	△ 5.0	95.3	—	—	—
(期末) 2021年 8月23日	8,144	0.2	8,967	△ 1.7	96.5	—	—	—

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) MSCIフィリピン指数(配当込み、円換算)は、MSCI Inc.の承諾を得て、MSCIフィリピン指数(配当込み、フィリピン・ペソベース)をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。MSCIフィリピン指数(配当込み、フィリピン・ペソベース)は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有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。

(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注5) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：8,128円 期末：8,144円 騰落率：0.2%

【基準価額の主な変動要因】

フィリピン株式に投資した結果、基準価額はおおむね横ばいとなりました。フィリピン株式市況は下落したものの、銘柄選択の結果として保有株式はわずかながら上昇しました。また、フィリピン・ペソは円に対して横ばいとなりました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○フィリピン株式市況

フィリピン株式市況は下落しました。

フィリピン株式市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスの感染拡大や米国長期金利の上昇への懸念から軟調に推移しました。2021年5月末以降は、ワクチン接種の進展や行動制限措置の緩和への期待から大きく反発しました。その後はレンジ内での推移となり、7月には大手格付会社による格付け見通しの下方修正やフィリピン国内における新型コロナウイルスのデルタ型の感染確認などを嫌気し、下落しました。8月前半は値動きの荒い展開となったものの、当作成期末にかけてはマニラ首都圏などでの行動制限の緩和期待などを背景に持ち直しました。

○為替相場

フィリピン・ペソは円に対して横ばいとなりました。

フィリピン・ペソは、当作成期首より2021年5月にかけて、米国長期金利の上昇などを背景とした円安米ドル高を受けて、対円で上昇(円安)しました。6月は円安米ドル高が進行したものの、米国の利上げ時期の前倒し観測を受けて対米ドルで下落したため、対円では弱含み動きとなりました。7月から当作成期末にかけては、新型コロナウイルスの感染拡大を受けて投資家心理が悪化する中、対円で下落(円高)しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

引き続き個別企業選択を重視し、長期的な利益成長性が高いと見込まれる銘柄を中心に投資することにより、中長期的なフィリピン経済の高成長を享受することをめざして運用を行ってまいります。

セクターでは、株価バリュエーション面で投資妙味があり財務基盤が堅固な複合企業を中心に資本財・サービスセクター、経済活動の段階的な正常化を背景に業績の回復が期待される銀行大手を中心に金融セクターなどに注目しています。

◆ポートフォリオについて

当ファンドの運用にあたっては、個別企業選択を重視し、長期的な利益成長性が高いと見込まれる銘柄を中心に投資して、ポートフォリオを構築しました。

セクターでは、銀行や不動産事業などを傘下に持ち、中長期的にフィリピン経済の高成長を享受できると見込まれた複合企業を中心に資本財・サービスや、住宅やオフィスに対する中長期的な需要拡大の恩恵が期待された不動産などのセクターを高位に組み入れました。

個別銘柄では、不動産開発で長年にわたる実績を持つ不動産大手のAYALA LAND INC(不動産)、小売りや不動産事業に強みを持つ複合企業のSM INVESTMENTS CORP(資本財・サービス)などを高位に組み入れました。また、ブロードバンドの普及率上昇の恩恵が期待された通信会社のCONVERGE ICT SOLUTIONS INC(コミュニケーション・サービス)などを買い付けました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

当作成期の当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率は、「当作成期中の基準価額と市況等の推移」をご参照ください。

フィリピン株式マザーファンド

《今後の運用方針》

引き続き個別企業選択を重視し、長期的な利益成長性が高いと見込まれる銘柄を中心に投資することにより、中長期的なフィリピン経済の成長を享受することをめざして運用を行ってまいります。

セクターでは、株価バリュエーション面で投資妙味があり財務基盤が堅固な複合企業を中心に、資本財・サービスセクターや、経済活動の段階的な正常化を背景に業績の回復が期待される銀行大手を中心に金融セクターなどに注目しています。

■1万口当りの費用の明細

項目	当 期
売買委託手数料 (株式)	11円 (11)
有価証券取引税 (株式)	16 (16)
その他費用 (保管費用) (その他)	6 (5) (0)
合 計	33

(注1) 費用の項目および算出法については前掲しております項目の概要をご参照ください。

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

株 式

(2021年2月23日から2021年8月23日まで)

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	フィリピン	百株 59,690 ()	千フィリピン・ペソ 62,281 ()	百株 87,570.2	千フィリピン・ペソ 202,619

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) ()内は株式分割、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

株 式

(2021年2月23日から2021年8月23日まで)

銘 柄	当 期			銘 柄	期		
	株 数	金 額	平均単価		株 数	金 額	平均単価
CONVERGE ICT SOLUTIONS INC (フィリピン)	千株 650	千円 29,356	円 45	AYALA CORPORATION (フィリピン)	千株 31.17	千円 51,183	円 1,642
AC ENERGY CORP (フィリピン)	1,300	21,478	16	BDO UNIBANK INC (フィリピン)	210	48,490	230
GLOBE TELECOM INC (フィリピン)	4	18,533	4,633	METROPOLITAN BANK & TRUST (フィリピン)	350	35,500	101
MONDE NISSIN CORP (フィリピン)	500	17,501	35	SM PRIME HOLDINGS INC (フィリピン)	420	32,561	77
MEGAWORLD CORP (フィリピン)	2,500	16,474	6	SM INVESTMENTS CORP (フィリピン)	14.47	32,105	2,218
METROPOLITAN BANK & TRUST (フィリピン)	100	10,856	108	WILCON DEPOT INC (フィリピン)	621.7	25,902	41
NICKEL ASIA CORP (フィリピン)	800	10,618	13	JG SUMMIT HOLDINGS INC (フィリピン)	190	23,741	124
GT CAPITAL HOLDINGS INC (フィリピン)	5	6,736	1,347	AYALA LAND INC (フィリピン)	280	21,940	78
FIRST GEN CORPORATION (フィリピン)	80	5,686	71	ROBINSONS LAND CO (フィリピン)	550	20,752	37
SM PRIME HOLDINGS INC (フィリピン)	30	2,550	85	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC (フィリピン)	240	19,635	81

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表 外国株式

銘柄	期首		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	フィリピン・ペソ	千円	
(フィリピン)					
MONDE NISSIN CORP	—	5,000	8,400	18,316	生活必需品
AYALA LAND INC	17,385	14,585	50,609	110,354	不動産
CENTURY PACIFIC FOOD INC	4,561	3,761	9,402	20,502	生活必需品
PLDT INC	90	70	8,743	19,064	コミュニケーション・サービス
METROPOLITAN BANK & TRUST	10,499.1	7,999.1	36,395	79,361	金融
MANILA ELECTRIC COMPANY	310	210	6,006	13,096	公益事業
SM PRIME HOLDINGS INC	18,253	14,353	48,441	105,626	不動産
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	3,492.15	3,043.35	25,001	54,514	金融
AYALA CORPORATION	817.8	506.1	36,337	79,234	資本財・サービス
JG SUMMIT HOLDINGS INC	6,995.13	5,095.13	31,640	68,992	資本財・サービス
JOLLIBEE FOODS CORP	1,100	980	18,963	41,348	一般消費財・サービス
UNIVERSAL ROBINA CORP	1,158.8	758.8	10,471	22,832	生活必需品
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	3,000	2,650	47,170	102,854	資本財・サービス
MEGAWORLD CORP	—	9,000	2,583	5,632	不動産
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	4,640	2,240	9,049	19,732	資本財・サービス
GLOBE TELECOM INC	19.7	59.7	12,871	28,065	コミュニケーション・サービス
SM INVESTMENTS CORP	629	484.3	47,316	103,172	資本財・サービス
BDO UNIBANK INC	6,234	4,134	46,259	100,868	金融
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	44,000	26,000	9,984	21,770	金融
ROBINSONS LAND CO	14,116	8,616	14,561	31,750	不動産
ABOITIZ POWER CORP	3,685	—	—	—	公益事業
FIRST GEN CORPORATION	4,232	2,311	6,413	13,983	公益事業
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	7,000	7,000	7,420	16,179	資本財・サービス
GT CAPITAL HOLDINGS INC	403.45	393.45	20,656	45,040	資本財・サービス
D&L INDUSTRIES INC	12,541	8,749	7,279	15,872	素材
LT GROUP INC	4,000	4,000	3,708	8,085	資本財・サービス
ROBINSONS RETAIL HOLDINGS IN	583.9	583.9	2,995	6,531	生活必需品
BLOOMBERRY RESORTS CORP	8,000	4,000	2,360	5,145	一般消費財・サービス
WILCON DEPOT INC	14,812	8,595	20,585	44,885	一般消費財・サービス
INTEGRATED MICRO-ELECTRONICS	0.01	0.01	0	0	情報技術
AC ENERGY CORP	—	13,000	11,635	25,370	公益事業
CONVERGE ICT SOLUTIONS INC	—	6,500	19,110	41,669	コミュニケーション・サービス
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	192,558.04 164,677.84 28銘柄 31銘柄	582,369	1,269,856	<96.5%>

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < > 内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年8月23日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
株式	1,269,856	95.2%
コール・ローン等、その他	64,365	4.8
投資信託財産総額	1,334,221	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、8月23日における邦貨換算レートは、1フィリピン・ペソ＝2.18円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(1,307,357千円)の投資信託財産総額(1,334,221千円)に対する比率は、98.0%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年8月23日現在

項目	当期末
(A) 資産	1,334,221,463円
コール・ローン等	62,113,878
株式(評価額)	1,269,856,293
未収配当金	2,251,292
(B) 負債	18,533,727
未払金	18,533,727
(C) 純資産総額(A-B)	1,315,687,736
元本	1,615,433,350
次期繰越損益金	△ 299,745,614
(D) 受益権総口数	1,615,433,350口
1万口当り基準価額(C/D)	8,144円

* 期首における元本額は2,082,378,278円、当作成期間中における追加設定元本額は16,134,930円、同解約元本額は483,079,858円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、フィリピン株式オープン1,615,433,350円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は8,144円です。

* 当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は299,745,614円です。

フィリピン株式マザーファンド

■損益の状況

当期 自2021年2月23日 至2021年8月23日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	18,393,201円
受取配当金	18,396,207
受取利息	35
支払利息	△ 3,041
(B) 有価証券売買損益	△ 13,309,053
売買益	96,321,735
売買損	△ 109,630,788
(C) その他費用	△ 1,018,464
(D) 当期損益金 (A + B + C)	4,065,684
(E) 前期繰越損益金	△ 389,756,226
(F) 解約差損益金	89,079,858
(G) 追加信託差損益金	△ 3,134,930
(H) 合計 (D + E + F + G)	△ 299,745,614
次期繰越損益金 (H)	△ 299,745,614

(注1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。