

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／国内／株式	
信託期間	2014年8月8日から2024年7月29日まで	
運用方針	イーストスプリング日本中小型株式マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてわが国の金融商品取引所に上場されている（上場予定を含みます。）中小型株に投資を行い、中長期的な信託財産の成長を目指した運用を行います。	
主要投資対象	イーストスプリング・ジャパン中小型厳選バリュー株ファンド	イーストスプリング日本中小型株式マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	イーストスプリング日本中小型株式マザーファンド	わが国の金融商品取引所に上場されている（上場予定を含みます。）中小型株を主要投資対象とします。
組入制限	イーストスプリング・ジャパン中小型厳選バリュー株ファンド	<ul style="list-style-type: none">・株式への実質投資割合には、制限を設けません。・同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。・外貨建資産への投資は、行いません。
	イーストスプリング日本中小型株式マザーファンド	<ul style="list-style-type: none">・株式への投資割合には、制限を設けません。・同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。・外貨建資産への投資は、行いません。
分配方針	毎決算時（毎年7月27日。休業日の場合は翌営業日。）に、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。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・ ジャパン中小型厳選 バリュー株ファンド

第3期（決算日 2017年7月27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・ジャパン中小型厳選バリュー株ファンド」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

設定以来の運用実績

決 算 期	基準価額 (分配落)	騰 落 率		株 式 組入比率	純資産 総 額
		税 込 分配金	期 中 騰 落 率		
(設 定 日) 2014年 8 月 8 日	円 10,000	円 —	% —	% —	百万円 3,048
1 期 (2015年 7 月 27日)	12,821	0	28.2	99.4	26,494
2 期 (2016年 7 月 27日)	11,160	0	△13.0	99.3	13,337
3 期 (2017年 7 月 27日)	15,582	0	39.6	99.5	7,430

(注1) 純資産総額の単位未満は切捨てです。

(注2) 設定日の基準価額は設定時の価額を、設定日の純資産総額は設定元本を記載しております。

(注3) 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」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。

当期中の基準価額等の推移

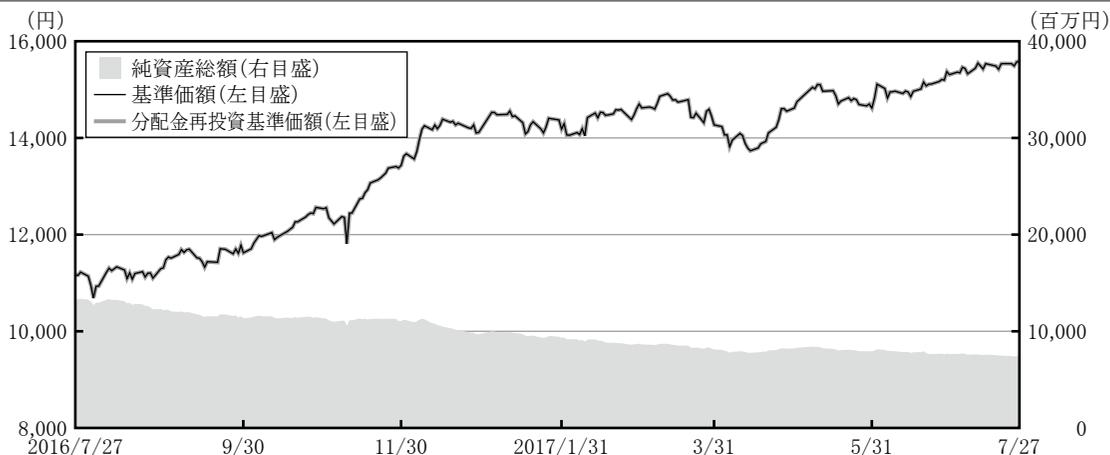
年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		株 式 組入比率
(期 首) 2016年 7 月 27日	円 11,160	% —	% 99.3	
7 月末	11,222	0.6	99.2	
8 月末	11,478	2.8	99.4	
9 月末	11,621	4.1	99.0	
10 月末	12,533	12.3	99.0	
11 月末	13,432	20.4	99.5	
12 月末	14,112	26.5	100.4	
2017年 1 月末	14,184	27.1	99.2	
2 月末	14,470	29.7	99.7	
3 月末	14,268	27.8	98.3	
4 月末	14,551	30.4	98.6	
5 月末	14,617	31.0	99.0	
6 月末	15,308	37.2	99.8	
(期 末) 2017年 7 月 27日	15,582	39.6	99.5	

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しております。

運用経過

基準価額等の推移について(第3期:2016年7月28日から2017年7月27日まで)



第3期首	11,160円
第3期末	15,582円(既払分配金0円)
騰落率	39.6%(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(税引前)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。

(注3) 最初の分配金が出るまでの期間においては、基準価額を示す折れ線と分配金再投資基準価額を示す折れ線は重なって表示されます。

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



・日本株式市場が上昇したこと。

投資環境について

○国内株式市況

日本株式市場は、2016年10月から年末にかけて大きく上昇しました。特に11月の米国大統領選挙でトランプ候補の勝利が確定すると米国の財政支出拡大や大型減税期待から米国株は上昇し、米ドル高円安が進んだことから日本株式市場も上昇しました。また12月に開催された米連邦公開市場委員会 (FOMC) 参加者による経済予測で2017年の米国利上げペースが市場予想を上回ったことを受けて、一段と米ドル高円安が進んだことも株式市場にとって好材料となりました。2017年1月から4月はトランプ大統領が行き過ぎた米ドル高に対し懸念を表明したことや、トランプ政権が掲げた政策の実行に対する不透明感が強まったことなどから円高米ドル安となり、株式市場は上値の重い展開となりました。5月以降は財務省発表の法人企業統計で設備投資の伸びが確認されたことや、さらに高値を抜く米国株式市場などにも後押しされ、株式市場は上昇して期末を迎えました。

ポートフォリオについて

○当ファンド

当ファンドは、イーストスプリング日本中小型株式マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として日本の中小型株に投資を行いました。

○イーストスプリング日本中小型株式マザーファンド

主として日本の中小型株に投資を行い、中長期的な値上がり益の獲得を目指しました。

当期中の投資行動は、株価の変動による割安度の変化などを考慮して、商船三井や栗田工業などの組入れを引き上げ、また、日立造船やリコーリースなどを新たに組み入れました。一方で、住友不動産販売やアドバンテストなどを全売却しました。

パフォーマンスについては、東芝テックやロームの保有がプラスに貢献しました。

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3期	
	2016年7月28日 ～2017年7月27日	
当期分配金	(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)	5,582

(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) —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

引き続きイーストスプリング日本中小型株式マザーファンド受益証券を高位に組み入れることにより、信託財産の成長を図ることを目指します。

○イーストスプリング日本中小型株式マザーファンド

マザーファンドのアプローチでは、テーマに基づく市場の選好を追いかけることはせず、割安に放置された銘柄の中から、バリュエーションに基づく投資機会を見い出します。運用担当者が市場に反した行動をとる場合は、個別企業の収益トレンドを熟知したうえで、短期のニュースに反応する市場においてその変動によって生じた投資機会を活用することが重要だと考えます。

話題性のあるマクロ経済等のニュースに市場の関心が短期的に集中することにより株価が大きく変動し、結果として魅力的な投資機会がもたらされることがあります。実際の市場においても魅力的な水準のまま放置された銘柄が存在しています。

多くの日本企業では、現金保有比率が高まるなど財務内容に改善が見られます。マイナス金利下では、経営陣は株主の観点に立った資本効率の向上を図る必要があると考えられ、そのような改善努力が日本株式市場の長期的な見通しの再評価につながると思っています。

マザーファンドは個別銘柄の選択に集中し、業種配分は行わないものの、機械、不動産、小売、金融などに加えて、自動車部品、ハイテク関連、特殊素材といったより景気に敏感な業種においても、投資候補銘柄を見い出しています。

1万口当たりの費用明細

項目	当期 2016/7/28 ～2017/7/27		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	255円	1.890%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は、13,483円です。
(投信会社)	(131)	(0.972)	委託した資金の運用の対価 交付運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(販売会社)	(116)	(0.864)	
(受託会社)	(7)	(0.054)	
(b) 売買委託手数料	23	0.167	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数
(株式)	(23)	(0.167)	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
(c) その他費用	3	0.024	(c) 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)	(0.013)	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
(印刷)	(1)	(0.011)	目論見書及び運用報告書等の法定開示書類の作成費用等
(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	281	2.081	

(注1) 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4) 売買委託手数料およびその他費用は、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7月28日から2017年7月27日まで)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
イーストスプリング日本中小型株式マザーファンド	千口 178,713	千円 263,000	千口 7,160,035	千円 9,862,000

(注) 単位未満は切捨てです。

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2016年7月28日から2017年7月27日まで)

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	20,181,374千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	10,877,912千円
(c) 売 買 高 比 率(a)/(b)	1.85

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(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7月28日から2017年7月27日まで)

当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7月27日現在)

親投資信託残高

種 類	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
イーストスプリング日本中小型株式マザーファンド	11,479,241	4,497,919	7,411,221

(注1) 単位未満は切捨てです。

(注2) マザーファンドの2017年7月27日現在の受益権総口数は、5,244,799千口です。

投資信託財産の構成

(2017年7月27日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
イーストスプリング日本中小型株式マザーファンド	7,411,221	98.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	121,859	1.6
投 資 信 託 財 産 総 額	7,533,080	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨てです。

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2017年7月27日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	7,533,080,532円
コール・ローン等	97,858,742
イーストスプリング日本中小型株式 マザーファンド(評価額)	7,411,221,790
未 収 入 金	24,000,000
(B) 負 債	102,380,137
未 払 解 約 金	24,114,701
未 払 信 託 報 酬	76,905,799
未 払 利 息	238
そ の 他 未 払 費 用	1,359,399
(C) 純 資 産 総 額 (A－B)	7,430,700,395
元 本	4,768,631,280
次 期 繰 越 損 益 金	2,662,069,115
(D) 受 益 権 総 口 数	4,768,631,280口
1 万 口 当 ち 基 準 価 額 (C/D)	15,582円

(注1) 元本の状況

期首元本額	11,950,813,701円
期中追加設定元本額	780,209,829円
期中一部解約元本額	7,962,392,250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2016年7月28日 至2017年7月27日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 21,095円
支 払 利 息	△ 21,095
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	2,134,983,608
売 買 益	3,301,522,766
売 買 損	△1,166,539,158
(C) 信 託 報 酬 等	△ 187,387,478
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	1,947,575,035
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	11,531,614
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	702,962,466
(配 当 等 相 当 額)	(178,977,110)
(売 買 損 益 相 当 額)	(523,985,356)
(G) 計 (D+E+F)	2,662,069,115
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	2,662,069,115
追 加 信 託 差 損 益 金	702,962,466
(配 当 等 相 当 額)	(179,853,655)
(売 買 損 益 相 当 額)	(523,108,811)
分 配 準 備 積 立 金	1,959,106,649

(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) 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又は一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に年10,000分の45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

計算期間末における費用控除後の配当等収益(127,380,275円)、費用控除後の有価証券売買等損益(1,137,461,333円)、信託約款に規定する収益調整金(702,962,466円)および分配準備積立金(694,265,041円)より、分配対象収益は2,662,069,115円(10,000口当たり5,582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。

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。

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。

お知らせ

該当事項はありません。

イーストスプリング日本中小型株式マザーファンド 運用報告書

第3期（決算日：2017年7月27日）
（計算期間：2016年7月28日～2017年7月27日）

「イーストスプリング日本中小型株式マザーファンド」の第3期の運用状況をご報告申し上げます。

当マザーファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	主としてわが国の金融商品取引所に上場されている（上場予定を含みます。）中小型株に投資を行い、中長期的な信託財産の成長を目指した運用を行います。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所に上場されている（上場予定を含みます。）中小型株を主要投資対象とします。
組入制限	<ul style="list-style-type: none">・株式への投資割合には、制限を設けません。・同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。・外貨建資産への投資は、行いません。

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額	期 中	株 式 組入比率	純資産 総 額
		騰 落 率		
(設 定 日) 2014年 8 月 8 日	円 10,000	% —	% —	百万円 3,040
1 期 (2015年 7 月27日)	13,061	30.6	99.6	26,458
2 期 (2016年 7 月27日)	11,588	△11.3	99.5	14,174
3 期 (2017年 7 月27日)	16,477	42.2	99.7	8,641

(注1) 純資産総額の単位未満は切捨てです。

(注2) 設定日の基準価額は設定時の価額を、設定日の純資産総額は設定元本を記載しております。

(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。

当期中の基準価額等の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	株 式 組入比率
(期 首) 2016年 7 月27日	円 11,588	% —	% 99.5
7 月末	11,653	0.6	99.4
8 月末	11,940	3.0	99.4
9 月末	12,108	4.5	98.9
10 月末	13,077	12.8	98.7
11 月末	14,033	21.1	99.0
12 月末	14,764	27.4	99.6
2017年 1 月末	14,863	28.3	99.4
2 月末	15,186	31.0	99.8
3 月末	14,999	29.4	98.2
4 月末	15,318	32.2	98.4
5 月末	15,414	33.0	98.5
6 月末	16,164	39.5	99.1
(期 末) 2017年 7 月27日	16,477	42.2	99.7

(注) 騰落率は期首比です。

運用経過

基準価額の推移について（第3期：2016年7月28日から2017年7月27日まで）



当期首11,588円であった基準価額は、当期末時点で16,477円となり、騰落率は+42.2%となりました。

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



・日本株式市場が上昇したこと。

投資環境について

○国内株式市況

日本株式市場は、2016年10月から年末にかけて大きく上昇しました。特に11月の米国大統領選挙でトランプ候補の勝利が確定すると米国の財政支出拡大や大型減税期待から米国株は上昇し、米ドル高円安が進んだことから日本株式市場も上昇しました。また12月に開催された米連邦公開市場委員会(FOMC)参加者による経済予測で2017年の米国利上げペースが市場予想を上回ったことを受けて、一段と米ドル高円安が進んだことも株式市場にとって好材料となりました。2017年1月から4月はトランプ大統領が行き過ぎた米ドル高に対し懸念を表明したことや、トランプ政権が掲げた政策の実行に対する不透明感が強まったことなどから円高米ドル安となり、株式市場は上値の重い展開となりました。5月以降は財務省発表の法人企業統計で設備投資の伸びが確認されたことや、さらに高値を抜く米国株式市場などにも後押しされ、株式市場は上昇して期末を迎えました。

ポートフォリオについて

主として日本の中小型株に投資を行い、中長期的な値上がり益の獲得を目指しました。

当期中の投資行動は、株価の変動による割安度の変化などを考慮して、商船三井や栗田工業などの組入れを引き上げ、また、日立造船やリコーリースなどを新たに組み入れました。一方で、住友不動産販売やアドバンテストなどを全売却しました。

パフォーマンスについては、東芝テックやロームの保有がプラスに貢献しました。

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。

今後の運用方針について

当マザーファンドのアプローチでは、テーマに基づく市場の選好を追いかけることはせず、割安に放置された銘柄の中から、バリュエーションに基づく投資機会を見い出します。運用担当者が市場に反した行動をとる場合は、個別企業の収益トレンドを熟知したうえで、短期のニュースに反応する市場においてその変動によって生じた投資機会を活用することが重要だと考えます。

話題性のあるマクロ経済等のニュースに市場の関心が短期的に集中することにより株価が大きく変動し、結果として魅力的な投資機会がもたらされることがあります。実際の市場においても魅力的な水準のまま放置された銘柄が存在しています。

多くの日本企業では、現金保有比率が高まるなど財務内容に改善が見られます。マイナス金利下では、経営陣は株主の観点に立った資本効率の向上を図る必要があると考えられ、そのような改善努力が日本株式市場の長期的な見通しの再評価につながると見えています。

当マザーファンドは個別銘柄の選択に集中し、業種配分は行わないものの、機械、不動産、小売、金融などに加えて、自動車部品、ハイテク関連、特殊素材といったより景気に敏感な業種においても、投資候補銘柄を見い出しています。

1 万口当たりの費用明細

項目	当期 2016/7/28～ 2017/7/27		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式)	24円 (24)	0.168% (0.168)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 期中の平均基準価額は、14,126円です。 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
(b) その他費用 (その他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 余資運用に係る費用（マイナス金利相当額）
合計	24	0.168	

(注1) 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

(2016年7月28日から2017年7月27日まで)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内	上 場	千株	千円	千株	千円
		5,608 (△3,198)	5,426,631 ()	13,514	14,754,743

(注1) 金額は受渡し代金です。

(注2) 単位未満は切捨てです。

(注3) () 内は株式分割、予約権行使、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。

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2016年7月28日から2017年7月27日まで)

項 目	当 期
(a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	20,181,374千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	10,877,912千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	1.85

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(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7月28日から2017年7月27日まで)

当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7月27日現在)

国内株式

組入有価証券明細表

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
繊維製品 (1.0%)			
富士紡ホールディングス	1,126	—	—
オンワードホールディングス	305	107	85,386
パルプ・紙 (—%)			
レンゴー	214	—	—
化学 (8.4%)			
カネカ	272	281	252,057
J S R	318.1	134.1	256,265
宇部興産	—	427	128,954
中国塗料	276	94.8	82,855
ゴム製品 (2.8%)			
住友理工	464.2	202.7	241,010
非鉄金属 (—%)			
アーレスティ	298.7	—	—
金属製品 (2.2%)			
トーカロ	97.3	—	—
三協立山	401.5	125.7	193,326
機械 (17.4%)			
日本製鋼所	—	123	222,507
日特エンジニアリング	210.7	—	—
ホソカワミクロン	697	—	—
住友重機械工業	941	278	224,902
栗田工業	70.1	88.5	285,855
マースエンジニアリング	63.8	32.3	76,357
ダイコク電機	237.4	96.5	167,331
リケン	1,082	49.9	267,464
日立造船	—	443.8	256,072
電気機器 (15.9%)			
コニカミノルタ	—	230.5	228,656
明電舎	—	471	181,335
東芝テック	1,166	343	210,945
沖電気工業	2,285	153.8	256,538
電気興業	491	281	159,608
日本航空電子工業	—	119	215,985
新電元工業	640	69	40,917
アドバンテスト	352.1	—	—
ローム	90.3	8.1	74,034
輸送用機器 (7.1%)			
武蔵精密工業	182.5	78.4	248,920
日信工業	260.6	131.3	243,955
ヤマハ発動機	209.4	43.1	120,507
精密機器 (1.9%)			
ニコン	200	84.8	161,713

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
陸運業 (—%)			
東武鉄道	211	—	—
ハマキョウレックス	80	—	—
海運業 (3.4%)			
商船三井	1,131	881	296,897
倉庫・運輸関連業 (2.1%)			
近鉄エクスプレス	147.2	94.9	182,018
情報・通信業 (—%)			
C A C H o l d i n g s	210	—	—
卸売業 (—%)			
第一実業	571	—	—
小売業 (10.0%)			
バルグループホールディングス	69	33.7	118,287
ココカラファイン	—	23.6	134,284
ユナイテッドアローズ	—	52.7	175,754
コメリ	140.8	87.2	273,808
しまむら	5.9	—	—
ゼビオホールディングス	194.9	78	161,928
銀行業 (7.4%)			
東京TYフィナンシャルグループ	153.5	113.1	342,127
千葉銀行	—	307	245,600
阿波銀行	625	63	47,061
その他金融業 (7.9%)			
クレディセゾン	228.2	138.6	294,386
興銀リース	278.8	52.6	136,917
リコーリース	—	65.2	248,412
不動産業 (9.9%)			
野村不動産ホールディングス	153.8	115.3	257,695
レオパレス21	501.4	350.2	275,257
住友不動産販売	197.7	—	—
サンヨーハウジング名古屋	273.7	166	189,738
イオンモール	—	62.1	132,086
サービス業 (2.6%)			
りらいあコミュニケーションズ	348	186.9	222,784
合 計	株 数・金 額	株 数	評 価 額
		18,472	7,368
	銘柄数<比率>	46	44
			8,618,501
			<99.7%>

(注1) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨てです。

(注4) ー印は組入れなしです。

(注5) 業種区分は、東証33業種分類に基づいています。

投資信託財産の構成

(2017年7月27日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 8,618,501	% 99.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	72,493	0.8
投 資 信 託 財 産 総 額	8,690,994	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨てです。

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2017年7月27日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	8,690,994,995円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	19,552,544
株 式(評価額)	8,618,501,600
未 収 入 金	48,605,601
未 収 配 当 金	4,335,250
(B) 負 債	49,395,302
未 払 金	25,394,385
未 払 解 約 金	24,000,000
未 払 利 息	47
そ の 他 未 払 費 用	870
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	8,641,599,693
元 本	5,244,799,730
次 期 繰 越 損 益 金	3,396,799,963
(D) 受 益 権 総 口 数	5,244,799,730口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,477円

(注1) 元本の状況
 期首元本額 12,231,854,008円
 期中追加設定元本額 178,713,115円
 期中一部解約元本額 7,165,767,393円
 当期末における元本の内訳
 イーストスプリング・ジャパン中小型厳選バリュー株ファンド 4,497,919,397円
 イーストスプリング日本中小型バリュー株式ファンド(適格機関投資家専用) 746,880,333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2016年7月28日 至2017年7月27日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	236,713,021円
受 取 配 当 金	236,746,700
そ の 他 収 益 金	3,570
支 払 利 息	△ 37,249
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	3,838,467,920
売 買 益	3,986,689,870
売 買 損	△ 148,221,950
(C) 信 託 報 酬 等	△ 1,613
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	4,075,179,328
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,942,566,357
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	84,286,885
(G) 解 約 差 損 益 金	△2,705,232,607
(H) 計 (D+E+F+G)	3,396,799,963
次 期 繰 越 損 益 金(H)	3,396,799,963

(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し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、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

お知らせ

該当事項はありません。