

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5期（決算日 2019年7月29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：<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)	税 込	期 中	株 式 組入比率	純資産 総 額
		分配金	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
4 期 (2018年 7 月 27日)	16,431	0	5.4	99.1	5,663
5 期 (2019年 7 月 29日)	13,363	0	△18.7	99.4	3,668

(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当初の元本額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) 2018年 7 月 27 日	円 16,431		% —	% 99.1
7 月 末	16,321		△ 0.7	99.2
8 月 末	15,904		△ 3.2	99.3
9 月 末	16,476		0.3	98.8
10 月 末	14,791		△10.0	99.2
11 月 末	14,753		△10.2	99.4
12 月 末	12,914		△21.4	100.2
2019年 1 月 末	13,860		△15.6	99.5
2 月 末	13,924		△15.3	99.5
3 月 末	13,614		△17.1	98.4
4 月 末	13,775		△16.2	98.3
5 月 末	12,641		△23.1	98.4
6 月 末	13,263		△19.3	99.7
(期 末) 2019年 7 月 29 日	13,363		△18.7	99.4

(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

(2018年7月28日～2019年7月29日)



第 5 期 首	16,431円
第 5 期 末	13,363円 (既払分配金0円)
騰 落 率	-18.7% (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1人ひとりの損益の状況を示すものではありません。

(注3) 分配金再投資基準価額は、期首の値が基準価額と同一になるように指数化しております。

基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は下落しました。

下落要因

・日本株式市場が下落したこと。

投資環境について

日本株式市場

米中貿易交渉の行方が市場の注目材料となる中、米中関係の悪化が長引いたことから、期初から2018年の年末まで日本株式市場は下落基調で推移しました。2019年に入ると、米中の閣僚級協議が開かれるなど貿易交渉の進展を好感して株価は反発しました。しかし、

5月には世界経済減速への懸念や米中関係の悪化、さらに米国によるメキシコへの追加関税発表（6月初旬に先送りが決定）などが嫌気され、株価は下落に転じました。為替市場で一時1米ドル106円台後半まで円高が進んだことも日本株式市場にとってマイナス材料となりました。

ポートフォリオについて

当ファンド

当ファンドは、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、LIXILグループ、富士通ゼネラルなどの株式を新たに組み入れました。一方で、大京、近鉄エクスプレスなどの株式を全売却しました。

パフォーマンスについては、エフテック、東京きらばしフィナンシャルグループの保有がマイナスに影響しました。

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5期	
	2018年7月28日 ～2019年7月29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)	5,351

(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避ける一方、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出します。運用担当者が市場に反した行動を取る場合は、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の改善が見られます。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、改善への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。

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、小売、不動産関連、地方銀行、その他金融、電子機器、自動車部品に加えて、資本財や特殊素材を含む幅広い業種において、投資候補銘柄を見出しています。

1 万口当たりの費用明細

(2018年7月28日～2019年7月29日)

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	273円	1.900%	(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、14,353円です。
(投信会社)	(140)	(0.977)	委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(125)	(0.869)	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)	(8)	(0.054)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売買委託手数料	10	0.069	(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)	(10)	(0.069)	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	5	0.038	(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)	(3)	(0.020)	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)	(3)	(0.017)	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	288	2.007	

(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

(2018年7月28日から2019年7月29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 2,030	千円 3,000	千口 700,460	千円 1,081,000

(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 (2018年7月28日から2019年7月29日まで)

項 目	当 期
	イーストスプリング日本中小型株式マザーファンド
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	4,638,745千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	6,488,426千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.71

(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

(2018年7月28日から2019年7月29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

(2019年7月29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
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 3,189,950	千口 2,491,521	千円 3,660,044

(注1) 単位未満は切捨てです。

(注2) マザーファンドの2019年7月29日現在の受益権総口数は、3,785,848千口です。

投資信託財産の構成

(2019年7月29日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
イーストスプリング日本中小型株式マザーファンド	千円 3,660,044	% 98.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	55,136	1.5
投 資 信 託 財 産 総 額	3,715,180	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

(2019年7月29日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	3,715,180,992円
コール・ローン等	43,136,610
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)	3,660,044,382
未 収 入 金	12,000,000
(B) 負 債	46,516,231
未 払 解 約 金	8,163,904
未 払 信 託 報 酬	37,432,797
未 払 利 息	126
そ の 他 未 払 費 用	919,404
(C) 純 資 産 総 額 (A－B)	3,668,664,761
元 本	2,745,368,867
次 期 繰 越 損 益 金	923,295,894
(D) 受 益 権 総 口 数	2,745,368,867口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	13,363円

- (注1) 元本の状況
 期首元本額 3,446,786,772円
 期中追加設定元本額 9,043,408円
 期中一部解約元本額 710,461,313円
- (注2) 1口当たり純資産額は1.3363円です。
- (注3) 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2018年7月28日 至2019年7月29日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 8,191円
支 払 利 息	△ 8,191
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 754,793,029
売 買 益	132,398,784
売 買 損	△ 887,191,813
(C) 信 託 報 酬 等	△ 85,798,255
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 840,599,475
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,318,792,093
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	445,103,276
(配 当 等 相 当 額)	(136,921,659)
(売 買 損 益 相 当 額)	(308,181,617)
(G) 計 (D + E + F)	923,295,894
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	923,295,894
追 加 信 託 差 損 益 金	445,103,276
(配 当 等 相 当 額)	(136,919,473)
(売 買 損 益 相 当 額)	(308,183,803)
分 配 準 備 積 立 金	1,332,299,982
繰 越 損 益 金	△ 854,107,364

- (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(13,507,889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(136,919,473円)および分配準備積立金(1,318,792,093円)より、分配対象収益は1,469,219,455円(10,000口当たり5,351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

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5期（決算日：2019年7月29日）
（計算期間：2018年7月28日～2019年7月29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5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
4 期 (2018年 7 月27日)	17,707	7.5	99.3	7,959
5 期 (2019年 7 月29日)	14,690	△17.0	99.6	5,561

(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当初の元本額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) 2018年 7 月27日	円 17,707	% —	% 99.3
7 月末	17,592	△ 0.6	99.4
8 月末	17,169	△ 3.0	99.3
9 月末	17,812	0.6	98.8
10 月末	16,021	△ 9.5	98.9
11 月末	16,005	△ 9.6	99.0
12 月末	14,041	△20.7	99.5
2019年 1 月末	15,089	△14.8	99.6
2 月末	15,182	△14.3	99.4
3 月末	14,867	△16.0	98.1
4 月末	15,065	△14.9	97.9
5 月末	13,856	△21.7	97.8
6 月末	14,554	△17.8	98.9
(期 末) 2019年 7 月29日	14,690	△17.0	99.6

(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

(2018年7月28日～2019年7月29日)



第5期首	17,707円
第5期末	14,690円
騰落率	-17.0%

基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は下落しました。

下落要因



・日本株式市場が下落したこと。

投資環境について

日本株式市場

米中貿易交渉の行方が市場の注目材料となる中、米中関係の悪化が長引いたことから、期初から2018年の年末まで日本株式市場は下落基調で推移しました。2019年に入ると、米中の閣僚級協議が開かれるなど貿易交渉の進展を好感して株価は反発しました。しかし、5月

には世界経済減速への懸念や米中関係の悪化、さらに米国によるメキシコへの追加関税発表（6月初旬に先送りが決定）などが嫌気され、株価は下落に転じました。為替市場で一時1米ドル106円台後半まで円高が進んだことも日本株式市場にとってマイナス材料となりました。

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、LIXILグループ、富士通ゼネラルなどの株式を新たに組み入れまし

た。一方で、大京、近鉄エクスプレスなどの株式を全売却しました。

パフォーマンスについては、エフテック、東京きらぼしフィナンシャルグループの保有がマイナスに影響しました。

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、公表されている指標が存在しないため、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

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避ける一方、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取る場合は、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の改善が見られます。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、改善への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。

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、小売、不動産関連、地方銀行、その他金融、電子機器、自動車部品に加えて、資本財や特殊素材を含む幅広い業種において、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

(2018年7月28日～2019年7月29日)

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式)	11円 (11)	0.069% (0.069)	(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、15,604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	11	0.069	

(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

(2018年7月28日から2019年7月29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
		1,616 (△ 665)	1,870,484 ()	1,876	2,768,260

(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 (2018年7月28日から2019年7月29日まで)

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	4,638,745千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	6,488,426千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.71

(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

(2018年7月28日から2019年7月29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

(2019年7月29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 (2.0%)			
オンワードホールディングス	198.7	191.2	108,792
化学 (8.6%)			
カネカ	146	25.4	102,743
J S R	111.3	113	187,241
宇部興産	46.2	64.1	143,135
大日本塗料	—	45	44,730
中国塗料	57	—	—
ゴム製品 (3.4%)			
住友ゴム工業	—	85.1	102,375
住友理工	193.7	103.3	85,739
鉄鋼 (2.6%)			
神戸製鋼所	224.8	206.1	144,888
金属製品 (8.6%)			
三協立山	134.1	102.5	127,510
L I X I Lグループ	—	92.2	169,740
日本発條	263.1	214	182,114
機械 (15.3%)			
日本製鋼所	—	75.6	144,622
住友重機械工業	43.5	38.2	137,138
栗田工業	51.2	56.6	159,555
椿本チエイン	174	30.6	106,335
マースグループホールディングス	29.3	25.5	51,255
ダイコク電機	75.2	40.8	54,835
リケン	26.6	—	—
日立造船	525.1	484.4	193,275
電気機器 (12.7%)			
コニカミノルタ	188.3	17.9	18,293
明電舎	380	91.7	155,614
東芝テック	239	9.5	30,637
沖電気工業	198.2	148.5	213,840
電気興業	32.4	—	—
富士通ゼネラル	—	87.4	151,551
日本航空電子工業	95	86.5	131,566
輸送用機器 (9.3%)			
川崎重工業	51.2	61.2	161,017
エフテック	167.5	134.3	98,710
武蔵精密工業	27	42.3	59,981
日信工業	57	—	—
N O K	—	123.5	196,735

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
その他製品 (2.0%)			
アシックス	92.2	91.3	108,464
海運業 (4.2%)			
商船三井	75	84.7	231,823
倉庫・運輸関連業 (—%)			
近鉄エクスプレス	6.3	—	—
小売業 (3.8%)			
パルグループホールディングス	28	—	—
ユナイテッドアローズ	24.1	—	—
コメリ	53.5	30.8	70,285
しまむら	17	17.7	139,122
ゼビオホールディングス	44.5	—	—
銀行業 (6.2%)			
東京きらぼしフィナンシャルグループ	121.2	61.6	92,769
コンソルティア・フィナンシャルグループ	—	323.9	127,616
千葉銀行	302.7	233.4	125,335
その他金融業 (7.8%)			
クレディセゾン	133.9	140.3	180,566
興銀リース	34.2	30.1	81,962
リコーリース	67.3	50.8	170,434
不動産業 (11.2%)			
野村不動産ホールディングス	73.3	53.9	125,802
飯田グループホールディングス	106.3	92.5	166,037
大京	68.8	—	—
レオパレス21	326.6	377	86,710
サンヨーハウジング名古屋	141.6	140.4	135,486
イオンモール	94.3	63.5	105,791
サービス業 (2.3%)			
りらいあコミュニケーションズ	68.1	99.9	129,170
合 計	株 数・金 額	株 数	金 額
	5,614	4,688	5,541,352
	銘柄数<比率>	46	44
			<99.6%>

(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) 一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

(2019年7月29日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 5,541,352	% 99.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	32,011	0.6
投 資 信 託 財 産 総 額	5,573,363	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

(2019年7月29日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	5,573,363,532円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	19,302,023
株 式(評価額)	5,541,352,900
未 収 入 金	9,811,909
未 収 配 当 金	2,896,700
(B) 負 債	12,000,056
未 払 解 約 金	12,000,000
未 払 利 息	56
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	5,561,363,476
元 本	3,785,848,541
次 期 繰 越 損 益 金	1,775,514,935
(D) 受 益 権 総 口 数	3,785,848,541口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	14,690円

(注1) 元本の状況
 期首元本額 4,495,145,015円
 期中追加設定元本額 2,030,301円
 期中一部解約元本額 711,326,775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
 2,491,521,023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)
 1,294,327,518円

(注2) 1口当たり純資産額は1,4690円です。

(注3) 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2018年7月28日 至2019年7月29日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	163,323,419円
受 取 配 当 金	163,354,150
そ の 他 収 益 金	1,674
支 払 利 息	△ 32,405
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△1,467,309,375
売 買 損 益	136,576,627
売 買 損	△1,603,886,002
(C) 信 託 報 酬 等	△ 538
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△1,303,986,494
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	3,464,204,955
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	969,699
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 385,673,225
(H) 計 (D+E+F+G)	1,775,514,935
次 期 繰 越 損 益 金(H)	1,775,514,935

(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。