

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6期（決算日 2020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りますよう、お願い申し上げます。

イーストスプリング・インベストメンツ株式会社

【お問い合わせ先】

電話番号：03-5224-3400

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時まで）

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

〒100-6905

東京都千代田区丸の内2-6-1丸の内パークビルディング

最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税込	期中	株式 組入比率	純資産 総額
		分配金	騰落率		
	円	円	%	%	百万円
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
6期 (2020年7月27日)	11,777	0	△11.9	99.0	2,463

(注1) 純資産総額の単位未満は切捨てです。

(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。

(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) 2019年7月29日	円 13,363	% —		% 99.4
7月末	13,358	△ 0.0		99.4
8月末	12,656	△ 5.3		99.3
9月末	13,632	2.0		98.7
10月末	14,739	10.3		98.8
11月末	14,900	11.5		99.2
12月末	15,219	13.9		100.2
2020年1月末	14,388	7.7		98.6
2月末	12,391	△ 7.3		99.3
3月末	10,925	△18.2		97.3
4月末	11,261	△15.7		97.9
5月末	12,135	△ 9.2		98.3
6月末	11,763	△12.0		98.8
(期末) 2020年7月27日	11,777	△11.9		99.0

(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

(2019年7月30日～2020年7月27日)



第 6 期 首	13,363円
第 6 期 末	11,777円 (既払分配金0円)
騰 落 率	-11.9% (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



・保有している株式が下落したこと。

投資環境について

日本株式市場

期初から米中貿易交渉の行方が市場の注目材料となる中、米中閣僚級協議における部分合意や対中追加関税の引上げ延期などが好感され、2019年の年末に向けて日本株式市場は上昇基調で推移しました。2020年に入ると、中国での新型コロナウイルス感染拡大から世界に感染が加速し、各国で都市封鎖や移動制限が実施されたことから世界規模での景気後退入りが懸念され、株価は2月から3月にか

けて大きく下落しました。その後は新型コロナウイルスの感染速度の鈍化がみられたことで、感染拡大がピークを迎えるとの期待から株価は反発しました。ワクチン開発進展報道や日本国内における緊急事態宣言の解除に加え、各国の大規模な支援策や流動性供給策なども材料視されました。しかし、新規感染拡大の兆候が世界で再び顕著になってきたことを受けて、感染第二波への懸念から株価は上値の重い展開となり、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。

投資行動としては、株価の変動による割安度の変化などを考慮して、EPSホールディングスや新生銀行などの株式を新たに組み入れました。一方で、東京きらぼしフィナンシャルグループやレオパレス21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、商船三井やNOK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6期	
	2019年7月30日 ～2020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)	5,441

(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

新型コロナウイルスの感染拡大により日本経済は大きな影響を受けていますが、マザーファンドでは市場が何を織り込んでいるかに着目しています。株価が調整する中、多くの銘柄は企業の本来の価値を正確に反映していないと思われ、長期投資家にとっては投資機会を見出す局面ともいえます。多くの日本企業は、これまでの非効率な投資と過剰な負債を削減してきた結果、他の先進国並みの収益性や体力を備え、収益率の水準は肩を並べつつあります。また、業績に連動した経営陣

の報酬や社外取締役の増員など、コーポレートガバナンスに対する企業の姿勢は改善されており、経営陣が株主リターンを意識した適切な判断を下すことが世界での高い競争力につながると考えています。

保有銘柄については、企業の資金調達に影響を及ぼす重要な変化を確認し、利払いや負債の返済、バランスシートの健全性などの検証も行っています。

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、割安とみられる銘柄群の中から、バリュエーションに基づく投資機会を見出します。また、個別銘柄の選択に集中し、業種配分は行わないものの、小売や不動産関連、地方銀行、その他金融、電子機器、自動車部品メーカー、さらに資本財や特殊素材といった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

(2019年7月30日～2020年7月27日)

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	251円	1.914%	(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、13,113円です。
(投信会社)	(129)	(0.985)	委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(115)	(0.875)	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)	(7)	(0.055)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売買委託手数料	14	0.104	(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)	(14)	(0.104)	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	7	0.051	(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)	(4)	(0.030)	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)	(0.022)	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
合計	272	2.069	

(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。

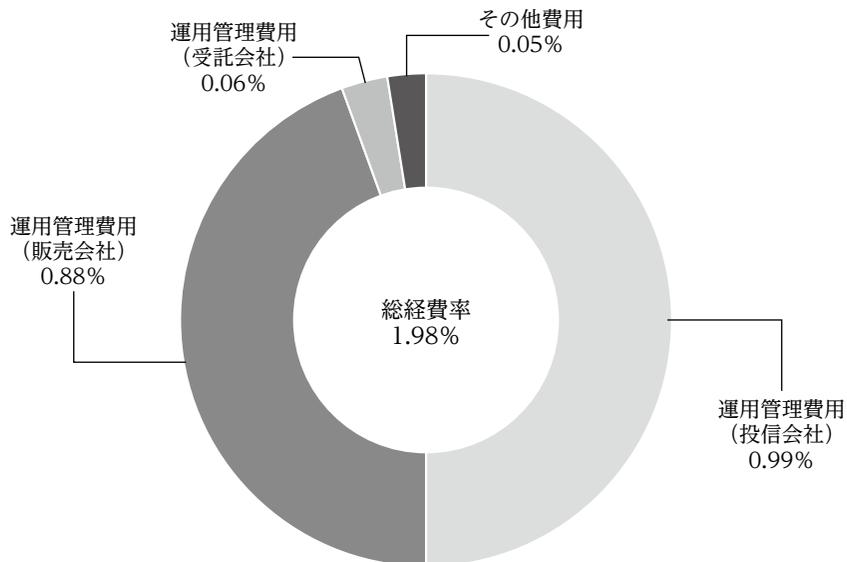
(注3) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(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。

(参考情報)

■総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.98%です。



(注) 各費用は、1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

売買及び取引の状況

(2019年7月30日から2020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 10,644	千円 18,000	千口 639,564	千円 961,000

(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 (2019年7月30日から2020年7月27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	5,460,858千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	4,802,859千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	1.13

(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

(2019年7月30日から2020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

(2020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
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 2,491,521	千口 1,862,601	千円 2,455,467

(注1) 単位未満は切捨てです。

(注2) マザーファンドの2020年7月27日現在の受益権総口数は、1,862,601千口です。

投資信託財産の構成

(2020年7月27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 2,455,467	% 98.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	37,348	1.5
投 資 信 託 財 産 総 額	2,492,815	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

(2020年7月27日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,492,815,465円
コール・ローン等	33,348,133
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)	2,455,467,332
未 収 入 金	4,000,000
(B) 負 債	29,202,849
未 払 解 約 金	3,561,640
未 払 信 託 報 酬	24,727,267
未 払 利 息	97
そ の 他 未 払 費 用	913,845
(C) 純 資 産 総 額 (A－B)	2,463,612,616
元 本	2,091,894,122
次 期 繰 越 損 益 金	371,718,494
(D) 受 益 権 総 口 数	2,091,894,122口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	11,777円

- (注1) 元本の状況
 期首元本額 2,745,368,867円
 期中追加設定元本額 25,584,538円
 期中一部解約元本額 679,059,283円

(注2) 1口当たり純資産額は1.1777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2019年7月30日 至2020年7月27日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 6,851円
支 払 利 息	△ 6,851
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 273,014,555
売 買 益	95,537,568
売 買 損	△ 368,552,123
(C) 信 託 報 酬 等	△ 60,598,357
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 333,619,763
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	360,427,604
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	344,910,653
(配 当 等 相 当 額)	(115,310,411)
(売 買 損 益 相 当 額)	(229,600,242)
(G) 計 (D + E + F)	371,718,494
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	371,718,494
追 加 信 託 差 損 益 金	344,910,653
(配 当 等 相 当 額)	(115,387,422)
(売 買 損 益 相 当 額)	(229,523,231)
分 配 準 備 積 立 金	1,022,835,539
繰 越 損 益 金	△ 996,027,698

(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(18,642,512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(115,387,422円)および分配準備積立金(1,004,193,027円)より、分配対象収益は1,138,222,961円(10,000口当たり5,441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6期（決算日：2020年7月27日）
（計算期間：2019年7月30日～2020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6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。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中	株式 組入比率	純資産 総額
		騰落率		
2期 (2016年7月27日)	円 11,588	% △11.3	% 99.5	百万円 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
6期 (2020年7月27日)	13,183	△10.3	99.3	2,455

(注1) 純資産総額の単位未満は切捨てです。

(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。

当期中の基準価額等の推移

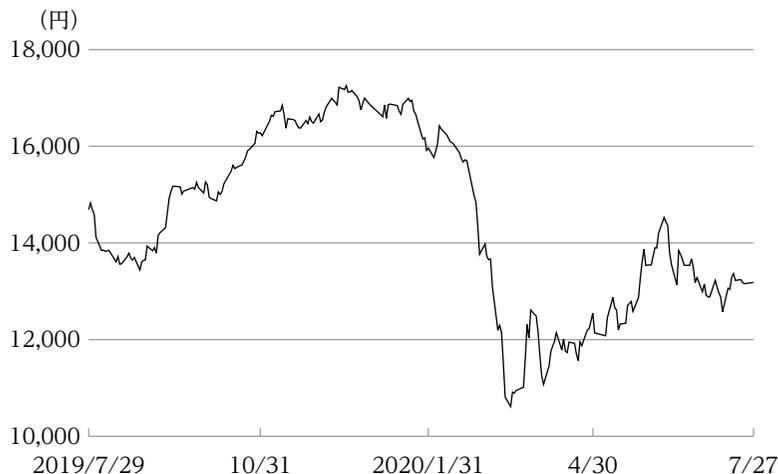
年月日	基準価額	騰落率	株式 組入比率
(期首) 2019年7月29日	円 14,690	% —	% 99.6
7月末	14,686	△0.0	99.6
8月末	13,935	△5.1	99.2
9月末	15,032	2.3	98.5
10月末	16,276	10.8	98.4
11月末	16,479	12.2	98.6
12月末	16,858	14.8	99.4
2020年1月末	15,961	8.7	99.0
2月末	13,766	△6.3	99.3
3月末	12,155	△17.3	97.3
4月末	12,547	△14.6	97.6
5月末	13,538	△7.8	97.9
6月末	13,149	△10.5	98.2
(期末) 2020年7月27日	13,183	△10.3	99.3

(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

(2019年7月30日～2020年7月27日)



第6期首	14,690円
第6期末	13,183円
騰落率	-10.3%

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

・保有している株式が下落したこと。

投資環境について

日本株式市場

期初から米中貿易交渉の行方が市場の注目材料となる中、米中間僚級協議における部分合意や対中追加関税の引上げ延期などが好感され、2019年の年末に向けて日本株式市場は上昇基調で推移しました。2020年に入ると、中国での新型コロナウイルス感染拡大から世界に感染が加速し、各国で都市封鎖や移動制限が実施されたことから世界規模での景気後退入りが懸念され、株価は2月から3月にかけて大き

く下落しました。その後は新型コロナウイルスの感染速度の鈍化がみられたことで、感染拡大がピークを迎えるとの期待から株価は反発しました。ワクチン開発進展報道や日本国内における緊急事態宣言の解除に加え、各国の大規模な支援策や流動性供給策なども材料視されました。しかし、新規感染拡大の兆候が世界で再び顕著になってきたことを受けて、感染第二波への懸念から株価は上値の重い展開となり、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。

投資行動としては、株価の変動による割安度の変化などを考慮して、EPSホールディングスや新生銀行などの株式を新たに組み入れまし

た。一方で、東京きらぼしフィナンシャルグループやレオパレス21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、商船三井やNOK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。

今後の運用方針について

新型コロナウイルスの感染拡大により日本経済は大きな影響を受けていますが、マザーファンドでは市場が何を織り込んでいるかに着目しています。株価が調整する中、多くの銘柄は企業の本来の価値を正確に反映していないと思われる、長期投資家にとっては投資機会を見い出す局面ともいえます。多くの日本企業は、これまでの非効率な投資と過剰な負債を削減してきた結果、他の先進国並みの収益性や体力を備え、収益率の水準は肩を並べつつあります。また、業績に連動した経営陣の報酬や社外取締役の増員など、コーポレートガバナンスに対する企業の姿勢は改善されており、経営陣が株主リターンを意識した適切な判断を下すことが世界での高い競争力につながると考えています。

保有銘柄については、企業の資金調達に影響を及ぼす重要な変化を確認し、利払いや負債の返済、バランスシートの健全性などの検証も行っています。

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、割安とみられる銘柄群の中から、バリュエーションに基づく投資機会を見い出します。また、個別銘柄の選択に集中し、業種配分は行わないものの、小売や不動産関連、地方銀行、その他金融、電子機器、自動車部品メーカー、さらに資本財や特殊素材といった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

(2019年7月30日～2020年7月27日)

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	13円	0.091%	(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、14,531円です。
(株式)	(13)	(0.091)	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
合計	13	0.091	

(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

(2019年7月30日から2020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 1,316	千円 1,434,016	千株 3,629	千円 4,026,842

(注1) 金額は受渡し代金です。

(注2) 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 (2019年7月30日から2020年7月27日まで)

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	5,460,858千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	4,802,859千円
(c) 売買高比率(a)÷(b)	1.13

(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

(2019年7月30日から2020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

(2020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 (2.4%)			
マツオカコーポレーション	—	26.8	49,660
オンワードホールディングス	191.2	25.2	7,837
化学 (10.1%)			
カネカ	25.4	26.1	70,026
J S R	113	22.8	51,824
宇部興産	64.1	40	72,240
大日本塗料	45	53	52,788
ゴム製品 (3.4%)			
住友ゴム工業	85.1	66.3	64,974
ニッタ	—	7.5	17,527
住友理工	103.3	—	—
鉄鋼 (1.9%)			
神戸製鋼所	206.1	119.1	45,615
金属製品 (7.4%)			
三協立山	102.5	52.4	48,417
L I X I L グループ	92.2	41.7	63,926
日本発條	214	103.2	68,834
機械 (15.7%)			
日本製鋼所	75.6	53.6	85,224
住友重機械工業	38.2	33.3	78,255
栗田工業	56.6	16.8	50,736
椿本チエイン	30.6	22.5	59,985
マースグループホールディングス	25.5	12.1	20,412
ダイコク電機	40.8	15.4	19,850
日立造船	484.4	177	68,145
電気機器 (7.6%)			
コニカミノルタ	17.9	—	—
明電舎	91.7	28.2	48,842
東芝テック	9.5	—	—
沖電気工業	148.5	66.3	72,001
富士通ゼネラル	87.4	6.2	16,138
ローランド ディー、ジー	—	7.8	9,547
日本航空電子工業	86.5	28.1	40,154
輸送用機器 (13.5%)			
川崎重工	61.2	43.6	70,675
三菱自動車工業	—	128.4	34,539
エフテック	134.3	90.4	44,928
武蔵精密工業	42.3	62.7	56,994
N O K	123.5	62.6	80,128

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
マツダ	—	60.4	42,219	
その他製品 (0.9%)				
アシックス	91.3	16.7	21,142	
海運業 (3.4%)				
商船三井	84.7	44	82,324	
倉庫・運輸関連業 (1.6%)				
近鉄エクスプレス	—	20.6	39,284	
小売業 (3.6%)				
コメリ	30.8	11.9	34,510	
しまむら	17.7	7	54,040	
銀行業 (8.3%)				
東京きらぼしフィナンシャルグループ	61.6	—	—	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	323.9	214.9	73,710	
新生銀行	—	40.8	53,162	
千葉銀行	233.4	146	74,898	
その他金融業 (5.5%)				
クレディセゾン	140.3	58.6	64,401	
みずほリース	30.1	—	—	
リコーリース	50.8	24.3	70,640	
不動産業 (9.6%)				
野村不動産ホールディングス	53.9	26.1	49,772	
飯田グループホールディングス	92.5	41.6	73,632	
レオパレス21	377	—	—	
A V A N T I A	140.4	71.1	61,999	
イオンモール	63.5	35.4	47,719	
サービス業 (5.1%)				
E P Sホールディングス	—	62.1	61,913	
りらいあコミュニケーションズ	99.9	54.6	63,554	
合 計	株 数 : 金 額	4,688	2,375	2,439,154
	銘柄数<比率>	44	46	<99.3%>

(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) —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

(2020年7月27日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 2,439,154	% 99.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	24,626	1.0
投 資 信 託 財 産 総 額	2,463,780	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

(2020年7月27日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,463,780,276円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	6,557,485
株 式(評価額)	2,439,154,500
未 収 入 金	15,681,591
未 収 配 当 金	2,386,700
(B) 負 債	8,386,767
未 払 金	4,386,748
未 払 解 約 金	4,000,000
未 払 利 息	19
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	2,455,393,509
元 本	1,862,601,329
次 期 繰 越 損 益 金	592,792,180
(D) 受 益 権 総 口 数	1,862,601,329口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,183円

(注1) 元本の状況
 期首元本額 3,785,848,541円
 期中追加設定元本額 10,644,590円
 期中一部解約元本額 1,933,891,802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
 1,862,601,329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)
 0円

(注2) 1口当たり純資産額は1,3183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2019年7月30日 至2020年7月27日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	141,053,194円
受 取 配 当 金	141,099,050
そ の 他 収 益 金	1,763
支 払 利 息	△ 47,619
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 509,372,635
売 買 益	336,871,692
売 買 損	△ 846,244,327
(C) 当 期 損 益 金 (A + B)	△ 368,319,441
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	1,775,514,935
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	7,355,410
(F) 解 約 差 損 益 金	△ 821,758,724
(G) 計 (C + D + E + F)	592,792,180
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	592,792,180

(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(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し引いた差額分をいいます。

(注3) 損益の状況の中で(F)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。