

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 | 2017年4月20日から2027年3月25日まで | |
| 運用方針 | 主として米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。）小型株に実質的に投資を行い、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。 | |
| 主要投資対象 | Aコース （為替ヘッジあり）／ Bコース （為替ヘッジなし） | イーストスプリング米国小型株式マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。 |
| | イーストスプリング 米国小型株式 マザーファンド | 米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。）小型株を主要投資対象とします。 |
| 組入制限 | Aコース （為替ヘッジあり）／ Bコース （為替ヘッジなし） | <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。 ・外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 |
| | イーストスプリング 米国小型株式 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割合には制限を設けません。 |
| 分配方針 | 毎決算時（毎年3月25日および9月25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。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があります。 | |

運用報告書（全体版）

イーストスプリング 米国小型厳選バリュー株ファンド Aコース（為替ヘッジあり）／ Bコース（為替ヘッジなし）

第3期（決算日 2018年9月25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米国小型厳選バリュー株ファンドAコース（為替ヘッジあり）／Bコース（為替ヘッジなし）」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) | 騰 落 率 | | 株 式 組入比率 | 投資信託 証 券 組入比率 | 純資産 総 額 |
|-----------------------|---------------|------------|--------|-------------|---------------------|------------|
| | | 税 込 分配金 | 期 中 | | | |
| (設 定 日) 2017年4月20日 | 円 10,000 | 円 — | % — | % — | % — | 百万円 24 |
| 1期(2017年9月25日) | 10,553 | 0 | 5.5 | 96.0 | 1.4 | 334 |
| 2期(2018年3月26日) | 10,482 | 0 | △0.7 | 88.5 | 1.4 | 89 |
| 3期(2018年9月25日) | 11,498 | 0 | 9.7 | 93.5 | 1.5 | 39 |

(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、投資信託証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。

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 | 投資信託 証 券 組入比率 |
|---------------------|-------------|--------|--|-------------|---------------------|
| | | | | | |
| (期 首) 2018年3月26日 | 円 10,482 | % — | | % 88.5 | % 1.4 |
| 3月末 | 10,639 | 1.5 | | 87.8 | 1.4 |
| 4月末 | 10,739 | 2.5 | | 104.4 | 1.6 |
| 5月末 | 11,227 | 7.1 | | 99.8 | 1.6 |
| 6月末 | 10,943 | 4.4 | | 100.4 | 1.6 |
| 7月末 | 11,232 | 7.2 | | 96.5 | 1.6 |
| 8月末 | 11,562 | 10.3 | | 94.3 | 1.6 |
| (期 末) 2018年9月25日 | 11,498 | 9.7 | | 93.5 | 1.5 |

(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、投資信託証券組入比率は実質比率を記載しております。

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 | 投資信託 証 券 組入比率 | 純資産 総 額 |
|-----------------------|---------------|------------|--------|-------------|---------------------|------------|
| | | 税 込 分配金 | 期 中 | | | |
| (設 定 日) 2017年4月20日 | 円 10,000 | 円 — | % — | % — | % — | 百万円 804 |
| 1期(2017年9月25日) | 10,990 | 0 | 9.9 | 96.8 | 1.4 | 6,903 |
| 2期(2018年3月26日) | 10,233 | 0 | △ 6.9 | 96.2 | 1.5 | 5,042 |
| 3期(2018年9月25日) | 12,227 | 0 | 19.5 | 93.6 | 1.5 | 1,507 |

(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、投資信託証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。

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 | 投資信託 証 券 組入比率 |
|---------------------|-------------|--------|--------|-------------|---------------------|
| | | | | | |
| (期 首) 2018年3月26日 | 円 10,233 | % — | % — | % 96.2 | % 1.5 |
| 3月末 | 10,528 | 2.9 | | 95.1 | 1.5 |
| 4月末 | 10,963 | 7.1 | | 102.2 | 1.5 |
| 5月末 | 11,405 | 11.5 | | 96.4 | 1.5 |
| 6月末 | 11,341 | 10.8 | | 95.0 | 1.6 |
| 7月末 | 11,697 | 14.3 | | 97.8 | 1.6 |
| 8月末 | 12,072 | 18.0 | | 95.8 | 1.6 |
| (期 末) 2018年9月25日 | 12,227 | 19.5 | | 93.6 | 1.5 |

(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、投資信託証券組入比率は実質比率を記載しております。

運用経過

Aコース(為替ヘッジあり)

基準価額等の推移について

(2018年3月27日～2018年9月25日)



| | |
|------|------------------|
| 第3期首 | 10,482円 |
| 第3期末 | 11,498円(既払分配金0円) |
| 騰落率 | 9.7%(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

当期の基準価額は上昇しました。

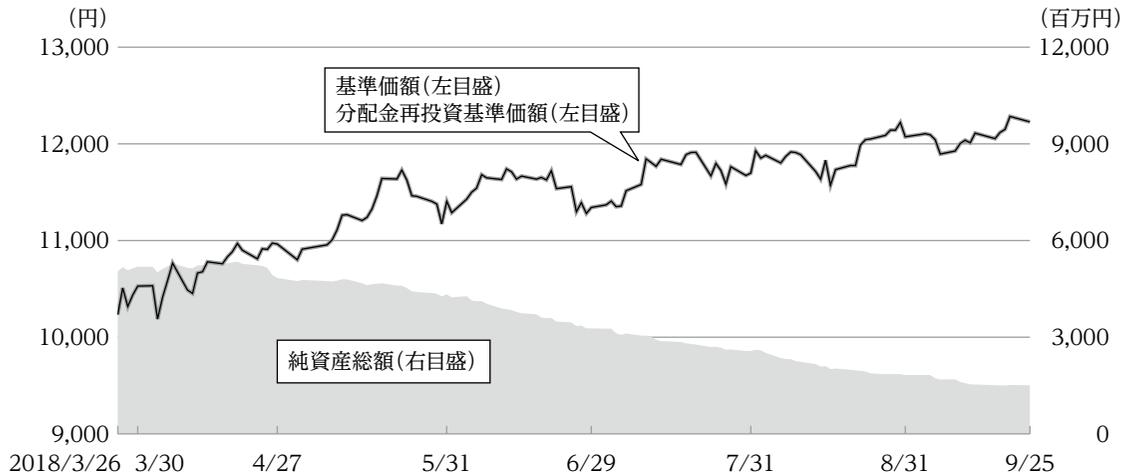
上昇要因

・保有する米国株式が上昇したこと。

Bコース (為替ヘッジなし)

基準価額等の推移について

(2018年3月27日～2018年9月25日)



| | |
|------|-------------------|
| 第3期首 | 10,233円 |
| 第3期末 | 12,227円 (既払分配金0円) |
| 騰落率 | 19.5% (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

当期の基準価額は上昇しました。

上昇要因

- ・保有する米国株式が上昇したこと。
- ・為替市場で円安米ドル高となったこと。

投資環境について

米国株式市場

米国株式市場は期を通して堅調となる場面が多く見られました。期初は良好な米国の経済指標や企業業績に対する期待を背景に上昇しました。その後は米中貿易摩擦に関する報道が相次ぐ中で景気減速懸念が強まり、株式市場は伸び悩む展開となりました。2018年8月に入るとトルコリラ急落が引き金となり新興国全般の通貨が下落したことで米国株式市場も調整する場面がありましたが、為替市場が落ち着きを取り戻すと再び上昇トレンドに転じました。9月に入るとトランプ大統領が中国に対して追加関税を課すと発言したことなどから再び貿易摩擦への懸念が生じ様子見姿勢が強まったことにより、株式市場は一定範囲の値動きの中で期末を迎えました。

ポートフォリオについて

イーストスプリング米国小型厳選バリュー株ファンドAコース(為替ヘッジあり)

イーストスプリング米国小型株式マザーファンドの受益証券への投資を通じて、主として米国の小型株に投資を行いました。なお実質組入外貨建資産に対しては、為替変動リスクの低減のために為替ヘッジを行いました。

為替市場

当期の米ドルは円に対して上昇しました。期初から2018年5月中旬にかけては米長期金利の上昇を背景に円安米ドル高が進みましたが、その後は調整し、一進一退の推移となりましたが、7月に入ると米中貿易摩擦への懸念が一旦落ち着きを見せたことや、連邦準備制度理事会(FRB)のパウエル議長が米国経済について楽観的な見通しを示したことなどで米ドルが買われました。8月にはトルコリラ急落を背景に円高米ドル安が進みましたが、9月に入ると新興国通貨の反発などを受けて再び円安米ドル高が進む流れとなりました。

イーストスプリング米国小型厳選バリュー株ファンドBコース(為替ヘッジなし)

イーストスプリング米国小型株式マザーファンドの受益証券への投資を通じて、主として米国の小型株に投資を行いました。

イーストスプリング米国小型厳選バリュー株ファンドAコース(為替ヘッジあり)／Bコース(為替ヘッジなし)

イーストスプリング米国小型株式マザーファンド

主として、米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。)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て運用を行いました。投資にあたっては、独自の調査により個別企業の財務内容等を分析し、小型株市場全体や過去の水準と比較して

割安と判断される銘柄を選択し、ポートフォリオ構築を行いました。

当期は家庭用品メーカーHelen of Troyや石油精製会社PBF Energyなどの保有がプラスとなった一方で、ヘルスケアサービス会社Magellan Health、靴メーカーSketchersなどの保有はマイナスとなりました。

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した。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)

Aコース(為替ヘッジあり)

| 項目 | 第3期 | |
|-----------|---------------------------|-------|
| | 2018年3月27日 ～2018年9月25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) | 1,523 |

Bコース(為替ヘッジなし)

| 項目 | 第3期 | |
|-----------|---------------------------|-------|
| | 2018年3月27日 ～2018年9月25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) | 2,227 |

(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

イーストスプリング米国小型厳選バリュー株ファンドAコース(為替ヘッジあり)

イーストスプリング米国小型株式マザーファンドの受益証券への投資を通じて、主として米国の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ます。なお実質組入外貨建資産に対しては、為替変動リスクの低減のために為替ヘッジを行います。

イーストスプリング米国小型厳選バリュー株ファンドBコース(為替ヘッジなし)

イーストスプリング米国小型株式マザーファンドの受益証券への投資を通じて、主として米国の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ます。

イーストスプリング米国小型株式マザーファンド

米国株式市場は、良好なファンダメンタルズなどを背景に堅調に推移すると考えています。法人税減税や規制緩和の進展なども株式市場を下支えすると思われます。また、企業の好業績や海外での利益の米国内還流を促すレパトリ減税の実施などにより自社株買い、M&A、設備投資などが増加する可能性が高いと思われます。投資プロセスにおいては個別企業の分析が重要と考えており、中長期的視点から投資銘柄を決定し、最適なポートフォリオ構築を目指しています。今後も個別企業の業績に注目し、忍耐力をもって長期的な投資機会を追求してまいります。

1万口当たりの費用明細

(2018年3月27日～2018年9月25日)

| 項目 | 当期 | | 項目の概要 |
|-------------|-------|---------|--|
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 111円 | 1.002% | (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、11,057円です。 |
| (投信会社) | (54) | (0.487) | 委託した資金の運用の対価 |
| (販売会社) | (54) | (0.487) | 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) | (3) | (0.027) | 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 | 8 | 0.077 | (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) | (8) | (0.075) | 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 |
| (投資信託証券) | (0) | (0.002) | |
| (c) その他費用 | 12 | 0.111 | (c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| (保管費用) | (4) | (0.040) | 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) | (7) | (0.060) | 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) | 目論見書および運用報告書等の法定開示書類の作成費用等 |
| (その他1) | (0) | (0.000) | 信託管理事務に係る手数料 |
| (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 | 131 | 1.190 | |

(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。

イーストスプリング米国小型厳選バリュー株ファンドAコース(為替ヘッジあり)

売買及び取引の状況

(2018年3月27日から2018年9月25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米国小型株式マザーファンド | 千口 7,338 | 千円 8,214 | 千口 55,397 | 千円 64,250 |

(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3月27日から2018年9月25日まで)

| 項 目 | 当 期 |
|-------------------------------|------------------------|
| | イーストスプリング米国小型株式マザーファンド |
| (a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額 | 4,522,219千円 |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 3,629,617千円 |
| (c) 売 買 高 比 率(a)/(b) | 1.24 |

(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3月27日から2018年9月25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

(2018年9月25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米国小型株式マザーファンド | 千口 79,980 | 千口 31,921 | 千円 40,160 |

(注1) 単位未満は切捨てです。

(注2) マザーファンドの2018年9月25日現在の受益権総口数は、1,258,118千口です。

投資信託財産の構成

(2018年9月25日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-------------------------|---------------------|
| | 評 価 額 比 率 |
| イーストスプリング米国小型株式マザーファンド | 千円 40,160 98.7 % |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 511 1.3 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 40,671 100.0 |

(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米国小型株式マザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産(1,478,144千円)の投資信託財産総額(1,586,939千円)に対する比率は93.1%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、2018年9月25日における邦貨換算レートは、1米ドル=113.02円です。

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2018年9月25日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|---------------------------------|--------------|
| (A) 資 産 | 131,028,017円 |
| イーストスプリング米国小型株式 マザーファンド(評価額) | 40,160,694 |
| 未 収 入 金 | 90,867,323 |
| (B) 負 債 | 91,740,982 |
| 未 払 金 | 91,096,138 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 600,085 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 44,759 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A-B) | 39,287,035 |
| 元 本 | 34,167,119 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 5,119,916 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 34,167,119口 |
| 1 万 口 当 ち 基 準 価 額 (C/D) | 11,498円 |

(注1) 元本の状況

| | |
|-----------|-------------|
| 期首元本額 | 85,404,297円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,727,728円 |
| 期中一部解約元本額 | 52,964,906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2018年3月27日 至2018年9月25日)

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------|-------------|
| (A) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 3,991,818円 |
| 売 買 益 | 21,344,901 |
| 売 買 損 | △17,353,083 |
| (B) 信 託 報 酬 等 | △ 644,844 |
| (C) 当 期 損 益 金 (A+B) | 3,346,974 |
| (D) 前 期 繰 越 損 益 金 | 1,713,084 |
| (E) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 59,858 |
| (配 当 等 相 当 額) | (142,790) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△ 82,932) |
| (F) 計 (C+D+E) | 5,119,916 |
| (G) 収 益 分 配 金 | 0 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (F+G) | 5,119,916 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 59,858 |
| (配 当 等 相 当 額) | (145,768) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△ 85,910) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 5,060,058 |

(注1) 損益の状況の中で(A)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(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(210,360円)、費用控除後の有価証券売買等損益(2,820,038円)、信託約款に規定する収益調整金(145,768円)および分配準備積立金(2,029,660円)より、分配対象収益は5,205,826円(10,000口当たり1,523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。

1万口当たりの費用明細

(2018年3月27日～2018年9月25日)

| 項目 | 当期 | | 項目の概要 |
|-------------|--------|---------|--|
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 114円 | 1.002% | (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、11,334円です。 |
| (投信会社) | (55) | (0.487) | 委託した資金の運用の対価 |
| (販売会社) | (55) | (0.487) | 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) | (3) | (0.027) | 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 | 8 | 0.073 | (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) | (8) | (0.071) | 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 |
| (投資信託証券) | (0) | (0.002) | |
| (c) その他費用 | 6 | 0.055 | (c) その他費用 = 期中のその他費用 ÷ 期中の平均受益権口数 |
| (保管費用) | (4) | (0.033) | 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) | (1) | (0.006) | 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) | (2) | (0.016) | 目論見書および運用報告書等の法定開示書類の作成費用等 |
| (その他1) | (0) | (0.000) | 信託管理事務に係る手数料 |
| (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 | 128 | 1.130 | |

(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3月27日から2018年9月25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米国小型株式マザーファンド | 千口 63 | 千円 69 | 千口 3,669,992 | 千円 4,311,499 |

(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3月27日から2018年9月25日まで)

| 項 目 | 当 期 |
|-------------------------------|------------------------|
| | イーストスプリング米国小型株式マザーファンド |
| (a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額 | 4,522,219千円 |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 3,629,617千円 |
| (c) 売 買 高 比 率(a)/(b) | 1.24 |

(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3月27日から2018年9月25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

(2018年9月25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米国小型株式マザーファンド | 千口 4,896,125 | 千口 1,226,196 | 千円 1,542,678 |

(注1) 単位未満は切捨てです。

(注2) マザーファンドの2018年9月25日現在の受益権総口数は、1,258,118千口です。

投資信託財産の構成

(2018年9月25日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| イーストスプリング米国小型株式マザーファンド | 千円 1,542,678 | % 99.7 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 4,275 | 0.3 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 1,546,953 | 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米国小型株式マザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産(1,478,144千円)の投資信託財産総額(1,586,939千円)に対する比率は93.1%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、2018年9月25日における邦貨換算レートは、1米ドル=113.02円です。

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2018年9月25日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------------------|----------------|
| (A) 資 産 | 1,546,953,431円 |
| コール・ローン等 | 243,291 |
| イーストスプリング米国小型株式マザーファンド(評価額) | 1,542,678,039 |
| 未 収 入 金 | 4,032,101 |
| (B) 負 債 | 39,932,804 |
| 未 払 解 約 金 | 4,275,392 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 34,833,102 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 824,310 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A-B) | 1,507,020,627 |
| 元 本 | 1,232,494,653 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 274,525,974 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 1,232,494,653口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 12,227円 |

(注1) 元本の状況

| | |
|-----------|----------------|
| 期首元本額 | 4,927,933,160円 |
| 期中追加設定元本額 | 119,604,435円 |
| 期中一部解約元本額 | 3,815,042,942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2018年3月27日 至2018年9月25日)

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------|---------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | △ 724円 |
| 支 払 利 息 | △ 724 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 274,273,825 |
| 売 買 益 | 532,646,886 |
| 売 買 損 | △258,373,061 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 35,657,488 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 238,615,613 |
| (E) 前期繰越損益金 | △ 7,672,841 |
| (F) 追加信託差損益金 | 43,583,202 |
| (配当等相当額) | (5,945,272) |
| (売買損益相当額) | (37,637,930) |
| (G) 計 (D+E+F) | 274,525,974 |
| (H) 収 益 分 配 金 | 0 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 274,525,974 |
| 追加信託差損益金 | 43,583,202 |
| (配当等相当額) | (6,139,890) |
| (売買損益相当額) | (37,443,312) |
| 分配準備積立金 | 230,942,772 |

(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(8,194,127円)、費用控除後の有価証券売買等損益(139,037,404円)、信託約款に規定する収益調整金(43,583,202円)および分配準備積立金(83,711,241円)より、分配対象収益は274,525,974円(10,000口当たり2,227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米国小型株式マザーファンド 運用報告書

第3期（決算日：2018年9月25日）
（計算期間：2018年3月27日～2018年9月25日）

「イーストスプリング米国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 | 主として米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。）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て運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 米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。）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割合には制限を設けません。 |

設定以来の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | 株式 組入比率 | 投資信託証券 組入比率 | 純資産 総額 |
|---------------------|-------------|-----------|------------|----------------|------------|
| | | 期中 騰落率 | | | |
| (設定日) 2017年4月20日 | 円 10,000 | % — | % — | % — | 百万円 828 |
| 1期(2017年9月25日) | 11,079 | 10.8 | 96.3 | 1.4 | 7,273 |
| 2期(2018年3月26日) | 10,432 | △ 5.8 | 94.9 | 1.5 | 5,190 |
| 3期(2018年9月25日) | 12,581 | 20.6 | 91.4 | 1.5 | 1,582 |

(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

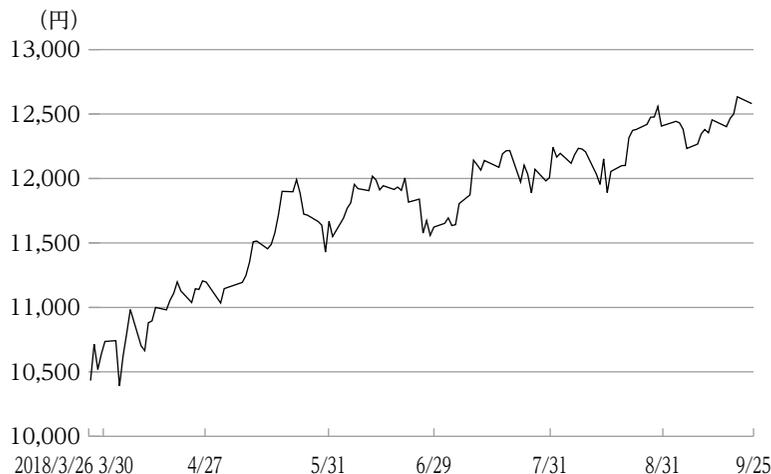
| 年月日 | 基準価額 | | 株式 組入比率 | 投資信託証券 組入比率 |
|--------------------|-------------|--------|------------|----------------|
| | | 騰落率 | | |
| (期首) 2018年3月26日 | 円 10,432 | % — | % 94.9 | % 1.5 |
| 3月末 | 10,736 | 2.9 | 95.1 | 1.5 |
| 4月末 | 11,196 | 7.3 | 102.0 | 1.5 |
| 5月末 | 11,668 | 11.8 | 96.0 | 1.5 |
| 6月末 | 11,623 | 11.4 | 94.3 | 1.5 |
| 7月末 | 12,006 | 15.1 | 96.7 | 1.6 |
| 8月末 | 12,407 | 18.9 | 94.1 | 1.6 |
| (期末) 2018年9月25日 | 12,581 | 20.6 | 91.4 | 1.5 |

(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3月27日～2018年9月25日)



| | |
|------|---------|
| 第3期首 | 10,432円 |
| 第3期末 | 12,581円 |
| 騰落率 | 20.6% |

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

- ・保有する米国株式が上昇したこと。
- ・為替市場で円安米ドル高となったこと。

投資環境について

米国株式市場

米国株式市場は期を通して堅調となる場面が多く見られました。期初は良好な米国の経済指標や企業業績に対する期待を背景に上昇しました。その後は米中貿易摩擦に関する報道が相次ぐ中で景気減速懸念が強まり、株式市場は伸び悩む展開となりました。2018年8月に入るとトルコリラ急落が引き金となり新興国全般の通貨

が下落したことで米国株式市場も調整する場面がありましたが、為替市場が落ち着きを取り戻すと再び上昇トレンドに転じました。9月に入るとトランプ大統領が中国に対して追加関税を課すと発言したことなどから再び貿易摩擦への懸念が生じ様子見姿勢が強まったことにより、株式市場は一定範囲の値動きの中で期末を迎えました。

為替市場

当期の米ドルは円に対して上昇しました。

期初から2018年5月中旬にかけては米長期金利の上昇を背景に円安米ドル高が進みました。その後は調整し、一進一退の推移となりましたが、7月に入ると米中貿易摩擦への懸念が一旦落ち着きを見せたことや、連邦準備制度理

事会（FRB）のパウエル議長が米国経済について楽観的な見通しを示したことなどで米ドルが買われました。8月にはトルコリラ急落を背景に円高米ドル安が進みましたが、9月に入ると新興国通貨の反発などを受けて再び円安米ドル高が進む流れとなりました。

ポートフォリオについて

主として、米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。）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て運用を行いました。投資にあたっては、独自の調査により個別企業の財務内容等を分析し、小型株市場全体や過去の水準と比較して割安と判断される銘柄を選択し、ポートフォリオ構築

を行いました。

当期は家庭用品メーカーHelen of Troyや石油精製会社PBF Energyなどの保有がプラスとなった一方で、ヘルスケアサービス会社Magellan Health、靴メーカーSketchersなどの保有がマイナスとなりました。

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

米国株式市場は、良好なファンダメンタルズなどを背景に堅調に推移すると考えています。法人税減税や規制緩和の進展なども株式市場を下支えすると思われる。また、企業の好業績や海外での利益の米国内還流を促すレパトリ減税の実施などにより自社株買い、M&A、設備投資などが増加する可能性が高いと思われる。

投資プロセスにおいては個別企業の分析が重要と考えており、中長期的視点から投資銘柄を決定し、最適なポートフォリオ構築を目指しています。今後も個別企業の業績に注目し、忍耐力をもって長期的な投資機会を追求してまいります。

1万口当たりの費用明細

(2018年3月27日～2018年9月25日)

| 項目 | 当期 | | 項目の概要 |
|-------------|------|---------|--|
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 売買委託手数料 | 8円 | 0.072% | (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、11,606円です。 |
| (株式) | (8) | (0.071) | 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 |
| (投資信託証券) | (0) | (0.002) | |
| (b) その他費用 | 4 | 0.033 | (b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| (保管費用) | (4) | (0.033) | 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 |
| (その他1) | (0) | (0.000) | 信託管理事務に係る手数料 |
| (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 | 12 | 0.105 | |

(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3月27日から2018年9月25日まで)

(1) 株式

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|----|---------|-----------|---------------|--------------|----------------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 外国 | ア メ リ カ | 百株 581 | 千米ドル 1,430 | 百株 13,105 | 千米ドル 39,564 |

(注1) 金額は受渡し代金です。

(注2) 単位未満は切捨てです。

(2) 投資信託証券

| | | | 買 付 | | 売 付 | |
|----|---------|-------------------------|---------|-----------|----------|-------------|
| | | | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 外国 | ア メ リ カ | KITE REALTY GROUP TRUST | 千口 - | 千米ドル - | 千口 37 | 千米ドル 606 |

(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(2018年3月27日から2018年9月25日まで)

| 項 目 | 当 期 |
|-------------------------------|-------------|
| (a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額 | 4,522,219千円 |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 3,629,617千円 |
| (c) 売 買 高 比 率(a)／(b) | 1.24 |

(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3月27日から2018年9月25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

(2018年9月25日現在)

(1) 外国株式

上場、登録株式

組入有価証券明細表

| 銘 柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|------------------------------|---------|-----|-------|--------|--------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| AEROJET ROCKETDYNE HOLDINGS | 278 | 58 | 191 | 21,671 | 資本財 |
| ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC | 190 | 69 | 200 | 22,669 | 素材 |
| AMERICAN AXLE & MFG HOLDINGS | 835 | 177 | 324 | 36,728 | 自動車・自動車部品 |
| APOGEE ENTERPRISES INC | 240 | 53 | 225 | 25,457 | 資本財 |
| AXOS FINANCIAL INC | 303 | 72 | 255 | 28,871 | 銀行 |
| BANC OF CALIFORNIA INC | 515 | 166 | 319 | 36,115 | 銀行 |
| BELDEN INC | 164 | 46 | 329 | 37,193 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| BENCHMARK ELECTRONICS INC | 245 | 79 | 201 | 22,767 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CSG SYSTEMS INTL INC | 168 | 47 | 195 | 22,108 | ソフトウェア・サービス |
| CACI INTERNATIONAL INC -CL A | 82 | 17 | 320 | 36,198 | ソフトウェア・サービス |
| COTT CORPORATION | 406 | 141 | 212 | 23,999 | 食品・飲料・タバコ |
| HELEN OF TROY LTD | 144 | 25 | 326 | 36,844 | 耐久消費財・アパレル |
| ELECTRONICS FOR IMAGING | — | 38 | 131 | 14,868 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| ESTERLINE TECHNOLOGIES CORP | 80 | 19 | 168 | 19,057 | 資本財 |
| FCB FINANCIAL HOLDINGS-CL A | 179 | 54 | 264 | 29,874 | 銀行 |
| GATX CORP | 153 | 32 | 276 | 31,193 | 資本財 |
| HELIX ENERGY SOLUTIONS GROUP | 1,665 | 281 | 273 | 30,901 | エネルギー |
| HILL-ROM HOLDINGS INC | 60 | 15 | 137 | 15,498 | ヘルスケア機器・サービス |
| INDEPENDENT BANK CORP/MA | 168 | 37 | 319 | 36,130 | 銀行 |
| INGREDION INC | 39 | 13 | 133 | 15,099 | 食品・飲料・タバコ |
| INTEGER HOLDINGS CORP | 175 | 31 | 258 | 29,220 | ヘルスケア機器・サービス |
| KENAMETAL INC | 288 | 73 | 326 | 36,912 | 資本財 |

| 銘 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | | | 業 種 等 | |
|------------------------------|---------------|--------|-------|--------|--------------------|--|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | | |
| LIFEPOINT HEALTH INC | 245 | 51 | 328 | 37,177 | ヘルスケア機器・サービス | |
| MAGELLAN HEALTH INC | 116 | 45 | 326 | 36,898 | ヘルスケア機器・サービス | |
| MEREDITH CORP | 175 | 49 | 257 | 29,046 | メディア | |
| OLIN CORP | 226 | 85 | 234 | 26,514 | 素材 | |
| OWENS & MINOR INC | 593 | 144 | 242 | 27,374 | ヘルスケア機器・サービス | |
| PBF ENERGY INC-CLASS A | 400 | 64 | 312 | 35,283 | エネルギー | |
| PNM RESOURCES INC | 275 | 68 | 267 | 30,203 | 公益事業 | |
| PATTERSON-UTI ENERGY INC | 478 | 132 | 233 | 26,405 | エネルギー | |
| PENSKE AUTOMOTIVE GROUP INC | 269 | 63 | 312 | 35,302 | 小売 | |
| PHOTRONICS INC | 714 | 138 | 133 | 15,128 | 半導体・半導体製造装置 | |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA | 33 | 9 | 132 | 14,938 | 保険 | |
| RELIANCE STEEL & ALUMINUM | 53 | 15 | 128 | 14,503 | 素材 | |
| RENASANT CORP | 281 | 74 | 318 | 36,013 | 銀行 | |
| SEMTECH CORP | 303 | 54 | 307 | 34,726 | 半導体・半導体製造装置 | |
| SKECHERS USA INC-CL A | 217 | 109 | 295 | 33,384 | 耐久消費財・アパレル | |
| SKYWEST INC | 210 | 55 | 317 | 35,897 | 運輸 | |
| STEEL DYNAMICS INC | 102 | — | — | — | 素材 | |
| STEELCASE INC-CL A | 741 | 130 | 244 | 27,622 | 商業・専門サービス | |
| STERLING BANCORP/DE | 381 | 102 | 232 | 26,226 | 銀行 | |
| SUPERIOR ENERGY SERVICES INC | 1,314 | 341 | 335 | 37,884 | エネルギー | |
| SUPERIOR INDUSTRIES INTL | 488 | 73 | 129 | 14,685 | 自動車・自動車部品 | |
| SYNNEX CORP | 71 | 24 | 220 | 24,968 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| TCF FINANCIAL CORP | 440 | 114 | 283 | 32,043 | 銀行 | |
| TERADYNE INC | 110 | 43 | 165 | 18,686 | 半導体・半導体製造装置 | |
| TEREX CORP | 321 | 77 | 316 | 35,784 | 資本財 | |
| TOWER INTERNATIONAL INC | 370 | 82 | 255 | 28,868 | 自動車・自動車部品 | |
| TRIUMPH GROUP INC | 469 | 142 | 322 | 36,430 | 資本財 | |
| TUPPERWARE BRANDS CORP | 245 | 80 | 264 | 29,945 | 耐久消費財・アパレル | |
| VERINT SYSTEMS INC | 254 | 55 | 271 | 30,707 | ソフトウェア・サービス | |
| JANUS HENDERSON GROUP PLC | 293 | 79 | 220 | 24,973 | 各種金融 | |
| 合 計 | 株 数 ・ 金 額 | 16,564 | 4,040 | 12,803 | 1,447,010 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 51 | 51 | — | <91.4%> | |

(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) 邦貨換算金額欄の〈 〉内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率です。

(注3) 株数・評価額の単位未満は切捨てです。

(注4) 業種等欄の業種名は期末時点のものです。

(2) 外国投資信託証券

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 | | | 末 | |
|-----------------------------------|------------------|----------|-------------|--------------|------------------|--------|
| | | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | | 邦貨換算金額 |
| (アメリカ) KITE REALTY GROUP TRUST | 千口 49 | 千口 12 | 千米ドル 205 | 千円 23,169 | % 1.5 | |
| 合 計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 49 1 | 12 1 | 205 - | 23,169 <1.5%> | |

(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) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(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

(2018年9月25日現在)

| 項 目 | 当 期 | |
|-------------------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 株 式 | 千円 1,447,010 | % 91.2 |
| 投 資 証 券 | 23,169 | 1.5 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 116,760 | 7.3 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 1,586,939 | 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(1,478,144千円)の投資信託財産総額(1,586,939千円)に対する比率は93.1%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、2018年9月25日における邦貨換算レートは1米ドル=113.02円です。

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2018年9月25日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|----------------------|----------------|
| (A) 資 産 | 1,586,939,883円 |
| コール・ローン等 株 式(評価額) | 59,563,805 |
| 投 資 証 券(評価額) | 1,447,010,317 |
| 未 収 入 金 | 23,169,326 |
| 未 収 配 当 金 | 55,412,505 |
| (B) 負 債 | 1,783,930 |
| 未 払 解 約 金 | 4,043,219 |
| 未 払 利 息 | 4,042,901 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 318 |
| 元 本 | 1,582,896,664 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 1,258,118,380 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 324,778,284 |
| 1 万口当たり基準価額(C/D) | 1,258,118,380口 |
| | 12,581円 |

(注1) 元本の状況

| | |
|---|----------------|
| 期首元本額 | 4,976,106,002円 |
| 期中追加設定元本額 | 7,402,198円 |
| 期中一部解約元本額 | 3,725,389,820円 |
| 当期末における元本の内訳 | |
| イーストスプリング米国小型厳選バリューストックファンドBコース (為替ヘッジなし) | 1,226,196,677円 |
| イーストスプリング米国小型厳選バリューストックファンドAコース (為替ヘッジあり) | 31,921,703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2018年3月27日 至2018年9月25日)

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------|--------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 23,333,174円 |
| 受 取 配 当 金 | 23,349,023 |
| 受 取 利 息 | 24,131 |
| そ の 他 収 益 金 | 17,932 |
| 支 払 利 息 | △ 57,912 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 737,311,801 |
| 売 買 益 | 902,921,112 |
| 売 買 損 | △165,609,311 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 1,259,775 |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | 759,385,200 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 214,871,882 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 881,780 |
| (G) 解 約 差 損 益 金 | △650,360,578 |
| (H) 計 (D+E+F+G) | 324,778,284 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(H) | 324,778,284 |

(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。

お知らせ

該当事項はありません。