

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"><li>・株式への実質投資割合には、制限を設けません。</li><li>・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。</li><li>・外貨建資産への投資は、行いません。</li></ul>
	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"><li>・株式への投資割合には、制限を設けません。</li><li>・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。</li><li>・外貨建資産への投資は、行いません。</li></ul>
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9期（決算日 2023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)	騰落率		株式 組入比率	純資産 総額
		税込 分配金	期中 騰落率		
5期 (2019年7月29日)	円 13,363	円 0	% △18.7	% 99.4	百万円 3,668
6期 (2020年7月27日)	11,777	0	△11.9	99.0	2,463
7期 (2021年7月27日)	17,436	0	48.1	98.8	3,100
8期 (2022年7月27日)	18,046	0	3.5	98.3	2,834
9期 (2023年7月27日)	22,499	200	25.8	99.1	3,055

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 純資産総額の単位未満は切捨てです。

(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) 2022年7月27日	円 18,046	% —	% 98.3	
7月末	17,919	△ 0.7	98.3	
8月末	18,195	0.8	98.7	
9月末	17,603	△ 2.5	98.0	
10月末	18,211	0.9	98.2	
11月末	18,908	4.8	98.8	
12月末	18,363	1.8	99.5	
2023年1月末	19,198	6.4	98.6	
2月末	19,899	10.3	98.6	
3月末	19,981	10.7	97.5	
4月末	20,914	15.9	97.1	
5月末	20,665	14.5	97.0	
6月末	22,095	22.4	99.1	
(期末) 2023年7月27日	22,699	25.8	99.1	

(注1) 期末基準価額は分配金込み、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

(2022年7月28日～2023年7月27日)



第9期首	18,046円
第9期末	22,499円 (既払分配金200円)
騰落率	25.8% (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

・保有している株式が上昇したこと。

## 投資環境について

### 日本株式市場

期初から米国の利上げペースに対する思惑と米経済後退懸念が台頭する中、インフレや雇用など、米経済指標に一喜一憂する展開が続き、日本株式市場は2023年1月までレンジ圏で推移しました。2月以降は円安や中国からの渡航者に対する水際対策の緩和などを受けて、株価は期末まで上昇基調で推移しまし

た。低PBR（株価純資産倍率）や高配当利回りなどの割安株への買いや、外国人投資家の資金流入などが目立ちました。日銀のイールド・カーブ・コントロールの早期修正観測など金融政策の見直し懸念が高まる中、日銀が金融政策の維持を表明したことも株価上昇を後押しする要因となりました。

## 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。

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、良品計画やリンテックなどの株式を新たに組み入れました。一方で、神戸製鋼所、りらいあコミュニケーションズなどの株式を全売却しました。

パフォーマンスは、神戸製鋼所やNOKなどの保有がプラスに寄与しました。

## ベンチマークとの差異について

当ファンドにおいては、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9期	
	2022年7月28日 ～2023年7月27日	
当期分配金	(円)	200
（対基準価額比率）	(%)	0.881
当期の収益	(円)	200
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	12,499

(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

これまで市場が短期的な視点やテーマに基づいた行動をとってきたことによって、依然として多くの銘柄の株価は企業の本来の価値を正確に反映していないとみており、長期投資家にとっては投資機会を見出すことが可能だと思われます。当マザーファンドは企業の長期的な収益をけん引するドライバーは何であるかを分析し、さらに現在の株価がどのような懸念を織り込んでいるのかを十分に理解したうえで判断します。市場が短期的な視点

で投資行動を起こす中、我々は長期的な観点から企業業績のトレンドに着目していきます。

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。

多くの日本企業は、これまでの非効率な投資を減らし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、さらに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加、報酬委員会の導入など、コーポレートガバナンス改革に対する企業側の姿勢が改善している点も着目しています。このように日本企業の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勝ち抜ける高い競争力につながると考えています。

## 1 万口当たりの費用明細

(2022年7月28日～2023年7月27日)

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	372円	1.925%	(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、19,329円です。
(投信会社)	(191)	(0.990)	委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(170)	(0.880)	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)	( 11)	(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	18	0.091	(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)	( 18)	(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
(c) その他費用	11	0.057	(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)	( 6)	(0.032)	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)	( 5)	(0.025)	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	401	2.073	

(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。

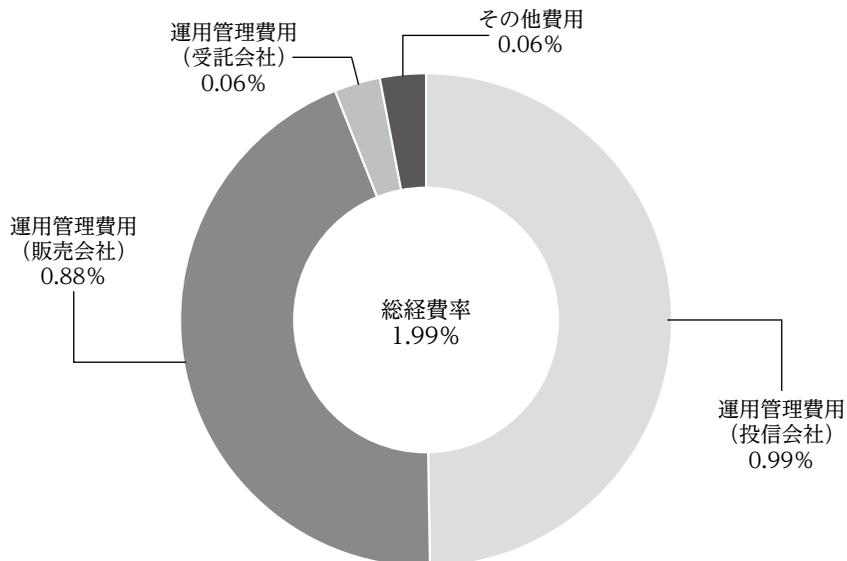
(注3) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額 (円未満の端数を含む) を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(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1.99%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

(2022年7月28日から2023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 32,320	千円 78,000	千口 239,083	千円 568,000

(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 (2022年7月28日から2023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	3,392,408千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	2,826,292千円
(c) 売 買 高 比 率(a) / (b)	1.20

(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

(2022年7月28日から2023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

(2023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 1,335,142	千口 1,128,379	千円 3,047,414

(注1) 単位未満は切捨てです。

(注2) マザーファンドの2023年7月27日現在の受益権総口数は、1,128,379千口です。

## 投資信託財産の構成

(2023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 3,047,414	% 97.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	71,259	2.3
投 資 信 託 財 産 総 額	3,118,673	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

(2023年7月27日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	3,118,673,298円
コール・ローン等	71,258,578
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)	3,047,414,720
(B) 負 債	62,723,329
未払収益分配金	27,164,907
未払解約金	6,181,783
未払信託報酬	28,440,221
未払利息	208
その他未払費用	936,210
(C) 純資産総額(A-B)	3,055,949,969
元 本	1,358,245,385
次期繰越損益金	1,697,704,584
(D) 受益権総口数	1,358,245,385口
1万口当たり基準価額(C/D)	22,499円

- (注1) 元本の状況  
 期首元本額 1,570,793,104円  
 期中追加設定元本額 91,781,268円  
 期中一部解約元本額 304,328,987円
- (注2) 1口当たり純資産額は2,2499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2022年7月28日 至2023年7月27日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 20,206円
支 払 利 息	△ 20,206
(B) 有価証券売買損益	670,681,994
売 買 益	729,010,975
売 買 損	△ 58,328,981
(C) 信託報酬等	△ 57,151,989
(D) 当期損益金(A+B+C)	613,509,799
(E) 前期繰越損益金	725,026,287
(F) 追加信託差損益金	386,333,405
(配当等相当額)	( 209,619,024)
(売買損益相当額)	( 176,714,381)
(G) 計 (D+E+F)	1,724,869,491
(H) 収益分配金	△ 27,164,907
次期繰越損益金(G+H)	1,697,704,584
追加信託差損益金	386,333,405
(配当等相当額)	( 210,922,143)
(売買損益相当額)	( 175,411,262)
分配準備積立金	1,311,371,179

- (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(80,645,251円)、費用控除後の有価証券売買等損益(532,864,548円)、信託約款に規定する収益調整金(386,333,405円)および分配準備積立金(725,026,287円)より、分配対象収益は1,724,869,491円(10,000口当たり12,699円)であり、うち27,164,907円(10,000口当たり200円)を分配金額としております。

## 分配金のお知らせ

決 算 期	第 9 期
1 万口当たり分配金（税引前）	200円

- ◇分配金のお支払いは決算日から起算して5営業日までに開始いたします。
- ◇分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は全額普通分配金となり、分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合は、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの部分が普通分配金となります。
- ◇元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、個別元本から元本払戻金（特別分配金）を控除した額がその後の新たな個別元本となります。
- ◇個人の受益者については、原則として20.315%の税率で源泉徴収（申告不要）されます。
- ◇「自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合、分配金は、税金を差引いた後、決算日の基準価額に基づいて自動的に無手数料で再投資いたしました。

※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。

※少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。

## 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9期（決算日：2023年7月27日）  
（計算期間：2022年7月28日～2023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9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"><li>・株式への投資割合には、制限を設けません。</li><li>・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。</li><li>・外貨建資産への投資は、行いません。</li></ul>

## 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		
5期(2019年7月29日)	円 14,690	% △17.0	% 99.6	百万円 5,561
6期(2020年7月27日)	13,183	△10.3	99.3	2,455
7期(2021年7月27日)	19,913	51.1	99.6	3,076
8期(2022年7月27日)	21,036	5.6	99.2	2,808
9期(2023年7月27日)	27,007	28.4	99.4	3,047

(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) 2022年7月27日	円 21,036	% —	% 99.2
7月末	20,889	△0.7	99.2
8月末	21,252	1.0	99.4
9月末	20,592	△2.1	98.1
10月末	21,339	1.4	98.4
11月末	22,193	5.5	98.6
12月末	21,590	2.6	99.2
2023年1月末	22,612	7.5	99.3
2月末	23,478	11.6	99.2
3月末	23,614	12.3	98.1
4月末	24,762	17.7	97.7
5月末	24,507	16.5	97.5
6月末	26,245	24.8	98.7
(期末) 2023年7月27日	27,007	28.4	99.4

(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

(2022年7月28日～2023年7月27日)



第9期首	21,036円
第9期末	27,007円
騰落率	28.4%

### 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



・保有している株式が上昇したこと。

### 投資環境について

#### 日本株式市場

期初から米国の利上げペースに対する思惑と米経済後退懸念が台頭する中、インフレや雇用など、米経済指標に一喜一憂する展開が続き、日本株式市場は2023年1月までレンジ圏で推移しました。2月以降は円安や中国からの渡航者に対する水際対策の緩和などを受けて、株価は期末まで上昇基調で推移しました。低PBR

(株価純資産倍率)や高配当利回りなどの割安株への買いや、外国人投資家の資金流入などが目立ちました。日銀のイールド・カーブ・コントロールの早期修正観測など金融政策の見直し懸念が高まる中、日銀が金融政策の維持を表明したことも株価上昇を後押しする要因となりました。

## 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。

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、良品計画やリンテックなどの株式を新たに組み入れました。一方で、

神戸製鋼所、りらいあコミュニケーションズなどの株式を全売却しました。

パフォーマンスは、神戸製鋼所やNOKなどの保有がプラスに寄与しました。

## ベンチマークとの差異について

当ファンドにおいては、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

これまで市場が短期的な視点やテーマに基づいた行動をとってきたことによって、依然として多くの銘柄の株価は企業の本来の価値を正確に反映していないとみており、長期投資家にとっては投資機会を見い出すことが可能だと思われれます。当マザーファンドは企業の長期的な収益をけん引するドライバーは何であるかを分析し、さらに現在の株価がどのような懸念を織り込んでいるのかを十分に理解したうえで判断します。市場が短期的な視点で投資行動を起こす中、我々は長期的な観点から企業業績のトレンドに着目していきます。

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。

多くの日本企業は、これまでの非効率な投資を減らし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、さらに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加、報酬委員会の導入など、コーポレートガバナンス改革に対する企業側の姿勢が改善している点も着目しています。このように日本企業の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勝ち抜ける高い競争力につながると考えています。

## 1 万口当たりの費用明細

(2022年7月28日～2023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 (株式)	21円 (21)	0.092% (0.092)	(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、22,756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	21	0.092	

(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

(2022年7月28日から2023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
		1,114 ( 36)	1,501,666 ( -)	1,383	1,890,741

(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 (2022年7月28日から2023年7月27日まで)

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	3,392,408千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	2,826,292千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	1.20

(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

(2022年7月28日から2023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

(2023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 評 価 額
	株 数	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千株	千円	
<b>水産・農林業 (0.7%)</b>					
ニッスイ	—	32.5		21,775	
<b>建設業 (7.5%)</b>					
高松コンストラクショングループ	28.2	28.5		76,351	
オリエンタル白石	273.8	258.2		79,783	
大成建設	—	13.5		71,469	
大東建託	6.1	—		—	
<b>食料品 (2.0%)</b>					
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	37.1	36.7		60,793	
<b>繊維製品 (3.4%)</b>					
帝人	42.8	50.7		76,024	
マツオカコーポレーション	24.9	21.5		27,584	
<b>化学 (12.5%)</b>					
住友化学	116.6	109.3		48,321	
東ソー	—	10		18,140	
ステラ ケミファ	—	25.1		77,308	
大日精化工業	—	12		26,832	
カネカ	18.6	16.2		67,116	
ダイセル	78.2	—		—	
UBE	21.8	10.9		27,849	
大日本塗料	39.5	33.3		31,701	
D I C	29.1	31.1		82,072	
<b>医薬品 (0.6%)</b>					
参天製薬	—	14.4		17,438	
<b>ゴム製品 (4.6%)</b>					
住友ゴム工業	49	51.4		73,219	
ニッタ	26	20.8		66,768	
<b>鉄鋼 (—%)</b>					
神戸製鋼所	79	—		—	
<b>非鉄金属 (2.3%)</b>					
古河電気工業	28.3	25.3		68,449	
<b>金属製品 (3.4%)</b>					
SUMCO	—	14		28,588	
三協立山	31.9	—		—	
日本発條	77.2	65.4		72,888	
<b>機械 (6.3%)</b>					
日本製鋼所	—	10.2		29,957	
サトーホールディングス	36.9	26.1		51,417	
住友重機械工業	27	21.1		72,816	
椿本チエイン	19.1	9.5		36,432	
<b>電気機器 (12.9%)</b>					
ブラザー工業	—	31.9		71,137	
明電舎	25.6	42.4		86,284	
沖電気工業	80.2	93.5		82,654	
エレコム	—	44.5		67,417	
日本航空電子工業	10.8	—		—	
スタンレー電気	20.7	—		—	
リコー	76.6	65.9		83,034	
<b>輸送用機器 (6.2%)</b>					
川崎重工業	28.8	—		—	
三菱自動車工業	115.2	60.8		34,242	

銘柄	期首(前期末)		当 期		末 評 価 額
	株 数	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千株	千円	
エフテック	67.8	28.1		25,823	
NOK	68.4	25.4		53,086	
マツダ	49.1	24.4		34,477	
テイ・エス テック	33.5	22		39,721	
<b>その他製品 (5.1%)</b>					
フジールインターナショナル	44.5	46.5		71,982	
リンテック	—	35.8		83,163	
<b>電気・ガス業 (2.6%)</b>					
メタウオーター	—	43.4		79,552	
<b>陸運業 (2.6%)</b>					
ハマキョウレックス	26	20.2		77,871	
<b>倉庫・運輸関連業 (—%)</b>					
上組	10.2	—		—	
<b>小売業 (6.2%)</b>					
ドール・日レスホールディングス	38.7	8.3		18,251	
良品計画	—	42.3		75,991	
エイチ・ツー・オー リテイリング	82	—		—	
イズミ	—	18.8		66,476	
サンドラッグ	3.5	6.2		25,835	
<b>銀行業 (6.3%)</b>					
めぶきフィナンシャルグループ	—	151.8		53,570	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	156.4	154.4		92,485	
SBI新生銀行	15.2	—		—	
千葉銀行	83.3	49.4		46,114	
<b>その他金融業 (4.9%)</b>					
クレディセゾン	—	57		30.1	67,649
東京センチュリー	—	15.3		15.3	82,115
リコーリース	12.2	—		—	—
<b>不動産業 (6.9%)</b>					
大東建託	—	6.1		88,663	
野村不動産ホールディングス	6.9	—		—	—
飯田グループホールディングス	23.1	25.5		63,061	
A V A N T I A	21.3	—		—	—
イオンモール	39.5	33.1		58,371	
<b>サービス業 (3.0%)</b>					
総合警備保障	—	43.7		34,815	
りらいあコミュニケーションズ	71.4	—		—	—
アサンテ	23.5	32.1		54,794	
合 計	株 数 : 2,382	株 数 : 2,149	株 数 : 2,149	金 額 : 3,029,742	金 額 : 3,029,742
	銘柄数 < 比率 >	49	53	< 99.4% >	< 99.4% >

(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

(2023年7月27日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 3,029,742	99.0 %
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	30,827	1.0
投 資 信 託 財 産 総 額	3,060,569	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

(2023年7月27日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	3,060,569,202円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	17,394,665
株 式(評価額)	3,029,742,800
未 収 入 金	9,509,737
未 収 配 当 金	3,922,000
(B) 負 債	13,143,133
未 払 金	13,143,083
未 払 利 息	50
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	3,047,426,069
元 本	1,128,379,576
次 期 繰 越 損 益 金	1,919,046,493
(D) 受 益 権 総 口 数	1,128,379,576口
1 万 口 当 ち 基 準 価 額(C/D)	27,007円

(注1) 元本の状況  
 期首元本額 1,335,142,234円  
 期中追加設定元本額 32,320,714円  
 期中一部解約元本額 239,083,372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ストックファンド 1,128,379,576円

(注2) 1口当たり純資産額は2,7007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2022年7月28日 至2023年7月27日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	96,151,058円
受 取 配 当 金	96,171,700
そ の 他 収 益 金	1,957
支 払 利 息	△ 22,599
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	632,680,650
売 買 益	654,770,395
売 買 損	△ 22,089,745
(C) 信 託 報 酬 等	△ 90
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	728,831,618
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,473,452,217
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	45,679,286
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 328,916,628
(H) 計 (D+E+F+G)	1,919,046,493
次 期 繰 越 損 益 金(H)	1,919,046,493

(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。