

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／債券
信託期間	無期限（2016年5月10日設定）
運用方針	主として、米ドル建ての債券を主要投資対象とする投資信託証券に投資を行い、安定した収益の確保と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	外国投資法人「イーストスプリング・インベストメント - USインベストメント・グレード・ボンド・ファンド クラス J」JDM(hedged)の投資証券およびわが国の証券投資信託「イーストスプリング国内債券ファンド（国債）追加型 I（適格機関投資家向け）」の受益証券（振替受益権を含みます。）を主要投資対象とします。
組入制限	・投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ・外貨建資産への直接投資は行いません。 ・株式への直接投資は行いません。
分配方針	（毎月決算型） 原則として毎月21日（休業日の場合は翌営業日）（年2回決算型） 原則として毎年4月21日および10月21日（休業日の場合は翌営業日） 各ファンドの毎決算時に、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、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 US投資適格債ファンド・ 為替ヘッジ付 （毎月決算型）／（年2回決算型） 【愛称：USAボンド毎月／USAボンド】

（毎月決算型）

第96期（決算日2024年5月21日）第99期（決算日2024年8月21日）
第97期（決算日2024年6月21日）第100期（決算日2024年9月24日）
第98期（決算日2024年7月22日）第101期（決算日2024年10月21日）

（年2回決算型）

第17期（決算日2024年10月21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US投資適格債ファンド・為替ヘッジ付（毎月決算型）／（年2回決算型）」は、上記の決算を行いましたので、ここに各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・インベストメント株式会社

〔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

イーストスプリングUS投資適格債ファンド・為替ヘッジ付(毎月決算型)／(年2回決算型)

(毎月決算型)

○最近30期の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額			投 資 信 託 純 資 産 組 入 比 率 総 額	純 資 産 産 額
		税 分	込 配	み 金 期 騰 落 中 率		
	円		円	%	%	百万円
72期(2022年5月23日)	9,322		10	△1.9	95.2	39
73期(2022年6月21日)	9,112		10	△2.1	95.1	38
74期(2022年7月21日)	9,214		10	1.2	95.2	39
75期(2022年8月22日)	9,295		10	1.0	94.9	38
76期(2022年9月21日)	8,898		10	△4.2	94.8	37
77期(2022年10月21日)	8,461		10	△4.8	94.6	35
78期(2022年11月21日)	8,756		10	3.6	93.2	59
79期(2022年12月21日)	8,887		10	1.6	91.1	64
80期(2023年1月23日)	9,056		10	2.0	90.5	71
81期(2023年2月21日)	8,830		10	△2.4	69.3	136
82期(2023年3月22日)	8,867		10	0.5	92.6	342
83期(2023年4月21日)	8,953		10	1.1	92.1	354
84期(2023年5月22日)	8,762		10	△2.0	92.7	344
85期(2023年6月21日)	8,804		10	0.6	92.4	356
86期(2023年7月21日)	8,789		10	△0.1	92.7	354
87期(2023年8月21日)	8,565		10	△2.4	92.4	342
88期(2023年9月21日)	8,548		10	△0.1	89.4	263
89期(2023年10月23日)	8,204		10	△3.9	91.7	237
90期(2023年11月21日)	8,500		10	3.7	92.1	245
91期(2023年12月21日)	8,861		10	4.4	92.0	277
92期(2024年1月22日)	8,732		10	△1.3	92.7	277
93期(2024年2月21日)	8,665		10	△0.7	91.2	236
94期(2024年3月21日)	8,658		10	0.0	92.9	236
95期(2024年4月22日)	8,467		10	△2.1	93.0	231
96期(2024年5月21日)	8,588		10	1.5	93.0	229
97期(2024年6月21日)	8,608		10	0.3	91.5	226
98期(2024年7月22日)	8,611		10	0.2	91.8	221
99期(2024年8月21日)	8,773		10	2.0	92.1	234
100期(2024年9月24日)	8,812		10	0.6	93.0	233
101期(2024年10月21日)	8,698		10	△1.2	92.8	231

(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) 純資産総額の単位未満は切捨てです。

(注) 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。

イーストスプリングUS投資適格債ファンド・為替ヘッジ付(毎月決算型)／(年2回決算型)

(毎月決算型)

○当作成期中の基準価額等の推移

決 算 期	年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		投 資 信 託 証 組 入 比 率
			騰 落	率	
第96期	(期 首) 2024年 4月22日	円 8,467		% -	% 93.0
	4 月末	8,465		△0.0	92.7
	(期 末) 2024年 5月21日	8,598		1.5	93.0
第97期	(期 首) 2024年 5月21日	8,588		-	93.0
	5 月末	8,502		△1.0	92.9
	(期 末) 2024年 6月21日	8,618		0.3	91.5
第98期	(期 首) 2024年 6月21日	8,608		-	91.5
	6 月末	8,586		△0.3	91.9
	(期 末) 2024年 7月22日	8,621		0.2	91.8
第99期	(期 首) 2024年 7月22日	8,611		-	91.8
	7 月末	8,630		0.2	91.9
	(期 末) 2024年 8月21日	8,783		2.0	92.1
第100期	(期 首) 2024年 8月21日	8,773		-	92.1
	8 月末	8,750		△0.3	92.8
	(期 末) 2024年 9月24日	8,822		0.6	93.0
第101期	(期 首) 2024年 9月24日	8,812		-	93.0
	9 月末	8,832		0.2	93.1
	(期 末) 2024年10月21日	8,708		△1.2	92.8

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

イーストスプリングUS投資適格債ファンド・為替ヘッジ付(毎月決算型)／(年2回決算型)

(年2回決算型)

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額			投 資 信 託 組 入 比 率	純 資 産 総 額
		税 分 配 金	期 騰 落	中 率		
13期(2022年10月21日)	円 8,942	円 0	% △10.7	% 97.9	百万円 2,649	
14期(2023年4月21日)	9,571	0	7.0	98.0	6,128	
15期(2023年10月23日)	8,795	0	△ 8.1	97.9	6,684	
16期(2024年4月22日)	9,180	0	4.4	97.5	10,181	
17期(2024年10月21日)	9,517	0	3.7	97.2	12,945	

(注) 純資産総額の単位未満は切捨てです。

(注) 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		投 資 信 託 組 入 比 率
		騰 落	率	
(期 首) 2024年4月22日	円 9,180		% -	% 97.5
4月末	9,178		△0.0	97.3
5月末	9,231		0.6	97.3
6月末	9,337		1.7	97.4
7月末	9,402		2.4	97.4
8月末	9,552		4.1	97.7
9月末	9,658		5.2	97.5
(期 末) 2024年10月21日	9,517		3.7	97.2

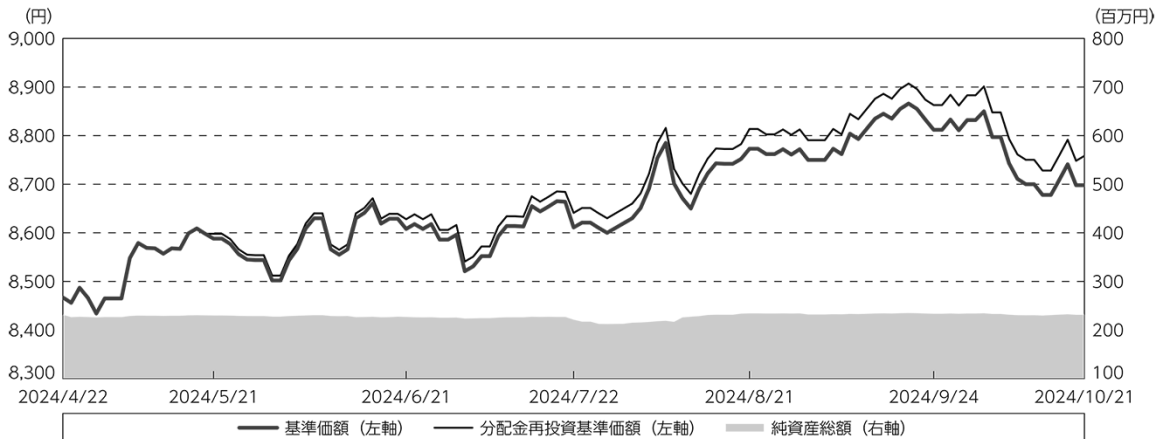
(注) 騰落率は期首比です。

(毎月決算型)

○運用経過

(2024年4月23日～2024年10月21日)

基準価額等の推移について



第96期首：8,467円

第101期末：8,698円 (既払分配金(税込み):60円)

騰落率：3.4% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注) 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、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 分配金再投資基準価額は、作成期首(2024年4月22日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。
- (注) 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。

基準価額の主な変動要因

当作成期の基準価額は上昇しました。

(上昇要因)

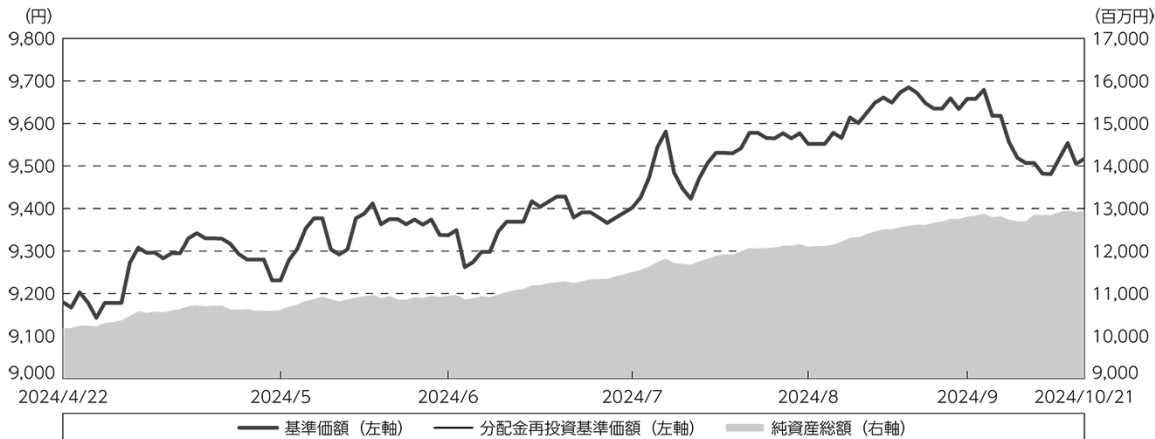
- ・米国投資適格社債の価格が上昇(利回りは低下)したこと。

(年2回決算型)

○運用経過

(2024年4月23日～2024年10月21日)

基準価額等の推移について



期 首：9,180円

期 末：9,517円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率： 3.7% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注) 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、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 分配金再投資基準価額は、期首(2024年4月22日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。
- (注) 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。

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)

- ・米国投資適格社債の価格が上昇(利回りは低下)したこと。

(毎月決算型／年2回決算型)

投資環境について

米国債券市場

当（作成）期、米国投資適格社債の価格は上昇（利回りは低下）しました。

当（作成）期初から2024年半ばにかけて、米国では経済指標が徐々に悪化し、米連邦準備制度理事会（FRB）による利下げ開始の時期が市場の関心を集めました。こうした環境下で米国債利回りは低下しました。7月末から8月上旬にかけて、日本株の急落によりリスクオフが急激に進み、米国債利回りも急低下しました。その後も、市場の利下げ観測やFRB高官のハト派的な発言を背景に低下しましたが、9月の米連邦公開市場委員会（FOMC）で0.50%の利下げが実施されたあとは、10月上旬に好調な雇用統計が発表されたことや市場織り込みの巻き戻しにより、米国債利回りは上昇しました。米国投資適格社債の対国債スプレッドは、8月上旬のリスクオフ局面では一時的に拡大したものの、当（作成）期を通じて狭い水準で推移し、利下げが実施された9月以降は一段と縮小しました。

国内債券市場

2024年7月の金融政策決定会合まで、日銀の利上げをめぐる思惑により、日本国債利回りは徐々に上昇しました。7月末の金融政策決定会合で実際に利上げが実施されると、8月上旬にかけて日本株が急落したことでリスクオフとなり、日本国債利回りは低下しました。日銀による追加利上げが遠のいたのではないかという憶測も利回り低下の要因となりました。その後、当（作成）期末にかけて日本国債利回りは小幅に上昇し、当（作成）期を通してみるとほぼ横ばいとなりました。

ポートフォリオについて

イーストスプリングUS投資適格債ファンド・為替ヘッジ付（毎月決算型）／（年2回決算型）

主要な投資対象の一つである「イーストスプリング・インベストメンツ - USインベストメント・グレード・ボンド・ファンド クラスJ」_{JDM} (hedged)（以下「USIGボンド・ファンド」ということがあります。）の組入比率を高位に保つよう運用しました。

USIGボンド・ファンド

主として、米国の債券市場において発行されたBBB－相当以上の米ドル建ての投資適格債券に投資を行いました。原則として米ドル建ての資産について対円での為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図りました。銘柄別では、当（作成）期は、通信、ヘルスケア、金融、飲料メーカーなどが発行する債券の保有がプラスとなった一方で、銀行、鉄道会社、衛星放送事業会社などが発行する債券の保有はマイナス要因となりました。

イーストスプリング国内債券ファンド（国債）追加型I（適格機関投資家向け）

主としてデュレーションをコントロールすることによって、ベンチマークであるICE BofA 国債インデックス（1－10年債）を中長期的に上回ることを目指して運用を行いました。

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。

イーストスプリングUS投資適格債ファンド・為替ヘッジ付(毎月決算型)／(年2回決算型)

(毎月決算型／年2回決算型)

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

(毎月決算型)

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項 目	第96期	第97期	第98期	第99期	第100期	第101期
	2024年4月23日～ 2024年5月21日	2024年5月22日～ 2024年6月21日	2024年6月22日～ 2024年7月22日	2024年7月23日～ 2024年8月21日	2024年8月22日～ 2024年9月24日	2024年9月25日～ 2024年10月21日
当期分配金 (対基準価額比率)	10 0.116%	10 0.116%	10 0.116%	10 0.114%	10 0.113%	10 0.115%
当期の収益	10	10	10	10	10	10
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	1,911	1,930	1,944	1,963	1,983	1,997

(注) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)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) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出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) ー印は該当がないことを示しています。

(年2回決算型)

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項 目	第17期
	2024年4月23日～ 2024年10月21日
当期分配金 (対基準価額比率)	— —%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	2,383

(注) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)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) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出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) ー印は該当がないことを示しています。

(毎月決算型／年2回決算型)

○今後の運用方針について

イーストスプリングUS投資適格債ファンド・為替ヘッジ付(毎月決算型)／(年2回決算型)

主要な投資対象の一つであるUSIG債券・ファンドの組入比率を高位に保つことを基本とします。

USIG債券・ファンド

FRBが金融緩和サイクルに入ったことは投資適格社債への需要を後押しし、投資家は債券の保有を増やし続けると予想しています。懸念要因は投資適格社債のバリュエーションです。スプレッドはすでにタイトな水準にあり、市場は地政学リスクや中央銀行の政策、またはマクロ経済の悪化懸念によって引き起こされるリスクオフ局面に対して脆弱である可能性があります。このような局面では、優良銘柄に着目しつつ、綿密なリサーチに基づいた業種および銘柄選択に収益の源泉があると考えています。今後も長期的な見通しに立って慎重にセクターおよび銘柄を選択し、運用を継続してまいります。

イーストスプリング国内債券ファンド(国債)追加型I(適格機関投資家向け)

今後もファンダメンタルズ分析、金利動向予測、イールドカーブ分析等を行い、ベンチマークであるICE BofA 国債インデックス(1-10年債)を中長期的に上回ることを目指した運用を行っていく所存です。

イーストスプリングUS投資適格債ファンド・為替ヘッジ付(毎月決算型)／(年2回決算型)

(毎月決算型)

○ 1万口当たりの費用明細

(2024年4月23日～2024年10月21日)

項 目	第96期～第101期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 30	% 0.346	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(9)	(0.110)	委託した資金の運用の対価
(販 売 会 社)	(19)	(0.219)	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)	(1)	(0.016)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用	4	0.041	(b) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(4)	(0.041)	監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	34	0.387	
作成期間の平均基準価額は、8,627円です。			

(注) 作成期間の費用(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) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 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)を作成期間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。

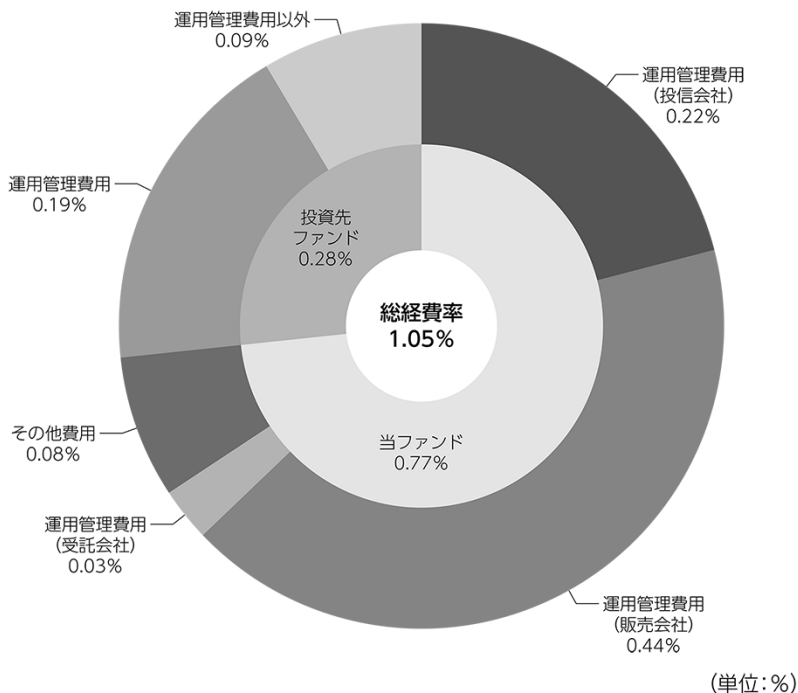
(注) 各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

(毎月決算型)

(参考情報)

○総経費率

作成期間の運用・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。）を作成期間の平均受益権口数に作成期間の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.05%です。



総経費率(①+②+③)	1.05
①当ファンドの費用の比率	0.77
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.19
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.09

(注) ①の費用は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) 投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券です。

(注) ①の費用は、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) 投資先ファンドでは、監査費用等がかかる場合がありますが、上記の「運用管理費用以外」には含まれておりません。

(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。

イーストスプリングUS投資適格債ファンド・為替ヘッジ付(毎月決算型)／(年2回決算型)

(毎月決算型)

○売買及び取引の状況

(2024年4月23日～2024年10月21日)

投資信託証券

銘柄		第96期～第101期			
		買付		売却	
		口数	金額	口数	金額
外国	邦貨建 ルクセンブルグ籍	千口	千円	千口	千円
	イーストスプリング・インベストメンツ - USインベストメント・グレード・ボンド・ファンドクラスJ _{JDM} (hedged)	30	22,952	35	27,000

(注) 金額は受渡し代金です。

(注) 単位未満は切捨てです。

○利害関係人との取引状況等

(2024年4月23日～2024年10月21日)

該当事項はございません。

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。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2024年4月23日～2024年10月21日)

作成期首残高 (元本)	当作成期設定 元本	当作成期解約 元本	作成期末残高 (元本)	取引の理由
百万円 1	百万円 -	百万円 -	百万円 1	当初設定時における取得

(注) 単位未満は切捨てです。

○組入資産の明細

(2024年10月21日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘柄		第95期末		第101期末	
		口数	口数	評価額	比率
		千口	千口	千円	%
	イーストスプリング国内債券ファンド(国債)追加型I (適格機関投資家向け)	235	235	247	0.1
	イーストスプリング・インベストメンツ - USインベストメント・ グレード・ボンド・ファンドクラスJ _{JDM} (hedged)	288	282	214,290	92.7
	合計	524	518	214,537	92.8

(注) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注) 口数・評価額の単位未満は切捨てです。

イーストスプリングUS投資適格債ファンド・為替ヘッジ付(毎月決算型)／(年2回決算型)

(毎月決算型)

○投資信託財産の構成

(2024年10月21日現在)

項 目	第101期末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 247	% 0.1
投資証券	214,290	92.5
コール・ローン等、その他	17,155	7.4
投資信託財産総額	231,692	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

項 目	第96期末	第97期末	第98期末	第99期末	第100期末	第101期末
	2024年5月21日現在	2024年6月21日現在	2024年7月22日現在	2024年8月21日現在	2024年9月24日現在	2024年10月21日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	230,236,441	227,294,373	226,519,770	238,636,233	233,874,450	231,692,941
コール・ローン等	16,562,478	19,686,644	18,411,002	22,945,641	16,731,849	17,154,903
投資信託受益証券(評価額)	247,265	247,831	247,194	248,444	248,468	247,807
投資証券(評価額)	213,426,694	207,359,893	202,861,569	215,442,079	216,894,083	214,290,180
未収入金	—	—	5,000,000	—	—	—
未収利息	4	5	5	69	50	51
(B) 負債	407,984	434,466	5,344,270	4,454,658	494,508	508,642
未払金	—	—	—	4,000,000	—	—
未払収益分配金	267,615	263,533	256,854	266,927	264,848	265,779
未払解約金	55	6,018	4,908,204	41	199	31,400
未払信託報酬	125,582	134,435	132,984	126,222	150,721	118,932
その他未払費用	14,732	30,480	46,228	61,468	78,740	92,531
(C) 純資産総額(A-B)	229,828,457	226,859,907	221,175,500	234,181,575	233,379,942	231,184,299
元本	267,615,024	263,533,540	256,854,960	266,927,066	264,848,010	265,779,838
次期繰越損益金	△ 37,786,567	△ 36,673,633	△ 35,679,460	△ 32,745,491	△ 31,468,068	△ 34,595,539
(D) 受益権総口数	267,615,024口	263,533,540口	256,854,960口	266,927,066口	264,848,010口	265,779,838口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,588円	8,608円	8,611円	8,773円	8,812円	8,698円

(注) 元本の状況

当ファンドの第96期首元本額は273,217,891円、第96～101期中追加設定元本額は23,181,676円、第96～101期中一部解約元本額は30,619,729円です。

(注) 1口当たり純資産額は、第96期0.8588円、第97期0.8608円、第98期0.8611円、第99期0.8773円、第100期0.8812円、第101期0.8698円です。

(注) 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。

イーストスプリングUS投資適格債ファンド・為替ヘッジ付(毎月決算型)／(年2回決算型)

(毎月決算型)

○損益の状況

項 目	第96期	第97期	第98期	第99期	第100期	第101期
	2024年4月23日～ 2024年5月21日	2024年5月22日～ 2024年6月21日	2024年6月22日～ 2024年7月22日	2024年7月23日～ 2024年8月21日	2024年8月22日～ 2024年9月24日	2024年9月25日～ 2024年10月21日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	838,301	900,708	761,486	756,612	892,798	775,343
受取配当金	838,179	900,579	761,333	755,180	891,030	774,003
受取利息	122	129	153	1,432	1,768	1,340
(B) 有価証券売買損益	2,812,175	44,768	△ 291,124	3,821,088	561,582	△ 3,375,919
売買益	2,820,044	44,765	68	3,826,423	561,344	3,907
売買損	△ 7,869	3	△ 291,192	△ 5,335	238	△ 3,379,826
(C) 信託報酬等	△ 140,314	△ 150,183	△ 148,732	△ 141,462	△ 167,993	△ 132,723
(D) 当期損益金(A+B+C)	3,510,162	795,293	321,630	4,436,238	1,286,387	△ 2,733,299
(E) 前期繰越損益金	△12,330,477	△ 8,907,750	△ 8,157,865	△ 7,776,733	△ 3,576,750	△ 2,550,727
(F) 追加信託差損益金	△28,698,637	△28,297,643	△27,586,371	△29,138,069	△28,912,857	△29,045,734
(配当等相当額)	(44,491,482)	(43,846,841)	(42,741,065)	(45,028,715)	(44,683,763)	(44,885,941)
(売買損益相当額)	(△73,190,119)	(△72,144,484)	(△70,327,436)	(△74,166,784)	(△73,596,620)	(△73,931,675)
(G) 計(D+E+F)	△37,518,952	△36,410,100	△35,422,606	△32,478,564	△31,203,220	△34,329,760
(H) 収益分配金	△ 267,615	△ 263,533	△ 256,854	△ 266,927	△ 264,848	△ 265,779
次期繰越損益金(G+H)	△37,786,567	△36,673,633	△35,679,460	△32,745,491	△31,468,068	△34,595,539
追加信託差損益金	△28,698,637	△28,297,643	△27,586,371	△29,138,069	△28,912,857	△29,045,734
(配当等相当額)	(44,491,482)	(43,846,841)	(42,741,065)	(45,028,715)	(44,683,763)	(44,885,941)
(売買損益相当額)	(△73,190,119)	(△72,144,484)	(△70,327,436)	(△74,166,784)	(△73,596,620)	(△73,931,675)
分配準備積立金	6,657,960	7,020,050	7,193,135	7,378,252	7,840,333	8,203,416
繰越損益金	△15,745,890	△15,396,040	△15,286,224	△10,985,674	△10,395,544	△13,753,221

(注) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注) 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) 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) 分配金の計算過程

第96期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(806,085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(44,491,482円)および分配準備積立金(6,119,490円)より分配対象収益は51,417,057円(10,000口当たり1,921円)であり、うち267,615円(10,000口当たり10円)を分配金額としております。

第97期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(757,629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(43,846,841円)および分配準備積立金(6,525,954円)より分配対象収益は51,130,424円(10,000口当たり1,940円)であり、うち263,533円(10,000口当たり10円)を分配金額としております。

第98期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(612,754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(42,741,065円)および分配準備積立金(6,837,235円)より分配対象収益は50,191,054円(10,000口当たり1,954円)であり、うち256,854円(10,000口当たり10円)を分配金額としております。

第99期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(733,228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(45,028,715円)および分配準備積立金(6,911,951円)より分配対象収益は52,673,894円(10,000口当たり1,973円)であり、うち266,927円(10,000口当たり10円)を分配金額としております。

第100期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(789,667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(44,683,763円)および分配準備積立金(7,315,514円)より分配対象収益は52,788,944円(10,000口当たり1,993円)であり、うち264,848円(10,000口当たり10円)を分配金額としております。

第101期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(642,620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(44,885,941円)および分配準備積立金(7,826,575円)より分配対象収益は53,355,136円(10,000口当たり2,007円)であり、うち265,779円(10,000口当たり10円)を分配金額としております。

(毎月決算型)

○分配金のお知らせ

	第96期	第97期	第98期	第99期	第100期	第101期
1万口当たり分配金(税込み)	10円	10円	10円	10円	10円	10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。

◇「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。

○お知らせ

該当事項はありません。

イーストスプリングUS投資適格債ファンド・為替ヘッジ付(毎月決算型)／(年2回決算型)

(年2回決算型)

○ 1万口当たりの費用明細

(2024年4月23日～2024年10月21日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(10)	(0.110)	委託した資金の運用の対価
(販 売 会 社)	(21)	(0.219)	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)	(2)	(0.016)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用	1	0.011	(b) 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)	(1)	(0.007)	監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(印 刷)	(0)	(0.004)	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
合 計	33	0.357	
期中の平均基準価額は、9,393円です。			

(注) 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) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 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。

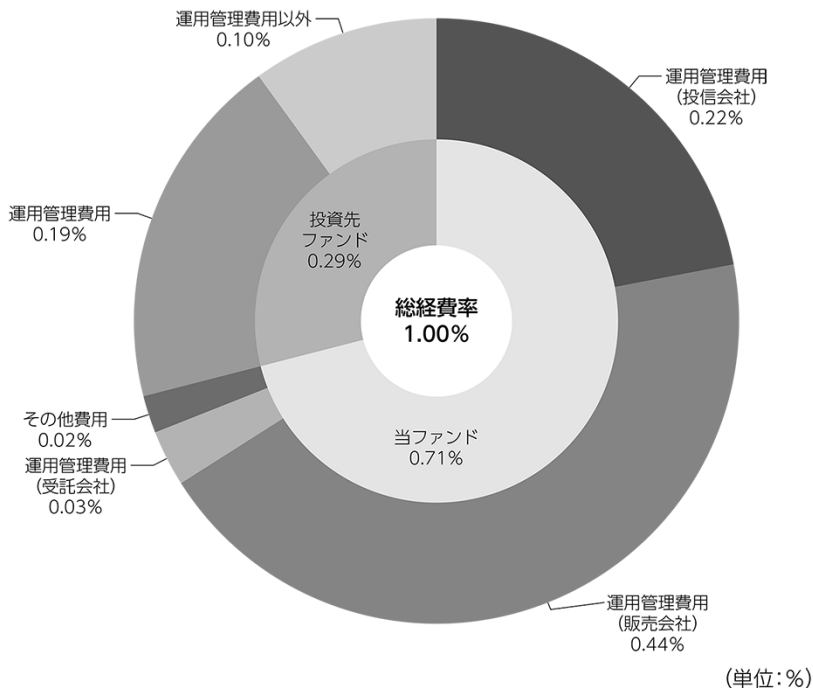
(注) 各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

(年2回決算型)

(参考情報)

○総経費率

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。)を期中の平均受益権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1.00%です。



総経費率(①+②+③)	1.00
①当ファンドの費用の比率	0.71
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.19
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.10

(注) ①の費用は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) 投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券です。

(注) ①の費用は、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) 投資先ファンドでは、監査費用等がかかる場合がありますが、上記の「運用管理費用以外」には含まれておりません。

(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。

イーストスプリングUS投資適格債ファンド・為替ヘッジ付(毎月決算型)／(年2回決算型)

(年2回決算型)

○売買及び取引の状況

(2024年4月23日～2024年10月21日)

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	イーストスプリング国内債券ファンド(国債)追加型I(適格機関投資家向け)	千口 1,333	千円 1,400	千口 —	千円 —
外国	邦貨建 ルクセンブルグ籍 イーストスプリング・インベストメンツ - USインベストメント・グレード・ ボンド・ファンドクラスJ _{JDM} (hedged)	3,286	2,494,657	—	—
合計		4,619	2,496,057	—	—

(注) 金額は受渡し代金です。

(注) 単位未満は切捨てです。

○利害関係人との取引状況等

(2024年4月23日～2024年10月21日)

該当事項はございません。

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。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2024年4月23日～2024年10月21日)

期首残高 (元本)	当期設定 元本	当期解約 元本	期末残高 (元本)	取引の理由
百万円 1	百万円 —	百万円 1	百万円 —	当初設定時取得分の処分

(注) 単位未満は切捨てです。

○組入資産の明細

(2024年10月21日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘柄		期首(前期末)	当期末		
		口数	口数	評価額	比率
		千口	千口	千円	%
イーストスプリング国内債券ファンド(国債)追加型I(適格機関投資家向け)		5,015	6,348	6,669	0.1
イーストスプリング・インベストメンツ - USインベストメント・グレード・ボンド・ファンドクラスJ _{JDM} (hedged)		13,313	16,600	12,582,862	97.2
合計		18,328	22,948	12,589,531	97.2

(注) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注) 口数・評価額の単位未満は切捨てです。

イーストスプリングUS投資適格債ファンド・為替ヘッジ付(毎月決算型)／(年2回決算型)

(年2回決算型)

○投資信託財産の構成

(2024年10月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	6,669	0.1
投資証券	12,582,862	96.5
コール・ローン等、その他	447,925	3.4
投資信託財産総額	13,037,456	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 (2024年10月21日現在)

○損益の状況 (2024年4月23日～2024年10月21日)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	13,037,456,757
コール・ローン等	447,924,040
投資信託受益証券(評価額)	6,669,059
投資証券(評価額)	12,582,862,309
未収利息	1,349
(B) 負債	91,595,675
未払金	27,000,000
未払解約金	23,632,450
未払信託報酬	39,729,219
その他未払費用	1,234,006
(C) 純資産総額(A－B)	12,945,861,082
元本	13,602,856,736
次期繰越損益金	△ 656,995,654
(D) 受益権総口数	13,602,856,736口
1万円当たり基準価額(C/D)	9,517円

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	252,602,619
受取配当金	252,493,598
受取利息	109,021
(B) 有価証券売買損益	153,926,142
売買益	169,714,226
売買損	△ 15,788,084
(C) 信託報酬等	△ 40,963,225
(D) 当期損益金(A+B+C)	365,565,536
(E) 前期繰越損益金	△ 544,793,220
(F) 追加信託差損益金	△ 477,767,970
(配当等相当額)	(2,682,348,584)
(売買損益相当額)	(△3,160,116,554)
(G) 計(D+E+F)	△ 656,995,654
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	△ 656,995,654
追加信託差損益金	△ 477,767,970
(配当等相当額)	(2,682,348,584)
(売買損益相当額)	(△3,160,116,554)
分配準備積立金	559,523,657
繰越損益金	△ 738,751,341

(注) 元本の状況
 期首元本額 11,091,965,661円
 期中追加設定元本額 3,952,663,655円
 期中一部解約元本額 1,441,772,580円
 (注) 1口当たり純資産額は0.9517円です。
 (注) 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条の第6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

(注) 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) 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) 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) 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(227,148,071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(2,682,348,584円)および分配準備積立金(332,375,586円)より分配対象収益は3,241,872,241円(10,000口当たり2,383円)ですが、当期に分配した金額はありません。

(年2回決算型)

○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。

<参考情報>

■投資対象とする投資信託証券の仕組み

ファンド名	イーストスプリング・インベストメンツ - USインベストメント・グレード・ボンド・ファンド クラス J _{JDM} (hedged)	
形態	ルクセンブルグ籍外国投資法人/オープン・エンド型	
表示通貨	日本円	
運用の基本方針	主として、米国の債券市場において発行されたBBB-相当以上の米ドル建ての投資適格債券（ヤンキー債、グローバル債を含みます。）に投資を行います。なお、原則として、米ドル建ての資産について対円で為替ヘッジを行います。	
主な投資対象	米国の債券市場で発行されたBBB-相当以上の米ドル建ての投資適格債券（ヤンキー債、グローバル債を含みます。） ヤンキー債：米国以外の国籍の発行体（国際機関を含む）が米国債券市場で発行する米ドル建て債券 グローバル債：ユーロ債券市場や米国債券市場等の2つ以上の市場において同時に発行される債券	
ベンチマーク	ICE BofA USコーポレートBBB 3 - A 3 格インデックス*	
ファンドの関係法人	運用会社	イーストスプリング・インベストメンツ（シンガポール）リミテッド
	投資顧問会社	ピーピーエム アメリカ インク
	管理会社	イーストスプリング・インベストメンツ（ルクセンブルグ）S.A.
申込手数料	ありません。	
運用報酬	年率0.2%	
管理費用等	年率0.1%程度	
その他の費用・手数料	監査費用、組入有価証券の売買時の売買委託手数料等がかかります。	
設立日	2004年11月10日	
決算日	毎年12月31日	

ファンド名	イーストスプリング国内債券ファンド（国債）追加型 I（適格機関投資家向け）	
形態	国内籍証券投資信託/適格機関投資家私募	
表示通貨	日本円	
運用の基本方針	わが国の国債を中心に、国債、政府保証債、地方債等の公共債を主要投資対象とし、安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指した運用を行います。	
主な投資対象	日本の国債、政府保証債、地方債	
ベンチマーク	ICE BofA 国債インデックス（1-10年債）*	
ファンドの関係法人	委託会社	イーストスプリング・インベストメンツ株式会社
	投資顧問会社	イーストスプリング・インベストメンツ（シンガポール）リミテッド
	受託会社	三菱UFJ信託銀行株式会社
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。 ・投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%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。 	
申込手数料	ありません。	
信託報酬	年率0.22%（税抜0.2%）	
その他の費用・手数料	監査費用、有価証券売買時の売買委託手数料等がかかります。	
設定日	2002年8月26日	
決算日	毎年2月25日（休業日の場合は翌営業日）	

* ICEの指数データは、ICE Data Indices, LLC、その関係会社（以下「ICE Data」）及び/またはその第三者サプライヤーの財産です。ICE Data及びその第三者サプライヤーは、その使用に関して一切の責任を負いません。

「イーストスプリングUS投資適格債ファンド・為替ヘッジ付（毎月決算型）／（年2回決算型）」が主要投資対象とする「イーストスプリング・インベストメンツ - USインベストメント・グレード・ボンド・ファン ド クラスJ」_{JDM} (hedged) を含む「イーストスプリング・インベストメンツ - USインベストメント・グ レード・ボンド・ファンド」の情報をご報告申し上げます。法令等に則り、2023年12月31日を基準日とする Annual Report（監査済み）を基に、委託会社が抜粋、翻訳したものを記載しております。

損益計算書及び純資産変動計算書

	2023年12月31日に終了した事業年度	米ドル
期首純資産		316,426,271
収益		
債券利息		16,055,080
短期金融市場預金利息		193,911
預金利息		14,906
収益合計		16,263,897
費用		
運用報酬		586,649
運営費用及びサービス費用		427,260
販売会社報酬		10,760
スワップに係る利息		88,375
その他費用		13,826
費用合計		1,126,870
純投資収益（損）		15,137,027
投資有価証券の売却に係る実現純利益（損）		(14,372,880)
先物取引に係る実現純利益（損）		(627,634)
外国為替先渡取引に係る実現純利益（損）		(6,488,536)
クレジット・デフォルト・スワップに係る実現純利益（損）		70,081
外国為替に係る実現純利益（損）		(98,129)
実現純利益（損）		(21,517,098)
投資有価証券に係る未実現評価益（損）の変動額		32,040,700
先物取引に係る未実現評価益（損）の変動額		36,316
外国為替先渡取引に係る未実現評価益（損）の変動額		214,278
クレジット・デフォルト・スワップに係る未実現評価益（損）の変動額		(3,220)
外国為替に係る未実現評価益（損）の変動額		(11,641)
未実現評価益（損）の純変動額		32,276,433
運用による純資産の純増加額（減少額）		25,896,362
資本金の変動		
投資証券の発行		203,045,499
投資証券の解約		(141,016,107)
配当金及び分配金		
当期の配当金及び分配金		(8,628,819)
当期の純資産の変動額		79,296,935
期末純資産		395,723,206

投資有価証券明細表 (2023年12月31日現在)

(米ドル表示)

銘柄	数量	通貨	評価金額	対純資産 比率(%)
投資信託証券				
Ireland				
BNY Mellon U.S. Dollar Liquidity Fund ‘Investor’	1,782,334	USD	1,782,334	0.45
投資信託証券合計			1,782,334	0.45
公認の証券取引所に上場されているまたは他の規制ある市場で取引されている譲渡可能な有価証券				
債券				
Australia				
Commonwealth Bank of Australia ‘144A’ FRN 12/9/2034	1,250,000	USD	1,105,830	0.28
Macquarie Bank Ltd ‘144A’ 4.875% 10/6/2025	715,000	USD	706,234	0.18
Macquarie Bank Ltd ‘144A’ 5.391% 7/12/2026	1,500,000	USD	1,516,705	0.38
Macquarie Group Ltd ‘144A’ FRN 14/1/2033	500,000	USD	410,730	0.10
Santos Finance Ltd ‘144A’ 3.649% 29/4/2031	895,000	USD	774,978	0.20
Woodside Finance Ltd ‘144A’ 4.5% 4/3/2029	775,000	USD	743,426	0.19
			5,257,903	1.33
Bermuda				
Aircastle Ltd 4.25% 15/6/2026	950,000	USD	915,189	0.23
Aircastle Ltd ‘144A’ 5.25% 11/8/2025	400,000	USD	394,682	0.10
Aircastle Ltd ‘144A’ 6.5% 18/7/2028	1,840,000	USD	1,865,372	0.47
			3,175,243	0.80
Canada				
Air Canada 2020-2 Class A Pass Through Trust ‘144A’ 5.25% 1/4/2029	129,561	USD	127,160	0.03
Canadian Pacific Railway Co 3.1% 2/12/2051	694,000	USD	498,751	0.13
Element Fleet Management Corp ‘144A’ 6.319% 4/12/2028	957,000	USD	985,649	0.25
Federation des Caisses Desjardins du Quebec ‘144A’ 5.7% 14/3/2028	1,500,000	USD	1,538,732	0.39
Glencore Finance Canada Ltd ‘144A’ 5.55% 25/10/2042	600,000	USD	582,337	0.15
Suncor Energy Inc 6.5% 15/6/2038	500,000	USD	535,535	0.13
Waste Connections Inc 2.2% 15/1/2032	1,000,000	USD	834,358	0.21
			5,102,522	1.29
Cayman Islands				
Avolon Holdings Funding Ltd ‘144A’ 2.875% 15/2/2025	1,291,000	USD	1,245,883	0.31
Chile				
Corp Nacional del Cobre de Chile ‘144A’ 5.125% 2/2/2033	758,000	USD	731,509	0.18
France				
Banque Federative du Credit Mutuel SA ‘144A’ 5.896% 13/7/2026	1,500,000	USD	1,527,950	0.39
BNP Paribas SA ‘144A’ FRN 12/8/2035	800,000	USD	653,326	0.17
BPCE SA ‘144A’ 5.15% 21/7/2024	650,000	USD	644,411	0.16
BPCE SA ‘144A’ FRN 19/10/2027	1,600,000	USD	1,452,541	0.37

銘柄	数量	通貨	評価金額	対純資産 比率(%)
BPCE SA ‘144A’ FRN 19/10/2029	1,000,000	USD	1,048,762	0.26
			5,326,990	1.35
Germany				
Deutsche Bank AG/New York NY FRN 18/1/2029	730,000	USD	762,951	0.19
Deutsche Bank AG/New York NY FRN 20/11/2029	595,000	USD	625,191	0.16
Deutsche Bank AG/New York NY FRN 10/2/2034	900,000	USD	923,261	0.24
Deutsche Bank AG/New York NY FRN 13/7/2027	1,419,000	USD	1,472,449	0.37
			3,783,852	0.96
Ireland				
AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3% 29/10/2028	1,100,000	USD	1,000,063	0.25
AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 4.45% 1/10/2025	616,000	USD	603,868	0.15
STERIS Irish FinCo UnLtd Co 3.75% 15/3/2051	430,000	USD	334,337	0.09
			1,938,268	0.49
Japan				
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc FRN 17/4/2026	1,467,000	USD	1,469,801	0.37
Mizuho Financial Group Inc FRN 6/7/2029	1,300,000	USD	1,333,013	0.34
			2,802,814	0.71
Jersey				
Aptiv Plc 3.1% 1/12/2051	750,000	USD	490,733	0.12
Luxembourg				
Schlumberger Investment SA 4.5% 15/5/2028	958,000	USD	965,585	0.24
Mexico				
America Movil SAB de CV 3.625% 22/4/2029	1,500,000	USD	1,415,042	0.36
Multinational				
Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 3.875% 15/1/2027	592,000	USD	575,662	0.14
JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co / JBS Luxembourg SARL ‘144A’ 6.75% 15/3/2034	3,550,000	USD	3,727,500	0.94
JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co / JBS USA Finance Inc 2.5% 15/1/2027	980,000	USD	894,250	0.23
JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co / JBS USA Finance Inc 3.75% 1/12/2031	1,000,000	USD	855,000	0.22
NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc 3.15% 1/5/2027	280,000	USD	265,209	0.07
			6,317,621	1.60
Netherlands				
ING Groep NV FRN 11/9/2034	2,400,000	USD	2,510,119	0.63
Norway				
Var Energi ASA ‘144A’ 7.5% 15/1/2028	625,000	USD	662,743	0.17
Var Energi ASA ‘144A’ 8% 15/11/2032	800,000	USD	902,326	0.23
Yara International ASA ‘144A’ 7.378% 14/11/2032	1,000,000	USD	1,105,800	0.28
			2,670,869	0.68

銘柄	数量	通貨	評価金額	対純資産 比率(%)
Spain				
Banco Santander SA 5.147% 18/8/2025	500,000	USD	497,519	0.13
Banco Santander SA 6.921% 8/8/2033	2,300,000	USD	2,441,954	0.62
Banco Santander SA FRN 24/3/2028	600,000	USD	575,868	0.14
CaixaBank SA '144A' FRN 13/9/2034	1,500,000	USD	1,579,601	0.40
			<u>5,094,942</u>	<u>1.29</u>
Switzerland				
Credit Suisse AG/New York NY 5% 9/7/2027	1,200,000	USD	1,200,658	0.30
UBS AG/London 5.65% 11/9/2028	1,880,000	USD	1,946,550	0.49
UBS AG/London 5.8% 11/9/2025	1,880,000	USD	1,897,990	0.48
UBS Group AG '144A' FRN 12/5/2028	532,000	USD	523,361	0.13
UBS Group AG '144A' FRN 22/9/2029	2,896,000	USD	3,012,271	0.76
UBS Group AG '144A' FRN 22/9/2034	1,000,000	USD	1,052,528	0.27
UBS Group AG '144A' FRN 15/7/2026	1,783,000	USD	1,802,349	0.46
UBS Group AG '144A' FRN 15/11/2033	1,200,000	USD	1,470,569	0.37
			<u>12,906,276</u>	<u>3.26</u>
United Kingdom				
Anglo American Capital Plc '144A' 2.875% 17/3/2031	750,000	USD	637,226	0.16
Anglo American Capital Plc '144A' 4.5% 15/3/2028	548,000	USD	530,747	0.13
Anglo American Capital Plc '144A' 4.875% 14/5/2025	238,000	USD	236,013	0.06
Barclays Plc FRN 24/11/2027	1,000,000	USD	914,943	0.23
Barclays Plc FRN 13/9/2029	1,800,000	USD	1,871,030	0.47
Barclays Plc FRN 27/6/2034	1,000,000	USD	1,058,122	0.27
British Telecommunications Plc '144A' 3.25% 8/11/2029	800,000	USD	728,634	0.18
CSL Finance Plc '144A' 4.25% 27/4/2032	1,600,000	USD	1,550,707	0.39
HSBC Holdings Plc FRN 18/4/2026	1,000,000	USD	949,922	0.24
HSBC Holdings Plc FRN 17/8/2029	600,000	USD	522,532	0.13
HSBC Holdings Plc FRN 24/5/2032	790,000	USD	659,342	0.17
HSBC Holdings Plc FRN 14/8/2027	700,000	USD	709,047	0.18
HSBC Holdings Plc FRN 9/3/2029	1,500,000	USD	1,545,295	0.39
Lloyds Banking Group Plc 4.65% 24/3/2026	940,000	USD	919,550	0.23
Nationwide Building Society '144A' FRN 18/10/2027	1,300,000	USD	1,342,839	0.34
NatWest Group Plc FRN 22/3/2025	825,000	USD	821,966	0.21
Royalty Pharma Plc 1.2% 2/9/2025	1,000,000	USD	932,668	0.24
Royalty Pharma Plc 3.3% 2/9/2040	600,000	USD	450,406	0.11
Royalty Pharma Plc 3.35% 2/9/2051	500,000	USD	339,735	0.09
Smith & Nephew Plc 2.032% 14/10/2030	3,700,000	USD	3,053,518	0.77
Vodafone Group Plc 5.625% 10/2/2053	800,000	USD	814,000	0.21
			<u>20,588,242</u>	<u>5.20</u>
United States				
AbbVie Inc 3.2% 14/5/2026	1,200,000	USD	1,160,924	0.29
AbbVie Inc 3.2% 21/11/2029	4,900,000	USD	4,565,462	1.15
AbbVie Inc 4.3% 14/5/2036	527,000	USD	501,972	0.13
AbbVie Inc 4.875% 14/11/2048	750,000	USD	732,935	0.19
AEP Transmission Co LLC 3.8% 15/6/2049	425,000	USD	343,569	0.09
AEP Transmission Co LLC 4.5% 15/6/2052	400,000	USD	364,570	0.09
ATG SunAmerica Global Financing X '144A' 6.9% 15/3/2032	400,000	USD	438,273	0.11
Alcon Finance Corp '144A' 2.6% 27/5/2030	1,609,000	USD	1,391,063	0.35
Amcor Finance USA Inc 5.625% 26/5/2033	1,200,000	USD	1,240,968	0.31

銘柄	数量	通貨	評価金額	対純資産 比率(%)
American Airlines 2016-2 Class A Pass Through Trust 3.65% 15/6/2028	883,595	USD	785,594	0.20
American Airlines 2016-2 Class AA Pass Through Trust 3.2% 15/6/2028	975,327	USD	890,519	0.22
American Tower Corp 1.45% 15/9/2026	1,807,000	USD	1,646,152	0.42
American Tower Corp 2.9% 15/1/2030	2,600,000	USD	2,317,435	0.59
Ameriprise Financial Inc 5.7% 15/12/2028	1,500,000	USD	1,564,522	0.40
Amgen Inc 1.65% 15/8/2028	1,500,000	USD	1,324,688	0.33
Amgen Inc 3.15% 21/2/2040	600,000	USD	467,752	0.12
Amgen Inc 4.2% 22/2/2052	300,000	USD	253,021	0.06
Amgen Inc 4.4% 1/5/2045	325,000	USD	289,489	0.07
Amgen Inc 5.25% 2/3/2030	1,400,000	USD	1,434,359	0.36
Amgen Inc 5.65% 15/6/2042	700,000	USD	722,944	0.18
Amgen Inc 5.65% 2/3/2053	1,000,000	USD	1,048,181	0.26
Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.7% 1/2/2036	1,300,000	USD	1,293,317	0.33
Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 5.45% 23/1/2039	2,500,000	USD	2,637,625	0.67
Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 8.2% 15/1/2039	745,000	USD	991,374	0.25
Aon Corp / Aon Global Holdings Plc 3.9% 28/2/2052	600,000	USD	475,270	0.12
Aon Corp / Aon Global Holdings Plc 5% 12/9/2032	500,000	USD	495,509	0.13
AptarGroup Inc 3.6% 15/3/2032	439,000	USD	396,394	0.10
Ares Finance Co IV LLC '144A' 3.65% 1/2/2052	423,000	USD	301,017	0.08
Ashtead Capital Inc '144A' 4% 1/5/2028	426,000	USD	398,843	0.10
Ashtead Capital Inc '144A' 5.95% 15/10/2033	1,880,000	USD	1,920,146	0.49
AT&T Inc 3.5% 15/9/2053	2,400,000	USD	1,744,992	0.44
AT&T Inc 3.65% 1/6/2051	2,300,000	USD	1,743,860	0.44
AT&T Inc 3.8% 1/12/2057	400,000	USD	299,478	0.08
AT&T Inc 4.3% 15/12/2042	364,000	USD	318,722	0.08
AT&T Inc 4.35% 1/3/2029	1,150,000	USD	1,131,157	0.29
AT&T Inc 5.25% 1/3/2037	500,000	USD	502,822	0.13
AT&T Inc 5.4% 15/2/2034	2,800,000	USD	2,888,270	0.73
AutoZone Inc 1.65% 15/1/2031	700,000	USD	562,961	0.14
Bank of America Corp FRN 21/9/2036	1,500,000	USD	1,183,358	0.30
Bank of America Corp FRN 29/4/2031	1,500,000	USD	1,290,830	0.33
Bank of America Corp FRN 25/4/2029	1,000,000	USD	1,004,508	0.25
Bank of America Corp FRN 15/9/2029	4,000,000	USD	4,127,228	1.04
Bank of America Corp 'MTN' FRN 24/10/2031	750,000	USD	609,277	0.15
Bank of America Corp 'MTN' FRN 7/2/2030	1,000,000	USD	946,774	0.24
Bayer US Finance II LLC '144A' 4.25% 15/12/2025	667,000	USD	649,289	0.16
Bayer US Finance II LLC '144A' 4.625% 25/6/2038	1,500,000	USD	1,285,252	0.32
Berkshire Hathaway Finance Corp 2.85% 15/10/2050	637,000	USD	445,629	0.11
Bio-Rad Laboratories Inc 3.3% 15/3/2027	478,000	USD	452,879	0.11
Blackstone Private Credit Fund 4% 15/1/2029	1,000,000	USD	909,992	0.23
Boeing Co/The 3.2% 1/3/2029	1,650,000	USD	1,532,570	0.39
Boeing Co/The 3.25% 1/2/2035	310,000	USD	261,554	0.07
Boeing Co/The 3.625% 1/2/2031	300,000	USD	278,707	0.07
Boeing Co/The 5.805% 1/5/2050	1,640,000	USD	1,708,439	0.43
Boston Gas Co '144A' 6.119% 20/7/2053	850,000	USD	900,116	0.23
BP Capital Markets America Inc 3.06% 17/6/2041	1,400,000	USD	1,082,340	0.27
BP Capital Markets America Inc 4.812% 13/2/2033	966,000	USD	972,159	0.25
BP Capital Markets America Inc 4.893% 11/9/2033	500,000	USD	506,173	0.13
Broadcom Inc '144A' 3.419% 15/4/2033	890,000	USD	781,816	0.20
Broadcom Inc '144A' 3.469% 15/4/2034	900,000	USD	782,652	0.20

銘柄	数量	通貨	評価金額	対純資産 比率(%)
Broadcom Inc '144A' 4.926% 15/5/2037	201,000	USD	194,365	0.05
Burlington Northern Santa Fe LLC 5.2% 15/4/2054	1,000,000	USD	1,042,481	0.26
Celanese US Holdings LLC 6.33% 15/7/2029	1,500,000	USD	1,565,562	0.40
Celanese US Holdings LLC 6.55% 15/11/2030	1,043,000	USD	1,103,479	0.28
Centene Corp 2.5% 1/3/2031	700,000	USD	583,719	0.15
Centene Corp 3.375% 15/2/2030	2,000,000	USD	1,792,500	0.45
CenterPoint Energy Resources Corp 5.25% 1/3/2028	1,200,000	USD	1,228,318	0.31
Cheniere Energy Partners LP '144A' 5.95% 30/6/2033	704,000	USD	723,360	0.18
Chevron USA Inc 3.25% 15/10/2029	475,000	USD	450,307	0.11
Cigna Group/The 3.2% 15/3/2040	403,000	USD	315,974	0.08
Cigna Group/The 4.375% 15/10/2028	470,000	USD	464,763	0.12
Citibank NA 'BKNT' 5.488% 4/12/2026	3,710,000	USD	3,777,069	0.95
Citigroup Inc FRN 3/11/2032	2,000,000	USD	1,648,156	0.42
Citigroup Inc FRN 31/3/2031	600,000	USD	574,558	0.15
Comcast Corp 2.887% 1/11/2051	3,000,000	USD	2,024,178	0.51
Comcast Corp 3.75% 1/4/2040	1,000,000	USD	860,850	0.22
Connecticut Light and Power Co/The 2.05% 1/7/2031	2,000,000	USD	1,664,952	0.42
ConocoPhillips Co 5.3% 15/5/2053	834,000	USD	857,251	0.22
ConocoPhillips Co 5.7% 15/9/2063	554,000	USD	600,255	0.15
Consolidated Edison Co of New York Inc 4.45% 15/3/2044	1,000,000	USD	895,904	0.23
Consolidated Edison Co of New York Inc 5.5% 1/12/2039	704,000	USD	715,180	0.18
Consolidated Edison Co of New York Inc 5.9% 15/11/2053	1,250,000	USD	1,381,880	0.35
Constellation Brands Inc 2.25% 1/8/2031	730,000	USD	612,257	0.15
Constellation Brands Inc 4.9% 1/5/2033	295,000	USD	296,023	0.07
Constellation Energy Generation LLC 6.125% 15/1/2034	281,000	USD	301,663	0.08
Constellation Energy Generation LLC 6.5% 1/10/2053	348,000	USD	391,857	0.10
Continental Airlines 2012-2 Class A Pass Through Trust 4% 29/10/2024	675,759	USD	658,870	0.17
Corebridge Financial Inc 4.4% 5/4/2052	700,000	USD	585,273	0.15
Corebridge Financial Inc 5.75% 15/1/2034	500,000	USD	510,781	0.13
Cox Communications Inc '144A' 4.7% 15/12/2042	174,000	USD	149,963	0.04
Crown Castle Inc 2.1% 1/4/2031	1,500,000	USD	1,227,080	0.31
CVS Health Corp 3% 15/8/2026	480,000	USD	459,025	0.12
CVS Health Corp 4.78% 25/3/2038	3,055,000	USD	2,882,460	0.73
CVS Health Corp 5.625% 21/2/2053	600,000	USD	607,998	0.15
CVS Pass-Through Trust '144A' 7.507% 10/1/2032	1,062,263	USD	1,118,340	0.28
Darden Restaurants Inc 6.3% 10/10/2033	1,800,000	USD	1,937,840	0.49
Dell International LLC / EMC Corp 8.35% 15/7/2046	32,000	USD	42,255	0.01
Diamondback Energy Inc 6.25% 15/3/2033	500,000	USD	534,786	0.13
Discover Bank 2.45% 12/9/2024	800,000	USD	780,392	0.20
Duke Energy Corp 4.2% 15/6/2049	775,000	USD	641,468	0.16
Duke Energy Corp 5% 8/12/2025	1,209,000	USD	1,210,934	0.31
Duke Energy Florida LLC 5.95% 15/11/2052	639,000	USD	707,500	0.18
Eastman Chemical Co 5.75% 8/3/2033	700,000	USD	724,967	0.18
Edison International 5.25% 15/11/2028	997,000	USD	1,003,771	0.25
Elevance Health Inc 2.25% 15/5/2030	1,800,000	USD	1,556,476	0.39
Elevance Health Inc 4.55% 15/5/2052	750,000	USD	681,158	0.17
Elevance Health Inc 6.1% 15/10/2052	388,000	USD	439,799	0.11
Enel Finance America LLC '144A' 2.875% 12/7/2041	625,000	USD	424,988	0.11
Enel Finance America LLC '144A' 7.1% 14/10/2027	300,000	USD	318,750	0.08
Energy Transfer LP 4.95% 15/6/2028	816,000	USD	811,666	0.20
Energy Transfer LP 5% 15/5/2050	1,900,000	USD	1,699,115	0.43
Energy Transfer LP 5.8% 15/6/2038	455,000	USD	458,997	0.12

銘柄	数量	通貨	評価金額	対純資産 比率(%)
Energy Transfer LP 6.4% 1/12/2030	1,804,000	USD	1,926,836	0.49
Energy Transfer LP 6.55% 1/12/2033	400,000	USD	431,664	0.11
Energy Louisiana LLC 4.75% 15/9/2052	305,000	USD	282,548	0.07
Enterprise Products Operating LLC 6.125% 15/10/2039	689,000	USD	751,689	0.19
Enterprise Products Operating LLC 7.55% 15/4/2038	875,000	USD	1,069,103	0.27
Equinix Inc 2.9% 18/11/2026	997,000	USD	943,974	0.24
Equitable Financial Life Global Funding '144A' 1% 9/1/2026	600,000	USD	549,695	0.14
Equitable Financial Life Global Funding '144A' 1.7% 12/11/2026	775,000	USD	696,463	0.18
Essential Properties LP 2.95% 15/7/2031	800,000	USD	629,370	0.16
Essential Utilities Inc 2.704% 15/4/2030	498,000	USD	435,718	0.11
Eversource Energy 2.55% 15/3/2031	468,000	USD	399,082	0.10
Eversource Energy 2.9% 1/3/2027	2,000,000	USD	1,889,400	0.48
Eversource Energy 4.75% 15/5/2026	1,079,000	USD	1,073,022	0.27
Exelon Corp 4.1% 15/3/2052	501,000	USD	407,399	0.10
Exelon Corp 5.6% 15/3/2053	500,000	USD	509,329	0.13
Extra Space Storage LP 2.4% 15/10/2031	900,000	USD	740,318	0.19
Extra Space Storage LP 3.9% 1/4/2029	398,000	USD	374,469	0.09
F&G Global Funding '144A' 1.75% 30/6/2026	1,500,000	USD	1,356,999	0.34
F&G Global Funding '144A' 2.3% 11/4/2027	1,500,000	USD	1,347,112	0.34
FedEx Corp 5.25% 15/5/2050	500,000	USD	499,325	0.13
Five Corners Funding Trust II '144A' 2.85% 15/5/2030	1,085,000	USD	961,506	0.24
Florida Gas Transmission Co LLC '144A' 2.3% 1/10/2031	800,000	USD	655,837	0.17
FMC Corp 3.45% 1/10/2029	340,000	USD	307,956	0.08
Ford Motor Credit Co LLC 6.798% 7/11/2028	1,239,000	USD	1,291,771	0.33
GA Global Funding Trust '144A' 2.25% 6/1/2027	2,300,000	USD	2,086,808	0.53
GATX Corp 6.9% 1/5/2034	1,840,000	USD	2,017,656	0.51
General Motors Financial Co Inc 5.8% 23/6/2028	2,000,000	USD	2,051,924	0.52
General Motors Financial Co Inc 6.05% 10/10/2025	1,000,000	USD	1,010,299	0.26
Georgia Power Co 4.3% 15/3/2042	455,000	USD	405,176	0.10
Gilead Sciences Inc 2.6% 1/10/2040	600,000	USD	440,933	0.11
Gilead Sciences Inc 4.8% 1/4/2044	500,000	USD	483,365	0.12
Gilead Sciences Inc 5.55% 15/10/2053	444,000	USD	480,722	0.12
GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 3.25% 15/1/2032	436,000	USD	363,276	0.09
Goldman Sachs Group Inc/The 4.25% 21/10/2025	507,000	USD	497,823	0.13
Goldman Sachs Group Inc/The 6.25% 1/2/2041	500,000	USD	557,199	0.14
Goldman Sachs Group Inc/The 6.75% 1/10/2037	500,000	USD	546,659	0.14
Goldman Sachs Group Inc/The FRN 9/12/2026	936,000	USD	861,102	0.22
Goldman Sachs Group Inc/The FRN 21/10/2027	1,500,000	USD	1,369,480	0.35
Goldman Sachs Group Inc/The FRN 23/4/2039	550,000	USD	496,767	0.13
Guardian Life Insurance Co of America/The '144A' 4.85% 24/1/2077	300,000	USD	256,519	0.06
Halliburton Co 5% 15/11/2045	370,000	USD	357,188	0.09
Hartford Financial Services Group Inc/The 3.6% 19/8/2049	225,000	USD	174,390	0.04
HCA Inc 4.625% 15/3/2052	1,000,000	USD	850,381	0.21
Holcim Finance US LLC '144A' 4.75% 22/9/2046	500,000	USD	450,625	0.11
Host Hotels & Resorts LP 2.9% 15/12/2031	364,000	USD	305,538	0.08
Humana Inc 4.625% 1/12/2042	244,000	USD	222,800	0.06
Humana Inc 5.75% 1/3/2028	1,060,000	USD	1,098,103	0.28
Humana Inc 5.95% 15/3/2034	1,500,000	USD	1,606,083	0.41
Hyatt Hotels Corp 5.75% 30/1/2027	2,020,000	USD	2,059,725	0.52
Hyatt Hotels Corp 5.75% 23/4/2030	950,000	USD	982,600	0.25
Hyundai Capital America '144A' 1.65% 17/9/2026	1,000,000	USD	907,590	0.23

銘柄	数量	通貨	評価金額	対純資産 比率(%)
Hyundai Capital America '144A' 6.1% 21/9/2028	3,720,000	USD	3,856,249	0.97
Indiana University Health Inc Obligated Group 2.852% 1/11/2051	581,000	USD	401,285	0.10
Ingredion Inc 3.2% 1/10/2026	632,000	USD	604,210	0.15
International Flavors & Fragrances Inc '144A' 1.832% 15/10/2027	242,000	USD	211,792	0.05
International Flavors & Fragrances Inc '144A' 2.3% 1/11/2030	569,000	USD	469,768	0.12
ITC Holdings Corp 3.25% 30/6/2026	804,000	USD	773,134	0.20
Jersey Central Power & Light Co 6.4% 15/5/2036	370,000	USD	399,712	0.10
Jersey Central Power & Light Co '144A' 4.3% 15/1/2026	325,000	USD	318,074	0.08
JobsOhio Beverage System 2.833% 1/1/2038	175,000	USD	143,040	0.04
John Deere Capital Corp 'MTN' 4.95% 6/6/2025	1,000,000	USD	1,003,614	0.25
JPMorgan Chase & Co FRN 1/6/2029	700,000	USD	617,766	0.16
JPMorgan Chase & Co FRN 1/2/2028	2,000,000	USD	1,931,044	0.49
JPMorgan Chase & Co FRN 23/7/2029	2,000,000	USD	1,939,668	0.49
JPMorgan Chase & Co FRN 1/6/2034	1,604,000	USD	1,628,171	0.41
JPMorgan Chase & Co FRN (Perpetual)	500,000	USD	491,875	0.12
JPMorgan Chase Bank NA 5.11% 8/12/2026	2,000,000	USD	2,017,764	0.51
Keurig Dr Pepper Inc 3.95% 15/4/2029	600,000	USD	584,115	0.15
Keurig Dr Pepper Inc 4.42% 15/12/2046	200,000	USD	177,278	0.04
Kinder Morgan Energy Partners LP 7.75% 15/3/2032	405,000	USD	457,572	0.12
Kinder Morgan Inc 5.2% 1/6/2033	1,006,000	USD	1,003,841	0.25
KKR Group Finance Co X LLC '144A' 3.25% 15/12/2051	535,000	USD	368,793	0.09
Kraft Heinz Foods Co 4.375% 1/6/2046	1,600,000	USD	1,397,773	0.35
L3Harris Technologies Inc 5.4% 31/7/2033	1,243,000	USD	1,288,634	0.33
Liberty Mutual Group Inc '144A' 3.951% 15/10/2050	400,000	USD	305,182	0.08
LKQ Corp 5.75% 15/6/2028	781,000	USD	786,319	0.20
Lowe's Cos Inc 3% 15/10/2050	900,000	USD	609,588	0.15
Lowe's Cos Inc 5.625% 15/4/2053	600,000	USD	627,460	0.16
Marathon Petroleum Corp 4.5% 1/4/2048	330,000	USD	277,141	0.07
Marriott International Inc/MD 3.5% 15/10/2032	700,000	USD	623,207	0.16
Marriott International Inc/MD 4.65% 1/12/2028	1,100,000	USD	1,090,658	0.28
Marriott International Inc/MD 4.9% 15/4/2029	465,000	USD	466,647	0.12
Mars Inc '144A' 2.375% 16/7/2040	555,000	USD	397,425	0.10
Mars Inc '144A' 3.875% 1/4/2039	680,000	USD	597,585	0.15
Marsh & McLennan Cos Inc 2.375% 15/12/2031	400,000	USD	339,378	0.09
Marsh & McLennan Cos Inc 5.45% 15/3/2053	448,000	USD	467,405	0.12
McDonald's Corp 4.95% 14/8/2033	1,800,000	USD	1,848,116	0.47
McKesson Corp 1.3% 15/8/2026	2,280,000	USD	2,085,625	0.53
Meta Platforms Inc 5.6% 15/5/2053	800,000	USD	868,472	0.22
MetLife Capital Trust IV '144A' 7.875% 15/12/2037	1,475,000	USD	1,583,781	0.40
MetLife Inc '144A' 9.25% 8/4/2038	405,000	USD	464,250	0.12
Microsoft Corp '144A' 2.5% 15/9/2050	595,000	USD	401,632	0.10
Mondelez International Inc 1.5% 4/2/2031	533,000	USD	432,940	0.11
Morgan Stanley FRN 19/1/2038	442,000	USD	445,121	0.11
Morgan Stanley FRN 1/11/2029	1,646,000	USD	1,740,984	0.44
Morgan Stanley 'MTN' FRN 20/4/2029	2,870,000	USD	2,876,328	0.73
Morgan Stanley 'MTN' FRN 21/4/2034	600,000	USD	598,868	0.15
Morgan Stanley 'MTN' FRN 21/7/2034	844,000	USD	851,967	0.22
MPLX LP 4.5% 15/4/2038	520,000	USD	464,473	0.12
MPLX LP 5.5% 15/2/2049	400,000	USD	386,972	0.10
MPLX LP 5.65% 1/3/2053	208,000	USD	205,890	0.05
Mylan Inc 5.2% 15/4/2048	300,000	USD	245,145	0.06
Nationwide Mutual Insurance Co '144A' 9.375% 15/8/2039	1,005,000	USD	1,326,290	0.34

銘柄	数量	通貨	評価金額	対純資産 比率(%)
Nevada Power Co 6% 15/3/2054	337,000	USD	371,763	0.09
Nordson Corp 5.8% 15/9/2033	195,000	USD	206,462	0.05
Norfolk Southern Corp 5.35% 1/8/2054	1,400,000	USD	1,449,204	0.37
Northern Natural Gas Co '144A' 3.4% 16/10/2051	279,000	USD	196,664	0.05
Northern States Power Co/MN 5.1% 15/5/2053	400,000	USD	408,082	0.10
Northwestern Memorial Healthcare Obligated Group 2.633% 15/7/2051	320,000	USD	212,823	0.05
Occidental Petroleum Corp 8.875% 15/7/2030	750,000	USD	876,563	0.22
Ohio Power Co 2.9% 1/10/2051	1,000,000	USD	682,752	0.17
Oncor Electric Delivery Co LLC 5.25% 30/9/2040	400,000	USD	408,935	0.10
Oncor Electric Delivery Co LLC '144A' 4.3% 15/5/2028	1,000,000	USD	986,995	0.25
Oracle Corp 3.6% 1/4/2040	500,000	USD	398,941	0.10
Oracle Corp 3.6% 1/4/2050	900,000	USD	667,313	0.17
Oracle Corp 3.65% 25/3/2041	1,260,000	USD	1,007,602	0.25
Ovintiv Inc 5.65% 15/5/2028	1,800,000	USD	1,831,072	0.46
Ovintiv Inc 6.25% 15/7/2033	608,000	USD	628,582	0.16
Pacific Gas and Electric Co 3.3% 1/12/2027	500,000	USD	466,762	0.12
Pacific Gas and Electric Co 4.5% 1/7/2040	635,000	USD	540,322	0.14
Pacific Gas and Electric Co 4.55% 1/7/2030	1,500,000	USD	1,428,935	0.36
Pacific Gas and Electric Co 4.95% 1/7/2050	700,000	USD	601,917	0.15
Pacific Gas and Electric Co 6.1% 15/1/2029	740,000	USD	764,561	0.19
Pacific Gas and Electric Co 6.7% 1/4/2053	690,000	USD	752,074	0.19
Pacific Gas and Electric Co 6.75% 15/1/2053	1,400,000	USD	1,539,080	0.39
PacifiCorp 5.5% 15/5/2054	300,000	USD	295,192	0.07
Parker-Hannifin Corp 4.5% 15/9/2029	639,000	USD	638,844	0.16
PECO Energy Co 2.85% 15/9/2051	600,000	USD	410,099	0.10
Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp '144A' 6.2% 15/6/2030	509,000	USD	534,953	0.14
Piedmont Natural Gas Co Inc 3.5% 1/6/2029	600,000	USD	560,385	0.14
Pioneer Natural Resources Co 1.9% 15/8/2030	1,500,000	USD	1,268,169	0.32
PNC Financial Services Group Inc/The FRN 12/6/2029	1,400,000	USD	1,426,111	0.36
PPL Electric Utilities Corp 5.25% 15/5/2053	954,000	USD	986,246	0.25
Priscoa Global Funding I '144A' 5.55% 28/8/2026	560,000	USD	571,318	0.14
Prologis LP 5.125% 15/1/2034	1,710,000	USD	1,763,137	0.45
Prologis LP 5.25% 15/6/2053	300,000	USD	314,022	0.08
Protective Life Global Funding '144A' 0.781% 5/7/2024	2,000,000	USD	1,951,326	0.49
Public Service Electric and Gas Co 5.45% 1/8/2053	940,000	USD	1,022,642	0.26
Public Service Electric and Gas Co 'MTN' 4.9% 15/12/2032	449,000	USD	457,949	0.12
Public Service Electric and Gas Co 'MTN' 5.125% 15/3/2053	553,000	USD	576,516	0.15
Public Service Enterprise Group Inc 5.85% 15/11/2027	1,981,000	USD	2,059,634	0.52
Quest Diagnostics Inc 2.95% 30/6/2030	404,000	USD	360,279	0.09
Quest Diagnostics Inc 6.4% 30/11/2033	1,000,000	USD	1,103,168	0.28
Regal Rexnord Corp '144A' 6.05% 15/4/2028	780,000	USD	786,730	0.20
Regal Rexnord Corp '144A' 6.4% 15/4/2033	300,000	USD	312,080	0.08
Reliance Standard Life Global Funding II '144A' 5.243% 2/2/2026	1,000,000	USD	993,335	0.25
Republic Services Inc 4.875% 1/4/2029	3,000,000	USD	3,047,460	0.77
Roper Technologies Inc 1% 15/9/2025	341,000	USD	318,414	0.08
RPM International Inc 4.55% 1/3/2029	775,000	USD	763,544	0.19
RTX Corp 5.15% 27/2/2033	1,600,000	USD	1,629,552	0.41
RTX Corp 5.375% 27/2/2053	1,032,000	USD	1,046,185	0.26
RTX Corp 6% 15/3/2031	785,000	USD	835,242	0.21
RTX Corp 6.1% 15/3/2034	500,000	USD	540,832	0.14

銘柄	数量	通貨	評価金額	対純資産 比率(%)
S&P Global Inc '144A' 5.25% 15/9/2033	1,200,000	USD	1,250,873	0.32
Sabine Pass Liquefaction LLC 4.5% 15/5/2030	1,500,000	USD	1,466,250	0.37
Sabine Pass Liquefaction LLC 5% 15/3/2027	750,000	USD	751,875	0.19
Sabine Pass Liquefaction LLC 5.875% 30/6/2026	1,222,000	USD	1,243,385	0.31
Southern California Edison Co 3.65% 1/2/2050	600,000	USD	466,544	0.12
Southern California Edison Co 4.125% 1/3/2048	359,000	USD	303,118	0.08
Southern California Edison Co 5.7% 1/3/2053	278,000	USD	293,058	0.07
Southern California Edison Co 5.85% 1/11/2027	390,000	USD	406,814	0.10
Southern California Edison Co 5.875% 1/12/2053	354,000	USD	381,002	0.10
Southern Co/The 4.85% 15/6/2028	1,000,000	USD	1,005,370	0.25
Southern Co/The 5.2% 15/6/2033	500,000	USD	509,788	0.13
Southwest Gas Corp 5.45% 23/3/2028	585,000	USD	599,931	0.15
State Street Corp FRN 18/5/2034	1,100,000	USD	1,109,171	0.28
Synovus Bank/Columbus GA 5.625% 15/2/2028	486,000	USD	467,352	0.12
Sysco Corp 6% 17/1/2034	1,400,000	USD	1,510,722	0.38
Sysco Corp 6.6% 1/4/2050	181,000	USD	211,012	0.05
Targa Resources Corp 4.95% 15/4/2052	800,000	USD	703,803	0.18
Targa Resources Corp 6.15% 1/3/2029	1,297,000	USD	1,350,077	0.34
Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 4% 15/1/2032	745,000	USD	679,812	0.17
Thermo Fisher Scientific Inc 5% 5/12/2026	1,500,000	USD	1,520,023	0.38
Thermo Fisher Scientific Inc 5.086% 10/8/2033	1,000,000	USD	1,036,379	0.26
T-Mobile USA Inc 2.05% 15/2/2028	680,000	USD	611,987	0.15
T-Mobile USA Inc 3.3% 15/2/2051	420,000	USD	304,469	0.08
T-Mobile USA Inc 5.05% 15/7/2033	2,200,000	USD	2,210,619	0.56
T-Mobile USA Inc 5.75% 15/1/2034	2,049,000	USD	2,167,901	0.55
T-Mobile USA Inc 5.8% 15/9/2062	800,000	USD	860,064	0.22
Tractor Supply Co 5.25% 15/5/2033	303,000	USD	310,065	0.08
Truist Financial Corp FRN (Perpetual)	630,000	USD	598,500	0.15
UL Solutions Inc '144A' 6.5% 20/10/2028	808,000	USD	842,098	0.21
Union Pacific Corp 3.5% 14/2/2053	400,000	USD	319,822	0.08
Union Pacific Corp 3.6% 15/9/2037	520,000	USD	461,967	0.12
Union Pacific Corp 3.799% 1/10/2051	400,000	USD	334,572	0.08
Union Pacific Corp 3.95% 15/8/2059	500,000	USD	409,572	0.10
United Airlines 2012-1 Class A Pass Through Trust 4.15% 11/4/2024	1,570,411	USD	1,555,637	0.39
United Airlines 2023-1 Class A Pass Through Trust 5.8% 15/1/2036	2,030,000	USD	2,051,082	0.52
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0% 6/2/2024	8,700,000	USD	8,650,189	2.19
UPMC 5.035% 15/5/2033	745,000	USD	752,814	0.19
US Bancorp FRN 12/6/2029	1,000,000	USD	1,022,520	0.26
Valero Energy Corp 3.65% 1/12/2051	700,000	USD	507,510	0.13
Verizon Communications Inc 2.65% 20/11/2040	1,000,000	USD	722,617	0.18
Verizon Communications Inc 4.329% 21/9/2028	800,000	USD	789,460	0.20
Verizon Communications Inc 4.4% 1/11/2034	3,000,000	USD	2,887,218	0.73
VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A' 4.125% 15/8/2030	450,000	USD	410,625	0.10
Virginia Electric and Power Co 8.875% 15/11/2038	180,000	USD	245,598	0.06
Volkswagen Group of America Finance LLC '144A' 4.75% 13/11/2028	450,000	USD	444,606	0.11
Walt Disney Co/The 3.5% 13/5/2040	1,500,000	USD	1,264,696	0.32
Warnermedia Holdings Inc 5.141% 15/3/2052	1,700,000	USD	1,466,048	0.37
Waste Management Inc 4.875% 15/2/2034	800,000	USD	813,868	0.21
WEA Finance LLC '144A' 3.5% 15/6/2029	800,000	USD	679,191	0.17

銘柄	数量	通貨	評価金額	対純資産 比率(%)
Wells Fargo & Co FRN 30/4/2041	425,000	USD	321,030	0.08
Wells Fargo & Co 'MTN' 4.1% 3/6/2026	1,000,000	USD	975,828	0.25
Wells Fargo & Co 'MTN' 4.65% 4/11/2044	575,000	USD	512,786	0.13
Wells Fargo & Co 'MTN' FRN 25/4/2053	1,470,000	USD	1,322,080	0.33
Wells Fargo & Co 'MTN' FRN 25/7/2033	1,250,000	USD	1,223,845	0.31
Wells Fargo Bank NA 5.254% 11/12/2026	1,500,000	USD	1,519,227	0.38
Weyerhaeuser Co 3.375% 9/3/2033	560,000	USD	496,311	0.13
Williams Cos Inc/The 5.3% 15/8/2052	1,500,000	USD	1,467,459	0.37
Williams Cos Inc/The 5.65% 15/3/2033	1,000,000	USD	1,040,349	0.26
			<u>302,351,898</u>	<u>76.41</u>
債券合計			<u>384,676,311</u>	<u>97.21</u>
投資総額			<u>386,458,645</u>	<u>97.66</u>
その他資産			<u>9,264,561</u>	<u>2.34</u>
純資産			<u>395,723,206</u>	<u>100.00</u>

「イーストスプリング国内債券ファンド（国債）追加型 I（適格機関投資家向け）」の直近の決算にかかる運用状況をご報告申し上げます。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年2月28日～2024年2月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	23	0.219	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(15)	(0.143)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(2)	(0.022)	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 ）	(6)	(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) そ の 他 費 用	2	0.014	(b) 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)	(0.014)	監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	金銭信託に係る手数料等
合 計	25	0.233	
期中の平均基準価額は、10,610円です。			

(注) 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) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 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。

○組入資産の明細

(2024年2月26日現在)

国内公社債

(A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当		期		末		
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちB B格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	654,500	669,730	92.9	—	43.8	34.6	14.5
合 計	654,500	669,730	92.9	—	43.8	34.6	14.5

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 額面金額・評価額の単位未満は切捨てです。

(注) —印は組入れなしです。

(B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄	当		期		末
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
国債証券	%	千円	千円		
第351回利付国債 (10年)	0.1	50,000	49,616	2028/6/20	
第354回利付国債 (10年)	0.1	59,000	58,281	2029/3/20	
第359回利付国債 (10年)	0.1	175,000	172,032	2030/6/20	
第67回利付国債 (20年)	1.9	45,000	45,055	2024/3/20	
第75回利付国債 (20年)	2.1	20,000	20,438	2025/3/20	
第80回利付国債 (20年)	2.1	38,000	39,011	2025/6/20	
第87回利付国債 (20年)	2.2	55,000	57,318	2026/3/20	
第91回利付国債 (20年)	2.3	135,000	142,406	2026/9/20	
第117回利付国債 (20年)	2.1	77,500	85,570	2030/3/20	
合 計		654,500	669,730		

(注) 額面金額・評価額の単位未満は切捨てです。