

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】

追加型投信/海外/債券

作成対象期間 2024年4月23日～2024年10月21日

(毎月決算型)

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

(年2回決算型)

第17期 2024年10月21日決算

(毎月決算型)

日経新聞掲載名：USAボンド

第101期末(2024年10月21日)	
基準価額	8,698円
純資産総額	231百万円
第96期～第101期	
騰落率	3.4%
分配金(税込み)合計	60円

(年2回決算型)

日経新聞掲載名：USAボンド

第17期末(2024年10月21日)	
基準価額	9,517円
純資産総額	12,945百万円
第17期	
騰落率	3.7%
分配金(税込み)合計	0円

(注) 騰落率は分配金(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、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

(注) 純資産総額の単位未満は切捨てて表示しております。

## 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。

当ファンドは、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。当作成対象期間につきましてもこれに沿った運用を行ってまいりました。ここに、そ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われますよう、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

〒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

<https://www.eastspring.co.jp/>

【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)

当ファンドは、信託約款において運用報告書(全体版)を電磁的方法によりご提供することを定めております。運用報告書(全体版)は、下記の手順で閲覧、ダウンロードすることができます。なお、書面をご請求される方は、販売会社までお問い合わせください。

&lt;運用報告書(全体版)の閲覧・ダウンロード方法&gt;

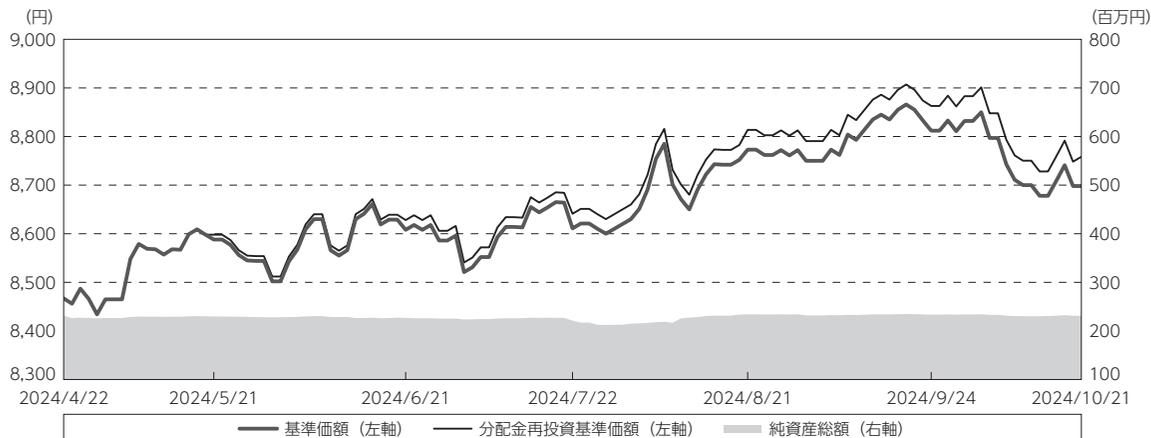
ホームページにアクセス⇒「ファンド情報」を選択⇒ファンド名を選択⇒「目論見書・月報・運用報告書等」の「運用報告書(全体版)」を選択

## 運用経過

(毎月決算型)

### 基準価額等の推移について

(2024年4月23日～2024年10月21日)



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。

## 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	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。

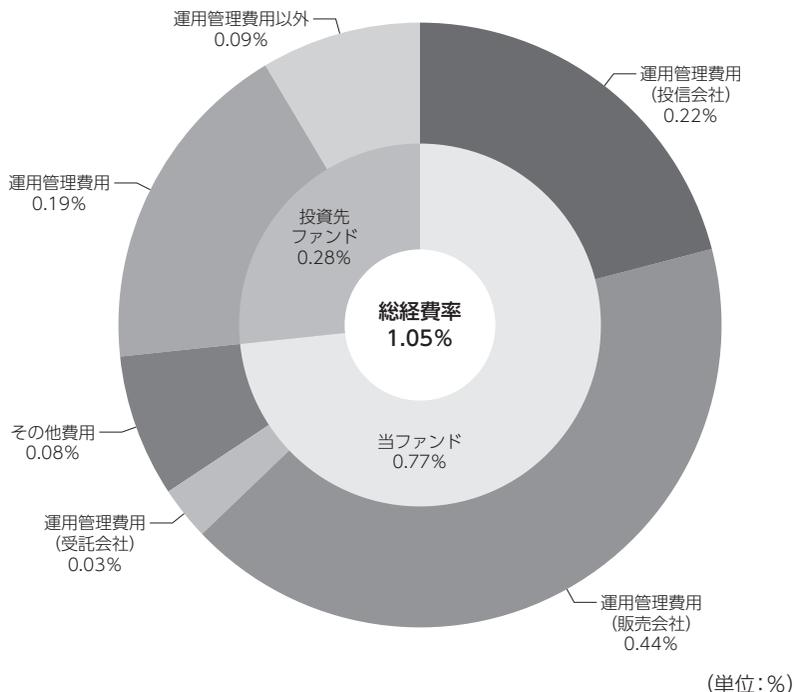
(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(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。当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当たりの費用明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

(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。

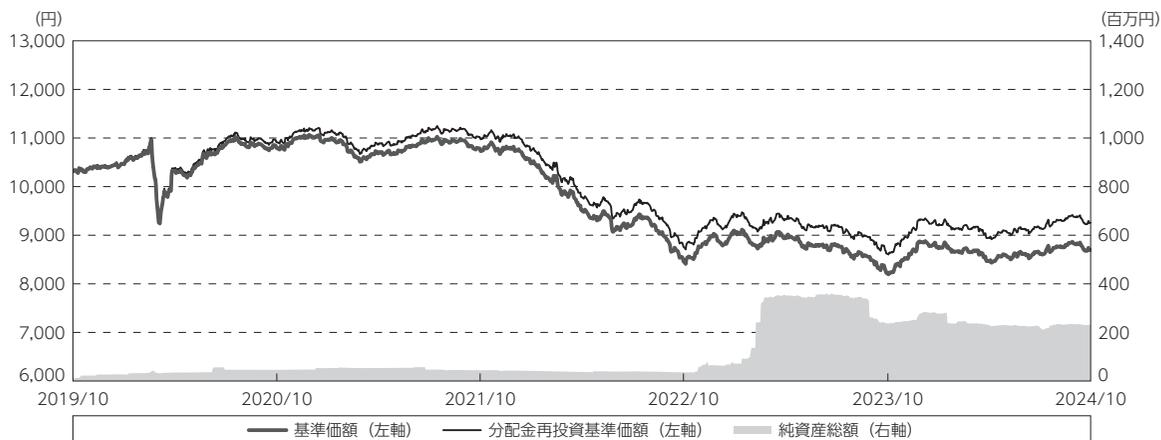
(注) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(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。

## 最近5年間の基準価額等の推移について

(2019年10月21日～2024年10月21日)



- (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、2019年10月21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。

	2019年10月21日 決算日	2020年10月21日 決算日	2021年10月21日 決算日	2022年10月21日 決算日	2023年10月23日 決算日	2024年10月21日 決算日
基準価額 (円)	10,312	10,793	10,749	8,461	8,204	8,698
期間分配金合計(税込み) (円)	—	120	120	120	120	120
分配金再投資基準価額騰落率 (%)	—	5.9	0.7	△ 20.3	△ 1.7	7.5
純資産総額 (百万円)	12	45	44	35	237	231

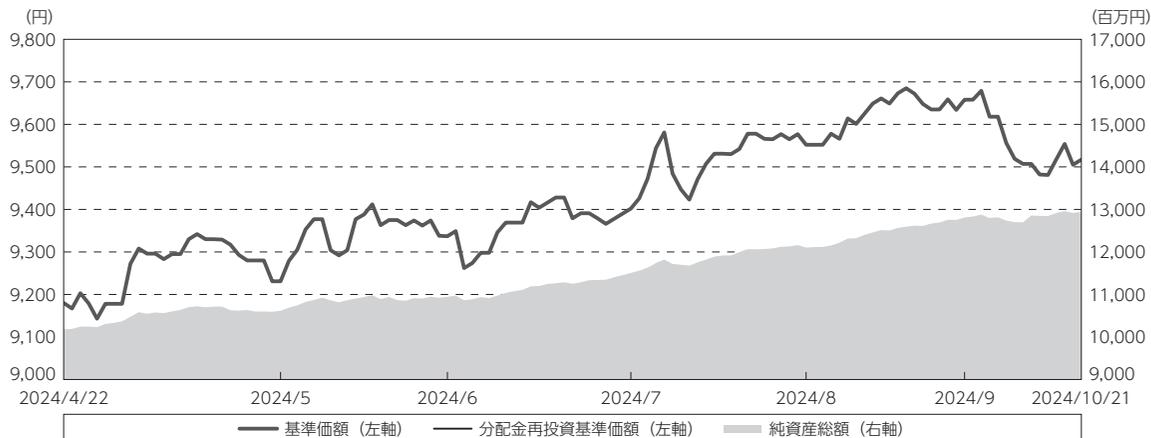
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。
- (注) 純資産総額の単位未満は切捨てて表示しております。
- (注) 騰落率は1年前の決算応当日との比較です。
- (注) 当ファンドにおいては、運用の基本方針に適合した、公表されている指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

## 運用経過

(年2回決算型)

### 基準価額等の推移について

(2024年4月23日～2024年10月21日)



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。

## 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	32	0.346	(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。

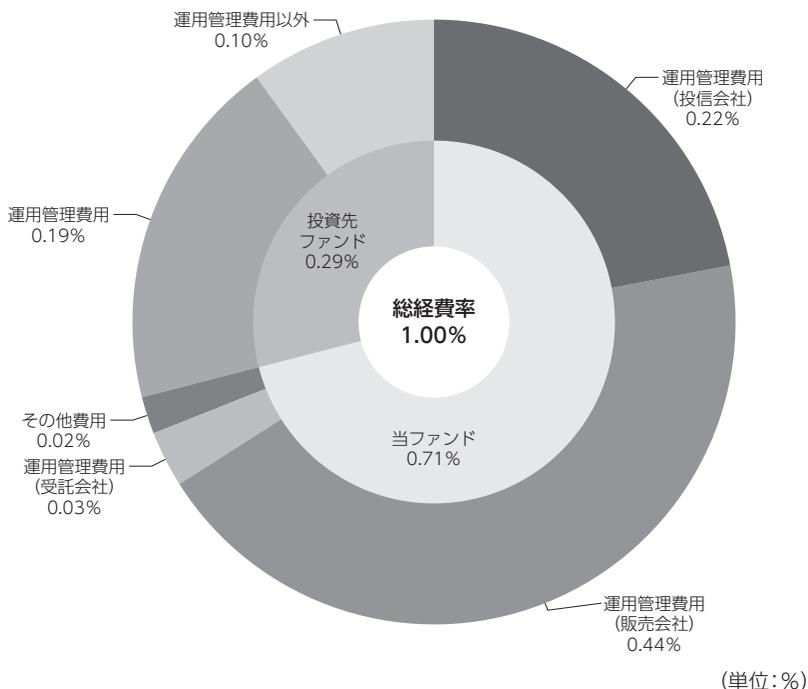
(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(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。当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当たりの費用明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

## (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。

## 最近5年間の基準価額等の推移について

(2019年10月21日～2024年10月21日)



- (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、2019年10月21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。

	2019年10月21日 決算日	2020年10月21日 決算日	2021年10月21日 決算日	2022年10月21日 決算日	2023年10月23日 決算日	2024年10月21日 決算日
基準価額 (円)	10,684	11,241	11,315	8,942	8,795	9,517
期間分配金合計(税込み) (円)	-	0	0	0	0	0
分配金再投資基準価額騰落率 (%)	-	5.2	0.7	△ 21.0	△ 1.6	8.2
純資産総額 (百万円)	66	358	1,887	2,649	6,684	12,945

- (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) 純資産総額の単位未満は切捨てて表示しております。  
 (注) 騰落率は1年前の決算応当日との比較です。  
 (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。

## 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」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。

## 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	10	10	10	10	10	10
(対基準価額比率)	0.116%	0.116%	0.116%	0.114%	0.113%	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) —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) —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US I G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。

#### US I G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。

### お知らせ

該当事項はありません。

### 当ファンドの概要

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・インベストメンツ・USインベストメント・グレード・ボンド・ファンドクラス」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。
運用方法	以下の投資制限のもと運用を行います。 <ul style="list-style-type: none"><li>・投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</li><li>・外貨建資産への直接投資は行いません。</li><li>・株式への直接投資は行いません。</li></ul>
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。

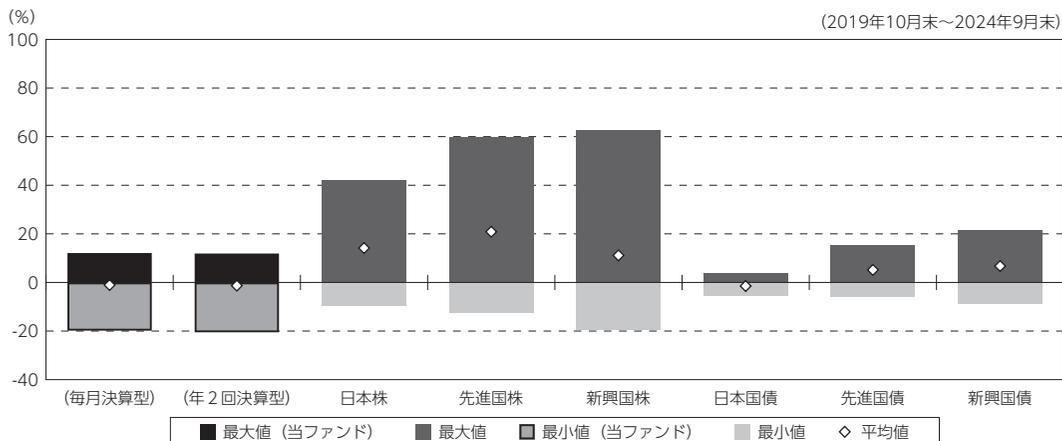
### 指数に関して

当ファンドの投資対象である「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）」のベンチマーク（ICE BofA 国債インデックス（1－10年債））について

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。

(参考情報)

○当ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



(単位: %)

	(毎月決算型)	(年2回決算型)	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	12.1	11.9	42.1	59.8	62.7	3.7	15.3	21.5
最小値	△ 19.8	△ 20.5	△ 9.5	△ 12.4	△ 19.4	△ 5.5	△ 6.1	△ 8.8
平均値	△ 1.1	△ 1.3	14.1	20.9	11.1	△ 1.5	5.2	6.8

(注) 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

(注) 2019年10月から2024年9月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。

(注) 上記の騰落率は決算日に対応した数値とは異なります。

(注) 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

《各資産クラスの指数》

日本株：配当込みTOPIX

先進国株：MSCI - KOKUSAI インデックス (配当込み、円ベース)

新興国株：MSCI エマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)

日本国債：NOMURA - BPI 国債

先進国債：FTSE 世界国債インデックス (除く日本、円ベース)

新興国債：JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)

※各指数についての説明は、後述の「代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について」をご参照ください。

(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

## ファンドデータ

(毎月決算型)

### 当ファンドの組入資産の内容

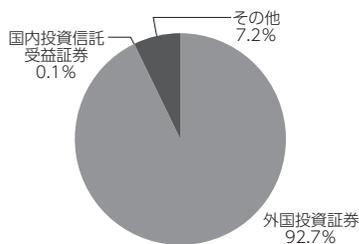
#### ○組入上位ファンド

銘柄名	第101期末 %
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・グレート・ボンド・ファンドクラスJ(JDM)(hedged)	92.7
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)	0.1
組入銘柄数	2銘柄

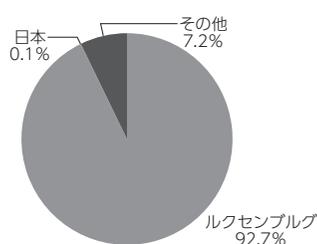
(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 組入銘柄に関する詳細な情報等につきましては、運用報告書(全体版)に記載しております。

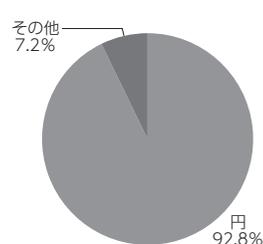
#### ○資産別配分



#### ○国別配分



#### ○通貨別配分



(注) 比率は当ファンドの純資産総額に対する割合です。

(注) 国別配分につきましては発行国(地域)もしくは投資国(地域)を表示しております。

(注) その他にはコール・ローン等を含む場合があります。

### 純資産等

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	2024年6月21日	2024年7月22日	2024年8月21日	2024年9月24日	2024年10月21日
純資産総額	229,828,457円	226,859,907円	221,175,500円	234,181,575円	233,379,942円	231,184,299円
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	8,588円	8,608円	8,611円	8,773円	8,812円	8,698円

(注) 当作成期間(第96期~第101期)中における追加設定元本額は23,181,676円、同解約元本額は30,619,729円です。

## ファンドデータ

(年2回決算型)

### 当ファンドの組入資産の内容

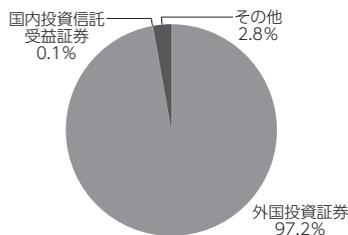
#### ○組入上位ファンド

銘 柄 名	第17期末 %
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・グレート・ボンド・ファンドクラスJ(JDM)(hedged)	97.2
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)	0.1
組入銘柄数	2銘柄

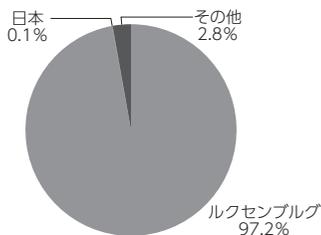
(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 組入銘柄に関する詳細な情報等につきましては、運用報告書(全体版)に記載しております。

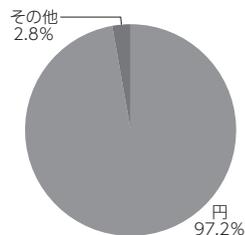
#### ○資産別配分



#### ○国別配分



#### ○通貨別配分



(注) 比率は当ファンドの純資産総額に対する割合です。

(注) 国別配分につきましては発行国(地域)もしくは投資国(地域)を表示しております。

(注) その他にはコール・ローン等を含む場合があります。

### 純資産等

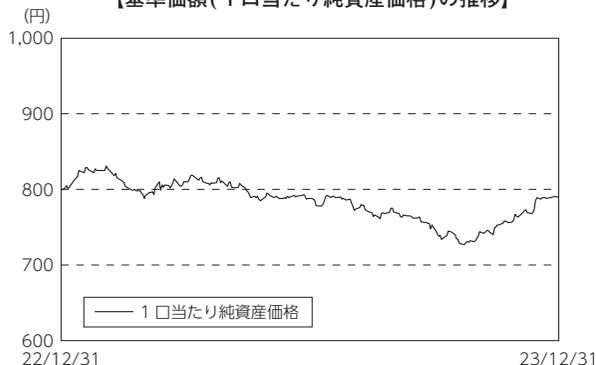
項 目	第17期末
	2024年10月21日
純 資 産 総 額	12,945,861,082円
受 益 権 総 口 数	13,602,856,736口
1万口当たり基準価額	9,517円

(注) 当期中における追加設定元本額は3,952,663,655円、同解約元本額は1,441,772,580円です。

## 組入上位ファンドの概要

### 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)

【基準価額(1口当たり純資産価格)の推移】



【1万口当たりの費用明細】

(2023年1月1日～2023年12月31日)

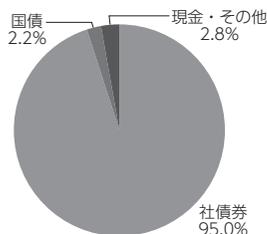
当該期間のAnnual Report (監査済み) には、1万口当たりの費用明細が開示されていないため、記載できません。

【組入上位10銘柄】

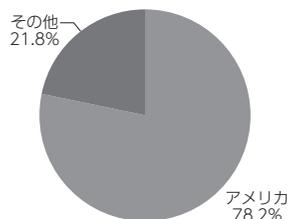
(2023年12月31日現在)

	銘柄名	業種	利率	償還日	国・地域	比率
1	米国債	国債	0.000%	2024/2/6	アメリカ	2.2%
2	アヴイ	ヘルスケア	3.200%	2029/11/21	アメリカ	1.2%
3	バンク・オブ・アメリカ	銀行	5.819%	2029/9/15	アメリカ	1.0%
4	現代キャピタル・アメリカ	自動車	6.100%	2028/9/21	アメリカ	1.0%
5	シティバンク銀行	銀行	5.488%	2026/12/4	アメリカ	1.0%
6	JBS USA LUX SA/FOOD/LUX	消費財	6.750%	2034/3/15	スイス	0.9%
7	スミス・アンド・ネフュー	ヘルスケア	2.032%	2030/10/14	イギリス	0.8%
8	リパブリック・サービス	サービス	4.875%	2029/4/1	アメリカ	0.8%
9	UBSグループ	金融	6.246%	2029/9/22	スイス	0.8%
10	AT&T	通信	5.400%	2034/2/15	アメリカ	0.7%
組入銘柄数		399銘柄				

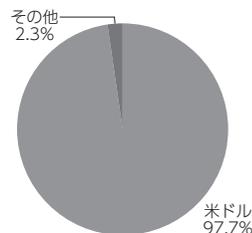
【資産別配分】



【国別配分】



【通貨別配分】



(注) 組入ファンドのデータは、当社で入手可能な時点のもの (監査済みおよび同時点の関連データを含む) を使用しています。

(注) 組入上位10銘柄、資産別・通貨別配分の比率は組入ファンドの純資産に対する割合、国別配分の比率は組入銘柄の総額に対する割合です。

\* 組入全銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書 (全体版) でご覧いただけます。

## 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）

### 【基準価額の推移】



### 【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	
	金額	比率
(a) 信託報酬 ( 投信会社 ) ( 販売会社 ) ( 受託会社 )	23 (15) ( 2) ( 6)	0.219 (0.143) (0.022) (0.055)
(b) その他費用 ( 監査費用 ) ( その他 )	2 ( 2) ( 0)	0.014 (0.014) (0.000)
合計	25	0.233

期中の平均基準価額は、10,610円です。

- (注) 上記項目の概要につきましては運用報告書(全体版)をご参照ください。  
 (注) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税を含む)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。

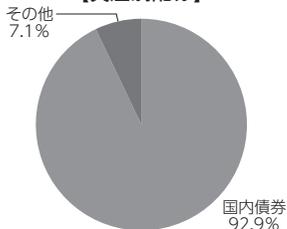
### 【組入上位10銘柄】

(2024年2月26日現在)

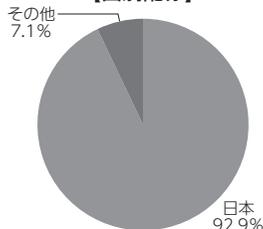
銘柄名	業種/種別等	通貨	国(地域)	比率
1 第359回利付国債(10年)	国債	円	日本	23.9%
2 第91回利付国債(20年)	国債	円	日本	19.8
3 第117回利付国債(20年)	国債	円	日本	11.9
4 第354回利付国債(10年)	国債	円	日本	8.1
5 第87回利付国債(20年)	国債	円	日本	8.0
6 第351回利付国債(10年)	国債	円	日本	6.9
7 第67回利付国債(20年)	国債	円	日本	6.2
8 第80回利付国債(20年)	国債	円	日本	5.4
9 第75回利付国債(20年)	国債	円	日本	2.8
10 -	-	-	-	-
組入銘柄数			9銘柄	

- (注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。  
 (注) 組入銘柄に関する詳細な情報等につきましては、運用報告書(全体版)に記載しております。  
 (注) 国(地域)につきましては発行国(地域)もしくは投資国(地域)を表示しております。

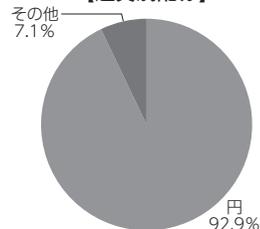
### 【資産別配分】



### 【国別配分】



### 【通貨別配分】



- (注) 比率は当ファンドの純資産総額に対する割合です。  
 (注) 国別配分につきましては発行国(地域)もしくは投資国(地域)を表示しております。  
 (注) その他にはコール・ローン等を含む場合があります。

## <代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について>

騰落率は、データソースが提供する各指数をもとに株式会社野村総合研究所が計算しており、その内容について、信憑性、正確性、完全性、最新性、網羅性、適時性を含む一切の保証を行いません。また、当該騰落率に関連して資産運用または投資判断をした結果生じた損害等、当該騰落率の利用に起因する損害及び一切の問題について、何らの責任も負いません。

### ○配当込みTOPIX

配当込みTOPIXは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、配当を考慮したものです。なお、配当込みTOPIXの指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社J P X総研又は株式会社J P X総研の関連会社の知的財産です。

### ○MSCI-KOKUSAI インデックス (配当込み、円ベース)

MSCI-KOKUSAI インデックス (配当込み、円ベース) は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、MSCI Indexに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc. に帰属します。

### ○MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)

MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース) は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、MSCI Indexに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc. に帰属します。

### ○NOMURA-BPI国債

NOMURA-BPI国債は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、NOMURA-BPI国債に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。

### ○FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)

FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース) は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、FTSE世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利は、FTSE Fixed Income LLCに帰属します。

### ○JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド (円ベース)

JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド (円ベース) は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイドに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。