

運用報告書（全体版）

■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	2024年10月31日から2034年10月10日まで
運用方針	<p>①主として、パークレイズ投信投資顧問株式会社が運用する「米国ハイイールド社債エンハンスト戦略ファンド（適格機関投資家向け）」に投資を行い、インカムゲインの確保と信託財産の成長を目指します。</p> <p>②原則として、「米国ハイイールド社債エンハンスト戦略ファンド（適格機関投資家向け）」への投資比率は、高位を維持することを基本とします。</p> <p>③実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p>
主要投資対象	<p>「米国ハイイールド社債エンハンスト戦略ファンド（毎月分配型）／（資産成長型）」</p> <p>米国ハイイールド社債エンハンスト戦略ファンド（適格機関投資家向け）</p> <p>SOMPOマネー・ポートフォリオ・マザーファンド</p>
主組入制限	<p>米国ハイイールド社債エンハンスト戦略ファンド（毎月分配型）／（資産成長型）</p> <p>米国ハイイールド社債エンハンスト戦略ファンド（適格機関投資家向け）</p> <p>SOMPOマネー・ポートフォリオ・マザーファンド</p>
分配方針	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。</p> <p>①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子、配当収入と売買益（評価損益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>②収益分配金額は、委託会社が基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。</p>

米国ハイイールド社債エンハンスト戦略ファンド（毎月分配型）／（資産成長型） 〈愛称〉利回り名人

（毎月分配型）

第6期（決算日	2025年5月12日）
第7期（決算日	2025年6月10日）
第8期（決算日	2025年7月10日）
第9期（決算日	2025年8月12日）
第10期（決算日	2025年9月10日）
第11期（決算日	2025年10月10日）

（資産成長型）

第2期（決算日	2025年10月10日）
---------	--------------

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。さて、「米国ハイイールド社債エンハンスト戦略ファンド（毎月分配型）」は、このたび第11期の決算を行いましたので、第6～11期中の運用状況、「米国ハイイールド社債エンハンスト戦略ファンド（資産成長型）」は、このたび第2期の決算を行いましたので、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引立て賜りますようお願い申し上げます。

SOMPOアセットマネジメント株式会社

東京都中央区日本橋二丁目2番16号 共立日本橋ビル

 <https://www.sompo-am.co.jp/>

お問い合わせ先

 リテール営業部 0120-69-5432
(受付時間 営業日の午前9時～午後5時)

(毎月分配型)

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配額)	債券組入比率				投資信託券組入比率	純資産額	
		税分	込配	み金	期騰落	中率		
(設定日) 2024年10月31日	円 10,000	円 —	—	—	% —	% —	% —	百万円 523
1期(2024年12月10日)	9,994	0	0	△0.1	0.5	96.8	1,027	
2期(2025年1月10日)	10,269	60	60	3.4	0.5	96.6	2,266	
3期(2025年2月10日)	9,823	60	60	△3.8	0.5	96.3	2,450	
4期(2025年3月10日)	9,600	60	60	△1.7	0.4	95.8	2,656	
5期(2025年4月10日)	9,174	60	60	△3.8	0.6	96.7	2,840	
6期(2025年5月12日)	9,286	60	60	1.9	0.4	95.8	3,062	
7期(2025年6月10日)	9,302	60	60	0.8	0.5	95.4	3,264	
8期(2025年7月10日)	9,379	60	60	1.5	0.3	96.1	3,600	
9期(2025年8月12日)	9,314	60	60	△0.1	0.5	97.1	3,714	
10期(2025年9月10日)	9,380	60	60	1.4	0.5	96.3	3,772	
11期(2025年10月10日)	9,620	60	60	3.2	0.4	96.1	3,982	

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 基準価額及び分配金は1万口当たり（以下同じ）。

(注3) 債券組入比率はマザーファンドへの投資割合に応じて算出された当ファンドベースの組入比率。

(注4) 投資信託証券組入比率は「米国ハイイールド社債エンハンスト戦略ファンド（適格機関投資家向け）」の組入比率。

(注5) 当ファンドは、米国ハイイールド社債エンハンスト戦略ファンド（適格機関投資家向け）の投資比率を可能な限り高位に保ちますが、本投資信託証券のコンセプトに適った指標等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指標は記載しておりません。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年月日	基準価額			債券組入比率	投資信託券組入比率
			騰落率	率		
第6期	(期首) 2025年4月10日	円 9,174	—	—	0.6	96.7
	4月末	9,292	1.3	0.5	96.3	
	(期末) 2025年5月12日	9,346	1.9	0.4	95.8	
第7期	(期首) 2025年5月12日	9,286	—	0.4	95.8	
	5月末	9,309	0.2	0.5	97.0	
	(期末) 2025年6月10日	9,362	0.8	0.5	95.4	
第8期	(期首) 2025年6月10日	9,302	—	0.5	95.4	
	6月末	9,327	0.3	0.5	94.8	
	(期末) 2025年7月10日	9,439	1.5	0.3	96.1	
第9期	(期首) 2025年7月10日	9,379	—	0.3	96.1	
	7月末	9,468	0.9	0.5	97.0	
	(期末) 2025年8月12日	9,374	△0.1	0.5	97.1	
第10期	(期首) 2025年8月12日	9,314	—	0.5	97.1	
	8月末	9,409	1.0	0.5	95.5	
	(期末) 2025年9月10日	9,440	1.4	0.5	96.3	
第11期	(期首) 2025年9月10日	9,380	—	0.5	96.3	
	9月末	9,470	1.0	0.4	94.6	
	(期末) 2025年10月10日	9,680	3.2	0.4	96.1	

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(注2) 債券組入比率はマザーファンドへの投資割合に応じて算出された当ファンドベースの組入比率。

(注3) 投資信託証券組入比率は「米国ハイイールド社債エンハンスト戦略ファンド（適格機関投資家向け）」の組入比率。

(注4) 当ファンドは、米国ハイイールド社債エンハンスト戦略ファンド（適格機関投資家向け）の投資比率を可能な限り高位に保ちますが、本投資信託証券のコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

(資産成長型)

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税込分配 み金	期騰落	債組入比率	投資信託券組入比率	純総資産額
	円	円	%	%	%	百万円
(設定日) 2024年10月31日	10,000	—	—	—	—	378
1期(2025年4月10日)	9,439	0	△5.6	0.5	97.0	2,278
2期(2025年10月10日)	10,290	0	9.0	0.5	95.6	2,605

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 基準価額及び分配金は1万口当たり（以下同じ）。

(注3) 債券組入比率はマザーファンドへの投資割合に応じて算出された当ファンドベースの組入比率。

(注4) 投資信託証券組入比率は「米国ハイイールド社債エンハンスト戦略ファンド（適格機関投資家向け）」の組入比率。

(注5) 当ファンドは、米国ハイイールド社債エンハンスト戦略ファンド（適格機関投資家向け）の投資比率を可能な限り高位に保ちますが、本投資信託証券のコンセプトに適った指標等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指標は記載しておりません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	債組入比率	投資信託組入比率	
	騰落率	券率	券率	
(期首) 2025年4月10日	円 9,439	% —	% 0.5	% 97.0
4月末	9,561	1.3	0.5	96.3
5月末	9,641	2.1	0.5	95.3
6月末	9,721	3.0	0.5	94.4
7月末	9,933	5.2	0.5	96.4
8月末	9,936	5.3	0.5	96.9
9月末	10,066	6.6	0.5	95.3
(期末) 2025年10月10日	10,290	9.0	0.5	95.6

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(注2) 債券組入比率はマザーファンドへの投資割合に応じて算出された当ファンドベースの組入比率。

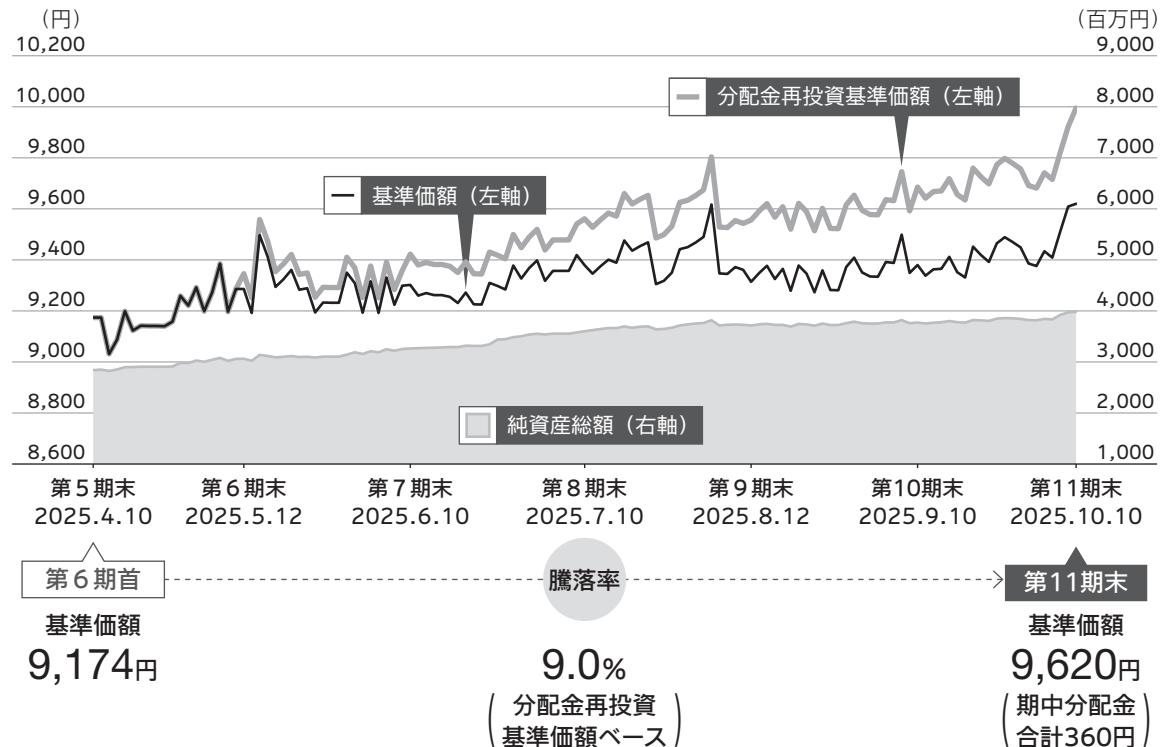
(注3) 投資信託証券組入比率は「米国ハイイールド社債エンハンスト戦略ファンド（適格機関投資家向け）」の組入比率。

(注4) 当ファンドは、米国ハイイールド社債エンハンスト戦略ファンド（適格機関投資家向け）の投資比率を可能な限り高位に保ちますが、本投資信託証券のコンセプトに適った指標等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指標は記載しておりません。

運用経過

● 基準価額の推移

毎月分配型



- 分配金再投資基準価額の推移は、2025年4月10日の基準価額をもとに委託会社にて指数化したものを使用しております。
- 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、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- 当ファンドは、米国ハイイールド社債エンハンスト戦略ファンド（適格機関投資家向け）の投資比率を可能な限り高位に保ちますが、本投資信託証券のコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

● 基準価額の主な変動要因

毎月分配型

主要投資対象である「米国ハイイールド社債エンハンスト戦略ファンド（適格機関投資家向け）」投資信託証券の基準価額が上昇したことから、当期の分配金再投資基準価額は上昇しました。主要投資対象である「米国ハイイールド社債エンハンスト戦略ファンド（適格機関投資家向け）」投資信託証券において、主に米国ハイイールド社債のクレジットスプレッド（国債との利回り格差）縮小効果により、ファンド全体でプラスのリターンとなりました。

- 本報告書では、ベビーファンド、マザーファンド及びマザーファンド以外のファンドを下記の様に統一して表記しています。



ベビーファンド



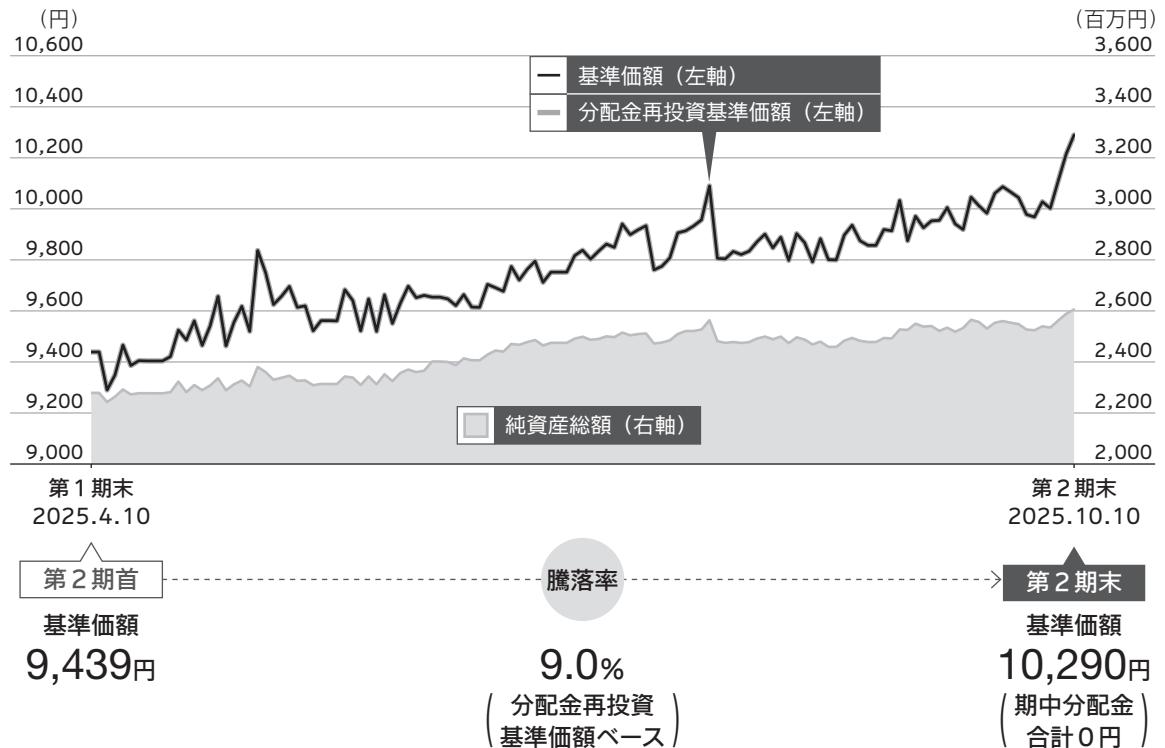
マザーファンド



マザーファンド以外のファンド

● 基準価額の推移

資産成長型



- 分配金再投資基準価額の推移は、2025年4月10日の基準価額をもとに委託会社にて指数化したものを使用しております。
- 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、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- 当ファンドは、米国ハイイールド社債エンハンスト戦略ファンド（適格機関投資家向け）の投資比率を可能な限り高位に保ちますが、本投資信託証券のコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

● 基準価額の主な変動要因

資産成長型

主要投資対象である「米国ハイイールド社債エンハンスト戦略ファンド（適格機関投資家向け）」投資信託証券の基準価額が上昇したことから、当期の基準価額は上昇しました。主要投資対象である「米国ハイイールド社債エンハンスト戦略ファンド（適格機関投資家向け）」投資信託証券において、主に米国ハイイールド社債のクレジットスプレッド縮小効果により、ファンド全体でプラスのリターンとなりました。

- 本報告書では、ベビーファンド、マザーファンド及びマザーファンド以外のファンドを下記の様に統一して表記しています。



ベビーファンド



マザーファンド



マザーファンド以外のファンド

● 投資環境

米国国債利回りは低下（価格は上昇）しました。期初から2025年5月にかけては、米国トランプ政権の関税政策を巡る不透明感が続く中、米国の大型減税法案に伴う財政悪化懸念や米国国債の格下げなどから利回りは上昇（価格は下落）基調で推移しました。その後、期末にかけては、FRB（米連邦準備理事会）による利下げ期待が高まり、実際に9月のFOMC（米連邦公開市場委員会）で追加利下げが決定されたことなどから、利回りは低下基調で推移しました。

米国ハイイールド社債のクレジットスプレッドは全般的に縮小しました。為替は、円安ドル高となりました。

● 当該投資信託のポートフォリオ

毎月分配型／資産成長型

当ファンドは主要投資対象であるバークレイズ投信投資顧問株式会社が運用する「米国ハイイールド社債エンハンスト戦略ファンド（適格機関投資家向け）」投資信託証券の組入れを高位に保ちました。「米国ハイイールド社債エンハンスト戦略ファンド（適格機関投資家向け）」投資信託証券では、主に担保付スワップ取引を通じて、米国のハイイールド社債への投資と為替リスクコントロール戦略の2つを組み合わせた米国ハイイールド社債エンハンスト戦略へ投資を行いました。



米国ハイイールド社債エンハンスト戦略ファンド（適格機関投資家向け）

主に担保付スワップ取引を通じて、米国ハイイールド社債と為替リスクコントロール戦略を投資対象とする米国ハイイールド社債エンハンスト戦略へ投資を行いました。主に米国ハイイールド社債のクレジットスプレッド縮小効果により、ファンド全体でプラスのリターンとなりました。

利回り	
利回り	9.0%

注1. 2025年9月末時点の利回り。

注2. 利回りは米国ハイイールド社債エンハンスト戦略ファンド（適格機関投資家向け）の信託報酬、スワップ管理費用控除後のものです。

注3. 利回りはファンド全体の期待利回りを示すものではありません。

投資比率	
為替ヘッジ	23.54%
為替ヘッジなし	126.46%
合計(米国ハイイールド社債)	150.00%

注. 比率は毎月分配型は第11期末、資産成長型は第2期末時点。



SOMPOマネー・ポートフォリオ・マザーファンド

コール・ローンや、残存期間1年未満の公社債を中心とした運用を行いました。

● 当該投資信託のベンチマークとの差異



毎月分配型／資産成長型

各ファンドは、米国ハイイールド社債エンハンスト戦略ファンド（適格機関投資家向け）の投資比率を可能な限り高位に保ちますが、本投資信託証券のコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

● 分配金

毎月分配型

収益分配金については、基準価額の水準等を勘案し、次表の通りと致しました。なお、収益分配に充てなかった収益は、信託財産に留保し、運用の基本方針に基づいて引き続き元本と同一の運用を行います。

分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税引前)

項目	第6期 2025.4.11 ～ 2025.5.12	第7期 2025.5.13 ～ 2025.6.10	第8期 2025.6.11 ～ 2025.7.10	第9期 2025.7.11 ～ 2025.8.12	第10期 2025.8.13 ～ 2025.9.10	第11期 2025.9.11 ～ 2025.10.10
当期分配金	60	60	60	60	60	60
(対基準価額比率)	0.642%	0.641%	0.636%	0.640%	0.636%	0.620%
当期の収益	60	58	60	56	60	60
当期の収益以外	—	1	—	3	—	—
翌期繰越分配対象額	247	248	253	251	255	261

注1. 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

注2. 円未満は切り捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税引前）に合致しない場合があります。

注3. 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、ファンドの収益率とは異なります。

毎月分配型は、決算期毎にインカム収入※を中心に分配を行うことを目指すファンドです。

※ インカム収入とは、債券の利子収入等をいいます。

- ・ ファンドに蓄積された過去の運用成果（分配原資）を加味する場合があります。
- ・ 投資対象資産や為替の値動き等により基準価額が下落した場合でも、原則として、インカム収入相当については、分配を行います。

 **資産成長型**

収益分配金については、基準価額の水準等を勘案し、次表の通りと致しました。なお、収益分配に充てなかった収益は、信託財産に留保し、運用の基本方針に基づいて引き続き元本と同一の運用を行います。

分配原資の内訳 (単位：円、1万口当たり・税引前)

項目	第2期 2025.4.11～2025.10.10
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	719

注1. 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

注2. 円未満は切り捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税引前）に合致しない場合があります。

注3. 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、ファンドの収益率とは異なります。

資産成長型は、中長期的な観点から、複利効果による資産の成長を目指すために分配を抑えるファンドです。

● 今後の運用方針

毎月分配型／資産成長型

引き続き、「米国ハイイールド社債エンハンスト戦略ファンド（適格機関投資家向け）」投資信託証券の組入比率を高位に保ち、中長期的な信託財産の成長を目指します。

米国ハイイールド社債エンハンスト戦略ファンド（適格機関投資家向け）

引き続き、担保付スワップ取引を通じて、米国ハイイールド社債エンハンスト戦略のパフォーマンスに連動する投資成果を目指し、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

SOMPOマネー・ポートフォリオ・マザーファンド

安全性、流動性の高いコール・ローンや、残存期間1年未満の公社債を中心とした運用を行う方針です。

● 1万口当たりの費用明細

毎月分配型

項目	第6期～第11期 2025.4.11～2025.10.10		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	61円	0.651%	(a)信託報酬＝各期中の平均基準価額×信託報酬率（年率）×各期の日数 年間の日数 期中の平均基準価額は9,379円です。
(投信会社)	(18)	(0.193)	ファンドの運用の対価
(販売会社)	(41)	(0.441)	購入後の情報提供、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等の対価
(受託会社)	(2)	(0.017)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) その他費用	0	0.005	(b)その他費用＝各期中のその他費用 各期中の平均受益権口数
(監査費用)	(0)	(0.005)	監査法人に支払うファンドの監査にかかる費用
合計	61	0.656	

注1. 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、その他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

注2. 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

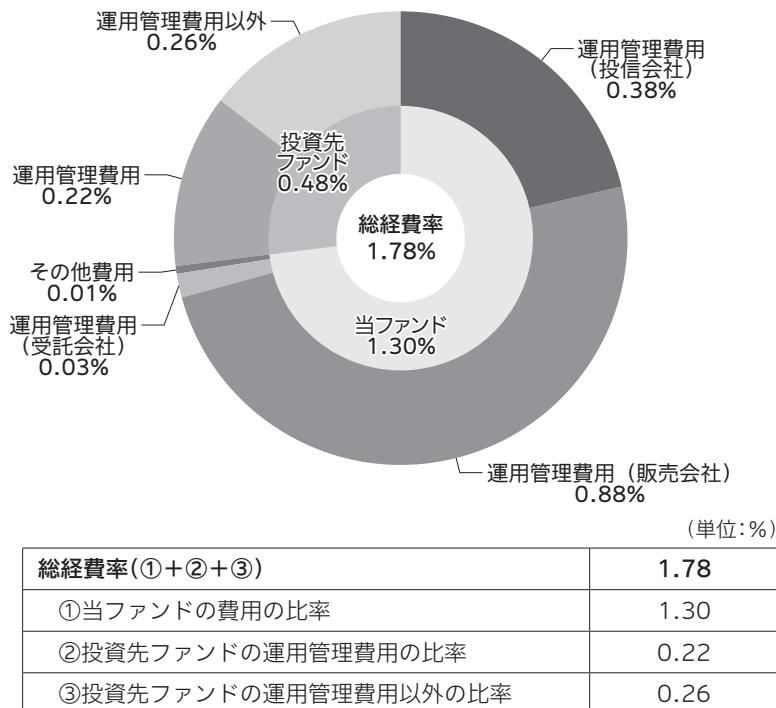
注3. 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

注4. 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

(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1.78%です。



注1. 当ファンドの費用は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2. 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3. 各比率は、年率換算した値です。

注4. 投資先ファンドとは、当ファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

注5. 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

注6. 当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

注7. 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。

● 1万口当たりの費用明細

資産成長型

項目	第2期 2025.4.11～2025.10.10		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	64円	0.651%	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率（年率）× 期中の日数 年間の日数 期中の平均基準価額は9,809円です。
(投信会社)	(19)	(0.193)	ファンドの運用の対価
(販売会社)	(43)	(0.441)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの 管理等の対価
(受託会社)	(2)	(0.017)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) その他費用	1	0.005	(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)	(0.005)	監査法人に支払うファンドの監査にかかる費用
合計	65	0.656	

注1. 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、その他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

注2. 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

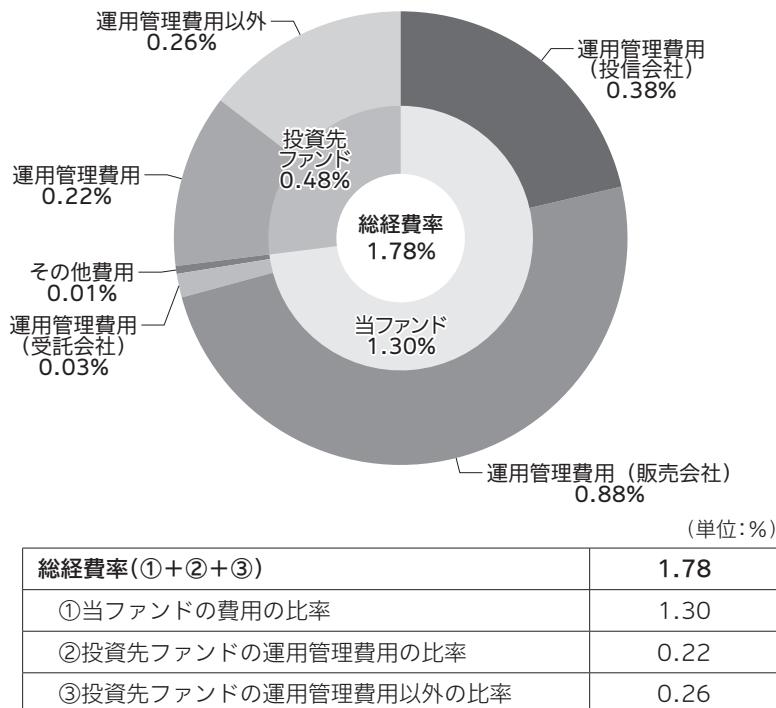
注3. 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

注4. 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

(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1.78%です。



注1. 当ファンドの費用は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2. 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3. 各比率は、年率換算した値です。

注4. 投資先ファンドとは、当ファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

注5. 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

注6. 当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

注7. 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。

(毎月分配型)

○売買及び取引の状況

(2025年4月11日～2025年10月10日)

投資信託証券

銘柄	第6期～第11期					
	買付		売付			
	口数	金額	口数	金額	口数	金額
国内 米国ハイイールド社債エンハンスト戦略ファンド(適格機関投資家向け)	978,378,338	千円 904,320	口 一	千円 一	口 一	千円 一

(注1) 金額は受渡代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2025年4月11日～2025年10月10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。

○組入資産の明細

(2025年10月10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5期末		第11期末		
	口数	口数	評価額	比率	
米国ハイイールド社債エンハンスト戦略ファンド(適格機関投資家向け)	3,013,520,685	3,991,899,023	千円 3,826,235	% 96.1	
合計	3,013,520,685	3,991,899,023	千円 3,826,235	% 96.1	

(注) 単位未満は切捨て。

親投資信託残高

銘柄	第5期末		第11期末	
	口数	口数	評価額	
SOMPOマネー・ポートフォリオ・マザーファンド	千口 22,239	千口 22,239	千円 22,237	

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 当ファンドは、第11期末において、直接投資をする株式及び新株予約権証券の組入れはありません。

○投資信託財産の構成

(2025年10月10日現在)

項目	第11期末	
	評価額	比率
投資信託受益証券	千円 3,826,235	% 95.4
SOMPOマネー・ポートフォリオ・マザーファンド	22,237	0.6
コール・ローン等、その他	163,266	4.0
投資信託財産総額	4,011,738	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項目	第6期末	第7期末	第8期末	第9期末	第10期末	第11期末
	2025年5月12日現在	2025年6月10日現在	2025年7月10日現在	2025年8月12日現在	2025年9月10日現在	2025年10月10日現在
(A) 資産	円 3,085,921,798	円 3,289,057,442	円 3,627,144,738	円 3,743,091,761	円 3,800,459,742	円 4,011,738,323
コール・ローン等	128,442,877	152,446,916	144,479,632	114,486,791	144,600,472	163,264,321
投資信託受益証券(評価額)	2,935,273,826	3,114,400,753	3,460,446,513	3,606,379,993	3,633,627,332	3,826,235,213
SOMPOマネー・ポートフォリオ・マザーファンド(評価額)	22,203,864	22,208,312	22,217,208	22,223,880	22,230,552	22,237,224
未収利息	1,231	1,461	1,385	1,097	1,386	1,565
(B) 負債	円 23,182,977	円 24,321,169	円 26,700,011	円 28,301,324	円 28,026,448	円 28,944,684
未払収益分配金	19,789,290	21,057,261	23,033,194	23,931,408	24,129,488	24,839,659
未払信託報酬	3,365,743	3,237,035	3,636,627	4,333,931	3,864,871	4,071,222
その他未払費用	27,944	26,873	30,190	35,985	32,089	33,803
(C) 純資産総額(A-B)	円 3,062,738,821	円 3,264,736,273	円 3,600,444,727	円 3,714,790,437	円 3,772,433,294	円 3,982,793,639
元本	3,298,215,143	3,509,543,666	3,838,865,815	3,988,568,006	4,021,581,473	4,139,943,300
次期繰越損益金	△ 235,476,322	△ 244,807,393	△ 238,421,088	△ 273,777,569	△ 249,148,179	△ 157,149,661
(D) 受益権総口数	口 3,298,215,143口	口 3,509,543,666口	口 3,838,865,815口	口 3,988,568,006口	口 4,021,581,473口	口 4,139,943,300口
1万口当たり基準価額(C/D)	円 9,286円	円 9,302円	円 9,379円	円 9,314円	円 9,380円	円 9,620円

(注1) 当作成期間（第6期～第11期）における期首元本額3,096,057,631円、期中追加設定元本額1,161,606,497円、期中一部解約元本額117,720,828円

(注2) 期末における1口当たりの純資産総額

第6期0.9286円、第7期0.9302円、第8期0.9379円、第9期0.9314円、第10期0.9380円、第11期0.9620円

(注3) 期末における元本の欠損金額

第6期235,476,322円、第7期244,807,393円、第8期238,421,088円、第9期273,777,569円、第10期249,148,179円、第11期157,149,661円

○損益の状況

項目	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期
	2025年4月11日～ 2025年5月12日	2025年5月13日～ 2025年6月10日	2025年6月11日～ 2025年7月10日	2025年7月11日～ 2025年8月12日	2025年8月13日～ 2025年9月10日	2025年9月11日～ 2025年10月10日
(A) 配当等収益	円	円	円	円	円	円
受取配当金	22,076,579	23,117,078	25,641,918	26,945,088	27,595,354	28,054,853
受取利息	22,046,445	23,086,508	25,610,975	26,909,277	27,561,411	28,016,857
(B) 有価証券売買損益	30,134	30,570	30,943	35,811	33,943	37,996
売買益	37,934,596	6,583,915	29,644,897	△ 25,041,985	27,131,393	99,728,004
売買損	37,932,570	6,583,344	29,644,661	97,728	27,253,607	99,738,750
(C) 信託報酬等	2,026	571	236	△ 25,139,713	△ 122,214	△ 10,746
(D) △ 3,393,687	△ 3,263,908	△ 3,666,817	△ 4,369,916	△ 3,896,960	△ 4,105,025	
(E) 当期損益金(A+B+C)	56,617,488	26,437,085	51,619,998	△ 2,466,813	50,829,787	123,677,832
(F) 前期繰越損益金	△254,776,753	△216,869,206	△211,203,820	△180,845,274	△205,084,479	△178,105,069
(G) 追加信託差損益金	△17,527,767	△33,318,011	△55,804,072	△66,534,074	△70,763,999	△77,882,765
(H) (配当等相当額)	(38,593,143)	(44,963,911)	(54,002,085)	(58,666,595)	(60,061,222)	(63,600,858)
(I) (売買損益相当額)	(△ 56,120,910)	(△ 78,281,922)	(△109,806,157)	(△125,200,669)	(△130,825,221)	(△141,483,623)
(J) 計(D+E+F)	△215,687,032	△223,750,132	△215,387,894	△249,846,161	△225,018,691	△132,310,002
(K) 収益分配金	△19,789,290	△21,057,261	△23,033,194	△23,931,408	△24,129,488	△24,839,659
(L) 次期繰越損益金(G+H)	△235,476,322	△244,807,393	△238,421,088	△273,777,569	△249,148,179	△157,149,661
(M) 追加信託差損益金	△17,527,767	△33,318,011	△55,804,072	△66,534,074	△70,763,999	△77,882,765
(N) (配当等相当額)	(38,593,210)	(44,963,966)	(54,002,146)	(58,666,641)	(60,061,231)	(63,600,871)
(O) (売買損益相当額)	(△ 56,120,977)	(△ 78,281,977)	(△109,806,218)	(△125,200,715)	(△130,825,230)	(△141,483,636)
(P) 分配準備積立金	43,072,175	42,379,730	43,232,118	41,458,136	42,527,854	44,776,189
(Q) 繰越損益金	△261,020,730	△253,869,112	△225,849,134	△248,701,631	△220,912,034	△124,043,085

(注1) 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) 信託報酬等には、消費税相当額を含めて表示しております。

(注3) 追加信託差損益金とは、信託の追加設定の際、追加設定をした額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 分配金の計算過程（2025年4月11日～2025年10月10日）は以下の通りです。

項目	2025年4月11日～ 2025年5月12日	2025年5月13日～ 2025年6月10日	2025年6月11日～ 2025年7月10日	2025年7月11日～ 2025年8月12日	2025年8月13日～ 2025年9月10日	2025年9月11日～ 2025年10月10日
a. 配当等収益(費用控除後)	20,830,062円	20,578,123円	23,942,804円	22,576,863円	25,631,106円	27,154,537円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	0円	0円	0円	0円	0円	0円
c. 信託約款に規定する収益調整金	38,593,210円	44,963,966円	54,002,146円	58,666,641円	60,061,231円	63,600,871円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	42,031,403円	42,858,868円	42,322,508円	42,812,681円	41,026,236円	42,461,311円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	101,454,675円	108,400,957円	120,267,458円	124,056,185円	126,718,573円	133,216,719円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	307円	308円	313円	311円	315円	321円
g. 分配金	19,789,290円	21,057,261円	23,033,194円	23,931,408円	24,129,488円	24,839,659円
h. 分配金(1万口当たり)	60円	60円	60円	60円	60円	60円

(資産成長型)

○売買及び取引の状況

(2025年4月11日～2025年10月10日)

投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
国内 米国ハイイールド社債エンハンスト戦略ファンド(適格機関投資家向け)	173,595,970	千円	160,180	千円

(注1) 金額は受渡代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2025年4月11日～2025年10月10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

(2025年4月11日～2025年10月10日)

当期首残高 (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
万円 1,000	万円 —	万円 —	万円 1,000	当初設定時における取得

○組入資産の明細

(2025年10月10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	
米国ハイイールド社債エンハンスト戦略ファンド(適格機関投資家向け)	2,425,080,971	2,598,676,941	千円 2,490,831	% 95.6	
合計	2,425,080,971	2,598,676,941	千円 2,490,831	% 95.6	

(注) 単位未満は切捨て。

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千 口	千 口	千 円
SOMPOマネー・ポートフォリオ・マザーファンド	15,622	15,622	15,620

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 当ファンドは、当期末において、直接投資をする株式及び新株予約権証券の組入れはありません。

○投資信託財産の構成

(2025年10月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千 円	%
投資信託受益証券	2,490,831	94.9
SOMPOマネー・ポートフォリオ・マザーファンド	15,620	0.6
コール・ローン等、その他	117,344	4.5
投資信託財産総額	2,623,795	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2025年10月10日現在）

項目	当期末
(A) 資産	円
コール・ローン等	2,623,795,619
投資信託受益証券(評価額)	117,341,649
SOMPOマネー・ポートフォリオ・マザーファンド(評価額)	2,490,831,847
未収利息	15,620,998
未収利息	1,125
(B) 負債	17,926,350
未払解約金	1,977,735
未払信託報酬	15,817,312
その他未払費用	131,303
(C) 純資産総額(A-B)	2,605,869,269
元本	2,532,361,742
次期繰越損益金	73,507,527
(D) 受益権総口数	2,532,361,742口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,290円

(注1) 信託財産に係る期首元本額2,414,210,096円、期中追加設定元本額332,100,331円、期中一部解約元本額213,948,685円

(注2) 期末における1口当たりの純資産総額 1.0290円

○損益の状況（2025年4月11日～2025年10月10日）

項目	当期
(A) 配当等収益	円
受取配当金	104,079,112
受取利息	103,940,471
(B) 有価証券売買損益	138,641
売買益	117,487,395
売買損	120,957,009
(C) 信託報酬等	△ 3,469,614
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 15,948,615
(E) 前期繰越損益金	205,617,892
(F) 追加信託差損益金	△145,320,876
(配当等相当額)	13,210,511
(売買損益相当額)	(28,184,954)
(G) 計(D+E+F)	(△ 14,974,443)
(H) 収益分配金	73,507,527
次期繰越損益金(G+H)	0
追加信託差損益金	73,507,527
(配当等相当額)	13,210,511
(売買損益相当額)	(28,185,013)
分配準備積立金	(△ 14,974,502)
繰越損益金	154,141,031
	△ 93,844,015

(注1) 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) 信託報酬等には、消費税相当額を含めて表示しております。

(注3) 追加信託差損益金とは、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4) 分配金の計算過程（2025年4月11日～2025年10月10日）は以下の通りです。

項目	2025年4月11日～2025年10月10日
a. 配当等収益(費用控除後)	96,592,828円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	0円
c. 信託約款に規定する収益調整金	28,185,013円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	57,548,203円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	182,326,044円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	719円
g. 分配金	0円

○分配金のお知らせ

(毎月分配型)	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期
1万口当たり分配金（税込み）	60円	60円	60円	60円	60円	60円

＜分配金をお支払いする場合＞

- ・分配金は、原則として各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しています。

＜分配金を再投資する場合＞

- ・お手取り分配金は、各決算日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資しています。

＜課税上の取扱いについて＞

- ・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。
- ・分配金落ち後の基準価額が個別元本と同額の場合または個別元本を上回っている場合は、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配金落ち後の基準価額が個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、収益分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・個人の受益者に対する課税
税率は普通分配金について、20.315%（所得税及び復興特別所得税15.315%、並びに地方税5%）です。

※上記は源泉徴収時の税率であり、税率は課税方法等により異なる場合があります。

※法人の受益者に対する課税は、税率が異なります。

※上記内容は、税法が改正された場合等には変更になることがあります。

※課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家または税務署等にご確認ください。

＜参考情報＞組入れ投資信託証券の内容

■主要投資対象の投資信託証券の概要

名称	米国ハイールド社債エンハンスト戦略ファンド（適格機関投資家向け）
形態	国内籍私募投資信託（円建て）
運用の基本方針	<p>①スワップ取引への投資を通じて、バークレイズ・バンク・ビーエルシー（英國バークレイズ銀行）が提供する米国ハイールド社債エンハンスト戦略のパフォーマンスに連動する投資成果を目指します。</p> <p>②米国ハイールド社債エンハンスト戦略は、米国のハイールド社債と為替リスクコントロール戦略を投資対象とします。</p> <p>③米国のハイールド社債に係るエクスポージャーは、米国のハイールド社債市場全体の動向を示す米ドル建ての指数を日本円に換算したもの^①を通じて取得します。原則として、当該エクスポージャーのスワップ取引の想定元本に対する比率は概ね150%となるように管理し、米国のハイールド社債の変動率が高まつた局面等においてはエクスポージャーを機動的に引き下げます。</p> <p>*1. 当該エクスポージャーが持つ米ドル円の為替リスクはヘッジされていません。</p> <p>④為替リスクコントロール戦略は米ドル円為替レートや日米の経済指標等に関するデータを基に、米ドル円の為替取引のポジション量を日次で調節する戦略です。この戦略を通じて米国のハイールド社債が持つ為替リスクの最適化を目指します。</p> <p>⑤原則として、当ファンドの信託財産の純資産総額に対するスワップ取引の想定元本の比率を高位に保ちます。</p> <p>⑥スワップ取引の評価損益等のエクスポージャーに対応し、日次でスワップ取引相手先と担保の授受を行います。スワップ取引相手先のエクスポージャー（無担保エクスポージャー）の純資産総額に対する割合は原則として10%未満になるように管理します。</p> <p>⑦現金部分は、主にわが国の国債（短期国債を含みます。）、国内コマーシャル・ペーパー、SPC債^②を投資対象とし、その内訳は当ファンドの資金事情や取引見通し、市場動向等を勘案の上、決定します。また現金部分の運用パフォーマンスは基準価額とスワップ取引のパフォーマンスの乖離要因となります。</p> <p>*2. SPCはわが国の国債を購入しそれを別のカウンターパーティーに貸し出し、カウンターパーティーは担保契約に基づいてSPCに対して担保を差し入れます。当ファンドはSPC債を通じ、国債のリターンに加えて国債の貸出の対価を受け取ります。</p> <p>⑧市場動向や当ファンドの資金事情等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>①デリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。</p> <p>②外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>③株式への投資割合は、取得時において、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>④同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>⑤一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>⑥デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p> <p>⑦投資信託証券（上場投資信託を除きます。）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%以下とします。</p>
決算日	原則、毎月25日（休業日の場合は翌営業日）
信託財産留保額	ありません。
信託報酬等	<p>純資産総額に対して年率0.231%（税抜0.21%）</p> <p>※上記のほか、以下の費用がかかります。</p> <p>各項目について消費税および地方消費税がかかる場合には、当該消費税等を含みます。その他の費用については、運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。</p> <ul style="list-style-type: none"> ■スワップ取引の管理費用、スワップ取引が内包する資産の取引コスト及びリバランスコスト ■スワップ取引の一部または全部解約費用 ■SPC債に係る費用（組成費用や取引コスト等が生じる場合を含みます。） ■ファンド監査費用 ■有価証券取引に伴う手数料等（売買委託手数料、保管手数料等） ■法令で定める価格等調査にかかる費用 ■信託財産に関する租税 ■信託事務の処理等に要する諸費用 ■受託者の立替えた立替金の利息、現金担保を受け入れた場合の利息等
申込・解約手数料	ありません。
委託会社	バークレイズ投信投資顧問株式会社

※当ファンドが主要投資対象とする投資信託証券の名称及びその運用会社の名称等は今後変更となる場合があります。

(ご参考) 費用明細 (2025年3月26日～2025年9月25日)

項目	比率
運用管理費用	0.23%
その他費用	0.27%
トータルエクスペンスレシオ	0.50%

※トータルエクスペンスレシオはパークレイズ投信投資顧問株式会社から入手したものを掲載しています。

※各比率は、年率換算した値です。

組入上位10銘柄

基準日：2025年9月25日

	銘柄名	国	組入比率
1	第1263回国庫短期証券	日本	9.9%
2	第1270回国庫短期証券	日本	18.1%
3	第1276回国庫短期証券	日本	9.9%
4	第1281回国庫短期証券	日本	3.3%
5	第1288回国庫短期証券	日本	34.3%
6	第1307回国庫短期証券	日本	4.9%
7	第1313回国庫短期証券	日本	6.6%
8	—	—	—
9	—	—	—
10	—	—	—
組入銘柄数		7 銘柄	

注1. 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

注2. パークレイズ投信投資顧問株式会社が作成したデータを掲載しています。

SOMPOマネー・ポートフォリオ・マザーファンド

運用報告書

第4期（決算日 2025年3月10日）

＜計算期間 2024年3月9日～2025年3月10日＞

SOMPOマネー・ポートフォリオ・マザーファンドの第4期の運用状況をご報告申し上げます。

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	無期限
運用方針	安定した収益の確保を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債等
主な組入制限	株式への投資は、転換社債の転換及び転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得したものに限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資は行いません。

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額	期 賦		債組入比率	券 率	純 資 産 額
		騰	落			
(設定日) 2021年2月26日	円 10,000		% —		% —	百万円 29
1期(2022年3月8日)	9,991		△0.1		—	67
2期(2023年3月8日)	9,980		△0.1		—	330
3期(2024年3月8日)	9,969		△0.1		—	518
4期(2025年3月10日)	9,978		0.1		53.9	556

(注1) 基準価額は1万口当たり（以下同じ）。

(注2) 当ファンドは、わが国の公社債等に投資を行い、安定した収益の確保を目指しますが、当ファンドのコンセプトに適った指標等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指標は記載しておりません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		債 組 入 比	券 率
		騰	落		
(期 首) 2024年3月8日	円 9,969		% —		% —
3月末	9,969		0.0		1.8
4月末	9,969		0.0		42.4
5月末	9,969		0.0		60.8
6月末	9,970		0.0		60.8
7月末	9,969		0.0		73.7
8月末	9,970		0.0		55.3
9月末	9,971		0.0		55.3
10月末	9,972		0.0		54.4
11月末	9,973		0.0		54.0
12月末	9,973		0.0		51.6
2025年1月末	9,974		0.1		51.5
2月末	9,977		0.1		53.0
(期 末) 2025年3月10日	9,978		0.1		53.9

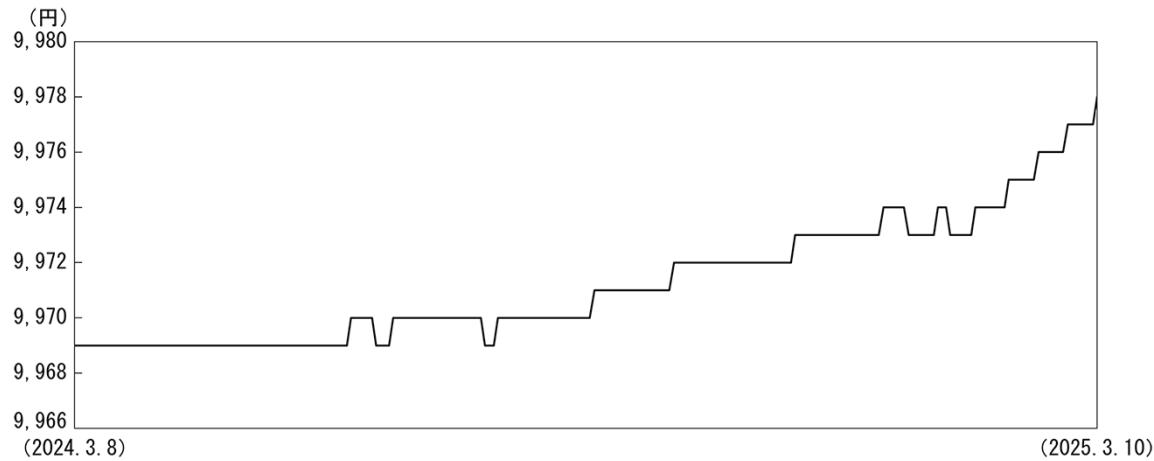
(注1) 謄落率は期首比。

(注2) 当ファンドは、わが国の公社債等に投資を行い、安定した収益の確保を目指しますが、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

○運用経過

(2024年3月9日～2025年3月10日)

■基準価額の推移



期 首 : 9,969円
 期 末 : 9,978円
 講落率 : 0.1%

■基準価額の主な変動要因

2024年4月以降は、短期金融資産の利回りがプラス圏で推移したことから、当期末の基準価額は期首の水準を上回りました。

■投資環境

2024年3月までは日銀のマイナス金利政策により、無担保コールレート（オーバーナイト物）は概ね-0.1%～0.0%の範囲で推移しました。

マイナス金利解除後は、概ね0.05%～0.15%の範囲で推移しましたが、7月に政策金利が引上げられた後は概ね0.20%～0.25%の範囲で推移し、2025年1月に再び政策金利が引き上げられた後は、概ね0.45%～0.50%の範囲で推移しました。

■当該投資信託のポートフォリオ

2024年3月までは短期金融市場において国債の利回りがマイナスであったため、比較的マイナス幅が小さいコール・ローン運用を中心に行いました。

4月以降は、コール・ローンや、残存期間1年未満の公社債を中心とした運用を行いました。

■当該投資信託のベンチマークとの差異

当ファンドは、わが国の公社債等に投資を行い、安定した収益の確保を目指しますが、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

■今後の運用方針

安全性、流動性の高いコール・ローンや、残存期間1年未満の公社債を中心とした運用を行う方針です。

○1万口当たりの費用明細

(2024年3月9日～2025年3月10日)

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) その他の費用 (その他の)	円 (0)	% (0.003)	(a) その他費用 = $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 信託事務の処理にかかるその他の費用等
合計	0	0.003	
期中の平均基準価額は9,971円です。			

(注1) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しております。

(注2) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

○売買及び取引の状況

(2024年3月9日～2025年3月10日)

公社債

		買付額	売付額
国内	国債証券	千円 1,679,658	千円 — (1,380,000)

(注1) 金額は受渡代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) () 内は償還等による増減分です。

(注3) 単位未満は切捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2024年3月9日～2025年3月10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。

○組入資産の明細

(2025年3月10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						残存期間別組入比率
	額面金額	評価額	組入比率	うちB級以下組入比率	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	千円 300,000 (300,000)	千円 299,866 (299,866)	% 53.9 (53.9)	% — (—)	% — (—)	% — (—)	% 53.9 (53.9)
合 計	300,000 (300,000)	299,866 (299,866)	53.9 (53.9)	— (—)	— (—)	— (—)	53.9 (53.9)

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(注3) () 内は非上場債で内書き。

(注4) 当マザーファンドは、当期末において、株式及び新株予約権証券の組入れはありません。

(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 100,000 100,000 100,000	千円 99,992 99,945 99,928	2025/3/17 2025/5/12 2025/6/2
合 計		300,000	299,866	

(注) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

○投資信託財産の構成

(2025年3月10日現在)

項目	当 期 末	
	評価額	比率
公社債	千円 299,866	% 53.9
コール・ローン等、その他	256,821	46.1
投資信託財産総額	556,687	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2025年3月10日現在)

項目	当期末
(A) 資産	円
コール・ローン等	556,687,137
公社債(評価額)	256,818,275
未収利息	299,866,400
	2,462
(B) 負債	0
(C) 純資産総額(A-B)	556,687,137
元本	557,934,928
次期繰越損益金	△ 1,247,791
(D) 受益権総口数	557,934,928口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,978円

(注1) 信託財産に係る期首元本額520,586,012円、期中追加設定元本額71,429,307円、期中一部解約元本額34,080,391円

(注2) 期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託ごとの元本の内訳

債券パワード・インカムファンド (毎月分配型) 102,734,182円
 債券パワード・インカムファンド (資産成長型) 361,811,671円
 米国株式自動配分戦略ファンド 45,472,658円
 米国ハイールド社債エンハンスト戦略ファンド (毎月分配型) 22,239,448円
 米国ハイールド社債エンハンスト戦略ファンド (資産成長型) 15,622,561円
 ゴールド・インカムプラス 10,054,408円

(注3) 期末における1口当たりの純資産総額 0.9978円

(注4) 期末における元本の欠損金額 1,247,791円

○損益の状況 (2024年3月9日～2025年3月10日)

項目	当期
(A) 配当等収益	円
受取利息	269,607
支払利息	272,706
	△ 3,099
(B) 有価証券売買損益	207,820
売買益	207,820
(C) 保管費用等	△ 15,643
(D) 当期損益金(A+B+C)	461,784
(E) 前期繰越損益金	△ 1,590,659
(F) 追加信託差損益金	△ 199,307
(G) 解約差損益金	80,391
(H) 計(D+E+F+G)	△ 1,247,791
次期繰越損益金(H)	△ 1,247,791

(注1) 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) 追加信託差損益金とは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注3) 解約差損益金とは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。