

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   | 2021年2月26日から2028年3月8日まで                                                                                                                                                                                                                      |                                                                                                                                           |
| 運用方針   | ①米国の国債、ジニーメイ債、投資適格社債およびハイイールド社債へ分散投資を行い、インカムゲインの確保と信託財産の成長を目指します。<br>②「パワード・インカム戦略」は、米国の国債、ジニーメイ債、投資適格社債およびハイイールド社債に分散投資を行い、レバレッジを活用することにより、インカムゲインの獲得を目指す戦略です。<br>③担保付スワップ取引を活用するため、為替変動リスクは限定的です。<br>④原則、毎月8日（休業日の場合は翌営業日）の決算時に収益の分配を行います。 |                                                                                                                                           |
| 主要投資対象 | 債券パワード・インカムファンド（毎月分配型）                                                                                                                                                                                                                       | 「パワード・インカムファンド（適格機関投資家向け）」および「SOMPOマネー・ポートフォリオ・マザーファンド」                                                                                   |
|        | パワード・インカムファンド（適格機関投資家向け）                                                                                                                                                                                                                     | オンバランスでは短期金融資産等を、オフバランスでは担保付スワップ取引（円建て）を主要取引対象とします。                                                                                       |
|        | SOMPOマネー・ポートフォリオ・マザーファンド                                                                                                                                                                                                                     | わが国の公社債等                                                                                                                                  |
| 主な組入制限 | 債券パワード・インカムファンド（毎月分配型）                                                                                                                                                                                                                       | ①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。<br>②外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。<br>③デリバティブの直接利用は行いません。<br>④株式への直接投資は行いません。                                          |
|        | パワード・インカムファンド（適格機関投資家向け）                                                                                                                                                                                                                     | ①デリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。<br>②外貨建資産への投資は行いません。<br>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。<br>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。 |
|        | SOMPOマネー・ポートフォリオ・マザーファンド                                                                                                                                                                                                                     | ①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。<br>②外貨建資産への投資は行いません。                                   |
| 分配方針   | 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。<br>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。<br>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。                                                                                            |                                                                                                                                           |

債券パワード・インカムファンド  
（毎月分配型）  
〈愛称〉 パワード・インカム

第40期（決算日 2024年10月8日）  
第41期（決算日 2024年11月8日）  
第42期（決算日 2024年12月9日）  
第43期（決算日 2025年1月8日）  
第44期（決算日 2025年2月10日）  
第45期（決算日 2025年3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、「債券パワード・インカムファンド（毎月分配型）」は、このたび第45期の決算を行いましたので、第40期～第45期中の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

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

お問い合わせ先

TEL  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）

## ○最近30期の運用実績

| 決 算 期            | 基<br>(分配落) | 準 価 額 |     |             | 債 券 投 資 信 託 純 資 産<br>組 入 比 率 証 組 入 比 率 券 率 総 資 産 額 | %   | %    | 百万円    |
|------------------|------------|-------|-----|-------------|----------------------------------------------------|-----|------|--------|
|                  |            | 税 分   | 達 配 | み 期 騰 落 中 率 |                                                    |     |      |        |
|                  | 円          |       |     | 円           |                                                    | %   |      |        |
| 16期(2022年10月11日) | 5,016      |       |     | 40          | △ 8.8                                              | —   | 98.2 | 7,434  |
| 17期(2022年11月8日)  | 4,766      |       |     | 36          | △ 4.3                                              | —   | 98.3 | 7,902  |
| 18期(2022年12月8日)  | 5,333      |       |     | 40          | 12.7                                               | —   | 98.4 | 10,121 |
| 19期(2023年1月10日)  | 5,216      |       |     | 40          | △ 1.4                                              | —   | 98.4 | 12,045 |
| 20期(2023年2月8日)   | 5,433      |       |     | 40          | 4.9                                                | —   | 98.3 | 16,044 |
| 21期(2023年3月8日)   | 4,941      |       |     | 36          | △ 8.4                                              | —   | 98.4 | 18,555 |
| 22期(2023年4月10日)  | 5,341      |       |     | 40          | 8.9                                                | —   | 98.6 | 21,898 |
| 23期(2023年5月8日)   | 5,290      |       |     | 40          | △ 0.2                                              | —   | 98.4 | 23,118 |
| 24期(2023年6月8日)   | 5,008      |       |     | 40          | △ 4.6                                              | —   | 98.5 | 23,695 |
| 25期(2023年7月10日)  | 4,583      |       |     | 36          | △ 7.8                                              | —   | 98.3 | 24,111 |
| 26期(2023年8月8日)   | 4,742      |       |     | 36          | 4.3                                                | —   | 98.4 | 26,811 |
| 27期(2023年9月8日)   | 4,477      |       |     | 36          | △ 4.8                                              | —   | 98.3 | 26,399 |
| 28期(2023年10月10日) | 3,901      |       |     | 28          | △12.2                                              | —   | 98.0 | 23,997 |
| 29期(2023年11月8日)  | 4,059      |       |     | 32          | 4.9                                                | —   | 98.7 | 25,391 |
| 30期(2023年12月8日)  | 4,604      |       |     | 36          | 14.3                                               | —   | 98.4 | 30,298 |
| 31期(2024年1月9日)   | 4,783      |       |     | 35          | 4.6                                                | —   | 98.5 | 32,773 |
| 32期(2024年2月8日)   | 4,723      |       |     | 30          | △ 0.6                                              | —   | 99.0 | 32,133 |
| 33期(2024年3月8日)   | 4,709      |       |     | 30          | 0.3                                                | —   | 98.6 | 31,720 |
| 34期(2024年4月8日)   | 4,573      |       |     | 30          | △ 2.3                                              | 0.0 | 98.5 | 31,287 |
| 35期(2024年5月8日)   | 4,289      |       |     | 26          | △ 5.6                                              | 0.2 | 98.8 | 29,005 |
| 36期(2024年6月10日)  | 4,506      |       |     | 30          | 5.8                                                | 0.2 | 99.4 | 29,048 |
| 37期(2024年7月8日)   | 4,454      |       |     | 26          | △ 0.6                                              | 0.3 | 98.3 | 27,920 |
| 38期(2024年8月8日)   | 4,682      |       |     | 30          | 5.8                                                | 0.2 | 98.6 | 28,436 |
| 39期(2024年9月9日)   | 4,923      |       |     | 30          | 5.8                                                | 0.1 | 98.5 | 28,799 |
| 40期(2024年10月8日)  | 4,773      |       |     | 30          | △ 2.4                                              | 0.2 | 99.1 | 27,132 |
| 41期(2024年11月8日)  | 4,467      |       |     | 30          | △ 5.8                                              | 0.3 | 98.7 | 24,838 |
| 42期(2024年12月9日)  | 4,653      |       |     | 30          | 4.8                                                | 0.2 | 98.7 | 24,622 |
| 43期(2025年1月8日)   | 4,278      |       |     | 26          | △ 7.5                                              | 0.3 | 98.6 | 21,274 |
| 44期(2025年2月10日)  | 4,400      |       |     | 26          | 3.5                                                | 0.3 | 98.4 | 20,473 |
| 45期(2025年3月10日)  | 4,403      |       |     | 26          | 0.7                                                | 0.3 | 98.5 | 19,810 |

(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1万円当たり（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「パワード・インカムファンド（適格機関投資家向け）」の組入比率。

(注5) 当ファンドは、パワード・インカムファンド（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。

## ○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 組 入 比 率 |
|-------|------------|-------|-------|-------------|-----------------|
|       |            |       | 騰 落 率 |             |                 |
| 第40期  | (期 首)      | 円     | %     | %           | %               |
|       | 2024年9月9日  | 4,923 | —     | 0.1         | 98.5            |
|       | 9月末        | 5,002 | 1.6   | 0.2         | 98.5            |
|       | (期 末)      |       |       |             |                 |
|       | 2024年10月8日 | 4,803 | △2.4  | 0.2         | 99.1            |
| 第41期  | (期 首)      |       |       |             |                 |
|       | 2024年10月8日 | 4,773 | —     | 0.2         | 99.1            |
|       | 10月末       | 4,561 | △4.4  | 0.2         | 97.8            |
|       | (期 末)      |       |       |             |                 |
|       | 2024年11月8日 | 4,497 | △5.8  | 0.3         | 98.7            |
| 第42期  | (期 首)      |       |       |             |                 |
|       | 2024年11月8日 | 4,467 | —     | 0.3         | 98.7            |
|       | 11月末       | 4,604 | 3.1   | 0.3         | 98.1            |
|       | (期 末)      |       |       |             |                 |
|       | 2024年12月9日 | 4,683 | 4.8   | 0.2         | 98.7            |
| 第43期  | (期 首)      |       |       |             |                 |
|       | 2024年12月9日 | 4,653 | —     | 0.2         | 98.7            |
|       | 12月末       | 4,320 | △7.2  | 0.3         | 97.7            |
|       | (期 末)      |       |       |             |                 |
|       | 2025年1月8日  | 4,304 | △7.5  | 0.3         | 98.6            |
| 第44期  | (期 首)      |       |       |             |                 |
|       | 2025年1月8日  | 4,278 | —     | 0.3         | 98.6            |
|       | 1月末        | 4,349 | 1.7   | 0.3         | 97.9            |
|       | (期 末)      |       |       |             |                 |
|       | 2025年2月10日 | 4,426 | 3.5   | 0.3         | 98.4            |
| 第45期  | (期 首)      |       |       |             |                 |
|       | 2025年2月10日 | 4,400 | —     | 0.3         | 98.4            |
|       | 2月末        | 4,537 | 3.1   | 0.3         | 98.3            |
|       | (期 末)      |       |       |             |                 |
|       | 2025年3月10日 | 4,429 | 0.7   | 0.3         | 98.5            |

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

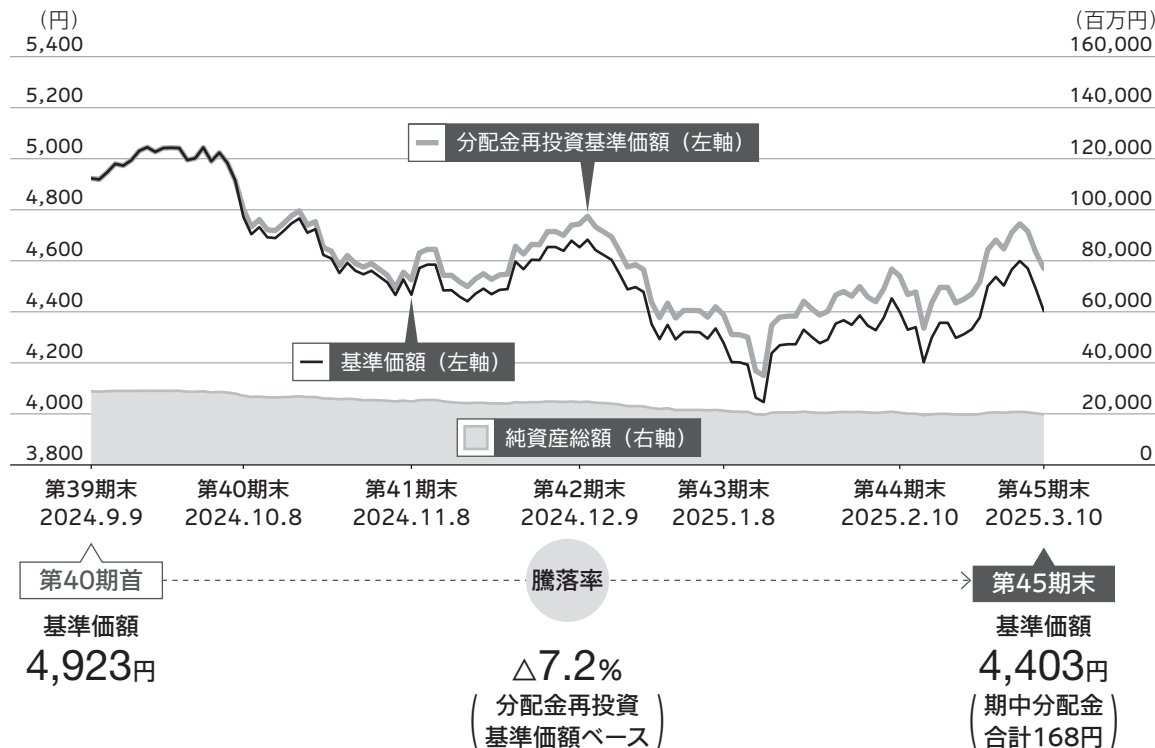
(注2) 債券組入比率はマザーファンドへの投資割合に応じて算出された当ファンドベースの組入比率。

(注3) 投資信託証券組入比率は「パワード・インカムファンド（適格機関投資家向け）」の組入比率。

(注4) 当ファンドは、パワード・インカムファンド（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。

## 運用経過

## ● 基準価額の推移



- 分配金再投資基準価額の推移は、2024年9月9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、パワード・インカムファンド（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

### 債券パワード・インカムファンド（毎月分配型）

主要投資対象である「パワード・インカムファンド（適格機関投資家向け）」投資信託証券の基準価額が下落したことから、当期の分配金再投資基準価額は下落しました。

主要投資対象である「パワード・インカムファンド（適格機関投資家向け）」投資信託証券においては、主に米国国債、ジニーメイ債、米国投資適格社債のエクスポージャーがマイナスに寄与しました。

- 本報告書では、ベビーファンド、マザーファンドおよ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

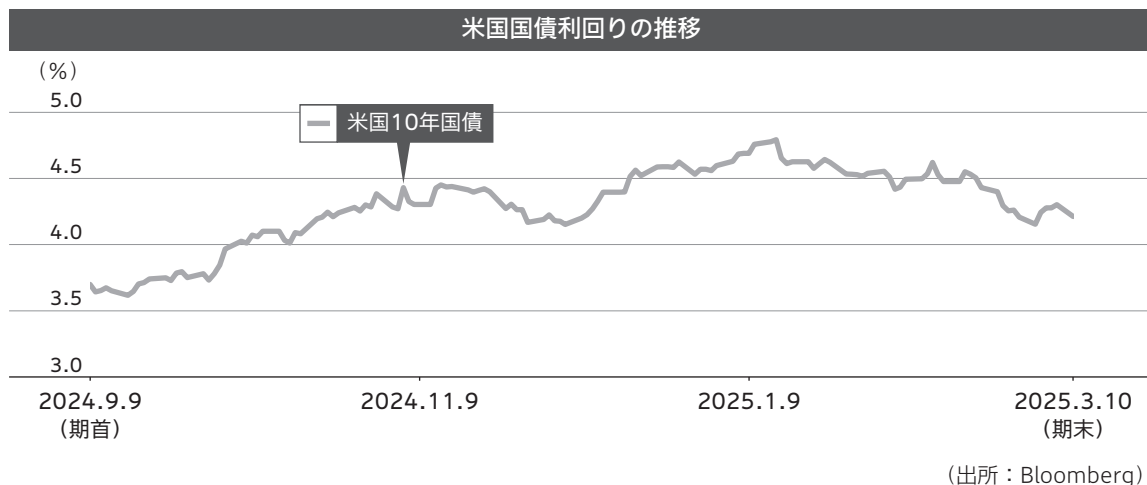


マザーファンド以外のファンド

## ● 投資環境

当期の米国債券市場は、FRB（米連邦準備理事会）が2024年9月に0.5%の利下げを実施したものの、FRBの政策金利見通しが市場予想よりも高い水準であったことや良好な雇用関連指標を受けて米国10年債利回りは上昇（価格は下落）しました。トランプ新大統領就任によるインフレ再燃懸念も利回り上昇要因となりました。一方、2025年に入ると、米消費者物価指数が市場予想を下回ったことやトランプ大統領の関税政策による米国経済の減速懸念が再び高まったことなどから、期末にかけて米国10年債利回りは低下（価格は上昇）しました。

このような中、米国投資適格社債及び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）は全般的に縮小しました。



## ● 当該投資信託のポートフォリオ

期を通じて、主要投資対象である「パワード・インカムファンド（適格機関投資家向け）」投資信託証券の投資比率を高位に維持しました。

### パワード・インカムファンド（適格機関投資家向け）

ポートフォリオにおける各資産への投資配分比率の合計は期初に400%としていましたが、価格変動リスクを抑えながらポートフォリオの利回り水準を高位に維持するため、2024年12月以降、米国投資適格社債への投資配分比率を引き上げました。期末の配分比率の合計は500%、各資産の配分比率は、米国ハイイールド社債が250%、米国投資適格社債が150%、米国国債が50%、ジニーメイ債が50%となりました。

| ポートフォリオ構成比率、利回り |       |
|-----------------|-------|
| 資産              | 比率    |
| 投資資産全体          | 500%  |
| 米国国債            | 50%   |
| ジニーメイ債          | 50%   |
| 米国投資適格社債        | 150%  |
| 米国ハイイールド社債      | 250%  |
| 利回り             | 5.97% |

注1．第45期末における各資産の数字です。

注2．利回りはパワード・インカムファンド（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。

### 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

当ファンドは、パワード・インカムファンド（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

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40期<br>2024.9.10<br>} 2024.10.8 | 第41期<br>2024.10.9<br>} 2024.11.8 | 第42期<br>2024.11.9<br>} 2024.12.9 | 第43期<br>2024.12.10<br>} 2025.1.8 | 第44期<br>2025.1.9<br>} 2025.2.10 | 第45期<br>2025.2.11<br>} 2025.3.10 |
|-----------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 当期分配金     | 30                               | 30                               | 30                               | 26                               | 26                              | 26                               |
| （対基準価額比率） | 0.625%                           | 0.667%                           | 0.641%                           | 0.604%                           | 0.587%                          | 0.587%                           |
| 当期の収益     | 29                               | 26                               | 30                               | 26                               | 26                              | 26                               |
| 当期の収益以外   | 0                                | 3                                | —                                | —                                | —                               | —                                |
| 翌期繰越分配対象額 | 948                              | 944                              | 945                              | 946                              | 950                             | 950                              |

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。



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。

## ● 今後の運用方針

### 債券パワード・インカムファンド（毎月分配型）

引き続き「パワード・インカムファンド（適格機関投資家向け）」投資信託証券への投資を通じて、米国の国債、ジニーメイ債、投資適格社債、ハイイールド社債に実質的に分散投資を行い、投資比率を定期的に見直すことで、インカムゲインの確保と信託財産の成長を目指します。

### パワード・インカムファンド（適格機関投資家向け）

FRBの金融政策は利上げから利下げのサイクルへと移行していますが、米国の物価、雇用をはじめとする強弱入り乱れる経済指標に加え、トランプ政権の掲げる関税をはじめとする各種政策に伴う米国経済への影響、ウクライナを巡る問題など地政学リスクの高まりなどから、先行きの不透明感が高く、ボラティリティの高い市場環境が継続することが想定されます。今後の運用については、引き続き、パワード・インカム戦略のパフォーマンスに連動する担保付スワップ取引の組入を行う予定です。

### 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

| 項目        | 第40期～第45期<br>2024.9.10～2025.3.10 |         | 項目の概要                                                                                     |
|-----------|----------------------------------|---------|-------------------------------------------------------------------------------------------|
|           | 金額                               | 比率      |                                                                                           |
| (a) 信託報酬  | 35円                              | 0.757%  | (a) 信託報酬＝各期中の平均基準価額×信託報酬率（年率）× $\frac{\text{各期の日数}}{\text{年間の日数}}$<br>期中の平均基準価額は4,562円です。 |
| （投信会社）    | （11）                             | （0.247） | ファンドの運用の対価                                                                                |
| （販売会社）    | （23）                             | （0.494） | 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<br>管理等の対価                                               |
| （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等の対価                                                                  |
| (b) その他費用 | 0                                | 0.002   | (b) その他費用＝ $\frac{\text{各期中のその他費用}}{\text{各期中の平均受益権口数}}$                                  |
| （監査費用）    | （ 0）                             | （0.002） | 監査法人に支払うファンドの監査にかかる費用                                                                     |
| （その他）     | （ 0）                             | （0.000） | 信託事務の処理にかかるその他の費用等                                                                        |
| 合計        | 35                               | 0.759   |                                                                                           |

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。

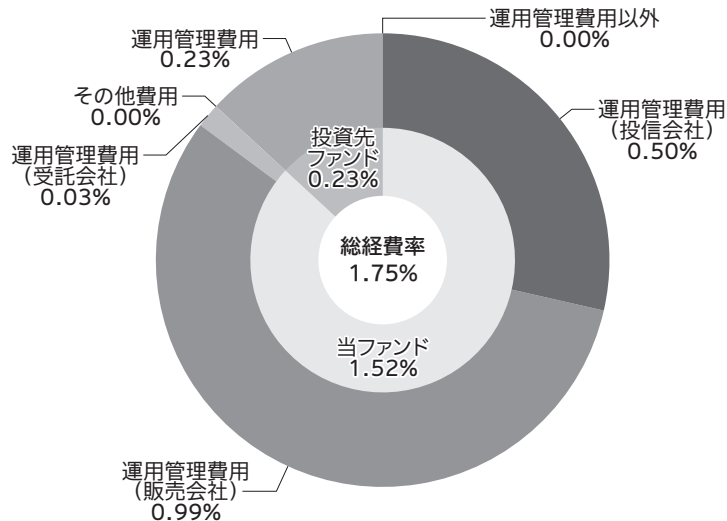
注3．比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

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1.75%**です。



(単位: %)

|                      |      |
|----------------------|------|
| 総経費率(①+②+③)          | 1.75 |
| ①当ファンドの費用の比率         | 1.52 |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率   | 0.23 |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.00 |

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。

○売買及び取引の状況

(2024年9月10日～2025年3月10日)

投資信託証券

| 銘柄 |                          | 第40期～第45期 |         |                     |                 |
|----|--------------------------|-----------|---------|---------------------|-----------------|
|    |                          | 買付        |         | 売付                  |                 |
|    |                          | 口数        | 金額      | 口数                  | 金額              |
| 国内 | パワード・インカムファンド（適格機関投資家向け） | 口<br>—    | 千円<br>— | 口<br>13,909,110,428 | 千円<br>5,990,000 |

(注1) 金額は受渡代金。  
(注2) 単位未満は切捨て。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘柄 |                          | 第40期～第45期 |         |              |              |
|----|--------------------------|-----------|---------|--------------|--------------|
|    |                          | 設定        |         | 解約           |              |
|    |                          | 口数        | 金額      | 口数           | 金額           |
|    | SOMPOマネー・ポートフォリオ・マザーファンド | 千口<br>—   | 千円<br>— | 千口<br>14,032 | 千円<br>14,000 |

(注) 単位未満は切捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2024年9月10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)

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39期末               | 第45期末               |                  |           |
|----|--------------------------|---------------------|---------------------|------------------|-----------|
|    |                          | 口数                  | 口数                  | 評価額              | 比率        |
|    | パワード・インカムファンド（適格機関投資家向け） | 口<br>59,858,991,828 | 口<br>45,949,881,400 | 千円<br>19,505,724 | %<br>98.5 |
|    | 合計                       | 59,858,991,828      | 45,949,881,400      | 19,505,724       | 98.5      |

(注) 単位未満は切捨て。

親投資信託残高

| 銘                        | 柄 | 第39期末   | 第45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 |   | 116,766 | 102,734 | 102,508 |

(注1) 単位未満は切捨て。  
(注2) 当ファンドは、第45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ございません。

○投資信託財産の構成 (2025年3月10日現在)

| 項                        | 目 | 第45期末      |       |
|--------------------------|---|------------|-------|
|                          |   | 評価額        | 比率    |
|                          |   | 千円         | %     |
| 投資信託受益証券                 |   | 19,505,724 | 97.5  |
| SOMPOマネー・ポートフォリオ・マザーファンド |   | 102,508    | 0.5   |
| コール・ローン等、その他             |   | 401,814    | 2.0   |
| 投資信託財産総額                 |   | 20,010,046 | 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40期末           | 第41期末           | 第42期末           | 第43期末           | 第44期末           | 第45期末           |
|----------------|-------------------------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
|                |                               | 2024年10月8日現在    | 2024年11月8日現在    | 2024年12月9日現在    | 2025年1月8日現在     | 2025年2月10日現在    | 2025年3月10日現在    |
|                |                               | 円               | 円               | 円               | 円               | 円               | 円               |
| (A) 資産         |                               | 27,511,916,217  | 25,103,558,024  | 24,958,210,415  | 21,507,171,777  | 20,856,330,769  | 20,010,046,395  |
|                | コール・ローン等                      | 514,538,350     | 481,237,371     | 528,541,914     | 411,758,949     | 309,260,072     | 281,810,873     |
|                | 投資信託受益証券(評価額)                 | 26,880,936,807  | 24,505,879,693  | 24,313,215,722  | 20,978,960,401  | 20,150,593,192  | 19,505,724,654  |
|                | SOMPOマネー・ポートフォリオ・マザーファンド(評価額) | 116,439,510     | 116,439,510     | 116,451,187     | 116,451,187     | 116,474,540     | 102,508,166     |
|                | 未収入金                          | —               | —               | —               | —               | 280,000,000     | 120,000,000     |
|                | 未収利息                          | 1,550           | 1,450           | 1,592           | 1,240           | 2,965           | 2,702           |
| (B) 負債         |                               | 379,451,467     | 264,573,302     | 336,048,942     | 232,370,117     | 382,543,355     | 200,040,790     |
|                | 未払収益分配金                       | 170,551,657     | 166,821,221     | 158,759,829     | 129,292,490     | 120,991,281     | 116,973,999     |
|                | 未払解約金                         | 174,090,572     | 64,055,257      | 145,466,347     | 74,924,944      | 233,156,971     | 59,578,564      |
|                | 未払信託報酬                        | 34,740,488      | 33,628,074      | 31,754,016      | 28,083,933      | 28,326,353      | 23,419,477      |
|                | その他未払費用                       | 68,750          | 68,750          | 68,750          | 68,750          | 68,750          | 68,750          |
| (C) 純資産総額(A－B) |                               | 27,132,464,750  | 24,838,984,722  | 24,622,161,473  | 21,274,801,660  | 20,473,787,414  | 19,810,005,605  |
|                | 元本                            | 56,850,552,548  | 55,607,073,867  | 52,919,943,171  | 49,727,880,901  | 46,535,108,168  | 44,989,999,655  |
|                | 次期繰越損益金                       | △29,718,087,798 | △30,768,089,145 | △28,297,781,698 | △28,453,079,241 | △26,061,320,754 | △25,179,994,050 |
| (D) 受益権総口数     |                               | 56,850,552,548口 | 55,607,073,867口 | 52,919,943,171口 | 49,727,880,901口 | 46,535,108,168口 | 44,989,999,655口 |
|                | 1万口当たり基準価額(C／D)               | 4,773円          | 4,467円          | 4,653円          | 4,278円          | 4,400円          | 4,403円          |

(注1) 当作成期間（第40期～第45期）における期首元本額58,502,772,038円、期中追加設定元本額2,684,324,489円、期中一部解約元本額16,197,096,872円  
(注2) 期末における1口当たりの純資産総額  
第40期0.4773円、第41期0.4467円、第42期0.4653円、第43期0.4278円、第44期0.4400円、第45期0.4403円  
(注3) 期末における元本の欠損金額  
第40期29,718,087,798円、第41期30,768,089,145円、第42期28,297,781,698円、第43期28,453,079,241円、第44期26,061,320,754円、第45期25,179,994,050円

## ○損益の状況

| 項 目               | 第40期                      | 第41期                      | 第42期                      | 第43期                      | 第44期                     | 第45期                      |
|-------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|--------------------------|---------------------------|
|                   | 2024年9月10日～<br>2024年10月8日 | 2024年10月9日～<br>2024年11月8日 | 2024年11月9日～<br>2024年12月9日 | 2024年12月10日～<br>2025年1月8日 | 2025年1月9日～<br>2025年2月10日 | 2025年2月11日～<br>2025年3月10日 |
|                   | 円                         | 円                         | 円                         | 円                         | 円                        | 円                         |
| (A) 配当等収益         | 202,577,971               | 181,529,563               | 168,562,780               | 158,268,081               | 144,704,030              | 138,466,139               |
| 受取配当金             | 202,541,680               | 181,492,426               | 168,531,564               | 158,233,503               | 144,646,192              | 138,402,381               |
| 受取利息              | 36,291                    | 37,137                    | 31,216                    | 34,578                    | 57,838                   | 63,758                    |
| (B) 有価証券売買損益      | △ 856,622,915             | △ 1,670,275,304           | 1,003,813,915             | △ 1,859,807,631           | 568,702,426              | 18,124,463                |
| 売買益               | 13,005,319                | 34,413,192                | 1,017,614,548             | 64,345,338                | 605,596,226              | 29,429,258                |
| 売買損               | △ 869,628,234             | △ 1,704,688,496           | △ 13,800,633              | △ 1,924,152,969           | △ 36,893,800             | △ 11,304,795              |
| (C) 信託報酬等         | △ 34,815,178              | △ 33,696,824              | △ 31,822,766              | △ 28,152,683              | △ 28,395,103             | △ 23,488,227              |
| (D) 当期損益金 (A+B+C) | △ 688,860,122             | △ 1,522,442,565           | 1,140,553,929             | △ 1,729,692,233           | 685,011,353              | 133,102,375               |
| (E) 前期繰越損益金       | △ 3,551,605,440           | △ 4,240,290,743           | △ 5,620,543,735           | △ 4,332,978,750           | △ 5,765,098,458          | △ 5,022,822,416           |
| (F) 追加信託差損益金      | △ 25,307,070,579          | △ 24,838,534,616          | △ 23,659,032,063          | △ 22,261,115,768          | △ 20,860,242,368         | △ 20,173,300,010          |
| (配当等相当額)          | ( 4,969,918,147)          | ( 4,869,632,894)          | ( 4,636,096,844)          | ( 4,358,645,153)          | ( 4,080,883,897)         | ( 3,945,755,031)          |
| (売買損益相当額)         | (△ 30,276,988,726)        | (△ 29,708,167,510)        | (△ 28,295,128,907)        | (△ 26,619,760,921)        | (△ 24,941,126,265)       | (△ 24,119,055,041)        |
| (G) 計 (D+E+F)     | △ 29,547,536,141          | △ 30,601,267,924          | △ 28,139,021,869          | △ 28,323,786,751          | △ 25,940,329,473         | △ 25,063,020,051          |
| (H) 収益分配金         | △ 170,551,657             | △ 166,821,221             | △ 158,759,829             | △ 129,292,490             | △ 120,991,281            | △ 116,973,999             |
| 次期繰越損益金 (G+H)     | △ 29,718,087,798          | △ 30,768,089,145          | △ 28,297,781,698          | △ 28,453,079,241          | △ 26,061,320,754         | △ 25,179,994,050          |
| 追加信託差損益金          | △ 25,307,070,579          | △ 24,838,534,616          | △ 23,659,032,063          | △ 22,261,115,768          | △ 20,860,242,368         | △ 20,173,300,010          |
| (配当等相当額)          | ( 4,969,918,197)          | ( 4,869,632,959)          | ( 4,636,096,856)          | ( 4,358,645,171)          | ( 4,080,883,918)         | ( 3,945,755,039)          |
| (売買損益相当額)         | (△ 30,276,988,776)        | (△ 29,708,167,575)        | (△ 28,295,128,919)        | (△ 26,619,760,939)        | (△ 24,941,126,286)       | (△ 24,119,055,049)        |
| 分配準備積立金           | 419,983,884               | 384,745,830               | 369,927,325               | 346,371,147               | 340,454,741              | 329,522,559               |
| 繰越損益金             | △ 4,831,001,103           | △ 6,314,300,359           | △ 5,008,676,960           | △ 6,538,334,620           | △ 5,541,533,127          | △ 5,336,216,599           |

(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（2024年9月10日～2025年3月10日）は以下の通りです。

| 項 目                 | 2024年9月10日～<br>2024年10月8日 | 2024年10月9日～<br>2024年11月8日 | 2024年11月9日～<br>2024年12月9日 | 2024年12月10日～<br>2025年1月8日 | 2025年1月9日～<br>2025年2月10日 | 2025年2月11日～<br>2025年3月10日 |
|---------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|--------------------------|---------------------------|
| a. 配当等収益(費用控除後)     | 167,768,550円              | 147,838,457円              | 163,991,835円              | 130,120,688円              | 138,953,202円             | 117,710,184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   | 4,969,918,197円            | 4,869,632,959円            | 4,636,096,856円            | 4,358,645,171円            | 4,080,883,918円           | 3,945,755,039円            |
| d. 信託約款に規定する分配準備積立金 | 422,766,991円              | 403,728,594円              | 364,695,319円              | 345,542,949円              | 322,492,820円             | 328,786,374円              |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d)  | 5,560,453,738円            | 5,421,200,010円            | 5,164,784,010円            | 4,834,308,808円            | 4,542,329,940円           | 4,392,251,597円            |
| f. 分配対象収益(1万口当たり)   | 978円                      | 974円                      | 975円                      | 972円                      | 976円                     | 976円                      |
| g. 分配金              | 170,551,657円              | 166,821,221円              | 158,759,829円              | 129,292,490円              | 120,991,281円             | 116,973,999円              |
| h. 分配金(1万口当たり)      | 30円                       | 30円                       | 30円                       | 26円                       | 26円                      | 26円                       |

○分配金のお知らせ

|                 | 第40期 | 第41期 | 第42期 | 第43期 | 第44期 | 第45期 |
|-----------------|------|------|------|------|------|------|
| 1 万口当たり分配金（税込み） | 30円  | 30円  | 30円  | 26円  | 26円  | 26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>

・お手持り分配金は、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       | パワード・インカムファンド（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、パークレイズ・バンク・ピーエルシー（英国パークレイズ銀行）が提供するパワード・インカム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パワード・インカム戦略は、米国の国債、ジニーメイ債、投資適格社債及びハイイールド社債を投資対象とします。各資産の利回り水準、実績変動率と相関係数を基礎データとして年率12%の利回り（「目標利回り」）を目指しつつ、最も低い価格変動リスクを示す投資配分で分散投資を行う戦略です。投資配分は定期的に見直しされます。目標利回りを達成するため、パワード・インカム戦略はレバレッジを利用します。各資産の配分比率の合計は500%を上限とします。なお、パワード・インカム戦略が目標利回りを達成できない場合があります。戦略の実際の収益率は市況動向等により変動します。</p> <p>③原則として、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>④市場動向や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>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 決算日      | 原則、毎月23日（休業日の場合は翌営業日）                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 信託報酬等    | <p>純資産総額に対して年率0.231%（税抜0.21%）程度。</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（以下「消費税等」といいます。）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> <p>■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バランスコスト</p> <p>■スワップ取引の一部または全部解約費用</p> <p>■ファンド監査費用</p> <p>■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）</p> <p>■法令で定める価格等調査にかかる費用</p> <p>■信託財産に関する租税</p> <p>■信託事務の処理等に要する諸費用</p> <p>■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</p>                                                           |
| 申込・解約手数料 | ありません。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 委託会社     | パ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 (2024年 8月24日～2025年 2月25日)

| 項 目           | 比 率   |
|---------------|-------|
| 運用管理費用        | 0.23% |
| その他費用         | 0.00% |
| トータルエクスペンスレシオ | 0.24% |

※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 2月25日

| 銘柄名   |              | 国   | 組入比率  |
|-------|--------------|-----|-------|
| 1     | 第1288回国庫短期証券 | 日本  | 47.3% |
| 2     | 第1276回国庫短期証券 | 日本  | 18.9% |
| 3     | 第1220回国庫短期証券 | 日本  | 6.8%  |
| 4     | 第1270回国庫短期証券 | 日本  | 5.7%  |
| 5     | 第1231回国庫短期証券 | 日本  | 3.6%  |
| 6     | 第1257回国庫短期証券 | 日本  | 3.0%  |
| 7     | 第1244回国庫短期証券 | 日本  | 2.8%  |
| 8     | 第1238回国庫短期証券 | 日本  | 2.4%  |
| 9     | —            | —   | —     |
| 10    | —            | —   | —     |
| 組入銘柄数 |              | 8銘柄 |       |

注1. オフバランス部分でエクセス・リターン・スワップを98.5%組  
入れています。  
注2. 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。  
注3. 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<br>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。<br>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       | 債 組 入 比 | 券 率  | 純 資 産 額 |
|----------------|--------|-----------|---------|------|---------|
|                |        | 期 騰 落 中 率 |         |      |         |
| (設定日)          | 円      | %         |         | %    | 百万円     |
| 2021年2月26日     | 10,000 | —         |         | —    | 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1万円当たり（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。

○当期中の基準価額と市況等の推移

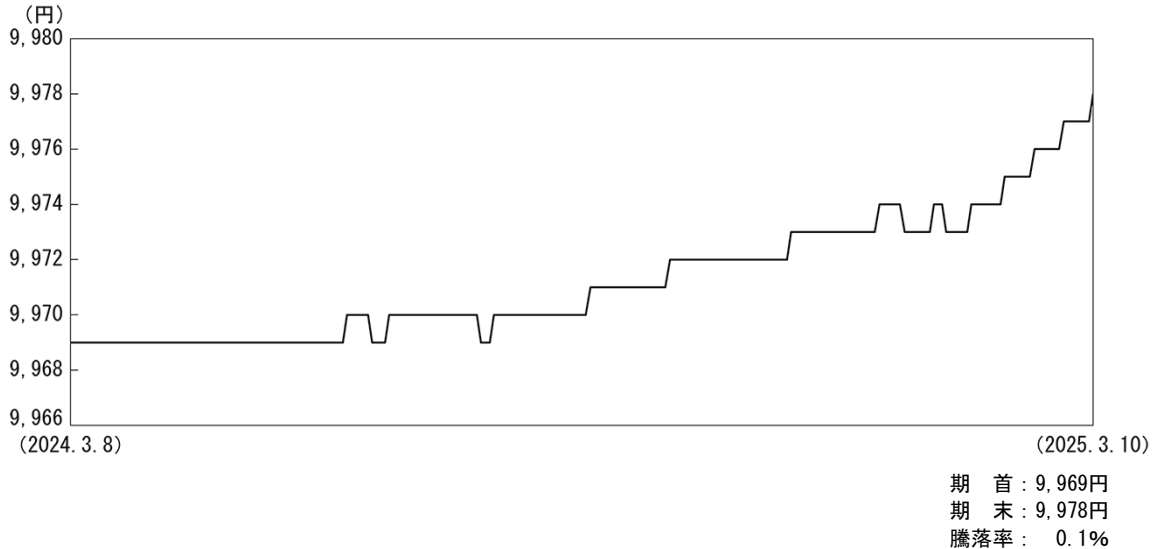
| 年 | 月             | 日 | 基 準   | 価 額 |     | 債 組 入 比 | 券 率  |
|---|---------------|---|-------|-----|-----|---------|------|
|   |               |   |       | 騰 落 | 率   |         |      |
|   | (期 首)         |   | 円     |     | %   |         | %    |
|   | 2024年 3 月 8 日 |   | 9,969 |     | —   |         | —    |
|   | 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) 騰落率は期首比。  
(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



## ■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 費 用       | 円<br>0 | %<br>0.003 | (a)その他費用= $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}}$<br>信託事務の処理にかかるその他の費用等 |
| ( そ の 他 )           | (0)    | (0.003)    |                                                                             |
| 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あります。

(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<br>1,679,658 | 千円<br>—<br>(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BB格以下<br>組 入 比 率 |      |      |        |
|      |           |           |         |                    | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満   |
| 国債証券 | 千円        | 千円        | %       | %                  | %    | %    | %      |
|      | 300,000   | 299,866   | 53.9    | —                  | —    | —    | 53.9   |
|      | (300,000) | (299,866) | (53.9)  | (—)                | (—)  | (—)  | (53.9) |
| 合 計  | 300,000   | 299,866   | 53.9    | —                  | —    | —    | 53.9   |
|      | (300,000) | (299,866) | (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      | 千円      |             |
| 第1273回国庫短期証券 | —     | 100,000 | 99,992  | 2025/ 3 /17 |
| 第1286回国庫短期証券 | —     | 100,000 | 99,945  | 2025/ 5 /12 |
| 第1290回国庫短期証券 | —     | 100,000 | 99,928  | 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        |
|-----------------|--------------|
|                 | 円            |
| (A) 資産          | 556,687,137  |
| コール・ローン等        | 256,818,275  |
| 公社債(評価額)        | 299,866,400  |
| 未収利息            | 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  |
| 米国ハイイールド社債エンハンス戦略ファンド(毎月分配型) | 22,239,448円  |
| 米国ハイイールド社債エンハンス戦略ファンド(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        |
|------------------|------------|
|                  | 円          |
| (A) 配当等収益        | 269,607    |
| 受取利息             | 272,706    |
| 支払利息             | △ 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。