

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	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。 ②原則として、「米国ハイイールド社債エンハンス戦略ファンド（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。 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。	
主要投資対象	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）／（資産成長型）	「米国ハイイールド社債エンハンス戦略ファンド（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」
	米国ハイイールド社債エンハンス戦略ファンド（適格機関投資家向け）	オンバランスではわが国の国債、国内コマーシャル・ペーパー、特別目的会社が発行する担保付SPC債（円建て）等を、オフバランスでは担保付スワップ取引（円建て）を主要投資対象とします。
	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	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）／（資産成長型）	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 ③デリバティブの直接利用は行いません。 ④株式への直接投資は行いません。
	米国ハイイールド社債エンハンス戦略ファンド（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。 ②外貨建資産への投資は行いません。 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。 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。 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。 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（評価損益を含みません）等の全額とします。 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。	

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）／（資産成長型）
〈愛称〉利回り名人

（毎月分配型）

第1期（決算日 2024年12月10日）
第2期（決算日 2025年1月10日）
第3期（決算日 2025年2月10日）
第4期（決算日 2025年3月10日）
第5期（決算日 2025年4月10日）

（資産成長型）

第1期（決算日 2025年4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戦略ファンド（毎月分配型）」は、このたび第5期の決算を行いましたので、第1～5期中の運用状況、「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）」は、このたび第1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

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）

（毎月分配型）

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額			債 券 組 入 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率	純 資 産 総 額
		税 分	込 配	み 期 金 騰 落 中 率			
(設定日)	円		円	%	%	%	百万円
2024年10月31日	10,000		—	—	—	—	523
1 期(2024年12月10日)	9,994		0	△0.1	0.5	96.8	1,027
2 期(2025年 1 月10日)	10,269		60	3.4	0.5	96.6	2,266
3 期(2025年 2 月10日)	9,823		60	△3.8	0.5	96.3	2,450
4 期(2025年 3 月10日)	9,600		60	△1.7	0.4	95.8	2,656
5 期(2025年 4 月10日)	9,174		60	△3.8	0.6	96.7	2,840

- (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。

○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 組 入 比	券 率	投 資 信 託 組 入 比 率
			騰 落 率			
第 1 期	(設定日) 2024年10月31日	円 10,000	% —		% —	% —
	11月末	10,002	0.0		0.4	97.0
	(期 末) 2024年12月10日	9,994	△0.1		0.5	96.8
第 2 期	(期 首) 2024年12月10日	9,994	—		0.5	96.8
	12月末	10,216	2.2		0.5	96.2
	(期 末) 2025年 1 月10日	10,329	3.4		0.5	96.6
第 3 期	(期 首) 2025年 1 月10日	10,269	—		0.5	96.6
	1 月末	10,080	△1.8		0.5	95.7
	(期 末) 2025年 2 月10日	9,883	△3.8		0.5	96.3
第 4 期	(期 首) 2025年 2 月10日	9,823	—		0.5	96.3
	2 月末	9,831	0.1		0.4	95.1
	(期 末) 2025年 3 月10日	9,660	△1.7		0.4	95.8
第 5 期	(期 首) 2025年 3 月10日	9,600	—		0.4	95.8
	3 月末	9,692	1.0		0.4	97.0
	(期 末) 2025年 4 月10日	9,234	△3.8		0.6	96.7

(注 1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比（第 1 期は設定日比）。

(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 (分配落)	価 額			債 券 組 入 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率	純 資 産 総 額
		税 分	込 配	み 騰 落 中 率			
(設定日)	円	円		%	%	%	百万円
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

- (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「米国ハイイールド社債エンハンス戦略ファンド（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。

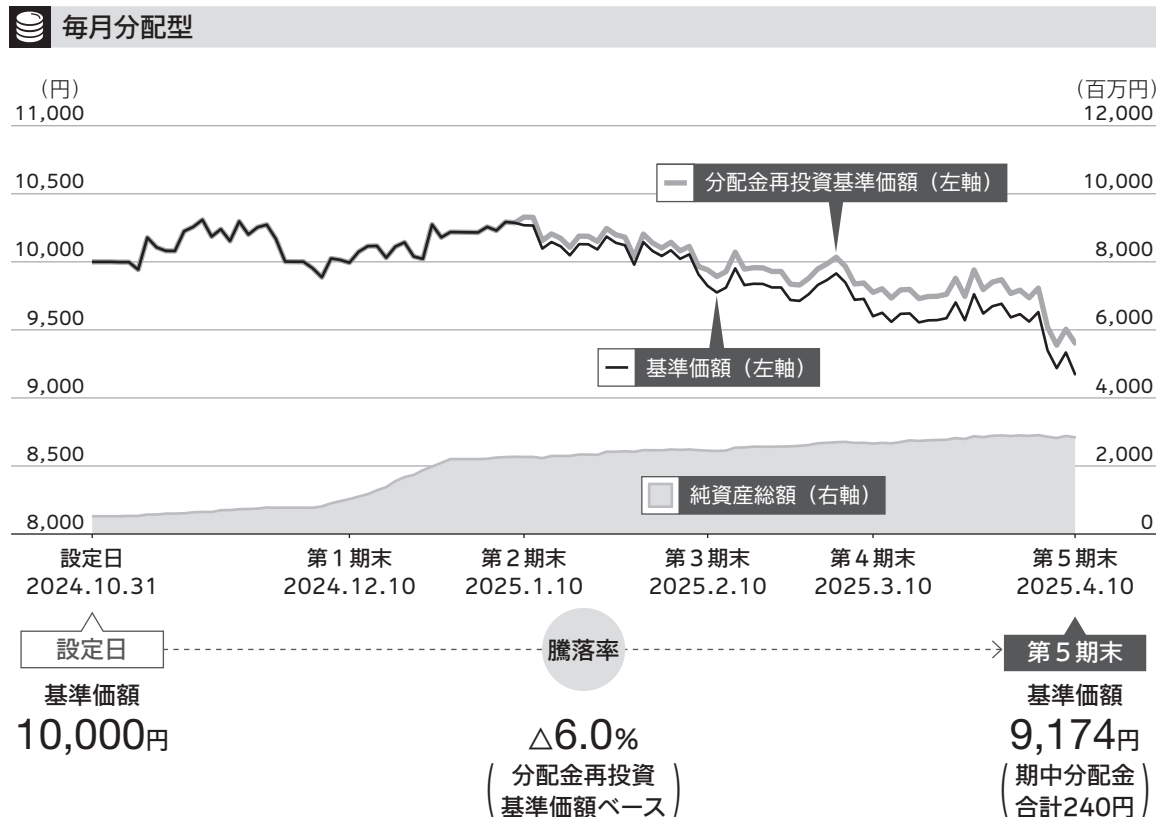
○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額		債 券 組 入 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
		騰 落	率		
(設定日)	円		%	%	%
2024年10月31日	10,000		—	—	—
11月末	10,028		0.3	0.6	97.0
12月末	10,238		2.4	0.4	96.2
2025年 1 月末	10,169		1.7	0.3	96.0
2 月末	9,984		△0.2	0.3	94.9
3 月末	9,905		△1.0	0.3	95.2
(期 末)					
2025年 4 月10日	9,439		△5.6	0.5	97.0

- (注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は設定日比。
(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。

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、設定時の基準価額（10,000円）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「米国ハイイールド社債エンハンス戦略ファンド（適格機関投資家向け）」投資信託証券において、社債の保有効果はプラスとなりましたが、円高の影響によりファンド全体ではマイナ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

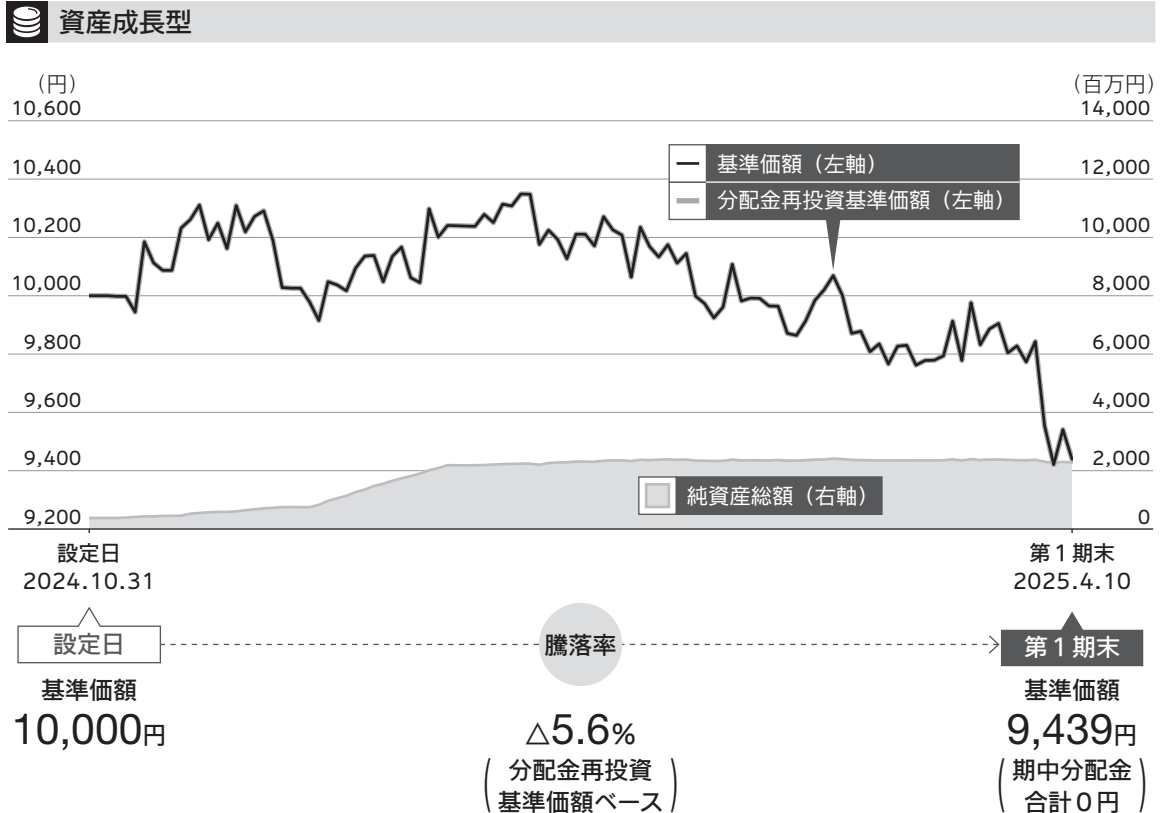


マザーファンド



マザーファンド以外のファンド

● 基準価額の推移



- 分配金再投資基準価額の推移は、設定時の基準価額（10,000円）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下落したことから、当期の基準価額は下落しました。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、社債の保有効果はプラスとなりましたが、円高の影響によりファンド全体ではマイナ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

米国債利回りは、期初から底堅い雇用情勢や、FRB（米連邦準備理事会）が政策金利見通しを引き上げたことなどをを受けて上昇（価格は下落）しました。2025年1月中旬以降は、米国の消費者物価指数が市場予想を下振れたことや、トランプ大統領による関税政策を受けて、米国景気の減速懸念が高まったことなどから、利回りは低下（価格は上昇）基調となりました。4月に入り、トランプ大統領の関税政策の発表を受けて利回りは乱高下しました。

米国ハイイールド社債のクレジットスプレッド（国債との利回り格差）は全般的に拡大しました。為替は、円高ドル安となりました。

● 当該投資信託のポートフォリオ



毎月分配型／資産成長型

各ファンドは主要投資対象である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戦略へ投資を行いました。社債の保有効果はプラスとなりましたが、円高の影響によりファンド全体ではマイナスのリターンとなりました。

利回り	
利回り	10.6%

注1．2025年3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	107.54%
為替ヘッジなし	35.46%
合計(米国ハイイールド社債)	143.00%

注．比率は毎月分配型は第5期末、資産成長型は第1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1期 2024.10.31 } 2024.12.10	第2期 2024.12.11 } 2025.1.10	第3期 2025.1.11 } 2025.2.10	第4期 2025.2.11 } 2025.3.10	第5期 2025.3.11 } 2025.4.10
当期分配金	—	60	60	60	60
（対基準価額比率）	—%	0.581%	0.607%	0.621%	0.650%
当期の収益	—	60	60	59	57
当期の収益以外	—	—	—	0	2
翌期繰越分配対象額	60	268	240	242	243

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1期 2024.10.31～2025.4.10
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	315

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、インカムゲインの確保と信託財産の成長を図ることを目指します。

米国ハイイールド社債エンハンス戦略ファンド（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1期～第5期 2024.10.31～2025.4.10		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	57円	0.576%	(a) 信託報酬＝各期中の平均基準価額×信託報酬率（年率）× $\frac{\text{各期の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は9,970円です。
（投信会社）	（17）	（0.171）	ファンドの運用の対価
（販売会社）	（39）	（0.391）	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）	（1）	（0.015）	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＝ $\frac{\text{各期中のその他費用}}{\text{各期中の平均受益権口数}}$
（監査費用）	（0）	（0.005）	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	58	0.581	

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。

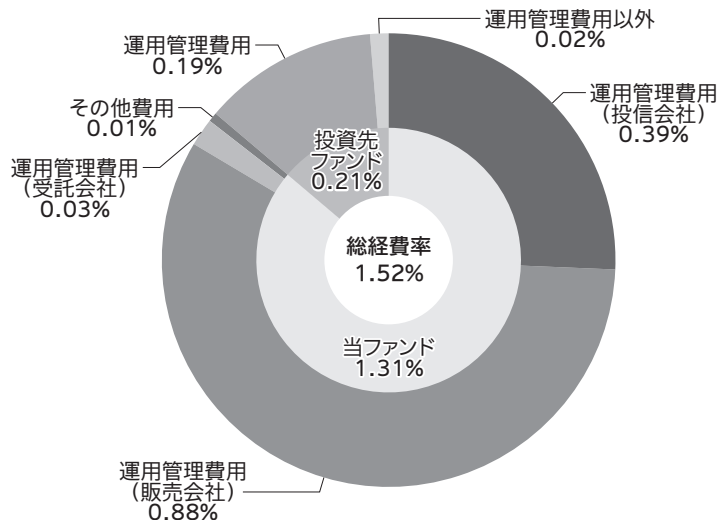
注3．比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

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1.52%**です。



(単位: %)

総経費率(①+②+③)	1.52
①当ファンドの費用の比率	1.31
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	0.02

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 1 期 2024.10.31～2025.4.10		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	58円	0.576%	$(a) \text{ 信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率（年率）} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は10,054円です。
（投信会社）	（17）	（0.171）	ファンドの運用の対価
（販売会社）	（39）	（0.391）	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）	（1）	（0.015）	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	$(d) \text{ その他費用} = \frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}}$
（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
（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	59	0.581	

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。

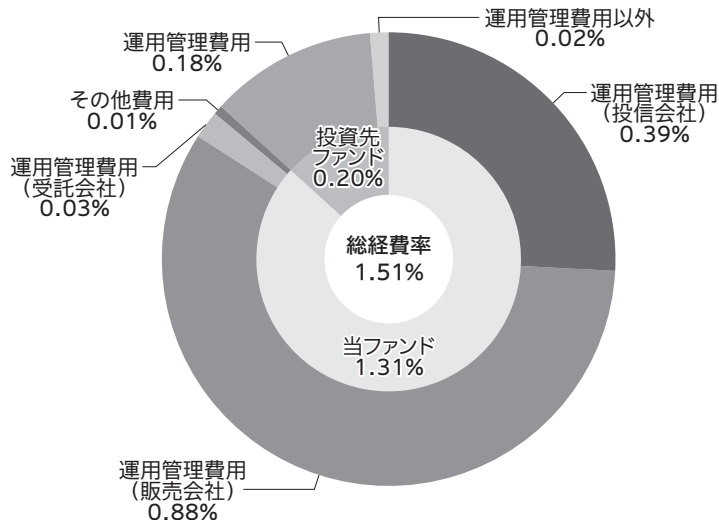
注 3. 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

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1.51%**です。



（単位：％）

総経費率(①+②+③)	1.51
①当ファンドの費用の比率	1.31
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.18
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.02

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

（2024年10月31日～2025年4月10日）

投資信託証券

銘柄		第1期～第5期			
		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戦略ファンド（適格機関投資家向け）	3,013,520	685千円	3,006,930	930千円

（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1期～第5期			
		設定		解約	
		口数	金額	口数	金額
SOMPOマナー・ポートフォリオ・マザーファンド		22,239	千円	—	千円

（注1）単位未満は切捨て。
（注2）金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

（2024年10月31日～2025年4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4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		
		口数	評価額	比率
米国ハイイールド社債エンハンス戦略ファンド（適格機関投資家向け）		3,013,520	685千円	96.7%
合計		3,013,520	685千円	96.7%

（注）単位未満は切捨て。

親投資信託残高

銘	柄	第 5 期末	
		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	千円
	22,239		22,194

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 当ファンドは、第5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4月10日現在)

項 目	第 5 期末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	2,745,920	95.9
SOMPOマネー・ポートフォリオ・マザーファンド	22,194	0.8
コール・ローン等、その他	93,872	3.3
投資信託財産総額	2,861,986	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 1 期末	第 2 期末	第 3 期末	第 4 期末	第 5 期末
	2024年12月10日現在	2025年1月10日現在	2025年2月10日現在	2025年3月10日現在	2025年4月10日現在
	円	円	円	円	円
(A) 資産	1,028,336,964	2,281,576,886	2,468,161,376	2,676,189,449	2,861,986,695
コール・ローン等	22,499,222	69,281,515	85,047,761	108,304,087	93,870,778
投資信託受益証券(評価額)	994,877,150	2,190,113,538	2,360,928,951	2,545,693,803	2,745,920,048
SOMPOマネー・ポートフォリオ・マザーファンド(評価額)	10,960,525	22,181,625	22,183,849	22,190,521	22,194,969
未収利息	67	208	815	1,038	900
(B) 負債	978,177	15,344,336	17,611,619	19,207,677	21,701,299
未払収益分配金	—	13,241,769	14,968,349	16,606,265	18,576,345
未払信託報酬	970,133	2,085,257	2,621,507	2,579,997	3,099,226
その他未払費用	8,044	17,310	21,763	21,415	25,728
(C) 純資産総額(A－B)	1,027,358,787	2,266,232,550	2,450,549,757	2,656,981,772	2,840,285,396
元本	1,028,001,726	2,206,961,594	2,494,724,841	2,767,710,884	3,096,057,631
次期繰越損益金	△ 642,939	59,270,956	△ 44,175,084	△ 110,729,112	△ 255,772,235
(D) 受益権総口数	1,028,001,726口	2,206,961,594口	2,494,724,841口	2,767,710,884口	3,096,057,631口
1万口当たり基準価額(C／D)	9,994円	10,269円	9,823円	9,600円	9,174円

(注1) 当作成期間（第1期～第5期）における期首元本額523,346,366円、期中追加設定元本額2,582,987,225円、期中一部解約元本額10,275,960円

(注2) 期末における1口当たりの純資産総額

第1期0.9994円、第2期1.0269円、第3期0.9823円、第4期0.9600円、第5期0.9174円

(注3) 期末における元本の欠損金額

第1期642,939円、第3期44,175,084円、第4期110,729,112円、第5期255,772,235円

○損益の状況

項 目	第 1 期	第 2 期	第 3 期	第 4 期	第 5 期
	2024年10月31日～ 2024年12月10日	2024年12月11日～ 2025年 1月10日	2025年 1月11日～ 2025年 2月10日	2025年 2月11日～ 2025年 3月10日	2025年 3月11日～ 2025年 4月10日
	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	5,350,209	16,552,908	17,806,767	19,086,400	21,019,415
受取配当金	5,346,621	16,548,474	17,793,131	19,065,310	20,991,345
受取利息	3,588	4,434	13,636	21,090	28,070
(B) 有価証券売買損益	△8,242,325	45,587,222	△106,232,363	△ 61,668,476	△130,450,116
売買益	525	45,587,488	2,224	6,672	21,767
売買損	△8,242,850	△ 266	△106,234,587	△ 61,675,148	△130,471,883
(C) 信託報酬等	△ 985,877	△ 2,102,567	△ 2,643,270	△ 2,601,412	△ 3,124,954
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△3,877,993	60,037,563	△ 91,068,866	△ 45,183,488	△112,555,655
(E) 前期繰越損益金	—	△ 3,877,957	42,917,837	△ 63,119,378	△124,474,728
(F) 追加信託差損益金	3,235,054	16,353,119	18,944,294	14,180,019	△ 165,507
(配当等相当額)	(1,873,677)	(9,375,724)	(16,802,472)	(24,016,241)	(33,123,642)
(売買損益相当額)	(1,361,377)	(6,977,395)	(2,141,822)	(△ 9,836,222)	(△ 33,289,149)
(G) 計 (D + E + F)	△ 642,939	72,512,725	△ 29,206,735	△ 94,122,847	△237,195,890
(H) 収益分配金	0	△13,241,769	△ 14,968,349	△ 16,606,265	△ 18,576,345
次期繰越損益金 (G + H)	△ 642,939	59,270,956	△ 44,175,084	△110,729,112	△255,772,235
追加信託差損益金	3,235,054	16,353,119	18,944,294	14,180,019	△ 165,507
(配当等相当額)	(1,873,755)	(9,376,096)	(16,802,588)	(24,016,361)	(33,123,835)
(売買損益相当額)	(1,361,299)	(6,977,023)	(2,141,706)	(△ 9,836,342)	(△ 33,289,342)
分配準備積立金	4,364,917	42,917,837	43,114,987	42,996,656	42,168,327
繰越損益金	△8,242,910	—	△106,234,365	△167,905,787	△297,775,055

(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10月31日～2025年4月10日）は以下の通りです。

項 目	2024年10月31日～ 2024年12月10日	2024年12月11日～ 2025年 1月10日	2025年 1月11日～ 2025年 2月10日	2025年 2月11日～ 2025年 3月10日	2025年 3月11日～ 2025年 4月10日
a. 配当等収益(費用控除後)	4,364,917円	15,993,841円	15,165,499円	16,487,934円	17,897,548円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	0円	35,800,887円	0円	0円	0円
c. 信託約款に規定する収益調整金	1,873,755円	16,353,119円	16,802,588円	24,016,361円	33,123,835円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	0円	4,364,878円	42,917,837円	43,114,987円	42,847,124円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	6,238,672円	72,512,725円	74,885,924円	83,619,282円	93,868,507円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	60円	328円	300円	302円	303円
g. 分配金	0円	13,241,769円	14,968,349円	16,606,265円	18,576,345円
h. 分配金(1万口当たり)	0円	60円	60円	60円	60円

（資産成長型）

○売買及び取引の状況

（2024年10月31日～2025年4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ド戦略ファンド（適格機関投資家向け）	口 2,425,080,971	千円 2,431,340	口 —	千円 —

（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	設 定		解 約	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	SOMPOマナー・ポートフォリオ・マザーファンド	千口 15,622	千円 15,580	千口 —	千円 —

（注1）単位未満は切捨て。

（注2）金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

（2024年10月31日～2025年4月10日）

該当事項はありません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

（2024年10月31日～2025年4月10日）

設定時 （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4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	当 期 末		
		口 数	評 価 額	比 率
	米国ハイイールド社債エンハンスド戦略ファンド（適格機関投資家向け）	口 2,425,080,971	千円 2,209,733	% 97.0
合	計	2,425,080,971	2,209,733	97.0

（注）単位未満は切捨て。

親投資信託残高

銘	柄	当 期 末	
		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	千円
		15,622	15,591

(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4月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 2, 209, 733	% 96. 5
SOMPOマネー・ポートフォリオ・マザーファンド	15, 591	0. 7
コール・ローン等、その他	64, 116	2. 8
投資信託財産総額	2, 289, 440	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4月10日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,289,440,200
コール・ローン等	64,114,491
投資信託受益証券(評価額)	2,209,733,780
SOMPOマネー・ポートフォリオ・マザーファンド(評価額)	15,591,315
未収利息	614
(B) 負債	10,577,737
未払信託報酬	10,490,659
その他未払費用	87,078
(C) 純資産総額(A－B)	2,278,862,463
元本	2,414,210,096
次期繰越損益金	△ 135,347,633
(D) 受益権総口数	2,414,210,096口
1万口当たり基準価額(C／D)	9.439円

- (注1) 信託財産に係る期首元本額378,616,991円、期中追加設定元本額2,050,222,426円、期中一部解約元本額14,629,321円
(注2) 期末における1口当たりの純資産総額 0.9439円
(注3) 期末における元本の欠損金額 135,347,633円

○損益の状況（2024年10月31日～2025年4月10日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	73,269,744
受取配当金	73,196,350
受取利息	73,394
(B) 有価証券売買損益	△220,992,421
売買益	613,786
売買損	△221,606,207
(C) 信託報酬等	△ 10,585,437
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	△158,308,114
(E) 追加信託差損益金	22,960,481
(配当等相当額)	(13,584,858)
(売買損益相当額)	(9,375,623)
(F) 計(D＋E)	△135,347,633
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F＋G)	△135,347,633
追加信託差損益金	22,960,481
(配当等相当額)	(13,585,315)
(売買損益相当額)	(9,375,166)
分配準備積立金	62,691,247
繰越損益金	△220,999,361

- (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10月31日～2025年4月10日）は以下の通りです。

項 目	2024年10月31日～ 2025年4月10日
a. 配当等収益(費用控除後)	62,691,247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	13,585,315円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	0円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	76,276,562円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	315円
g. 分配金	0円

○分配金のお知らせ

（ 毎 月 分 配 型 ）	第 1 期	第 2 期	第 3 期	第 4 期	第 5 期
1 万口当たり分配金（税込み）	0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。

○お知らせ

米国ハイイールド社債エンハンススト戦略ファンド（毎月分配型）

米国ハイイールド社債エンハンススト戦略ファンド（資産成長型）

- ・投資信託及び投資法人に関する法律第14条の改正に伴い、投資信託約款の「運用報告書に記載すべき事項」を「運用状況に係る情報」に変更するなどの必要があるため、投資信託約款に所要の変更を致しました（2025年4月1日）。

<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	米国ハイイールド社債エンハンス戦略ファンド（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	①スワップ取引への投資を通じて、パークレイズ・バンク・ビーエルシー（英国パークレイズ銀行）が提供する米国ハイイールド社債エンハンス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。 ②米国ハイイールド社債エンハンス戦略は、米国の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します。 ③米国のハイイールド社債に係るエクスポージャーは、米国のハイ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、米国のハイイールド社債の変動率が高まっ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。 *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。 ④為替リスクコントロール戦略は米ドル円の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イールド社債が持つ為替リスクの最適化を目指します。 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。 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。 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。 *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債を通じて、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。 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。
主な投資制限	①デリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。 ②外貨建資産への投資は行いません。 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。 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。 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。 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。 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。
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	純資産総額に対して年率0.231%（税抜0.21%） ※上記のほか、以下の費用がかかります。 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。 ■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	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11月 1 日～2025年 3 月25日)

項 目	比 率
運用管理費用	0.23%
その他費用	0.02%
トータルエクスペンスレシオ	0.25%

※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 3 月25日

銘柄名		国	組入比率
1	第1 2 8 8 回国庫短期証券	日本	35.6%
2	第1 2 7 0 回国庫短期証券	日本	21.9%
3	第1 2 6 3 回国庫短期証券	日本	12.0%
4	第1 2 7 6 回国庫短期証券	日本	12.0%
5	第1 2 8 1 回国庫短期証券	日本	4.0%
6	—	—	—
7	—	—	—
8	—	—	—
9	—	—	—
10	—	—	—
組入銘柄数		5 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り、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		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

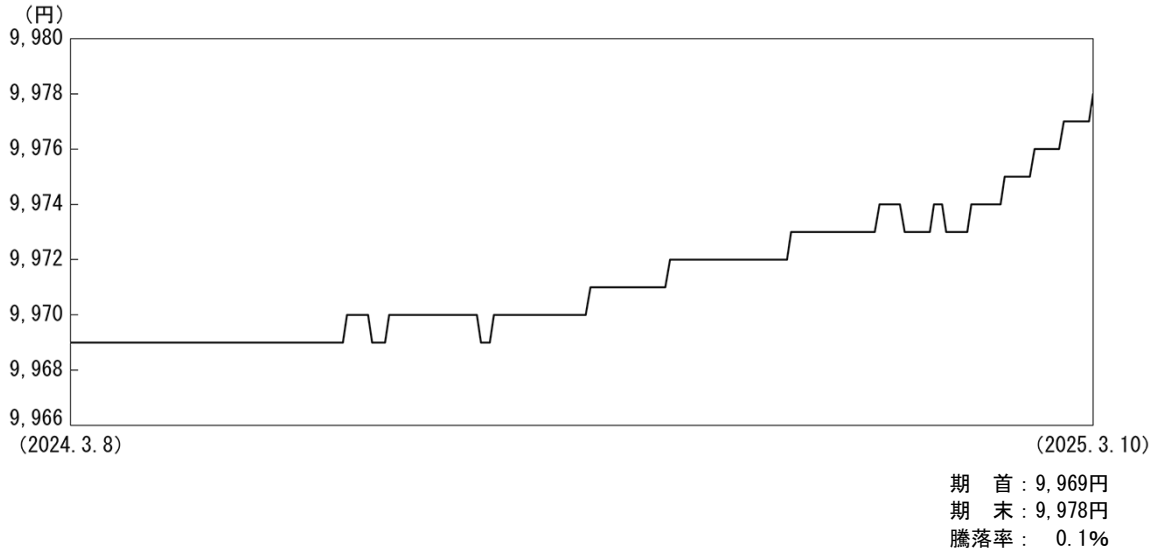
(注1) 騰落率は期首比。

(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 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
(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 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 B格以下 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。