

## 運用報告書 (全体版)

### ルーミス米国投資適格債券ファンド [毎月決算型]

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	2003年10月31日から無期限です。	
運用方針	主として米国の米ドル建て公社債に投資を行い、安定した収益の確保と信託財産の中・長期的な成長を目指します。	
主要投資対象	ルーミス米国投資適格債券ファンド [毎月決算型]	ルーミス米国投資適格債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	ルーミス米国投資適格債券マザーファンド	主として米国の米ドル建て公社債を主要投資対象とします。
運用方法	投資を行う公社債の格付けについては、原則として取得時においてBBB- (B a a 3) 格以上の格付けを有する公社債に投資を行うとともに、ファンド全体の加重平均格付けをA- (A 3) 格以上に維持します。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。ルーミス米国投資適格債券マザーファンドにおける円の余資運用以外の運用の指図に関する権限を、ルーミス・セイレス・アンド・カンパニー・エル・ピーに委託します。	
組入制限	ルーミス米国投資適格債券ファンド [毎月決算型]	外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
	ルーミス米国投資適格債券マザーファンド	外貨建資産への投資には制限を設けません。
分配方針	第3期以降の毎期、原則として経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益 (評価益を含みます。以下同じ。) 等の全額を分配対象額の範囲とし、分配金額は、原則として利息収入相当分を中心とし、委託会社が基準価額の水準、市況動向等を勘案して決定します。なお、売買益については、原則として毎年6月および12月の決算時に分配を行います。ただし、分配対象額が少額の場合ならびに委託会社が基準価額の水準、市況動向を勘案したうえで、分配を見送る場合があります。	

第199期	<決算日	2020年5月20日>
第200期	<決算日	2020年6月22日>
第201期	<決算日	2020年7月20日>
第202期	<決算日	2020年8月20日>
第203期	<決算日	2020年9月23日>
第204期	<決算日	2020年10月20日>

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「ルーミス米国投資適格債券ファンド [毎月決算型]」は、2020年10月20日に第204期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター : 0120-104-694

受付時間 : 営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

<http://www.am-one.co.jp/>

# ルーミス米国投資適格債券ファンド [毎月決算型]

## ■最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			ブルームバーグ・バークレイズ 米国政府/クレジット指数		為替		債 券 組 比	債 券 入 率	債 先 比	債 券 率	純資産 総額
		(分配落)	税込み 分配金	期 中 騰落率	(為替ノーヘッジ・円ベース) (参考指数)	期 中 騰落率	(対米ドル)	期 中 騰落率					
第30作成期	175期(2018年5月21日)	円	円	%		%	円	%	%	%	%	百万円	
	176期(2018年6月20日)	7,475	15	2.4	391.06	2.4	111.09	3.4	95.8	96.8	-	6,080	
	177期(2018年7月20日)	7,450	15	△0.1	391.66	0.2	110.09	△0.9	96.8	-	-	5,829	
	178期(2018年8月20日)	7,641	15	2.8	405.11	3.4	112.61	2.3	97.8	-	-	5,947	
	178期(2018年8月20日)	7,498	15	△1.7	396.99	△2.0	110.56	△1.8	97.0	-	-	5,815	
	179期(2018年9月20日)	7,537	15	0.7	400.13	0.8	112.38	1.6	97.8	-	-	5,803	
第31作成期	180期(2018年10月22日)	7,480	15	△0.6	398.59	△0.4	112.49	0.1	96.8	-	-	5,732	
	181期(2018年11月20日)	7,471	15	0.1	400.76	0.5	112.67	0.2	97.7	-	-	5,695	
	182期(2018年12月20日)	7,536	15	1.1	406.60	1.5	112.60	△0.1	95.9	-	-	5,671	
	183期(2019年1月21日)	7,355	15	△2.2	397.75	△2.2	109.67	△2.6	94.1	-	-	5,509	
	184期(2019年2月20日)	7,529	15	2.6	406.60	2.2	110.75	1.0	96.8	-	-	5,621	
	185期(2019年3月20日)	7,609	15	1.3	411.41	1.2	111.65	0.8	96.8	-	-	5,663	
第32作成期	186期(2019年4月22日)	7,696	15	1.3	417.46	1.5	111.99	0.3	97.8	-	-	5,716	
	187期(2019年5月20日)	7,630	15	△0.7	414.54	△0.7	110.17	△1.6	97.7	-	-	5,678	
	188期(2019年6月20日)	7,605	15	△0.1	418.37	0.9	107.79	△2.2	96.5	-	-	5,587	
	189期(2019年7月22日)	7,648	15	0.8	417.25	△0.3	107.98	0.2	97.3	-	-	5,559	
	190期(2019年8月20日)	7,737	15	1.4	423.99	1.6	106.65	△1.2	96.8	-	-	5,583	
	191期(2019年9月20日)	7,772	15	0.6	427.12	0.7	108.06	1.3	94.9	-	-	5,599	
第33作成期	192期(2019年10月21日)	7,827	15	0.9	430.77	0.9	108.52	0.4	96.5	-	-	5,597	
	193期(2019年11月20日)	7,826	15	0.2	431.37	0.1	108.61	0.1	97.2	-	-	5,533	
	194期(2019年12月20日)	7,869	15	0.7	434.46	0.7	109.43	0.8	95.7	-	-	5,570	
	195期(2020年1月20日)	7,963	15	1.4	440.92	1.5	110.19	0.7	96.0	-	-	5,635	
	196期(2020年2月20日)	8,169	15	2.8	452.20	2.6	111.28	1.0	97.1	-	-	5,657	
	197期(2020年3月23日)	7,594	15	△6.9	441.80	△2.3	110.82	△0.4	98.3	-	-	5,234	
第34作成期	198期(2020年4月20日)	8,022	15	5.8	451.32	2.2	107.89	△2.6	96.2	-	-	5,524	
	199期(2020年5月20日)	8,017	15	0.1	452.50	0.3	107.98	0.1	97.1	-	-	5,463	
	200期(2020年6月22日)	8,146	15	1.8	455.24	0.6	106.77	△1.1	97.7	-	-	5,495	
	201期(2020年7月20日)	8,288	15	1.9	461.91	1.5	107.52	0.7	96.3	-	-	5,552	
	202期(2020年8月20日)	8,165	15	△1.3	455.03	△1.5	106.09	△1.3	97.7	-	-	5,394	
	203期(2020年9月23日)	8,094	15	△0.7	452.86	△0.5	105.14	△0.9	94.7	-	-	5,345	
204期(2020年10月20日)	8,082	15	0.0	453.19	0.1	105.59	0.4	95.7	-	-	5,307		

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注4) ブルームバーグ・バークレイズ米国政府/クレジット指数(為替ノーヘッジ・円ベース)は、基準価額への反映を考慮して前営業日の値を用いております(小数第3位四捨五入)。また、為替(対米ドル)は、当日の対顧客電信相場仲値を用いております(以下同じ)。

(注5) ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーの商標およびサービスマークです。バークレイズは、ライセンスに基づき使用されているバークレイズ・バンク・ビーエルシーの商標およびサービスマークです。ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社(以下「ブルームバーグ」と総称します。)またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・バークレイズ・インデックスに対する一切の独占的権利を有しています(以下同じ)。

(注6) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

## ■過去6ヶ月間の基準価額と市況の推移

決算期	年月日	基準価額		ブルームバーグ・パークレイズ 米国政府/クレジット指数 (為替ノーヘッジ・円ベース) (参考指数)		為替		債券 組入比率	債券 先物比率
		騰落率	騰落率	(対米ドル)	騰落率				
第199期	(期首) 2020年4月20日	円 8,022	% -	% 451.32	% -	円 107.89	% -	% 96.2	% -
	4月末	7,967	△0.7	448.29	△0.7	106.87	△0.9	96.7	-
	(期末) 2020年5月20日	8,032	0.1	452.50	0.3	107.98	0.1	97.1	-
第200期	(期首) 2020年5月20日	8,017	-	452.50	-	107.98	-	97.1	-
	5月末	8,066	0.6	453.33	0.2	107.53	△0.4	95.8	-
	(期末) 2020年6月22日	8,161	1.8	455.24	0.6	106.77	△1.1	97.7	-
第201期	(期首) 2020年6月22日	8,146	-	455.24	-	106.77	-	97.7	-
	6月末	8,226	1.0	459.56	0.9	107.74	0.9	97.9	-
	(期末) 2020年7月20日	8,303	1.9	461.91	1.5	107.52	0.7	96.3	-
第202期	(期首) 2020年7月20日	8,288	-	461.91	-	107.52	-	96.3	-
	7月末	8,145	△1.7	456.77	△1.1	104.60	△2.7	96.9	-
	(期末) 2020年8月20日	8,180	△1.3	455.03	△1.5	106.09	△1.3	97.7	-
第203期	(期首) 2020年8月20日	8,165	-	455.03	-	106.09	-	97.7	-
	8月末	8,079	△1.1	451.45	△0.8	105.36	△0.7	97.9	-
	(期末) 2020年9月23日	8,109	△0.7	452.86	△0.5	105.14	△0.9	94.7	-
第204期	(期首) 2020年9月23日	8,094	-	452.86	-	105.14	-	94.7	-
	9月末	8,124	0.4	455.33	0.5	105.80	0.6	94.6	-
	(期末) 2020年10月20日	8,097	0.0	453.19	0.1	105.59	0.4	95.7	-

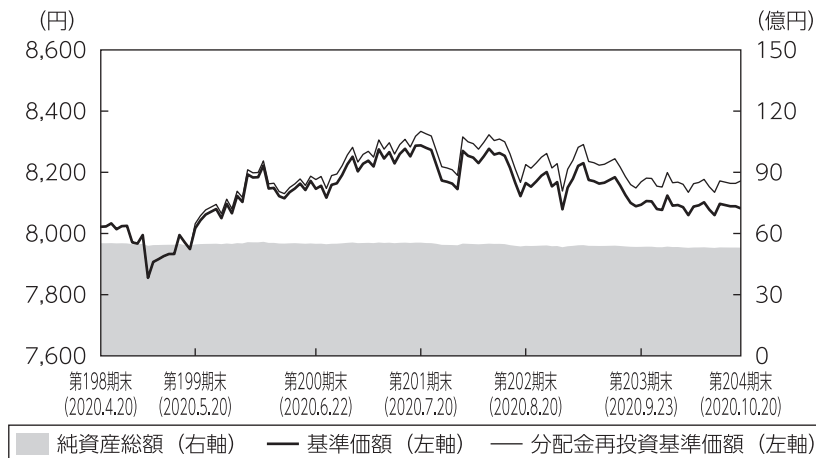
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

## ■第199期～第204期の運用経過（2020年4月21日から2020年10月20日まで）

### 基準価額等の推移



第199期首： 8,022円  
 第204期末： 8,082円  
 （既払分配金90円）  
 騰落率： 1.9%  
 （分配金再投資ベース）

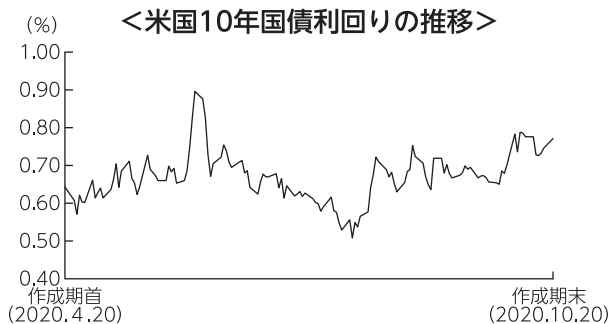
- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

### 基準価額の主な変動要因

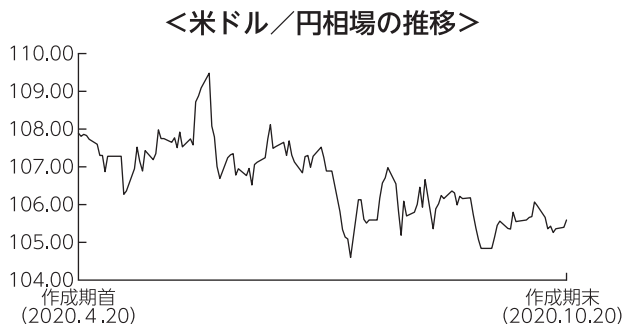
「ルーミス米国投資適格債券マザーファンド」受益証券への投資を通じて、米国の投資適格債券に投資を行った結果、社債市場が堅調に推移したことなどから、基準価額（分配金再投資ベース）は上昇しました。

## 投資環境

### ●海外債券市況と為替市況



(注) 値は前営業日のものを用いています。



米国国債市場は下落（利回りは上昇）しました。8月上旬にかけては、新型コロナウイルスの感染拡大懸念を受けリスク回避姿勢が高まったことなどから上昇しました。作成期末にかけては、米国債に対する先行きの需給悪化懸念などから下落し、作成期を通じては下落しました。

米国の投資適格社債市場は上昇しました。信用スプレッドが金融会社やREITセクターを中心に全般的に縮小したことが上昇要因となりました。

米ドルは対円で下落しました。

作成期初は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大に伴う世界景気の下押し懸念の高まりなどを背景に米国国債利回りが低下したことなどから下落しました。その後は、米経済活動の再開を背景にリスク選好姿勢が高まったことなどから上昇した場面もあったものの、作成期後半は、新型コロナウイルス感染再拡大への懸念や米国の金融緩和政策の長期化観測などから下落しました。

## ポートフォリオについて

### ●当ファンド

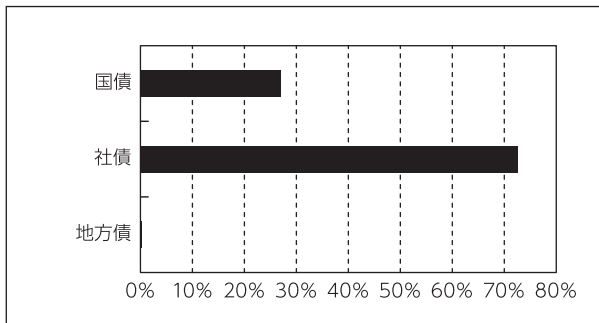
「ルーミス米国投資適格債券マザーファンド」受益証券の組入比率を高位に維持しました。なお、実質組入外貨建資産に対して為替ヘッジを行いませんでした。

### ●ルーミス米国投資適格債券マザーファンド

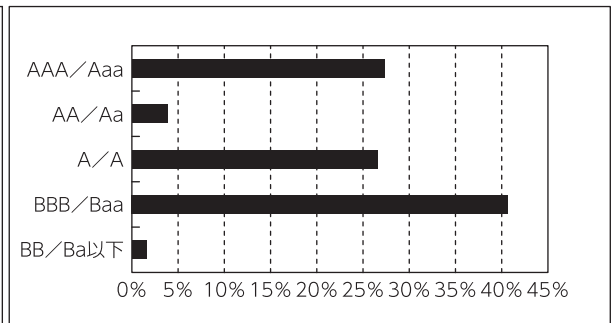
米国の投資適格債券に投資を行い、個別銘柄の選別により分散されたポートフォリオの構築を行いました。当作成期末時点における債券の組入比率は、国債を3割程度、普通社債を7割程度とし、組入比率を高位に維持しました。ファンド全体の加重平均格付については、当ファンドの運用の基本方針に従い、A格以上を維持しました。上記の通り運用を行った結果、社債市場が堅調に推移したことなどから基準価額は上昇しました。

作成期末

【種別保有比率】



【格付別保有比率】



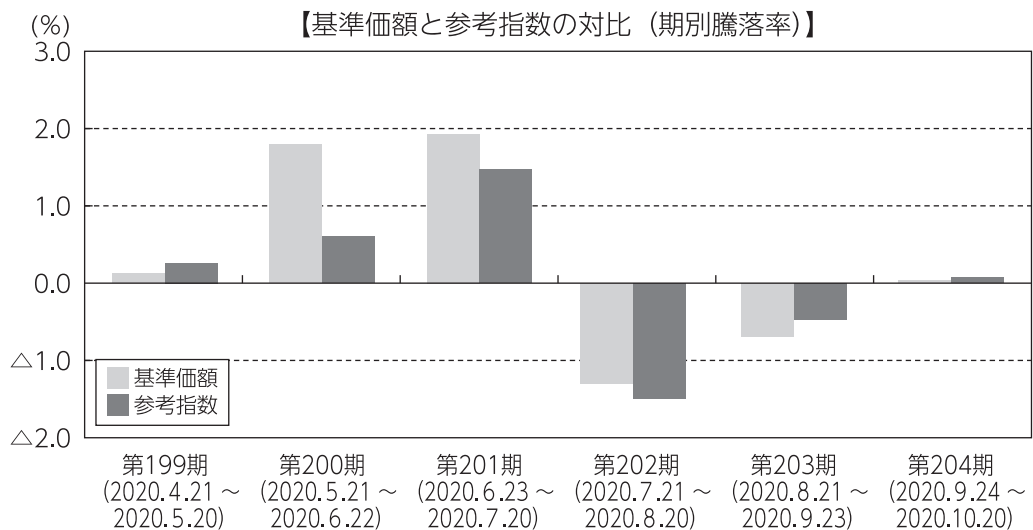
(注) 比率はルーミス米国投資適格債券マザーファンドの債券部分を100%換算したものをを用いています。

(注1) 比率はルーミス米国投資適格債券マザーファンドの債券部分を100%換算したものをを用いています。

(注2) 格付はS & P、Moody'sの高いほうの格付を採用しています。

## ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

## 分配金

当作成期の収益分配金は、利息収入相当分を中心とし、基準価額の水準、市況動向等を勘案して、下記のとおりといたしました。なお、収益分配に充てなかった収益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

### ■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	第199期	第200期	第201期	第202期	第203期	第204期
	2020年4月21日 ～2020年5月20日	2020年5月21日 ～2020年6月22日	2020年6月23日 ～2020年7月20日	2020年7月21日 ～2020年8月20日	2020年8月21日 ～2020年9月23日	2020年9月24日 ～2020年10月20日
当期分配金（税引前）	15円	15円	15円	15円	15円	15円
対基準価額比率	0.19%	0.18%	0.18%	0.18%	0.18%	0.19%
当期の収益	10円	15円	15円	10円	11円	9円
当期の収益以外	4円	-円	-円	4円	3円	5円
翌期繰越分配対象額	198円	204円	208円	203円	199円	193円

（注1）「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切捨てで算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

（注2）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。また、小数点第3位を四捨五入しています。

（注3）「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・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

## 今後の運用方針

### ●当ファンド

「ルーミス米国投資適格債券マザーファンド」受益証券の組入比率を高位に維持する方針です。

### ●ルーミス米国投資適格債券マザーファンド

米国では新型コロナウイルスの感染拡大の影響によりしばらくは不安定な状況が続くものとみています。しかし、FRB（米連邦準備制度理事会）が流動性の改善に向けて社債の購入を実施するなど、金融政策や財政政策などは市場の下支え要因になると考えます。

引き続き発行体のクオリティを重視しつつ米国の投資適格債券に投資を行い、安定した収益の確保と信託財産の中・長期的な成長を目指します。



## ■ 1 万口当たりの費用明細

項目	第199期～第204期 (2020年4月21日 ～2020年10月20日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	60円	
(投信会社)	(34)	(0.413)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(25)	(0.303)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	( 2)	(0.027)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) その他費用	2	0.025	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保管費用)	( 2)	(0.024)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
(監査費用)	( 0)	(0.001)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
(その他)	( 0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	62	0.768	

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。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。

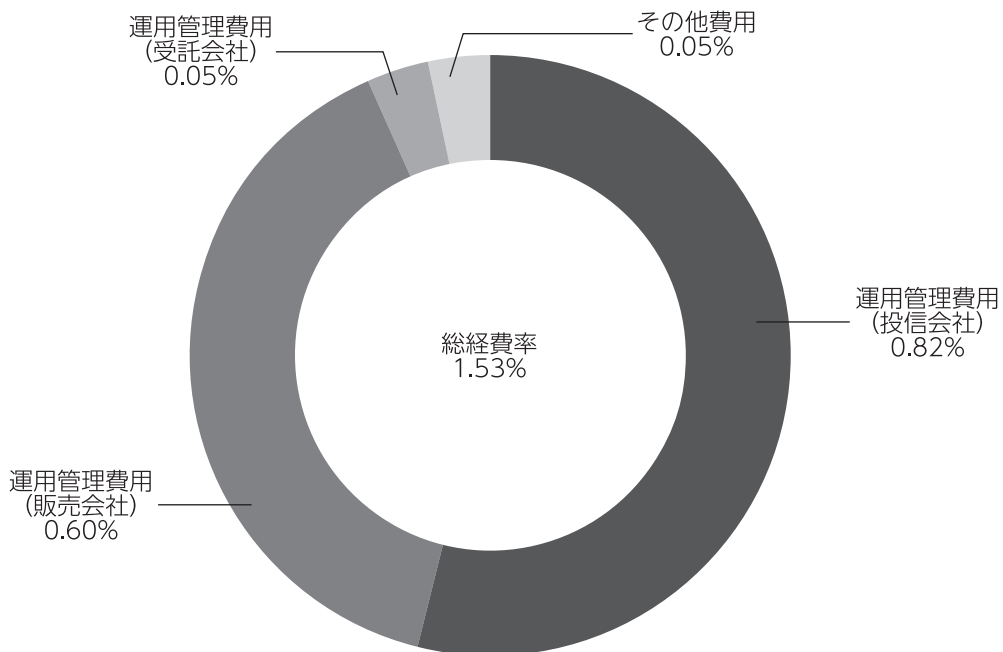
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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。

## (参考情報)

### ◆総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額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1.53%です。



(注1) 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) 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異なります。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2020年4月21日から2020年10月20日まで）

	第 199 期 ~ 第 204 期			
	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
ルーミス米国投資適格債券マザーファンド	千□ -	千円 -	千□ 147,353	千円 340,000

■利害関係人との取引状況等（2020年4月21日から2020年10月20日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 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

親投資信託残高

	第33作成期末	第34作成期末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
ルーミス米国投資適格債券マザーファンド	千□ 2,421,718	千□ 2,274,364	千円 5,270,156

## ■投資信託財産の構成

2020年10月20日現在

項 目	第34作成期末	
	評 価 額	比 率
ルーミス米国投資適格債券マザーファンド	千円 5,270,156	99.0%
コール・ローン等、その他	52,565	1.0
投資信託財産総額	5,322,722	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 期末のルーミス米国投資適格債券マザーファンドの外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、5,266,788千円、99.8%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2020年10月20日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=105.59円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年5月20日)、 (2020年6月22日)、 (2020年7月20日)、 (2020年8月20日)、 (2020年9月23日)、 (2020年10月20日)現在

項 目	第199期末	第200期末	第201期末	第202期末	第203期末	第204期末
<b>(A) 資 産</b>	<b>5,480,407,627円</b>	<b>5,519,828,187円</b>	<b>5,576,221,217円</b>	<b>5,411,780,734円</b>	<b>5,362,875,340円</b>	<b>5,322,722,110円</b>
コール・ローン等	96,528,318	66,005,266	95,294,772	65,715,487	100,223,761	52,565,129
ルーミス米国投資適格債券マザーファンド(評価額)	5,383,879,309	5,453,822,921	5,480,926,445	5,346,065,247	5,262,651,579	5,270,156,981
<b>(B) 負 債</b>	<b>16,969,572</b>	<b>24,371,902</b>	<b>23,791,207</b>	<b>17,616,830</b>	<b>17,375,834</b>	<b>15,718,939</b>
未払収益分配金	10,221,902	10,119,822	10,048,952	9,909,723	9,906,290	9,850,157
未払解約金	45,310	6,828,091	7,427,119	781,955	2,432	3,714
未払信託報酬	6,685,836	7,405,684	6,299,564	6,908,077	7,448,699	5,850,767
その他未払費用	16,524	18,305	15,572	17,075	18,413	14,301
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>5,463,438,055</b>	<b>5,495,456,285</b>	<b>5,552,430,010</b>	<b>5,394,163,904</b>	<b>5,345,499,506</b>	<b>5,307,003,171</b>
元 本	6,814,601,579	6,746,548,506	6,699,301,351	6,606,482,323	6,604,193,702	6,566,771,724
次期繰越損益金	△1,351,163,524	△1,251,092,221	△1,146,871,341	△1,212,318,419	△1,258,694,196	△1,259,768,553
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>6,814,601,579口</b>	<b>6,746,548,506口</b>	<b>6,699,301,351口</b>	<b>6,606,482,323口</b>	<b>6,604,193,702口</b>	<b>6,566,771,724口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	8,017円	8,146円	8,288円	8,165円	8,094円	8,082円

(注) 第198期末における元本額は6,886,108,715円、当作成期間(第199期～第204期)中における追加設定元本額は36,671,610円、同解約元本額は356,008,601円です。

## ■損益の状況

[自 2020年4月21日 至 2020年5月20日] [自 2020年5月21日 至 2020年6月22日] [自 2020年6月23日 至 2020年7月20日] [自 2020年7月21日 至 2020年8月20日] [自 2020年8月21日 至 2020年9月23日] [自 2020年9月24日 至 2020年10月20日]

項 目	第199期	第200期	第201期	第202期	第203期	第204期
(A)配 当 等 収 益	△2,008円	△4,354円	△1,733円	△2,440円	△4,493円	△1,582円
受 取 利 息	14	32	5	12	1	4
支 払 利 息	△2,022	△4,386	△1,738	△2,452	△4,494	△1,586
(B)有価証券売買損益	13,510,473	104,077,135	111,748,474	△64,466,782	△29,437,845	7,511,732
売 買 益	13,690,421	104,943,612	112,126,493	348,220	5,937	7,519,730
売 買 損	△179,948	△866,477	△378,019	△64,815,002	△29,443,782	△7,998
(C)信 託 報 酬 等	△6,702,360	△7,423,989	△6,315,136	△6,925,152	△7,467,112	△5,865,068
(D)当期損益金(A + B + C)	6,806,105	96,648,792	105,431,605	△71,394,374	△36,909,450	1,645,082
(E)前期繰越損益金	△684,066,152	△680,194,324	△588,733,828	△486,175,196	△566,105,872	△609,088,661
(F)追加信託差損益金	△663,681,575	△657,426,867	△653,520,166	△644,839,126	△645,772,584	△642,474,817
(配当等相当額)	(54,493,791)	(54,000,580)	(53,738,077)	(53,063,414)	(53,218,876)	(52,982,383)
(売買損益相当額)	(△718,175,366)	(△711,427,447)	(△707,258,243)	(△697,902,540)	(△698,991,460)	(△695,457,200)
(G)合 計(D + E + F)	△1,340,941,622	△1,240,972,399	△1,136,822,389	△1,202,408,696	△1,248,787,906	△1,249,918,396
(H)収 益 分 配 金	△10,221,902	△10,119,822	△10,048,952	△9,909,723	△9,906,290	△9,850,157
次期繰越損益金(G + H)	△1,351,163,524	△1,251,092,221	△1,146,871,341	△1,212,318,419	△1,258,694,196	△1,259,768,553
追加信託差損益金	△663,681,575	△657,426,867	△653,520,166	△644,839,126	△645,772,584	△642,474,817
(配当等相当額)	(54,495,000)	(54,006,597)	(53,749,045)	(53,068,472)	(53,237,871)	(52,986,024)
(売買損益相当額)	(△718,176,575)	(△711,433,464)	(△707,269,211)	(△697,907,598)	(△699,010,455)	(△695,460,841)
分配準備積立金	81,011,689	84,158,222	85,616,558	81,393,119	78,634,597	74,215,611
繰 越 損 益 金	△768,493,638	△677,823,576	△578,967,733	△648,872,412	△691,556,209	△691,509,347

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

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

(注4) 信託財産の運用の指図に係る権限を委託するために要する費用は、第199期から第204期まではルーミス米国投資適格債券マザーファンド12,163,507円で、委託者報酬から支弁しております。

(注5) 分配金の計算過程

項 目	第199期	第200期	第201期	第202期	第203期	第204期
(a)経費控除後の配当等収益	7,304,095円	14,125,114円	12,206,385円	6,931,608円	7,344,754円	5,922,920円
(b)経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0	0
(c)収 益 調 整 金	54,495,000	54,006,597	53,749,045	53,068,472	53,237,871	52,986,024
(d)分 配 準 備 積 立 金	83,929,496	80,152,930	83,459,125	84,371,234	81,196,133	78,142,848
(e)当期分配対象額(a + b + c + d)	145,728,591	148,284,641	149,414,555	144,371,314	141,778,758	137,051,792
(f)1万口当たり当期分配対象額	213.85	219.79	223.03	218.53	214.68	208.70
(g)分 配 金	10,221,902	10,119,822	10,048,952	9,909,723	9,906,290	9,850,157
(h)1万口当たり分配金	15	15	15	15	15	15

## ■分配金のお知らせ

決算期	第199期	第200期	第201期	第202期	第203期	第204期
1万口当たり分配金	15円	15円	15円	15円	15円	15円

※分配金を再投資する場合、分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。

### 分配金の課税上の取扱いについて

- ・追加型株式投資信託の分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
  - 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
  - 分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における受益者毎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、その後の受益者毎の個別元本となります。

# ルーミス米国投資適格債券マザーファンド

## 運用報告書

第34期（決算日 2020年10月20日）

（計算期間 2020年4月21日～2020年10月20日）

ルーミス米国投資適格債券マザーファンドの第34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	2003年10月31日から無期限です。
運用方針	主として米国の米ドル建て公社債に投資を行い、安定した収益の確保と信託財産の中・長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。 投資を行う公社債の格付けについては、原則として取得時においてBBB-（Baa3）格以上の格付けを有する公社債に投資を行うとともに、ファンド全体の加重平均格付けをA-（A3）格以上に維持します。 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。 円の余資運用以外の運用の指図に関する権限を、ルーミス・セイレス・アンド・カンパニー・エル・ピーに委託します。
主要投資対象	主として米国の米ドル建て公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資には制限を設けません。

## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ブルームバーグ・パークレイズ 米国政府ノレッジ指数 (為替ノーヘッジ・円ベース) (参考指数)		為替 (対米ドル)		債券 組入 率	債券 優先 率	純資産 総額
	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率					
	円	%		%	円	%	%	%	百万円
30期(2018年10月22日)	19,849	4.4	398.59	4.3	112.49	4.7	97.7	-	5,685
31期(2019年4月22日)	20,820	4.9	417.46	4.7	111.99	△0.4	98.4	-	5,680
32期(2019年10月21日)	21,589	3.7	430.77	3.2	108.52	△3.1	97.8	-	5,523
33期(2020年4月20日)	22,573	4.6	451.32	4.8	107.89	△0.6	97.2	-	5,466
34期(2020年10月20日)	23,172	2.7	453.19	0.4	105.59	△2.1	96.4	-	5,270

(注1) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注2) ブルームバーグ・パークレイズ米国政府ノレッジ指数（為替ノーヘッジ・円ベース）は、基準価額への反映を考慮して前営業日の値を用いております（小数第3位四捨五入）。また、為替（対米ドル）は、当日の対顧客電信相場仲値を用いております（以下同じ）。

(注3) ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーの商標およびサービスマークです。パークレイズは、ライセンスに基づき使用されているパークレイズ・バンク・ピーエルシーの商標およびサービスマークです。ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・パークレイズ・インデックスに対する一切の独占的権利を有しています（以下同じ）。

(注4) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

## ■当期中の基準価額と市況の推移

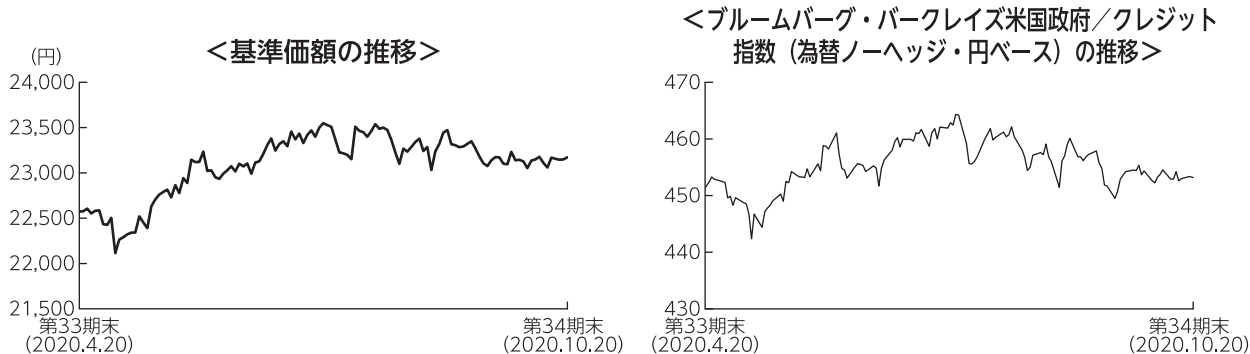
年 月 日	基 準 価 額		ブルームバーグ・パークレイズ 米国政府／クレジット指数 (為替ノーヘッジ・円ベース) (参考指数)		為 替		債 券 組入比率	債 券 先物比率
	騰 落 率		騰 落 率		(対米ドル)	騰 落 率		
(期 首) 2020年 4 月20日	円	%		%	円	%	%	%
	22,573	—	451.32	—	107.89	—	97.2	—
4 月末	22,426	△0.7	448.29	△0.7	106.87	△0.9	97.5	—
5 月末	22,777	0.9	453.33	0.4	107.53	△0.3	97.0	—
6 月末	23,309	3.3	459.56	1.8	107.74	△0.1	98.5	—
7 月末	23,151	2.6	456.77	1.2	104.60	△3.0	97.5	—
8 月末	23,032	2.0	451.45	0.0	105.36	△2.3	98.5	—
9 月末	23,233	2.9	455.33	0.9	105.80	△1.9	95.9	—
(期 末) 2020年10月20日	23,172	2.7	453.19	0.4	105.59	△2.1	96.4	—

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。



## ■当期の運用経過 (2020年4月21日から2020年10月20日まで)



### 基準価額の推移

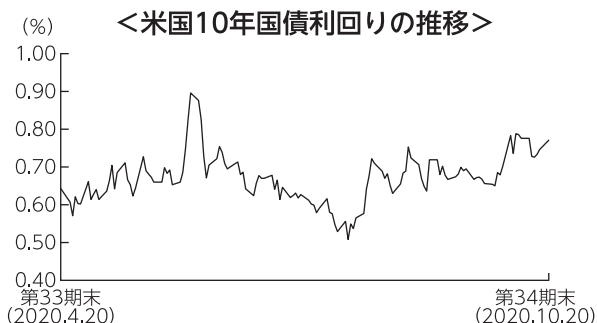
当ファンドの基準価額は、前期末比で2.7%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

米国の投資適格債券に投資を行った結果、社債市場が堅調に推移したことなどから、基準価額は上昇しました。

### 投資環境

#### ●海外債券市況と為替市況

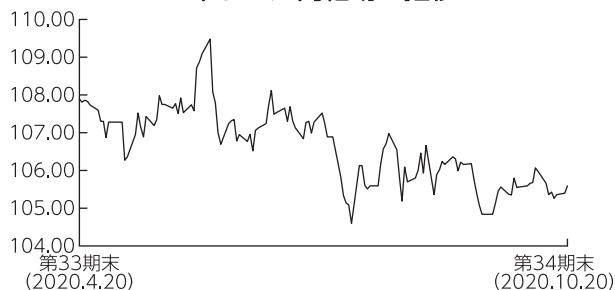


米国国債市場は下落（利回りは上昇）しました。8月上旬にかけては、新型コロナウイルスの感染拡大懸念を受けリスク回避姿勢が高まったことなどから上昇しました。期末にかけては、米国債に対する先行きの需給悪化懸念などから下落し、期を通じては下落しました。

米国の投資適格社債市場は上昇しました。信用スプレッドが金融会社やREITセクターを中心に全般的に縮小したことが上昇要因となりました。

(注) 値は前営業日のものを用いています。

## <米ドル／円相場の推移>



米ドルは対円で下落しました。

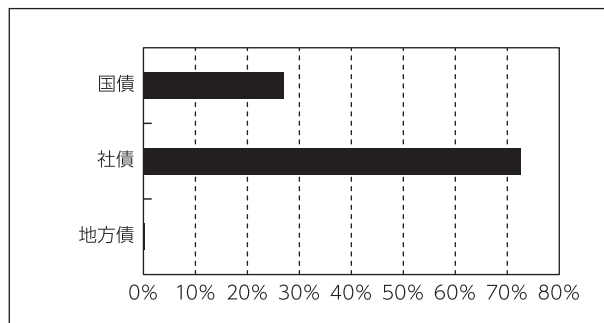
期初は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大に伴う世界景気の下押し懸念の高まりなどを背景に米国国債利回りが低下したことなどから下落しました。その後は、米経済活動の再開を背景にリスク選好姿勢が高まったことなどから上昇した場面もあったものの、期後半は、新型コロナウイルス感染再拡大への懸念や米国の金融緩和政策の長期化観測などから下落しました。

## ポートフォリオ

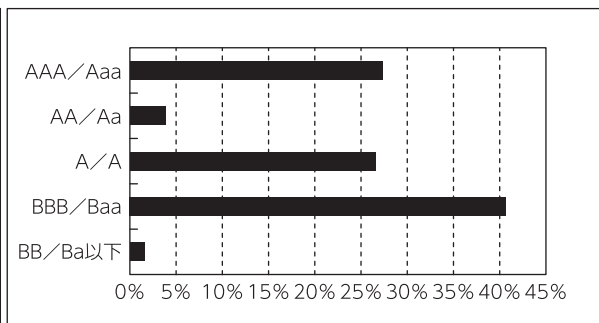
米国の投資適格債券に投資を行い、個別銘柄の選別により分散されたポートフォリオの構築を行いました。当期末時点における債券の組入比率は、国債を3割程度、普通社債を7割程度とし、組入比率を高位に維持しました。ファンド全体の加重平均格付については、当ファンドの運用の基本方針に従い、A格以上を維持しました。上記の通り運用を行った結果、社債市場が堅調に推移したことなどから基準価額は上昇しました。

期末

### 【種別保有比率】



### 【格付別保有比率】



(注) 比率はルーミス米国投資適格債券マザーファンドの債券部分を100%換算したものを採用しています。

(注1) 比率はルーミス米国投資適格債券マザーファンドの債券部分を100%換算したものを採用しています。

(注2) 格付はS & P、Moody'sの高いほうの格付を採用しています。

## 今後の運用方針

米国では新型コロナウイルスの感染拡大の影響によりしばらくは不安定な状況が続くものとみています。しかし、F R B（米連邦準備制度理事会）が流動性の改善に向けて社債の購入を実施するなど、金融政策や財政政策などは市場の下支え要因になると考えます。

引き続き発行体のクオリティを重視しつつ米国の投資適格債券に投資を行い、安定した収益の確保と信託財産の中・長期的な成長を目指します。

## ■ 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) その他費用 (保管費用)	6円	0.024%	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(その他)	(6)	(0.024)	
合計	(0)	(0.000)	
期中の平均基準価額は23,094円です。	6	0.024	

(注1) 金額欄は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 (2020年4月21日から2020年10月20日まで)

### 公社債

			買付額	売付額
外 国	ア メ リ カ	国債証券	千アメリカ・ドル 5,193	千アメリカ・ドル 6,772 (755)
		社債証券	4,501	3,830 (1,155)

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

## ■ 利害関係人との取引状況等 (2020年4月21日から2020年10月20日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 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

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

区 分	額面金額	当 期 末			残存期間別組入比率			
		評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組 入 比 率	5年以上	2年以上	2年未満
		外貨建金額	邦貨換算金額					
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 42,080	千アメリカ・ドル 48,114	千円 5,080,378	% 96.4	% 1.6	% 63.3	% 23.4	% 9.7
合 計	-	-	千円 5,080,378	96.4	1.6	63.3	23.4	9.7

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。

(注3) 無格付銘柄については、BB格以下に含めて表示しています。

(B) 個別銘柄開示

外国（外貨建）公社債銘柄別

銘 柄	種 類	利 率	当 期 末			償 還 年 月 日
			額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 2.5 01/31/21	国債証券	2.5000	20	20	2,126	2021/01/31
US T N/B 1.375 01/31/25	国債証券	1.3750	105	109	11,604	2025/01/31
US T N/B 4.5 02/15/36	国債証券	4.5000	55	82	8,697	2036/02/15
US T N/B 2.5 02/15/22	国債証券	2.5000	185	190	20,148	2022/02/15
US T N/B 1.5 02/15/30	国債証券	1.5000	115	123	13,009	2030/02/15
US T N/B 2.375 03/15/22	国債証券	2.3750	210	216	22,874	2022/03/15
US T N/B 3.0 05/15/45	国債証券	3.0000	215	283	29,980	2045/05/15
US T N/B 1.125 05/15/40	国債証券	1.1250	505	490	51,769	2040/05/15
US T N/B 1.25 05/15/50	国債証券	1.2500	175	162	17,168	2050/05/15
US T N/B 2.125 05/31/26	国債証券	2.1250	640	701	74,034	2026/05/31
US T N/B 0.25 05/31/25	国債証券	0.2500	105	104	11,060	2025/05/31
US T N/B 2.625 06/15/21	国債証券	2.6250	685	696	73,515	2021/06/15
US T N/B 1.75 07/31/24	国債証券	1.7500	185	195	20,646	2024/07/31
US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	0.6250	795	784	82,875	2030/08/15
US T N/B 1.25 08/31/24	国債証券	1.2500	575	597	63,062	2024/08/31
US T N/B 1.5 09/30/24	国債証券	1.5000	255	267	28,246	2024/09/30
US T N/B 1.625 10/31/26	国債証券	1.6250	125	133	14,123	2026/10/31
US T N/B 1.5 10/31/24	国債証券	1.5000	160	167	17,736	2024/10/31
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4.2500	3,270	5,017	529,760	2040/11/15
US T N/B 3.75 11/15/43	国債証券	3.7500	1,530	2,243	236,914	2043/11/15
US T N/B 2.875 11/30/25	国債証券	2.8750	50	56	5,956	2025/11/30
US T N/B 2.875 11/30/23	国債証券	2.8750	125	135	14,294	2023/11/30
US T N/B 1.75 11/15/20	国債証券	1.7500	65	65	6,872	2020/11/15
US T N/B 2.625 12/31/23	国債証券	2.6250	65	70	7,391	2023/12/31
US T N/B 2.25 12/31/24	国債証券	2.2500	80	86	9,145	2024/12/31
UNIV VA-A-TXBL 3.227 09/01/19	地方債証券	3.2270	120	124	13,168	2119/09/01
GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.5 01/23/25	社債証券	3.5000	120	131	13,890	2025/01/23
AERCAP IRELAND CAPITAL 3.3 01/23/23	社債証券	3.3000	150	151	16,014	2023/01/23
BNP PARIBAS 01/13/31	社債証券	3.0520	200	215	22,712	2031/01/13
LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.344 01/09/48	社債証券	4.3440	220	262	27,699	2048/01/09
REALTY INCOME CORP 3.25 01/15/31	社債証券	3.2500	30	33	3,506	2031/01/15
MORGAN STANLEY 5.75 01/25/21	社債証券	5.7500	535	542	57,282	2021/01/25
MORGAN STANLEY 3.125 01/23/23	社債証券	3.1250	200	211	22,352	2023/01/23

銘柄	当 期 末						償 還 年 月 日
	種類	利率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
PROTECTIVE LIFE CORP 3.4 01/15/30	社 債 券	3.4000	180	193	20,434	2030/01/15	
WELLTOWER INC 2.75 01/15/31	社 債 券	2.7500	35	36	3,802	2031/01/15	
JABIL INC 3.0 01/15/31	社 債 券	3.0000	40	40	4,303	2031/01/15	
ENERGY TRANSFER OPERATNG 4.75 01/15/26	社 債 券	4.7500	85	91	9,636	2026/01/15	
ENTERPRISE PRODUCTS OPER 2.8 01/31/30	社 債 券	2.8000	175	186	19,670	2030/01/31	
AKER BP ASA 3.75 01/15/30	社 債 券	3.7500	150	146	15,457	2030/01/15	
AMERICAN HONDA FINANCE 2.35 01/08/27	社 債 券	2.3500	150	160	16,945	2027/01/08	
WESTPAC BANKING CORP 2.65 01/16/30	社 債 券	2.6500	60	66	7,017	2030/01/16	
STANDARD CHARTERED PLC 01/30/26	社 債 券	2.8190	200	208	21,998	2026/01/30	
SOCIETE GENERALE 2.625 01/22/25	社 債 券	2.6250	210	218	23,055	2025/01/22	
KINDER MORGAN ENER PART 4.15 02/01/24	社 債 券	4.1500	65	70	7,486	2024/02/01	
EXPEDIA INC 3.8 02/15/28	社 債 券	3.8000	205	207	21,866	2028/02/15	
TELEFONICA EMISIONES SAU 5.462 02/16/21	社 債 券	5.4620	20	20	2,145	2021/02/16	
ANHEUSER-BUSCH CO/INBEV 4.9 02/01/46	社 債 券	4.9000	100	124	13,102	2046/02/01	
BURLINGTN NORTH SANTA FE 3.55 02/15/50	社 債 券	3.5500	50	58	6,182	2050/02/15	
UNIVERSITY OF PENNSYLVAN 3.61 02/15/19	社 債 券	3.6100	40	43	4,566	2119/02/15	
CANADIAN IMPERIAL BANK 2.7 02/02/21	社 債 券	2.7000	285	286	30,302	2021/02/02	
AMERICAN EXPRESS CO 3.4 02/22/24	社 債 券	3.4000	175	190	20,084	2024/02/22	
WHIRLPOOL CORP 4.75 02/26/29	社 債 券	4.7500	155	189	19,977	2029/02/26	
COMCAST CORP 2.65 02/01/30	社 債 券	2.6500	75	81	8,616	2030/02/01	
TARGET CORP 2.35 02/15/30	社 債 券	2.3500	80	87	9,227	2030/02/15	
ALTRIA GROUP INC 4.4 02/14/26	社 債 券	4.4000	65	74	7,912	2026/02/14	
UNION PACIFIC CORP 2.4 02/05/30	社 債 券	2.4000	100	107	11,353	2030/02/05	
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 3.0 02/10/27	社 債 券	3.0000	60	62	6,606	2027/02/10	
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 2.15 02/13/30	社 債 券	2.1500	145	153	16,211	2030/02/13	
SYSCO CORPORATION 2.4 02/15/30	社 債 券	2.4000	40	41	4,352	2030/02/15	
GENERAL MOTORS FINL CO 2.9 02/26/25	社 債 券	2.9000	55	57	6,022	2025/02/26	
BANK OF NOVA SCOTIA 2.2 02/03/25	社 債 券	2.2000	145	153	16,189	2025/02/03	
AMGEN INC 2.45 02/21/30	社 債 券	2.4500	190	202	21,428	2030/02/21	
CENTENE CORP 3.375 02/15/30	社 債 券	3.3750	65	67	7,129	2030/02/15	
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 2.65 02/10/25	社 債 券	2.6500	80	82	8,762	2025/02/10	
OTIS WORLDWIDE CORP 2.565 02/15/30	社 債 券	2.5650	175	188	19,921	2030/02/15	
MITSUBISHI UFJ FIN GRP 2.193 02/25/25	社 債 券	2.1930	250	262	27,769	2025/02/25	
WW GRAINGER INC 1.85 02/15/25	社 債 券	1.8500	170	177	18,725	2025/02/15	
PEPSICO INC 3.875 03/19/60	社 債 券	3.8750	75	96	10,223	2060/03/19	
MPLX LP 4.125 03/01/27	社 債 券	4.1250	65	71	7,578	2027/03/01	
BOSTON SCIENTIFIC CORP 4.0 03/01/29	社 債 券	4.0000	95	110	11,696	2029/03/01	
CVS HEALTH CORP 5.05 03/25/48	社 債 券	5.0500	125	162	17,112	2048/03/25	
AT&T INC 4.5 03/09/48	社 債 券	4.5000	63	72	7,627	2048/03/09	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 3.75 03/09/27	社 債 券	3.7500	255	286	30,227	2027/03/09	
CVS HEALTH CORP 4.3 03/25/28	社 債 券	4.3000	50	58	6,179	2028/03/25	
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL 3.455 03/02/23	社 債 券	3.4550	115	122	12,945	2023/03/02	
FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.339 03/28/22	社 債 券	3.3390	520	519	54,838	2022/03/28	
TOYOTA INDUSTRIES CORP 3.235 03/16/23	社 債 券	3.2350	275	289	30,569	2023/03/16	
STARBUCKS CORP 3.35 03/12/50	社 債 券	3.3500	50	52	5,575	2050/03/12	
BAT CAPITAL CORP 2.726 03/25/31	社 債 券	2.7260	125	126	13,307	2031/03/25	
MASTERCARD INC 3.85 03/26/50	社 債 券	3.8500	30	38	4,066	2050/03/26	
SOUTHERN CAL EDISON 3.65 03/01/28	社 債 券	3.6500	195	214	22,699	2028/03/01	
SYNCHRONY FINANCIAL 5.15 03/19/29	社 債 券	5.1500	95	112	11,914	2029/03/19	
ENERGY TRANSFER OPERATNG 4.25 03/15/23	社 債 券	4.2500	115	120	12,674	2023/03/15	
FIRSTENERGY CORP 2.65 03/01/30	社 債 券	2.6500	125	126	13,319	2030/03/01	
ENTERPRISE PRODUCTS OPER 3.35 03/15/23	社 債 券	3.3500	100	106	11,219	2023/03/15	
MCDONALD'S CORP 2.125 03/01/30	社 債 券	2.1250	40	41	4,402	2030/03/01	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY 2.05 03/05/30	社 債 券	2.0500	20	21	2,217	2030/03/05	

銘柄	当 期 末						償 還 年 月 日
	種類	利率	額面金額	評 価 額		千円	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル			
AMERICAN ELECTRIC POWER 2.3 03/01/30	社 債 券	2.3000	80	83	8,830	2030/03/01	
JOHN DEERE CAPITAL CORP 2.6 03/07/24	社 債 券	2.6000	35	37	3,953	2024/03/07	
CIGNA CORP 2.4 03/15/30	社 債 券	2.4000	30	31	3,306	2030/03/15	
JM SMUCKER CO 2.375 03/15/30	社 債 券	2.3750	130	136	14,361	2030/03/15	
ONEOK INC 3.1 03/15/30	社 債 券	3.1000	180	175	18,537	2030/03/15	
METHANEX CORP 5.25 03/01/22	社 債 券	5.2500	55	58	6,148	2022/03/01	
MARTIN MARIETTA MATERIAL 2.5 03/15/30	社 債 券	2.5000	65	67	7,153	2030/03/15	
ECOLAB INC 4.8 03/24/30	社 債 券	4.8000	10	12	1,345	2030/03/24	
JOHN DEERE CAPITAL CORP 1.75 03/09/27	社 債 券	1.7500	20	20	2,207	2027/03/09	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND C 3.25 03/27/30	社 債 券	3.2500	80	92	9,750	2030/03/27	
RAYTHEON TECH CORP 3.2 03/15/24	社 債 券	3.2000	145	156	16,484	2024/03/15	
AMPHENOL CORP 2.05 03/01/25	社 債 券	2.0500	15	15	1,663	2025/03/01	
CIGNA CORP 3.4 03/01/27	社 債 券	3.4000	285	319	33,727	2027/03/01	
EBAY INC 1.9 03/11/25	社 債 券	1.9000	100	104	10,995	2025/03/11	
DAIMLER FINANCE NA LLC 2.125 03/10/25	社 債 券	2.1250	170	176	18,605	2025/03/10	
EXXON MOBIL CORPORATION 3.452 04/15/51	社 債 券	3.4520	30	33	3,502	2051/04/15	
GENERAL MOTORS FINL CO 4.35 04/09/25	社 債 券	4.3500	120	131	13,882	2025/04/09	
AMERICAN INTL GROUP 3.9 04/01/26	社 債 券	3.9000	225	257	27,207	2026/04/01	
BANK OF MONTREAL 3.1 04/13/21	社 債 券	3.1000	90	91	9,635	2021/04/13	
BANK OF NOVA SCOTIA 3.125 04/20/21	社 債 券	3.1250	190	192	20,351	2021/04/20	
PSEG POWER LLC 8.625 04/15/31	社 債 券	8.6250	435	636	67,191	2031/04/15	
GENERAL MOTORS 5.0 04/01/35	社 債 券	5.0000	95	104	11,079	2035/04/01	
NATIONAL RURAL UTIL COOP 04/30/43	社 債 券	4.7500	275	284	30,034	2043/04/30	
GENERAL MILLS INC 4.7 04/17/48	社 債 券	4.7000	155	210	22,240	2048/04/17	
GEORGETOWN UNIVERSITY 4.315 04/01/49	社 債 券	4.3150	30	37	3,967	2049/04/01	
COMCAST CORP 3.75 04/01/40	社 債 券	3.7500	40	47	5,013	2040/04/01	
GENERAL DYNAMICS CORP 4.25 04/01/50	社 債 券	4.2500	10	13	1,399	2050/04/01	
ORACLE CORP 3.6 04/01/40	社 債 券	3.6000	90	103	10,898	2040/04/01	
MCDONALD'S CORP 4.2 04/01/50	社 債 券	4.2000	5	6	653	2050/04/01	
HOME DEPOT INC 3.35 04/15/50	社 債 券	3.3500	15	17	1,842	2050/04/15	
KRAFT HEINZ FOODS CO 3.75 04/01/30	社 債 券	3.7500	180	192	20,333	2030/04/01	
DEERE & COMPANY 3.75 04/15/50	社 債 券	3.7500	40	50	5,341	2050/04/15	
STEEL DYNAMICS INC 3.45 04/15/30	社 債 券	3.4500	15	16	1,754	2030/04/15	
MIDWEST CONNECTOR CAPIT 3.625 04/01/22	社 債 券	3.6250	110	111	11,723	2022/04/01	
AVERY DENNISON CORP 2.65 04/30/30	社 債 券	2.6500	35	37	3,951	2030/04/30	
OHIO POWER COMPANY 2.6 04/01/30	社 債 券	2.6000	20	21	2,318	2030/04/01	
ORACLE CORP 3.6 04/01/50	社 債 券	3.6000	95	106	11,241	2050/04/01	
GLP CAPITAL LP / FIN II 5.375 04/15/26	社 債 券	5.3750	175	194	20,537	2026/04/15	
EXELON CORP 4.05 04/15/30	社 債 券	4.0500	30	35	3,714	2030/04/15	
DOMINION ENERGY INC 3.375 04/01/30	社 債 券	3.3750	60	68	7,186	2030/04/01	
BANK OF AMERICA CORP 04/23/27	社 債 券	3.5590	330	369	39,039	2027/04/23	
PROLOGIS LP 2.125 04/15/27	社 債 券	2.1250	35	37	3,938	2027/04/15	
T-MOBILE USA INC 3.875 04/15/30	社 債 券	3.8750	135	153	16,180	2030/04/15	
DXC TECHNOLOGY CO 4.0 04/15/23	社 債 券	4.0000	100	105	11,184	2023/04/15	
MICRON TECHNOLOGY INC 2.497 04/24/23	社 債 券	2.4970	85	88	9,351	2023/04/24	
ESSENTIAL UTILITIES INC 2.704 04/15/30	社 債 券	2.7040	55	58	6,209	2030/04/15	
EDISON INTERNATIONAL 4.95 04/15/25	社 債 券	4.9500	5	5	580	2025/04/15	
DXC TECHNOLOGY CO 4.125 04/15/25	社 債 券	4.1250	25	27	2,868	2025/04/15	
BROADCOM INC 4.7 04/15/25	社 債 券	4.7000	100	114	12,048	2025/04/15	
LIBERTY MUTUAL GROUP INC 3.95 05/15/60	社 債 券	3.9500	50	55	5,910	2060/05/15	
GENERAL ELECTRIC CO 4.25 05/01/40	社 債 券	4.2500	100	103	10,949	2040/05/01	
BOEING CO 5.93 05/01/60	社 債 券	5.9300	90	111	11,738	2060/05/01	
JPMORGAN CHASE & CO 05/13/31	社 債 券	2.9560	65	69	7,382	2031/05/13	
GENERAL ELECTRIC CO 4.35 05/01/50	社 債 券	4.3500	20	20	2,188	2050/05/01	

銘柄	当 期 末					
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償 還 年 月 日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
KANSAS CITY SOUTHERN 3.5 05/01/50	社 債 券	3.5000	35	36	3,870	2050/05/01
CONSTELLATION BRANDS INC 3.75 05/01/50	社 債 券	3.7500	15	16	1,781	2050/05/01
BIOGEN INC 3.15 05/01/50	社 債 券	3.1500	40	40	4,265	2050/05/01
BOEING CO 5.805 05/01/50	社 債 券	5.8050	125	151	16,012	2050/05/01
CHEVRON CORP 3.078 05/11/50	社 債 券	3.0780	30	32	3,412	2050/05/11
JPMORGAN CHASE & CO 2.7 05/18/23	社 債 券	2.7000	450	475	50,189	2023/05/18
LEAR CORP 5.25 05/15/49	社 債 券	5.2500	100	112	11,908	2049/05/15
ENERGY TRANSFER OPERATNG 3.75 05/15/30	社 債 券	3.7500	70	68	7,237	2030/05/15
SHERWIN-WILLIAMS CO 2.3 05/15/30	社 債 券	2.3000	95	99	10,495	2030/05/15
HUNTINGTON INGALLS INDUS 4.2 05/01/30	社 債 券	4.2000	30	34	3,665	2030/05/01
VIACOMCBS INC 4.2 05/19/32	社 債 券	4.2000	45	52	5,527	2032/05/19
BP CAP MARKETS AMERICA 3.119 05/04/26	社 債 券	3.1190	45	49	5,231	2026/05/04
EQUIFAX INC 3.1 05/15/30	社 債 券	3.1000	15	16	1,728	2030/05/15
CONSTELLATION BRANDS INC 2.875 05/01/30	社 債 券	2.8750	35	38	4,018	2030/05/01
BIOGEN INC 2.25 05/01/30	社 債 券	2.2500	85	86	9,102	2030/05/01
KINDER MORGAN ENER PART 4.3 05/01/24	社 債 券	4.3000	140	154	16,315	2024/05/01
GENERAL DYNAMICS CORP 3.5 05/15/25	社 債 券	3.5000	85	95	10,045	2025/05/15
MOHAWK INDUSTRIES INC 3.625 05/15/30	社 債 券	3.6250	125	137	14,478	2025/05/15
KEURIG DR PEPPER INC 4.417 05/25/25	社 債 券	4.4170	60	69	7,319	2025/05/25
BRIGHTHOUSE FINANCIAL IN 5.625 05/15/30	社 債 券	5.6250	95	112	11,895	2030/05/15
EXPEDIA GROUP INC 7.0 05/01/25	社 債 券	7.0000	25	26	2,819	2025/05/01
EXPEDIA GROUP INC 6.25 05/01/25	社 債 券	6.2500	30	32	3,473	2025/05/01
DIAMONDBACK ENERGY INC 4.75 05/31/25	社 債 券	4.7500	50	54	5,753	2025/05/31
ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR 4.6 06/01/60	社 債 券	4.6000	75	91	9,658	2060/06/01
ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR 4.35 06/01/40	社 債 券	4.3500	100	119	12,568	2040/06/01
HCA INC 4.125 06/15/29	社 債 券	4.1250	90	103	10,885	2029/06/15
AIR LEASE CORP 3.75 06/01/26	社 債 券	3.7500	125	128	13,583	2026/06/01
SANTANDER HOLDINGS USA 3.5 06/07/24	社 債 券	3.5000	165	177	18,780	2024/06/07
VALERO ENERGY CORP 6.625 06/15/37	社 債 券	6.6250	340	417	44,037	2037/06/15
AT&T INC 4.35 06/15/45	社 債 券	4.3500	2	2	237	2045/06/15
WRKCO INC 3.0 06/15/33	社 債 券	3.0000	20	21	2,305	2033/06/15
ENERGY TRANSFER OPERATNG 6.05 06/01/41	社 債 券	6.0500	160	163	17,280	2041/06/01
QUEST DIAGNOSTICS INC 2.8 06/30/31	社 債 券	2.8000	55	59	6,292	2031/06/30
WHIRLPOOL CORP 4.85 06/15/21	社 債 券	4.8500	370	380	40,201	2021/06/15
UNUM GROUP 4.0 06/15/29	社 債 券	4.0000	40	43	4,644	2029/06/15
SOUTHERN CAL EDISON 2.25 06/01/30	社 債 券	2.2500	45	45	4,823	2030/06/01
TEXTRON INC 3.0 06/01/30	社 債 券	3.0000	180	191	20,230	2030/06/01
PAYPAL HOLDINGS INC 3.25 06/01/50	社 債 券	3.2500	110	122	12,928	2050/06/01
XCEL ENERGY INC 3.4 06/01/30	社 債 券	3.4000	30	34	3,621	2030/06/01
BB&T CORPORATION 3.05 06/20/22	社 債 券	3.0500	250	260	27,533	2022/06/20
UPJOHN INC 4.0 06/22/50	社 債 券	4.0000	20	21	2,281	2050/06/22
AIRCASLE LTD 4.25 06/15/26	社 債 券	4.2500	195	182	19,300	2026/06/15
GATX CORP 4.0 06/30/30	社 債 券	4.0000	30	34	3,693	2030/06/30
SANTANDER UK PLC 2.875 06/18/24	社 債 券	2.8750	200	214	22,646	2024/06/18
CITIGROUP INC 4.4 06/10/25	社 債 券	4.4000	180	204	21,565	2025/06/10
MICROCHIP TECHNOLOGY INC 4.333 06/01/23	社 債 券	4.3330	40	43	4,554	2023/06/01
XILINX INC 2.375 06/01/30	社 債 券	2.3750	125	129	13,639	2030/06/01
ENTERGY CORP 2.8 06/15/30	社 債 券	2.8000	50	54	5,759	2030/06/15
TORONTO-DOMINION BANK 2.65 06/12/24	社 債 券	2.6500	185	198	20,915	2024/06/12
STRYKER CORP 1.95 06/15/30	社 債 券	1.9500	75	76	8,072	2030/06/15
CCL INDUSTRIES INC 3.05 06/01/30	社 債 券	3.0500	50	53	5,665	2030/06/01
NXP BV/NXP FDG/NXP USA 3.875 06/18/26	社 債 券	3.8750	110	123	13,087	2026/06/18
SOUTHWEST AIRLINES CO 5.125 06/15/27	社 債 券	5.1250	90	100	10,607	2027/06/15
ALLY FINANCIAL INC 3.05 06/05/23	社 債 券	3.0500	175	183	19,325	2023/06/05



銘柄	当 期 末						償 還 年 月 日
	種類	利率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
STEEL DYNAMICS INC 2.4 06/15/25	社 債 券	2.4000	25	26	2,777	2025/06/15	
ORIX CORP 3.7 07/18/27	社 債 券	3.7000	225	256	27,090	2027/07/18	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 2.784 07/12/22	社 債 券	2.7840	300	312	32,948	2022/07/12	
EQUIFAX INC 7.0 07/01/37	社 債 券	7.0000	440	582	61,483	2037/07/01	
ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR 3.75 07/15/42	社 債 券	3.7500	145	156	16,527	2042/07/15	
CROWN CASTLE INTL CORP 4.15 07/01/50	社 債 券	4.1500	10	11	1,235	2050/07/01	
PARTNERS HEALTHCARE SYST 3.342 07/01/60	社 債 券	3.3420	120	131	13,880	2060/07/01	
ATHENE GLOBAL FUNDING 3.0 07/01/22	社 債 券	3.0000	465	480	50,696	2022/07/01	
RAYTHEON TECH CORP 2.25 07/01/30	社 債 券	2.2500	90	95	10,049	2030/07/01	
AES CORP/THE 3.95 07/15/30	社 債 券	3.9500	15	16	1,767	2030/07/15	
CABOT CORP 4.0 07/01/29	社 債 券	4.0000	255	272	28,750	2029/07/01	
BRIXMOR OPERATING PART 4.05 07/01/30	社 債 券	4.0500	15	16	1,714	2030/07/01	
VIRGINIA ELEC & POWER CO 2.875 07/15/29	社 債 券	2.8750	20	22	2,364	2029/07/15	
US BANCORP 3.0 07/30/29	社 債 券	3.0000	120	133	14,102	2029/07/30	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 3.04 07/16/29	社 債 券	3.0400	200	218	23,046	2029/07/16	
TOYOTA MOTOR CORP 2.358 07/02/24	社 債 券	2.3580	75	80	8,459	2024/07/02	
AMERICAN EXPRESS CO 2.5 07/30/24	社 債 券	2.5000	150	159	16,865	2024/07/30	
ARES CAPITAL CORP 3.25 07/15/25	社 債 券	3.2500	175	176	18,586	2025/07/15	
CNH INDUSTRIAL CAP LLC 1.95 07/02/23	社 債 券	1.9500	40	40	4,303	2023/07/02	
AES CORP/THE 3.3 07/15/25	社 債 券	3.3000	25	27	2,861	2025/07/15	
RATTLER MIDSTREAM LP 5.625 07/15/25	社 債 券	5.6250	40	41	4,389	2025/07/15	
LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.05 08/16/23	社 債 券	4.0500	205	222	23,515	2023/08/16	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR 2.6 08/13/21	社 債 券	2.6000	105	103	10,969	2021/08/13	
AMAZON.COM INC 4.25 08/22/57	社 債 券	4.2500	120	162	17,157	2057/08/22	
WESTLAKE CHEMICAL CORP 3.6 08/15/26	社 債 券	3.6000	135	148	15,705	2026/08/15	
COX COMMUNICATIONS INC 3.15 08/15/24	社 債 券	3.1500	210	226	23,942	2024/08/15	
BOSTON GAS COMPANY 3.001 08/01/29	社 債 券	3.0010	25	27	2,906	2029/08/01	
HUNTINGTON BANCSHARES 2.625 08/06/24	社 債 券	2.6250	140	149	15,756	2024/08/06	
BB&T CORPORATION 2.5 08/01/24	社 債 券	2.5000	210	224	23,656	2024/08/01	
BUNGE LTD FINANCE CORP 1.63 08/17/25	社 債 券	1.6300	20	20	2,128	2025/08/17	
EXPEDIA GROUP INC 4.625 08/01/27	社 債 券	4.6250	25	26	2,780	2027/08/01	
ATHENE GLOBAL FUNDING 2.45 08/20/27	社 債 券	2.4500	150	153	16,253	2027/08/20	
AT&T 3.5 09/15/53	社 債 券	3.5000	48	47	4,974	2053/09/15	
AT&T 3.55 09/15/55	社 債 券	3.5500	20	19	2,055	2055/09/15	
NORTHWESTERN MUTUAL LIFE 3.625 09/30/59	社 債 券	3.6250	60	66	7,031	2059/09/30	
TELEFONICA 8.25 09/15/30	社 債 券	8.2500	470	711	75,150	2030/09/15	
AT&T 3.65 09/15/59	社 債 券	3.6500	87	85	9,027	2059/09/15	
ACTIVISION BLIZZARD 2.5 09/15/50	社 債 券	2.5000	115	107	11,327	2050/09/15	
KINDER MORGAN ENER PART 4.25 09/01/24	社 債 券	4.2500	145	160	16,995	2024/09/01	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP 2.55 09/15/26	社 債 券	2.5500	45	48	5,127	2026/09/15	
CONAGRA BRANDS INC 8.25 09/15/30	社 債 券	8.2500	595	902	95,245	2030/09/15	
PLAINS ALL AMERICAN PIPE 3.8 09/15/30	社 債 券	3.8000	20	19	2,071	2030/09/15	
BERKSHIRE HATHAWAY ENERG 8.48 09/15/28	社 債 券	8.4800	375	563	59,521	2028/09/15	
IPALCO ENTERPRISES INC 3.7 09/01/24	社 債 券	3.7000	40	43	4,593	2024/09/01	
GLENCORE FUNDING LLC 2.5 09/01/30	社 債 券	2.5000	175	171	18,124	2030/09/01	
RYDER SYSTEM INC 2.5 09/01/24	社 債 券	2.5000	75	79	8,354	2024/09/01	
ANGLO AMERICAN CAPITAL 2.625 09/10/30	社 債 券	2.6250	200	202	21,353	2030/09/10	
TEXAS INSTRUMENTS INC 2.25 09/04/29	社 債 券	2.2500	40	43	4,546	2029/09/04	
WILLIS NORTH AMERICA INC 2.95 09/15/29	社 債 券	2.9500	30	32	3,479	2029/09/15	
APPLE INC 2.2 09/11/29	社 債 券	2.2000	130	140	14,786	2029/09/11	
NATWEST GROUP PLC 3.875 09/12/23	社 債 券	3.8750	235	253	26,796	2023/09/12	
ROPER TECHNOLOGIES INC 1.4 09/15/27	社 債 券	1.4000	50	50	5,330	2027/09/15	
REGENCY CENTERS LP 2.95 09/15/29	社 債 券	2.9500	80	82	8,753	2029/09/15	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC 2.67 09/01/23	社 債 券	2.6700	60	62	6,569	2023/09/01	

銘柄	当 期 末					
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償 還 年 月 日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
BAT CAPITAL CORP 2.789 09/06/24	社 債 券	2.7890	260	275	29,113	2024/09/06
APPLE INC 2.05 09/11/26	社 債 券	2.0500	130	139	14,699	2026/09/11
NISSAN MOTOR CO 3.522 09/17/25	社 債 券	3.5220	200	201	21,293	2025/09/17
GOLDMAN SACHS GROUP INC 6.75 10/01/37	社 債 券	6.7500	90	132	13,985	2037/10/01
BERKSHIRE HATHAWAY ENERG 4.25 10/15/50	社 債 券	4.2500	20	25	2,668	2050/10/15
MARRIOTT INTERNATIONAL 3.5 10/15/32	社 債 券	3.5000	115	116	12,339	2032/10/15
ONEAMERICA FINL PARTNERS 4.25 10/15/50	社 債 券	4.2500	15	15	1,667	2050/10/15
LOWE'S COS INC 3.0 10/15/50	社 債 券	3.0000	65	67	7,121	2050/10/15
HP ENTERPRISE CO 10/15/45	社 債 券	6.3500	125	164	17,385	2045/10/15
GEORGETOWN UNIVERSITY 5.215 10/01/18	社 債 券	5.2150	30	39	4,210	2118/10/01
PPL ELECTRIC UTILITIES 3.0 10/01/49	社 債 券	3.0000	40	43	4,560	2049/10/01
CONCHO RESOURCES INC 3.75 10/01/27	社 債 券	3.7500	80	89	9,498	2027/10/01
FLORIDA POWER & LIGHT CO 3.15 10/01/49	社 債 券	3.1500	65	74	7,845	2049/10/01
JPMORGAN CHASE & CO 10/15/30	社 債 券	2.7390	170	183	19,400	2030/10/15
NEWMONT CORP 2.25 10/01/30	社 債 券	2.2500	65	67	7,165	2030/10/01
SMITHFIELD FOODS INC 3.0 10/15/30	社 債 券	3.0000	10	10	1,066	2030/10/15
HOSPITALITY PROP TRUST 4.75 10/01/26	社 債 券	4.7500	105	93	9,895	2026/10/01
LYB INT FINANCE III 2.25 10/01/30	社 債 券	2.2500	30	29	3,165	2030/10/01
BAYER US FINANCE LLC 3.375 10/08/24	社 債 券	3.3750	210	228	24,095	2024/10/08
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 2.25 10/18/23	社 債 券	2.2500	140	147	15,554	2023/10/18
HP ENTERPRISE CO 4.45 10/02/23	社 債 券	4.4500	100	110	11,659	2023/10/02
GRAY OAK PIPELINE LLC 3.45 10/15/27	社 債 券	3.4500	5	5	542	2027/10/15
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 2.375 10/15/27	社 債 券	2.3750	65	65	6,905	2027/10/15
SOCIETE GENERALE 2.625 10/16/24	社 債 券	2.6250	200	208	21,987	2024/10/16
LEASEPLAN CORPORATION NV 2.875 10/24/24	社 債 券	2.8750	200	206	21,794	2024/10/24
AIR PRODUCTS & CHEMICALS 1.5 10/15/25	社 債 券	1.5000	25	25	2,743	2025/10/15
GRAY OAK PIPELINE LLC 2.6 10/15/25	社 債 券	2.6000	10	10	1,057	2025/10/15
GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.5 11/16/26	社 債 券	3.5000	260	288	30,468	2026/11/16
MORGAN STANLEY 2.625 11/17/21	社 債 券	2.6250	130	133	14,063	2021/11/17
TIME WARNER CABLE LLC 5.875 11/15/40	社 債 券	5.8750	125	157	16,583	2040/11/15
WILLIAMS COMPANIES INC 3.5 11/15/30	社 債 券	3.5000	125	136	14,416	2030/11/15
BANK OF IRELAND GROUP 4.5 11/25/23	社 債 券	4.5000	200	216	22,815	2023/11/25
HASBRO INC 3.55 11/19/26	社 債 券	3.5500	40	42	4,531	2026/11/19
HASBRO INC 3.9 11/19/29	社 債 券	3.9000	5	5	568	2029/11/19
BANK OF NOVA SCOTIA 2.0 11/15/22	社 債 券	2.0000	180	186	19,647	2022/11/15
BNP PARIBAS 11/19/25	社 債 券	2.8190	210	222	23,498	2025/11/19
CONAGRA BRANDS INC 1.375 11/01/27	社 債 券	1.3750	50	49	5,249	2027/11/01
CATERPILLAR FINL SERVICE 2.15 11/08/24	社 債 券	2.1500	50	53	5,620	2024/11/08
BROADCOM INC 3.15 11/15/25	社 債 券	3.1500	125	135	14,318	2025/11/15
OWENS CORNING INC 4.2 12/01/24	社 債 券	4.2000	110	121	12,878	2024/12/01
RYDER SYSTEM INC 3.875 12/01/23	社 債 券	3.8750	80	87	9,222	2023/12/01
ORIX CORP 3.25 12/04/24	社 債 券	3.2500	140	152	16,052	2024/12/04
GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.6 12/27/20	社 債 券	2.6000	145	145	15,375	2020/12/27
WAL-MART STORES INC 2.35 12/15/22	社 債 券	2.3500	180	187	19,826	2022/12/15
NATIONAL OILWELL VARCO I 3.6 12/01/29	社 債 券	3.6000	80	76	8,039	2029/12/01
CHOICE HOTELS INTL INC 3.7 12/01/29	社 債 券	3.7000	175	185	19,563	2029/12/01
DIAMONDBACK ENERGY INC 3.5 12/01/29	社 債 券	3.5000	160	158	16,756	2029/12/01
EXPEDIA GROUP INC 3.6 12/15/23	社 債 券	3.6000	50	51	5,411	2023/12/15
CENTENE CORP 4.625 12/15/29	社 債 券	4.6250	80	87	9,206	2029/12/15
PNC BANK NA 12/09/22	社 債 券	2.0280	250	254	26,879	2022/12/09
EQUIFAX INC 2.6 12/15/25	社 債 券	2.6000	25	26	2,840	2025/12/15
合 計	-	-	42,080	48,114	5,080,378	-

## ■投資信託財産の構成

2020年10月20日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 5,080,378	% 96.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	196,562	3.7
投 資 信 託 財 産 総 額	5,276,940	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、5,266,788千円、99.8%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2020年10月20日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=105.59円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年10月20日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	5,276,940,702円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	155,935,468
公 社 債(評価額)	5,080,378,035
未 収 利 息	40,132,980
前 払 費 用	494,219
(B) 負 債	6,856,624
未 払 金	6,856,624
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	5,270,084,078
元 本	2,274,364,311
次 期 繰 越 損 益 金	2,995,719,767
(D) 受 益 権 総 口 数	2,274,364,311口
1万口当たり基準価額(C / D)	23,172円

(注1) 期首元本額 2,421,718,174円  
追加設定元本額 -円  
一部解約元本額 147,353,863円

(注2) 期末における元本の内訳  
ルーミス米国投資適格債券ファンド [毎月決算型] 2,274,364,311円  
期末元本合計 2,274,364,311円

## ■損益の状況

当期 自2020年4月21日 至2020年10月20日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	82,230,561円
受 取 利 息	82,001,501
そ の 他 収 益 金	230,714
支 払 利 息	△1,654
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	62,722,059
売 買 益	212,738,946
売 買 損	△150,016,887
(C) そ の 他 費 用	△1,305,721
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	143,646,899
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	3,044,719,005
(F) 解 約 差 損 益 金	△192,646,137
(G) 合 計(D + E + F)	2,995,719,767
次 期 繰 越 損 益 金(G)	2,995,719,767

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (F)解約差損益金とあるのは、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。