

運用報告書 (全体版)

ルーミス・グローバル債券ファンド (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	2007年1月31日から無期限です。 なお、クローズド期間はありません。	
運用方針	日本を除く世界各国の公社債に投資し、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。 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・グローバル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。	
主要投資対象	ルーミス・グローバル債券ファンド (毎月決算型)	ルーミス・グローバル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・グローバル債券マザーファンド	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	ルーミス・グローバル債券ファンド (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・グローバル債券マザーファンド	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
分配方針	第3期以降、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、売買益等については、原則として毎年5月および11月の決算時に分配を行うことを目指します。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138期	<決算日	2018年8月10日>
第139期	<決算日	2018年9月10日>
第140期	<決算日	2018年10月10日>
第141期	<決算日	2018年11月12日>
第142期	<決算日	2018年12月10日>
第143期	<決算日	2019年1月10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・グローバル債券ファンド (毎月決算型)」は、2019年1月10日に第143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/>

目 次

「ルーミス・グローバル債券ファンド（毎月決算型）」の運用状況のご報告	
お知らせ	1
最近5作成期の運用実績	2
当作成期中の基準価額と市況推移	3
当作成期中の運用経過	4
今後の運用方針	9
1万口当たりの費用明細	10
作成期中の売買及び取引の状況	11
利害関係人との取引状況等	11
組入資産の明細	11
投資信託財産の構成	12
資産、負債、元本及び基準価額の状況	12
損益の状況	13
「ルーミス・グローバル債券マザーファンド」の運用状況のご報告	14

お知らせ

収益分配金のお知らせ

決 算 期	1 万口当たり分配金 (税込み)
第 138 期	10円
第 139 期	10円
第 140 期	10円
第 141 期	10円
第 142 期	10円
第 143 期	10円

収益分配金の支払いについて

- ・収益分配金は、取扱い販売会社において各決算日から起算して5営業日までに支払いを開始いたします。
- ・分配金再投資コースを選択されている場合のお手取り分配金は、各決算日の基準価額に基づき、お客様の口座に繰り入れて再投資いたします。

収益分配金の課税上の取扱いについて

- ・分配金は、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）」に区分され、分配後の基準価額が個々の受益者の個別元本と同額または上回る場合は、全額普通分配金となります。分配後の基準価額が個々の受益者の個別元本を下回る場合は、その下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となり、残りの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。

普通分配金の税率について

	所得税	復興特別所得税	地方税	計
個人の受益者	15%	0.315%	5%	20.315%
法人の受益者	15%	0.315%	—	15.315%

※2037年12月31日までは所得税の額に対し2.1%の金額が復興特別所得税として徴収されます。

※個人の受益者が有する当該受益権のうちNISA（ニーサ、少額投資非課税制度）の適用を受けているものについては非課税となります。

※上記は当ファンドの作成期末時点のものです。今後税法が改正された場合等には上記内容が変更になる場合があります。

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・パークレイズ・グローバル総合（日本円除く）インデックス		為替 （対米ドル）	米国10年国債利回り		ドイツ10年国債利回り		債組比	券入率	債先比	券物率	純資産総額
		（分配落）	税込み分配金	期中騰落率	（海昔ノーヘッジ・円ベース） 期中騰落率 （参考指数）	期中騰落率		期中騰落幅	期中騰落幅	期中騰落幅						
第20作成期	114期(2016年8月10日)	円	円	%			円	%	%	%	%	%	%	%	%	百万円
	115期(2016年9月12日)	5,570	10	2.4	238.80	1.8	101.62	1.55	0.19	△0.08	0.11	94.8	—	—	2,946	
	116期(2016年10月11日)	5,630	10	1.3	240.39	0.7	102.64	1.67	0.13	0.01	0.09	95.0	—	—	2,964	
	117期(2016年11月10日)	5,631	10	0.2	240.27	△0.1	103.95	1.72	0.04	0.06	0.05	95.8	—	—	2,946	
	118期(2016年12月12日)	5,615	10	△0.1	238.05	△0.9	105.63	2.06	0.34	0.20	0.15	96.3	—	—	2,921	
	119期(2017年1月10日)	5,938	10	5.9	255.05	7.1	115.47	2.47	0.41	0.37	0.16	96.1	—	—	3,069	
第21作成期	120期(2017年2月10日)	5,993	10	1.1	258.99	1.5	115.96	2.36	△0.10	0.28	△0.09	96.0	—	—	3,058	
	121期(2017年3月10日)	5,939	10	△0.7	253.19	△2.2	113.74	2.39	0.03	0.31	0.03	96.9	—	—	2,911	
	122期(2017年4月10日)	5,943	10	0.2	254.27	0.4	115.22	2.61	0.21	0.43	0.11	97.6	—	—	2,901	
	123期(2017年5月10日)	5,827	10	△1.8	249.28	△2.0	111.43	2.38	△0.22	0.23	△0.20	95.0	—	—	2,832	
	124期(2017年6月12日)	6,005	10	3.2	259.09	3.9	113.86	2.40	0.02	0.43	0.20	95.8	—	—	2,895	
	125期(2017年7月10日)	5,922	10	△1.2	256.63	△0.9	110.23	2.20	△0.20	0.26	△0.17	96.2	—	—	2,818	
第22作成期	126期(2017年8月10日)	6,118	10	3.5	263.77	2.8	114.17	2.39	0.19	0.57	0.31	95.1	—	—	2,898	
	127期(2017年9月10日)	6,042	10	△1.1	260.60	△1.2	110.19	2.25	△0.14	0.43	△0.15	96.5	—	—	2,842	
	128期(2017年10月10日)	6,041	10	0.1	260.15	△0.2	108.44	2.05	△0.20	0.31	△0.12	96.3	—	—	2,833	
	129期(2017年11月10日)	6,174	10	2.4	266.54	2.5	112.76	2.36	0.31	0.44	0.13	96.2	—	—	2,875	
	130期(2017年12月11日)	6,198	10	0.6	269.40	1.1	113.39	2.34	△0.02	0.38	△0.07	95.4	—	—	2,852	
	131期(2018年1月10日)	6,233	10	0.7	270.98	0.6	113.65	2.38	0.03	0.31	△0.07	96.1	—	—	2,852	
第23作成期	132期(2018年2月13日)	6,194	10	△0.5	268.95	△0.7	112.45	2.55	0.18	0.47	0.16	95.7	—	—	2,823	
	133期(2018年3月12日)	5,965	10	△3.5	259.45	△3.5	108.73	2.86	0.31	0.76	0.29	96.5	—	—	2,703	
	134期(2018年4月10日)	5,861	10	△1.6	256.20	△1.3	106.95	2.89	0.04	0.65	△0.11	94.7	—	—	2,651	
	135期(2018年5月10日)	5,876	10	0.4	258.57	0.9	106.75	2.78	△0.11	0.50	△0.14	95.7	—	—	2,650	
	136期(2018年6月11日)	5,871	10	0.1	258.64	0.0	109.96	3.00	0.23	0.56	0.06	95.9	—	—	2,640	
	137期(2018年7月10日)	5,803	10	△1.0	256.84	△0.7	109.41	2.95	△0.06	0.45	△0.11	95.4	—	—	2,602	
第24作成期	138期(2018年8月10日)	5,894	10	1.7	261.73	1.9	111.06	2.86	△0.09	0.30	△0.15	95.6	—	—	2,630	
	139期(2018年9月10日)	5,832	10	△0.9	260.22	△0.6	110.92	2.93	0.07	0.38	0.08	95.4	—	—	2,586	
	140期(2018年10月10日)	5,789	10	△0.6	260.48	0.1	110.93	2.94	0.01	0.39	0.01	95.8	—	—	2,555	
	141期(2018年11月12日)	5,840	10	1.1	261.88	0.5	113.06	3.21	0.27	0.55	0.16	94.7	—	—	2,553	
	142期(2018年12月10日)	5,835	10	0.1	262.92	0.4	113.94	3.18	△0.02	0.41	△0.14	96.7	—	—	2,524	
	143期(2019年1月10日)	5,787	10	△0.7	263.49	0.2	112.52	2.85	△0.34	0.25	△0.16	96.2	—	—	2,497	
	144期(2019年1月10日)	5,640	10	△2.4	255.72	△3.0	108.19	2.71	△0.14	0.28	0.03	96.0	—	—	2,419	

(注1) 基準価額は1万円当たり（以下同じ）。

(注2) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

(注4) ブルームバーグ・パークレイズ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（為替ノーヘッジ・円ベース）、米国10年国債利回りおよびドイツ10年国債利回りの値は、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) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、債券組入比率および債券先物比率は、実質比率を記載しております（以下同じ）。

(注6) 債券先物比率は買建比率－売建比率（以下同じ）。

(注7) 純資産総額の単位未満は切捨て。

(注8) 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）。

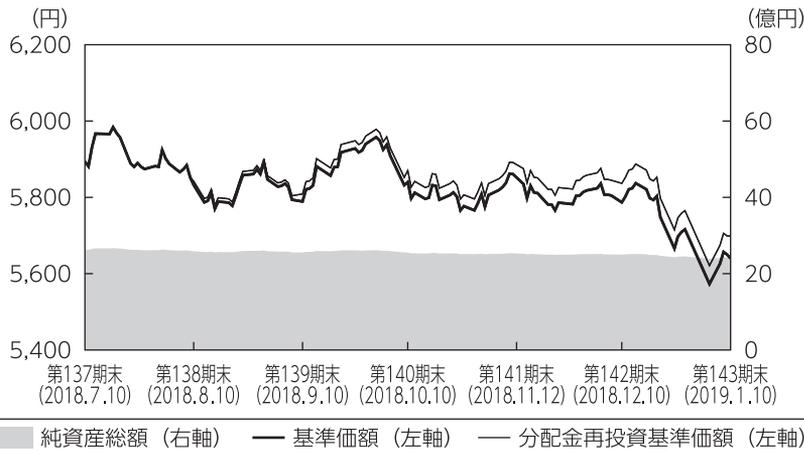
当作成期中の基準価額と市況推移

		基準価額		ブルームバーグ・パークレイズ・グローバル総合(日本円除く)インデックス (為替ノーハッジ・円ベース) (参考指数)		為替 (対米ドル)	米国10年国債利回り			ドイツ10年国債利回り		債組比	券入率	債先比	券物率
		円	騰落率	騰落率	騰落率		騰落幅	騰落幅	騰落幅						
第138期	(期首) 2018年7月10日	5,894	-	261.73	-	111.06	2.86	-	0.30	-	95.6	-	-	-	-
	7月末	5,880	△0.2	261.12	△0.2	111.01	2.97	0.12	0.45	0.15	90.2	-	-	-	-
	(期末) 2018年8月10日	5,842	△0.9	260.22	△0.6	110.92	2.93	0.07	0.38	0.08	95.4	-	-	-	-
第139期	(期首) 2018年8月10日	5,832	-	260.22	-	110.92	2.93	-	0.38	-	95.4	-	-	-	-
	8月末	5,847	0.3	262.43	0.8	111.06	2.86	△0.07	0.35	△0.03	95.3	-	-	-	-
	(期末) 2018年9月10日	5,799	△0.6	260.48	0.1	110.93	2.94	0.01	0.39	0.01	95.8	-	-	-	-
第140期	(期首) 2018年9月10日	5,789	-	260.48	-	110.93	2.94	-	0.39	-	95.8	-	-	-	-
	9月末	5,940	2.6	265.76	2.0	113.57	3.05	0.11	0.53	0.14	96.1	-	-	-	-
	(期末) 2018年10月10日	5,850	1.1	261.88	0.5	113.06	3.21	0.27	0.55	0.16	94.7	-	-	-	-
第141期	(期首) 2018年10月10日	5,840	-	261.88	-	113.06	3.21	-	0.55	-	94.7	-	-	-	-
	10月末	5,808	△0.5	260.93	△0.4	113.26	3.12	△0.08	0.37	△0.18	95.4	-	-	-	-
	(期末) 2018年11月12日	5,845	0.1	262.92	0.4	113.94	3.18	△0.02	0.41	△0.14	96.7	-	-	-	-
第142期	(期首) 2018年11月12日	5,835	-	262.92	-	113.94	3.18	-	0.41	-	96.7	-	-	-	-
	11月末	5,818	△0.3	263.09	0.1	113.47	3.03	△0.15	0.32	△0.09	96.9	-	-	-	-
	(期末) 2018年12月10日	5,797	△0.7	263.49	0.2	112.52	2.85	△0.34	0.25	△0.16	96.2	-	-	-	-
第143期	(期首) 2018年12月10日	5,787	-	263.49	-	112.52	2.85	-	0.25	-	96.2	-	-	-	-
	12月末	5,716	△1.2	259.98	△1.3	111.00	2.77	△0.08	0.23	△0.02	95.8	-	-	-	-
	(期末) 2019年1月10日	5,650	△2.4	255.72	△3.0	108.19	2.71	△0.14	0.28	0.03	96.0	-	-	-	-

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率および騰落幅は対期首比。

■ 当作成期中の運用経過 (2018年7月11日から2019年1月10日まで)

■ 基準価額等の推移



第138期首 : 5,894円
 第143期末 : 5,640円
 (既払分配金60円)
 騰落率 : △3.3%
 (分配金再投資ベース)

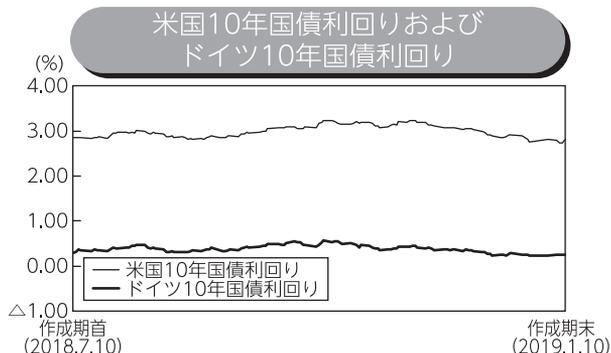
- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまが利用するコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

■ 基準価額の主な変動要因

「ルーミス・グローバル債券マザーファンド」受益証券への投資を通じて、日本を除く世界各国の公社債に投資を行った結果、ユーロや米ドルなどの通貨が対円で下落したことなどから、基準価額は下落しました。

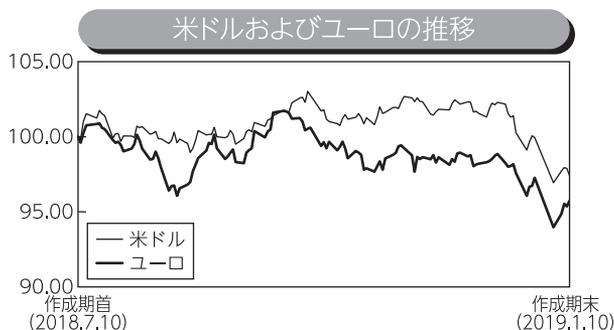
投資環境

● 海外債券市況と為替市場



米国国債市場は、比較的良好な米経済指標の発表などから11月上旬にかけて下落（利回りは上昇）しましたが、その後は原油価格の下落や米中貿易摩擦に対する警戒感の高まりなどから上昇に転じ、作成期を通じて上昇しました。一方で、ドイツ国債市場は、作成期前半は米国国債利回りの上昇に連れ下落しましたが、後半はイタリアの財政問題に対する懸念や、英国の欧州連合（EU）離脱に対する先行き不透明感などから上昇し、作成期を通じてはおおむね横ばいとなりました。投資適格社債市場は、米国が上昇した一方、欧州は下落しました。信用スプレッドは、米国、欧州ともに全般的に拡大し、中でも金融会社セクターの拡大が目立ちました。

先進国の高利回り債市場および新興国の公社債市場は上昇しました。作成期を通じ米国国債利回りが低下したことなどが上昇要因となりました。



(注) 作成期首の値を100として指数化しています。

為替市場（対円）は、米ドルやユーロが下落しました。作成期末にかけて、世界的な株安や政府機関一部閉鎖などによる米国の政治動向への不安から、リスク回避姿勢による円買い圧力が強まったことなどが下落要因となりました。ユーロについては、イタリアの財政問題やトルコリラ急落による欧州金融機関への影響が懸念されたことなども下落要因となりました。

■ ポートフォリオについて

● ルミス・グローバル債券ファンド（毎月決算型）

「ルミス・グローバル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。

● ルミス・グローバル債券マザーファンド

資産配分比率については、先進国の投資適格債を基本配分比率（60%）より高めに維持しました。先進国の高利回り債および新興国の公社債については、基本配分比率（それぞれ20%）より低めを維持しました。

債券の種別配分については、普通社債の組入比率を引き下げた一方、国債の組入比率を引き上げました。格付け別比率は、米国国債の組入を増やしたことなどに伴いAAA格の組入比率を引き上げた一方、BBB格の組入比率を引き下げました。

修正デュレーションについては、6.4から6.6程度としました。

投資通貨については、米ドル、ユーロを中心としつつ、英ポンド、カナダドル、オーストラリアドルなどへの配分も維持しました。為替ヘッジは行いませんでした。

上記の通り運用を行った結果、基準価額は2.6%下落しました。主な変動要因は以下の通りです。

（主な上昇要因）

- ・債券投資による利息収入

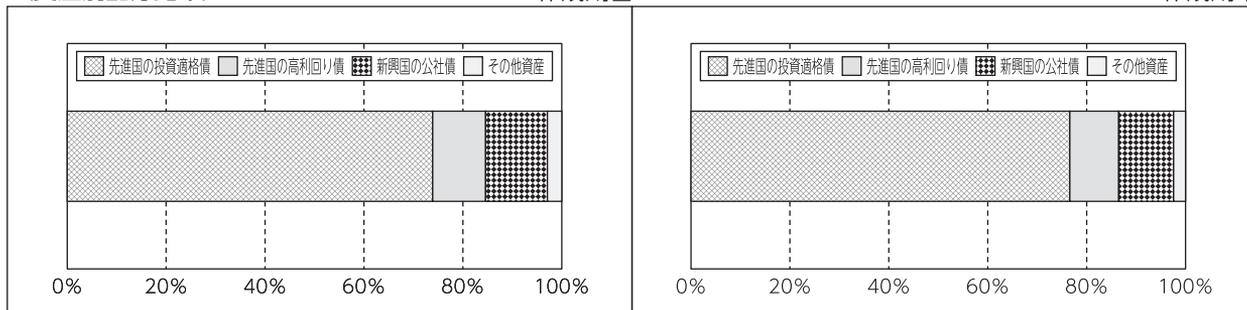
（主な下落要因）

- ・ユーロや米ドルが対円で下落したこと
- ・保有する債券の価格が下落したこと

〔資産別配分比率〕

作成期首

作成期末



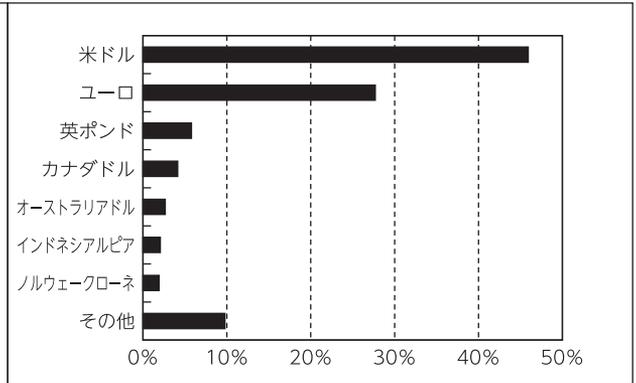
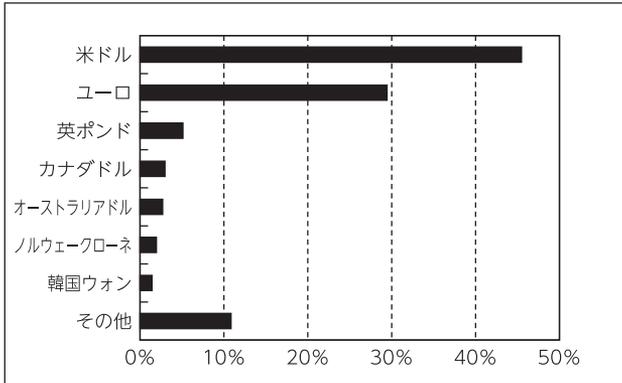
（注1）上記比率は、ルミス・グローバル債券マザーファンドの純資産総額に対する割合を表示しています。

（注2）その他資産には現金、経過利息等を含みます。

〔通貨別配分比率〕

作成期首

作成期末

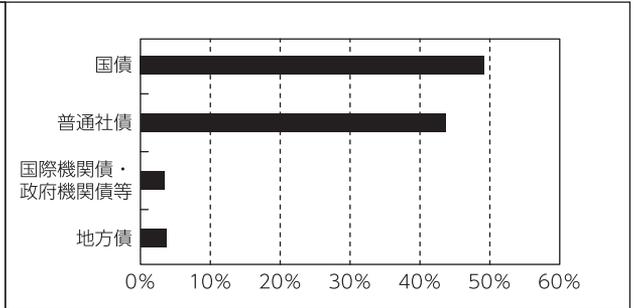
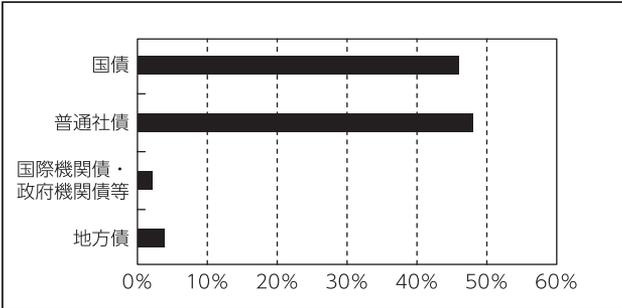


(注) 上記比率は、ルーミス・グローバル債券マザーファンドの純資産総額に対する割合を示しています。

〔種別組入比率〕

作成期首

作成期末

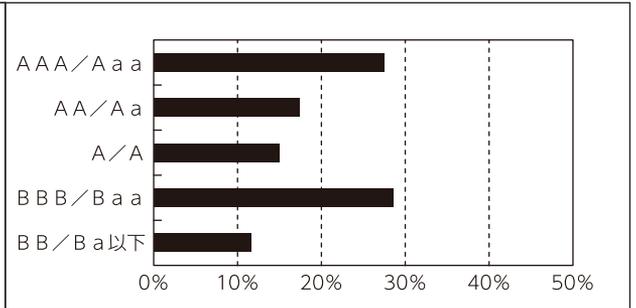
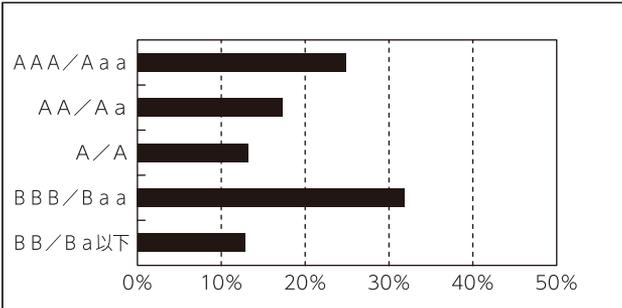


(注) 上記比率は、ルーミス・グローバル債券マザーファンドの債券部分を100%換算したものをしています。

〔格付別比率〕

作成期首

作成期末

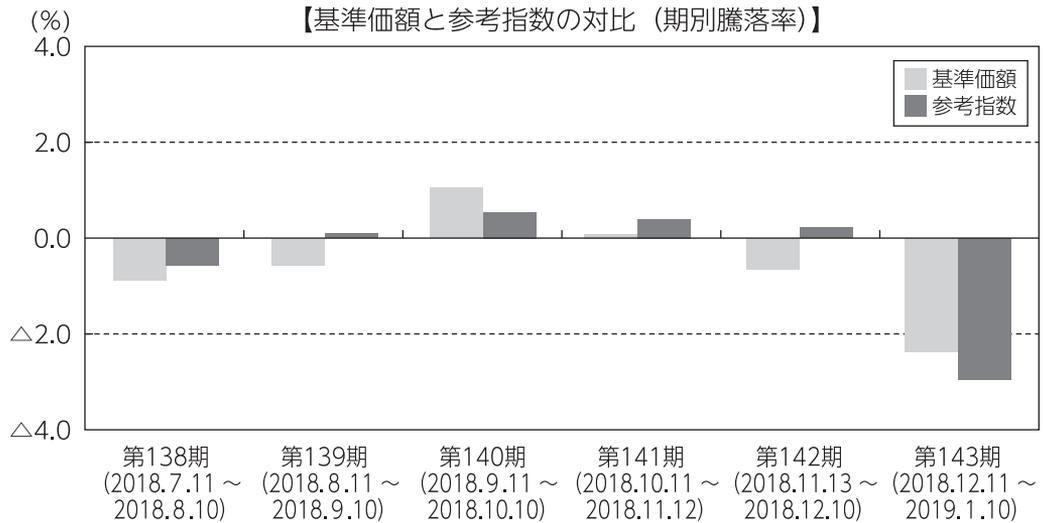


(注1) 上記比率は、ルーミス・グローバル債券マザーファンドの債券部分を100%換算したものをしています。

(注2) ファンドの格付は、S & P、Moody'sのうち高い方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（分配金再投資ベース）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138期	第139期	第140期	第141期	第142期	第143期
	2018年7月11日 ～2018年8月10日	2018年8月11日 ～2018年9月10日	2018年9月11日 ～2018年10月10日	2018年10月11日 ～2018年11月12日	2018年11月13日 ～2018年12月10日	2018年12月11日 ～2019年1月10日
当期分配金（税引前）	10円	10円	10円	10円	10円	10円
対基準価額比率	0.171%	0.172%	0.171%	0.171%	0.173%	0.177%
当期の収益	8円	7円	10円	8円	8円	8円
当期の収益以外	1円	2円	-円	1円	1円	1円
翌期繰越分配対象額	213円	211円	215円	214円	212円	210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。

（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

●ルミス・グローバル債券ファンド（毎月決算型）

「ルミス・グローバル債券マザーファンド」の組入れを高位に維持します。

●ルミス・グローバル債券マザーファンド

世界経済の見通しについては、米国欧州ともに景気は減速に向かうものの緩やかな成長が継続すると考えます。米国とドイツの国債利回りについては、米政権運営に対する不透明感が高まる中、その動向に左右される場面も予想されますが、中長期的には緩やかに上昇するとみています。債券種別配分については、相対的に利回り水準が高い社債に投資妙味があると考えます。

このような中、当ファンドは、ファンダメンタルズ分析の下、流動性に留意しつつ、割安な銘柄への投資機会を探っていきます。

資産配分については、「先進国の投資適格債」の組入比率を基本配分比率（60%）よりも高めで維持する方針です。

1 万口当たりの費用明細

項目	第138期～第143期 (2018年7月11日 ～2019年1月10日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	48円	
(投信会社)	(27)	(0.463)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各种書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(19)	(0.327)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各种書類の送付、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) 売買委託手数料	－	－	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(c) 有価証券取引税	－	－	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(d) その他費用	1	0.025	(d) 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)	(1)	(0.021)	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)	(0.002)	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)	(0.002)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用
合計	49	0.842	

(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、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、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。

作成期中の売買及び取引の状況 (2018年7月11日から2019年1月10日まで)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

	第 138 期		第 143 期	
	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
ルミス・グローバル債券マザーファンド	千□ -	千円 -	千□ 109,044	千円 149,000

(注) 単位未満は切捨て。

利害関係人との取引状況等 (2018年7月11日から2019年1月10日まで)

当作成期中における利害関係人との取引状況等はありません。

*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をいいます。

組入資産の明細

2019年1月10日現在

親投資信託残高

種 類	第23作成期末	第24作成期末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
ルミス・グローバル債券マザーファンド	千□ 1,890,879	千□ 1,781,835	千円 2,379,640

(注) 単位未満は切捨て。

※当作成期末における親投資信託の組入資産の明細は、19～24頁をご参照ください。

投資信託財産の構成

2019年1月10日現在

項 目	第24作成期末	
	評 価 額	比 率
ルーミス・グローバル債券マザーファンド	千円 2,379,640	% 98.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	49,644	2.0
投 資 信 託 財 産 総 額	2,429,284	100.0

(注1) 金額の単位未満は切捨て。

(注2) ルーミス・グローバル債券マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建純資産（2,377,478千円）の投資信託財産総額（2,398,965千円）に対する比率は99.1%です。

(注3) 外貨建資産は、作成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、2019年1月10日における邦貨換算レートは、1米ドル=108.19円、1カナダドル=81.83円、1アルゼンチンペソ=2.89円、1メキシコペソ=5.63円、1ブラジルレアル=29.38円、1コロンビアペソ=0.0345円、1ユーロ=125.00円、1英ポンド=138.41円、1スイスフラン=111.09円、1スウェーデンクローナ=12.21円、1ノルウェークローネ=12.77円、1デンマーククローネ=16.74円、1トルコリラ=19.77円、1ハンガリーフォリント=0.3888円、1ポーランドズロチ=29.06円、1ロシアルーブル=1.62円、1オーストラリアドル=77.60円、1ニュージーランドドル=73.45円、1シンガポールドル=79.96円、1マレーシアリンギット=26.36円、1タイバーツ=3.39円、1インドネシアルピア=0.0077円、1韓国ウォン=0.0969円、1南アフリカランド=7.80円です。

資産、負債、元本及び基準価額の状況

2018年8月10日現在 2018年9月10日現在 2018年10月10日現在 2018年11月12日現在 2018年12月10日現在 2019年1月10日現在

項 目	第138期末	第139期末	第140期末	第141期末	第142期末	第143期末
(A)資 産	2,595,070,920円	2,564,314,492円	2,568,915,261円	2,535,782,193円	2,506,063,801円	2,429,284,379円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	23,104,560	28,123,418	20,337,533	40,279,174	24,148,647	49,643,539
ルーミス・グローバル債券マザーファンド(評価額)	2,546,966,360	2,518,191,074	2,513,577,728	2,495,503,019	2,456,915,154	2,379,640,840
未 収 入 金	25,000,000	18,000,000	35,000,000	-	25,000,000	-
(B)負 債	8,743,682	8,552,392	15,910,097	11,612,958	8,342,944	9,894,068
未 払 収 益 分 配 金	4,435,057	4,414,818	4,371,894	4,325,781	4,316,460	4,289,939
未 払 解 約 金	676,660	579,400	8,073,206	3,575,820	902,945	2,205,740
未 払 信 託 報 酬	3,623,011	3,549,386	3,456,619	3,702,588	3,116,186	3,390,346
未 払 利 息	28	42	27	93	46	95
そ の 他 未 払 費 用	8,926	8,746	8,351	8,676	7,307	7,948
(C)純 資 産 総 額(A - B)	2,586,327,238	2,555,762,100	2,553,005,164	2,524,169,235	2,497,720,857	2,419,390,311
元 本	4,435,057,646	4,414,818,535	4,371,894,588	4,325,781,399	4,316,460,816	4,289,939,798
次 期 繰 越 損 益 金	△1,848,730,408	△1,859,056,435	△1,818,889,424	△1,801,612,164	△1,818,739,959	△1,870,549,487
(D)受 益 権 総 口 数	4,435,057,646□	4,414,818,535□	4,371,894,588□	4,325,781,399□	4,316,460,816□	4,289,939,798□
1万口当たり基準価額(C/D)	5,832円	5,789円	5,840円	5,835円	5,787円	5,640円

(注1) 各期末における1口当たり純資産額 (単位:円)

第138期	第139期	第140期	第141期	第142期	第143期
0.5832	0.5789	0.5840	0.5835	0.5787	0.5640

(注2) その他未払費用 監査費用等を計上しています。

(注3) 第24作成期末で、純資産総額が元本を下回っており、その差額は1,870,549,487円です。

(注4) 作成期首元本額 4,463,758,396円
作成期中追加設定元本額 5,168,346円
作成期中一部解約元本額 178,986,944円

損益の状況

項 目	2018年7月11日から 2018年8月10日まで	2018年8月11日から 2018年9月10日まで	2018年9月11日から 2018年10月10日まで	2018年10月11日から 2018年11月12日まで	2018年11月13日から 2018年12月10日まで	2018年12月11日から 2019年1月10日まで
	第138期	第139期	第140期	第141期	第142期	第143期
(A)配当等収益	△ 2,294円	△ 1,716円	△ 1,674円	△ 2,177円	△ 1,555円	△ 3,115円
支 払 利 息	△ 2,294	△ 1,716	△ 1,674	△ 2,177	△ 1,555	△ 3,115
(B)有価証券売買損益	△ 19,481,091	△ 10,787,868	29,929,956	6,130,583	△ 13,568,097	△ 55,292,621
売 買 益	13,999	19,662	30,386,650	6,378,825	17,436	190,534
売 買 損	△ 19,495,090	△ 10,807,530	△ 456,694	△ 248,242	△ 13,585,533	△ 55,483,155
(C)信託報酬等	△ 3,631,937	△ 3,558,132	△ 3,464,970	△ 3,711,264	△ 3,123,493	△ 3,398,294
(D)当期損益金(A+B+C)	△ 23,115,322	△ 14,347,716	26,463,312	2,417,142	△ 16,693,145	△ 58,694,030
(E)前期繰越損益金	△1,530,320,388	△1,550,450,826	△1,553,641,945	△1,515,101,251	△1,513,448,880	△1,524,733,803
(F)追加信託差損益金	△ 290,859,641	△ 289,843,075	△ 287,338,897	△ 284,602,274	△ 284,281,474	△ 282,831,715
(配当等相当額)	(41,249,245)	(41,072,649)	(40,684,677)	(40,266,634)	(40,190,890)	(39,954,727)
(売買損益相当額)	(△ 332,108,886)	(△ 330,915,724)	(△ 328,023,574)	(△ 324,868,908)	(△ 324,472,364)	(△ 322,786,442)
(G)計(D+E+F)	△1,844,295,351	△1,854,641,617	△1,814,517,530	△1,797,286,383	△1,814,423,499	△1,866,259,548
(H)収益分配金	△ 4,435,057	△ 4,414,818	△ 4,371,894	△ 4,325,781	△ 4,316,460	△ 4,289,939
次期繰越損益金(G+H)	△1,848,730,408	△1,859,056,435	△1,818,889,424	△1,801,612,164	△1,818,739,959	△1,870,549,487
追加信託差損益金	△ 290,859,641	△ 289,843,075	△ 287,338,897	△ 284,602,274	△ 284,281,474	△ 282,831,715
(配当等相当額)	(41,250,229)	(41,073,600)	(40,685,525)	(40,267,568)	(40,191,698)	(39,955,532)
(売買損益相当額)	(△ 332,109,870)	(△ 330,916,675)	(△ 328,024,422)	(△ 324,869,842)	(△ 324,473,172)	(△ 322,787,247)
分配準備積立金	53,434,128	52,155,079	53,408,648	52,313,358	51,509,835	50,423,478
繰越損益金	△1,611,304,895	△1,621,368,439	△1,584,959,175	△1,569,323,248	△1,585,968,320	△1,638,141,250

(注1) (B)有価証券売買損益は各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) 親投資信託の投資信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託するために要する費用（投資顧問料）として委託者報酬の中から支弁している額6,343,940円。

(注5) 分配金の計算過程

(単位：円)

	第138期	第139期	第140期	第141期	第142期	第143期
(a) 配当等収益(費用控除後)	3,669,932	3,390,266	6,143,001	3,804,113	3,635,735	3,530,026
(b) 有価証券売買等損益 (費用控除後、繰越欠損金補填後)	—	—	—	—	—	—
(c) 収益調整金	41,250,229	41,073,600	40,685,525	40,267,568	40,191,698	39,955,532
(d) 分配準備積立金	54,199,253	53,179,631	51,637,541	52,835,026	52,190,560	51,183,391
分配可能額(a+b+c+d)	99,119,414	97,643,497	98,466,067	96,906,707	96,017,993	94,668,949
(1万口当たり)	(223)	(221)	(225)	(224)	(222)	(220)
収益分配金額	4,435,057	4,414,818	4,371,894	4,325,781	4,316,460	4,289,939
(1万口当たり)	(10)	(10)	(10)	(10)	(10)	(10)

(注) (a)配当等収益（費用控除後）および(b)有価証券売買等損益（費用控除後、繰越欠損金補填後）には、各期中に親投資信託が計上した当該金額のうち、当ファンドに相当する金額が含まれています。

※本運用報告書作成時点においては、当作成期間に係る当ファンドの監査は終了しておりません。

－ 運用報告書（全体版） －

ルーミス・グローバル債券マザーファンド

第24期

決算日：2019年1月10日

(計算期間：2018年7月11日～2019年1月10日)

「ルーミス・グローバル債券マザーファンド」は、2019年1月10日に第24期決算を行いました。

ここに当マザーファンドの第24期の運用状況をご報告申し上げます。

■マザーファンドの仕組み

信託期間	2007年1月31日から無期限です。
運用方針	主として日本を除く世界各国の公社債に投資し、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に運用を行います。 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。 当マザーファンドの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。
投資対象	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	外貨建資産への投資割合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・グローバル総合 (日本円除く)インデックス		為替 (対米ドル)	米国10年国債利回り		ドイツ10年国債利回り		債 組 比	券 入 率	債 先 比	券 物 率	純資産 総額
	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 幅	期 中 騰 落 幅							
20期 (2017年1月10日)	円	%		%	円	%	%	%	%	%	%	%	%	百万円
21期 (2017年7月10日)	13,194	12.1	258.99	10.4	115.96	2.36	1.01	0.28	0.47	97.4	-	-	-	3,012
22期 (2018年1月10日)	13,722	4.0	263.77	1.8	114.17	2.39	0.02	0.57	0.30	95.6	-	-	-	2,883
23期 (2018年7月10日)	14,150	3.1	268.95	2.0	112.45	2.55	0.17	0.47	△0.11	96.7	-	-	-	2,796
24期 (2018年7月10日)	13,705	△ 3.1	261.73	△ 2.7	111.06	2.86	0.30	0.30	△0.17	97.1	-	-	-	2,591
24期 (2019年1月10日)	13,355	△ 2.6	255.72	△ 2.3	108.19	2.71	△0.15	0.28	△0.02	97.6	-	-	-	2,379

(注1) 基準価額は1万円当たり(以下同じ)。

(注2) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

(注3) ブルームバーグ・パークレイズ・グローバル総合(日本円除く)インデックス(為替ノーヘッジ・円ベース)、米国10年国債利回りおよびドイツ10年国債利回りの値は、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4) 債券先物比率は買建比率-売建比率(以下同じ)。

(注5) 純資産総額の単位未満は切捨て。

(注6) 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)。

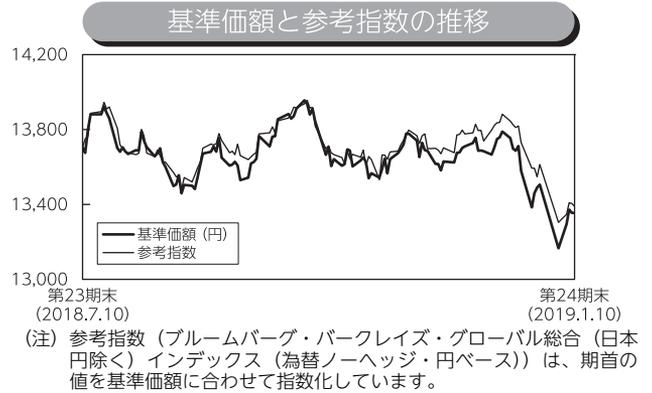
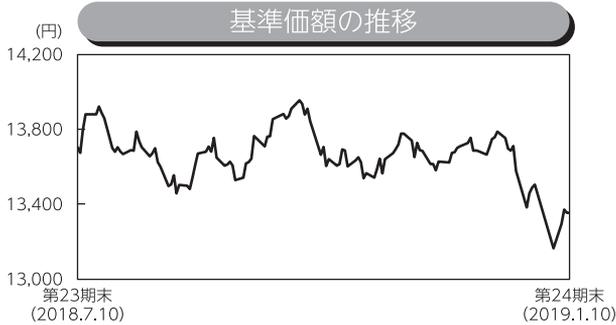
当期中の基準価額と市況推移

	基準価額		ブルームバーグ・パークレイズ・グローバル総合 (日本円除く)インデックス		為替 (対米ドル)	米国10年国債利回り		ドイツ10年国債利回り		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	
	騰 落 率	(為替ノーヘッジ・円ベース) (参考指数)	騰 落 率	(対米ドル)		騰 落 幅	騰 落 幅					
(期首)2018年7月10日	円	%		%	円	%	%	%	%	%	%	
第	7月末	13,687	△0.1	261.12	△0.2	111.01	2.97	0.12	0.45	0.15	91.2	-
24	8月末	13,650	△0.4	262.43	0.3	111.06	2.86	△0.00	0.35	0.05	96.5	-
	9月末	13,912	1.5	265.76	1.5	113.57	3.05	0.20	0.53	0.23	96.9	-
	10月末	13,644	△0.4	260.93	△0.3	113.26	3.12	0.27	0.37	0.07	96.2	-
	11月末	13,710	0.0	263.09	0.5	113.47	3.03	0.17	0.32	0.02	97.8	-
	12月末	13,506	△1.5	259.98	△0.7	111.00	2.77	△0.09	0.23	△0.07	97.6	-
(期末)2019年1月10日	13,355	△2.6	255.72	△2.3	108.19	2.71	△0.15	0.28	△0.02	97.6	-	

(注) 騰落率および騰落幅は対期首比。

当期中の運用経過 (2018年7月11日から2019年1月10日まで)

【基準価額等の推移】



【基準価額の主な変動要因】

日本を除く世界各国の公社債に投資を行った結果、保有する債券の価格が下落 (利回りは上昇) したことや、米ドルやユーロなどの通貨が対円で下落したことなどから、基準価額は下落しました。

【投資環境】

5頁をご参照ください。

【ポートフォリオ】

6～7頁をご参照ください。

今後の運用方針

9頁をご参照ください。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2018年7月11日~2019年1月10日)		
	金額 (円)	比率 (%)	
平均基準価額	13,684	-	-
(a) その他費用	3	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)	(3)	(0.022)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
(その他)	(0)	(0.002)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用
合計	3	0.024	

(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。

(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。

期中の売買及び取引の状況 (2018年7月11日から2019年1月10日まで)

公社債

		種 類	買 付 額	売 付 額
			千米ドル	千米ドル
外	アメリカ	国債証券	3,152	2,900
		地方債証券	-	197
		社債券(投資法人債券を含む)	1,829	2,313 (95)
カナダ	カナダ	国債証券	668	342
		特殊債証券	179	191
メキシコ	メキシコ	国債証券	1,711	-
ブラジル	ブラジル	国債証券	-	440
コロンビア	コロンビア	国債証券	313,923	-
国	ドイツ	国債証券	1,295	1,561
		特殊債証券	194	-
		社債券(投資法人債券を含む)	-	101
	イタリア	国債証券	76	-
		社債券(投資法人債券を含む)	-	94
	フランス	フランス	社債券(投資法人債券を含む)	-

		種 類	買 付 額	売 付 額
外 国	ユ ー ロ		千ユーロ	千ユーロ
		国 債 証 券	—	71
	そ の 他	社債券(投資法人債券を含む)	111	253
			千英ポンド	千英ポンド
	イ ギ リ ス	国 債 証 券	276	35
		社債券(投資法人債券を含む)	—	97
	オ ー ス ト ラ リ ア	国 債 証 券	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル
		地 方 債 証 券	—	34
		社債券(投資法人債券を含む)	177	—
			—	(180)
	シ ン ガ ポ ー ル	国 債 証 券	千シンガポールドル	千シンガポールドル
			—	314
	マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット
			—	120
イ ン ド ネ シ ア	国 債 証 券	千インドネシアルピア	千インドネシアルピア	
		2,725,150	838,463	
	特 殊 債 券	800,000	—	
韓 国	国 債 証 券	千韓国ウォン	千韓国ウォン	
		160,368	172,703	
南 ア フ リ カ	国 債 証 券	千南アフリカランド	千南アフリカランド	
		—	1,501	

(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) 単位未満は切捨て。

(注3) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注4) 社債券(投資法人債券を含む)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 (2018年7月11日から2019年1月10日まで)

当期中における利害関係人との取引状況等はありません。

* 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をいいます。

2019年1月10日現在

組入資産の明細

外国（外貨建）公社債

A 種類別開示

区 分	当			期		末		
	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	うちBB格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
ア メ リ カ	10,016	9,873	1,068,246	44.9	8.2	28.9	10.3	5.8
カ ナ ダ	千カナダドル	千カナダドル						
	1,215	1,206	98,715	4.1	—	1.2	2.5	0.4
メ キ シ コ	千メキシコペソ	千メキシコペソ						
	3,136	3,042	17,130	0.7	—	—	0.7	—
ブ ラ ジ ル	千ブラジルレアル	千ブラジルレアル						
	450	455	13,379	0.6	0.6	—	0.6	—
コ ロ ン ビ ア	千コロンビアペソ	千コロンビアペソ						
	1,000,000	1,055,115	36,401	1.5	—	1.5	—	—
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ						
ド イ ツ	1,315	1,336	167,051	7.0	0.4	2.2	0.4	4.4
イ タ リ ア	595	737	92,216	3.9	—	0.7	3.1	—
フ ラ ン ス	1,085	1,262	157,830	6.6	0.5	2.0	4.7	—
オ ラ ン ダ	75	109	13,708	0.6	—	0.6	—	—
ス ペ イ ン	505	583	72,969	3.1	—	1.8	1.3	—
ベ ル ギ ー	100	100	12,543	0.5	—	0.5	—	—
フ ィ ン ラ ン ド	100	100	12,593	0.5	0.5	0.5	—	—
そ の 他	925	929	116,224	4.9	—	4.9	—	—
イ ギ リ ス	千英ポンド	千英ポンド						
	875	966	133,758	5.6	1.1	4.1	—	1.5
ス イ ス	千スイスフラン	千スイスフラン						
	155	154	17,136	0.7	—	0.7	—	—
ス ウ ェ ー デ ン	千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ						
	940	1,009	12,326	0.5	—	—	0.5	—
ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ						
	3,435	3,492	44,595	1.9	—	—	1.0	0.8
デ ン マ ー ク	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ						
	1,645	1,846	30,916	1.3	—	1.3	—	—
ポ ー ラ ン ド	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ						
	710	707	20,566	0.9	—	0.5	0.4	—
ロ シ ア	千ロシアルーブル	千ロシアルーブル						
	1,600	1,576	2,553	0.1	—	—	—	0.1
オ ー ス ト ラ リ ア	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル						
	760	780	60,572	2.5	—	—	0.6	2.0
ニ ュ ー ジ ー ラ ン ド	千ニューージーランドドル	千ニューージーランドドル						
	45	51	3,800	0.2	—	—	0.2	—

区 分	当 期 末							
	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	う ち B B 格 以 下 組 入 比 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
シンガポール	千シンガポールドル 70	千シンガポールドル 71	千円 5,716	% 0.2	% -	% -	% -	% 0.2
マレーシア	千マレーシアリンギット 330	千マレーシアリンギット 330	8,716	0.4	-	-	0.4	-
タイ	千タイバーツ 2,250	千タイバーツ 2,365	8,018	0.3	-	-	0.3	-
インドネシア	千インドネシアルピア 5,987,000	千インドネシアルピア 6,067,681	46,721	2.0	-	-	2.0	-
韓国	千韓国ウォン 360,000	千韓国ウォン 360,441	34,926	1.5	-	-	-	1.5
南アフリカ	千南アフリカランド 1,920	千南アフリカランド 1,591	12,412	0.5	-	0.5	-	-
合 計	-	-	2,321,748	97.6	11.3	52.0	28.9	16.7

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(注4) -印は組入れなし。

(注5) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(注6) 債券の格付けは、原則として、信用格付業者等より当該債券が取得している格付けであり、複数の信用格付業者等により格付けがある場合は、その高い方を用いております。

B 個別銘柄開示

銘 柄		当 期 末					
		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	国債証券	FED REP BRAZIL	4.625	200	196	21,246	2028/1/13
		REP OF INDONESIA	5.125	200	203	22,016	2045/1/15
		TSY INFL IX N/B	0.125	450	454	49,204	2022/4/15
		US TREASURY N/B	2.25	510	507	54,913	2020/3/31
		US TREASURY N/B	2.25	55	53	5,804	2025/11/15
		US TREASURY N/B	2.5	205	184	19,981	2046/5/15
		US TREASURY N/B	2.75	75	70	7,668	2047/11/15
		US TREASURY N/B	2.875	165	167	18,068	2028/5/15
		US TREASURY N/B	3.0	240	238	25,801	2048/8/15
		US TREASURY N/B	5.0	340	445	48,150	2037/5/15
	普通社債券 (含む投資法人債券)	ALLY FINANCIAL INC	3.5	165	165	17,854	2019/1/27
		AMER AIRLINE SI	4.95	78	78	8,501	2025/2/15
		ANADARKO PETRO	6.6	40	45	4,893	2046/3/15
		ANADARKO PETROLEUM	5.55	50	53	5,734	2026/3/15
ANDEAVOR LOGIS		4.25	15	14	1,534	2027/12/1	
ANHEUSER-BUSCH		3.65	30	28	3,088	2026/2/1	
	ANHEUSER-BUSCH	4.7	170	160	17,413	2036/2/1	
	AT&T INC	4.35	50	43	4,714	2045/6/15	
	AT&T INC	4.5	50	44	4,806	2048/3/9	
	AT&T INC	4.8	5	4	501	2044/6/15	
	BANCO SANTANDER	3.875	200	199	21,586	2022/9/20	

銘柄			当		期		末
			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	普通社債券 (含む投資法人債券)	NXP BV/NXP FUNDI	4.625	200	196	21,309	2023/6/1
		OWENS CORNING	4.3	50	37	4,007	2047/7/15
		OWENS CORNING	4.4	20	15	1,632	2048/1/30
		QUICKEN LOANS INC	5.25	50	46	5,071	2028/1/15
		RAIZEN FUELS FIN	5.3	200	195	21,156	2027/1/20
		ROYAL BK SCOTLND	6.0	135	136	14,820	2023/12/19
		ROYAL BK SCOTLND	6.1	25	25	2,747	2023/6/10
		SP POWERASSETS	2.7	200	196	21,229	2022/9/14
		SPIRIT AIR SI	4.45	51	51	5,554	2025/10/1
		STANDARD CHARTERED	3.95	200	193	20,882	2023/1/11
		T-MOBILE USA INC	4.75	90	85	9,225	2028/2/1
		TELECOM ITALIA	7.2	20	19	2,098	2036/7/18
		TENET HEALTHCARE	5.125	65	63	6,894	2025/5/1
		TEVA PHARMA	2.8	80	70	7,659	2023/7/21
		TEVA PHARMA	3.15	55	44	4,840	2026/10/1
		TIME WARNER INC	3.6	45	42	4,649	2025/7/15
		TIME WARNER INC	3.8	55	52	5,667	2027/2/15
		TOLL BROS FINANCE	4.35	85	76	8,230	2028/2/15
		TRANSOCEAN GUARD SI	5.875	25	24	2,654	2024/1/15
		TRANSOCEAN PONT	6.125	35	34	3,760	2025/8/1
		UNITED AIR SI	3.65	77	74	8,025	2025/10/7
		UNITED AIR SI	3.65	41	39	4,222	2026/1/7
		UNITED OVERSEAS BK	3.2	200	200	21,648	2021/4/23
		UNITYMEDIA GMBH	6.125	230	234	25,319	2025/1/15
		USG CORP	4.875	150	151	16,390	2027/6/1
		WARNER MEDIA INC	3.875	20	19	2,080	2026/1/15
		WHITING PETROLEUM	5.75	140	140	15,146	2021/3/15
WHITING PETROLEUM	6.25	10	9	1,065	2023/4/1		
小計						1,068,246	
カナダ	国債証券	CANADIAN GOVT	0.5	120	114	9,398	2022/3/1
		CANADIAN GOVT	1.75	260	258	21,128	2023/3/1
		CANADIAN GOVT	2.0	360	360	29,514	2028/6/1
	特殊債券 (除く金融債)	INTL BK RECON&DEV	2.2	180	180	14,746	2022/1/18
		PSP CAPITAL INC	2.09	180	176	14,466	2023/11/22
	普通社債券 (含む投資法人債券)	ALIMENTATION COUC	3.319	115	115	9,460	2019/11/1
小計						98,715	
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR	6.5	1,446	1,385	7,799	2021/6/10
		MEX BONOS DESARR	8.0	1,690	1,657	9,330	2023/12/7
小計						17,130	
ブラジル	国債証券	FED REP BRAZIL	8.5	450	455	13,379	2024/1/5
コロンビア	国債証券	TITULOS DE TESORERIA	7.5	1,000,000	1,055,115	36,401	2026/8/26

銘柄		当		期		末	
		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		
ユーロ		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUT	1.0	70	75	9,410	2025/8/15
		BUNDESREPUB. DEUT	3.5	825	841	105,141	2019/7/4
	特殊債券 (除く金融債)	KFW	0.25	195	194	24,272	2025/9/15
	普通社債券 (含む投資法人債券)	COMMERZBANK	0.625	70	70	8,829	2025/5/28
	COMMERZBANK	4.0	75	77	9,633	2026/3/23	
	THYSSENKRUPP AG	1.375	80	78	9,764	2022/3/3	
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI	1.25	65	59	7,438	2026/12/1
		BUONI POLIENNALI	2.5	80	80	10,050	2025/11/15
		BUONI POLIENNALI	9.0	450	597	74,728	2023/11/1
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	0.5	90	90	11,362	2026/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	3.0	80	88	11,030	2022/4/25
		FRANCE (GOVT OF)	4.25	490	592	74,054	2023/10/25
		FRANCE (GOVT OF)	4.5	120	189	23,721	2041/4/25
		FRANCE (GOVT OF)	-	205	205	25,653	2023/3/25
	普通社債券 (含む投資法人債券)	CROWN EURO	2.875	100	96	12,010	2026/2/1
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVT	2.75	75	109	13,708	2047/1/15
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL	4.2	180	233	29,216	2037/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL	5.85	125	147	18,386	2022/1/31
	普通社債券 (含む投資法人債券)	BANCO POPULAR ESPA	0.875	100	101	12,748	2021/9/28
	BANCO SANTANDER	3.25	100	100	12,617	2026/4/4	
ベルギー	普通社債券 (含む投資法人債券)	ING BELGIUM SA	0.625	100	100	12,543	2025/5/30
フィンランド	普通社債券 (含む投資法人債券)	NOKIA OYJ	2.0	100	100	12,593	2024/3/15
その他	国債証券	HUNGARY	1.75	65	65	8,243	2027/10/10
	地方債証券	ONTARIO PROVINCE	0.625	100	100	12,581	2025/4/17
		PROVINCE OF ALBERT	0.625	100	100	12,592	2025/4/18
		PROVINCE OF QUEBEC	0.875	165	169	21,138	2025/1/15
	普通社債券 (含む投資法人債券)	AVIVA PLC VAR	3.375	160	155	19,395	2045/12/4
		CHANNEL LINK VAR/SI	1.761	100	100	12,542	2050/6/30
	SKY LTD	2.5	120	127	15,880	2026/9/15	
	XLIT LTD VAR	3.25	115	110	13,850	2047/6/29	
小計						645,138	
イギリス	国債証券	UK TSY	1.75	140	140	19,480	2019/7/22
		UK TSY	3.25	195	252	34,972	2044/1/22
		UK TSY	5.0	230	285	39,480	2025/3/7
	普通社債券 (含む投資法人債券)	AXA SA	7.125	20	21	3,032	2020/12/15
		FINMECCANICA SPA	8.0	90	93	12,931	2019/12/16
		VIRGIN MEDIA RECEIV	5.5	100	96	13,414	2024/9/15
	WPP FINANCE	2.875	100	75	10,445	2046/9/14	
小計						133,758	
スイス	普通社債券 (含む投資法人債券)	GOLDMAN SACHS	1.0	155	154	17,136	2025/11/24
スウェーデン	国債証券	SWEDISH GOVT	1.5	940	1,009	12,326	2023/11/13

銘柄			当		期		末
			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	
ノルウェー	国債証券	NORWEGIAN GOVT	% 2.0	千ノルウェークロネ 1,865	千ノルウェークロネ 1,921	千円 24,534	2023/5/24
	特殊債券 (除く金融債)	NORDIC INVESTMENT B	1.375	1,570	1,570	20,060	2020/7/15
小計						44,595	
デンマーク	国債証券	KINGDOM OF DENMARK	1.75	千デンマーククロネ 1,645	千デンマーククロネ 1,846	30,916	2025/11/15
ポーランド	国債証券	POLAND GOVT	2.0	千ポーランドズロチ 315	千ポーランドズロチ 317	9,227	2021/4/25
		POLAND GOVT	2.5	395	390	11,339	2026/7/25
小計						20,566	
ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT	6.4	千ロシアルーブル 1,600	千ロシアルーブル 1,576	2,553	2020/5/27
オーストラリア	国債証券	AUSTRALIAN GOVT	1.75	千オーストラリアドル 280	千オーストラリアドル 279	21,666	2020/11/21
	地方債証券	NEW S WALES	4.0	170	177	13,753	2021/4/8
		QUEENSLAND TREASURY	6.25	310	324	25,152	2020/2/21
小計						60,572	
ニュージーランド	国債証券	NEW ZEALAND GOVT	5.5	千ニュージーランドドル 45	千ニュージーランドドル 51	3,800	2023/4/15
シンガポール	国債証券	SINGAPORE GOVT	3.25	千シンガポールドル 70	千シンガポールドル 71	5,716	2020/9/1
マレーシア	国債証券	MALAYSIA GOVT	3.795	千マレーシアリンギット 330	千マレーシアリンギット 330	8,716	2022/9/30
タイ	国債証券	THAILAND GOVT	3.65	千タイバーツ 2,250	千タイバーツ 2,365	8,018	2021/12/17
インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVT	8.25	千インドネシアルピア 5,187,000	千インドネシアルピア 5,256,801	40,477	2021/7/15
	特殊債券 (除く金融債)	INTL BK RECON&DEV	8.4	800,000	810,880	6,243	2021/10/12
小計						46,721	
韓国	国債証券	KOREA TREASURY	1.75	千韓国ウォン 360,000	千韓国ウォン 360,441	34,926	2020/6/10
南アフリカ	国債証券	REP SOUTH AFRICA	7.0	千南アフリカランド 1,920	千南アフリカランド 1,591	12,412	2031/2/28
合計						2,321,748	

(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) 金額の単位未満は切捨て。

(注3) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入力しています。

(注4) 国籍は、組入資産の通貨を基準としています。

* 株式および新株予約権証券の保有はありません。

投資信託財産の構成

2019年1月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 2,321,748	% 96.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	77,217	3.2
投 資 信 託 財 産 総 額	2,398,965	100.0

(注1) 金額の単位未満は切捨て。

(注2) 当期末における外貨建純資産(2,377,478千円)の投資信託財産総額(2,398,965千円)に対する比率は99.1%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、2019年1月10日における邦貨換算レートは、1米ドル=108.19円、1カナダドル=81.83円、1アルゼンチンペソ=2.89円、1メキシコペソ=5.63円、1ブラジルレアル=29.38円、1コロンビアペソ=0.0345円、1ユーロ=125.00円、1英ポンド=138.41円、1スイスフラン=111.09円、1スウェーデンクローナ=12.21円、1ノルウェークローネ=12.77円、1デンマーククローネ=16.74円、1トルコリラ=19.77円、1ハンガリーフォリント=0.3888円、1ポーランドズロチ=29.06円、1ロシアルーブル=1.62円、1オーストラリアドル=77.60円、1ニュージーランドドル=73.45円、1シンガポールドル=79.96円、1マレーシアリンギット=26.36円、1タイバーツ=3.39円、1インドネシアルピア=0.0077円、1韓国ウォン=0.0969円、1南アフリカランド=7.80円です。

資産、負債、元本及び基準価額の状況

2019年1月10日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,398,965,015円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	34,513,811
公 社 債(評価額)	2,321,748,429
未 収 入 金	15,284,270
未 収 利 息	24,037,342
前 払 費 用	3,381,163
(B) 負 債	19,378,106
未 払 金	19,378,102
未 払 利 息	4
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	2,379,586,909
元 本	1,781,835,148
次 期 繰 越 損 益 金	597,751,761
(D) 受 益 権 総 口 数	1,781,835,148口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,355円

(注1) 当期末における1口当たり純資産額 1.3355円

(注2) 期首元本額 1,890,879,865円

期中追加設定元本額 0円

期中一部解約元本額 109,044,717円

(注3) 元本の内訳

ルミス・グローバル債券ファンド(毎月決算型) 1,781,835,148円

損益の状況

(2018年7月11日から2019年1月10日まで)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	41,262,733円
受 取 利 息	41,264,233
支 払 利 息	△ 1,500
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△103,502,425
売 買 益	20,065,640
売 買 損	△123,568,065
(C) 信 託 報 酬 等	△ 594,958
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	△ 62,834,650
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	700,541,694
(F) 解 約 差 損 益 金	△ 39,955,283
(G) 計 (D + E + F)	597,751,761
次 期 繰 越 損 益 金(G)	597,751,761

(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)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。