

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。	
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。	
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。
運用方法	<p>ファンド全体の加重平均格付けは、B B B格相当以上に維持することを基本とします。</p> <p>公社債の組入比率は、高位を保つことを基本とします。先進国の投資適格債60%、先進国の高利回り債20%、新興国の公社債20%を基本配分比率とします。</p> <p>外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p> <p>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。</p>	
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	<p>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。</p> <p>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。</p>	

第162期	<決算日	2020年8月11日>
第163期	<決算日	2020年9月10日>
第164期	<決算日	2020年10月12日>
第165期	<決算日	2020年11月10日>
第166期	<決算日	2020年12月10日>
第167期	<決算日	2021年1月12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、2021年1月12日に第167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/>

ルームス・グローバル債券ファンド（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・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） （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	純資産額
		（分配落）	税込み 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落幅		期中 騰落幅	期中 騰落幅	期中 騰落幅						
第24作成期	138期(2018年8月10日)	円	円	%			円	%	%	%	%	%	%	%	%	百万円
	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	
第25作成期	142期(2018年12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	
	143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	
	144期(2019年2月12日)	5,768	10	2.4	262.03	2.5	110.55	2.65	△0.06	0.12	△0.16	96.7	—	—	2,458	
	145期(2019年3月11日)	5,792	10	0.6	264.88	1.1	110.95	2.63	△0.03	0.07	△0.05	95.4	—	—	2,457	
	146期(2019年4月10日)	5,865	10	1.4	268.10	1.2	111.20	2.50	△0.13	△0.01	△0.08	95.1	—	—	2,481	
第26作成期	147期(2019年5月10日)	5,767	10	△1.5	264.53	△1.3	109.86	2.44	△0.06	△0.05	△0.04	96.0	—	—	2,432	
	148期(2019年6月10日)	5,786	10	0.5	266.33	0.7	108.52	2.08	△0.36	△0.26	△0.21	97.0	—	—	2,433	
	149期(2019年7月10日)	5,835	10	1.0	269.62	1.2	109.01	2.06	△0.02	△0.35	△0.10	94.9	—	—	2,434	
	150期(2019年8月13日)	5,695	10	△2.2	265.42	△1.6	105.43	1.71	△0.36	△0.61	△0.26	95.4	—	—	2,363	
	151期(2019年9月10日)	5,811	10	2.2	270.19	1.8	107.45	1.73	0.03	△0.55	0.06	96.6	—	—	2,407	
第27作成期	152期(2019年10月10日)	5,783	10	△0.3	270.74	0.2	107.37	1.67	△0.06	△0.47	0.08	96.0	—	—	2,383	
	153期(2019年11月11日)	5,817	10	0.8	272.94	0.8	109.16	1.94	0.27	△0.25	0.22	95.7	—	—	2,379	
	154期(2019年12月10日)	5,818	10	0.2	273.80	0.3	108.67	1.84	△0.10	△0.30	△0.05	96.0	—	—	2,376	
	155期(2020年1月10日)	5,877	10	1.2	277.09	1.2	109.57	1.82	△0.02	△0.20	0.10	95.9	—	—	2,384	
	156期(2020年2月10日)	5,908	10	0.7	280.56	1.3	109.67	1.57	△0.25	△0.41	△0.21	95.6	—	—	2,373	
第28作成期	157期(2020年3月10日)	5,683	10	△3.6	272.79	△2.8	103.28	0.81	△0.77	△0.79	△0.38	96.5	—	—	2,271	
	158期(2020年4月10日)	5,715	10	0.7	275.69	1.1	108.61	0.72	△0.08	△0.35	0.44	95.7	—	—	2,278	
	159期(2020年5月11日)	5,640	10	△1.1	272.34	△1.2	106.95	0.71	△0.01	△0.51	△0.17	96.4	—	—	2,242	
	160期(2020年6月10日)	5,966	10	6.0	282.07	3.6	107.79	0.73	0.02	△0.33	0.18	95.9	—	—	2,361	
	161期(2020年7月10日)	5,972	10	0.3	283.78	0.6	107.13	0.65	△0.08	△0.47	△0.13	94.9	—	—	2,275	
第29作成期	162期(2020年8月11日)	6,096	10	2.2	286.79	1.1	106.17	0.64	△0.00	△0.48	△0.01	94.2	—	—	2,295	
	163期(2020年9月10日)	6,054	10	△0.5	286.78	△0.0	106.22	0.68	0.04	△0.43	0.05	95.2	—	—	2,274	
	164期(2020年10月12日)	6,028	10	△0.3	286.17	△0.2	105.66	0.78	0.10	△0.55	△0.11	96.5	—	—	2,232	
	165期(2020年11月10日)	6,045	10	0.4	286.44	0.1	105.21	0.96	0.19	△0.49	0.06	94.8	—	—	2,234	
	166期(2020年12月10日)	6,103	10	1.1	287.88	0.5	104.28	0.91	△0.05	△0.60	△0.12	95.6	—	—	2,241	
	167期(2021年1月12日)	6,087	10	△0.1	288.24	0.1	104.23	1.13	0.22	△0.47	0.14	95.6	—	—	2,233	

(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・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) 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・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		%	%	%	%				
第162期	(期首) 2020年7月10日	5,972	—	283.78	—	107.13	0.65	—	△0.47	—	94.9	—	—	—
	7月末	6,022	0.8	284.46	0.2	104.60	0.53	△0.12	△0.52	△0.06	96.8	—	—	—
	(期末) 2020年8月11日	6,106	2.2	286.79	1.1	106.17	0.64	△0.00	△0.48	△0.01	94.2	—	—	—
第163期	(期首) 2020年8月11日	6,096	—	286.79	—	106.17	0.64	—	△0.48	—	94.2	—	—	—
	8月末	6,031	△1.1	284.57	△0.8	105.36	0.71	0.06	△0.40	0.08	94.4	—	—	—
	(期末) 2020年9月10日	6,064	△0.5	286.78	△0.0	106.22	0.68	0.04	△0.43	0.05	95.2	—	—	—
第164期	(期首) 2020年9月10日	6,054	—	286.78	—	106.22	0.68	—	△0.43	—	95.2	—	—	—
	9月末	6,000	△0.9	285.20	△0.6	105.80	0.69	0.01	△0.52	△0.09	95.3	—	—	—
	(期末) 2020年10月12日	6,038	△0.3	286.17	△0.2	105.66	0.78	0.10	△0.55	△0.11	96.5	—	—	—
第165期	(期首) 2020年10月12日	6,028	—	286.17	—	105.66	0.78	—	△0.55	—	96.5	—	—	—
	10月末	5,936	△1.5	282.45	△1.3	104.60	0.88	0.10	△0.63	△0.08	94.3	—	—	—
	(期末) 2020年11月10日	6,055	0.4	286.44	0.1	105.21	0.96	0.19	△0.49	0.06	94.8	—	—	—
第166期	(期首) 2020年11月10日	6,045	—	286.44	—	105.21	0.96	—	△0.49	—	94.8	—	—	—
	11月末	6,062	0.3	286.02	△0.1	103.89	0.84	△0.12	△0.57	△0.09	95.2	—	—	—
	(期末) 2020年12月10日	6,113	1.1	287.88	0.5	104.28	0.91	△0.05	△0.60	△0.12	95.6	—	—	—
第167期	(期首) 2020年12月10日	6,103	—	287.88	—	104.28	0.91	—	△0.60	—	95.6	—	—	—
	12月末	6,117	0.2	288.44	0.2	103.50	0.93	0.02	△0.57	0.03	95.6	—	—	—
	(期末) 2021年1月12日	6,097	△0.1	288.24	0.1	104.23	1.13	0.22	△0.47	0.14	95.6	—	—	—

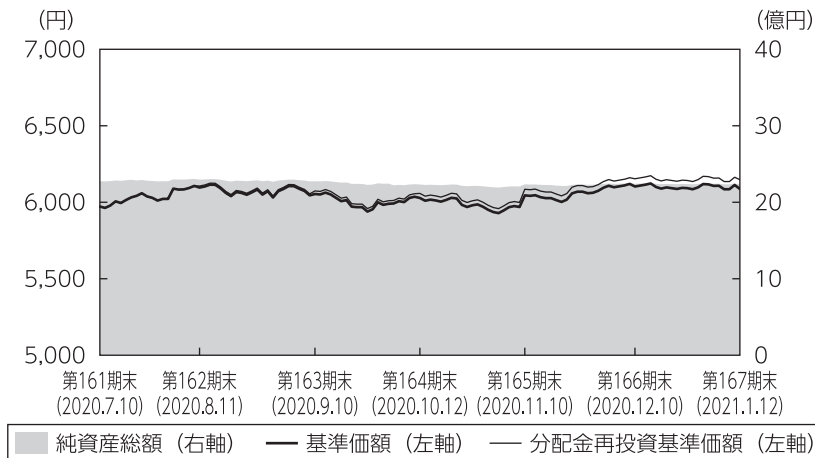
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率および騰落幅は期首比です。

(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162期～第167期の運用経過 (2020年7月11日から2021年1月12日まで)

基準価額等の推移



第162期首 : 5,972円
 第167期末 : 6,087円
 (既払分配金60円)
 騰落率 : 2.9%
 (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。

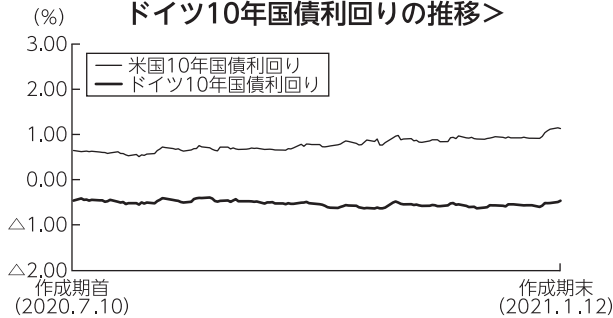
基準価額の主な変動要因

「ルーミス・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へ投資を行った結果、保有する普通社債の価格が上昇（利回りは低下）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場

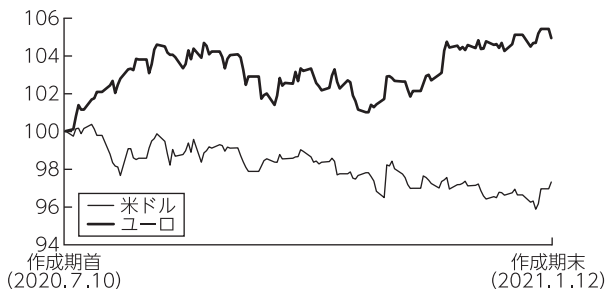
<米国10年国債利回りおよび
ドイツ10年国債利回りの推移>



米国国債市場は、米国債の需給悪化懸念や追加経済対策への進展期待、新型コロナウイルスのワクチン開発・実用化期待を背景にリスク選好姿勢が高まったことなどから下落（利回りは上昇）しました。ドイツ国債市場は、欧州での感染再拡大に伴う景気の先行き懸念などから上昇しました。投資適格社債市場は、米国、欧州ともに上昇しました。信用スプレッドは、米国、欧州ともに全般的に縮小しました。

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。

<米ドルおよびユーロの推移>



為替市場（対円）は、米ドルは下落し、ユーロは上昇しました。米ドルは、F R B（米連邦準備制度理事会）が低金利政策の継続を示唆したことが下落要因となりました。ユーロは、欧州各国首脳が経済立て直しに向けた財政政策で合意したことや、ユーロ圏経済指標の改善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。

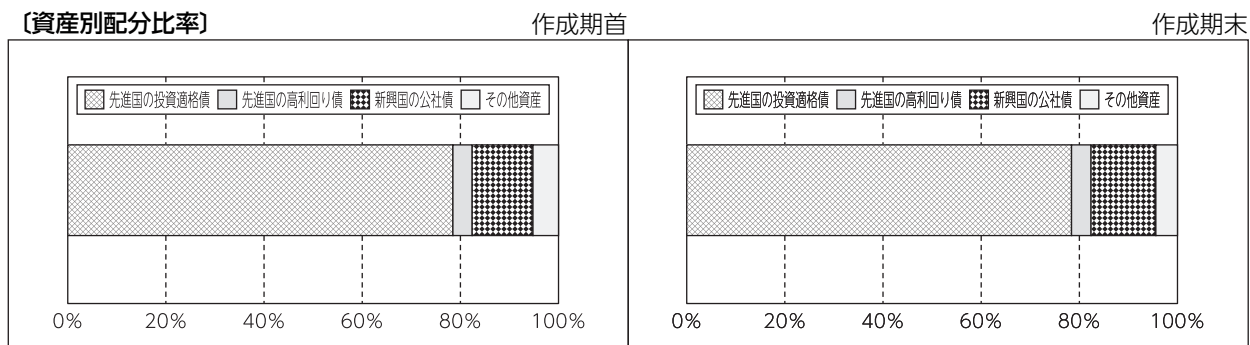
ポートフォリオについて

●当ファンド

「ルーミス・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。

●ルーミス・グローバル債券マザーファンド

資産配分比率は、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%）より低めとしました。投資通貨は、米ドル、ユーロを中心とし、英ポンド、カナダドルなどへの配分を維持しました。また、修正デュレーションは短期化しました。上記の通り運用を行った結果、保有する普通社債の価格が上昇したことから基準価額は上昇しました。



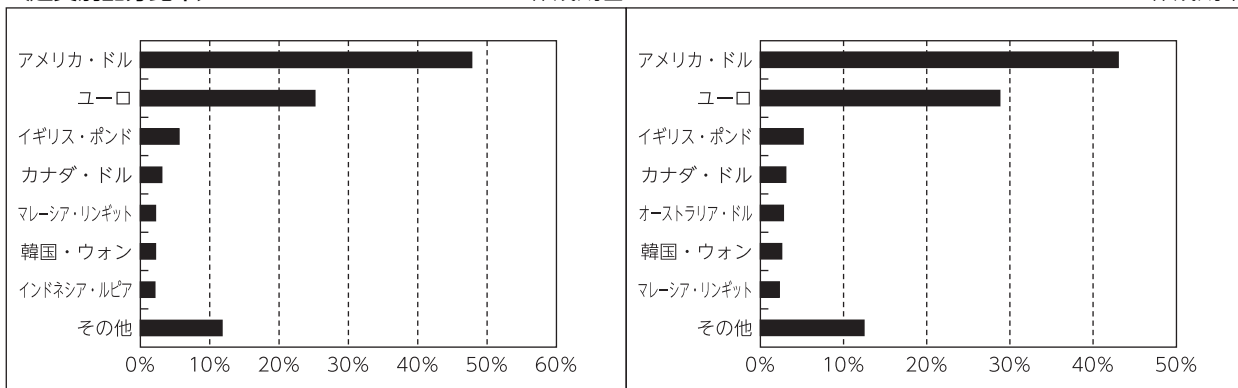
(注1) 上記比率は、ルーミス・グローバル債券マザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。

(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

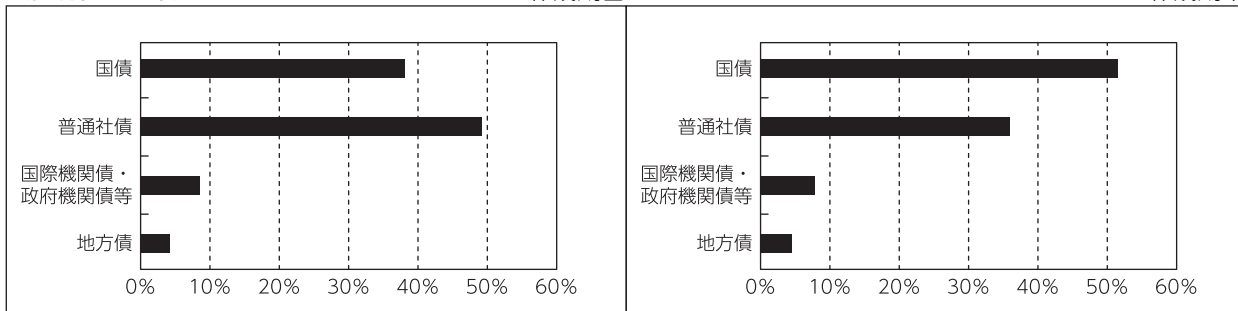


(注) 上記比率は、ルーミス・グローバル債券マザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。

【種別組入比率】

作成期首

作成期末

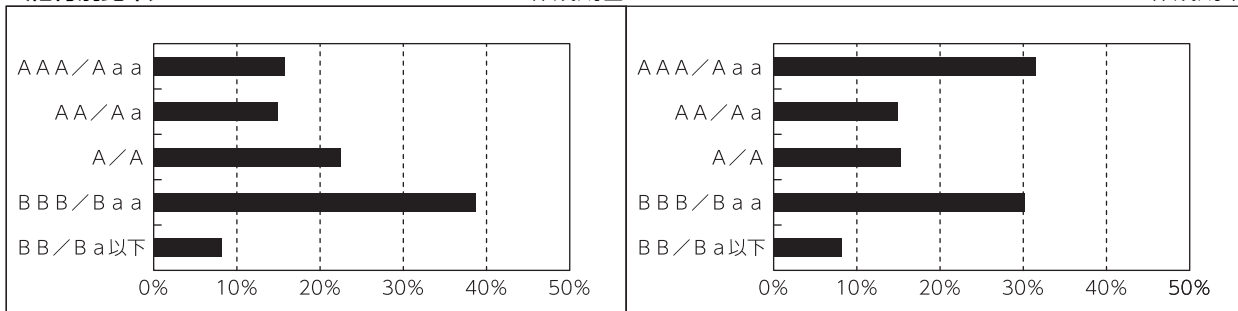


(注) 上記比率は、ルーミス・グローバル債券マザーファンドの債券部分に対する評価額の割合です。

【格付別比率】

作成期首

作成期末

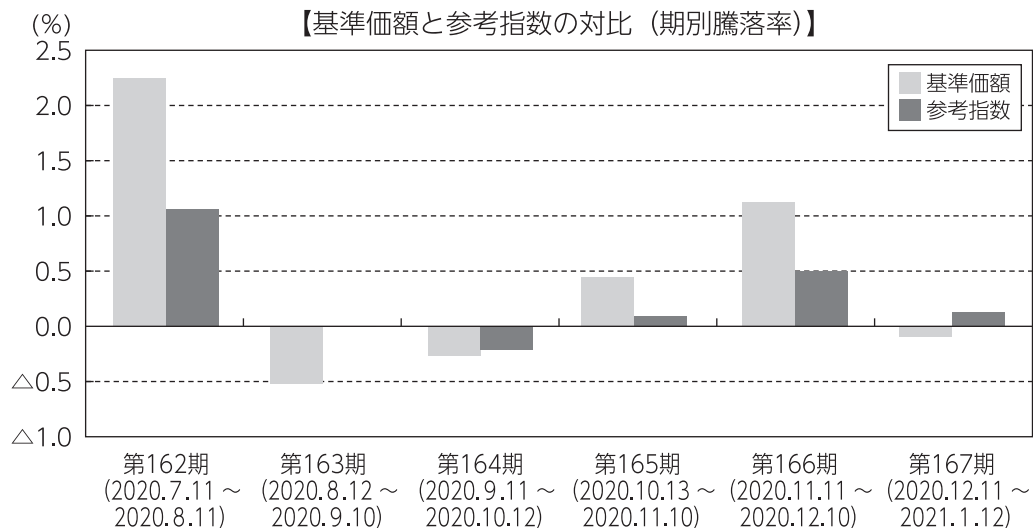


(注1) 上記比率は、ルーミス・グローバル債券マザーファンドの債券部分に対する評価額の割合です。

(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162期	第163期	第164期	第165期	第166期	第167期
	2020年7月11日 ～2020年8月11日	2020年8月12日 ～2020年9月10日	2020年9月11日 ～2020年10月12日	2020年10月13日 ～2020年11月10日	2020年11月11日 ～2020年12月10日	2020年12月11日 ～2021年1月12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	0.16%	0.16%	0.17%	0.17%	0.16%	0.16%
当期の収益	10円	5円	4円	9円	10円	3円
当期の収益以外	-円	4円	5円	0円	-円	6円
翌期繰越分配対象額	223円	218円	213円	212円	213円	206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・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。

●ルーミス・グローバル債券マザーファンド

米国とドイツの国債利回りについては、新型コロナウイルスの感染拡大に伴う世界景気への影響やワクチン普及への期待、各国の財政動向などが意識される中、短期的にはそれらの動向に左右される展開を予想します。債券種別配分については、引き続き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。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第162期～第167期		項目の概要
	(2020年7月11日 ～2021年1月12日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	51円	0.840%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は6,045円です。
(投信会社)	(29)	(0.476)	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)	(20)	(0.336)	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)	(0.028)	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	0.036	(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)	(0.033)	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)	(0.002)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	53	0.875	

(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。

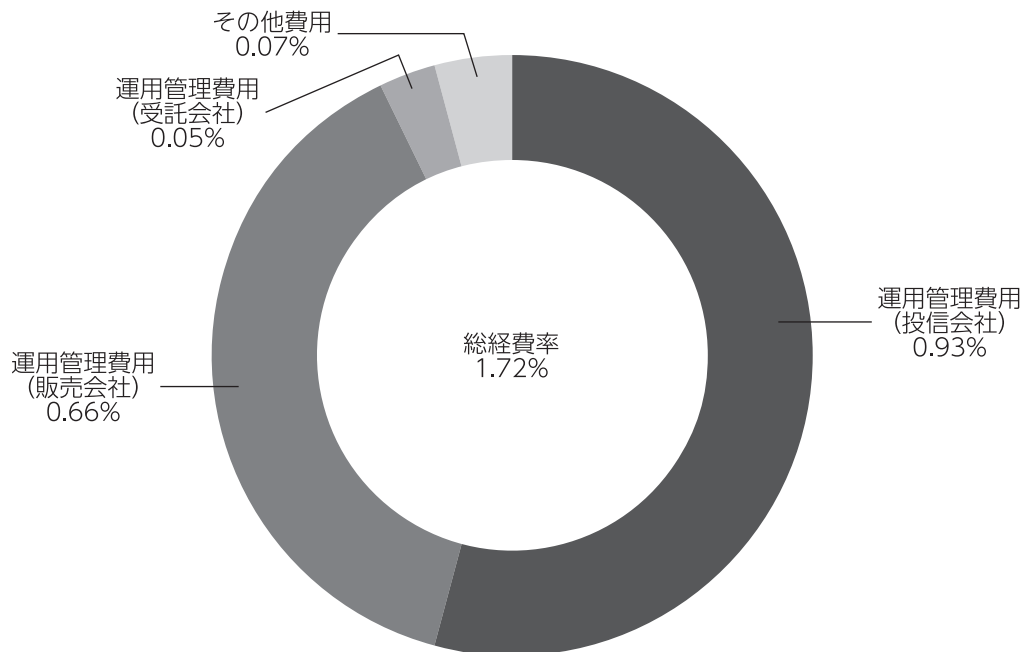
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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1.72%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7月11日から2021年1月12日まで）

	第 162 期 ~ 第 167 期			
	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
ルーミス・グローバル債券マザーファンド	千口 —	千円 —	千口 72,022	千円 110,000

■利害関係人との取引状況等（2020年7月11日から2021年1月12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27作成期末		第28作成期末	
	□ 数	□ 数	□ 数	評 価 額
ルーミス・グローバル債券マザーファンド	千口 1,490,945	千口 1,418,923	千円 2,207,135	

■投資信託財産の構成

2021年1月12日現在

項 目	第28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 2,207,135	98.4%
コーラル・ローン等、その他	34,951	1.6
投資信託財産総額	2,242,086	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・グローバル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、2,204,976千円、99.4%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、2021年1月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=104.23円、1カナダ・ドル=81.56円、1オーストラリア・ドル=80.34円、1シンガポール・ドル=78.36円、1ニュージーランド・ドル=74.76円、1イギリス・ポンド=140.94円、1スイス・フラン=117.09円、1トルコ・リラ=13.94円、1デンマーク・クローネ=17.04円、1ノルウェー・クローネ=12.22円、1スウェーデン・クローナ=12.56円、1メキシコ・ペソ=5.20円、1アルゼンチン・ペソ=1.22円、100コロンビア・ペソ=2.97円、100インドネシア・ルピア=0.74円、1ブラジル・リアル=18.93円、1チェコ・コルナ=4.83円、100韓国・ウォン=9.50円、1マレーシア・リンギット=25.70円、1南アフリカ・ランド=6.71円、1タイ・バーツ=3.45円、1ポーランド・ズロチ=27.99円、100ハンガリー・フォリント=35.06円、1ユーロ=126.73円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年8月11日)、(2020年9月10日)、(2020年10月12日)、(2020年11月10日)、(2020年12月10日)、(2021年1月12日)現在

項 目	第162期末	第163期末	第164期末	第165期末	第166期末	第167期末
(A)資 産	2,308,034,163円	2,283,052,893円	2,239,758,367円	2,240,950,194円	2,248,816,938円	2,242,086,502円
コーラル・ローン等	70,831,062	54,890,764	14,512,680	62,760,866	42,674,819	34,951,137
ルーミス・グローバル債券マザーファンド(評価額)	2,237,203,101	2,228,162,129	2,225,245,687	2,178,189,328	2,206,142,119	2,207,135,365
(B)負 債	12,309,029	8,678,865	6,963,621	6,602,729	7,009,763	8,210,066
未払収益分配金	3,765,810	3,756,836	3,703,911	3,695,895	3,673,027	3,669,905
未払解約金	5,227,592	1,813,500	-	-	306,000	1,189,235
未払信託報酬	3,308,275	3,101,639	3,252,525	2,900,487	3,024,119	3,343,611
その他未払費用	7,352	6,890	7,185	6,347	6,617	7,315
(C)純資産総額(A-B)	2,295,725,134	2,274,374,028	2,232,794,746	2,234,347,465	2,241,807,175	2,233,876,436
元 本	3,765,810,193	3,756,836,624	3,703,911,739	3,695,895,950	3,673,027,380	3,669,905,971
次期繰越損益金	△1,470,085,059	△1,482,462,596	△1,471,116,993	△1,461,548,485	△1,431,220,205	△1,436,029,535
(D)受益権総口数	3,765,810,193口	3,756,836,624口	3,703,911,739口	3,695,895,950口	3,673,027,380口	3,669,905,971口
1万口当たり基準価額(C/D)	6,096円	6,054円	6,028円	6,045円	6,103円	6,087円

(注) 第161期末における元本額は3,809,854,168円、当作成期間(第162期～第167期)中における追加設定元本額は2,587,081円、同解約元本額は142,535,278円です。

■損益の状況

[自 2020年7月11日] [自 2020年8月12日] [自 2020年9月11日] [自 2020年10月13日] [自 2020年11月11日] [自 2020年12月11日]
 [至 2020年8月11日] [至 2020年9月10日] [至 2020年10月12日] [至 2020年11月10日] [至 2020年12月10日] [至 2021年1月12日]

項 目	第162期	第163期	第164期	第165期	第166期	第167期
(A)配 当 等 収 益	△1,200円	△2,899円	△1,693円	△1,113円	△1,474円	△798円
受 取 利 息	5	2	20	-	3	-
支 払 利 息	△1,205	△2,901	△1,713	△1,113	△1,477	△798
(B)有価証券売買損益	53,911,974	△9,012,363	△2,573,061	12,988,701	27,990,096	996,034
売 買 益	54,215,709	25,735	312,869	12,985,505	28,003,995	995,575
売 買 損	△303,735	△9,038,098	△2,885,930	3,196	△13,899	459
(C)信 託 報 酬 等	△3,315,627	△3,108,529	△3,259,710	△2,906,834	△3,030,736	△3,350,926
(D)当期損益金(A + B + C)	50,595,147	△12,123,791	△5,834,464	10,080,754	24,957,886	△2,355,690
(E)前期繰越損益金	△1,264,711,511	△1,214,842,488	△1,213,246,631	△1,219,996,356	△1,205,961,303	△1,183,531,578
(F)追加信託差損益金	△252,202,885	△251,739,481	△248,331,987	△247,936,988	△246,543,761	△246,472,362
(配当等相当額)	(35,225,671)	(35,147,660)	(34,658,187)	(34,588,693)	(34,380,077)	(34,356,328)
(売買損益相当額)	(△287,428,556)	(△286,887,141)	(△282,990,174)	(△282,525,681)	(△280,923,838)	(△280,828,690)
(G)合 計(D + E + F)	△1,466,319,249	△1,478,705,760	△1,467,413,082	△1,457,852,590	△1,427,547,178	△1,432,359,630
(H)収 益 分 配 金	△3,765,810	△3,756,836	△3,703,911	△3,695,895	△3,673,027	△3,669,905
次期繰越損益金(G + H)	△1,470,085,059	△1,482,462,596	△1,471,116,993	△1,461,548,485	△1,431,220,205	△1,436,029,535
追加信託差損益金	△252,202,885	△251,739,481	△248,331,987	△247,936,988	△246,543,761	△246,472,362
(配当等相当額)	(35,226,086)	(35,148,045)	(34,658,547)	(34,589,011)	(34,380,430)	(34,356,664)
(売買損益相当額)	(△287,428,971)	(△286,887,526)	(△282,990,534)	(△282,525,999)	(△280,924,191)	(△280,829,026)
分配準備積立金	48,834,377	46,844,127	44,233,698	43,833,549	43,879,495	41,537,895
繰 越 損 益 金	△1,266,716,551	△1,277,567,242	△1,267,018,704	△1,257,445,046	△1,228,555,939	△1,231,095,068

(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162期から第167期まではルミス・グローバル債券マザーファンド5,630,269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162期	第163期	第164期	第165期	第166期	第167期
(a)経費控除後の配当等収益	5,100,666円	1,888,470円	1,758,679円	3,396,625円	3,995,285円	1,370,711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	35,226,086	35,148,045	34,658,547	34,589,011	34,380,430	34,356,664
(d)分 配 準 備 積 立 金	47,499,521	48,712,493	46,178,930	44,132,819	43,557,237	43,837,089
(e)当期分配対象額(a+b+c+d)	87,826,273	85,749,008	82,596,156	82,118,455	81,932,952	79,564,464
(f)1万円当たり当期分配対象額	233.22	228.25	223.00	222.19	223.07	216.80
(g)分 配 金	3,765,810	3,756,836	3,703,911	3,695,895	3,673,027	3,669,905
(h)1万円当たり分配金	10	10	10	10	10	10

■分配金のお知らせ

決算期	第162期	第163期	第164期	第165期	第166期	第167期
1万口当たり分配金	10円	10円	10円	10円	10円	10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・グローバル債券マザーファンド

運用報告書

第28期（決算日 2021年1月12日）

（計算期間 2020年7月11日～2021年1月12日）

ルーミス・グローバル債券マザーファンドの第28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	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産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	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	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	券利率	純資産額
	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	（円）		（％）	（％）	（％）	（％）					
24期（2019年1月10日）	円	△2.6	255.72	△2.3	円	2.71	△0.15	0.28	△0.02	97.6	—	—	2,379	
25期（2019年7月10日）	13,355	5.5	269.62	5.4	108.19	2.06	△0.65	△0.35	△0.63	96.8	—	—	2,385	
26期（2020年1月10日）	14,083	2.6	277.09	2.8	109.57	1.82	△0.24	△0.20	0.16	97.8	—	—	2,336	
27期（2020年7月10日）	14,454	3.6	283.78	2.4	107.13	0.65	△1.18	△0.47	△0.27	96.7	—	—	2,232	
28期（2021年1月12日）	14,977	3.9	288.24	1.6	104.23	1.13	0.48	△0.47	△0.00	96.8	—	—	2,207	

（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・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）。

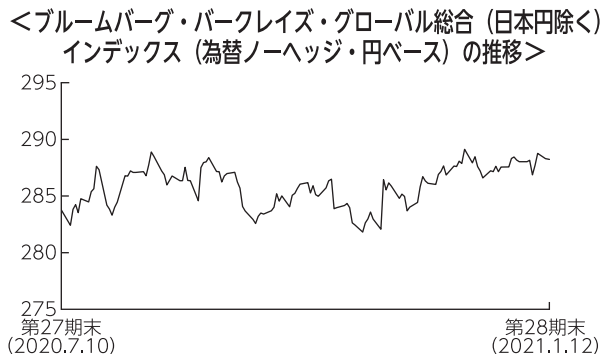
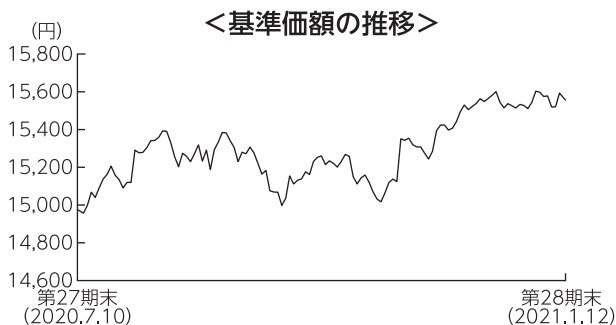
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基準価額		ブルームバーグ・バークレイズ・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		債券 組入比率	債券 先物比率
	騰落率		(為替ノヘッジ・円ベース) (参考指数)	騰落率		騰落幅	騰落幅				
(期首) 2020年7月10日	円	%		%	円	%	%	%	%	%	%
	14,977	—	283.78	—	107.13	0.65	—	△0.47	—	96.7	—
7月末	15,120	1.0	284.46	0.2	104.60	0.53	△0.12	△0.52	△0.06	97.7	—
8月末	15,188	1.4	284.57	0.3	105.36	0.71	0.06	△0.40	0.07	96.6	—
9月末	15,154	1.2	285.20	0.5	105.80	0.69	0.04	△0.52	△0.06	96.9	—
10月末	15,032	0.4	282.45	△0.5	104.60	0.88	0.23	△0.63	△0.16	97.1	—
11月末	15,407	2.9	286.02	0.8	103.89	0.84	0.20	△0.57	△0.11	97.1	—
12月末	15,598	4.1	288.44	1.6	103.50	0.93	0.28	△0.57	△0.10	97.1	—
(期末) 2021年1月12日	15,555	3.9	288.24	1.6	104.23	1.13	0.48	△0.47	△0.00	96.8	—

(注1) 騰落率および騰落幅は期首比です。

(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7月11日から2021年1月12日まで）



基準価額の推移

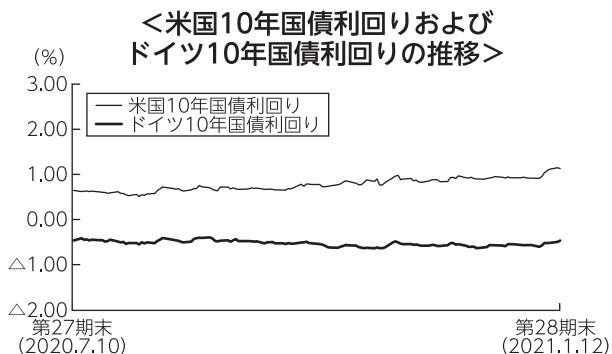
当ファンドの基準価額は、前期末比で3.9%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

日本を除く世界各国の公社債へ投資を行った結果、保有する普通社債の価格が上昇（利回りは低下）したことなどから、基準価額は上昇しました。

投資環境

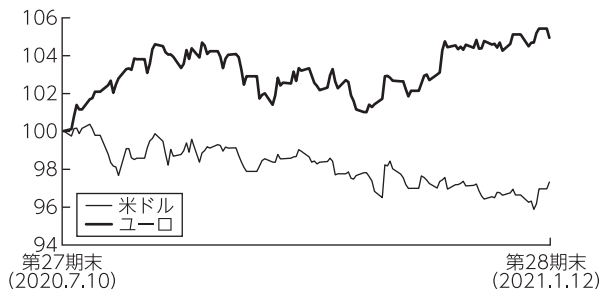
●海外債券市場と為替市場



米国国債市場は、米国債の需給悪化懸念や追加経済対策への進展期待、新型コロナウイルスのワクチン開発・実用化期待を背景にリスク選好姿勢が高まったことなどから下落（利回りは上昇）しました。ドイツ国債市場は、欧州での感染再拡大に伴う景気の先行き懸念などから上昇しました。投資適格社債市場は、米国、欧州ともに上昇しました。信用スプレッドは、米国、欧州ともに全般的に縮小しました。

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。

<米ドルおよびユーロの推移>



(注) 期首の値を100として指数化しています。

為替市場 (対円) は、米ドルは下落し、ユーロは上昇しました。米ドルは、F R B (米連邦準備制度理事会) が低金利政策の継続を示唆したことなどが下落要因となりました。ユーロは、欧州各国首脳が経済立て直しに向けた財政政策で合意したことや、ユーロ圏経済指標の改善などが上昇要因となりました。

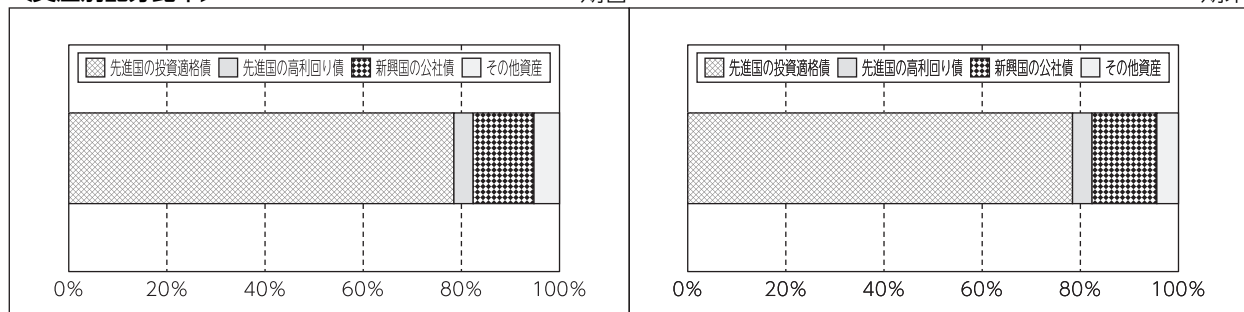
ポートフォリオについて

資産配分比率は、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%) より低めとしました。投資通貨は、米ドル、ユーロを中心とし、英ポンド、カナダドルなどへの配分を維持しました。また、修正デュレーションは短期化しました。上記の通り運用を行った結果、保有する普通社債の価格が上昇したことから基準価額は上昇しました。

〔資産別配分比率〕

期首

期末



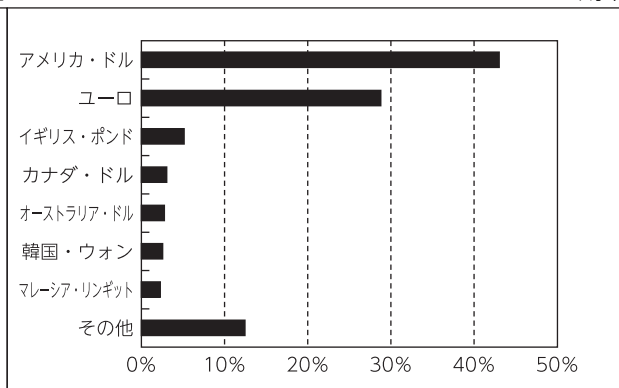
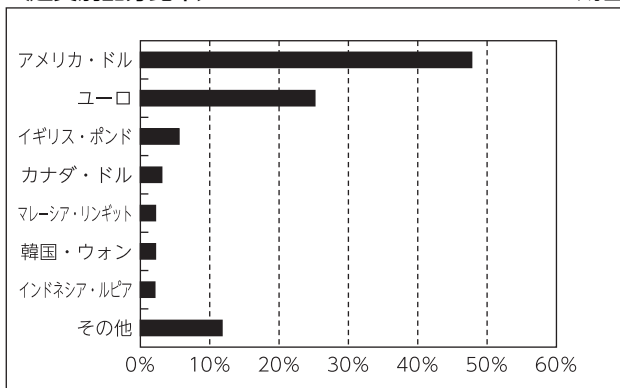
(注1) 上記比率は、ルミス・グローバル債券マザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。

(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〕

期首

期末

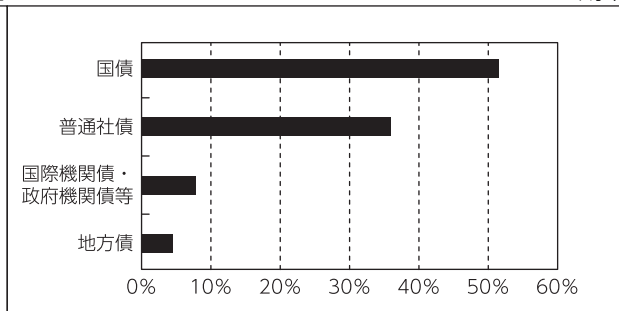
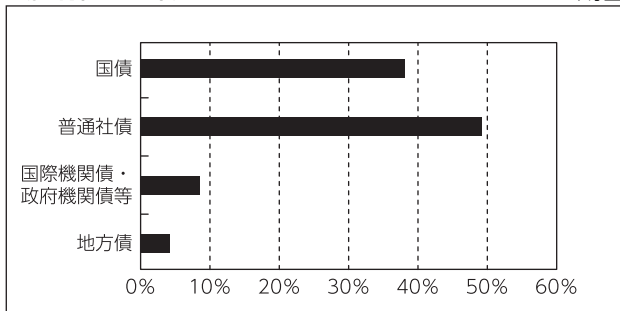


(注) 上記比率は、ルーミス・グローバル債券マザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。

〔種別組入比率〕

期首

期末

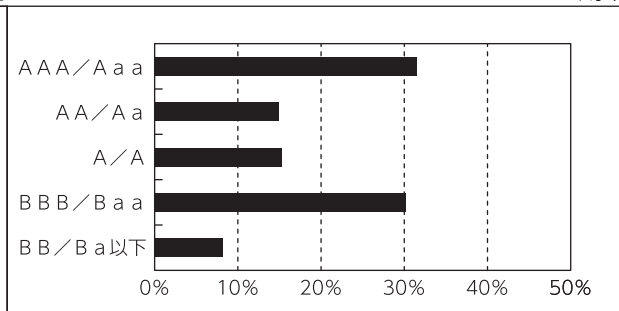
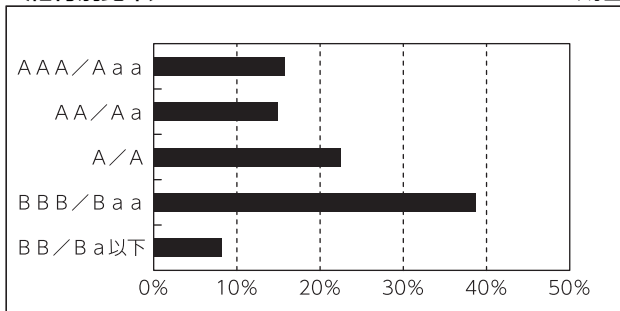


(注) 上記比率は、ルーミス・グローバル債券マザーファンドの債券部分に対する評価額の割合です。

〔格付別比率〕

期首

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に対する評価額の割合です。

(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。

今後の運用方針

米国とドイツの国債利回りについては、新型コロナウイルスの感染拡大に伴う世界景気への影響やワクチン普及への期待、各国の財政動向などが意識される中、短期的にはそれらの動向に左右される展開を予想します。債券種別配分については、引き続き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。

■ 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)	5円	0.035%	(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)	(5)	(0.033)	
合計	(0)	(0.002)	
合計	5	0.035	
期中の平均基準価額は15,294円です。			

(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7月11日から2021年1月12日まで)

公社債

			買付額	売付額	
外	アメリカ	国債証券	千アメリカ・ドル 4,033	千アメリカ・ドル 3,050 (-)	
		地方債証券	24	- (-)	
		特殊債証券	-	35 (-)	
		社債証券	1,045	2,957 (7)	
国	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 253	千カナダ・ドル 280 (-)	
		地方債証券	千オーストラリア・ドル 145	千オーストラリア・ドル - (-)	
国	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 263	千シンガポール・ドル - (-)	
		イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド -	千イギリス・ポンド 98 (-)
			社債証券	-	- (20)

			買付額	売付額	
外 国	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ -	千ノルウェー・クローネ 968 (-)	
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 910	千スウェーデン・クローナ -	
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 2,045	千メキシコ・ペソ 3,310 (-)	
	コロンビア	国債証券	千コロンビア・ペソ -	千コロンビア・ペソ 299,169 (-)	
	チエコ	国債証券	千チエコ・コルナ 3,017	千チエコ・コルナ -	
	韓国	国債証券	千韓国・ウォン 56,923	千韓国・ウォン -	
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ -	千ポーランド・ズロチ 603 (-)	
	ユ ー ロ 国	アイルランド	社債証券	千ユーロ 114	千ユーロ -
			特殊債証券	-	151 (-)
		オランダ	社債証券	121	- (-)
			社債証券	-	115 (-)
		フランス	国債証券	-	59 (-)
			社債証券	-	200 (-)
		ドイツ	国債証券	2,445	905 (-)
社債証券			34	187 (-)	
スペイン		国債証券	-	185 (-)	
		社債証券	95	201 (-)	

				買 付 額	売 付 額
外 国	ユ ー ロ	イ タ リ ア	国 債 証 券	千ユーロ —	千ユーロ 31 (—)
			社 債 券	—	201 (—)
		カ ナ ダ	地 方 債 証 券	—	104 (—)
		ア メ リ カ	社 債 券	—	300 (—)

(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7月11日から2021年1月12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	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	
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 8,189	千アメリカ・ドル 8,787	千円 915,936	% 41.5	% 5.8	% 23.9	% 6.8	% 10.8	
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 735	千カナダ・ドル 797	千円 65,010	2.9	—	1.6	0.7	0.7	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 655	千オーストラリア・ドル 750	千円 60,309	2.7	—	2.7	—	—	
シンガポール	千シンガポール・ドル 420	千シンガポール・ドル 482	千円 37,811	1.7	—	1.3	0.4	—	
ニュージーランド	千ニューージーランド・ドル 45	千ニューージーランド・ドル 50	千円 3,759	0.2	—	—	0.2	—	
イギリス	千イギリス・ポンド 535	千イギリス・ポンド 726	千円 102,389	4.6	—	3.6	1.0	—	
スイス	千スイス・フラン 155	千スイス・フラン 162	千円 19,045	0.9	—	—	0.9	—	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 1,395	千デンマーク・クローネ 1,555	千円 26,501	1.2	—	—	1.2	—	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 1,080	千ノルウェー・クローネ 1,122	千円 13,713	0.6	—	—	0.6	—	
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 1,800	千スウェーデン・クローナ 1,894	千円 23,797	1.1	—	—	1.1	—	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 4,505	千メキシコ・ペソ 5,273	千円 27,421	1.2	—	0.8	0.4	—	
コロンビア	千コロンビア・ペソ 393,800	千コロンビア・ペソ 455,593	千円 13,531	0.6	—	0.6	—	—	
インドネシア	千インドネシア・ルピア 5,900,000	千インドネシア・ルピア 6,623,450	千円 49,013	2.2	—	1.9	—	0.3	
ブラジル	千ブラジル・レアル 963	千ブラジル・レアル 1,076	千円 20,383	0.9	0.9	0.5	0.4	—	
チェコ	千チェコ・コルナ 2,770	千チェコ・コルナ 2,979	千円 14,392	0.7	—	—	0.7	—	
韓国	千韓国・ウォン 596,000	千韓国・ウォン 593,497	千円 56,382	2.6	—	1.0	1.2	0.3	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 1,785	千マレーシア・リンギット 1,913	千円 49,189	2.2	—	1.8	—	0.4	
タイ	千タイ・バーツ 2,295	千タイ・バーツ 2,371	千円 8,180	0.4	—	0.4	—	—	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 145	千ポーランド・ズロチ 160	千円 4,490	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
	千 ー ー ー	千 ー ー ー	千 円	%	%	%	%	%
ユ ー ー ー								
ジャージー	100	107	13,646	0.6	—	0.6	—	—
イギリス	100	99	12,588	0.6	—	0.6	—	—
アイルランド	115	123	15,628	0.7	—	0.7	—	—
オランダ	215	230	29,183	1.3	—	1.3	—	—
ベルギー	100	104	13,283	0.6	—	—	0.6	—
フランス	170	262	33,279	1.5	—	1.5	—	—
ドイツ	1,945	2,052	260,158	11.8	0.7	4.5	5.4	2.0
スペイン	405	494	62,691	2.8	—	2.8	—	—
イタリア	710	766	97,195	4.4	—	4.4	—	—
フィンランド	100	104	13,274	0.6	0.6	—	0.6	—
ハンガリー	65	71	9,066	0.4	—	0.4	—	—
カナダ	265	277	35,116	1.6	—	—	1.6	—
アメリカ	100	107	13,684	0.6	—	0.6	—	—
ケイマン諸島	115	130	16,544	0.7	—	0.7	—	—
合 計	—	—	千円 2,136,602	96.8	8.0	58.7	23.7	14.4

(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、B B 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	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		
		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
BRAZIL 4.625 01/13/28	国債証券	4.6250	200	221	23,059	2028/01/13	
US T N/B 1.375 01/31/21	国債証券	1.3750	505	505	52,669	2021/01/31	
REPUBLIC OF CHILE 2.45 01/31/31	国債証券	2.4500	200	210	21,919	2031/01/31	
US T N/B 1.125 02/28/21	国債証券	1.1250	410	410	42,791	2021/02/28	
US T N/B 0.125 08/31/22	国債証券	0.1250	950	949	98,999	2022/08/31	
IL ST TXB-PENSION 5.1 06/01/33	地方債証券	5.1000	25	27	2,836	2033/06/01	
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR 3.375 02/05/30	特殊債券	3.3750	210	219	22,886	2030/02/05	
SP POWERASSETS LTD 2.7 09/14/22	特殊債券	2.7000	200	206	21,555	2022/09/14	
ENTERPRISE PRODUCTS OPER 3.95 01/31/60	社債証券	3.9500	35	37	3,869	2060/01/31	
JPMORGAN CHASE & CO 3.2 01/25/23	社債証券	3.2000	180	190	19,833	2023/01/25	
UNITED AIR 2016-1 B PTT 3.65 01/07/26	社債証券	3.6500	33	32	3,414	2026/01/07	
CITIGROUP INC 01/29/31	社債証券	2.6660	235	247	25,817	2031/01/29	
QUICKEN LOANS INC 5.25 01/15/28	社債証券	5.2500	15	15	1,662	2028/01/15	
AMERICAN TOWER CORP 2.9 01/15/30	社債証券	2.9000	85	90	9,483	2030/01/15	

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	
COCA-COLA FEMSA SAB CV 2.75 01/22/30	社 債 券	2.7500	150	160	16,678	2030/01/22
SUZANO AUSTRIA GMBH 3.75 01/15/31	社 債 券	3.7500	40	42	4,436	2031/01/15
WEA FINANCE LLC 2.875 01/15/27	社 債 券	2.8750	65	66	6,918	2027/01/15
ITAU UNIBANCO HLDG SA/KY 2.9 01/24/23	社 債 券	2.9000	200	205	21,382	2023/01/24
BANCO BRADESCO (CAYMAN) 2.85 01/27/23	社 債 券	2.8500	200	204	21,351	2023/01/27
T-MOBILE USA INC 3.3 02/15/51	社 債 券	3.3000	15	14	1,525	2051/02/15
TOLL BROS FINANCE CORP 4.35 02/15/28	社 債 券	4.3500	85	94	9,821	2028/02/15
ANHEUSER-BUSCH CO/INBEV 4.7 02/01/36	社 債 券	4.7000	50	62	6,483	2036/02/01
ALTRIA GROUP INC 4.8 02/14/29	社 債 券	4.8000	55	65	6,788	2029/02/14
COMCAST CORP 1.5 02/15/31	社 債 券	1.5000	170	164	17,161	2031/02/15
T-MOBILE USA INC 4.75 02/01/28	社 債 券	4.7500	90	96	10,025	2028/02/01
EMBRAER NETHERLANDS FINA 5.4 02/01/27	社 債 券	5.4000	10	10	1,106	2027/02/01
BOEING CO 3.75 02/01/50	社 債 券	3.7500	15	14	1,541	2050/02/01
VALVOLINE INC 4.25 02/15/30	社 債 券	4.2500	15	15	1,647	2030/02/15
BOEING CO 3.25 02/01/28	社 債 券	3.2500	80	84	8,834	2028/02/01
CENTENE CORP 3.375 02/15/30	社 債 券	3.3750	75	78	8,210	2030/02/15
BOEING CO 3.825 03/01/59	社 債 券	3.8250	10	9	1,001	2059/03/01
COMCAST CORP 4.0 03/01/48	社 債 券	4.0000	15	17	1,871	2048/03/01
CHARTER COMM OPT LLC/CAP 4.8 03/01/50	社 債 券	4.8000	40	45	4,758	2050/03/01
ENERGY TRANSFER OPERATING 5.15 03/15/45	社 債 券	5.1500	45	47	4,905	2045/03/15
CITIGROUP INC 03/31/31	社 債 券	4.4120	60	71	7,428	2031/03/31
QUICKEN LOANS LLC/QUICKN 3.875 03/01/31	社 債 券	3.8750	70	71	7,492	2031/03/01
FREEMPORT-MCMORAN INC 4.25 03/01/30	社 債 券	4.2500	30	32	3,387	2030/03/01
QUICKEN LOANS LLC/QUICKN 3.625 03/01/29	社 債 券	3.6250	20	20	2,109	2029/03/01
FREEMPORT-MCMORAN INC 4.125 03/01/28	社 債 券	4.1250	20	21	2,190	2028/03/01
ALLY FINANCIAL INC 4.625 03/30/25	社 債 券	4.6250	15	17	1,777	2025/03/30
AMERICAN TOWER CORP 2.4 03/15/25	社 債 券	2.4000	100	105	10,980	2025/03/15
CHARTER COMM OPT LLC/CAP 3.7 04/01/51	社 債 券	3.7000	65	64	6,760	2051/04/01
AMERICA MOVIL SAB DE CV 3.625 04/22/29	社 債 券	3.6250	200	223	23,342	2029/04/22
BANK OF AMERICA CORP 04/29/31	社 債 券	2.5920	35	36	3,825	2031/04/29
T-MOBILE USA INC 4.375 04/15/40	社 債 券	4.3750	50	58	6,136	2040/04/15
AEP TRANSMISSION CO LLC 3.65 04/01/50	社 債 券	3.6500	15	17	1,804	2050/04/01
DOMINION ENERGY INC 3.375 04/01/30	社 債 券	3.3750	35	39	4,103	2030/04/01
T-MOBILE USA INC 3.875 04/15/30	社 債 券	3.8750	135	152	15,879	2030/04/15
BROADCOM INC 4.25 04/15/26	社 債 券	4.2500	105	118	12,388	2026/04/15
BROADCOM INC 5.0 04/15/30	社 債 券	5.0000	70	83	8,686	2030/04/15
GENERAL ELECTRIC CO 4.25 05/01/40	社 債 券	4.2500	25	28	3,010	2040/05/01
KEURIG DR PEPPER INC 3.8 05/01/50	社 債 券	3.8000	40	46	4,823	2050/05/01
NEW YORK LIFE INSURANCE 3.75 05/15/50	社 債 券	3.7500	50	57	5,970	2050/05/15
GENERAL ELECTRIC CO 4.35 05/01/50	社 債 券	4.3500	70	81	8,528	2050/05/01
CONSTELLATION BRANDS INC 3.75 05/01/50	社 債 券	3.7500	15	17	1,780	2050/05/01
UNITEDHEALTH GROUP INC 2.9 05/15/50	社 債 券	2.9000	10	10	1,091	2050/05/15
NISOURCE INC 3.6 05/01/30	社 債 券	3.6000	20	22	2,370	2030/05/01
TENET HEALTHCARE CORP 5.125 05/01/25	社 債 券	5.1250	65	66	6,894	2025/05/01
IPALCO ENTERPRISES INC 4.25 05/01/30	社 債 券	4.2500	30	34	3,566	2030/05/01
ALLY FINANCIAL INC 3.875 05/21/24	社 債 券	3.8750	5	5	570	2024/05/21
BOEING CO 3.1 05/01/26	社 債 券	3.1000	5	5	551	2026/05/01

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	
ALLY FINANCIAL INC 5.8 05/01/25	社 債 券	5.8000	15	17	1,857	2025/05/01
BOEING CO 2.25 06/15/26	社 債 券	2.2500	5	5	529	2026/06/15
FORD FOUNDATION/THE 3.859 06/01/47	社 債 券	3.8590	65	81	8,535	2047/06/01
AT&T 3.65 06/01/51	社 債 券	3.6500	115	113	11,828	2051/06/01
GREAT-WEST LIFECO FINANC 4.15 06/03/47	社 債 券	4.1500	45	55	5,744	2047/06/03
VODAFONE GROUP PLC 4.875 06/19/49	社 債 券	4.8750	30	38	4,005	2049/06/19
ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR 4.5 06/01/50	社 債 券	4.5000	50	60	6,333	2050/06/01
NOKIA OYJ 4.375 06/12/27	社 債 券	4.3750	45	49	5,136	2027/06/12
OWENS CORNING 3.875 06/01/30	社 債 券	3.8750	30	34	3,555	2030/06/01
GATX CORP 4.0 06/30/30	社 債 券	4.0000	20	23	2,431	2030/06/30
REGENCY CENTERS LP 3.7 06/15/30	社 債 券	3.7000	60	67	6,997	2030/06/15
NXP BV/NXP FDG/NXP USA 4.3 06/18/29	社 債 券	4.3000	65	76	7,940	2029/06/18
EMBRAER NETHERLANDS FINA 5.05 06/15/25	社 債 券	5.0500	85	89	9,375	2025/06/15
DELTA AIRLINES 2015B 4.25 07/30/23	社 債 券	4.2500	43	44	4,610	2023/07/30
CROWN CASTLE INTL CORP 4.15 07/01/50	社 債 券	4.1500	10	11	1,202	2050/07/01
AES CORP/THE 3.95 07/15/30	社 債 券	3.9500	15	16	1,751	2030/07/15
DELL INT LLC / EMC CORP 6.2 07/15/30	社 債 券	6.2000	55	70	7,359	2030/07/15
BOEING CO 3.95 08/01/59	社 債 券	3.9500	20	19	2,063	2059/08/01
CONSTELLATION BRANDS INC 3.15 08/01/29	社 債 券	3.1500	100	109	11,461	2029/08/01
CVS HEALTH CORP 3.25 08/15/29	社 債 券	3.2500	30	33	3,465	2029/08/15
BANK OF AMERICA CORP 4.2 08/26/24	社 債 券	4.2000	245	273	28,557	2024/08/26
VODAFONE GROUP PLC 4.25 09/17/50	社 債 券	4.2500	35	41	4,352	2050/09/17
AT&T 3.5 09/15/53	社 債 券	3.5000	2	1	195	2053/09/15
AT&T 3.65 09/15/59	社 債 券	3.6500	9	8	883	2059/09/15
MCDONALD'S CORP 3.625 09/01/49	社 債 券	3.6250	35	39	4,083	2049/09/01
ENEL FINANCE INTL NV 6.8 09/15/37	社 債 券	6.8000	155	225	23,490	2037/09/15
BANCO SANTANDER CHILE 3.875 09/20/22	社 債 券	3.8750	200	212	22,120	2022/09/20
FREEPORT-MCMORAN INC 5.0 09/01/27	社 債 券	5.0000	5	5	547	2027/09/01
UNITED AIR 2016-2 B PTT 3.65 10/07/25	社 債 券	3.6500	63	61	6,427	2025/10/07
CENTENE CORP 3.0 10/15/30	社 債 券	3.0000	75	78	8,191	2030/10/15
DELL INT LLC / EMC CORP 5.3 10/01/29	社 債 券	5.3000	15	18	1,887	2029/10/01
SANTANDER HOLDINGS USA 3.244 10/05/26	社 債 券	3.2440	20	21	2,256	2026/10/05
GENERAL MOTORS CO 6.125 10/01/25	社 債 券	6.1250	105	126	13,203	2025/10/01
BROADCOM INC 4.3 11/15/32	社 債 券	4.3000	30	34	3,631	2032/11/15
BOEING CO 3.85 11/01/48	社 債 券	3.8500	5	5	525	2048/11/01
NUTRITION & BIOSCIENCES 3.468 12/01/50	社 債 券	3.4680	10	10	1,102	2050/12/01
AT&T 3.8 12/01/57	社 債 券	3.8000	14	13	1,421	2057/12/01
DIAMONDBACK ENERGY INC 3.5 12/01/29	社 債 券	3.5000	75	80	8,368	2029/12/01
CENTENE CORP 4.625 12/15/29	社 債 券	4.6250	120	132	13,797	2029/12/15
小 計	-	-	8,189	8,787	915,936	-
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 2.25 06/01/29	国 債 証 券	2.2500	170	191	15,595	2029/06/01
CANADA 2.0 12/01/51	国 債 証 券	2.0000	205	233	19,055	2051/12/01
IBRD 2.2 01/18/22	特 殊 債 券	2.2000	180	183	14,986	2022/01/18
PSP CAPITAL INC 2.09 11/22/23	特 殊 債 券	2.0900	180	188	15,372	2023/11/22
小 計	-	-	735	797	65,010	-

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	
(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	千円	
NEW S WALES TREASURY CRP 3.0 02/20/30	地方債証券	3.0000	125	144	11,586	2030/02/20
NEW S WALES TREASURY CRP 4.0 05/20/26	地方債証券	4.0000	140	165	13,292	2026/05/20
QUEENSLAND 2.75 08/20/27	地方債証券	2.7500	390	441	35,430	2027/08/20
小 計	-	-	655	750	60,309	-
(シンガポール)		%	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円	
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国債証券	3.5000	310	362	28,372	2027/03/01
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国債証券	3.0000	110	120	9,439	2024/09/01
小 計	-	-	420	482	37,811	-
(ニュージーランド)		%	千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル	千円	
NEW ZEALAND 5.5 04/15/23	国債証券	5.5000	45	50	3,759	2023/04/15
小 計	-	-	45	50	3,759	-
(イギリス)		%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	国債証券	3.2500	300	449	63,286	2044/01/22
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国債証券	5.0000	130	157	22,178	2025/03/07
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国債証券	1.5000	105	120	16,924	2047/07/22
小 計	-	-	535	726	102,389	-
(スイス)		%	千スイス・フラン	千スイス・フラン	千円	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 1.0 11/24/25	社債証券	1.0000	155	162	19,045	2025/11/24
小 計	-	-	155	162	19,045	-
(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	千円	
DENMARK 1.75 11/15/25	国債証券	1.7500	1,395	1,555	26,501	2025/11/15
小 計	-	-	1,395	1,555	26,501	-
(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	千円	
NORWAY 2.0 05/24/23	国債証券	2.0000	1,080	1,122	13,713	2023/05/24
小 計	-	-	1,080	1,122	13,713	-
(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	千円	
SWEDEN 1.5 11/13/23	国債証券	1.5000	1,800	1,894	23,797	2023/11/13
小 計	-	-	1,800	1,894	23,797	-
(メキシコ)		%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円	
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	2,815	3,413	17,750	2029/05/31
MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	国債証券	8.0000	1,690	1,859	9,670	2023/12/07
小 計	-	-	4,505	5,273	27,421	-
(コロンビア)		%	千コロンビア・ペソ	千コロンビア・ペソ	千円	
TITULOS DE TESORERIA 7.5 08/26/26	国債証券	7.5000	393,800	455,593	13,531	2026/08/26
小 計	-	-	393,800	455,593	13,531	-
(インドネシア)		%	千インドネシア・ルピア	千インドネシア・ルピア	千円	
INDONESIA GOV'T 8.25 05/15/29	国債証券	8.2500	5,100,000	5,801,250	42,929	2029/05/15
IBRD 8.4 10/12/21	特殊債証券	8.4000	800,000	822,200	6,084	2021/10/12
小 計	-	-	5,900,000	6,623,450	49,013	-
(ブラジル)		%	千ブラジル・レアル	千ブラジル・レアル	千円	
BRAZIL NTN 01/01/27	国債証券	10.0000	280	318	6,038	2027/01/01
BRAZIL NTN 01/01/29	国債証券	10.0000	233	268	5,076	2029/01/01
BRAZIL 8.5 01/05/24	国債証券	8.5000	450	489	9,268	2024/01/05
小 計	-	-	963	1,076	20,383	-

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	
(チェコ)		%	千チェコ・コルナ	千チェコ・コルナ	千円	
CZECH REPUBLIC 2.4 09/17/25	国債証券	2.4000	2,770	2,979	14,392	2025/09/17
小 計	-	-	2,770	2,979	14,392	-
(韓国)		%	千韓国・ウォン	千韓国・ウォン	千円	
KOREA TREASURY BOND 1.5 03/10/25	国債証券	1.5000	270,000	272,965	25,931	2025/03/10
KOREA TREASURY BOND 2.0 12/10/21	国債証券	2.0000	76,000	76,943	7,309	2021/12/10
KOREA TREASURY BOND 1.375 12/10/29	国債証券	1.3750	250,000	243,588	23,140	2029/12/10
小 計	-	-	596,000	593,497	56,382	-
(マレーシア)		%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
MALAYSIA 3.892 03/15/27	国債証券	3.8920	630	681	17,521	2027/03/15
MALAYSIA 3.906 07/15/26	国債証券	3.9060	825	891	22,901	2026/07/15
MALAYSIA 3.795 09/30/22	国債証券	3.7950	330	341	8,765	2022/09/30
小 計	-	-	1,785	1,913	49,189	-
(タイ)		%	千タイ・バーツ	千タイ・バーツ	千円	
THAILAND 1.6 12/17/29	国債証券	1.6000	2,295	2,371	8,180	2029/12/17
小 計	-	-	2,295	2,371	8,180	-
(ポーランド)		%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	145	160	4,490	2026/07/25
小 計	-	-	145	160	4,490	-
(ユーロ…ジャージー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
HEATHROW FUNDING LTD 1.875 03/14/34	社債券	1.8750	100	107	13,646	2034/03/14
小 計	-	-	100	107	13,646	-
(ユーロ…イギリス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
CHANNEL LINK 06/30/50	特殊債券	1.7610	100	99	12,588	2050/06/30
小 計	-	-	100	99	12,588	-
(ユーロ…アイルランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
AIB GROUP PLC 05/30/31	社債券	2.8750	115	123	15,628	2031/05/30
小 計	-	-	115	123	15,628	-
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
COOPERATIEVE RABOBANK UA 0.0 06/21/27	特殊債券	0.0000	100	102	12,997	2027/06/21
UPJOHN FINANCE BV 1.908 06/23/32	社債券	1.9080	115	127	16,186	2032/06/23
小 計	-	-	215	230	29,183	-
(ユーロ…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ING BELGIUM SA 0.625 05/30/25	特殊債券	0.6250	100	104	13,283	2025/05/30
小 計	-	-	100	104	13,283	-
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	4.5000	100	188	23,878	2041/04/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	0.5000	70	74	9,401	2026/05/25
小 計	-	-	170	262	33,279	-
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	国債証券	0.5000	625	657	83,279	2025/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	国債証券	0.0000	430	452	57,321	2030/02/15
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	国債証券	1.7500	330	341	43,337	2022/07/04
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	170	178	22,659	2030/08/15

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	
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
COMMERZBANK AG 0.625 05/28/25	特 殊 債 券	0.6250	70	73	9,296	2025/05/28
KFW 0.25 09/15/25	特 殊 債 券	0.2500	195	202	25,700	2025/09/15
VOLKSWAGEN FIN SERV AG 3.375 04/06/28	社 債 券	3.3750	20	24	3,064	2028/04/06
DEUTSCHE BANK AG 05/19/31	社 債 券	5.6250	100	116	14,760	2031/05/19
DEUTSCHE TELEKOM AG 1.75 12/09/49	社 債 券	1.7500	5	5	737	2049/12/09
小 計	—	—	1,945	2,052	260,158	—
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 4.2 01/31/37	国 債 証 券	4.2000	120	190	24,186	2037/01/31
SPAIN 1.95 07/30/30	国 債 証 券	1.9500	85	100	12,758	2030/07/30
BANCO SANTANDER SA 0.1 02/27/32	特 殊 債 券	0.1000	100	102	13,014	2032/02/27
BANCO BILBAO VIZCAYA ARG 01/16/30	社 債 券	1.0000	100	100	12,731	2030/01/16
小 計	—	—	405	494	62,691	—
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	国 債 証 券	1.3500	710	766	97,195	2030/04/01
小 計	—	—	710	766	97,195	—
(ユーロ…フィンランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NOKIA OYJ 2.0 03/15/24	社 債 券	2.0000	100	104	13,274	2024/03/15
小 計	—	—	100	104	13,274	—
(ユーロ…ハンガリー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
HUNGARY 1.75 10/10/27	国 債 証 券	1.7500	65	71	9,066	2027/10/10
小 計	—	—	65	71	9,066	—
(ユーロ…カナダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
PROVINCE OF QUEBEC 0.875 01/15/25	地 方 債 証 券	0.8750	165	173	21,955	2025/01/15
PROVINCE OF ALBERTA 0.625 04/18/25	地 方 債 証 券	0.6250	100	103	13,160	2025/04/18
小 計	—	—	265	277	35,116	—
(ユーロ…アメリカ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
PROLOGIS EURO FINANCE 1.5 09/10/49	社 債 券	1.5000	100	107	13,684	2049/09/10
小 計	—	—	100	107	13,684	—
(ユーロ…ケイマン諸島)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
XLIT LTD 06/29/47	社 債 券	3.2500	115	130	16,544	2047/06/29
小 計	—	—	115	130	16,544	—
合 計	—	—	—	—	2,136,602	—

■投資信託財産の構成

2021年1月12日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 2,136,602	% 96.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	81,422	3.7
投 資 信 託 財 産 総 額	2,218,024	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、2,204,976千円、99.4%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、2021年1月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=104.23円、1カナダ・ドル=81.56円、1オーストラリア・ドル=80.34円、1シンガポール・ドル=78.36円、1ニュージーランド・ドル=74.76円、1イギリス・ポンド=140.94円、1スイス・フラン=117.09円、1トルコ・リラ=13.94円、1デンマーク・クローネ=17.04円、1ノルウェー・クローネ=12.22円、1スウェーデン・クローナ=12.56円、1メキシコ・ペソ=5.20円、1アルゼンチン・ペソ=1.22円、100コロンビア・ペソ=2.97円、100インドネシア・ルピア=0.74円、1ブラジル・リアル=18.93円、1チェコ・コルナ=4.83円、100韓国・ウォン=9.50円、1マレーシア・リングギット=25.70円、1南アフリカ・ランド=6.71円、1タイ・バーツ=3.45円、1ポーランド・ズロチ=27.99円、100ハンガリー・フォリント=35.06円、1ユーロ=126.73円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年1月12日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,218,024,966円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	56,478,692
公 社 債(評価額)	2,136,602,160
未 収 入 金	6,865,469
未 収 利 息	16,743,793
前 払 費 用	1,334,852
(B) 負 債	10,941,585
未 払 金	10,941,585
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	2,207,083,381
元 本	1,418,923,411
次 期 繰 越 損 益 金	788,159,970
(D) 受 益 権 総 口 数	1,418,923,411口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,555円

(注1) 期首元本額 1,490,945,944円
追加設定元本額 -円
一部解約元本額 72,022,533円

(注2) 期末における元本の内訳
ルミス・グローバル債券ファンド(毎月決算型) 1,418,923,411円
期末元本合計 1,418,923,411円

■損益の状況

当期 自2020年7月11日 至2021年1月12日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	29,239,370円
受 取 利 息	29,093,090
そ の 他 収 益 金	146,964
支 払 利 息	△684
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	55,659,192
売 買 益	103,268,640
売 買 損	△47,609,448
(C) そ の 他 費 用	△774,375
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	84,124,187
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	742,013,250
(F) 解 約 差 損 益 金	△37,977,467
(G) 合 計(D+E+F)	788,159,970
次 期 繰 越 損 益 金(G)	788,159,970

(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。