

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、BBB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168期	<決算日	2021年2月10日>
第169期	<決算日	2021年3月10日>
第170期	<決算日	2021年4月12日>
第171期	<決算日	2021年5月10日>
第172期	<決算日	2021年6月10日>
第173期	<決算日	2021年7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7月12日に第173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 騰落率		期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率						
第25作成期	144期(2019年2月12日)	円	円	%			円	%	%	%	%	%	%	%	%	百万円
	145期(2019年3月11日)	5,768	10	2.4	262.03	2.5	110.55	2.65	△0.06	0.12	△0.16	96.7	—	—	2,458	
	146期(2019年4月10日)	5,792	10	0.6	264.88	1.1	110.95	2.63	△0.03	0.07	△0.05	95.4	—	—	2,457	
	147期(2019年5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	
	148期(2019年6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	
第26作成期	149期(2019年7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	
	150期(2019年8月13日)	5,835	10	1.0	269.62	1.2	109.01	2.06	△0.02	△0.35	△0.10	94.9	—	—	2,434	
	151期(2019年9月10日)	5,695	10	△2.2	265.42	△1.6	105.43	1.71	△0.36	△0.61	△0.26	95.4	—	—	2,363	
	152期(2019年10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	
	153期(2019年11月11日)	5,783	10	△0.3	270.74	0.2	107.37	1.67	△0.06	△0.47	0.08	96.0	—	—	2,383	
第27作成期	154期(2019年12月10日)	5,817	10	0.8	272.94	0.8	109.16	1.94	0.27	△0.25	0.22	95.7	—	—	2,379	
	155期(2020年1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	
	156期(2020年2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	
	157期(2020年3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	
	158期(2020年4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	
第28作成期	159期(2020年5月11日)	5,715	10	0.7	275.69	1.1	108.61	0.72	△0.08	△0.35	0.44	95.7	—	—	2,278	
	160期(2020年6月10日)	5,640	10	△1.1	272.34	△1.2	106.95	0.71	△0.01	△0.51	△0.17	96.4	—	—	2,242	
	161期(2020年7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	
	162期(2020年8月11日)	5,972	10	0.3	283.78	0.6	107.13	0.65	△0.08	△0.47	△0.13	94.9	—	—	2,275	
	163期(2020年9月10日)	6,096	10	2.2	286.79	1.1	106.17	0.64	△0.00	△0.48	△0.01	94.2	—	—	2,295	
第29作成期	164期(2020年10月12日)	6,054	10	△0.5	286.78	△0.0	106.22	0.68	0.04	△0.43	0.05	95.2	—	—	2,274	
	165期(2020年11月10日)	6,028	10	△0.3	286.17	△0.2	105.66	0.78	0.10	△0.55	△0.11	96.5	—	—	2,232	
	166期(2020年12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	
	167期(2021年1月12日)	6,103	10	1.1	287.88	0.5	104.28	0.91	△0.05	△0.60	△0.12	95.6	—	—	2,241	
	168期(2021年2月10日)	6,087	10	△0.1	288.24	0.1	104.23	1.13	0.22	△0.47	0.14	95.6	—	—	2,233	
第30作成期	169期(2021年3月10日)	6,091	10	0.2	288.50	0.1	104.62	1.16	0.03	△0.45	0.02	96.8	—	—	2,221	
	170期(2021年4月12日)	6,115	10	0.6	293.28	1.7	108.57	1.53	0.37	△0.30	0.15	95.7	—	—	2,216	
	171期(2021年5月10日)	6,182	10	1.3	295.26	0.7	109.75	1.66	0.13	△0.30	△0.00	96.2	—	—	2,225	
	172期(2021年6月10日)	6,192	10	0.3	296.07	0.3	108.77	1.58	△0.08	△0.22	0.09	94.6	—	—	2,227	
	173期(2021年7月12日)	6,258	10	1.2	301.03	1.7	109.65	1.49	△0.09	△0.24	△0.03	95.3	—	—	2,231	
		6,211	10	△0.6	300.49	△0.2	110.17	1.36	△0.13	△0.29	△0.05	95.4	—	—	2,203	

(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 (海昔ノーハツジ・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						
第168期	(期首) 2021年1月12日	6,087	—	288.24	—	104.23	1.13	—	△0.47	—	95.6	—	—	—
	1月末	6,099	0.2	288.83	0.2	104.48	1.05	△0.08	△0.54	△0.07	96.9	—	—	—
	(期末) 2021年2月10日	6,101	0.2	288.50	0.1	104.62	1.16	0.03	△0.45	0.02	96.8	—	—	—
第169期	(期首) 2021年2月10日	6,091	—	288.50	—	104.62	1.16	—	△0.45	—	96.8	—	—	—
	2月末	6,072	△0.3	289.43	0.3	106.25	1.52	0.36	△0.23	0.21	94.3	—	—	—
	(期末) 2021年3月10日	6,125	0.6	293.28	1.7	108.57	1.53	0.37	△0.30	0.15	95.7	—	—	—
第170期	(期首) 2021年3月10日	6,115	—	293.28	—	108.57	1.53	—	△0.30	—	95.7	—	—	—
	3月末	6,182	1.1	294.69	0.5	110.71	1.71	0.18	△0.29	0.02	95.7	—	—	—
	(期末) 2021年4月12日	6,192	1.3	295.26	0.7	109.75	1.66	0.13	△0.30	△0.00	96.2	—	—	—
第171期	(期首) 2021年4月12日	6,182	—	295.26	—	109.75	1.66	—	△0.30	—	96.2	—	—	—
	4月末	6,186	0.1	295.84	0.2	108.93	1.64	△0.02	△0.19	0.11	94.5	—	—	—
	(期末) 2021年5月10日	6,202	0.3	296.07	0.3	108.77	1.58	△0.08	△0.22	0.09	94.6	—	—	—
第172期	(期首) 2021年5月10日	6,192	—	296.07	—	108.77	1.58	—	△0.22	—	94.6	—	—	—
	5月末	6,247	0.9	300.87	1.6	109.76	1.60	0.02	△0.18	0.03	95.5	—	—	—
	(期末) 2021年6月10日	6,268	1.2	301.03	1.7	109.65	1.49	△0.09	△0.24	△0.03	95.3	—	—	—
第173期	(期首) 2021年6月10日	6,258	—	301.03	—	109.65	1.49	—	△0.24	—	95.3	—	—	—
	6月末	6,236	△0.4	300.31	△0.2	110.58	1.47	△0.02	△0.17	0.07	95.4	—	—	—
	(期末) 2021年7月12日	6,221	△0.6	300.49	△0.2	110.17	1.36	△0.13	△0.29	△0.05	95.4	—	—	—

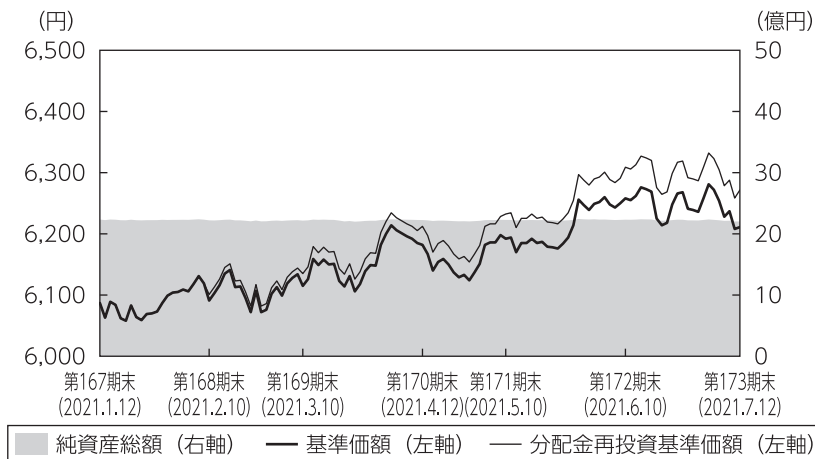
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率および騰落幅は期首比です。

(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168期～第173期の運用経過 (2021年1月13日から2021年7月12日まで)

基準価額等の推移



第168期首 : 6,087円
第173期末 : 6,211円
(既払分配金60円)
騰落率 : 3.0%
(分配金再投資ベース)

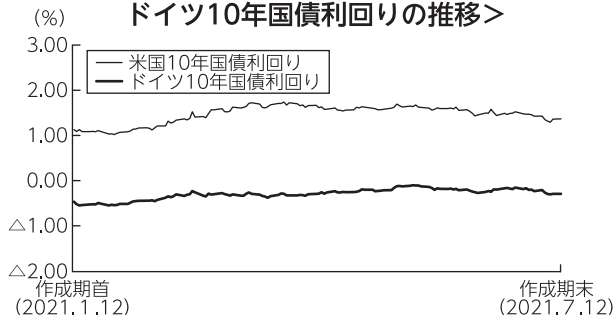
- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

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、為替市場で米ドルやユーロなどが対円で上昇したことから、基準価額は上昇しました。

投資環境

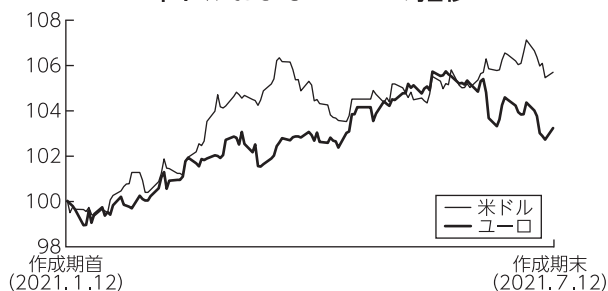
<米国10年国債利回りおよび
ドイツ10年国債利回りの推移>



米国国債市場は、大規模な追加経済対策への期待感や、新型コロナウイルスのワクチン接種開始に伴う景気回復期待を背景に3月末にかけ下落(利回りは上昇)しました。その後は、米金融緩和長期化観測などから下落幅は縮小しました。ドイツ国債市場は、世界景気の回復期待が意識されたことなどから下落しました。投資適格社債市場は、米国は上昇し、欧州は下落しました。信用スプレッドは、米国、欧州ともに縮小しました。

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、ユーロともに上昇しました。米ドルは、大規模な米追加経済対策に伴う景気回復期待などを背景に長期金利が上昇したことなどが上昇要因となりました。ユーロは、EU(欧州連合)域内の経済活動正常化への期待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。

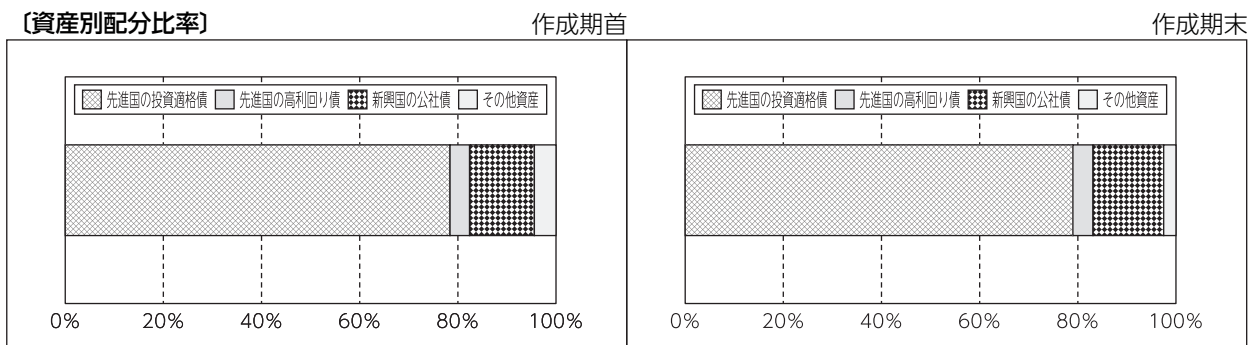
ポートフォリオについて

●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、為替市場で米ドルやユーロなどが対円で上昇したことから、基準価額は上昇しました。



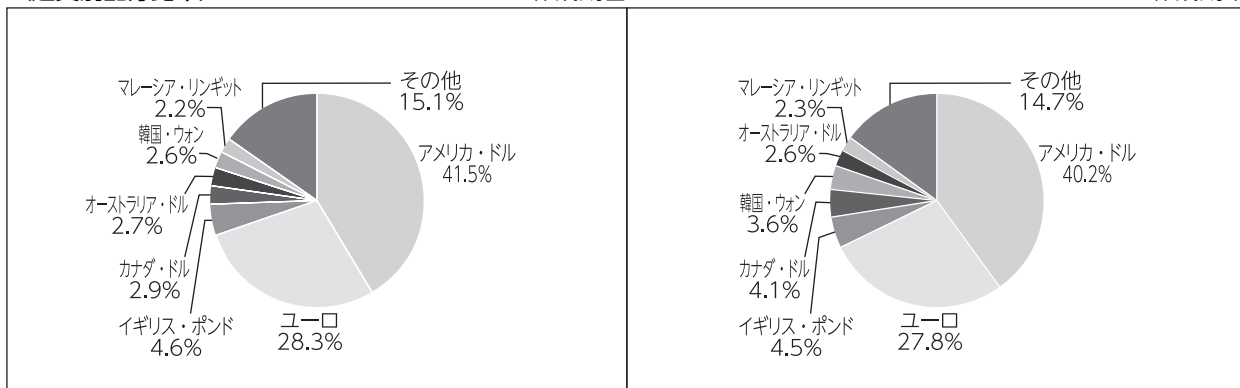
(注1) 上記比率は、ルーミス・グローバル債券マザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。

(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。

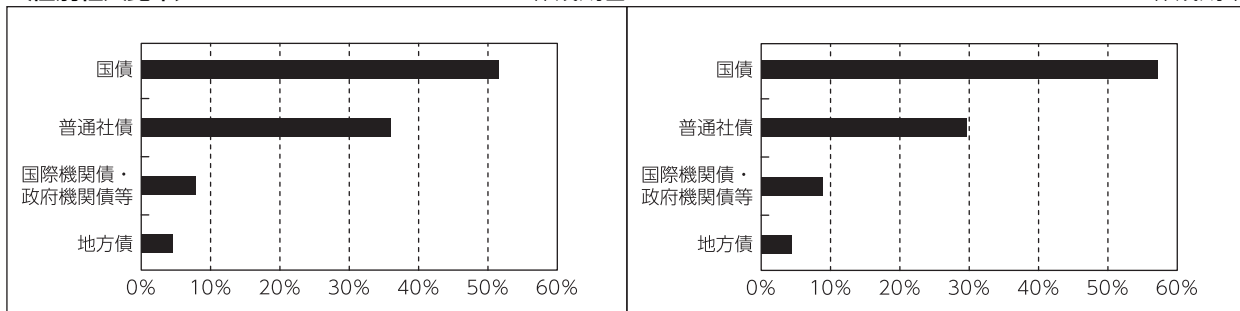
(注2) 現金等はその他として表示しています。

(注3) 上位8位以下をその他に含めて集計しています。

〔種別組入比率〕

作成期首

作成期末

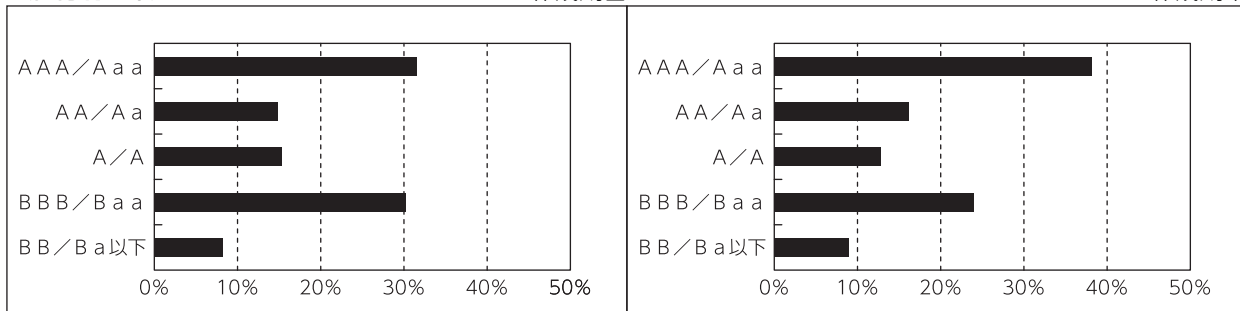


(注) 上記比率は、ルーミス・グローバル債券マザーファンドの債券部分に対する評価額の割合です。

〔格付別比率〕

作成期首

作成期末



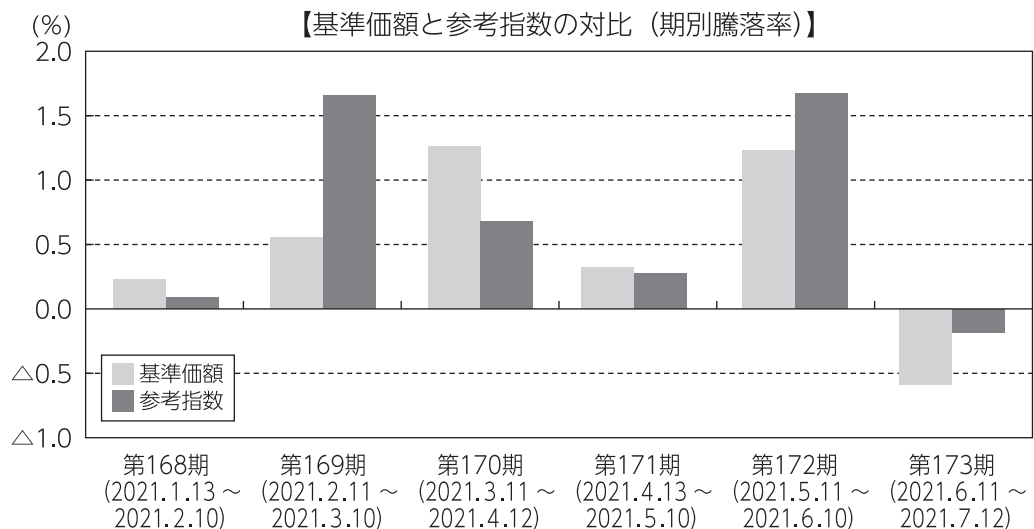
(注1) 上記比率は、ルーミス・グローバル債券マザーファンドの債券部分に対する評価額の割合です。

(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。

(注3) 無格付銘柄については、Ba以下に含めて表示しています。

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つた収益については、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168期	第169期	第170期	第171期	第172期	第173期
	2021年1月13日 ～2021年2月10日	2021年2月11日 ～2021年3月10日	2021年3月11日 ～2021年4月12日	2021年4月13日 ～2021年5月10日	2021年5月11日 ～2021年6月10日	2021年6月11日 ～2021年7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%	0.16%	0.16%	0.16%	0.16%
当期の収益	7円	8円	10円	7円	10円	2円
当期の収益以外	2円	1円	-円	2円	-円	7円
翌期繰越分配対象額	203円	202円	204円	201円	203円	196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

世界経済の見通しについては、米国・欧州ともに一部経済に回復の兆しがみられるものの、新型コロナウイルスの感染拡大状況やワクチンの普及動向に加え、財政拡大に伴う利回り上昇（価格は下落）に引き続き留意します。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168期～第173期		項目の概要
	(2021年1月13日 ～2021年7月12日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	50円	0.818%	(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6,163円です。
(投信会社)	(29)	(0.464)	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)	(20)	(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) その他費用	2	0.031	(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)	(0.030)	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
合計	52	0.849	

(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。

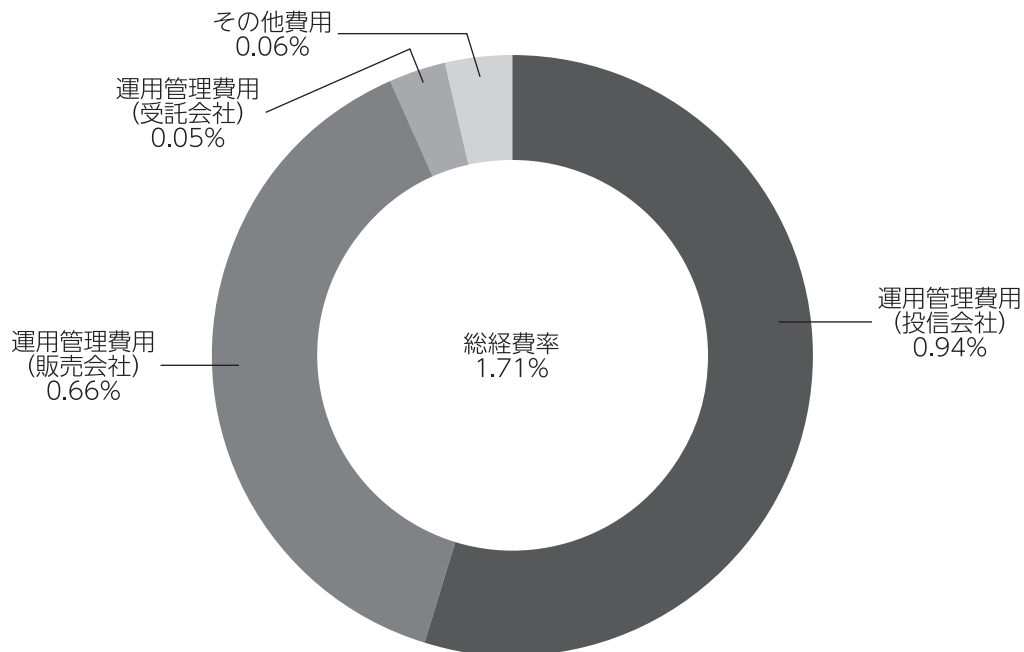
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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1.71%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（2021年1月13日から2021年7月12日まで）

	第 168 期 ~ 第 173 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 86,433	千円 137,000

■利害関係人との取引状況等（2021年1月13日から2021年7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28作成期末	第29作成期末	
	□ 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 1,418,923	千口 1,332,490	千円 2,154,770

■投資信託財産の構成

2021年7月12日現在

項 目	第29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 2,154,770	97.4%
コーラル・ローン等、その他	57,625	2.6
投資信託財産総額	2,212,395	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、2,153,620千円、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、2021年7月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=110.17円、1カナダ・ドル=88.44円、1オーストラリア・ドル=82.37円、1シンガポール・ドル=81.53円、1ニュージーランド・ドル=76.99円、1イギリス・ポンド=153.11円、1スイス・フラン=120.51円、1トルコ・リラ=12.732円、1デンマーク・クローネ=17.59円、1ノルウェー・クローネ=12.69円、1スウェーデン・クローナ=12.85円、1メキシコ・ペソ=5.541円、1アルゼンチン・ペソ=1.147円、100コロンビア・ペソ=2.873円、100インドネシア・ルピア=0.76円、1ブラジル・リアル=20.944円、1チェコ・コルナ=5.08円、100韓国・ウォン=9.62円、1マレーシア・リンギット=26.326円、1南アフリカ・ランド=7.72円、1タイ・バーツ=3.37円、1ポーランド・ズロチ=28.766円、100ハンガリー・フォリント=36.78円、1ユーロ=130.82円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年2月10日)、 (2021年3月10日)、 (2021年4月12日)、 (2021年5月10日)、 (2021年6月10日)、 (2021年7月12日)現在

項 目	第168期末	第169期末	第170期末	第171期末	第172期末	第173期末
(A)資 産	2,230,087,797円	2,223,062,339円	2,232,693,983円	2,234,347,859円	2,238,063,454円	2,212,395,565円
コーラル・ローン等	14,864,568	49,770,809	28,159,918	59,772,132	33,223,083	57,625,345
ルーミス・グローバル債券マザーファンド(評価額)	2,215,223,229	2,173,291,530	2,204,534,065	2,174,575,727	2,204,840,371	2,154,770,220
(B)負 債	9,085,794	6,437,326	6,923,838	6,411,289	6,694,797	9,266,476
未払収益分配金	3,646,283	3,624,952	3,600,204	3,597,824	3,565,469	3,547,239
未払解約金	2,512,270	-	-	-	-	2,494,800
未払信託報酬	2,920,848	2,806,234	3,316,377	2,807,323	3,122,496	3,217,395
その他未払費用	6,393	6,140	7,257	6,142	6,832	7,042
(C)純資産総額(A-B)	2,221,002,003	2,216,625,013	2,225,770,145	2,227,936,570	2,231,368,657	2,203,129,089
元 本	3,646,283,421	3,624,952,631	3,600,204,376	3,597,824,715	3,565,469,668	3,547,239,542
次期繰越損益金	△1,425,281,418	△1,408,327,618	△1,374,434,231	△1,369,888,145	△1,334,101,011	△1,344,110,453
(D)受益権総口数	3,646,283,421口	3,624,952,631口	3,600,204,376口	3,597,824,715口	3,565,469,668口	3,547,239,542口
1万口当たり基準価額(C/D)	6,091円	6,115円	6,182円	6,192円	6,258円	6,211円

(注) 第167期末における元本額は3,669,905,971円、当作成期間(第168期~第173期)中における追加設定元本額は2,532,269円、同解約元本額は125,198,698円です。

■損益の状況

[自 2021年1月13日] [自 2021年2月11日] [自 2021年3月11日] [自 2021年4月13日] [自 2021年5月11日] [自 2021年6月11日]
 [至 2021年2月10日] [至 2021年3月10日] [至 2021年4月12日] [至 2021年5月10日] [至 2021年6月10日] [至 2021年7月12日]

項 目	第168期	第169期	第170期	第171期	第172期	第173期
(A)配 当 等 収 益	△225円	△486円	△487円	△291円	△477円	△460円
受 取 利 息	1	-	1	-	2	-
支 払 利 息	△226	△486	△488	△291	△479	△460
(B)有価証券売買損益	8,078,293	15,053,914	31,202,760	10,049,249	30,163,386	△10,058,334
売 買 益	8,094,508	15,071,604	31,242,537	10,321,671	30,276,353	20,698
売 買 損	△16,215	△17,690	△39,777	△272,422	△112,967	△10,079,032
(C)信 託 報 酬 等	△2,927,241	△2,812,374	△3,323,634	△2,813,465	△3,129,328	△3,224,437
(D)当期損益金(A + B + C)	5,150,827	12,241,054	27,878,639	7,235,493	27,033,581	△13,283,231
(E)前期繰越損益金	△1,181,761,905	△1,173,214,445	△1,156,511,066	△1,131,352,192	△1,117,444,090	△1,088,257,352
(F)追加信託差損益金	△245,024,057	△243,729,275	△242,201,600	△242,173,622	△240,125,033	△239,022,631
(配当等相当額)	(34,140,340)	(33,945,624)	(33,718,754)	(33,701,466)	(33,403,136)	(33,237,177)
(売買損益相当額)	(△279,164,397)	(△277,674,899)	(△275,920,354)	(△275,875,088)	(△273,528,169)	(△272,259,808)
(G)合 計(D + E + F)	△1,421,635,135	△1,404,702,666	△1,370,834,027	△1,366,290,321	△1,330,535,542	△1,340,563,214
(H)収 益 分 配 金	△3,646,283	△3,624,952	△3,600,204	△3,597,824	△3,565,469	△3,547,239
次期繰越損益金(G + H)	△1,425,281,418	△1,408,327,618	△1,374,434,231	△1,369,888,145	△1,334,101,011	△1,344,110,453
追加信託差損益金	△245,024,057	△243,729,275	△242,201,600	△242,173,622	△240,125,033	△239,022,631
(配当等相当額)	(34,140,621)	(33,945,885)	(33,719,109)	(33,701,751)	(33,403,466)	(33,237,487)
(売買損益相当額)	(△279,164,678)	(△277,675,160)	(△275,920,709)	(△275,875,373)	(△273,528,499)	(△272,260,118)
分配準備積立金	40,220,183	39,511,454	39,802,389	38,893,685	39,266,663	36,547,161
繰 越 損 益 金	△1,220,477,544	△1,204,109,797	△1,172,035,020	△1,166,608,208	△1,133,242,641	△1,141,634,983

(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168期から第173期まではルミス・グローバル債券マザーファンド5,421,199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168期	第169期	第170期	第171期	第172期	第173期
(a)経費控除後の配当等収益	2,600,771円	3,156,229円	4,165,514円	2,720,070円	4,292,663円	1,032,998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	34,140,621	33,945,885	33,719,109	33,701,751	33,403,466	33,237,487
(d)分 配 準 備 積 立 金	41,265,695	39,980,177	39,237,079	39,771,439	38,539,469	39,061,402
(e)当期分配対象額(a+b+c+d)	78,007,087	77,082,291	77,121,702	76,193,260	76,235,598	73,331,887
(f)1万円当たり当期分配対象額	213.94	212.64	214.21	211.78	213.82	206.73
(g)分 配 金	3,646,283	3,624,952	3,600,204	3,597,824	3,565,469	3,547,239
(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168期	第169期	第170期	第171期	第172期	第173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29期（決算日 2021年7月12日）

（計算期間 2021年1月13日～2021年7月12日）

ルーミス・グローバル債券マザーファンドの第29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	券利率	純資産額
	期中騰落率	期中騰落率	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					
	円	%		%	円	%	%	%	%	%	%	%	%	百万円
25期（2019年7月10日）	14,083	5.5	269.62	5.4	109.01	2.06	△0.65	△0.35	△0.63	96.8	-	-	-	2,385
26期（2020年1月10日）	14,454	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）	14,977	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）	15,555	3.9	288.24	1.6	104.23	1.13	0.48	△0.47	△0.00	96.8	-	-	-	2,207
29期（2021年7月12日）	16,171	4.0	300.49	4.3	110.17	1.36	0.23	△0.29	0.18	97.6	-	-	-	2,154

（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）。

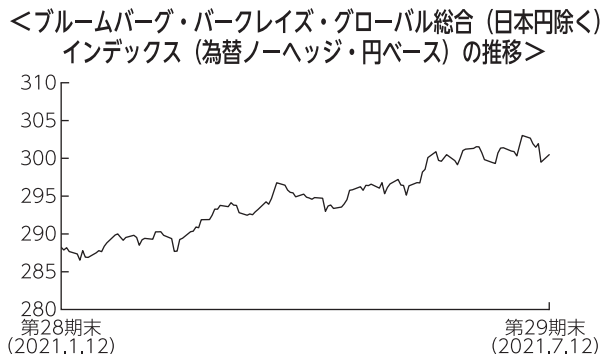
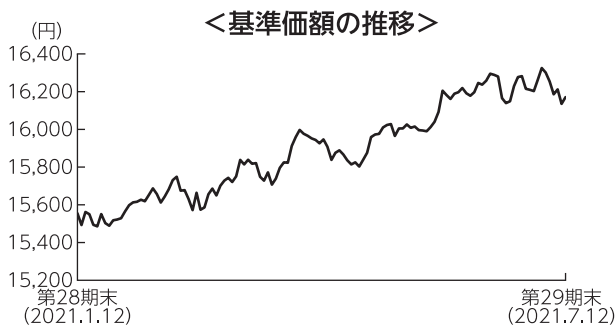
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基準価額		ブルームバーグ・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		債券 組入比率	債券 先物比率
	円	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) 2021年1月12日	円	%		%	円	%	%	%	%	%	%
	15,555	—	288.24	—	104.23	1.13	—	△0.47	—	96.8	—
1月末	15,598	0.3	288.83	0.2	104.48	1.05	△0.08	△0.54	△0.07	97.4	—
2月末	15,574	0.1	289.43	0.4	106.25	1.52	0.39	△0.23	0.24	96.6	—
3月末	15,912	2.3	294.69	2.2	110.71	1.71	0.58	△0.29	0.18	96.9	—
4月末	15,973	2.7	295.84	2.6	108.93	1.64	0.51	△0.19	0.28	97.1	—
5月末	16,182	4.0	300.87	4.4	109.76	1.60	0.47	△0.18	0.29	97.3	—
6月末	16,203	4.2	300.31	4.2	110.58	1.47	0.34	△0.17	0.30	98.0	—
(期末) 2021年7月12日	16,171	4.0	300.49	4.3	110.17	1.36	0.23	△0.29	0.18	97.6	—

(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 (2021年1月13日から2021年7月12日まで)



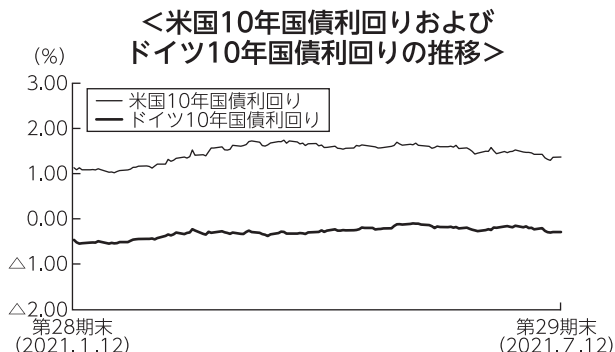
基準価額の推移

当ファンドの基準価額は、前期末比で4.0%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、為替市場で米ドルやユーロなどが対円で上昇したことから、基準価額は上昇しました。

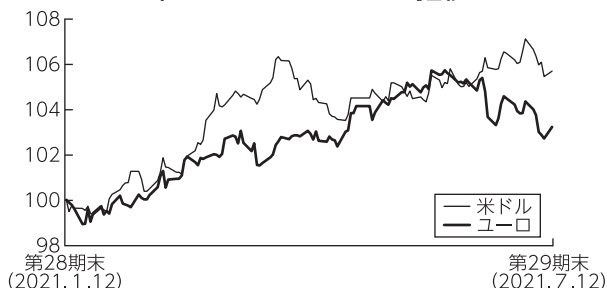
投資環境



米国国債市場は、大規模な追加経済対策への期待感や、新型コロナウイルスのワクチン接種開始に伴う景気回復期待を背景に3月末にかけ下落(利回りは上昇)しました。その後は、米金融緩和長期化観測などから下落幅は縮小しました。ドイツ国債市場は、世界景気の回復期待が意識されたことなどから下落しました。投資適格社債市場は、米国は上昇し、欧州は下落しました。信用スプレッドは、米国、欧州ともに縮小しました。

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、ユーロともに上昇しました。米ドルは、大規模な米追加経済対策に伴う景気回復期待などを背景に長期金利が上昇したことなどが上昇要因となりました。ユーロは、EU（欧州連合）域内の経済活動正常化への期待などが上昇要因となりました。

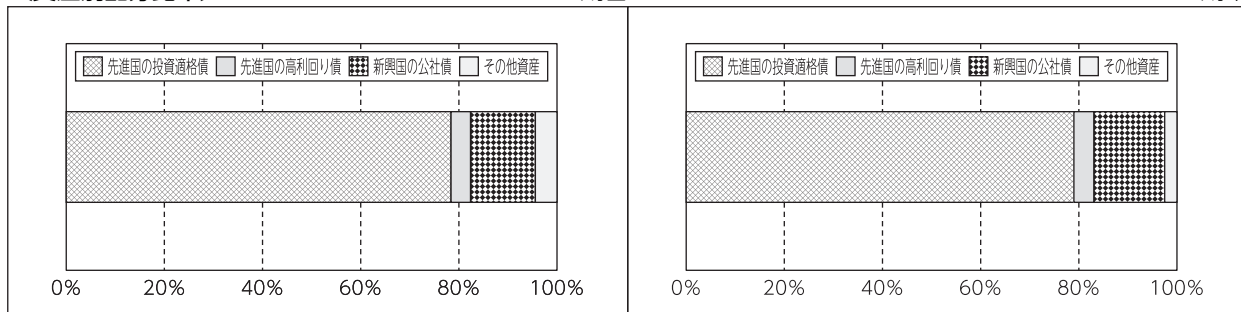
ポートフォリオについて

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、為替市場で米ドルやユーロなどが対円で上昇したことから、基準価額は上昇しました。

〔資産別配分比率〕

期首

期末



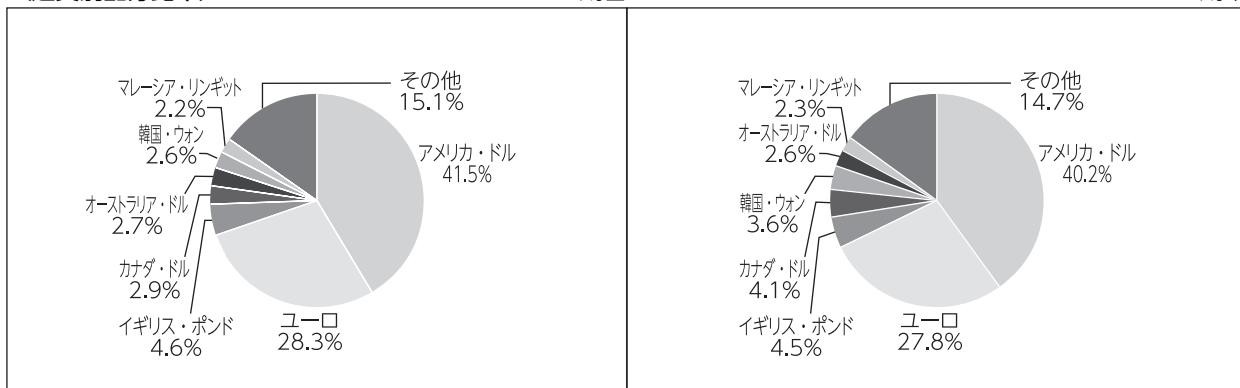
(注1) 上記比率は、ルミス・グローバル債券マザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。

(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。

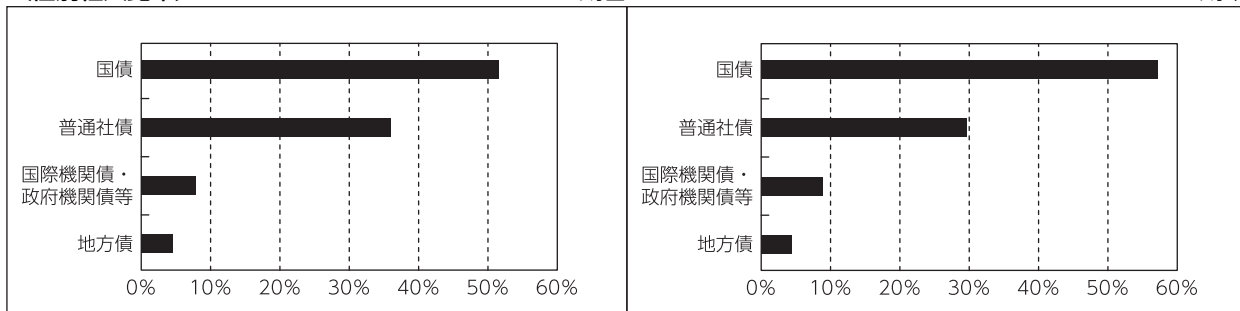
(注2) 現金等はその他として表示しています。

(注3) 上位8位以下をその他に含めて集計しています。

【種別組入比率】

期首

期末

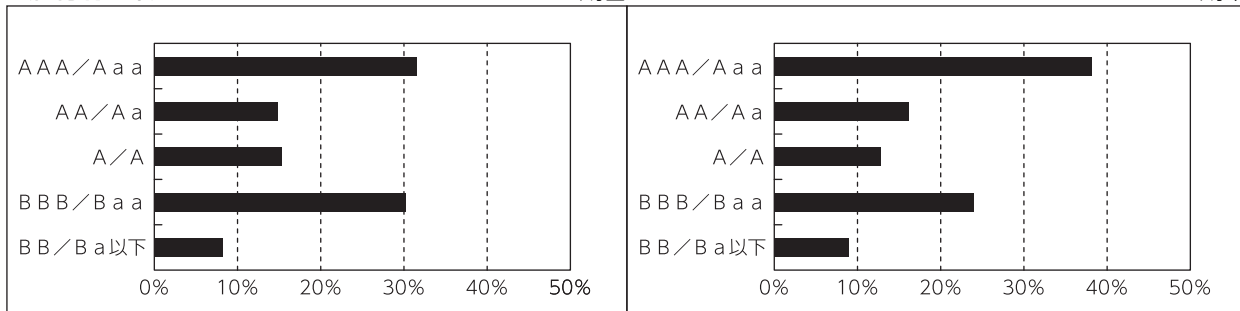


(注) 上記比率は、ルミス・グローバル債券マザーファンドの債券部分に対する評価額の割合です。

【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。

(注3) 無格付銘柄については、Ba以下に含めて表示しています。

今後の運用方針

世界経済の見通しについては、米国・欧州ともに一部経済に回復の兆しがみられるものの、新型コロナウイルスの感染拡大状況やワクチンの普及動向に加え、財政拡大に伴う利回り上昇（価格は下落）に引き続き留意します。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 (5)	0.030% (0.030)	(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
合計	5	0.030	
期中の平均基準価額は15,895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 (2021年1月13日から2021年7月12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 2,704	千アメリカ・ドル 2,050 (115)
		地方債証券	—	27 (—)
		社債証券	837	2,115 (73)
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 264	千カナダ・ドル 24 (—)
	オーストラリア	地方債証券	千オーストラリア・ドル —	千オーストラリア・ドル 40 (—)
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 101	千イギリス・ポンド 155 (—)
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ —	千デンマーク・クローネ 198 (—)
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 734	千ノルウェー・クローネ 907 (—)
		特殊債証券	916	— (—)

			買付額	売付額	
外	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 884	千スウェーデン・クローナ 177 (-)	
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 2,550	千メキシコ・ペソ 2,186 (-)	
	チェコ	国債証券	千チェコ・コルナ -	千チェコ・コルナ 2,910 (-)	
	韓国	国債証券	千韓国・ウォン 234,259	千韓国・ウォン -	
国	ユ	アイルランド	千ユーロ 137	千ユーロ -	
		オランダ	社債券	-	123 (-)
	イ	フランス	国債証券	381	382 (-)
		ドイッ	国債証券	989	856 (-)
	社債券		94	5 (-)	
	口	イタリア	国債証券	-	302 (-)
		フィンランド	社債券	-	104 (-)
		アメリカ	社債券	-	99 (-)

(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 (2021年1月13日から2021年7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 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
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 7,507	千アメリカ・ドル 7,870	千円 867,059	% 40.2	% 6.6	% 20.5	% 5.7	% 14.0
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 975	千カナダ・ドル 1,004	千円 88,846	4.1	—	1.6	0.8	1.7
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 620	千オーストラリア・ドル 689	千円 56,810	2.6	—	2.2	0.5	—
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 470	千円 38,358	1.8	—	1.3	0.4	—
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 45	千ニュージーランド・ドル 48	千円 3,762	0.2	—	—	—	0.2
イギリス	千イギリス・ポンド 485	千イギリス・ポンド 637	千円 97,538	4.5	—	3.4	1.2	—
スイス	千スイス・フラン 155	千スイス・フラン 162	千円 19,571	0.9	—	—	0.9	—
デンマーク	千デンマーク・クローネ 1,215	千デンマーク・クローネ 1,333	千円 23,463	1.1	—	—	1.1	—
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 1,820	千ノルウェー・クローネ 1,851	千円 23,498	1.1	—	—	1.0	0.1
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 2,475	千スウェーデン・クローナ 2,579	千円 33,151	1.5	—	—	1.5	—
メキシコ	千メキシコ・ペソ 4,787	千メキシコ・ペソ 5,197	千円 28,804	1.3	—	0.9	0.5	—
コロンビア	千コロンビア・ペソ 393,800	千コロンビア・ペソ 419,492	千円 12,055	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 6,500,390	千円 49,402	2.3	—	2.0	—	0.3
ブラジル	千ブラジル・レアル 963	千ブラジル・レアル 998	千円 20,909	1.0	1.0	0.5	0.4	—
韓国	千韓国・ウォン 836,000	千韓国・ウォン 813,147	千円 78,224	3.6	—	2.1	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 1,878	千円 49,446	2.3	—	1.9	—	0.4
タイ	千タイ・バーツ 2,295	千タイ・バーツ 2,313	千円 7,795	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 153	千円 4,425	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
	千ユーロ	千ユーロ	千円	%	%	%	%	%
ユ ー ロ								
ジャージー	100	105	13,780	0.6	—	0.6	—	—
イギリス	100	99	13,051	0.6	—	0.6	—	—
アイルランド	245	260	34,036	1.6	—	0.9	0.7	—
オランダ	100	101	13,274	0.6	—	0.6	—	—
ベルギー	100	103	13,601	0.6	—	—	0.6	—
フランス	200	238	31,262	1.5	—	1.0	0.4	—
ドイツ	2,160	2,257	295,370	13.7	1.3	5.9	5.9	1.9
スペイン	405	479	62,717	2.9	—	2.9	—	—
イタリア	430	457	59,865	2.8	—	2.8	—	—
ハンガリー	65	71	9,330	0.4	—	0.4	—	—
カナダ	265	275	36,050	1.7	—	—	1.7	—
ケイマン諸島	115	129	16,926	0.8	—	0.8	—	—
合 計	—	—	千円 2,102,391	97.6	8.8	54.1	24.5	18.9

(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						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		
			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	216	23,834	2028/01/13	
REPUBLIC OF CHILE 2.45 01/31/31	国債証券	2.4500	200	204	22,529	2031/01/31	
US T N/B 0.125 01/31/23	国債証券	0.1250	405	404	44,589	2023/01/31	
US T N/B 0.375 01/31/26	国債証券	0.3750	105	103	11,389	2026/01/31	
US T N/B 1.875 02/15/51	国債証券	1.8750	50	48	5,362	2051/02/15	
US T N/B 0.5 02/28/26	国債証券	0.5000	320	316	34,886	2026/02/28	
US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	1.6250	35	35	3,951	2031/05/15	
US T N/B 0.125 08/31/22	国債証券	0.1250	1,190	1,190	131,138	2022/08/31	
US T N/B 1.625 11/15/50	国債証券	1.6250	65	59	6,564	2050/11/15	
US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	0.8750	100	96	10,578	2030/11/15	
US T N/B 2.0 12/31/21	国債証券	2.0000	130	131	14,452	2021/12/31	
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR 3.375 02/05/30	特殊債券	3.3750	210	216	23,867	2030/02/05	
SP POWERASSETS LTD 2.7 09/14/22	特殊債券	2.7000	200	205	22,616	2022/09/14	
JPMORGAN CHASE & CO 3.2 01/25/23	社債券	3.2000	180	187	20,700	2023/01/25	
UNITED AIR 2016-1 B PTT 3.65 01/07/26	社債券	3.6500	31	31	3,448	2026/01/07	

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	
CITIGROUP INC 01/29/31	社 債 券	2.6660	235	243	26,862	2031/01/29
QUICKEN LOANS INC 5.25 01/15/28	社 債 券	5.2500	25	26	2,909	2028/01/15
AMERICAN TOWER CORP 2.9 01/15/30	社 債 券	2.9000	50	52	5,807	2030/01/15
COCA-COLA FEMSA SAB CV 2.75 01/22/30	社 債 券	2.7500	150	157	17,352	2030/01/22
SUZANO AUSTRIA GMBH 3.75 01/15/31	社 債 券	3.7500	40	41	4,617	2031/01/15
VWEA FINANCE LLC 2.875 01/15/27	社 債 券	2.8750	65	67	7,425	2027/01/15
ITAU UNIBANCO HLDG SA/KY 2.9 01/24/23	社 債 券	2.9000	200	204	22,485	2023/01/24
BANCO BRADESCO (CAYMAN) 2.85 01/27/23	社 債 券	2.8500	200	203	22,392	2023/01/27
TOLL BROS FINANCE CORP 4.35 02/15/28	社 債 券	4.3500	85	94	10,380	2028/02/15
BOEING CO 3.625 02/01/31	社 債 券	3.6250	50	54	5,949	2031/02/01
T-MOBILE USA INC 4.75 02/01/28	社 債 券	4.7500	90	96	10,634	2028/02/01
EMBRAER NETHERLANDS FINA 5.4 02/01/27	社 債 券	5.4000	10	10	1,174	2027/02/01
BOEING CO 3.75 02/01/50	社 債 券	3.7500	20	20	2,278	2050/02/01
BOEING CO 3.25 02/01/28	社 債 券	3.2500	80	85	9,386	2028/02/01
CENTENE CORP 3.375 02/15/30	社 債 券	3.3750	65	68	7,538	2030/02/15
BOEING CO 2.196 02/04/26	社 債 券	2.1960	45	45	5,007	2026/02/04
BOEING CO 3.825 03/01/59	社 債 券	3.8250	10	10	1,113	2059/03/01
COMCAST CORP 4.0 03/01/48	社 債 券	4.0000	15	17	1,951	2048/03/01
CHARTER COMM OPT LLC/CAP 4.8 03/01/50	社 債 券	4.8000	40	46	5,113	2050/03/01
CITIGROUP INC 03/31/31	社 債 券	4.4120	60	70	7,754	2031/03/31
QUICKEN LOANS LLC/QUICKN 3.875 03/01/31	社 債 券	3.8750	75	75	8,335	2031/03/01
CENTENE CORP 2.5 03/01/31	社 債 券	2.5000	50	50	5,515	2031/03/01
FREEMPORT-MCMORAN INC 4.25 03/01/30	社 債 券	4.2500	55	59	6,536	2030/03/01
QUICKEN LOANS LLC/QUICKN 3.625 03/01/29	社 債 券	3.6250	25	25	2,764	2029/03/01
FREEMPORT-MCMORAN INC 4.125 03/01/28	社 債 券	4.1250	20	21	2,317	2028/03/01
ALLY FINANCIAL INC 4.625 03/30/25	社 債 券	4.6250	10	11	1,235	2025/03/30
AMERICAN TOWER CORP 2.4 03/15/25	社 債 券	2.4000	95	99	10,940	2025/03/15
CHARTER COMM OPT LLC/CAP 3.7 04/01/51	社 債 券	3.7000	65	65	7,162	2051/04/01
BROADCOM INC 3.469 04/15/34	社 債 券	3.4690	85	89	9,904	2034/04/15
BANK OF AMERICA CORP 04/29/31	社 債 券	2.5920	35	36	3,994	2031/04/29
UNITED AIRLINES INC 4.375 04/15/26	社 債 券	4.3750	15	15	1,710	2026/04/15
T-MOBILE USA INC 3.875 04/15/30	社 債 券	3.8750	110	123	13,622	2030/04/15
NEW YORK LIFE INSURANCE 3.75 05/15/50	社 債 券	3.7500	50	56	6,267	2050/05/15
CONSTELLATION BRANDS INC 3.75 05/01/50	社 債 券	3.7500	15	16	1,829	2050/05/01
UNITEDHEALTH GROUP INC 2.9 05/15/50	社 債 券	2.9000	10	10	1,121	2050/05/15
BOEING CO 3.9 05/01/49	社 債 券	3.9000	15	15	1,749	2049/05/01
ALLY FINANCIAL INC 3.875 05/21/24	社 債 券	3.8750	5	5	595	2024/05/21
BOEING CO 3.1 05/01/26	社 債 券	3.1000	5	5	584	2026/05/01
ALLY FINANCIAL INC 5.8 05/01/25	社 債 券	5.8000	10	11	1,281	2025/05/01
IPALCO ENTERPRISES INC 4.25 05/01/30	社 債 券	4.2500	30	33	3,741	2030/05/01
BOEING CO 2.25 06/15/26	社 債 券	2.2500	5	5	563	2026/06/15
FORD FOUNDATION/THE 3.859 06/01/47	社 債 券	3.8590	65	78	8,687	2047/06/01
AT&T 3.65 06/01/51	社 債 券	3.6500	95	99	10,982	2051/06/01
GREAT-WEST LIFE CO FINANC 4.15 06/03/47	社 債 券	4.1500	45	54	6,003	2047/06/03
ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR 4.5 06/01/50	社 債 券	4.5000	50	61	6,769	2050/06/01

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	
EMBRAER NETHERLANDS FINA 5.05 06/15/25	社 債 券	5.0500	85	89	9,902	2025/06/15
VIATRIS INC 2.7 06/22/30	社 債 券	2.7000	90	91	10,073	2030/06/22
DELTA AIRLINES 2015B 4.25 07/30/23	社 債 券	4.2500	41	41	4,620	2023/07/30
CROWN CASTLE INTL CORP 4.15 07/01/50	社 債 券	4.1500	10	11	1,272	2050/07/01
AES CORP/THE 3.95 07/15/30	社 債 券	3.9500	15	16	1,823	2030/07/15
BOEING CO 3.95 08/01/59	社 債 券	3.9500	20	21	2,324	2059/08/01
CONSTELLATION BRANDS INC 3.15 08/01/29	社 債 券	3.1500	100	107	11,871	2029/08/01
CVS HEALTH CORP 3.25 08/15/29	社 債 券	3.2500	30	32	3,603	2029/08/15
FREEMPORT-MCMORAN INC 4.625 08/01/30	社 債 券	4.6250	115	126	13,952	2030/08/01
BANK OF AMERICA CORP 4.2 08/26/24	社 債 券	4.2000	245	268	29,596	2024/08/26
MCDONALD'S CORP 3.625 09/01/49	社 債 券	3.6250	35	39	4,317	2049/09/01
ENEL FINANCE INTL NV 6.8 09/15/37	社 債 券	6.8000	155	228	25,129	2037/09/15
BANCO SANTANDER CHILE 3.875 09/20/22	社 債 券	3.8750	200	207	22,864	2022/09/20
FREEMPORT-MCMORAN INC 5.0 09/01/27	社 債 券	5.0000	5	5	575	2027/09/01
UNITED AIR 2016-2 B PTT 3.65 10/07/25	社 債 券	3.6500	59	59	6,519	2025/10/07
CENTENE CORP 3.0 10/15/30	社 債 券	3.0000	105	109	12,012	2030/10/15
DELTA AIR LINES/SKYMILES 4.75 10/20/28	社 債 券	4.7500	85	94	10,427	2028/10/20
SANTANDER HOLDINGS USA 3.244 10/05/26	社 債 券	3.2440	20	21	2,364	2026/10/05
BOEING CO 3.85 11/01/48	社 債 券	3.8500	5	5	576	2048/11/01
ALLY FINANCIAL INC 5.75 11/20/25	社 債 券	5.7500	10	11	1,264	2025/11/20
CENTENE CORP 4.625 12/15/29	社 債 券	4.6250	80	88	9,705	2029/12/15
小 計	—	—	7,507	7,870	867,059	—
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 0.25 05/01/23	国 債 証 券	0.2500	240	239	21,137	2023/05/01
CANADA 2.25 06/01/29	国 債 証 券	2.2500	170	183	16,251	2029/06/01
CANADA 2.0 12/01/51	国 債 証 券	2.0000	205	214	18,936	2051/12/01
IBRD 2.2 01/18/22	特 殊 債 券	2.2000	180	181	16,077	2022/01/18
PSP CAPITAL INC 2.09 11/22/23	特 殊 債 券	2.0900	180	185	16,442	2023/11/22
小 計	—	—	975	1,004	88,846	—
(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	140	11,539	2030/02/20
NEW S WALES TREASURY CRP 4.0 05/20/26	地 方 債 証 券	4.0000	105	120	9,949	2026/05/20
QUEENSLAND 2.75 08/20/27	地 方 債 証 券	2.7500	390	428	35,322	2027/08/20
小 計	—	—	620	689	56,810	—
(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	352	28,721	2027/03/01
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国 債 証 券	3.0000	110	118	9,636	2024/09/01
小 計	—	—	420	470	38,358	—
(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	48	3,762	2023/04/15
小 計	—	—	45	48	3,762	—
(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	424	64,967	2044/01/22
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国 債 証 券	5.0000	140	164	25,182	2025/03/07
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国 債 証 券	1.5000	45	48	7,388	2047/07/22
小 計	—	—	485	637	97,538	—

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	
(スイス) GOLDMAN SACHS GROUP INC 1.0 11/24/25	社 債 券	% 1.0000	千スイス・フラン 155	千スイス・フラン 162	千円 19,571	2025/11/24
小 計	—	—	155	162	19,571	—
(デンマーク) DENMARK 1.75 11/15/25	国 債 証 券	% 1.7500	千デンマーク・クローネ 1,215	千デンマーク・クローネ 1,333	千円 23,463	2025/11/15
小 計	—	—	1,215	1,333	23,463	—
(ノルウェー) NORWAY 1.75 03/13/25 NORWAY 2.0 05/24/23 KFW 1.25 08/28/23	国 債 証 券 国 債 証 券 特 殊 債 券	% 1.7500 2.0000 1.2500	千ノルウェー・クローネ 715 205 900	千ノルウェー・クローネ 735 210 905	千円 9,334 2,666 11,496	2025/03/13 2023/05/24 2023/08/28
小 計	—	—	1,820	1,851	23,498	—
(スウェーデン) SWEDEN 1.5 11/13/23	国 債 証 券	% 1.5000	千スウェーデン・クローナ 2,475	千スウェーデン・クローナ 2,579	千円 33,151	2023/11/13
小 計	—	—	2,475	2,579	33,151	—
(メキシコ) MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29 MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	国 債 証 券 国 債 証 券	% 8.5000 8.0000	千メキシコ・ペソ 3,097 1,690	千メキシコ・ペソ 3,432 1,765	千円 19,022 9,782	2029/05/31 2023/12/07
小 計	—	—	4,787	5,197	28,804	—
(コロンビア) TITULOS DE TESORERIA 7.5 08/26/26	国 債 証 券	% 7.5000	千コロンビア・ペソ 393,800	千コロンビア・ペソ 419,492	千円 12,055	2026/08/26
小 計	—	—	393,800	419,492	12,055	—
(インドネシア) INDONESIA GOVT 8.25 05/15/29 IBRD 8.4 10/12/21	国 債 証 券 特 殊 債 券	% 8.2500 8.4000	千インドネシア・ルピア 5,100,000 800,000	千インドネシア・ルピア 5,694,150 806,240	千円 43,275 6,127	2029/05/15 2021/10/12
小 計	—	—	5,900,000	6,500,390	49,402	—
(ブラジル) BRAZIL NTN 01/01/27 BRAZIL NTN 01/01/29 BRAZIL 8.5 01/05/24	国 債 証 券 国 債 証 券 国 債 証 券	% 10.0000 10.0000 8.5000	千ブラジル・レアル 280 233 450	千ブラジル・レアル 293 244 459	千円 6,155 5,127 9,626	2027/01/01 2029/01/01 2024/01/05
小 計	—	—	963	998	20,909	—
(韓国) KOREA TREASURY BOND 1.5 03/10/25 KOREA TREASURY BOND 2.0 12/10/21 KOREA TREASURY BOND 1.5 12/10/30 KOREA TREASURY BOND 1.375 12/10/29	国 債 証 券 国 債 証 券 国 債 証 券 国 債 証 券	% 1.5000 2.0000 1.5000 1.3750	千韓国・ウォン 270,000 76,000 240,000 250,000	千韓国・ウォン 269,540 76,450 229,002 238,153	千円 25,929 7,354 22,030 22,910	2025/03/10 2021/12/10 2030/12/10 2029/12/10
小 計	—	—	836,000	813,147	78,224	—
(マレーシア) MALAYSIA 3.892 03/15/27 MALAYSIA 3.906 07/15/26 MALAYSIA 3.795 09/30/22	国 債 証 券 国 債 証 券 国 債 証 券	% 3.8920 3.9060 3.7950	千マレーシア・リンギット 630 825 330	千マレーシア・リンギット 666 873 338	千円 17,545 23,001 8,899	2027/03/15 2026/07/15 2022/09/30
小 計	—	—	1,785	1,878	49,446	—
(タイ) THAILAND 1.6 12/17/29	国 債 証 券	% 1.6000	千タイ・バーツ 2,295	千タイ・バーツ 2,313	千円 7,795	2029/12/17
小 計	—	—	2,295	2,313	7,795	—

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	
(ポーランド) POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	% 2.5000	千ポーランド・ズロチ 145	千ポーランド・ズロチ 153	千円 4,425	2026/07/25
小 計	-	-	145	153	4,425	-
(ユーロ…ジャージー) HEATHROW FUNDING LTD 1.875 03/14/34	社債証券	% 1.8750	千ユーロ 100	千ユーロ 105	千円 13,780	2034/03/14
小 計	-	-	100	105	13,780	-
(ユーロ…イギリス) CHANNEL LINK 06/30/50	特殊債券	% 1.7610	千ユーロ 100	千ユーロ 99	千円 13,051	2050/06/30
小 計	-	-	100	99	13,051	-
(ユーロ…アイルランド) IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	% 1.0000	千ユーロ 100	千ユーロ 107	千円 14,007	2026/05/15
IRISH 0.0 10/18/31	国債証券	% 0.0000	30	29	3,887	2031/10/18
AIB GROUP PLC 05/30/31	社債証券	% 2.8750	115	123	16,141	2031/05/30
小 計	-	-	245	260	34,036	-
(ユーロ…オランダ) COOPERATIEVE RABOBANK UA 0.0 06/21/27	特殊債券	% 0.0000	千ユーロ 100	千ユーロ 101	千円 13,274	2027/06/21
小 計	-	-	100	101	13,274	-
(ユーロ…ベルギー) ING BELGIUM SA 0.625 05/30/25	特殊債券	% 0.6250	千ユーロ 100	千ユーロ 103	千円 13,601	2025/05/30
小 計	-	-	100	103	13,601	-
(ユーロ…フランス) FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	% 4.5000	千ユーロ 50	千ユーロ 87	千円 11,478	2041/04/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	% 0.5000	70	73	9,600	2026/05/25
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	国債証券	% 0.5000	80	77	10,183	2044/06/25
小 計	-	-	200	238	31,262	-
(ユーロ…ドイツ) DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	国債証券	% 0.5000	千ユーロ 675	千ユーロ 704	千円 92,190	2025/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	国債証券	% 0.0000	420	435	56,947	2030/02/15
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	国債証券	% 1.7500	305	312	40,857	2022/07/04
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	% 0.0000	285	294	38,584	2030/08/15
COMMERZBANK AG 0.625 05/28/25	特殊債券	% 0.6250	70	72	9,518	2025/05/28
KFW 0.25 09/15/25	特殊債券	% 0.2500	195	200	26,285	2025/09/15
FRAPORT AG 1.875 03/31/28	社債証券	% 1.8750	90	94	12,372	2028/03/31
VOLKSWAGEN FIN SERV AG 3.375 04/06/28	社債証券	% 3.3750	20	23	3,129	2028/04/06
DEUTSCHE BANK AG 05/19/31	社債証券	% 5.6250	100	118	15,485	2031/05/19
小 計	-	-	2,160	2,257	295,370	-
(ユーロ…スペイン) SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	% 4.2000	千ユーロ 120	千ユーロ 180	千円 23,614	2037/01/31
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	% 1.9500	85	98	12,820	2030/07/30
BANCO SANTANDER SA 0.1 02/27/32	特殊債券	% 0.1000	100	100	13,082	2032/02/27
BANCO BILBAO VIZCAYA ARG 01/16/30	社債証券	% 1.0000	100	100	13,199	2030/01/16
小 計	-	-	405	479	62,717	-
(ユーロ…イタリア) ITALY BTPS 1.35 04/01/30	国債証券	% 1.3500	千ユーロ 430	千ユーロ 457	千円 59,865	2030/04/01
小 計	-	-	430	457	59,865	-

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・・・ハンガリー) HUNGARY 1.75 10/10/27	国 債 証 券	% 1.7500	千ユーロ 65	千ユーロ 71	千円 9,330	2027/10/10
小 計	-	-	65	71	9,330	-
(ユーロ・・・カナダ) PROVINCE OF QUEBEC 0.875 01/15/25 PROVINCE OF ALBERTA 0.625 04/18/25	地方債証券 地方債証券	% 0.8750 0.6250	千ユーロ 165 100	千ユーロ 172 103	千円 22,532 13,517	2025/01/15 2025/04/18
小 計	-	-	265	275	36,050	-
(ユーロ・・・ケイマン諸島) XLIT LTD 06/29/47	社 債 券	% 3.2500	千ユーロ 115	千ユーロ 129	千円 16,926	2047/06/29
小 計	-	-	115	129	16,926	-
合 計	-	-	-	-	2,102,391	-

■投資信託財産の構成

2021年7月12日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 2,102,391	% 97.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	56,288	2.6
投 資 信 託 財 産 総 額	2,158,680	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、2,153,620千円、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、2021年7月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=110.17円、1カナダ・ドル=88.44円、1オーストラリア・ドル=82.37円、1シンガポール・ドル=81.53円、1ニュージーランド・ドル=76.99円、1イギリス・ポンド=153.11円、1スイス・フラン=120.51円、1トルコ・リラ=12.732円、1デンマーク・クローネ=17.59円、1ノルウェー・クローネ=12.69円、1スウェーデン・クローナ=12.85円、1メキシコ・ペソ=5.541円、1アルゼンチン・ペソ=1.147円、100コロンビア・ペソ=2.873円、100インドネシア・ルピア=0.76円、1ブラジル・リアル=20.944円、1チェコ・コルナ=5.08円、100韓国・ウォン=9.62円、1マレーシア・リンギット=26.326円、1南アフリカ・ランド=7.72円、1タイ・バーツ=3.37円、1ポーランド・ズロチ=28.766円、100ハンガリー・フォリント=36.78円、1ユーロ=130.82円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年7月12日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,158,680,953円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	31,398,486
公 社 債(評価額)	2,102,391,999
未 収 入 金	9,367,022
未 収 利 息	15,084,381
前 払 費 用	439,065
(B) 負 債	3,974,340
未 払 金	3,974,340
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	2,154,706,613
元 本	1,332,490,397
次 期 繰 越 損 益 金	822,216,216
(D) 受 益 権 総 口 数	1,332,490,397口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,171円

(注1) 期首元本額 1,418,923,411円
追加設定元本額 -円
一部解約元本額 86,433,014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) 1,332,490,397円
期末元本合計 1,332,490,397円

■損益の状況

当期 自2021年1月13日 至2021年7月12日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	25,724,997円
受 取 利 息	25,118,921
そ の 他 収 益 金	606,178
支 払 利 息	△102
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	59,557,460
売 買 益	106,780,951
売 買 損	△47,223,491
(C) そ の 他 費 用	△659,225
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	84,623,232
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	788,159,970
(F) 解 約 差 損 益 金	△50,566,986
(G) 合 計(D + E + F)	822,216,216
次 期 繰 越 損 益 金(G)	822,216,216

(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。