

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180期	<決算日	2022年2月10日>
第181期	<決算日	2022年3月10日>
第182期	<決算日	2022年4月11日>
第183期	<決算日	2022年5月10日>
第184期	<決算日	2022年6月10日>
第185期	<決算日	2022年7月11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、2022年7月11日に第185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/>

ルミス・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・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 券 組 入 率	債 券 先 物 比	債 券 率	純資産 総額
		(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27 作成期	156期(2020年2月10日)	円 5,908	円 10	% 0.7	280.56	% 1.3	円 109.67	% 1.57	% △0.25	% △0.41	% △0.21	% 95.6	% -	% -	百万円 2,373
	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
第28 作成期	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
	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
第29 作成期	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
	168期(2021年2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
	169期(2021年3月10日)	6,115	10	0.6	293.28	1.7	108.57	1.53	0.37	△0.30	0.15	95.7	-	-	2,216
	170期(2021年4月12日)	6,182	10	1.3	295.26	0.7	109.75	1.66	0.13	△0.30	△0.00	96.2	-	-	2,225
第30 作成期	171期(2021年5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
	172期(2021年6月10日)	6,258	10	1.2	301.03	1.7	109.65	1.49	△0.09	△0.24	△0.03	95.3	-	-	2,231
	173期(2021年7月12日)	6,211	10	△0.6	300.49	△0.2	110.17	1.36	△0.13	△0.29	△0.05	95.4	-	-	2,203
	174期(2021年8月10日)	6,201	10	0.0	301.84	0.5	110.36	1.32	△0.04	△0.46	△0.17	95.7	-	-	2,195
	175期(2021年9月10日)	6,168	10	△0.4	301.31	△0.2	109.78	1.30	△0.03	△0.36	0.10	96.6	-	-	2,171
第31 作成期	176期(2021年10月11日)	6,145	10	△0.2	300.59	△0.2	112.30	1.61	0.31	△0.15	0.21	95.0	-	-	2,134
	177期(2021年11月10日)	6,223	10	1.4	307.10	2.2	112.86	1.44	△0.18	△0.30	△0.15	95.9	-	-	2,152
	178期(2021年12月10日)	6,145	10	△1.1	304.58	△0.8	113.47	1.50	0.06	△0.35	△0.06	97.3	-	-	2,113
	179期(2022年1月11日)	6,154	5	0.2	304.68	0.0	115.34	1.76	0.26	△0.03	0.32	94.8	-	-	2,110
	180期(2022年2月10日)	6,081	5	△1.1	301.45	△1.1	115.61	1.94	0.18	0.21	0.25	96.7	-	-	2,068
第31 作成期	181期(2022年3月10日)	5,967	5	△1.8	295.45	△2.0	116.01	1.95	0.01	0.22	0.00	96.6	-	-	2,019
	182期(2022年4月11日)	6,192	5	3.9	306.40	3.7	124.63	2.70	0.75	0.71	0.49	94.7	-	-	2,081
	183期(2022年5月10日)	6,126	5	△1.0	307.36	0.3	130.03	3.03	0.33	1.10	0.39	95.0	-	-	2,053
	184期(2022年6月10日)	6,320	5	3.2	316.20	2.9	134.22	3.04	0.01	1.43	0.34	95.6	-	-	2,113
	185期(2022年7月11日)	6,264	5	△0.8	314.06	△0.7	136.47	3.08	0.04	1.35	△0.09	96.2	-	-	2,082

(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・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) 「Bloomberg®」およびブルームバーグ・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）は、Bloomberg Finance L.P.および、同インデックスの管理者である Bloomberg Index Services Limited（以下「BISL」）をはじめとする関連会社（以下、総称して「ブルームバーグ」）のサービスマークであり、アセットマネジメントOne(株)による特定の目的での使用のために使用許諾されています。ブルームバーグはアセットマネジメントOne(株)とは提携しており、また、ルミス・グローバル債券ファンド（毎月決算型）を承認、支持、レビュー、推奨するものではありません。ブルームバーグは、ルミス・グローバル債券ファンド（毎月決算型）に関連するいかなるデータもしくは情報の適時性、正確性、または完全性についても保証しません（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・グローバル総合 (日本円除く)インデックス (海昔ノーハッ ジ・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
		騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		騰落幅	騰落幅						
第180期	(期首) 2022年1月11日	円	%		%	円	%	%	%	%	%	%	%	%
	1月末	6,154	-	304.68	-	115.34	1.76	-	△0.03	-	94.8	-	-	-
	(期末) 2022年2月10日	6,084	△1.1	302.28	△0.8	115.44	1.77	0.01	△0.05	△0.01	95.6	-	-	-
第181期	(期首) 2022年2月10日	6,081	-	301.45	-	115.61	1.94	-	0.21	-	96.7	-	-	-
	2月末	5,989	△1.5	298.14	△1.1	115.55	1.96	0.02	0.23	0.02	96.9	-	-	-
	(期末) 2022年3月10日	5,972	△1.8	295.45	△2.0	116.01	1.95	0.01	0.22	0.00	96.6	-	-	-
第182期	(期首) 2022年3月10日	5,967	-	295.45	-	116.01	1.95	-	0.22	-	96.6	-	-	-
	3月末	6,224	4.3	307.15	4.0	122.39	2.35	0.40	0.65	0.43	96.7	-	-	-
	(期末) 2022年4月11日	6,197	3.9	306.40	3.7	124.63	2.70	0.75	0.71	0.49	94.7	-	-	-
第183期	(期首) 2022年4月11日	6,192	-	306.40	-	124.63	2.70	-	0.71	-	94.7	-	-	-
	4月末	6,217	0.4	307.98	0.5	128.86	2.83	0.13	0.80	0.09	95.0	-	-	-
	(期末) 2022年5月10日	6,131	△1.0	307.36	0.3	130.03	3.03	0.33	1.10	0.39	95.0	-	-	-
第184期	(期首) 2022年5月10日	6,126	-	307.36	-	130.03	3.03	-	1.10	-	95.0	-	-	-
	5月末	6,197	1.2	307.34	△0.0	128.21	2.74	△0.30	1.06	△0.04	95.2	-	-	-
	(期末) 2022年6月10日	6,325	3.2	316.20	2.9	134.22	3.04	0.01	1.43	0.34	95.6	-	-	-
第185期	(期首) 2022年6月10日	6,320	-	316.20	-	134.22	3.04	-	1.43	-	95.6	-	-	-
	6月末	6,300	△0.3	316.98	0.2	136.68	3.09	0.05	1.52	0.09	95.9	-	-	-
	(期末) 2022年7月11日	6,269	△0.8	314.06	△0.7	136.47	3.08	0.04	1.35	△0.09	96.2	-	-	-

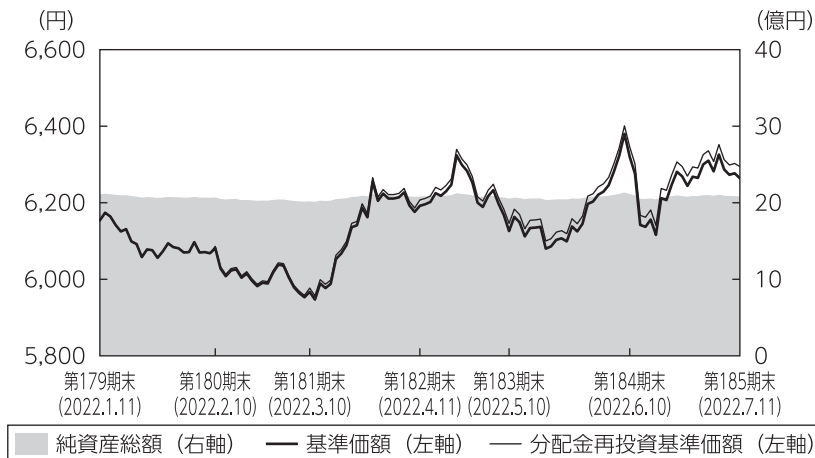
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率および騰落幅は期首比です。

(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180期～第185期の運用経過（2022年1月12日から2022年7月11日まで）

基準価額等の推移



第180期首： 6,154円
第185期末： 6,264円
(既払分配金30円)
騰落率： 2.3%
(分配金再投資ベース)

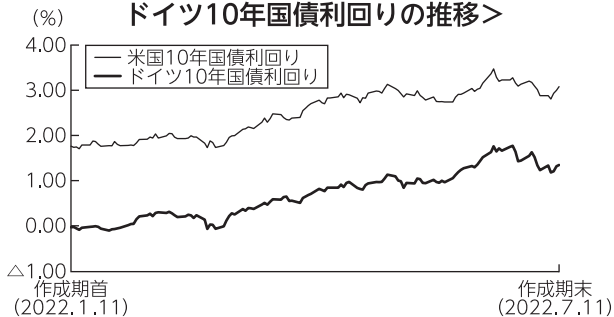
- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

基準価額の主な変動要因

「ルミス・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、米ドルなどの通貨が対円で上昇したことなどから、基準価額（税引前分配金再投資ベース）は上昇しました。

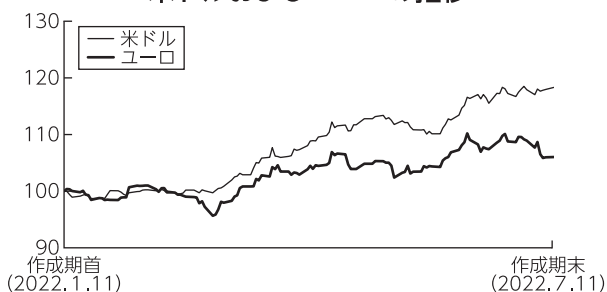
投資環境

<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>



(注) 値は前営業日のものを用いております。

<米ドルおよびユーロの推移>



(注) 作成期首の値を100として指数化しています。

米国国債市場は、3月にかけてのF R B（米連邦準備制度理事会）による早期利上げ観測の高まりやそれに伴う利上げの実施、またその後の金融引締め加速に対する積極的な姿勢などを受け下落（利回りは上昇）しました。ドイツ国債市場は、E C B（欧州中央銀行）による金融政策の早期正常化観測が高まったことなどから下落しました。投資適格社債市場は、米国、欧州ともに下落しました。信用スプレッドは、米国、欧州ともに全般的に拡大しました。

先進国の高利回り債市場、新興国の公社債市場はともに下落しました。

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、F R Bによる利上げの実施観測や、米長期金利の上昇、日銀が金利上昇を抑制する姿勢を明確に示すなど、日米の金融政策に対する姿勢の違いが意識されたことなどが上昇要因となりました。ユーロは、E C Bの金融政策正常化観測などが上昇要因となりました。

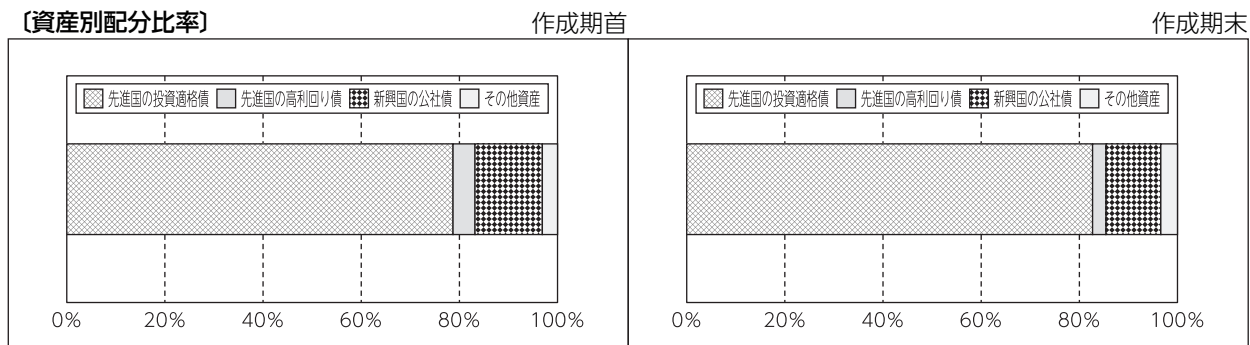
ポートフォリオについて

●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。上記の通り運用を行った結果、米ドルなどの通貨が対円で上昇したことから、基準価額は上昇しました。



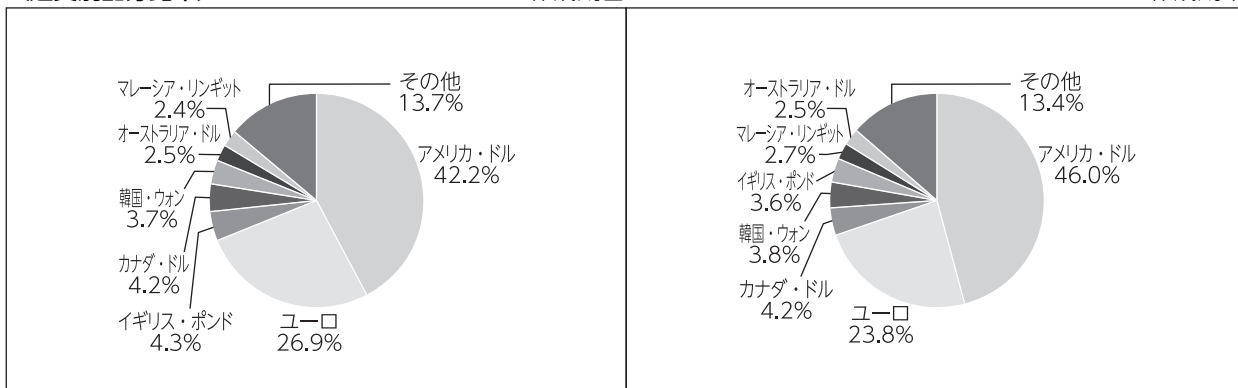
（注1）上記比率は、ルーミス・グローバル債券マザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。

（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。

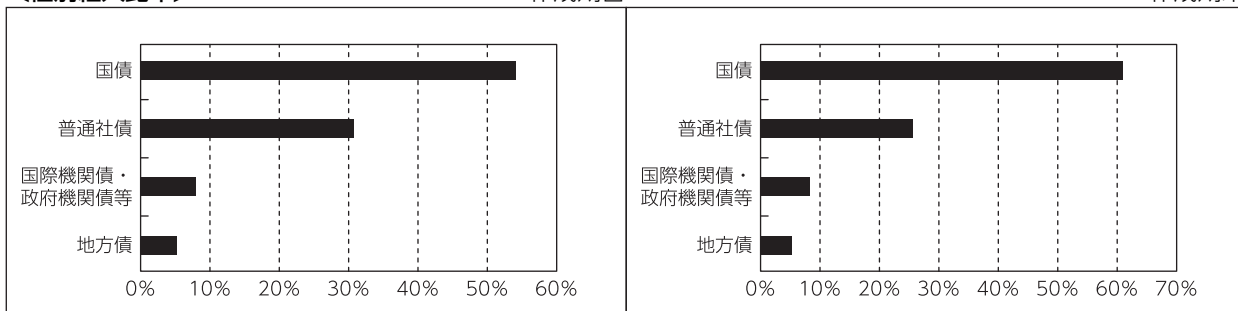
(注2) 現金等はその他として表示しています。

(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

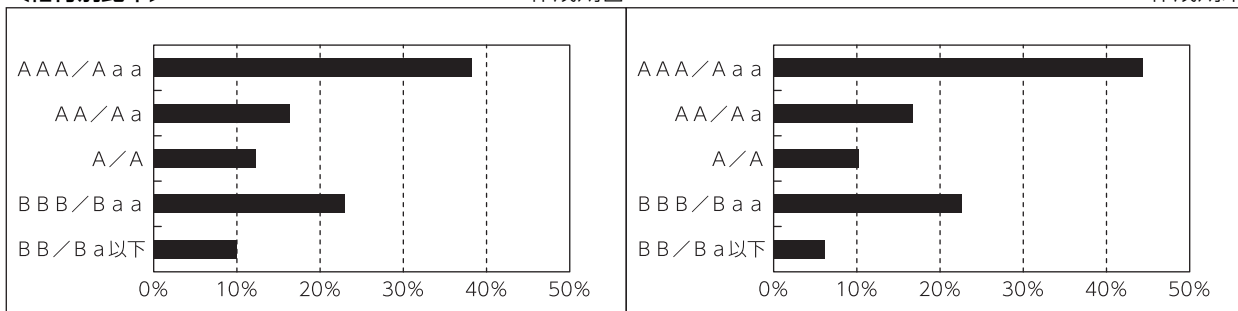


(注) 上記比率は、ルーミス・グローバル債券マザーファンドの債券部分に対する評価額の割合です。

〔格付別比率〕

作成期首

作成期末



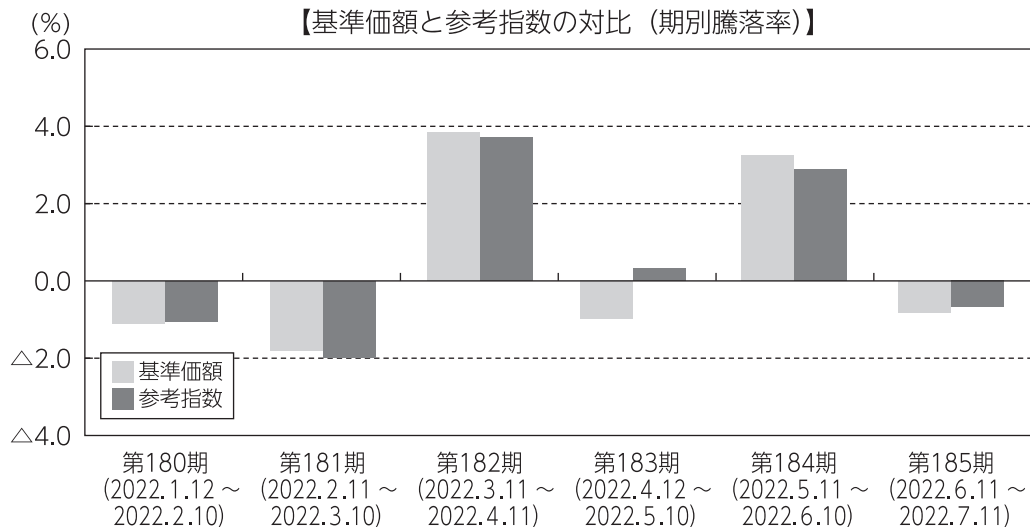
(注1) 上記比率は、ルーミス・グローバル債券マザーファンドの債券部分に対する評価額の割合です。

(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、BB/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180期	第181期	第182期	第183期	第184期	第185期
	2022年1月12日 ～2022年2月10日	2022年2月11日 ～2022年3月10日	2022年3月11日 ～2022年4月11日	2022年4月12日 ～2022年5月10日	2022年5月11日 ～2022年6月10日	2022年6月11日 ～2022年7月11日
当期分配金（税引前）	5円	5円	5円	5円	5円	5円
対基準価額比率	0.08%	0.08%	0.08%	0.08%	0.08%	0.08%
当期の収益	2円	3円	5円	3円	5円	5円
当期の収益以外	2円	1円	-円	1円	-円	-円
翌期繰越分配対象額	165円	163円	171円	170円	177円	177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

足もと、インフレの高止まりや、ウクライナ情勢をめぐる警戒感が継続していること等に、引き続き留意が必要と考えています。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180期～第185期		項目の概要
	(2022年1月12日 ～2022年7月11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6,146円です。
(投信会社)	(29)	(0.464)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、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種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(2)	(0.027)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) その他費用	2	0.029	(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)	(0.028)	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	0.847	

(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。

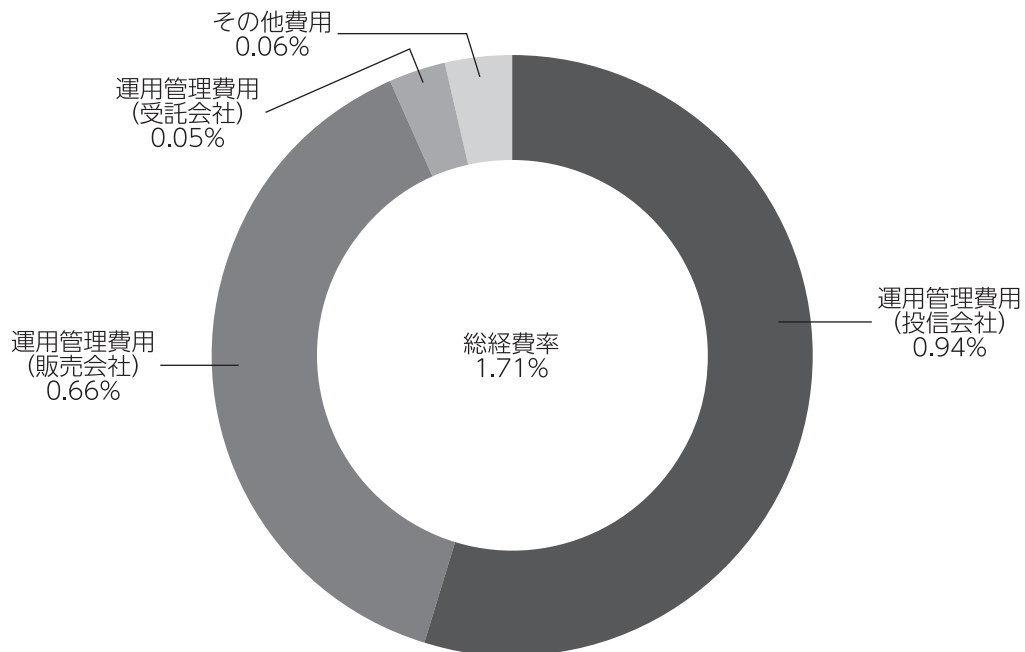
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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（2022年1月12日から2022年7月11日まで）

	第 180 期 ~ 第 185 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 33,777	千円 56,000

■利害関係人との取引状況等（2022年1月12日から2022年7月11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30作成期末	第31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 1,265,955	千口 1,232,178	千円 2,072,400

■投資信託財産の構成

2022年7月11日現在

項 目	第31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 2,072,400	% 99.2
コーラル・ローン等、その他	17,099	0.8
投資信託財産総額	2,089,499	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、2,069,964千円、99.3%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、2022年7月11日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=136.47円、1カナダ・ドル=105.35円、1オーストラリア・ドル=93.35円、1シンガポール・ドル=97.49円、1ニュージーランド・ドル=84.31円、1イギリス・ポンド=163.89円、1スイス・フラン=139.47円、1トルコ・リラ=7.91円、1デンマーク・クローネ=18.62円、1ノルウェー・クローネ=13.51円、1スウェーデン・クローナ=12.92円、1メキシコ・ペソ=6.67円、1アルゼンチン・ペソ=1.076円、100コロンビア・ペソ=3.10円、100インドネシア・ルピア=0.91円、1ブラジル・リアル=25.957円、1チェコ・コルナ=5.628円、100韓国・ウォン=10.53円、1マレーシア・リンギット=30.83円、1南アフリカ・ランド=8.10円、1タイ・バーツ=3.80円、1ポーランド・ズロチ=29.052円、100ハンガリー・フォリント=34.178円、1ユーロ=138.59円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年2月10日)、 (2022年3月10日)、 (2022年4月11日)、 (2022年5月10日)、 (2022年6月10日)、 (2022年7月11日)現在

項 目	第180期末	第181期末	第182期末	第183期末	第184期末	第185期末
(A)資 産	2,076,118,021円	2,023,643,908円	2,087,043,958円	2,058,076,050円	2,118,799,776円	2,089,499,756円
コーラル・ローン等	31,852,486	13,685,777	52,348,102	41,123,560	32,352,436	17,099,247
ルーミス・グローバル債券マザーファンド(評価額)	2,044,265,535	2,009,958,131	2,034,695,856	2,016,952,490	2,086,447,340	2,072,400,509
(B)負 債	8,049,577	4,277,959	5,297,607	4,545,956	5,203,287	7,035,637
未払収益分配金	1,700,445	1,692,044	1,681,017	1,676,180	1,672,275	1,662,297
未払解約金	3,520,640	-	619,300	123,360	632,300	2,446,470
未払信託報酬	2,822,318	2,580,267	2,990,750	2,740,418	2,892,384	2,920,484
その他未払費用	6,174	5,648	6,540	5,998	6,328	6,386
(C)純資産総額(A-B)	2,068,068,444	2,019,365,949	2,081,746,351	2,053,530,094	2,113,596,489	2,082,464,119
元 本	3,400,891,582	3,384,089,738	3,362,035,112	3,352,360,650	3,344,550,009	3,324,594,842
次期繰越損益金	△1,332,823,138	△1,364,723,789	△1,280,288,761	△1,298,830,556	△1,230,953,520	△1,242,130,723
(D)受益権総口数	3,400,891,582口	3,384,089,738口	3,362,035,112口	3,352,360,650口	3,344,550,009口	3,324,594,842口
1万口当たり基準価額(C/D)	6,081円	5,967円	6,192円	6,126円	6,320円	6,264円

(注) 第179期末における元本額は3,429,438,525円、当作成期間(第180期～第185期)中における追加設定元本額は1,153,285円、同解約元本額は105,996,968円です。

■損益の状況

[自 2022年1月12日] [自 2022年2月11日] [自 2022年3月11日] [自 2022年4月12日] [自 2022年5月11日] [自 2022年6月11日]
 [至 2022年2月10日] [至 2022年3月10日] [至 2022年4月11日] [至 2022年5月10日] [至 2022年6月10日] [至 2022年7月11日]

項 目	第180期	第181期	第182期	第183期	第184期	第185期
(A)配 当 等 収 益	△315円	△130円	△30円	△405円	△469円	△481円
受 取 利 息	-	-	-	-	-	2
支 払 利 息	△315	△130	△30	△405	△469	△483
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△20,231,886	△34,207,092	80,219,224	△17,803,037	69,422,378	△13,932,062
売 買 益	149,019	95,829	80,737,359	327	69,494,850	107,314
売 買 損	△20,380,905	△34,302,921	△518,135	△17,803,364	△72,472	△14,039,376
(C)信 託 報 酬 等	△2,828,492	△2,585,915	△2,997,290	△2,746,416	△2,898,712	△2,926,870
(D)当 期 損 益 金 (A + B + C)	△23,060,693	△36,793,137	77,221,904	△20,549,858	66,523,197	△16,859,413
(E)前 期 繰 越 損 益 金	△1,078,089,787	△1,097,338,587	△1,128,356,262	△1,049,727,220	△1,069,395,341	△998,496,654
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	△229,972,213	△228,900,021	△227,473,386	△226,877,298	△226,409,101	△225,112,359
(配 当 等 相 当 額)	(31,889,899)	(31,733,921)	(31,528,602)	(31,439,493)	(31,367,816)	(31,182,339)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△261,862,112)	(△260,633,942)	(△259,001,988)	(△258,316,791)	(△257,776,917)	(△256,294,698)
(G)合 計 (D + E + F)	△1,331,122,693	△1,363,031,745	△1,278,607,744	△1,297,154,376	△1,229,281,245	△1,240,468,426
(H)収 益 分 配 金	△1,700,445	△1,692,044	△1,681,017	△1,676,180	△1,672,275	△1,662,297
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	△1,332,823,138	△1,364,723,789	△1,280,288,761	△1,298,830,556	△1,230,953,520	△1,242,130,723
追 加 信 託 差 損 益 金	△229,972,213	△228,900,021	△227,473,386	△226,877,298	△226,409,101	△225,112,359
(配 当 等 相 当 額)	(31,890,045)	(31,734,055)	(31,528,771)	(31,439,622)	(31,367,982)	(31,182,501)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△261,862,258)	(△260,634,076)	(△259,002,157)	(△258,316,920)	(△257,777,083)	(△256,294,860)
分 配 準 備 積 立 金	24,522,291	23,741,338	26,154,945	25,623,032	28,088,000	27,948,447
繰 越 損 益 金	△1,127,373,216	△1,159,565,106	△1,078,970,320	△1,097,576,290	△1,032,632,419	△1,044,966,811

(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180期から第185期まではルーマス・グローバル債券マザーファンド5,066,470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180期	第181期	第182期	第183期	第184期	第185期
(a)経費控除後の配当等収益	919,159円	1,033,661円	4,250,713円	1,220,987円	4,198,387円	1,691,848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	31,890,045	31,734,055	31,528,771	31,439,622	31,367,982	31,182,501
(d)分 配 準 備 積 立 金	25,303,577	24,399,721	23,585,249	26,078,225	25,561,888	27,918,896
(e)当 期 分 配 対 象 額 (a + b + c + d)	58,112,781	57,167,437	59,364,733	58,738,834	61,128,257	60,793,245
(f)1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	170.88	168.93	176.57	175.22	182.77	182.86
(g)分 配 金	1,700,445	1,692,044	1,681,017	1,676,180	1,672,275	1,662,297
(h)1 万 口 当 たり 分 配 金	5	5	5	5	5	5

■分配金のお知らせ

決算期	第180期	第181期	第182期	第183期	第184期	第185期
1万口当たり分配金	5円	5円	5円	5円	5円	5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31期（決算日 2022年7月11日）

（計算期間 2022年1月12日～2022年7月11日）

ルーミス・グローバル債券マザーファンドの第31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・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	純資産総額
	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					
27期 (2020年7月10日)	円	%		%	円	%	%	%	%	%	%	%	%	百万円
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
30期 (2022年1月11日)	16,309	0.9	304.68	1.4	115.34	1.76	0.40	△0.03	0.26	96.9	-	-	-	2,064
31期 (2022年7月11日)	16,819	3.1	314.06	3.1	136.47	3.08	1.32	1.35	1.38	96.6	-	-	-	2,072

(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・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) 「Bloomberg®」およびブルームバーグ・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）は、Bloomberg Finance L.P.および、同インデックスの管理者であるBloomberg Index Services Limited（以下「BISL」）をはじめとする関連会社（以下、総称して「ブルームバーグ」）のサービスマークであり、アセットマネジメントOne®による特定の目的での使用のために使用許諾されています。ブルームバーグはアセットマネジメントOne®とは提携しておらず、また、ルーミス・グローバル債券マザーファンドを承認、支持、レビュー、推奨するものではありません。ブルームバーグは、ルーミス・グローバル債券マザーファンドに関連するいかなるデータもしくは情報の適時性、正確性、または完全性についても保証しません（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）。

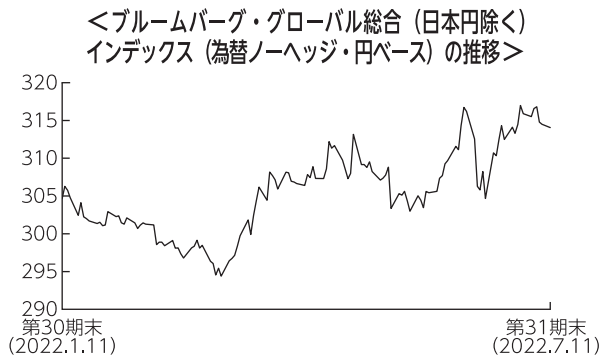
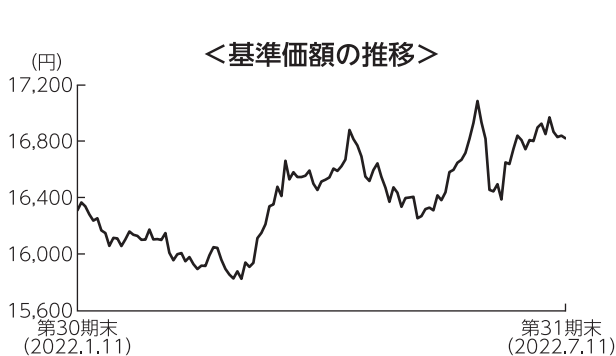
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基準価額		ブルームバーグ・グローバル総合 (日本円除く)インデックス (為替/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		債券 組入比率	債券 先物比率
		騰落率		騰落率			騰落幅		騰落幅		
(期首) 2022年1月11日	円	%		%	円	%	%	%	%	%	%
	16,309	—	304.68	—	115.34	1.76	—	△0.03	—	96.9	—
1月末	16,136	△1.1	302.28	△0.8	115.44	1.77	0.01	△0.05	△0.01	97.0	—
2月末	15,915	△2.4	298.14	△2.1	115.55	1.96	0.20	0.23	0.27	97.5	—
3月末	16,579	1.7	307.15	0.8	122.39	2.35	0.59	0.65	0.68	96.9	—
4月末	16,594	1.7	307.98	1.1	128.86	2.83	1.07	0.80	0.84	96.9	—
5月末	16,580	1.7	307.34	0.9	128.21	2.74	0.98	1.06	1.09	96.7	—
6月末	16,896	3.6	316.98	4.0	136.68	3.09	1.33	1.52	1.55	96.6	—
(期末) 2022年7月11日	16,819	3.1	314.06	3.1	136.47	3.08	1.32	1.35	1.38	96.6	—

(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 (2022年1月12日から2022年7月11日まで)



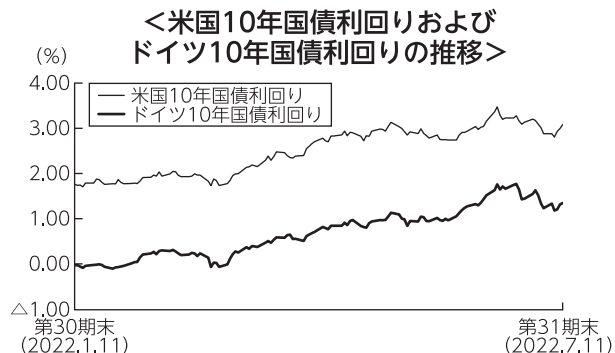
基準価額の推移

当ファンドの基準価額は、前期末比で3.1%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、米ドルなどの通貨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

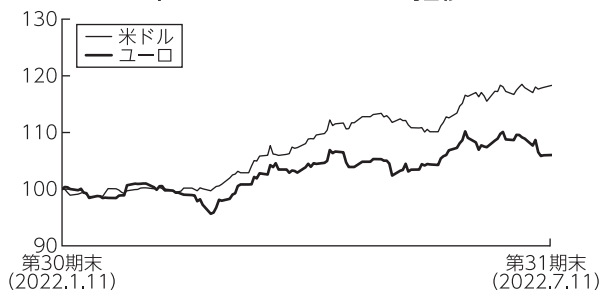


(注) 値は前営業日のものを用いております。

米国国債市場は、3月にかけてのF R B (米連邦準備制度理事会) による早期利上げ観測の高まりやそれに伴う利上げの実施、またその後の金融引締め加速に対する積極的な姿勢などを受け下落 (利回りは上昇) しました。ドイツ国債市場は、E C B (欧州中央銀行) による金融政策の早期正常化観測が高まったことなどから下落しました。投資適格社債市場は、米国、欧州ともに下落しました。信用スプレッドは、米国、欧州ともに全般的に拡大しました。

先進国の高利回り債市場、新興国の公社債市場はともに下落しました。

<米ドルおよびユーロの推移>

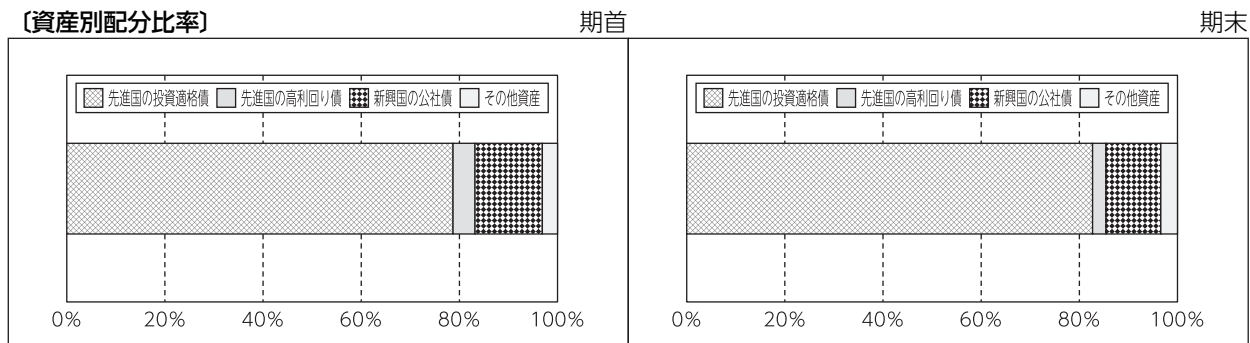


(注) 期首の値を100として指数化しています。

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、F R Bによる利上げの実施観測や、米長期金利の上昇、日銀が金利上昇を抑制する姿勢を明確に示すなど、日米の金融政策に対する姿勢の違いが意識されたことなどが上昇要因となりました。ユーロは、E C Bの金融政策正常化観測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。上記の通り運用を行った結果、米ドルなどの通貨が対円で上昇したことから、基準価額は上昇しました。



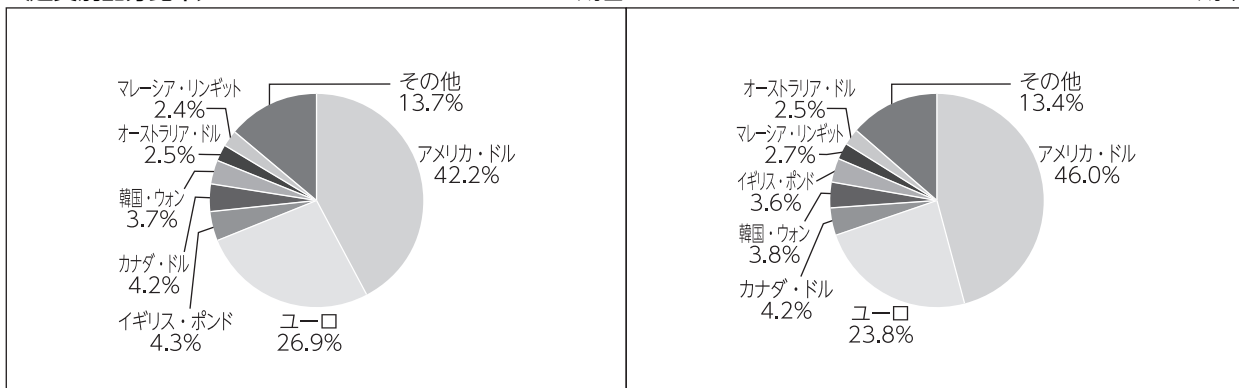
(注1) 上記比率は、ルーミス・グローバル債券マザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。

(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〕

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。

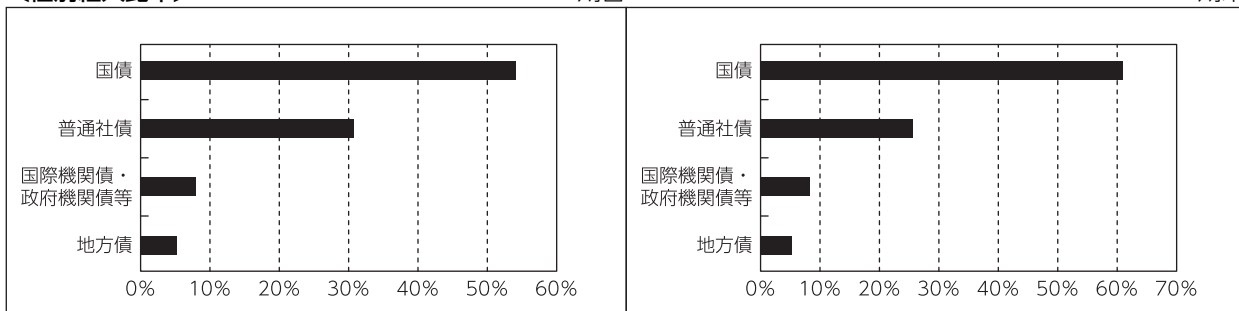
(注2) 現金等はその他として表示しています。

(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

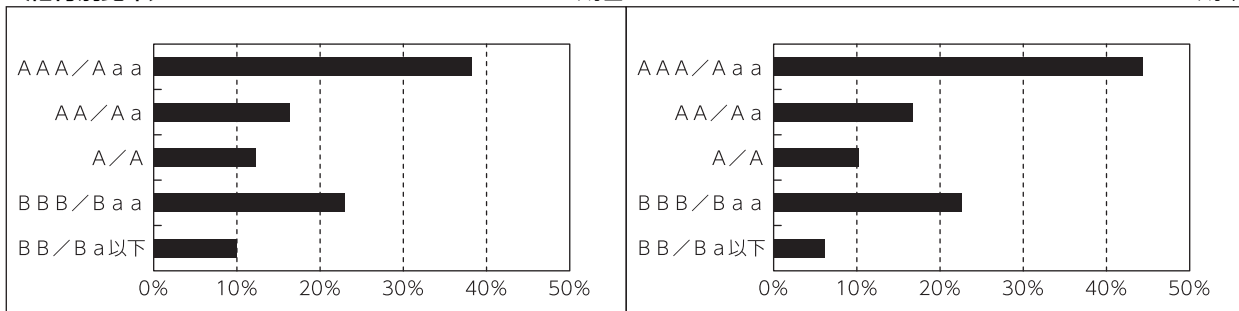


(注) 上記比率は、ルーミス・グローバル債券マザーファンドの債券部分に対する評価額の割合です。

〔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。

(注3) 無格付銘柄については、BB/Ba以下に含めて表示しています。

今後の運用方針

足もと、インフレの高止まりや、ウクライナ情勢をめぐる警戒感が継続していること等に、引き続き留意が必要と考えています。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)	0.028% (0.028)	(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	0.028	
期中の平均基準価額は16,391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 (2022年1月12日から2022年7月11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 4,340	千アメリカ・ドル 3,475 (-)
		社債証券	475	1,062 (7)
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル -	千カナダ・ドル 24 (-)
		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 26 (-)
	ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランド・ドル 257	千ニュージーランド・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 22 (-)
	国	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ -
ブラジル		国債証券	千ブラジル・リアル -	千ブラジル・リアル 844 (-)

			買付額	売付額	
			千ユーロ	千ユーロ	
外 国	ユ ー ロ 区	ジャージー	社債券	—	81 (—)
		イギリス	特殊債券	—	100 (—)
			社債券	—	94 (—)
		ルクセンブルグ	社債券	92	— (—)
		フランス	国債証券	142	— (—)
		ドイツ	国債証券	556	618 (—)
			社債券	4	32 (—)
ケイマン諸島	社債券	—	— (123)		

(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 (2022年1月12日から2022年7月11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 7,722	千アメリカ・ドル 6,978	千円 952,327	% 46.0	% 3.3	% 23.3	% 15.8	% 6.8
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 960	千カナダ・ドル 822	千円 86,617	4.2	—	1.6	1.4	1.2
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 570	千オーストラリア・ドル 549	千円 51,268	2.5	—	2.1	0.4	—
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 431	千円 42,090	2.0	—	—	2.0	—
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 280	千ニュージーランド・ドル 291	千円 24,588	1.2	—	—	1.0	0.2
イギリス	千イギリス・ポンド 440	千イギリス・ポンド 456	千円 74,739	3.6	—	2.7	0.9	—
スイス	千スイス・フラン 155	千スイス・フラン 151	千円 21,061	1.0	—	—	1.0	—
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 130	千ノルウェー・クローネ 126	千円 1,714	0.1	—	—	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 2,477	千円 32,011	1.5	—	—	—	1.5
メキシコ	千メキシコ・ペソ 876	千メキシコ・ペソ 858	千円 5,726	0.3	—	—	—	0.3
コロンビア	千コロンビア・ペソ 393,800	千コロンビア・ペソ 347,284	千円 10,765	0.5	—	—	0.5	—
インドネシア	千インドネシア・ルピア 3,619,000	千インドネシア・ルピア 3,763,879	千円 34,251	1.7	—	1.7	—	—
ブラジル	千ブラジル・レアル 625	千ブラジル・レアル 564	千円 14,646	0.7	0.7	—	0.7	—
韓国	千韓国・ウォン 834,280	千韓国・ウォン 756,162	千円 79,623	3.8	—	2.2	1.3	0.4
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 1,784	千円 55,026	2.7	—	—	2.2	0.5
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 1,640	千南アフリカ・ランド 1,284	千円 10,401	0.5	0.5	0.5	—	—
タイ	千タイ・バーツ 2,295	千タイ・バーツ 2,146	千円 8,157	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 122	千円 3,547	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 円	千 円	千 円	%	%	%	%	%
ユ ー ロ								
アイルランド	245	230	31,933	1.5	—	0.9	0.7	—
オランダ	100	91	12,735	0.6	—	—	0.6	—
ベルギー	100	97	13,542	0.7	—	—	0.7	—
ルクセンブルグ	100	80	11,181	0.5	—	0.5	—	—
フランス	380	337	46,842	2.3	—	1.8	0.5	—
ドイツ	1,905	1,775	246,116	11.9	1.4	5.9	6.0	—
スペイン	305	305	42,379	2.0	—	2.0	—	—
イタリア	430	383	53,202	2.6	—	2.6	—	—
カナダ	265	260	36,160	1.7	—	—	1.7	—
合 計	—	—	千円 2,002,660	96.6	5.9	48.2	37.7	10.8

(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)							
BRAZIL 4.625 01/13/28	国債証券	4.6250	200	187	25,624	2028/01/13	
REPUBLIC OF CHILE 2.45 01/31/31	国債証券	2.4500	200	170	23,297	2031/01/31	
US T N/B 1.5 01/31/27	国債証券	1.5000	490	455	62,189	2027/01/31	
US T N/B 0.375 01/31/26	国債証券	0.3750	105	95	12,981	2026/01/31	
US T N/B 2.25 02/15/52	国債証券	2.2500	250	201	27,501	2052/02/15	
US T N/B 1.875 02/15/51	国債証券	1.8750	50	36	5,008	2051/02/15	
US T N/B 0.5 02/28/26	国債証券	0.5000	320	290	39,651	2026/02/28	
US T N/B 2.75 04/30/27	国債証券	2.7500	1,010	992	135,406	2027/04/30	
US T N/B 1.25 05/15/50	国債証券	1.2500	110	68	9,329	2050/05/15	
US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	1.6250	35	31	4,236	2031/05/15	
US T N/B 2.5 05/31/24	国債証券	2.5000	335	331	45,176	2024/05/31	
US T N/B 1.75 08/15/41	国債証券	1.7500	300	224	30,593	2041/08/15	
US T N/B 0.875 09/30/26	国債証券	0.8750	235	213	29,174	2026/09/30	
US T N/B 1.625 11/15/50	国債証券	1.6250	65	44	6,099	2050/11/15	
US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	0.8750	65	54	7,436	2030/11/15	
US T N/B 0.75 12/31/23	国債証券	0.7500	80	77	10,544	2023/12/31	
US T N/B 1.375 12/31/28	国債証券	1.3750	90	80	11,007	2028/12/31	

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	
SP POWERASSETS LTD 2.7 09/14/22	特 殊 債 券	2.7000	200	199	27,275	2022/09/14
ECOPETROL SA 4.625 11/02/31	特 殊 債 券	4.6250	45	34	4,731	2031/11/02
JPMORGAN CHASE & CO 3.2 01/25/23	社 債 券	3.2000	180	180	24,584	2023/01/25
UNITED AIR 2016-1 B PTT 3.65 01/07/26	社 債 券	3.6500	27	25	3,424	2026/01/07
SUZANO AUSTRIA G 3.125 01/15/32	社 債 券	3.1250	5	3	520	2032/01/15
CONTINENTAL RESOURCES 4.375 01/15/28	社 債 券	4.3750	40	37	5,110	2028/01/15
EQT CORP 5.0 01/15/29	社 債 券	5.0000	10	9	1,308	2029/01/15
CONTINENTAL RESOURCES 5.75 01/15/31	社 債 券	5.7500	50	47	6,495	2031/01/15
AMERICAN TOWER CORP 2.9 01/15/30	社 債 券	2.9000	30	25	3,501	2030/01/15
SUZANO AUSTRIA GMBH 3.75 01/15/31	社 債 券	3.7500	45	36	5,013	2031/01/15
T-MOBILE USA INC 3.3 02/15/51	社 債 券	3.3000	15	11	1,509	2051/02/15
TOLL BROS FINANCE CORP 4.35 02/15/28	社 債 券	4.3500	85	77	10,643	2028/02/15
BOEING CO 3.625 02/01/31	社 債 券	3.6250	50	43	5,922	2031/02/01
T-MOBILE USA INC 4.75 02/01/28	社 債 券	4.7500	90	87	11,968	2028/02/01
BOEING CO 3.75 02/01/50	社 債 券	3.7500	25	17	2,357	2050/02/01
DCP MIDSTREAM OPERATING 3.25 02/15/32	社 債 券	3.2500	20	15	2,167	2032/02/15
BOEING CO 3.25 02/01/28	社 債 券	3.2500	80	71	9,755	2028/02/01
CENTENE CORP 3.375 02/15/30	社 債 券	3.3750	65	57	7,782	2030/02/15
BOEING CO 2.196 02/04/26	社 債 券	2.1960	5	4	616	2026/02/04
BOEING CO 3.825 03/01/59	社 債 券	3.8250	5	3	441	2059/03/01
CF INDUSTRIES INC 5.15 03/15/34	社 債 券	5.1500	10	9	1,327	2034/03/15
COMCAST CORP 4.0 03/01/48	社 債 券	4.0000	15	13	1,800	2048/03/01
MAGALLANES INC 5.05 03/15/42	社 債 券	5.0500	45	38	5,249	2042/03/15
QUICKEN LOANS LLC/QUICKN 3.875 03/01/31	社 債 券	3.8750	70	55	7,640	2031/03/01
CF INDUSTRIES INC 5.375 03/15/44	社 債 券	5.3750	15	13	1,898	2044/03/15
HCA INC 3.625 03/15/32	社 債 券	3.6250	140	118	16,224	2032/03/15
MAGALLANES INC 4.279 03/15/32	社 債 券	4.2790	50	44	6,114	2032/03/15
CENTENE CORP 2.5 03/01/31	社 債 券	2.5000	50	40	5,576	2031/03/01
FREEMPORT-MCMORAN INC 4.25 03/01/30	社 債 券	4.2500	15	13	1,855	2030/03/01
QUICKEN LOANS LLC/QUICKN 3.625 03/01/29	社 債 券	3.6250	35	28	3,900	2029/03/01
ALLY FINANCIAL INC 4.625 03/30/25	社 債 券	4.6250	10	9	1,355	2025/03/30
ENERGY TRANSFER PARTNERS 5.3 04/15/47	社 債 券	5.3000	25	21	2,939	2047/04/15
CHARTER COMM OPT LLC/CAP 3.7 04/01/51	社 債 券	3.7000	75	51	7,012	2051/04/01
CONTINENTAL RESOURCES 2.875 04/01/32	社 債 券	2.8750	10	7	1,065	2032/04/01
BROADCOM INC 3.469 04/15/34	社 債 券	3.4690	75	60	8,301	2034/04/15
DPL INC 4.35 04/15/29	社 債 券	4.3500	30	26	3,559	2029/04/15
UNITED AIRLINES INC 4.375 04/15/26	社 債 券	4.3750	15	13	1,894	2026/04/15
T-MOBILE USA INC 3.875 04/15/30	社 債 券	3.8750	55	51	7,036	2030/04/15
NEW YORK LIFE INSURANCE 3.75 05/15/50	社 債 券	3.7500	50	41	5,614	2050/05/15
CONSTELLATION BRANDS INC 3.75 05/01/50	社 債 券	3.7500	15	12	1,640	2050/05/01
UNITEDHEALTH GROUP INC 2.9 05/15/50	社 債 券	2.9000	10	7	1,017	2050/05/15

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	
EQT CORP 3.625 05/15/31	社 債 券	3.6250	75	65	8,924	2031/05/15
BOEING CO 3.9 05/01/49	社 債 券	3.9000	15	10	1,445	2049/05/01
ALLY FINANCIAL INC 3.875 05/21/24	社 債 券	3.8750	5	4	675	2024/05/21
ALLY FINANCIAL INC 5.8 05/01/25	社 債 券	5.8000	5	5	698	2025/05/01
BOEING CO 2.25 06/15/26	社 債 券	2.2500	5	4	613	2026/06/15
CF INDUSTRIES INC 4.95 06/01/43	社 債 券	4.9500	10	8	1,205	2043/06/01
FORD FOUNDATION/THE 3.859 06/01/47	社 債 券	3.8590	65	59	8,172	2047/06/01
AT&T 3.65 06/01/51	社 債 券	3.6500	95	74	10,210	2051/06/01
GREAT-WEST LIFECO FINANC 4.15 06/03/47	社 債 券	4.1500	45	38	5,288	2047/06/03
ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR 4.5 06/01/50	社 債 券	4.5000	50	45	6,222	2050/06/01
ARES CAPITAL CORP 2.875 06/15/28	社 債 券	2.8750	25	20	2,733	2028/06/15
DELTA AIRLINES 2015B 4.25 07/30/23	社 債 券	4.2500	36	35	4,896	2023/07/30
CROWN CASTLE INTL CORP 4.15 07/01/50	社 債 券	4.1500	10	8	1,132	2050/07/01
AES CORP/THE 3.95 07/15/30	社 債 券	3.9500	20	17	2,452	2030/07/15
CONSTELLATION BRANDS INC 3.15 08/01/29	社 債 券	3.1500	100	90	12,310	2029/08/01
CVS HEALTH CORP 3.25 08/15/29	社 債 券	3.2500	30	27	3,756	2029/08/15
OVINTIV INC 6.5 08/15/34	社 債 券	6.5000	11	11	1,538	2034/08/15
VMWARE INC 2.2 08/15/31	社 債 券	2.2000	70	54	7,491	2031/08/15
FREEMPORT-MCMORAN INC 4.625 08/01/30	社 債 券	4.6250	110	101	13,892	2030/08/01
BANK OF AMERICA CORP 4.2 08/26/24	社 債 券	4.2000	245	245	33,496	2024/08/26
ENEL FINANCE INTL NV 6.8 09/15/37	社 債 券	6.8000	155	169	23,145	2037/09/15
VERIZON COMMUNICATIONS 2.85 09/03/41	社 債 券	2.8500	10	7	1,027	2041/09/03
BANK OF AMERICA CORP 09/21/36	社 債 券	2.4820	5	3	529	2036/09/21
BANCO SANTANDER CHILE 3.875 09/20/22	社 債 券	3.8750	200	200	27,422	2022/09/20
CVS HEALTH CORP 2.125 09/15/31	社 債 券	2.1250	110	89	12,196	2031/09/15
T-MOBILE USA INC 3.4 10/15/52	社 債 券	3.4000	10	7	1,016	2052/10/15
UNITED AIR 2016-2 B PTT 3.65 10/07/25	社 債 券	3.6500	52	46	6,373	2025/10/07
ROCKETMTGE CO-ISSUER INC 4.0 10/15/33	社 債 券	4.0000	20	15	2,091	2033/10/15
CENTENE CORP 3.0 10/15/30	社 債 券	3.0000	105	89	12,196	2030/10/15
DELTA AIR LINES/SKYMILES 4.75 10/20/28	社 債 券	4.7500	115	109	14,891	2028/10/20
BOEING CO 3.85 11/01/48	社 債 券	3.8500	5	3	475	2048/11/01
CENTENE CORP 4.625 12/15/29	社 債 券	4.6250	80	76	10,388	2029/12/15
小 計	—	—	7,722	6,978	952,327	—
(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	55	53	5,658	2023/05/01
CANADA 2.25 06/01/29	国 債 証 券	2.2500	170	159	16,833	2029/06/01
ONTARIO (PROVINCE OF) 1.9 12/02/51	地 方 債 証 券	1.9000	250	153	16,203	2051/12/02
IBRD 1.2 07/22/26	特 殊 債 券	1.2000	305	278	29,303	2026/07/22
PSP CAPITAL INC 2.09 11/22/23	特 殊 債 券	2.0900	180	176	18,617	2023/11/22
小 計	—	—	960	822	86,617	—

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	117	10,956	2030/02/20
NEW S WALES TREASURY CRP 4.0 05/20/26	地方債証券	4.0000	80	81	7,592	2026/05/20
QUEENSLAND 2.75 08/20/27	地方債証券	2.7500	365	350	32,719	2027/08/20
小 計	—	—	570	549	51,268	—
(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	320	31,275	2027/03/01
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国債証券	3.0000	110	110	10,814	2024/09/01
小 計	—	—	420	431	42,090	—
(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 4.5 04/15/27	国債証券	4.5000	235	245	20,727	2027/04/15
NEW ZEALAND 5.5 04/15/23	国債証券	5.5000	45	45	3,860	2023/04/15
小 計	—	—	280	291	24,588	—
(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	280	306	50,178	2044/01/22
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国債証券	5.0000	30	32	5,306	2025/03/07
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国債証券	1.5000	45	35	5,824	2047/07/22
ASIAN DEV BANK 1.125 06/10/25	特殊債券	1.1250	85	81	13,430	2025/06/10
小 計	—	—	440	456	74,739	—
(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	151	21,061	2025/11/24
小 計	—	—	155	151	21,061	—
(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 1.75 03/13/25	国債証券	1.7500	130	126	1,714	2025/03/13
小 計	—	—	130	126	1,714	—
(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	2,475	2,477	32,011	2023/11/13
小 計	—	—	2,475	2,477	32,011	—
(メキシコ)		%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円	
MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	国債証券	8.0000	876	858	5,726	2023/12/07
小 計	—	—	876	858	5,726	—
(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	347,284	10,765	2026/08/26
小 計	—	—	393,800	347,284	10,765	—
(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 6.5 02/15/31	国債証券	6.5000	831,000	795,300	7,237	2031/02/15
INDONESIA GOV'T 8.25 05/15/29	国債証券	8.2500	2,788,000	2,968,578	27,014	2029/05/15
小 計	—	—	3,619,000	3,763,879	34,251	—
(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	625	564	14,646	2027/01/01
小 計	—	—	625	564	14,646	—

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	
(韓国)		%	千韓国・ウォン	千韓国・ウォン	千円	
KOREA TREASURY BOND (TAX) 2.375 03/10/23	国債証券	2.3750	74,280	74,189	7,812	2023/03/10
KOREA TREASURY BOND 1.5 03/10/25	国債証券	1.5000	270,000	258,089	27,176	2025/03/10
KOREA TREASURY BOND 1.5 12/10/30	国債証券	1.5000	240,000	206,883	21,784	2030/12/10
KOREA TREASURY BOND 1.375 12/10/29	国債証券	1.3750	250,000	217,000	22,850	2029/12/10
小 計	-	-	834,280	756,162	79,623	-
(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	628	19,376	2027/03/15
MALAYSIA 3.906 07/15/26	国債証券	3.9060	825	825	25,444	2026/07/15
MALAYSIA 3.795 09/30/22	国債証券	3.7950	330	331	10,205	2022/09/30
小 計	-	-	1,785	1,784	55,026	-
(南アフリカ)		%	千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド	千円	
SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	国債証券	7.0000	1,640	1,284	10,401	2031/02/28
小 計	-	-	1,640	1,284	10,401	-
(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	2,146	8,157	2029/12/17
小 計	-	-	2,295	2,146	8,157	-
(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	122	3,547	2026/07/25
小 計	-	-	145	122	3,547	-
(ユーロ… 아일랜드)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	1.0000	100	99	13,839	2026/05/15
IRISH 0.0 10/18/31	国債証券	0.0000	30	25	3,519	2031/10/18
AIB GROUP PLC 05/30/31	社債証券	2.8750	115	105	14,574	2031/05/30
小 計	-	-	245	230	31,933	-
(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	91	12,735	2027/06/21
小 計	-	-	100	91	12,735	-
(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	97	13,542	2025/05/30
小 計	-	-	100	97	13,542	-
(ユーロ… ルクセンブルグ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
LOGICOR FINANCING SARL 1.625 01/17/30	社債証券	1.6250	100	80	11,181	2030/01/17
小 計	-	-	100	80	11,181	-
(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	50	65	9,093	2041/04/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	0.5000	70	68	9,483	2026/05/25
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	国債証券	0.0000	180	149	20,775	2032/05/25
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	国債証券	0.5000	80	54	7,490	2044/06/25
小 計	-	-	380	337	46,842	-

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	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	国債証券	0.5000	340	339	46,985	2025/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	国債証券	0.2500	65	61	8,561	2029/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	国債証券	0.0000	135	124	17,206	2030/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	国債証券	0.0000	140	86	12,034	2052/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	0.0000	170	164	22,828	2026/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	国債証券	1.0000	130	131	18,192	2024/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	420	382	53,079	2030/08/15
COMMERZBANK AG 0.625 05/28/25	特殊債券	0.6250	70	68	9,484	2025/05/28
KFW 0.25 09/15/25	特殊債券	0.2500	195	189	26,319	2025/09/15
FRAPORT AG 1.875 03/31/28	社債証券	1.8750	115	101	14,077	2028/03/31
VOLKSWAGEN FIN SERV AG 3.375 04/06/28	社債証券	3.3750	20	19	2,769	2028/04/06
DEUTSCHE BANK AG 05/19/31	社債証券	5.6250	100	100	13,935	2031/05/19
FRAPORT AG 2.125 07/09/27	社債証券	2.1250	5	4	639	2027/07/09
小 計	—	—	1,905	1,775	246,116	—
(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	141	19,652	2037/01/31
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	1.9500	85	84	11,662	2030/07/30
BANCO SANTANDER SA 0.1 02/27/32	特殊債券	0.1000	100	79	11,064	2032/02/27
小 計	—	—	305	305	42,379	—
(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	430	383	53,202	2030/04/01
小 計	—	—	430	383	53,202	—
(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	163	22,599	2025/01/15
PROVINCE OF ALBERTA 0.625 04/18/25	地方債証券	0.6250	100	97	13,561	2025/04/18
小 計	—	—	265	260	36,160	—
合 計	—	—	—	—	2,002,660	—

■投資信託財産の構成

2022年7月11日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 2,002,660	% 96.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	82,383	4.0
投 資 信 託 財 産 総 額	2,085,044	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、2,069,964千円、99.3%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、2022年7月11日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=136.47円、1カナダ・ドル=105.35円、1オーストラリア・ドル=93.35円、1シンガポール・ドル=97.49円、1ニュージーランド・ドル=84.31円、1イギリス・ポンド=163.89円、1スイス・フラン=139.47円、1トルコ・リラ=7.91円、1デンマーク・クローネ=18.62円、1ノルウェー・クローネ=13.51円、1スウェーデン・クローナ=12.92円、1メキシコ・ペソ=6.67円、1アルゼンチン・ペソ=1.076円、100コロンビア・ペソ=3.10円、100インドネシア・ルピア=0.91円、1ブラジル・リアル=25.957円、1チェコ・コルナ=5.628円、100韓国・ウォン=10.53円、1マレーシア・リングギット=30.83円、1南アフリカ・ランド=8.10円、1タイ・バーツ=3.80円、1ポーランド・ズロチ=29.052円、100ハンガリー・フォリント=34.178円、1ユーロ=138.59円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年7月11日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,085,044,139円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	54,064,380
公 社 債(評価額)	2,002,660,924
未 収 入 金	11,290,927
未 収 利 息	15,966,472
前 払 費 用	1,061,436
(B) 負 債	12,644,536
未 払 金	12,644,536
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	2,072,399,603
元 本	1,232,178,197
次 期 繰 越 損 益 金	840,221,406
(D) 受 益 権 総 口 数	1,232,178,197口
1万口当たり基準価額(C / D)	16,819円

(注1) 期首元本額 1,265,955,868円
追加設定元本額 -円
一部解約元本額 33,777,671円

(注2) 期末における元本の内訳
ルーミス・グローバル債券ファンド(毎月決算型) 1,232,178,197円
期末元本合計 1,232,178,197円

■損益の状況

当期 自2022年1月12日 至2022年7月11日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	26,334,766円
受 取 利 息	26,268,723
そ の 他 収 益 金	66,125
支 払 利 息	△82
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	38,050,009
売 買 益	265,119,551
売 買 損	△227,069,542
(C) そ の 他 費 用	△579,820
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	63,804,955
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	798,638,780
(F) 解 約 差 損 益 金	△22,222,329
(G) 合 計(D + E + F)	840,221,406
次 期 繰 越 損 益 金(G)	840,221,406

(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。