

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186期	<決算日	2022年8月10日>
第187期	<決算日	2022年9月12日>
第188期	<決算日	2022年10月11日>
第189期	<決算日	2022年11月10日>
第190期	<決算日	2022年12月12日>
第191期	<決算日	2023年1月10日>

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「ルーミス・グローバル債券ファンド (毎月決算型)」は、2023年1月10日に第191期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された

販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

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

ルーミス・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 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28 作成期	162期(2020年8月11日)	円 6,096	円 10	% 2.2	286.79	% 1.1	106.17	% 0.64	% △0.00	% △0.48	% △0.01	% 94.2	% -	% -	百万円 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
第29 作成期	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
	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
第30 作成期	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
	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
第31 作成期	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
	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
第32 作成期	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
	186期(2022年8月10日)	6,350	5	1.5	318.56	1.4	135.25	2.78	△0.30	0.92	△0.42	94.9	-	-	2,106
第33 作成期	187期(2022年9月12日)	6,426	5	1.3	321.94	1.1	142.82	3.31	0.53	1.70	0.78	96.0	-	-	2,106
	188期(2022年10月11日)	6,215	5	△3.2	311.97	△3.1	145.77	3.88	0.57	2.34	0.64	96.1	-	-	2,032
	189期(2022年11月10日)	6,302	5	1.5	316.88	1.6	146.41	4.09	0.21	2.17	△0.17	94.6	-	-	2,047
	190期(2022年12月12日)	6,205	5	△1.5	312.86	△1.3	136.76	3.58	△0.51	1.93	△0.24	94.7	-	-	2,010
	191期(2023年1月10日)	6,002	5	△3.2	304.23	△2.8	131.85	3.53	△0.05	2.23	0.30	95.4	-	-	1,941

(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)とは提携しておらず、また、ルーミス・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、ルーミス・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・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
		騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		騰落幅	騰落幅						
第186期	(期首) 2022年7月11日	円	%		%	円	%	%	%	%	%	%	%	%
	7月末	6,264	-	314.06	-	136.47	3.08	-	1.35	-	96.2	-	-	-
	(期末) 2022年8月10日	6,345	1.3	318.46	1.4	134.61	2.68	△0.40	0.83	△0.52	94.4	-	-	-
第187期	(期首) 2022年8月10日	6,355	1.5	318.56	1.4	135.25	2.78	△0.30	0.92	△0.42	94.9	-	-	-
	8月末	6,350	-	318.56	-	135.25	2.78	-	0.92	-	94.9	-	-	-
	(期末) 2022年9月12日	6,301	△0.8	317.11	△0.5	138.63	3.10	0.33	1.51	0.59	94.0	-	-	-
第188期	(期首) 2022年9月12日	6,431	1.3	321.94	1.1	142.82	3.31	0.53	1.70	0.78	96.0	-	-	-
	9月末	6,426	-	321.94	-	142.82	3.31	-	1.70	-	96.0	-	-	-
	(期末) 2022年10月11日	6,232	△3.0	311.97	△3.1	144.81	3.79	0.48	2.18	0.48	96.1	-	-	-
第189期	(期首) 2022年10月11日	6,220	△3.2	311.97	△3.1	145.77	3.88	0.57	2.34	0.64	96.1	-	-	-
	10月末	6,215	-	311.97	-	145.77	3.88	-	2.34	-	96.1	-	-	-
	(期末) 2022年11月10日	6,396	2.9	319.83	2.5	148.26	4.01	0.13	2.10	△0.24	94.3	-	-	-
第190期	(期首) 2022年11月10日	6,307	1.5	316.88	1.6	146.41	4.09	0.21	2.17	△0.17	94.6	-	-	-
	11月末	6,302	-	316.88	-	146.41	4.09	-	2.17	-	94.6	-	-	-
	(期末) 2022年12月12日	6,213	△1.4	311.18	△1.8	138.87	3.74	△0.35	1.92	△0.25	95.0	-	-	-
第191期	(期首) 2022年12月12日	6,210	△1.5	312.86	△1.3	136.76	3.58	△0.51	1.93	△0.24	94.7	-	-	-
	12月末	6,205	-	312.86	-	136.76	3.58	-	1.93	-	94.7	-	-	-
	(期末) 2023年1月10日	5,937	△4.3	300.68	△3.9	132.70	3.81	0.24	2.44	0.51	95.4	-	-	-
		6,007	△3.2	304.23	△2.8	131.85	3.53	△0.05	2.23	0.30	95.4	-	-	-

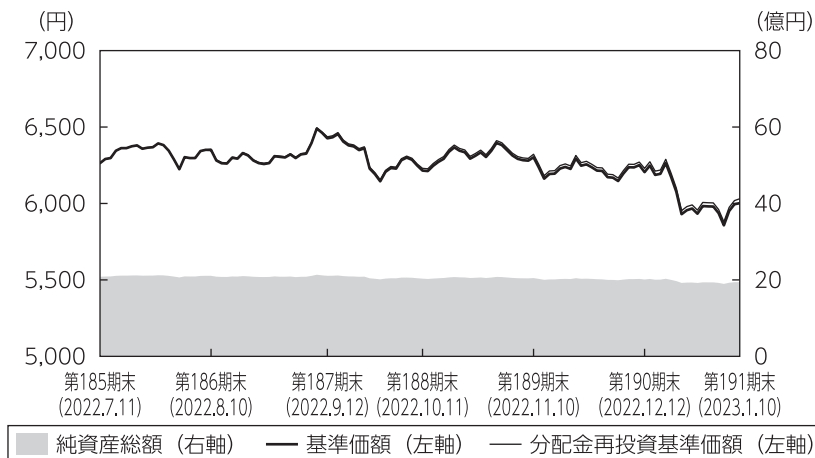
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率および騰落幅は期首比です。

(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186期～第191期の運用経過（2022年7月12日から2023年1月10日まで）

基準価額等の推移



第186期首： 6,264円
 第191期末： 6,002円
 (既払分配金30円)
 騰落率： △3.7%
 (分配金再投資ベース)

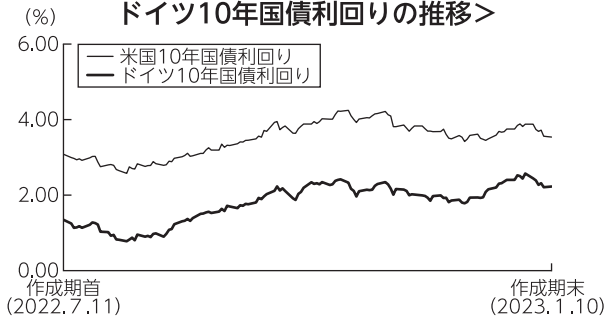
- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

基準価額の主な変動要因

「ルーミス・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、保有する債券の価格が下落（利回りは上昇）し、米ドルなどの通貨も対円で下落したことから、基準価額（税引前分配金再投資ベース）は下落しました。

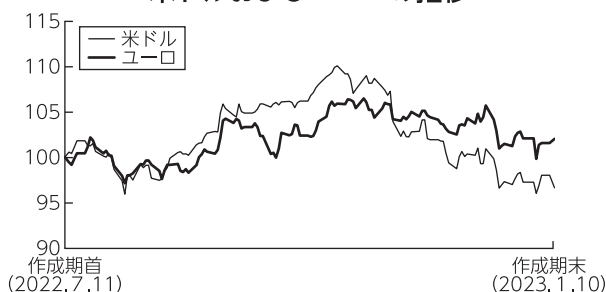
投資環境

<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、インフレ懸念を背景としたF R B (米連邦準備理事会) の積極的な利上げ継続姿勢や、その後の金融引締め長期化観測の広がり、日銀による予想外の長期金利許容変動幅の拡大を受け下落しました。ドイツ国債市場は、E C B (欧州中央銀行) が積極的な金融引締め姿勢を示し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、新興国の公社債市場はともに上昇しました。

為替市場 (対円) は、米ドルは下落、ユーロは上昇しました。米ドルは、F R Bによる利上げペースの鈍化が意識されたことや、日銀による金融緩和策の修正により内外金利差縮小が意識されたことなどが下落要因となりました。ユーロは、E C Bの積極的な利上げ姿勢を受けて作成期前半に上昇していたこと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。

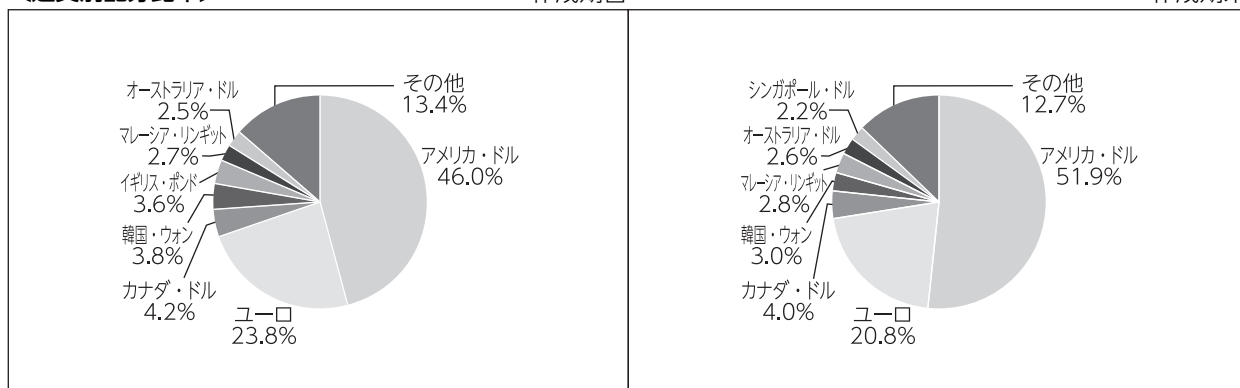
●ルーミス・グローバル債券マザーファンド

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、保有する債券の価格が下落し、米ドルなどの通貨も対円で下落したことから、基準価額（税引前分配金再投資ベース）は下落しました。

〔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。

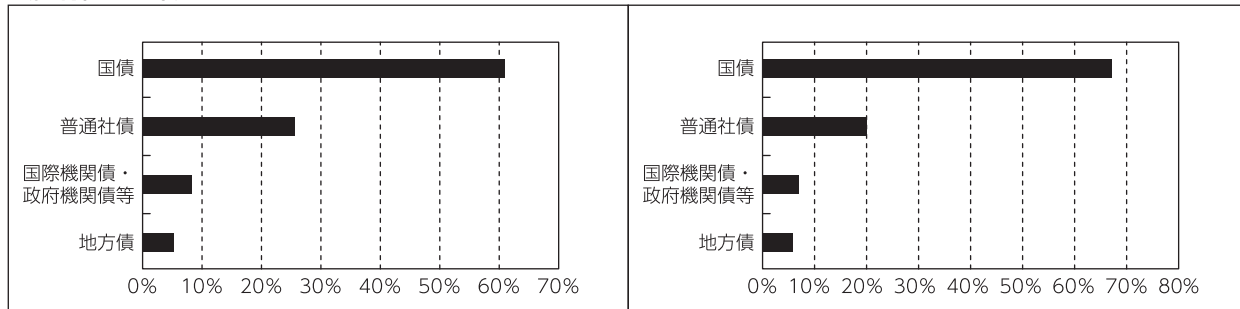
(注2) 現金等はその他として表示しています。

(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

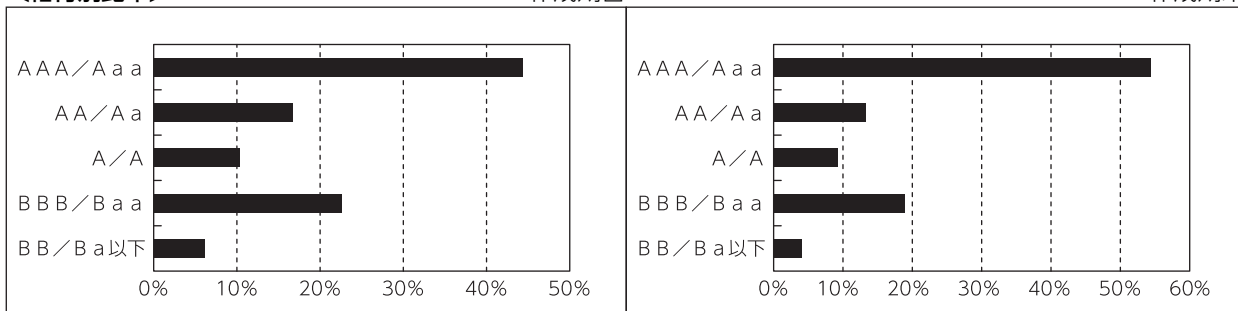


(注) 上記比率は、ルーミス・グローバル債券マザーファンドの債券部分に対する評価額の割合です。

【格付別比率】

作成期首

作成期末



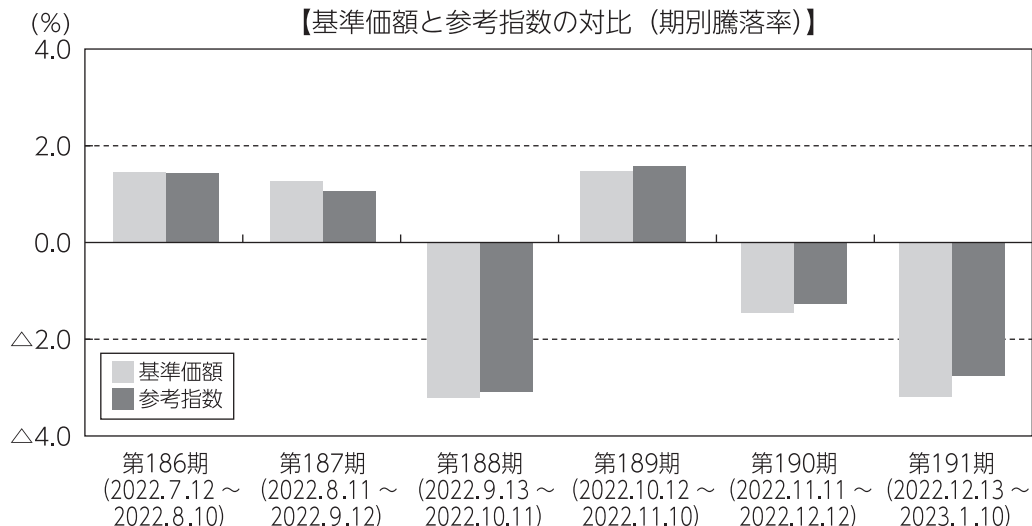
(注1) 上記比率は、ルミス・グローバル債券マザーファンドの債券部分に対する評価額の割合です。

(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186期	第187期	第188期	第189期	第190期	第191期
	2022年7月12日 ～2022年8月10日	2022年8月11日 ～2022年9月12日	2022年9月13日 ～2022年10月11日	2022年10月12日 ～2022年11月10日	2022年11月11日 ～2022年12月12日	2022年12月13日 ～2023年1月10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	5円	5円	4円	5円	5円	4円
当期の収益以外	-円	-円	0円	-円	-円	0円
翌期繰越分配対象額	184円	192円	192円	200円	200円	199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

米国は、FRBによる利上げ幅縮小観測などから利回り低下が進みましたが、物価高が進行してきた中、FRBは依然としてインフレ抑制を重視しており、利回り上昇（価格は下落）には引き続き留意します。欧州も、エネルギー問題等の不透明感が継続しているものの、ECBは高インフレに対する警戒感を強めているため、金融引き締め姿勢を継続すると予想されますが、エネルギー不足が経済に与える影響が深刻になるリスクが高まった場合、ECBの利上げ動向等には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186期～第191期		項目の概要
	(2022年7月12日 ～2023年1月10日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	52円	0.827%	(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6,253円です。
(投信会社)	(29)	(0.469)	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)	(21)	(0.331)	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	1	0.023	(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)	(1)	(0.021)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
(監査費用)	(0)	(0.001)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
(その他)	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	53	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。

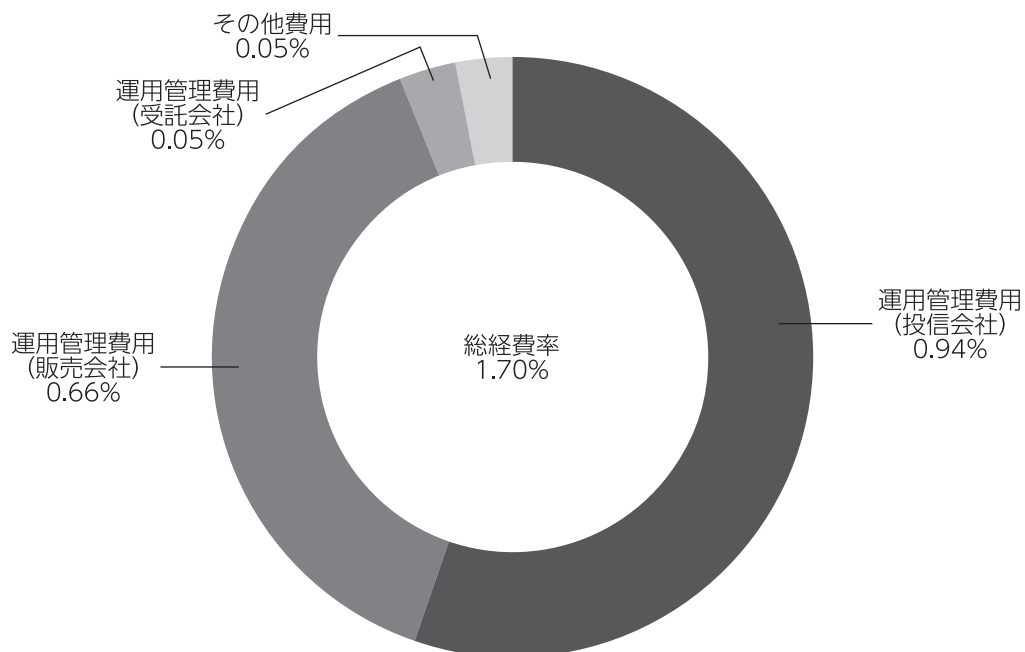
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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1.70%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7月12日から2023年1月10日まで）

	第 186 期 ~ 第 191 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 59,536	千円 101,000

■利害関係人との取引状況等（2022年7月12日から2023年1月10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31作成期末	第32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 1,232,178	千口 1,172,641	千円 1,913,751

■投資信託財産の構成

2023年1月10日現在

項 目	第32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 1,913,751	98.3%
コーラル・ローン等、その他	32,956	1.7
投資信託財産総額	1,946,708	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、1,912,780千円、99.9%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、2023年1月10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=131.85円、1カナダ・ドル=98.42円、1オーストラリア・ドル=91.10円、1シンガポール・ドル=99.04円、1ニュージーランド・ドル=84.00円、1イギリス・ポンド=160.47円、1スイス・フラン=143.04円、1トルコ・リラ=7.028円、1デンマーク・クローネ=19.01円、1ノルウェー・クローネ=13.29円、1スウェーデン・クローナ=12.66円、1メキシコ・ペソ=6.89円、1アルゼンチン・ペソ=0.731円、100コロンビア・ペソ=2,716円、100インドネシア・ルピア=0.85円、1ブラジル・リアル=25.068円、1チェコ・コルナ=5.894円、100韓国・ウォン=10.62円、1マレーシア・リンギット=30.139円、1南アフリカ・ランド=7.78円、1タイ・バーツ=3.94円、1ポーランド・ズロチ=30.135円、100ハンガリー・フォリント=35.661円、1ユーロ=141.38円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年8月10日)、 (2022年9月12日)、 (2022年10月11日)、 (2022年11月10日)、 (2022年12月12日)、 (2023年1月10日)現在

項 目	第186期末	第187期末	第188期末	第189期末	第190期末	第191期末
(A)資 産	2,111,410,184円	2,118,378,532円	2,037,311,411円	2,052,096,564円	2,015,343,876円	1,946,708,135円
コーラル・ローン等	56,949,842	34,218,336	17,841,585	49,927,901	40,028,710	32,956,666
ルーミス・グローバル債券マザーファンド(評価額)	2,054,460,342	2,084,160,196	2,019,469,826	2,002,168,663	1,975,315,166	1,913,751,469
(B)負 債	4,517,100	11,444,711	4,351,552	4,416,804	4,550,217	5,234,598
未払収益分配金	1,659,020	1,639,472	1,635,557	1,624,719	1,620,310	1,617,322
未払解約金	-	6,680,019	-	-	-	1,049,840
未払信託報酬	2,851,839	3,118,398	2,710,066	2,785,990	2,923,513	2,561,832
その他未払費用	6,241	6,822	5,929	6,095	6,394	5,604
(C)純資産総額(A-B)	2,106,893,084	2,106,933,821	2,032,959,859	2,047,679,760	2,010,793,659	1,941,473,537
元 本	3,318,041,525	3,278,945,126	3,271,115,448	3,249,439,895	3,240,620,350	3,234,644,495
次期繰越損益金	△1,211,148,441	△1,172,011,305	△1,238,155,589	△1,201,760,135	△1,229,826,691	△1,293,170,958
(D)受益権総口数	3,318,041,525口	3,278,945,126口	3,271,115,448口	3,249,439,895口	3,240,620,350口	3,234,644,495口
1万口当たり基準価額(C/D)	6,350円	6,426円	6,215円	6,302円	6,205円	6,002円

(注) 第185期末における元本額は3,324,594,842円、当作成期間(第186期～第191期)中における追加設定元本額は1,055,123円、同解約元本額は91,005,470円です。

■損益の状況

[自 2022年7月12日] [自 2022年8月11日] [自 2022年9月13日] [自 2022年10月12日] [自 2022年11月11日] [自 2022年12月13日]
 [至 2022年8月10日] [至 2022年9月12日] [至 2022年10月11日] [至 2022年11月10日] [至 2022年12月12日] [至 2023年1月10日]

項 目	第186期	第187期	第188期	第189期	第190期	第191期
(A)配 当 等 収 益	△188円	△935円	△787円	△1,874円	△2,749円	△1,222円
受 取 利 息	-	7	1	2	4	2
支 払 利 息	△188	△942	△788	△1,876	△2,753	△1,224
(B)有価証券売買損益	33,051,093	29,631,963	△64,590,474	32,609,718	△26,775,170	△61,426,197
売 買 益	33,059,671	29,775,834	95,203	32,716,681	73,323	135,250
売 買 損	△8,578	△143,871	△64,685,677	△106,963	△26,848,493	△61,561,447
(C)信 託 報 酬 等	△2,858,080	△3,125,220	△2,715,995	△2,792,085	△2,929,907	△2,567,436
(D)当期損益金(A + B + C)	30,192,825	26,505,808	△67,307,256	29,815,759	△29,707,826	△63,994,855
(E)前期繰越損益金	△1,014,958,386	△974,749,185	△947,565,487	△1,009,717,983	△978,810,701	△1,008,221,499
(F)追加信託差損益金	△224,723,860	△222,128,456	△221,647,289	△220,233,192	△219,687,854	△219,337,282
(配当等相当額)	(31,122,553)	(30,757,594)	(30,686,000)	(30,484,535)	(30,403,807)	(30,349,765)
(売買損益相当額)	(△255,846,413)	(△252,886,050)	(△252,333,289)	(△250,717,727)	(△250,091,661)	(△249,687,047)
(G)合 計(D + E + F)	△1,209,489,421	△1,170,371,833	△1,236,520,032	△1,200,135,416	△1,228,206,381	△1,291,553,636
(H)収 益 分 配 金	△1,659,020	△1,639,472	△1,635,557	△1,624,719	△1,620,310	△1,617,322
次期繰越損益金(G + H)	△1,211,148,441	△1,172,011,305	△1,238,155,589	△1,201,760,135	△1,229,826,691	△1,293,170,958
追加信託差損益金	△224,723,860	△222,128,456	△221,647,289	△220,233,192	△219,687,854	△219,337,282
(配当等相当額)	(31,122,698)	(30,757,758)	(30,686,136)	(30,484,698)	(30,403,961)	(30,349,899)
(売買損益相当額)	(△255,846,558)	(△252,886,214)	(△252,333,425)	(△250,717,890)	(△250,091,815)	(△249,687,181)
分配準備積立金	30,237,047	32,506,219	32,297,565	34,545,263	34,652,452	34,308,801
繰 越 損 益 金	△1,016,661,628	△982,389,068	△1,048,805,865	△1,016,072,206	△1,044,791,289	△1,108,142,477

(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186期から第191期まではルーマス・グローバル債券マザーファンド5,040,195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186期	第187期	第188期	第189期	第190期	第191期
(a)経費控除後の配当等収益	4,004,231円	4,266,533円	1,506,206円	4,088,167円	1,823,099円	1,339,444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	31,122,698	30,757,758	30,686,136	30,484,698	30,403,961	30,349,899
(d)分 配 準 備 積 立 金	27,891,836	29,879,158	32,426,916	32,081,815	34,449,663	34,586,679
(e)当期分配対象額(a + b + c + d)	63,018,765	64,903,449	64,619,258	66,654,680	66,676,723	66,276,022
(f)1万円当たり当期分配対象額	189.93	197.94	197.55	205.13	205.75	204.89
(g)分 配 金	1,659,020	1,639,472	1,635,557	1,624,719	1,620,310	1,617,322
(h)1万円当たり分配金	5	5	5	5	5	5

■分配金のお知らせ

決算期	第186期	第187期	第188期	第189期	第190期	第191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32期（決算日 2023年1月10日）

（計算期間 2022年7月12日～2023年1月10日）

ルーミス・グローバル債券マザーファンドの第32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					
28期 (2021年1月12日)	円	%		%	円	%	%	%	%	%	%	%	%	百万円
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
32期 (2023年1月10日)	16,320	△3.0	304.23	△3.1	131.85	3.53	0.45	2.23	0.88	96.8	-	-	-	1,913

(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)。

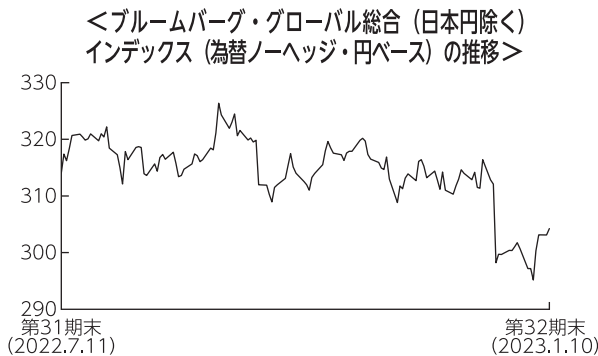
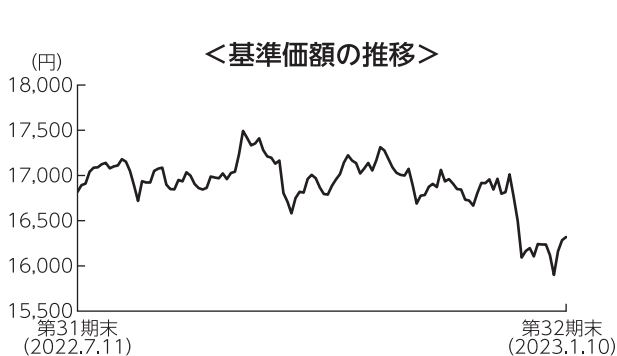
■当期中の基準価額と市況の推移

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
	円	騰落率	騰落率	騰落率		騰落幅	騰落幅	騰落率	騰落率		
(期首) 2022年7月11日	円	%		%	円	%	%	%	%	%	%
	16,819	—	314.06	—	136.47	3.08	—	1.35	—	96.6	—
7月末	17,049	1.4	318.46	1.4	134.61	2.68	△0.40	0.83	△0.52	97.0	—
8月末	16,969	0.9	317.11	1.0	138.63	3.10	0.02	1.51	0.17	96.0	—
9月末	16,819	0.0	311.97	△0.7	144.81	3.79	0.71	2.18	0.84	97.1	—
10月末	17,313	2.9	319.83	1.8	148.26	4.01	0.93	2.10	0.76	96.5	—
11月末	16,845	0.2	311.18	△0.9	138.87	3.74	0.66	1.92	0.58	96.9	—
12月末	16,118	△4.2	300.68	△4.3	132.70	3.81	0.73	2.44	1.09	97.0	—
(期末) 2023年1月10日	16,320	△3.0	304.23	△3.1	131.85	3.53	0.45	2.23	0.88	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 (2022年7月12日から2023年1月10日まで)



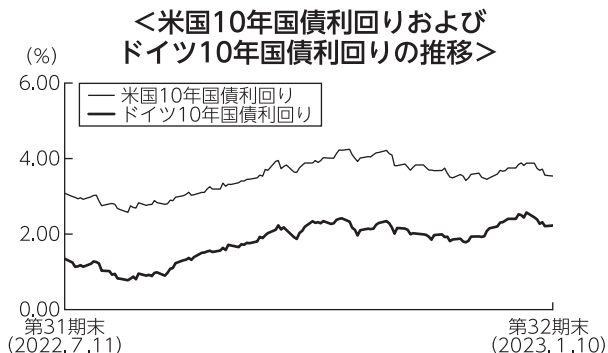
基準価額の推移

当ファンドの基準価額は、前期末比で3.0%下落しました。

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、保有する債券の価格が下落 (利回りは上昇) し、米ドルなどの通貨も対円で下落したことから、基準価額は下落しました。

投資環境

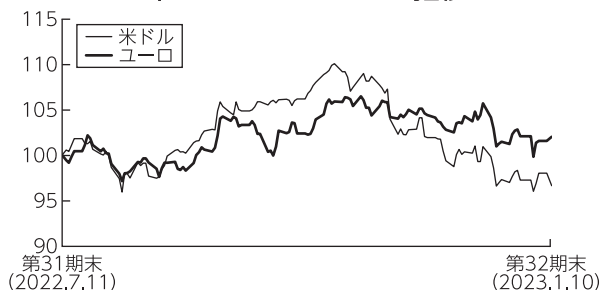


米国国債市場は、インフレ懸念を背景としたFRB (米連邦準備理事会) の積極的な利上げ継続姿勢や、その後の金融引締め長期化観測の広がり、日銀による予想外の長期金利許容変動幅の拡大を受け下落しました。ドイツ国債市場は、ECB (欧州中央銀行) が積極的な金融引締め姿勢を示したことなどから下落しました。投資適格社債市場は、米国は上昇し、欧州は下落しました。信用スプレッドは、米国、欧州ともに縮小しました。

先進国の高利回り債市場、新興国の公社債市場はともに上昇しました。

(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) 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、ユーロは上昇しました。米ドルは、F R Bによる利上げペースの鈍化が意識されたことや、日銀による金融緩和策の修正により内外金利差縮小が意識されたことなどが下落要因となりました。ユーロは、E C Bの積極的な利上げ姿勢を受けて期前半に上昇していたことなどが上昇要因となりました。

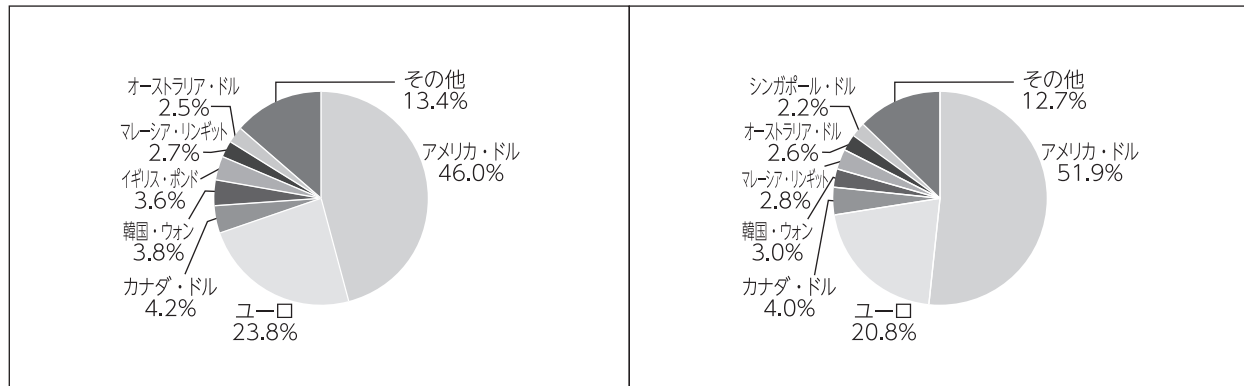
ポートフォリオについて

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、保有する債券の価格が下落し、米ドルなどの通貨も対円で下落したことから、基準価額（税引前分配金再投資ベース）は下落しました。

〔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。

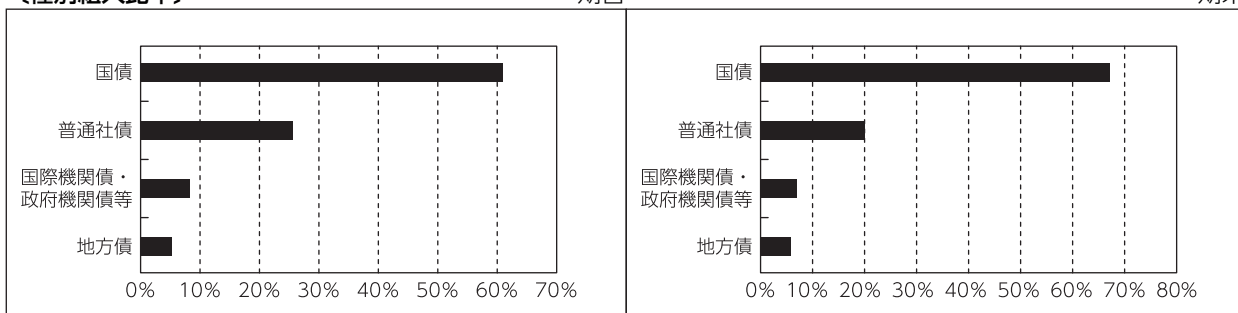
(注2) 現金等はその他として表示しています。

(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

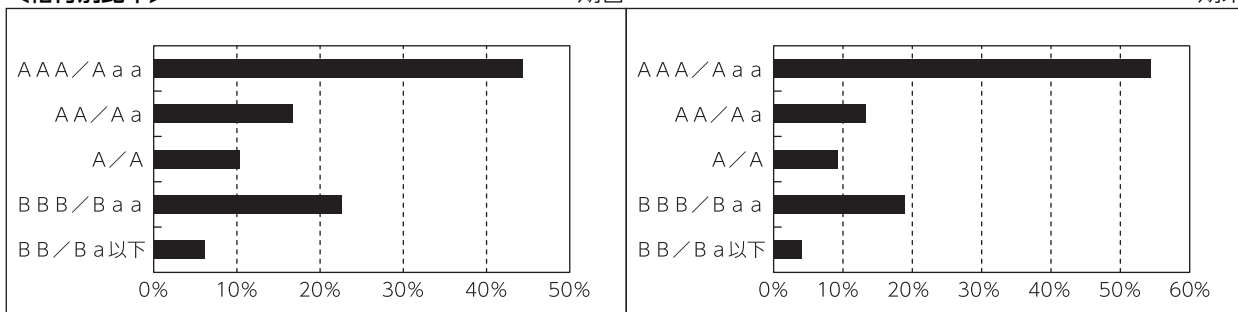


(注) 上記比率は、ルミス・グローバル債券マザーファンドの債券部分に対する評価額の割合です。

【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、BB/Ba以下に含めて表示しています。

今後の運用方針

米国は、FRBによる利上げ幅縮小観測などから利回り低下が進みましたが、物価高が進行してきた中、FRBは依然としてインフレ抑制を重視しており、利回り上昇（価格は下落）には引き続き留意します。欧州も、エネルギー問題等の不透明感が継続しているものの、ECBは高インフレに対する警戒感を強めているため、金融引き締め姿勢を継続すると予想されますが、エネルギー不足が経済に与える影響が深刻になるリスクが高まった場合、ECBの利上げ動向等には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) (その他)	4円 (4) (0)	0.022% (0.021) (0.000)	(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
合計	4	0.022	
期中の平均基準価額は16,904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7月12日から2023年1月10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 3,781	千アメリカ・ドル 1,920 (-)
		特殊債券	-	34 (200)
		社債証券	59	856 (207)
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル -	千カナダ・ドル 53 (-)
		国債証券	千イギリス・ポンド 144	千イギリス・ポンド 275 (-)
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ -	千スウェーデン・クローナ 2,458 (-)
地方債証券		608	- (-)	
国	韓国	国債証券	千韓国・ウォン -	千韓国・ウォン 219,904 (-)
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 332	千マレーシア・リンギット 330 (-)

				買付額	売付額
				千ユーロ	千ユーロ
外 国	ユ ー ロ 圏	アイルランド	社債券	-	104 (-)
		ルクセンブルグ	社債券	73	- (-)
		ド イ ツ	国債証券	401	820 (-)
	社債券		84	114 (-)	
	ス イ ス	社債券	101	- (-)	
		イタリア	国債証券	-	193 (-)

(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7月12日から2023年1月10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 8,369	千アメリカ・ドル 7,529	千円 992,829	% 51.9	% 1.8	% 24.2	% 15.6	% 12.1
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 905	千カナダ・ドル 777	千円 76,491	4.0	—	1.7	1.4	0.9
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 542	千円 49,405	2.6	—	0.5	2.0	—
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 428	千円 42,452	2.2	—	—	1.6	0.6
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 281	千円 23,622	1.2	—	—	1.0	0.2
イギリス	千イギリス・ポンド 275	千イギリス・ポンド 260	千円 41,865	2.2	—	1.5	0.7	—
スイス	千スイス・フラン 155	千スイス・フラン 150	千円 21,595	1.1	—	—	1.1	—
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 1,676	0.1	—	—	0.1	—
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 640	千スウェーデン・クローナ 606	千円 7,677	0.4	—	—	0.4	—
メキシコ	千メキシコ・ペソ 876	千メキシコ・ペソ 854	千円 5,889	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 334,481	千円 9,084	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 3,827,109	千円 32,530	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 575	千円 14,426	0.8	0.8	—	0.8	—
韓国	千韓国・ウォン 578,520	千韓国・ウォン 533,815	千円 56,691	3.0	—	1.2	1.4	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 1,796	千円 54,143	2.8	—	—	2.8	—
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 1,356	千円 10,553	0.6	0.6	0.6	—	—
タイ	千タイ・バーツ 2,295	千タイ・バーツ 2,202	千円 8,678	0.5	—	0.5	—	—
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 145	千ポーランド・ズロチ 129	千円 3,913	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								
ア イ ル ラ ン ド	130	119	16,864	0.9	—	0.2	0.7	—
オ ラ ン ダ	100	87	12,440	0.7	—	—	0.7	—
ベ ル ギ ー	100	94	13,318	0.7	—	—	0.7	—
ル ク セ ン ブ ル グ	200	148	20,986	1.1	—	1.1	—	—
フ ラ ン ス	380	315	44,559	2.3	—	1.8	0.5	—
ド イ ツ	1,540	1,250	176,774	9.2	0.8	6.8	2.4	—
ス イ ス	130	97	13,768	0.7	—	0.7	—	—
ス ペ イ ン	305	283	40,137	2.1	—	2.1	—	—
イ タ リ ア	205	172	24,452	1.3	—	1.3	—	—
カ ナ ダ	265	252	35,663	1.9	—	—	1.9	—
合 計	—	—	千円 1,852,492	96.8	3.9	45.9	36.6	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)							
BRAZIL 4.625 01/13/28	国債証券	4.6250	200	194	25,671	2028/01/13	
REPUBLIC OF CHILE 2.45 01/31/31	国債証券	2.4500	200	168	22,211	2031/01/31	
US T N/B 1.5 01/31/27	国債証券	1.5000	490	448	59,152	2027/01/31	
US T N/B 0.125 01/31/23	国債証券	0.1250	270	269	35,514	2023/01/31	
US T N/B 0.375 01/31/26	国債証券	0.3750	105	94	12,444	2026/01/31	
US T N/B 2.25 02/15/52	国債証券	2.2500	250	186	24,539	2052/02/15	
US T N/B 1.875 02/15/51	国債証券	1.8750	280	190	25,156	2051/02/15	
US T N/B 0.5 02/28/26	国債証券	0.5000	320	288	37,995	2026/02/28	
US T N/B 2.75 04/30/27	国債証券	2.7500	615	591	77,932	2027/04/30	
US T N/B 1.25 05/15/50	国債証券	1.2500	110	63	8,388	2050/05/15	
US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	1.6250	35	30	3,998	2031/05/15	
US T N/B 2.5 05/31/24	国債証券	2.5000	655	637	84,020	2024/05/31	
US T N/B 2.0 06/30/24	国債証券	2.0000	110	106	13,993	2024/06/30	
TSY INFL 0.625 07/15/32	国債証券	0.6250	145	139	18,449	2032/07/15	
US T N/B 2.75 07/31/27	国債証券	2.7500	355	340	44,943	2027/07/31	
US T N/B 3.0 07/31/24	国債証券	3.0000	75	73	9,680	2024/07/31	

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	
US T N/B 1.75 08/15/41	国債証券	1.7500	395	284	37,563	2041/08/15
US T N/B 2.75 08/15/32	国債証券	2.7500	380	356	47,026	2032/08/15
US T N/B 0.875 09/30/26	国債証券	0.8750	235	211	27,857	2026/09/30
US T N/B 3.5 09/15/25	国債証券	3.5000	55	54	7,160	2025/09/15
US T N/B 0.375 10/31/23	国債証券	0.3750	130	125	16,557	2023/10/31
US T N/B 4.125 10/31/27	国債証券	4.1250	140	142	18,803	2027/10/31
US T N/B 1.625 11/15/50	国債証券	1.6250	65	41	5,476	2050/11/15
US T N/B 1.375 11/15/31	国債証券	1.3750	70	58	7,752	2031/11/15
US T N/B 0.75 12/31/23	国債証券	0.7500	80	77	10,156	2023/12/31
US T N/B 1.375 12/31/28	国債証券	1.3750	210	185	24,413	2028/12/31
JPMORGAN CHASE & CO 3.2 01/25/23	社債証券	3.2000	180	179	23,717	2023/01/25
UNITED AIR 2016-1 B PTT 3.65 01/07/26	社債証券	3.6500	25	23	3,088	2026/01/07
SUZANO AUSTRIA G 3.125 01/15/32	社債証券	3.1250	5	3	522	2032/01/15
T-MOBILE USA INC 5.2 01/15/33	社債証券	5.2000	45	45	6,033	2033/01/15
CONTINENTAL RESOURCES 4.375 01/15/28	社債証券	4.3750	40	37	4,897	2028/01/15
EQT CORP 5.0 01/15/29	社債証券	5.0000	10	9	1,257	2029/01/15
CONTINENTAL RESOURCES 5.75 01/15/31	社債証券	5.7500	65	61	8,169	2031/01/15
AMERICAN TOWER CORP 2.9 01/15/30	社債証券	2.9000	30	26	3,435	2030/01/15
SUZANO AUSTRIA GMBH 3.75 01/15/31	社債証券	3.7500	45	38	5,080	2031/01/15
T-MOBILE USA INC 3.3 02/15/51	社債証券	3.3000	15	10	1,395	2051/02/15
TOLL BROS FINANCE CORP 4.35 02/15/28	社債証券	4.3500	85	78	10,395	2028/02/15
T-MOBILE USA INC 4.75 02/01/28	社債証券	4.7500	90	89	11,753	2028/02/01
BOEING CO 3.75 02/01/50	社債証券	3.7500	15	10	1,442	2050/02/01
DCP MIDSTREAM OPERATING 3.25 02/15/32	社債証券	3.2500	20	17	2,252	2032/02/15
CENTENE CORP 3.375 02/15/30	社債証券	3.3750	20	17	2,295	2030/02/15
BOEING CO 2.196 02/04/26	社債証券	2.1960	5	4	605	2026/02/04
BOEING CO 3.825 03/01/59	社債証券	3.8250	5	3	454	2059/03/01
CF INDUSTRIES INC 5.15 03/15/34	社債証券	5.1500	10	9	1,280	2034/03/15
COMCAST CORP 4.0 03/01/48	社債証券	4.0000	15	12	1,680	2048/03/01
CF INDUSTRIES INC 5.375 03/15/44	社債証券	5.3750	10	9	1,230	2044/03/15
HCA INC 3.625 03/15/32	社債証券	3.6250	125	108	14,357	2032/03/15
CENTENE CORP 2.5 03/01/31	社債証券	2.5000	20	16	2,125	2031/03/01
ALLY FINANCIAL INC 4.625 03/30/25	社債証券	4.6250	10	9	1,295	2025/03/30
ENERGY TRANSFER PARTNERS 5.3 04/15/47	社債証券	5.3000	25	21	2,891	2047/04/15
CHARTER COMM OPT LLC/CAP 3.7 04/01/51	社債証券	3.7000	60	39	5,165	2051/04/01
CONTINENTAL RESOURCES 2.875 04/01/32	社債証券	2.8750	10	7	1,007	2032/04/01
BROADCOM INC 3.469 04/15/34	社債証券	3.4690	45	37	4,886	2034/04/15
T-MOBILE USA INC 3.875 04/15/30	社債証券	3.8750	55	51	6,749	2030/04/15
NEW YORK LIFE INSURANCE 3.75 05/15/50	社債証券	3.7500	50	40	5,372	2050/05/15
UNITEDHEALTH GROUP INC 2.9 05/15/50	社債証券	2.9000	10	7	965	2050/05/15
EQT CORP 3.625 05/15/31	社債証券	3.6250	75	64	8,543	2031/05/15

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	
BOEING CO 3.9 05/01/49	社 債 券	3.9000	15	11	1,485	2049/05/01
ALLY FINANCIAL INC 3.875 05/21/24	社 債 券	3.8750	5	4	644	2024/05/21
ALLY FINANCIAL INC 5.8 05/01/25	社 債 券	5.8000	5	5	659	2025/05/01
BOEING CO 2.25 06/15/26	社 債 券	2.2500	5	4	602	2026/06/15
CF INDUSTRIES INC 4.95 06/01/43	社 債 券	4.9500	5	4	587	2043/06/01
FORD FOUNDATION/THE 3.859 06/01/47	社 債 券	3.8590	65	57	7,542	2047/06/01
AT&T 3.65 06/01/51	社 債 券	3.6500	65	49	6,477	2051/06/01
GREAT-WEST LIFECO FINANC 4.15 06/03/47	社 債 券	4.1500	45	36	4,798	2047/06/03
ARES CAPITAL CORP 2.875 06/15/28	社 債 券	2.8750	25	20	2,699	2028/06/15
DELTA AIRLINES 2015B 4.25 07/30/23	社 債 券	4.2500	34	33	4,467	2023/07/30
CROWN CASTLE INTL CORP 4.15 07/01/50	社 債 券	4.1500	10	8	1,079	2050/07/01
AES CORP/THE 3.95 07/15/30	社 債 券	3.9500	20	18	2,390	2030/07/15
CVS HEALTH CORP 3.25 08/15/29	社 債 券	3.2500	30	27	3,611	2029/08/15
OVINTIV INC 6.5 08/15/34	社 債 券	6.5000	11	11	1,508	2034/08/15
VMWARE INC 2.2 08/15/31	社 債 券	2.2000	50	39	5,171	2031/08/15
BANK OF AMERICA CORP 4.2 08/26/24	社 債 券	4.2000	245	242	31,948	2024/08/26
ENEL FINANCE INTL NV 6.8 09/15/37	社 債 券	6.8000	155	159	21,058	2037/09/15
VERIZON COMMUNICATIONS 2.85 09/03/41	社 債 券	2.8500	10	7	961	2041/09/03
BANK OF AMERICA CORP 09/21/36	社 債 券	2.4820	5	3	496	2036/09/21
CVS HEALTH CORP 2.125 09/15/31	社 債 券	2.1250	110	90	11,869	2031/09/15
T-MOBILE USA INC 3.4 10/15/52	社 債 券	3.4000	10	7	947	2052/10/15
UNITED AIR 2016-2 B PTT 3.65 10/07/25	社 債 券	3.6500	48	43	5,682	2025/10/07
DELTA AIR LINES/SKYMILES 4.75 10/20/28	社 債 券	4.7500	115	110	14,548	2028/10/20
BOEING CO 3.85 11/01/48	社 債 券	3.8500	5	3	487	2048/11/01
CENTENE CORP 4.625 12/15/29	社 債 券	4.6250	80	75	9,890	2029/12/15
小 計	-	-	8,369	7,529	992,829	-
(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	162	15,975	2029/06/01
ONTARIO (PROVINCE OF) 1.9 12/02/51	地 方 債 証 券	1.9000	250	158	15,648	2051/12/02
IBRD 1.2 07/22/26	特 殊 債 券	1.2000	305	279	27,518	2026/07/22
PSP CAPITAL INC 2.09 11/22/23	特 殊 債 券	2.0900	180	176	17,348	2023/11/22
小 計	-	-	905	777	76,491	-
(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	114	10,440	2030/02/20
NEW S WALES TREASURY CRP 4.0 05/20/26	地 方 債 証 券	4.0000	80	80	7,330	2026/05/20
QUEENSLAND 2.75 08/20/27	地 方 債 証 券	2.7500	365	347	31,634	2027/08/20
小 計	-	-	570	542	49,405	-
(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	318	31,562	2027/03/01

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	
(シンガポール) SINGAPORE 3.0 09/01/24	国債証券	% 3.0000	千シンガポール・ドル 110	千シンガポール・ドル 109	千円 10,890	2024/09/01
小 計	-	-	420	428	42,452	-
(ニュージーランド) NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	国債証券	% 4.5000	千ニュージーランド・ドル 235	千ニュージーランド・ドル 236	千円 19,834	2027/04/15
NEW ZEALAND 5.5 04/15/23	国債証券	5.5000	45	45	3,787	2023/04/15
小 計	-	-	280	281	23,622	-
(イギリス) UK TREASURY 3.25 01/22/44	国債証券	% 3.2500	千イギリス・ポンド 115	千イギリス・ポンド 102	千円 16,375	2044/01/22
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	75	79	12,784	2055/12/07
ASIAN DEV BANK 1.125 06/10/25	特殊債券	1.1250	85	79	12,706	2025/06/10
小 計	-	-	275	260	41,865	-
(スイス) GOLDMAN SACHS GROUP INC 1.0 11/24/25	社債証券	% 1.0000	千スイス・フラン 155	千スイス・フラン 150	千円 21,595	2025/11/24
小 計	-	-	155	150	21,595	-
(ノルウェー) NORWAY 1.75 03/13/25	国債証券	% 1.7500	千ノルウェー・クローネ 130	千ノルウェー・クローネ 126	千円 1,676	2025/03/13
小 計	-	-	130	126	1,676	-
(スウェーデン) KOMMUNINVEST I SVERIGE 1.0 05/12/25	地方債証券	% 1.0000	千スウェーデン・クローナ 640	千スウェーデン・クローナ 606	千円 7,677	2025/05/12
小 計	-	-	640	606	7,677	-
(メキシコ) MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	国債証券	% 8.0000	千メキシコ・ペソ 876	千メキシコ・ペソ 854	千円 5,889	2023/12/07
小 計	-	-	876	854	5,889	-
(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 334,481	千円 9,084	2026/08/26
小 計	-	-	393,800	334,481	9,084	-
(インドネシア) INDONESIA GOV'T 6.5 02/15/31	国債証券	% 6.5000	千インドネシア・ルピア 831,000	千インドネシア・ルピア 811,887	千円 6,901	2031/02/15
INDONESIA GOV'T 8.25 05/15/29	国債証券	8.2500	2,788,000	3,015,222	25,629	2029/05/15
小 計	-	-	3,619,000	3,827,109	32,530	-
(ブラジル) BRAZIL NTN 01/01/27	国債証券	% 10.0000	千ブラジル・レアル 625	千ブラジル・レアル 575	千円 14,426	2027/01/01
小 計	-	-	625	575	14,426	-
(韓国) KOREA TREASURY BOND (TAX) 2.375 03/10/23	国債証券	% 2.3750	千韓国・ウォン 58,520	千韓国・ウォン 58,425	千円 6,204	2023/03/10
KOREA TREASURY BOND 1.5 03/10/25	国債証券	1.5000	270,000	258,289	27,430	2025/03/10
KOREA TREASURY BOND 1.375 12/10/29	国債証券	1.3750	250,000	217,100	23,056	2029/12/10
小 計	-	-	578,520	533,815	56,691	-

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	
(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	633	19,080	2027/03/15
MALAYSIA 3.906 07/15/26	国債証券	3.9060	1,155	1,163	35,062	2026/07/15
小 計	-	-	1,785	1,796	54,143	-
(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	1,356	10,553	2031/02/28
小 計	-	-	1,640	1,356	10,553	-
(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	2,202	8,678	2029/12/17
小 計	-	-	2,295	2,202	8,678	-
(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	129	3,913	2026/07/25
小 計	-	-	145	129	3,913	-
(ユーロ・・・アイルランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	1.0000	100	95	13,496	2026/05/15
IRISH 0.0 10/18/31	国債証券	0.0000	30	23	3,368	2031/10/18
小 計	-	-	130	119	16,864	-
(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	87	12,440	2027/06/21
小 計	-	-	100	87	12,440	-
(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	94	13,318	2025/05/30
小 計	-	-	100	94	13,318	-
(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	74	10,493	2030/01/17
BLACKSTONE PP EUR HOLD 1.0 05/04/28	社債証券	1.0000	100	74	10,493	2028/05/04
小 計	-	-	200	148	20,986	-
(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	60	8,496	2041/04/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	0.5000	70	65	9,243	2026/05/25
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	国債証券	0.0000	180	140	19,859	2032/05/25
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	国債証券	0.5000	80	49	6,959	2044/06/25
小 計	-	-	380	315	44,559	-
(ユーロ・・・ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	国債証券	0.0000	320	274	38,819	2030/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	国債証券	0.0000	320	173	24,508	2052/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	0.0000	85	78	11,076	2026/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	330	280	39,637	2030/08/15
COMMERZBANK AG 0.625 05/28/25	特殊債券	0.6250	70	66	9,337	2025/05/28
KFW 0.25 09/15/25	特殊債券	0.2500	195	182	25,815	2025/09/15

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	
FRAPORT AG 1.875 03/31/28	社 債 券	1.8750	115	100	14,251	2028/03/31
DEUTSCHE BANK AG 06/24/32	社 債 券	4.0000	100	89	12,681	2032/06/24
FRAPORT AG 2.125 07/09/27	社 債 券	2.1250	5	4	647	2027/07/09
小 計	—	—	1,540	1,250	176,774	—
(ユーロ・・・スイス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
CREDIT SUISSE GROUP AG 01/14/28	社 債 券	0.6500	130	97	13,768	2028/01/14
小 計	—	—	130	97	13,768	—
(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	129	18,341	2037/01/31
SPAIN 1.95 07/30/30	国 債 証 券	1.9500	85	78	11,161	2030/07/30
BANCO SANTANDER SA 0.1 02/27/32	特 殊 債 券	0.1000	100	75	10,634	2032/02/27
小 計	—	—	305	283	40,137	—
(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	205	172	24,452	2030/04/01
小 計	—	—	205	172	24,452	—
(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	157	22,301	2025/01/15
PROVINCE OF ALBERTA 0.625 04/18/25	地 方 債 証 券	0.6250	100	94	13,362	2025/04/18
小 計	—	—	265	252	35,663	—
合 計	—	—	—	—	1,852,492	—

■投資信託財産の構成

2023年1月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 1,852,492	% 96.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	61,246	3.2
投 資 信 託 財 産 総 額	1,913,739	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、1,912,780千円、99.9%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、2023年1月10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=131.85円、1カナダ・ドル=98.42円、1オーストラリア・ドル=91.10円、1シンガポール・ドル=99.04円、1ニュージーランド・ドル=84.00円、1イギリス・ポンド=160.47円、1スイス・フラン=143.04円、1トルコ・リラ=7.028円、1デンマーク・クローネ=19.01円、1ノルウェー・クローネ=13.29円、1スウェーデン・クローナ=12.66円、1メキシコ・ペソ=6.89円、1アルゼンチン・ペソ=0.731円、100コロンビア・ペソ=2,716円、100インドネシア・ルピア=0.85円、1ブラジル・リアル=25.068円、1チェコ・コルナ=5.894円、100韓国・ウォン=10.62円、1マレーシア・リンギット=30.139円、1南アフリカ・ランド=7.78円、1タイ・バーツ=3.94円、1ポーランド・ズロチ=30.135円、100ハンガリー・フォリント=35.661円、1ユーロ=141.38円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年1月10日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	1,913,739,077円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	44,952,889
公 社 債(評価額)	1,852,492,767
未 収 入 金	254,085
未 収 利 息	14,695,610
前 払 費 用	1,343,726
(B) 負 債	-
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	1,913,739,077
元 本	1,172,641,832
次 期 繰 越 損 益 金	741,097,245
(D) 受 益 権 総 口 数	1,172,641,832口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,320円

(注1) 期首元本額 1,232,178,197円
追加設定元本額 -円
一部解約元本額 59,536,365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) 1,172,641,832円
期末元本合計 1,172,641,832円

■損益の状況

当期 自2022年7月12日 至2023年1月10日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	25,376,102円
受 取 利 息	25,178,496
そ の 他 収 益 金	197,878
支 払 利 息	△272
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△82,602,409
売 買 益	32,870,418
売 買 損	△115,472,827
(C) そ の 他 費 用	△434,219
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	△57,660,526
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	840,221,406
(F) 解 約 差 損 益 金	△41,463,635
(G) 合 計(D + E + F)	741,097,245
次 期 繰 越 損 益 金(G)	741,097,245

(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。