

運用報告書 (全体版)

ルーミス・グローバル債券ファンド (毎月決算型)

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券	
信託期間	2007年1月31日から無期限です。	
運用方針	日本を除く世界各国の公社債に投資し、安定した収益の確保と信託財産の中・長期的な成長を目指します。	
主要投資対象	ルーミス・グローバル債券ファンド (毎月決算型)	ルーミス・グローバル債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	ルーミス・グローバル債券マザーファンド	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
運用方法	<p>ファンド全体の加重平均格付けは、B B B格相当以上に維持することを基本とします。</p> <p>公社債の組入比率は、高位を保つことを基本とします。先進国の投資適格債60%、先進国の高利回り債20%、新興国の公社債20%を基本配分比率とします。</p> <p>外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p> <p>ルーミス・グローバル債券マザーファンドにおける円の余資運用以外の運用の指図に関する権限を、ルーミス・セイレス・アンド・カンパニー・エル・ピーに委託します。</p>	
組入制限	ルーミス・グローバル債券ファンド (毎月決算型)	外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
	ルーミス・グローバル債券マザーファンド	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
分配方針	<p>第3期以降、原則として経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益（評価益を含みます。以下同じ。）等の全額を分配対象額の範囲とし、分配金額は、原則として利息収入相当分を中心とし、委託会社が基準価額の水準、市況動向等を勘案して決定します。</p> <p>なお、売買益等については、原則として毎年5月および11月の決算時に分配を行うことを目指します。ただし、分配対象額が少額の場合ならびに委託会社が基準価額の水準、市況動向を勘案したうえで、分配を見送る場合があります。</p>	

第192期	<決算日	2023年2月10日>
第193期	<決算日	2023年3月10日>
第194期	<決算日	2023年4月10日>
第195期	<決算日	2023年5月10日>
第196期	<決算日	2023年6月12日>
第197期	<決算日	2023年7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7月10日に第197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 比	券 入 率	債 先 比	券 率 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29 作成期	168期(2021年2月10日)	円 6,091	円 10	% 0.2	288.50	0.1	104.62	1.16	0.03	△0.45	0.02	96.8	—	—	—	百万円 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
	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
第30 作成期	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
	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
第31 作成期	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
	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
第32 作成期	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
	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
第33 作成期	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
	192期(2023年2月10日)	5,998	5	0.0	302.76	△0.5	131.71	3.66	0.13	2.30	0.07	95.7	—	—	—	1,934
第33 作成期	193期(2023年3月10日)	6,023	5	0.5	306.79	1.3	136.01	3.90	0.25	2.64	0.34	94.1	—	—	—	1,928
	194期(2023年4月10日)	6,120	5	1.7	308.59	0.6	132.62	3.39	△0.51	2.18	△0.46	95.1	—	—	—	1,955
	195期(2023年5月10日)	6,204	5	1.5	314.97	2.1	135.15	3.52	0.13	2.35	0.17	96.1	—	—	—	1,978
	196期(2023年6月12日)	6,311	5	1.8	320.96	1.9	139.43	3.74	0.22	2.38	0.03	95.9	—	—	—	2,004
	197期(2023年7月10日)	6,398	5	1.5	325.24	1.3	142.54	4.06	0.32	2.64	0.26	97.5	—	—	—	2,024

(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・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192期	(期首) 2023年1月10日	円	%	304.23	%	円	%	%	%	%	%	%	%	%
	1月末	6,002	-	303.68	-	131.85	3.53	-	2.23	-	95.4	-	-	-
	(期末) 2023年2月10日	6,007	0.1	306.79	△0.2	130.47	3.54	0.00	2.32	0.09	95.2	-	-	-
第193期	(期首) 2023年2月10日	6,003	0.0	302.76	△0.5	131.71	3.66	0.13	2.30	0.07	95.7	-	-	-
	2月末	5,998	-	302.76	-	131.71	3.66	-	2.30	-	95.7	-	-	-
	(期末) 2023年3月10日	6,063	1.1	306.99	1.4	136.33	3.91	0.26	2.58	0.28	95.7	-	-	-
第194期	(期首) 2023年3月10日	6,028	0.5	306.79	1.3	136.01	3.90	0.25	2.64	0.34	94.1	-	-	-
	3月末	6,023	-	306.79	-	136.01	3.90	-	2.64	-	94.1	-	-	-
	(期末) 2023年4月10日	6,112	1.5	307.96	0.4	133.53	3.55	△0.35	2.37	△0.27	95.1	-	-	-
第195期	(期首) 2023年4月10日	6,125	1.7	308.59	0.6	132.62	3.39	△0.51	2.18	△0.46	95.1	-	-	-
	4月末	6,120	-	308.59	-	132.62	3.39	-	2.18	-	95.1	-	-	-
	(期末) 2023年5月10日	6,155	0.6	312.25	1.2	134.13	3.52	0.13	2.46	0.28	95.2	-	-	-
第196期	(期首) 2023年5月10日	6,209	1.5	314.97	2.1	135.15	3.52	0.13	2.35	0.17	96.1	-	-	-
	5月末	6,204	-	314.97	-	135.15	3.52	-	2.35	-	96.1	-	-	-
	(期末) 2023年6月12日	6,311	1.7	320.97	1.9	139.77	3.69	0.17	2.34	△0.01	96.8	-	-	-
第197期	(期首) 2023年6月12日	6,316	1.8	320.96	1.9	139.43	3.74	0.22	2.38	0.03	95.9	-	-	-
	6月末	6,311	-	320.96	-	139.43	3.74	-	2.38	-	95.9	-	-	-
	(期末) 2023年7月10日	6,557	3.9	333.03	3.8	144.99	3.84	0.10	2.42	0.04	96.8	-	-	-

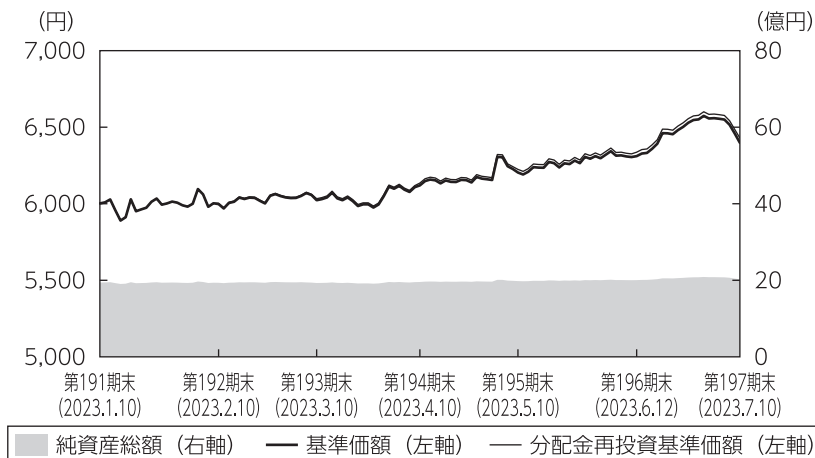
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率および騰落幅は期首比です。

(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192期～第197期の運用経過 (2023年1月11日から2023年7月10日まで)

基準価額等の推移



第192期首： 6,002円
第197期末： 6,398円
(既払分配金30円)
騰落率： 7.1%
(分配金再投資ベース)

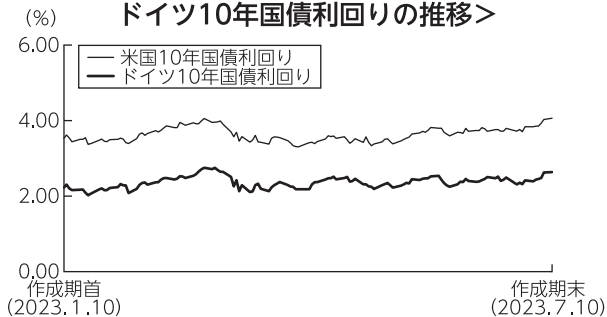
- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

基準価額の主な変動要因

「ルーミス・グローバル債券マザーファンド」受益証券への投資を通じて、日本を除く世界各国の公社債へ投資を行った結果、保有する債券の価格が下落（利回りは上昇）したものの、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（税引前分配金再投資ベース）は上昇しました。

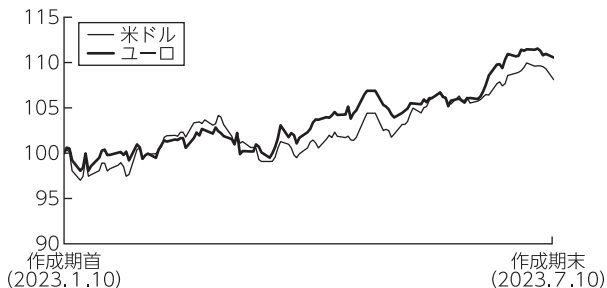
投資環境

<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、米政府の債務上限問題が懸念されたことやインフレ圧力の強まりなどを背景にF R B（米連邦準備理事会）の金融引き締め長期化観測が広まったこと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）が積極的な金融引き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、欧州ともに小幅に下落しました。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、ユーロともに上昇しました。米ドルは、F R Bの金融引き締め長期化観測が広がり、日米金利差が拡大したことなどが上昇要因となりました。ユーロは、E C Bが積極的な金融引き締め姿勢を示し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。

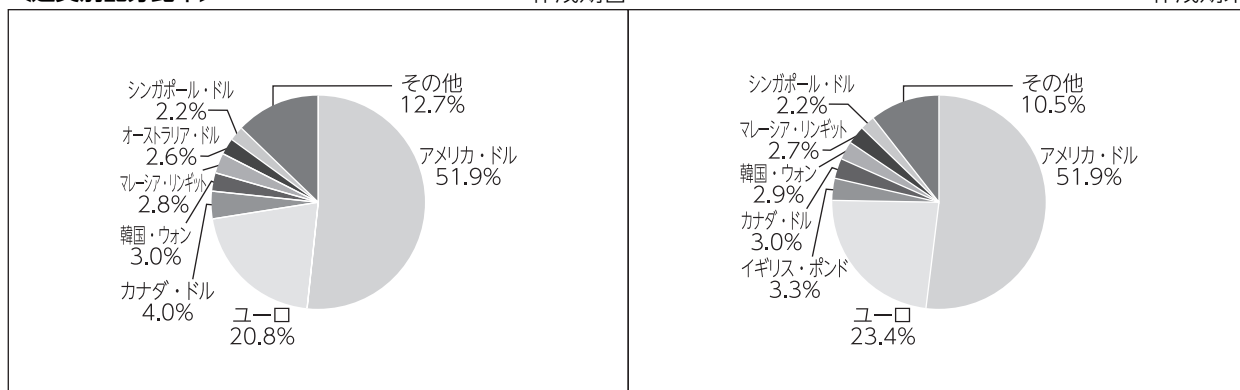
●ルーミス・グローバル債券マザーファンド

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たものの、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。

〔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。

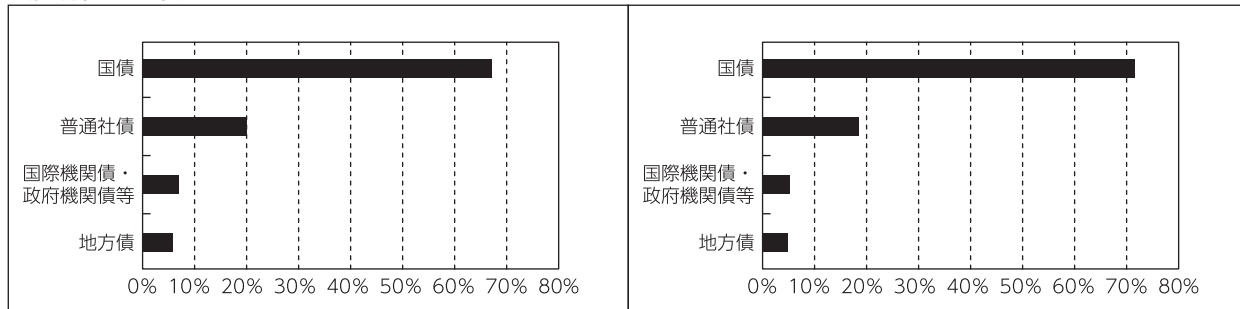
(注2) 現金等はその他として表示しています。

(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

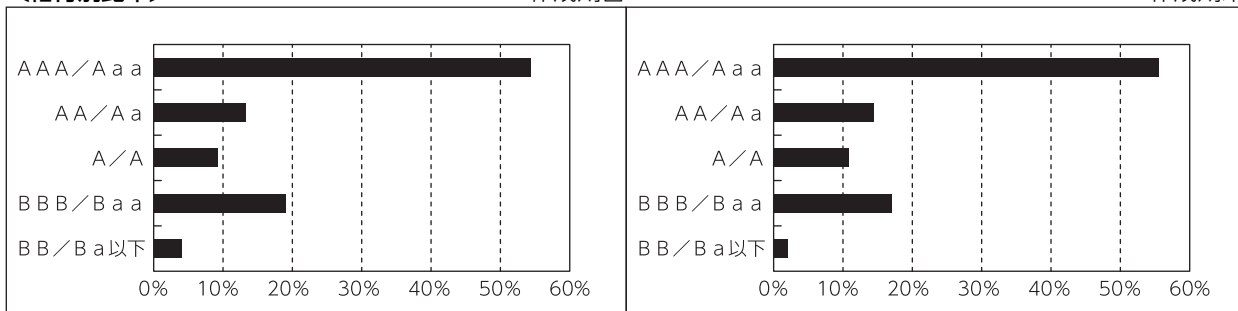


(注) 上記比率は、ルーミス・グローバル債券マザーファンドの債券部分に対する評価額の割合です。

【格付別比率】

作成期首

作成期末



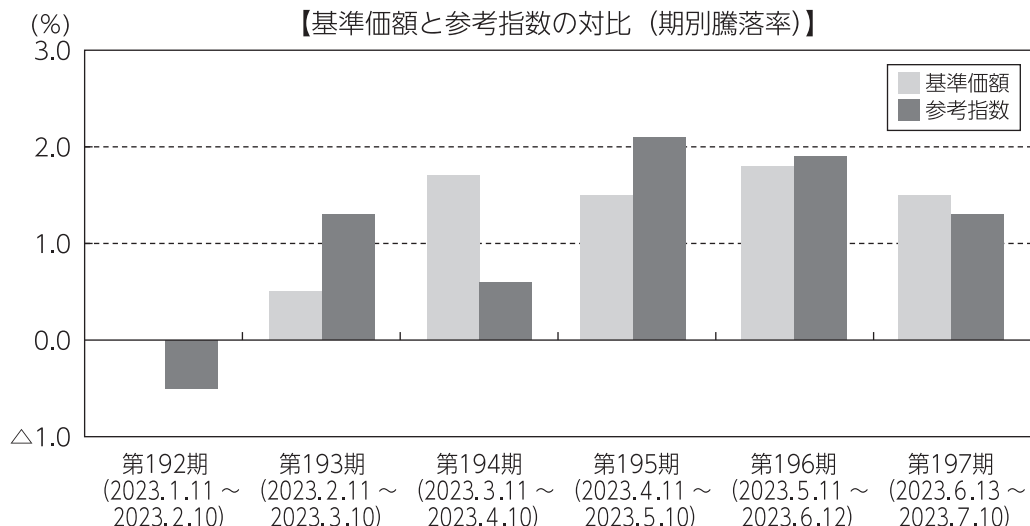
(注1) 上記比率は、ルーミス・グローバル債券マザーファンドの債券部分に対する評価額の割合です。

(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192期	第193期	第194期	第195期	第196期	第197期
	2023年1月11日 ～2023年2月10日	2023年2月11日 ～2023年3月10日	2023年3月11日 ～2023年4月10日	2023年4月11日 ～2023年5月10日	2023年5月11日 ～2023年6月12日	2023年6月13日 ～2023年7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	4円	5円	5円	5円	5円	5円
当期の収益以外	0円	-円	-円	-円	-円	-円
翌期繰越分配対象額	199円	204円	211円	219円	228円	236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、6月の利上げは見送られましたが、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、米国と比較して引き締めが進んでいない中、インフレは引き続き高水準であることから、インフレ抑制の優先度は高く、利上げを継続すると予想されます。債券種別配分については、相対的に景気感応度の低い業種等を選択しつつ、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192期～第197期		項目の概要
	(2023年1月11日 ～2023年7月10日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	50円	0.815%	(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6,169円です。
(投信会社)	(29)	(0.462)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(20)	(0.326)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書各種書類の送付、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	0.026	(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)	(0.025)	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	0.841	

(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まず。

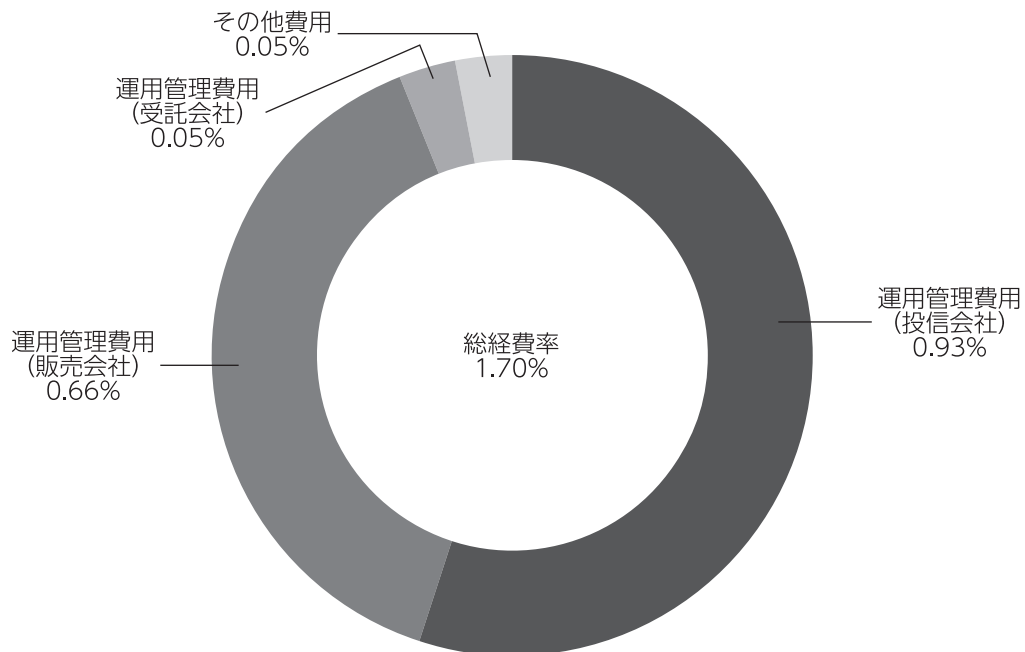
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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（2023年1月11日から2023年7月10日まで）

	第 192 期 ~ 第 197 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 30,282	千円 50,000

■利害関係人との取引状況等（2023年1月11日から2023年7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32作成期末	第33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 1,172,641	千口 1,142,358	千円 2,016,035

■投資信託財産の構成

2023年7月10日現在

項 目	第33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 2,016,035	99.2%
コール・ローン等、その他	16,966	0.8
投資信託財産総額	2,033,001	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、2,014,921千円、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、2023年7月10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=142.54円、1カナダ・ドル=107.30円、1オーストラリア・ドル=95.26円、1シンガポール・ドル=105.82円、1ニュージーランド・ドル=88.39円、1イギリス・ポンド=182.82円、1スイス・フラン=160.25円、1デンマーク・クローネ=20.98円、1ノルウェー・クローネ=13.41円、1スウェーデン・クローナ=13.17円、1メキシコ・ペソ=8.317円、1アルゼンチン・ペソ=0.545円、100コロンビア・ペソ=3.421円、100インドネシア・ルピア=0.95円、1ブラジル・レアル=29.247円、100韓国・ウォン=10.95円、1マレーシア・リンギット=30.594円、1南アフリカ・ランド=7.55円、1タイ・バーツ=4.06円、1ポランド・ズロチ=35.091円、100ハンガリー・フォリント=40.653円、1ユーロ=156.30円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年2月10日)、(2023年3月10日)、(2023年4月10日)、(2023年5月10日)、(2023年6月12日)、(2023年7月10日)現在

項 目	第192期末	第193期末	第194期末	第195期末	第196期末	第197期末
(A)資 産	1,939,123,407円	1,932,776,822円	1,959,832,580円	1,983,056,575円	2,008,975,550円	2,033,001,847円
コール・ローン等	22,440,333	53,824,756	45,581,621	37,619,216	24,926,457	16,966,702
ルーミス・グローバル債券マザーファンド(評価額)	1,916,683,074	1,878,952,066	1,914,250,959	1,945,437,359	1,984,049,093	2,016,035,145
(B)負 債	4,331,302	4,065,710	4,315,808	4,273,683	4,563,005	8,410,744
未払収益分配金	1,612,936	1,601,127	1,597,674	1,594,713	1,587,977	1,582,106
未払解約金	-	-	8,163	-	-	4,229,700
未払信託報酬	2,712,429	2,459,204	2,704,057	2,673,124	2,968,532	2,593,264
その他未払費用	5,937	5,379	5,914	5,846	6,496	5,674
(C)純資産総額(A-B)	1,934,792,105	1,928,711,112	1,955,516,772	1,978,782,892	2,004,412,545	2,024,591,103
元 本	3,225,873,682	3,202,255,740	3,195,349,023	3,189,427,656	3,175,954,930	3,164,213,636
次期繰越損益金	△1,291,081,577	△1,273,544,628	△1,239,832,251	△1,210,644,764	△1,171,542,385	△1,139,622,533
(D)受益権総口数	3,225,873,682口	3,202,255,740口	3,195,349,023口	3,189,427,656口	3,175,954,930口	3,164,213,636口
1万口当たり基準価額(C/D)	5,998円	6,023円	6,120円	6,204円	6,311円	6,398円

(注) 第191期末における元本額は3,234,644,495円、当作成期間(第192期～第197期)中における追加設定元本額は1,073,934円、同解約元本額は71,504,793円です。

■損益の状況

[自 2023年1月11日] [自 2023年2月11日] [自 2023年3月11日] [自 2023年4月11日] [自 2023年5月11日] [自 2023年6月13日]
 [至 2023年2月10日] [至 2023年3月10日] [至 2023年4月10日] [至 2023年5月10日] [至 2023年6月12日] [至 2023年7月10日]

項 目	第192期	第193期	第194期	第195期	第196期	第197期
(A)配 当 等 収 益	△277円	△152円	△449円	△1,090円	△1,078円	△873円
受 取 利 息	-	1	-	-	1	1
支 払 利 息	△277	△153	△449	△1,090	△1,079	△874
(B)有価証券売買損益	2,914,500	12,150,676	35,273,773	31,164,704	38,552,690	31,770,651
売 買 益	2,935,088	12,271,260	35,309,166	31,186,400	38,618,310	31,986,052
売 買 損	△20,588	△120,584	△35,393	△21,696	△65,620	△215,401
(C)信 託 報 酬 等	△2,718,366	△2,464,583	△2,709,971	△2,678,970	△2,975,028	△2,598,938
(D)当期損益金(A + B + C)	195,857	9,685,941	32,563,353	28,484,644	35,576,584	29,170,840
(E)前期繰越損益金	△1,070,861,774	△1,064,368,528	△1,053,945,881	△1,021,027,419	△989,883,515	△952,308,932
(F)追加信託差損益金	△218,802,724	△217,260,914	△216,852,049	△216,507,276	△215,647,477	△214,902,335
(配当等相当額)	(30,269,528)	(30,049,989)	(29,987,320)	(29,934,017)	(29,809,923)	(29,702,225)
(売買損益相当額)	(△249,072,252)	(△247,310,903)	(△246,839,369)	(△246,441,293)	(△245,457,400)	(△244,604,560)
(G)合 計(D + E + F)	△1,289,468,641	△1,271,943,501	△1,238,234,577	△1,209,050,051	△1,169,954,408	△1,138,040,427
(H)収 益 分 配 金	△1,612,936	△1,601,127	△1,597,674	△1,594,713	△1,587,977	△1,582,106
次期繰越損益金(G + H)	△1,291,081,577	△1,273,544,628	△1,239,832,251	△1,210,644,764	△1,171,542,385	△1,139,622,533
追加信託差損益金	△218,802,724	△217,260,914	△216,852,049	△216,507,276	△215,647,477	△214,902,335
(配当等相当額)	(30,269,688)	(30,050,133)	(29,987,487)	(29,934,165)	(29,810,098)	(29,702,380)
(売買損益相当額)	(△249,072,412)	(△247,311,047)	(△246,839,536)	(△246,441,441)	(△245,457,575)	(△244,604,715)
分配準備積立金	34,056,985	35,332,009	37,660,278	39,960,844	42,802,252	45,007,588
繰 越 損 益 金	△1,106,335,838	△1,091,615,723	△1,060,640,480	△1,034,098,332	△998,697,160	△969,727,786

(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192期から第197期まではルミス・グローバル債券マザーファンド4,820,638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192期	第193期	第194期	第195期	第196期	第197期
(a)経費控除後の配当等収益	1,456,071円	3,127,393円	4,004,141円	3,967,170円	4,600,378円	3,948,012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	30,269,688	30,050,133	29,987,487	29,934,165	29,810,098	29,702,380
(d)分 配 準 備 積 立 金	34,213,850	33,805,743	35,253,811	37,588,387	39,789,851	42,641,682
(e)当期分配対象額(a + b + c + d)	65,939,609	66,983,269	69,245,439	71,489,722	74,200,327	76,292,074
(f)1万口当たり当期分配対象額	204.41	209.18	216.71	224.15	233.63	241.11
(g)分 配 金	1,612,936	1,601,127	1,597,674	1,594,713	1,587,977	1,582,106
(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192期	第193期	第194期	第195期	第196期	第197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33期（決算日 2023年7月10日）

（計算期間 2023年1月11日～2023年7月10日）

ルーミス・グローバル債券マザーファンドの第33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					
29期 (2021年7月12日)	円	%		%	円	%	%	%	%	%	%	%	%	百万円
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
33期 (2023年7月10日)	17,648	8.1	325.24	6.9	142.54	4.06	0.53	2.64	0.41	97.9	-	-	-	2,016

(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)。

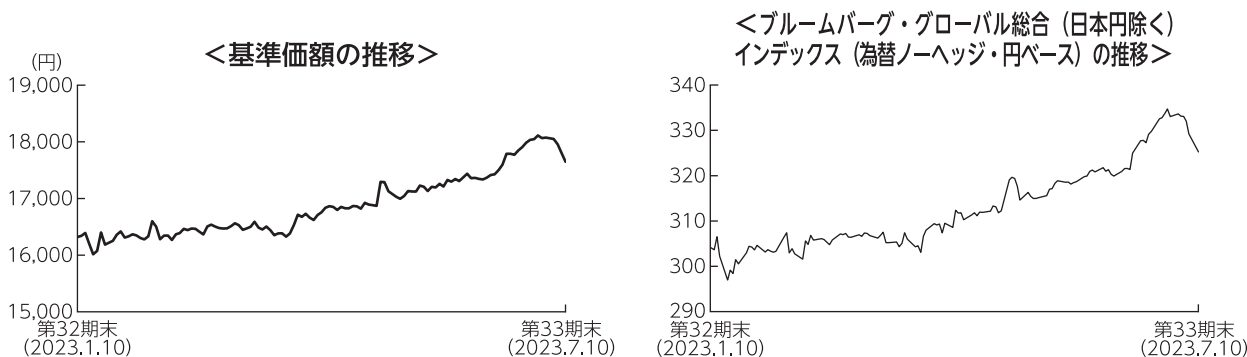
■当期中の基準価額と市況の推移

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 (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) 2023年1月10日	円	%		%	円	%	%	%	%	%	%
	16,320	—	304.23	—	131.85	3.53	—	2.23	—	96.8	—
1月末	16,348	0.2	303.68	△0.2	130.47	3.54	0.00	2.32	0.09	96.3	—
2月末	16,539	1.3	306.99	0.9	136.33	3.91	0.38	2.58	0.35	96.5	—
3月末	16,714	2.4	307.96	1.2	133.53	3.55	0.02	2.37	0.15	97.4	—
4月末	16,870	3.4	312.25	2.6	134.13	3.52	△0.01	2.46	0.23	97.0	—
5月末	17,344	6.3	320.97	5.5	139.77	3.69	0.15	2.34	0.11	98.0	—
6月末	18,065	10.7	333.03	9.5	144.99	3.84	0.31	2.42	0.19	97.6	—
(期末) 2023年7月10日	17,648	8.1	325.24	6.9	142.54	4.06	0.53	2.64	0.41	97.9	—

(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 (2023年1月11日から2023年7月10日まで)



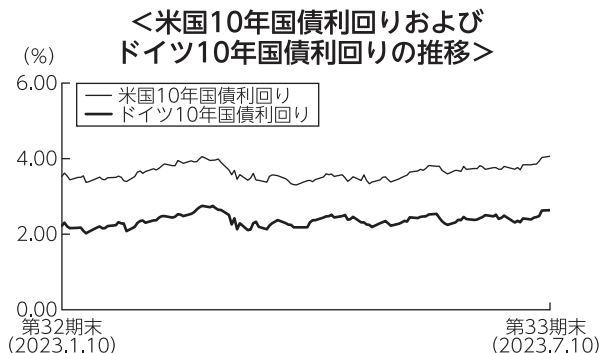
基準価額の推移

当ファンドの基準価額は、前期末比で8.1%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、保有する債券の価格が下落（利回りは上昇）したものの、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

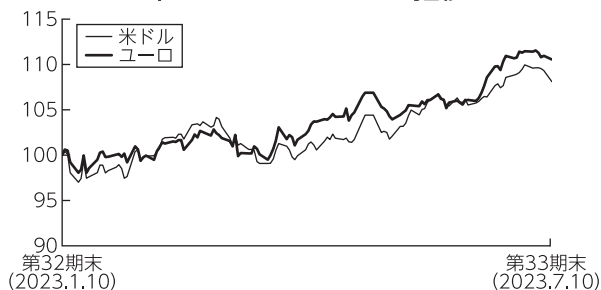


米国国債市場は、米政府の債務上限問題が懸念されたことやインフレ圧力の強まりなどを背景にF R B（米連邦準備理事会）の金融引き締め長期化観測が広まったことを受け下落しました。ドイツ国債市場は、E C B（欧州中央銀行）が積極的な金融引き締め姿勢を示したことなどから下落しました。投資適格社債市場は、米国、欧州ともに小幅に下落しました。信用スプレッドは、米国、欧州ともに縮小しました。

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、ユーロともに上昇しました。米ドルは、F R Bの金融引き締め長期化観測が広がり、日米金利差が拡大したことなどが上昇要因となりました。ユーロは、E C Bが積極的な金融引き締め姿勢を示したことなどが上昇要因となりました。

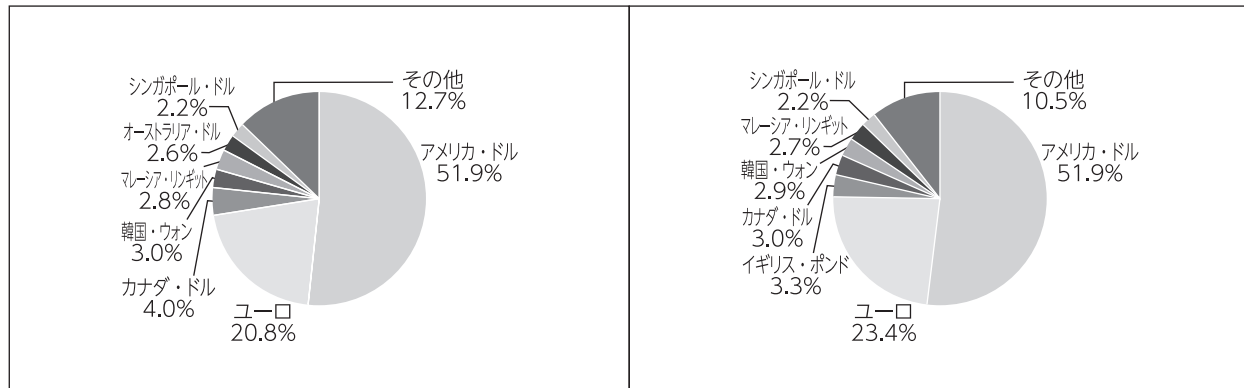
ポートフォリオについて

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たものの、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。

(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。

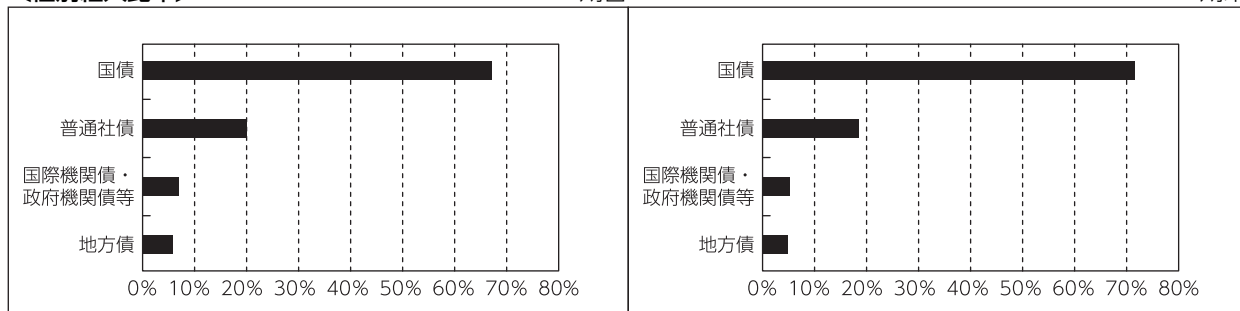
(注2) 現金等はその他として表示しています。

(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

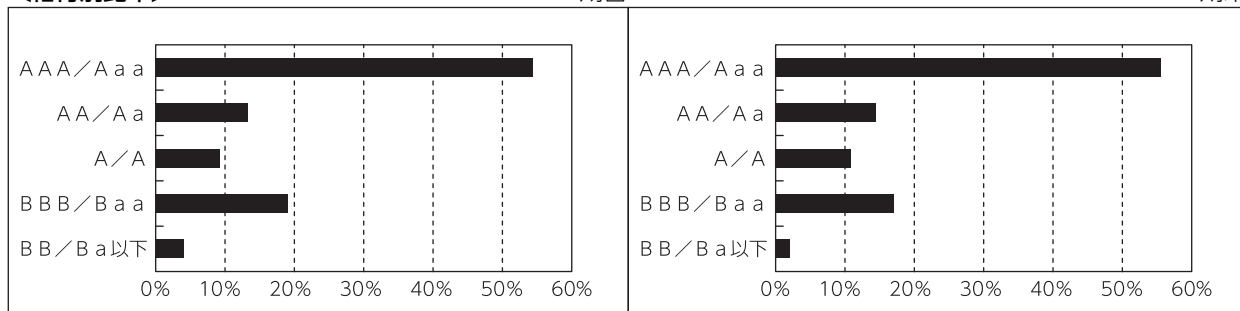


(注) 上記比率は、ルーミス・グローバル債券マザーファンドの債券部分に対する評価額の割合です。

【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

米国は、6月の利上げは見送られましたが、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、米国と比較して引き締めが進んでいない中、インフレは引き続き高水準であることから、インフレ抑制の優先度は高く、利上げを継続すると予想されます。債券種別配分については、相対的に景気感応度の低い業種等を選好しつつ、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)	4円 (4)	0.025% (0.025)	(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	4	0.025	
期中の平均基準価額は16,887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 (2023年1月11日から2023年7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 3,336	千アメリカ・ドル 3,127 (120)
		社債証券	625	537 (187)
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 223	千カナダ・ドル 190 (-)
		特殊債証券	-	235 (-)
	オーストラリア	地方債証券	千オーストラリア・ドル 29	千オーストラリア・ドル 245 (-)
	ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランド・ドル 60	千ニュージーランド・ドル 264 (45)
国	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 311	千イギリス・ポンド 98 (-)
		特殊債証券	-	77 (-)
		社債証券	90	86 (-)

			買付額	売付額
外	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 2,039	千メキシコ・ペソ 2,045 (-)
	ブラジル	国債証券	千ブラジル・リアル 145	千ブラジル・リアル -
	韓国	国債証券	千韓国・ウォン 59,698	千韓国・ウォン 58,495 (-)
国	ユーロ ドイツ	国債証券	千ユーロ 841	千ユーロ 479 (-)
		社債証券	79	194 (-)

(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(2023年1月11日から2023年7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 8,361	千アメリカ・ドル 7,344	千円 1,046,952	% 51.9	% 0.4	% 30.8	% 17.2	% 3.9
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 690	千カナダ・ドル 555	千円 59,584	3.0	—	1.8	1.2	—
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 345	千オーストラリア・ドル 317	千円 30,250	1.5	—	0.5	1.0	—
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 421	千円 44,566	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 35	千ニュージーランド・ドル 34	千円 3,039	0.2	—	—	0.2	—
イギリス	千イギリス・ポンド 380	千イギリス・ポンド 364	千円 66,704	3.3	—	3.3	—	—
スイス	千スイス・フラン 155	千スイス・フラン 150	千円 24,040	1.2	—	—	1.2	—
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 125	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 605	千円 7,979	0.4	—	—	—	0.4
メキシコ	千メキシコ・ペソ 876	千メキシコ・ペソ 865	千円 7,198	0.4	—	—	—	0.4
コロンビア	千コロンビア・ペソ 393,800	千コロンビア・ペソ 369,115	千円 12,628	0.6	—	—	0.6	—
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 3,915,179	千円 37,194	1.8	—	1.8	—	—
ブラジル	千ブラジル・レアル 789	千ブラジル・レアル 782	千円 22,876	1.1	1.1	0.2	0.9	—
韓国	千韓国・ウォン 581,950	千韓国・ウォン 536,237	千円 58,717	2.9	—	1.2	0.3	1.4
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 1,801	千円 55,113	2.7	—	—	2.7	—
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 1,292	千円 9,761	0.5	0.5	0.5	—	—
タイ	千タイ・バーツ 2,295	千タイ・バーツ 2,186	千円 8,876	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 132	千円 4,646	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	130	117	18,394	0.9	—	0.2	0.7	—
オ ラ ン ダ	100	87	13,620	0.7	—	—	0.7	—
ベ ル ギ ー	100	94	14,695	0.7	—	—	—	0.7
ル ク セ ン ブ ル グ	200	148	23,208	1.2	—	0.6	0.6	—
フ ラ ン ス	380	304	47,670	2.4	—	1.9	0.5	—
ド イ ツ	1,805	1,455	227,516	11.3	—	7.5	2.5	1.3
ス イ ス	130	111	17,370	0.9	—	—	0.9	—
ス ペ イ ン	305	275	43,108	2.1	—	2.1	—	—
イ タ リ ア	205	173	27,082	1.3	—	1.3	—	—
カ ナ ダ	265	252	39,426	2.0	—	—	—	2.0
合 計	—	—	千円 1,973,902	97.9	2.1	54.3	33.0	10.6

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

(注2) 組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。

(注3) 無格付銘柄については、B B格以下に含めて表示しています。

(B) 個別銘柄開示

外国（外貨建）公社債銘柄別

銘 柄	当 期 末						
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
REPUBLIC OF CHILE 2.45 01/31/31	国債証券	2.4500	200	170	24,235	2031/01/31	
US T N/B 1.5 01/31/27	国債証券	1.5000	490	441	62,898	2027/01/31	
US T N/B 2.25 02/15/52	国債証券	2.2500	295	205	29,284	2052/02/15	
US T N/B 3.625 02/15/53	国債証券	3.6250	20	18	2,640	2053/02/15	
US T N/B 1.875 02/15/51	国債証券	1.8750	280	178	25,453	2051/02/15	
US T N/B 0.5 02/28/26	国債証券	0.5000	350	313	44,704	2026/02/28	
US T N/B 2.75 04/30/27	国債証券	2.7500	245	229	32,773	2027/04/30	
US T N/B 3.375 05/15/33	国債証券	3.3750	645	609	86,852	2033/05/15	
US T N/B 3.625 05/31/28	国債証券	3.6250	200	193	27,611	2028/05/31	
US T N/B 3.625 05/15/26	国債証券	3.6250	325	315	45,026	2026/05/15	
TSY INFL 0.625 07/15/32	国債証券	0.6250	255	240	34,321	2032/07/15	
US T N/B 2.75 07/31/27	国債証券	2.7500	355	332	47,362	2027/07/31	
US T N/B 1.75 08/15/41	国債証券	1.7500	500	340	48,544	2041/08/15	
US T N/B 2.75 08/15/32	国債証券	2.7500	755	678	96,755	2032/08/15	
US T N/B 0.875 09/30/26	国債証券	0.8750	235	209	29,837	2026/09/30	
US T N/B 4.125 10/31/27	国債証券	4.1250	140	138	19,695	2027/10/31	

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 1.625 11/15/50	国債証券	1.6250	50	29	4,259	2050/11/15
US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	2.2500	515	494	70,526	2024/11/15
US T N/B 1.375 11/15/31	国債証券	1.3750	90	72	10,382	2031/11/15
US T N/B 1.375 12/31/28	国債証券	1.3750	125	107	15,279	2028/12/31
UNITED AIR 2016-1 B PTT 3.65 01/07/26	社債証券	3.6500	23	21	3,114	2026/01/07
SUZANO AUSTRIA G 3.125 01/15/32	社債証券	3.1250	5	3	562	2032/01/15
T-MOBILE USA INC 5.2 01/15/33	社債証券	5.2000	45	43	6,259	2033/01/15
CONTINENTAL RESOURCES 4.375 01/15/28	社債証券	4.3750	24	22	3,186	2028/01/15
EQT CORP 5.0 01/15/29	社債証券	5.0000	10	9	1,326	2029/01/15
CONTINENTAL RESOURCES 5.75 01/15/31	社債証券	5.7500	40	37	5,357	2031/01/15
AMERICAN TOWER CORP 2.9 01/15/30	社債証券	2.9000	30	25	3,642	2030/01/15
SUZANO AUSTRIA GMBH 3.75 01/15/31	社債証券	3.7500	45	37	5,408	2031/01/15
AES CORP/THE 2.45 01/15/31	社債証券	2.4500	50	39	5,667	2031/01/15
T-MOBILE USA INC 3.3 02/15/51	社債証券	3.3000	15	10	1,458	2051/02/15
TOLL BROS FINANCE CORP 4.35 02/15/28	社債証券	4.3500	85	79	11,298	2028/02/15
AT&T 5.4 02/15/34	社債証券	5.4000	40	39	5,590	2034/02/15
OVINTIV INC 6.5 02/01/38	社債証券	6.5000	5	4	685	2038/02/01
T-MOBILE USA INC 4.75 02/01/28	社債証券	4.7500	90	86	12,393	2028/02/01
BOEING CO 3.75 02/01/50	社債証券	3.7500	15	10	1,557	2050/02/01
COMCAST CORP 4.65 02/15/33	社債証券	4.6500	15	14	2,077	2033/02/15
CENTENE CORP 3.375 02/15/30	社債証券	3.3750	20	16	2,422	2030/02/15
BOEING CO 2.196 02/04/26	社債証券	2.1960	5	4	653	2026/02/04
BOEING CO 3.825 03/01/59	社債証券	3.8250	5	3	496	2059/03/01
CF INDUSTRIES INC 5.15 03/15/34	社債証券	5.1500	10	9	1,340	2034/03/15
COMCAST CORP 4.0 03/01/48	社債証券	4.0000	15	12	1,725	2048/03/01
CF INDUSTRIES INC 5.375 03/15/44	社債証券	5.3750	10	8	1,262	2044/03/15
HCA INC 3.625 03/15/32	社債証券	3.6250	130	110	15,802	2032/03/15
CENTENE CORP 2.5 03/01/31	社債証券	2.5000	20	15	2,248	2031/03/01
FREEMPORT-MCMORAN INC 4.25 03/01/30	社債証券	4.2500	5	4	650	2030/03/01
ALLY FINANCIAL INC 4.625 03/30/25	社債証券	4.6250	10	9	1,374	2025/03/30
CHARTER COMM OPT LLC/CAP 3.7 04/01/51	社債証券	3.7000	40	24	3,503	2051/04/01
CONTINENTAL RESOURCES 2.875 04/01/32	社債証券	2.8750	10	7	1,078	2032/04/01
UNITEDHEALTH GROUP INC 4.5 04/15/33	社債証券	4.5000	80	76	10,911	2033/04/15
BROADCOM INC 3.469 04/15/34	社債証券	3.4690	45	36	5,165	2034/04/15
MORGAN STANLEY 04/21/34	社債証券	5.2500	45	43	6,208	2034/04/21
BANK OF AMERICA CORP 04/25/34	社債証券	5.2880	115	111	15,921	2034/04/25
T-MOBILE USA INC 3.875 04/15/30	社債証券	3.8750	55	49	7,116	2030/04/15
NEW YORK LIFE INSURANCE 3.75 05/15/50	社債証券	3.7500	50	37	5,288	2050/05/15
UNITEDHEALTH GROUP INC 2.9 05/15/50	社債証券	2.9000	10	6	963	2050/05/15
ENERGY TRANSFER OPERATING 5.0 05/15/50	社債証券	5.0000	20	16	2,342	2050/05/15
EQT CORP 3.625 05/15/31	社債証券	3.6250	30	25	3,619	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	1,598	2049/05/01
GLENCORE FUNDING LLC 5.7 05/08/33	社 債 券	5.7000	10	9	1,386	2033/05/08
ALLY FINANCIAL INC 3.875 05/21/24	社 債 券	3.8750	5	4	696	2024/05/21
ALLY FINANCIAL INC 5.8 05/01/25	社 債 券	5.8000	5	4	701	2025/05/01
BOEING CO 2.25 06/15/26	社 債 券	2.2500	5	4	646	2026/06/15
CF INDUSTRIES INC 4.95 06/01/43	社 債 券	4.9500	5	4	599	2043/06/01
FORD FOUNDATION/THE 3.859 06/01/47	社 債 券	3.8590	65	52	7,513	2047/06/01
AT&T 3.65 06/01/51	社 債 券	3.6500	65	46	6,621	2051/06/01
GREAT-WEST LIFECO FINANC 4.15 06/03/47	社 債 券	4.1500	45	34	4,972	2047/06/03
JPMORGAN CHASE & CO 06/01/34	社 債 券	5.3500	50	49	7,031	2034/06/01
HCA INC 5.5 06/01/33	社 債 券	5.5000	25	24	3,481	2033/06/01
CVS HEALTH CORP 5.3 06/01/33	社 債 券	5.3000	30	29	4,191	2033/06/01
DELTA AIRLINES 2015B 4.25 07/30/23	社 債 券	4.2500	32	32	4,604	2023/07/30
CROWN CASTLE INTL CORP 4.15 07/01/50	社 債 券	4.1500	10	7	1,098	2050/07/01
AES CORP/THE 3.95 07/15/30	社 債 券	3.9500	20	17	2,533	2030/07/15
T-MOBILE USA INC 5.05 07/15/33	社 債 券	5.0500	45	43	6,177	2033/07/15
OVINTIV INC 6.25 07/15/33	社 債 券	6.2500	5	4	692	2033/07/15
CVS HEALTH CORP 3.25 08/15/29	社 債 券	3.2500	30	26	3,792	2029/08/15
OVINTIV INC 6.5 08/15/34	社 債 券	6.5000	11	10	1,547	2034/08/15
VMWARE INC 2.2 08/15/31	社 債 券	2.2000	50	38	5,499	2031/08/15
ENEL FINANCE INTL NV 6.8 09/15/37	社 債 券	6.8000	155	159	22,751	2037/09/15
VERIZON COMMUNICATIONS 2.85 09/03/41	社 債 券	2.8500	10	6	987	2041/09/03
CVS HEALTH CORP 2.125 09/15/31	社 債 券	2.1250	110	86	12,397	2031/09/15
GLENCORE FUNDING LLC 2.5 09/01/30	社 債 券	2.5000	15	12	1,721	2030/09/01
GLENCORE FUNDING LLC 2.625 09/23/31	社 債 券	2.6250	55	43	6,206	2031/09/23
T-MOBILE USA INC 3.4 10/15/52	社 債 券	3.4000	10	6	976	2052/10/15
UNITED AIR 2016-2 B PTT 3.65 10/07/25	社 債 券	3.6500	44	41	5,939	2025/10/07
BOEING CO 3.85 11/01/48	社 債 券	3.8500	5	3	513	2048/11/01
OVINTIV INC 7.375 11/01/31	社 債 券	7.3750	10	10	1,502	2031/11/01
CENTENE CORP 4.625 12/15/29	社 債 券	4.6250	80	73	10,437	2029/12/15
小 計	-	-	8,361	7,344	1,046,952	-
(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	200	184	19,826	2029/06/01
ONTARIO (PROVINCE OF) 1.9 12/02/51	地 方 債 証 券	1.9000	250	153	16,495	2051/12/02
IBRD 1.2 07/22/26	特 殊 債 券	1.2000	240	216	23,262	2026/07/22
小 計	-	-	690	555	59,584	-
(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	111	10,661	2030/02/20
QUEENSLAND 2.75 08/20/27	地 方 債 証 券	2.7500	220	205	19,589	2027/08/20
小 計	-	-	345	317	30,250	-

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)		%	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	312	33,017	2027/03/01
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国債証券	3.0000	110	109	11,548	2024/09/01
小 計	-	-	420	421	44,566	-
(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	35	34	3,039	2027/04/15
小 計	-	-	35	34	3,039	-
(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	20	16	2,926	2044/01/22
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国債証券	4.2500	285	278	50,896	2032/06/07
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	75	70	12,881	2055/12/07
小 計	-	-	380	364	66,704	-
(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	150	24,040	2025/11/24
小 計	-	-	155	150	24,040	-
(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	125	1,676	2025/03/13
小 計	-	-	130	125	1,676	-
(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	
KOMMUNINVEST I SVERIGE 1.0 05/12/25	地方債証券	1.0000	640	605	7,979	2025/05/12
小 計	-	-	640	605	7,979	-
(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	865	7,198	2023/12/07
小 計	-	-	876	865	7,198	-
(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	369,115	12,628	2026/08/26
小 計	-	-	393,800	369,115	12,628	-
(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	838,063	7,961	2031/02/15
INDONESIA GOV'T 8.25 05/15/29	国債証券	8.2500	2,788,000	3,077,115	29,232	2029/05/15
小 計	-	-	3,619,000	3,915,179	37,194	-
(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	621	18,176	2027/01/01
BRAZIL NTN 01/01/29	国債証券	10.0000	164	160	4,699	2029/01/01
小 計	-	-	789	782	22,876	-
(韓国)		%	千韓国・ウォン	千韓国・ウォン	千円	
KOREA TREASURY BOND 1.5 03/10/25	国債証券	1.5000	270,000	260,070	28,477	2025/03/10
KOREA TREASURY BOND (TAX) 2.25 12/10/25	国債証券	2.2500	61,950	59,898	6,558	2025/12/10
KOREA TREASURY BOND 1.375 12/10/29	国債証券	1.3750	250,000	216,268	23,681	2029/12/10
小 計	-	-	581,950	536,237	58,717	-

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	634	19,405	2027/03/15
MALAYSIA 3.906 07/15/26	国債証券	3.9060	1,155	1,167	35,708	2026/07/15
小 計	-	-	1,785	1,801	55,113	-
(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	1,292	9,761	2031/02/28
小 計	-	-	1,640	1,292	9,761	-
(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	2,186	8,876	2029/12/17
小 計	-	-	2,295	2,186	8,876	-
(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	132	4,646	2026/07/25
小 計	-	-	145	132	4,646	-
(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	94	14,730	2026/05/15
IRISH 0.0 10/18/31	国債証券	0.0000	30	23	3,663	2031/10/18
小 計	-	-	130	117	18,394	-
(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	13,620	2027/06/21
小 計	-	-	100	87	13,620	-
(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	14,695	2025/05/30
小 計	-	-	100	94	14,695	-
(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	73	11,529	2030/01/17
BLACKSTONE PP EUR HOLD 1.0 05/04/28	社債証券	1.0000	100	74	11,679	2028/05/04
小 計	-	-	200	148	23,208	-
(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	57	8,941	2041/04/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	0.5000	70	64	10,143	2026/05/25
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	国債証券	0.0000	180	137	21,452	2032/05/25
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	国債証券	0.5000	80	45	7,132	2044/06/25
小 計	-	-	380	304	47,670	-
(ユーロ・・・ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	国債証券	0.0000	155	124	19,454	2032/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	国債証券	0.0000	225	189	29,645	2030/02/15
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	国債証券	2.3000	120	116	18,245	2033/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	国債証券	0.0000	320	153	24,041	2052/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	0.0000	155	141	22,164	2026/08/15
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	国債証券	0.2500	35	30	4,841	2028/08/15

銘柄	当 期 末					
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	330	274	42,979	2030/08/15
BUNDESSCHAT 0.4 09/13/24	国債証券	0.4000	100	96	15,098	2024/09/13
COMMERZBANK AG 0.625 05/28/25	特殊債券	0.6250	70	65	10,302	2025/05/28
KFW 0.25 09/15/25	特殊債券	0.2500	195	182	28,463	2025/09/15
DEUTSCHE BANK AG 11/19/30	社債券	1.7500	100	78	12,279	2030/11/19
小 計	—	—	1,805	1,455	227,516	—
(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	111	17,370	2028/01/14
小 計	—	—	130	111	17,370	—
(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	124	19,522	2037/01/31
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	1.9500	85	77	12,064	2030/07/30
BANCO SANTANDER SA 0.1 02/27/32	特殊債券	0.1000	100	73	11,521	2032/02/27
小 計	—	—	305	275	43,108	—
(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	173	27,082	2030/04/01
小 計	—	—	205	173	27,082	—
(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	24,647	2025/01/15
PROVINCE OF ALBERTA 0.625 04/18/25	地方債証券	0.6250	100	94	14,779	2025/04/18
小 計	—	—	265	252	39,426	—
合 計	—	—	—	—	1,973,902	—

■投資信託財産の構成

2023年7月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 1,973,902	% 97.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	55,396	2.7
投 資 信 託 財 産 総 額	2,029,298	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、2,014,921千円、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、2023年7月10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=142.54円、1カナダ・ドル=107.30円、1オーストラリア・ドル=95.26円、1シンガポール・ドル=105.82円、1ニュージーランド・ドル=88.39円、1イギリス・ポンド=182.82円、1スイス・フラン=160.25円、1デンマーク・クローネ=20.98円、1ノルウェー・クローネ=13.41円、1スウェーデン・クローナ=13.17円、1メキシコ・ペソ=8.317円、1アルゼンチン・ペソ=0.545円、100コロンビア・ペソ=3.421円、100インドネシア・ルピア=0.95円、1ブラジル・レアル=29.247円、100韓国・ウォン=10.95円、1マレーシア・リンギット=30.594円、1南アフリカ・ランド=7.55円、1タイ・バーツ=4.06円、1ポランド・ズロチ=35.091円、100ハンガリー・フォリント=40.653円、1ユーロ=156.30円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年7月10日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,031,551,952円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	39,498,227
公 社 債(評価額)	1,973,902,034
未 収 入 金	2,530,129
未 収 利 息	14,269,529
前 払 費 用	1,352,033
(B) 負 債	15,514,652
未 払 金	15,514,652
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	2,016,037,300
元 本	1,142,358,990
次 期 繰 越 損 益 金	873,678,310
(D) 受 益 権 総 口 数	1,142,358,990口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,648円

(注1) 期首元本額 1,172,641,832円
追加設定元本額 -円
一部解約元本額 30,282,842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) 1,142,358,990円
期末元本合計 1,142,358,990円

■損益の状況

当期 自2023年1月11日 至2023年7月10日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	27,292,505円
受 取 利 息	27,292,620
支 払 利 息	△115
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	125,491,568
売 買 益	176,610,217
売 買 損	△51,118,649
(C) そ の 他 費 用	△485,850
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	152,298,223
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	741,097,245
(F) 解 約 差 損 益 金	△19,717,158
(G) 合 計(D + E + F)	873,678,310
次 期 繰 越 損 益 金(G)	873,678,310

(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。