

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156期	<決算日	2020年2月10日>
第157期	<決算日	2020年3月10日>
第158期	<決算日	2020年4月10日>
第159期	<決算日	2020年5月11日>
第160期	<決算日	2020年6月10日>
第161期	<決算日	2020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、2020年7月10日に第161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・パークレイズ・グローバル総合（日本円除く）インデックス （為替ノーヘッジ・円ベース） （参考指数）		為替 （対米ドル）	米国10年国債利回り		ドイツ10年国債利回り		債組比	券入率	債先比	券物率	純資産額
		（分配落）	税込み 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落幅		期中 騰落幅	期中 騰落幅	期中 騰落幅						
第23作成期	132期(2018年2月13日)	円	円	%	259.45	%	円	%	%	%	%	%	%	%	%	百万円
	133期(2018年3月12日)	5,965	10	△3.5	259.45	△3.5	108.73	2.86	0.31	0.76	0.29	96.5	—	—	2,703	
	134期(2018年4月10日)	5,861	10	△1.6	256.20	△1.3	106.95	2.89	0.04	0.65	△0.11	94.7	—	—	2,651	
	135期(2018年5月10日)	5,876	10	0.4	258.57	0.9	106.75	2.78	△0.11	0.50	△0.14	95.7	—	—	2,650	
	136期(2018年6月11日)	5,871	10	0.1	258.64	0.0	109.96	3.00	0.23	0.56	0.06	95.9	—	—	2,640	
第24作成期	137期(2018年7月10日)	5,803	10	△1.0	256.84	△0.7	109.41	2.95	△0.06	0.45	△0.11	95.4	—	—	2,602	
	138期(2018年8月10日)	5,894	10	1.7	261.73	1.9	111.06	2.86	△0.09	0.30	△0.15	95.6	—	—	2,630	
	139期(2018年9月10日)	5,832	10	△0.9	260.22	△0.6	110.92	2.93	0.07	0.38	0.08	95.4	—	—	2,586	
	140期(2018年10月10日)	5,789	10	△0.6	260.48	0.1	110.93	2.94	0.01	0.39	0.01	95.8	—	—	2,555	
	141期(2018年11月12日)	5,840	10	1.1	261.88	0.5	113.06	3.21	0.27	0.55	0.16	94.7	—	—	2,553	
第25作成期	142期(2018年12月10日)	5,835	10	0.1	262.92	0.4	113.94	3.18	△0.02	0.41	△0.14	96.7	—	—	2,524	
	143期(2019年1月10日)	5,787	10	△0.7	263.49	0.2	112.52	2.85	△0.34	0.25	△0.16	96.2	—	—	2,497	
	144期(2019年2月12日)	5,640	10	△2.4	255.72	△3.0	108.19	2.71	△0.14	0.28	0.03	96.0	—	—	2,419	
	145期(2019年3月11日)	5,768	10	2.4	262.03	2.5	110.55	2.65	△0.06	0.12	△0.16	96.7	—	—	2,458	
	146期(2019年4月10日)	5,792	10	0.6	264.88	1.1	110.95	2.63	△0.03	0.07	△0.05	95.4	—	—	2,457	
第26作成期	147期(2019年5月10日)	5,865	10	1.4	268.10	1.2	111.20	2.50	△0.13	△0.01	△0.08	95.1	—	—	2,481	
	148期(2019年6月10日)	5,767	10	△1.5	264.53	△1.3	109.86	2.44	△0.06	△0.05	△0.04	96.0	—	—	2,432	
	149期(2019年7月10日)	5,786	10	0.5	266.33	0.7	108.52	2.08	△0.36	△0.26	△0.21	97.0	—	—	2,433	
	150期(2019年8月13日)	5,835	10	1.0	269.62	1.2	109.01	2.06	△0.02	△0.35	△0.10	94.9	—	—	2,434	
	151期(2019年9月10日)	5,695	10	△2.2	265.42	△1.6	105.43	1.71	△0.36	△0.61	△0.26	95.4	—	—	2,363	
第27作成期	152期(2019年10月10日)	5,811	10	2.2	270.19	1.8	107.45	1.73	0.03	△0.55	0.06	96.6	—	—	2,407	
	153期(2019年11月11日)	5,783	10	△0.3	270.74	0.2	107.37	1.67	△0.06	△0.47	0.08	96.0	—	—	2,383	
	154期(2019年12月10日)	5,817	10	0.8	272.94	0.8	109.16	1.94	0.27	△0.25	0.22	95.7	—	—	2,379	
	155期(2020年1月10日)	5,818	10	0.2	273.80	0.3	108.67	1.84	△0.10	△0.30	△0.05	96.0	—	—	2,376	
	156期(2020年2月10日)	5,877	10	1.2	277.09	1.2	109.57	1.82	△0.02	△0.20	0.10	95.9	—	—	2,384	
第28作成期	157期(2020年3月10日)	5,908	10	0.7	280.56	1.3	109.67	1.57	△0.25	△0.41	△0.21	95.6	—	—	2,373	
	158期(2020年4月10日)	5,683	10	△3.6	272.79	△2.8	103.28	0.81	△0.77	△0.79	△0.38	96.5	—	—	2,271	
	159期(2020年5月11日)	5,715	10	0.7	275.69	1.1	108.61	0.72	△0.08	△0.35	0.44	95.7	—	—	2,278	
	160期(2020年6月10日)	5,640	10	△1.1	272.34	△1.2	106.95	0.71	△0.01	△0.51	△0.17	96.4	—	—	2,242	
	161期(2020年7月10日)	5,966	10	6.0	282.07	3.6	107.79	0.73	0.02	△0.33	0.18	95.9	—	—	2,361	
162期(2020年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		

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注4) ブルームバーグ・パークレイズ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（為替ノーヘッジ・円ベース）、米国10年国債利回りおよびドイツ10年国債利回りの値は、基準価額への反映を考慮して前営業日の値を用いております（小数第3位四捨五入）。また、為替（対米ドル）は、当日の対顧客電信相場仲値を用いております（以下同じ）。

(注5) ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーの商標およびサービスマークです。パークレイズは、ライセンスに基づき使用されているパークレイズ・バンク・ピーエルシーの商標およびサービスマークです。ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・パークレイズ・インデックスに対する一切の独占的権利を有しています（以下同じ）。

(注6) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■過去6ヶ月間の基準価額と市況の推移

決算期	年月日	基準価額		ブルームバーグ・パークレイズ・グローバル総合(日本円除く)インデックス (海苔ノヘッジ・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
		円	騰落率	騰落率	騰落率		騰落幅	騰落幅						
第156期	(期首) 2020年1月10日	5,877	—	277.09	—	109.57	1.82	—	△0.20	—	95.9	—	—	—
	1月末	5,911	0.6	278.50	0.5	109.06	1.51	△0.31	△0.43	△0.24	96.5	—	—	—
	(期末) 2020年2月10日	5,918	0.7	280.56	1.3	109.67	1.57	△0.25	△0.41	△0.21	95.6	—	—	—
第157期	(期首) 2020年2月10日	5,908	—	280.56	—	109.67	1.57	—	△0.41	—	95.6	—	—	—
	2月末	5,910	0.0	283.38	1.0	109.43	1.15	△0.42	△0.61	△0.20	95.6	—	—	—
	(期末) 2020年3月10日	5,693	△3.6	272.79	△2.8	103.28	0.81	△0.77	△0.79	△0.38	96.5	—	—	—
第158期	(期首) 2020年3月10日	5,683	—	272.79	—	103.28	0.81	—	△0.79	—	96.5	—	—	—
	3月末	5,634	△0.9	273.73	0.3	108.83	0.67	△0.14	△0.47	0.32	95.2	—	—	—
	(期末) 2020年4月10日	5,725	0.7	275.69	1.1	108.61	0.72	△0.08	△0.35	0.44	95.7	—	—	—
第159期	(期首) 2020年4月10日	5,715	—	275.69	—	108.61	0.72	—	△0.35	—	95.7	—	—	—
	4月末	5,674	△0.7	273.05	△1.0	106.87	0.64	△0.08	△0.59	△0.24	96.2	—	—	—
	(期末) 2020年5月11日	5,650	△1.1	272.34	△1.2	106.95	0.71	△0.01	△0.51	△0.17	96.4	—	—	—
第160期	(期首) 2020年5月11日	5,640	—	272.34	—	106.95	0.71	—	△0.51	—	96.4	—	—	—
	5月末	5,823	3.2	278.14	2.1	107.53	0.65	△0.06	△0.45	0.07	96.5	—	—	—
	(期末) 2020年6月10日	5,976	6.0	282.07	3.6	107.79	0.73	0.02	△0.33	0.18	95.9	—	—	—
第161期	(期首) 2020年6月10日	5,966	—	282.07	—	107.79	0.73	—	△0.33	—	95.9	—	—	—
	6月末	5,940	△0.4	282.71	0.2	107.74	0.66	△0.07	△0.45	△0.12	94.0	—	—	—
	(期末) 2020年7月10日	5,982	0.3	283.78	0.6	107.13	0.65	△0.08	△0.47	△0.13	94.9	—	—	—

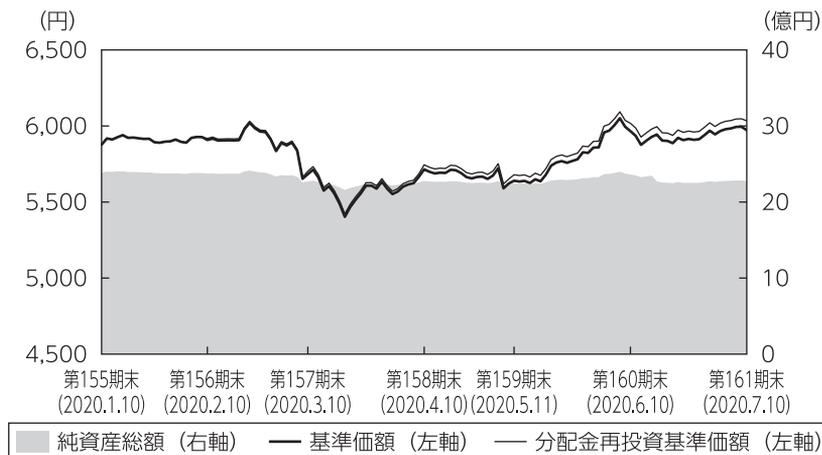
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率および騰落幅は期首比です。

(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156期～第161期の運用経過（2020年1月11日から2020年7月10日まで）

基準価額等の推移



第156期首： 5,877円
 第161期末： 5,972円
 （既払分配金60円）
 騰落率： 2.7%
 （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。

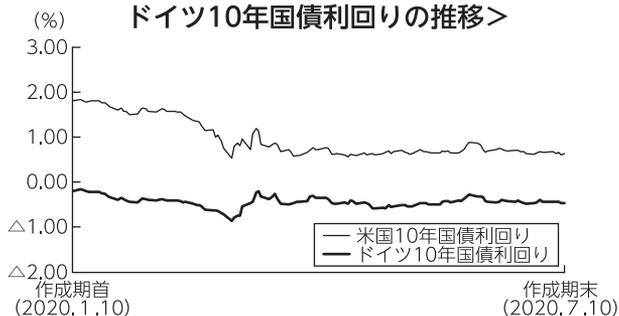
基準価額の主な変動要因

「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上昇（利回りは低下）したことなどから、基準価額は上昇しました。

投資環境

● 海外債券市況と為替市場

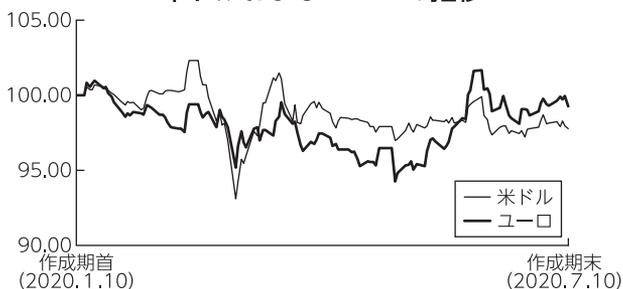
<米国10年国債利回りおよび
ドイツ10年国債利回りの推移>



米国国債市場は、3月上旬にかけ新型コロナウイルスの感染拡大懸念を受けリスク回避姿勢が高まったことなどから上昇（利回りは低下）しました。ドイツ国債市場は、感染拡大懸念が上昇要因となった一方で各国の財政出動などが下落要因となり、作成期を通じては上昇しました。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、欧州ともに全般的に拡大しました。

先進国の高利回り債市場および新興国の公社債市場は下落しました。

<米ドルおよびユーロの推移>



為替市場（対円）は、米ドル、ユーロともに下落しました。3月上旬にかけては新型コロナウイルスの感染拡大懸念を受け、円買い需要が高まったことなどから、米ドル、ユーロともに下落しました。作成期末にかけては、米国や欧州域内主要国の段階的な経済活動の再開を背景に、リスク選好姿勢が高まったことなどから上昇しましたが、作成期を通じては米ドル、ユーロともに下落しました。

(注) 作成期首の値を100として指数化しています。

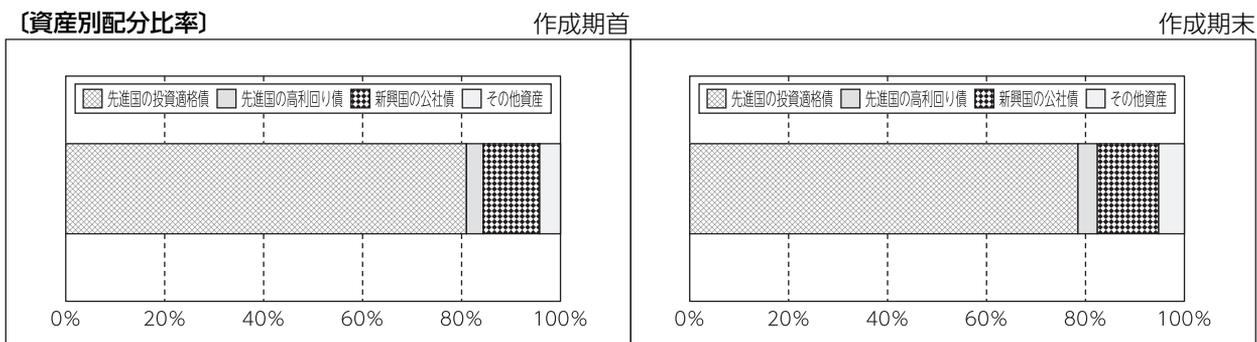
ポートフォリオについて

●当ファンド

「ルーミス・グローバル債券マザーファンド」受益証券の組入比率を高位に維持しました。なお、実質組入外貨建資産に対して為替ヘッジを行いませんでした。

●ルーミス・グローバル債券マザーファンド

資産配分比率は、先進国の投資適格債を基本配分比率（60%）より高めに維持しました。先進国の高利回り債および新興国の公社債については、基本配分比率（それぞれ20%）より低めとしました。投資通貨は、米ドル、ユーロを中心とし、英ポンド、カナダドルなどへの配分を維持しました。また、修正デュレーションは長期化しました。上記の通り運用を行った結果、保有する債券の価格が上昇したことから基準価額は上昇しました。



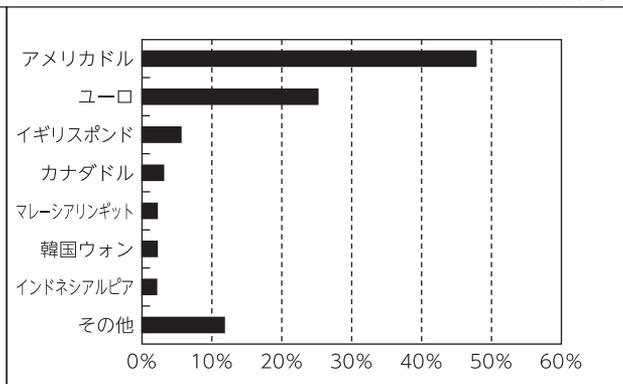
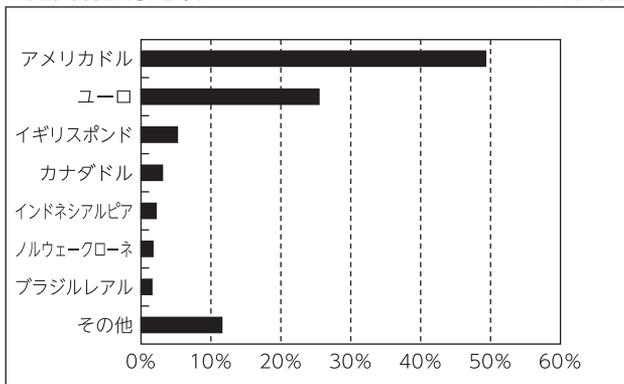
(注1) 上記比率は、ルーミス・グローバル債券マザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) その他資産には現金、経過利息等を含みます。

【通貨別配分比率】

作成期首

作成期末

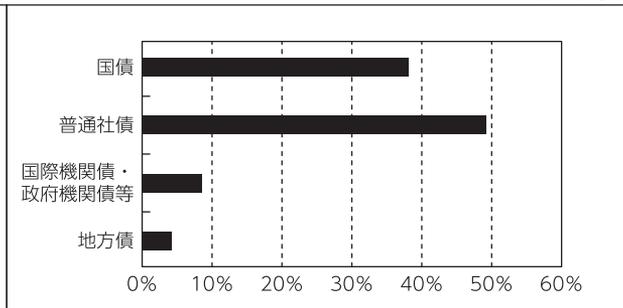
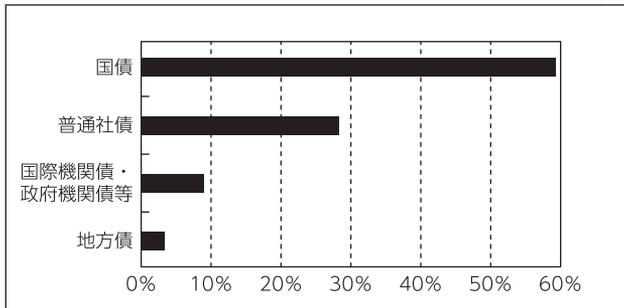


(注) 上記比率は、ルーミス・グローバル債券マザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。

【種別組入比率】

作成期首

作成期末

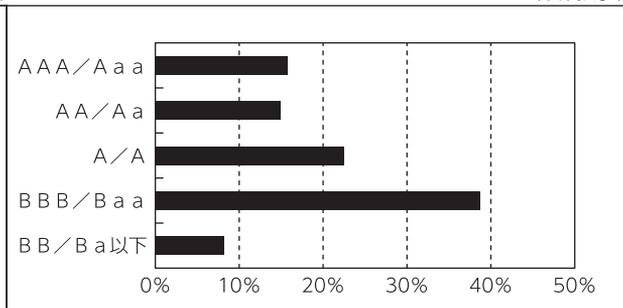
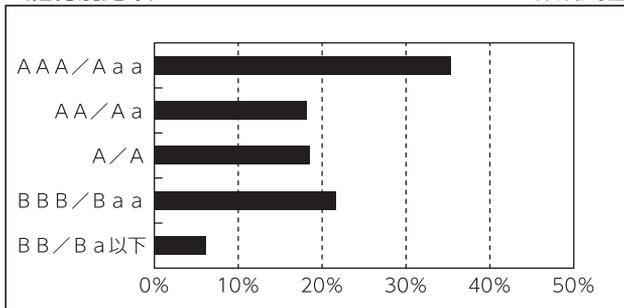


(注) 上記比率は、ルーミス・グローバル債券マザーファンドの債券部分に対する評価額の割合です。

【格付別比率】

作成期首

作成期末

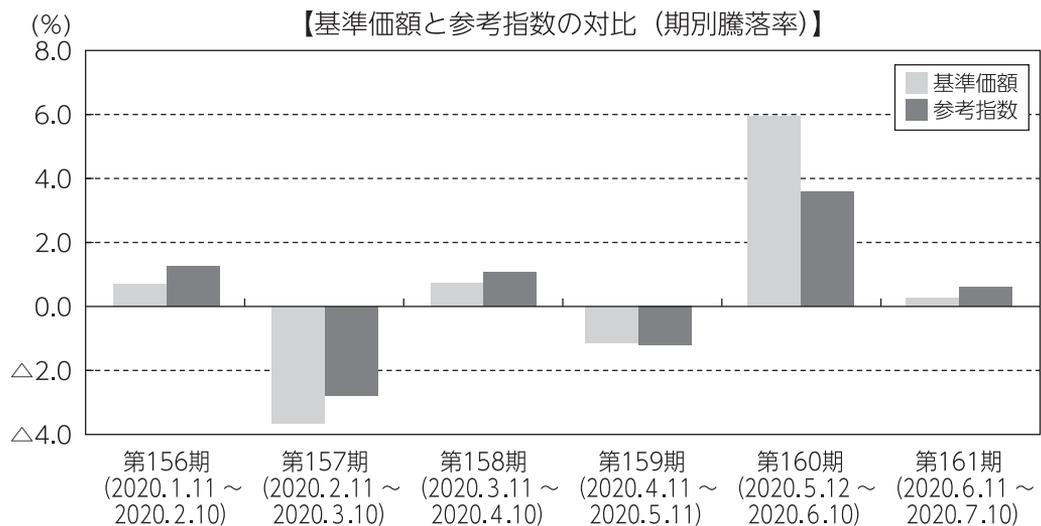


(注1) 上記比率は、ルーミス・グローバル債券マザーファンドの債券部分に対する評価額の割合です。

(注2) ファンドの格付は、S & P、Moody'sのうち高い方の格付を採用しています。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

当作成期の収益分配金は、利息収入相当分を中心とし、基準価額の水準、市況動向等を勘案して、下記のとおりといたしました。なお、収益分配に充てなかった収益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	第156期	第157期	第158期	第159期	第160期	第161期
	2020年1月11日 ～2020年2月10日	2020年2月11日 ～2020年3月10日	2020年3月11日 ～2020年4月10日	2020年4月11日 ～2020年5月11日	2020年5月12日 ～2020年6月10日	2020年6月11日 ～2020年7月10日
当期分配金（税引前）	10円	10円	10円	10円	10円	10円
対基準価額比率	0.17%	0.18%	0.17%	0.18%	0.17%	0.17%
当期の収益	10円	4円	10円	6円	10円	9円
当期の収益以外	-円	5円	-円	3円	-円	0円
翌期繰越分配対象額	224円	219円	220円	216円	220円	219円

(注1) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切捨てで算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

今後の運用方針

●当ファンド

「ルーミス・グローバル債券マザーファンド」の組入れを高位に維持します。

●ルーミス・グローバル債券マザーファンド

米国とドイツの国債利回りについては、新型コロナウイルスの感染拡大に伴う世界景気への影響や各国の財政動向などが意識される中、短期的にはそれらの動向に左右される展開を予想します。債券種別配分については、引き続き相対的に利回り水準が高い社債に投資妙味があると考えます。

このような中、当ファンドは、ファンダメンタルズ分析の下、流動性に留意しつつ、割安な銘柄への投資機会を探っていきます。

■ 1 万口当たりの費用明細

項目	第156期～第161期		項目の概要
	(2020年1月11日 ～2020年7月10日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	48円	0.822%	(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5,801円です。
(投信会社)	(27)	(0.466)	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)	(19)	(0.329)	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) 有価証券取引税	0	0.001	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数
(公社債)	(0)	(0.001)	有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用	2	0.041	(c) 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)	(0.039)	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	50	0.864	

(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、有価証券取引税およびその他費用は、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。

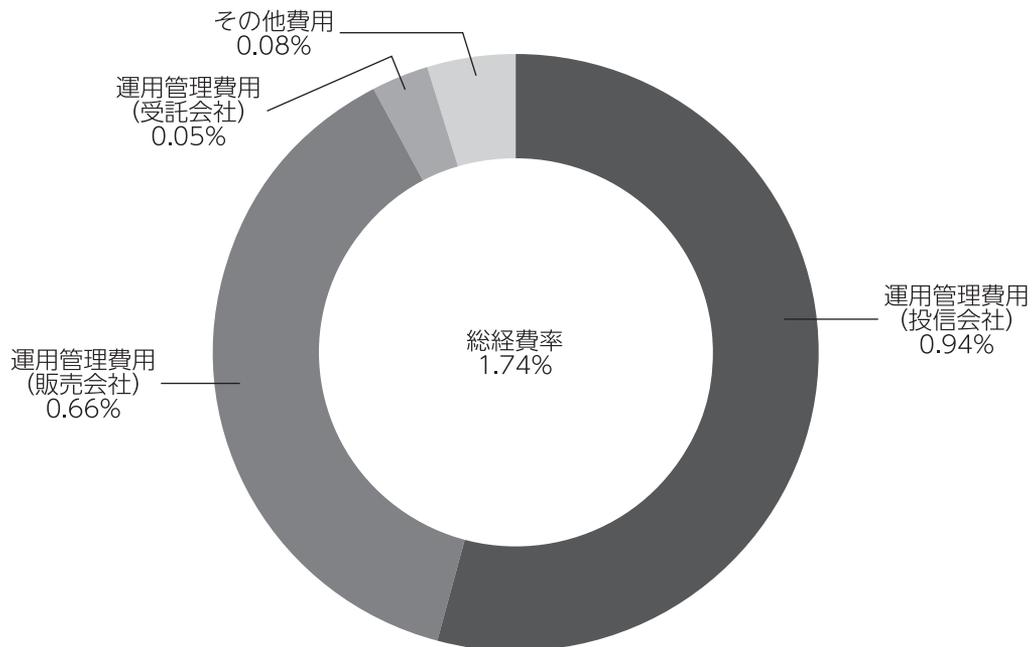
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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1.74%です。



(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2020年1月11日から2020年7月10日まで）

	第 156 期 ~ 第 161 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 125,576	千円 183,000

■利害関係人との取引状況等（2020年1月11日から2020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26作成期末		第27作成期末	
	□ 数	金 額	□ 数	評 価 額
ルーミス・グローバル債券マザーファンド	千口 1,616,522	千円 1,490,945	千口 1,490,945	千円 2,232,989

■投資信託財産の構成

2020年7月10日現在

項 目	第27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 2,232,989	97.8%
コーラル・ローン等、その他	49,119	2.2
投資信託財産総額	2,282,109	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、2,230,934千円、99.1%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、2020年7月10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=107.13円、1カナダ・ドル=78.78円、1オーストラリア・ドル=74.38円、1シンガポール・ドル=76.88円、1ニュージーランド・ドル=70.20円、1イギリス・ポンド=134.90円、1スイス・フラン=113.85円、1トルコ・リラ=15.61円、1デンマーク・クローネ=16.21円、1ノルウェー・クローネ=11.29円、1スウェーデン・クローナ=11.57円、1メキシコ・ペソ=4.72円、1アルゼンチン・ペソ=1.51円、100コロンビア・ペソ=2.96円、100インドネシア・ルピア=0.75円、1ブラジル・レアル=20.04円、100韓国・ウォン=8.92円、1ロシア・ルーブル=1.51円、1マレーシア・リンギット=25.08円、1南アフリカ・ランド=6.35円、1タイ・バーツ=3.42円、1ポーランド・ズロチ=26.99円、100ハンガリー・フォリント=34.17円、1ユーロ=120.76円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年2月10日)、 (2020年3月10日)、 (2020年4月10日)、 (2020年5月11日)、 (2020年6月10日)、 (2020年7月10日)現在

項 目	第156期末	第157期末	第158期末	第159期末	第160期末	第161期末
(A)資 産	2,380,706,465円	2,278,254,936円	2,290,096,508円	2,250,084,780円	2,372,378,926円	2,282,109,012円
コーラル・ローン等	59,359,624	39,716,654	55,655,573	38,164,641	24,074,106	49,119,272
ルーミス・グローバル債券マザーファンド(評価額)	2,321,346,841	2,238,538,282	2,234,440,935	2,211,920,139	2,348,304,820	2,232,989,740
(B)負 債	7,360,114	7,100,752	12,059,060	7,153,494	10,418,080	6,910,480
未払収益分配金	4,017,211	3,996,551	3,986,017	3,976,479	3,959,229	3,809,854
未払解約金	-	-	4,949,120	-	3,328,050	-
未払信託報酬	3,335,490	3,097,314	3,116,999	3,169,970	3,123,863	3,093,756
その他未払費用	7,413	6,887	6,924	7,045	6,938	6,870
(C)純資産総額(A-B)	2,373,346,351	2,271,154,184	2,278,037,448	2,242,931,286	2,361,960,846	2,275,198,532
元 本	4,017,211,920	3,996,551,559	3,986,017,805	3,976,479,028	3,959,229,835	3,809,854,168
次期繰越損益金	△1,643,865,569	△1,725,397,375	△1,707,980,357	△1,733,547,742	△1,597,268,989	△1,534,655,636
(D)受益権総口数	4,017,211,920口	3,996,551,559口	3,986,017,805口	3,976,479,028口	3,959,229,835口	3,809,854,168口
1万口当たり基準価額(C/D)	5,908円	5,683円	5,715円	5,640円	5,966円	5,972円

(注) 第155期末における元本額は4,056,612,538円、当作成期間(第156期～第161期)中における追加設定元本額は3,403,589円、同解約元本額は250,161,959円です。

■損益の状況

[自 2020年1月11日] [自 2020年2月11日] [自 2020年3月11日] [自 2020年4月11日] [自 2020年5月12日] [自 2020年6月11日]
 [至 2020年2月10日] [至 2020年3月10日] [至 2020年4月10日] [至 2020年5月11日] [至 2020年6月10日] [至 2020年7月10日]

項 目	第156期	第157期	第158期	第159期	第160期	第161期
(A)配 当 等 収 益	△1,309円	△1,013円	△1,607円	△1,849円	△1,622円	△2,015円
受 取 利 息	6	1	3	1	6	6
支 払 利 息	△1,315	△1,014	△1,610	△1,850	△1,628	△2,021
(B)有価証券売買損益	19,689,242	△82,884,301	19,980,881	△22,499,282	135,850,117	9,263,717
売 買 益	19,825,503	24,014	20,700,697	18,986	136,384,687	10,364,058
売 買 損	△136,261	△82,908,315	△719,816	△22,518,268	△534,570	△1,100,341
(C)信 託 報 酬 等	△3,342,903	△3,104,201	△3,123,923	△3,177,015	△3,130,801	△3,100,626
(D)当期損益金(A + B + C)	16,345,030	△85,989,515	16,855,351	△25,678,146	132,717,694	6,161,076
(E)前期繰越損益金	△1,388,330,309	△1,368,741,929	△1,454,677,875	△1,438,155,642	△1,461,233,400	△1,282,001,516
(F)追加信託差損益金	△267,863,079	△266,669,380	△266,171,816	△265,737,475	△264,794,054	△255,005,342
(配当等相当額)	(37,531,919)	(37,346,434)	(37,255,490)	(37,173,954)	(37,020,191)	(35,631,546)
(売買損益相当額)	(△305,394,998)	(△304,015,814)	(△303,427,306)	(△302,911,429)	(△301,814,245)	(△290,636,888)
(G)合 計(D + E + F)	△1,639,848,358	△1,721,400,824	△1,703,994,340	△1,729,571,263	△1,593,309,760	△1,530,845,782
(H)収 益 分 配 金	△4,017,211	△3,996,551	△3,986,017	△3,976,479	△3,959,229	△3,809,854
次期繰越損益金(G + H)	△1,643,865,569	△1,725,397,375	△1,707,980,357	△1,733,547,742	△1,597,268,989	△1,534,655,636
追加信託差損益金	△267,863,079	△266,669,380	△266,171,816	△265,737,475	△264,794,054	△255,005,342
(配当等相当額)	(37,532,406)	(37,346,852)	(37,255,991)	(37,174,469)	(37,020,668)	(35,632,126)
(売買損益相当額)	(△305,395,485)	(△304,016,232)	(△303,427,807)	(△302,911,944)	(△301,814,722)	(△290,637,468)
分配準備積立金	52,774,782	50,259,873	50,652,512	49,014,057	50,272,643	48,060,585
繰 越 損 益 金	△1,428,777,272	△1,508,987,868	△1,492,461,053	△1,516,824,324	△1,382,747,578	△1,327,710,879

(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156期から第161期まではルミス・グローバル債券マザーファンド5,627,076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156期	第157期	第158期	第159期	第160期	第161期
(a)経費控除後の配当等収益	4,410,745円	1,760,111円	4,518,200円	2,466,356円	5,437,435円	3,502,099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	37,532,406	37,346,852	37,255,991	37,174,469	37,020,668	35,632,126
(d)分 配 準 備 積 立 金	52,381,248	52,496,313	50,120,329	50,524,180	48,794,437	48,368,340
(e)当期分配対象額(a + b + c + d)	94,324,399	91,603,276	91,894,520	90,165,005	91,252,540	87,502,565
(f)1万円当たり当期分配対象額	234.80	229.21	230.54	226.75	230.48	229.67
(g)分 配 金	4,017,211	3,996,551	3,986,017	3,976,479	3,959,229	3,809,854
(h)1万円当たり分配金	10	10	10	10	10	10

■分配金のお知らせ

決算期	第156期	第157期	第158期	第159期	第160期	第161期
1万口当たり分配金	10円	10円	10円	10円	10円	10円

※分配金を再投資する場合、分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。

分配金の課税上の取扱いについて

- ・追加型株式投資信託の分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における受益者毎の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者毎の個別元本となります。

ルーミス・グローバル債券マザーファンド

運用報告書

第27期（決算日 2020年7月10日）

（計算期間 2020年1月11日～2020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27期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2007年1月31日から無期限です。
運用方針	主として日本を除く世界各国の公社債に投資し、安定した収益の確保と信託財産の中・長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 当マザーファンドの円の余資産運用以外の運用の指図に関する権限を、ルーミス・セイレス・アンド・カンパニー・エル・ピーに委託します。
主要投資対象	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ブルームバーグ・パークレイズ・グローバル総合（日本円除く）インデックス		為替 （対米ドル）	米国10年国債利回り		ドイツ10年国債利回り		債組比	券入率	債先比	券利率	純資産額
	期中騰落率	（為替ノーヘッジ・円ベース） （参考指数）	期中騰落率	（対米ドル）		期中騰落幅	期中騰落幅							
23期（2018年7月10日）	円	%	%	%	円	%	%	%	%	%	%	%	%	百万円
24期（2019年1月10日）	13,705	△3.1	261.73	△2.7	111.06	2.86	0.30	0.30	△0.17	97.1	-	-	-	2,591
25期（2019年7月10日）	13,355	△2.6	255.72	△2.3	108.19	2.71	△0.15	0.28	△0.02	97.6	-	-	-	2,379
26期（2020年1月10日）	14,083	5.5	269.62	5.4	109.01	2.06	△0.65	△0.35	△0.63	96.8	-	-	-	2,385
27期（2020年7月10日）	14,454	2.6	277.09	2.8	109.57	1.82	△0.24	△0.20	0.16	97.8	-	-	-	2,336
27期（2020年7月10日）	14,977	3.6	283.78	2.4	107.13	0.65	△1.18	△0.47	△0.27	96.7	-	-	-	2,232

（注1）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

（注2）ブルームバーグ・パークレイズ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（為替ノーヘッジ・円ベース）、米国10年国債利回りおよびドイツ10年国債利回りの値は、基準価額への反映を考慮して前営業日の値を用いております（小数第3位四捨五入）。また、為替（対米ドル）は、当日の対顧客電信相場仲値を用いております（以下同じ）。

（注3）ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーの商標およびサービスマークです。パークレイズは、ライセンスに基づき使用されているパークレイズ・バンク・ピーエルシーの商標およびサービスマークです。ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・パークレイズ・インデックスに対する一切の独占的権利を有しています（以下同じ）。

（注4）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

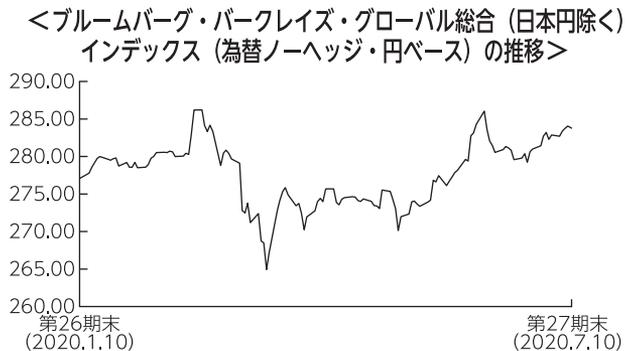
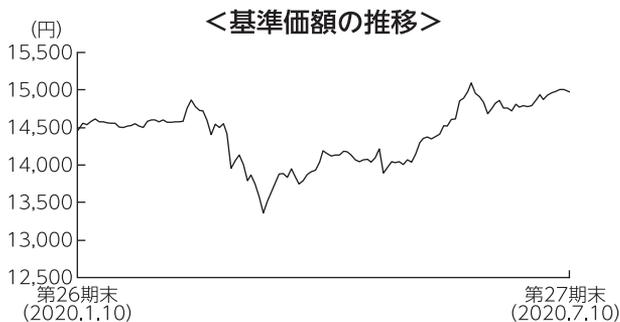
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基準価額		ブルームバーグ・バークレイズ・グローバル総合 (日本円除く)インデックス		為替 (対米ドル)	米国10年国債利回り		ドイツ10年国債利回り		債券 組入比率	債券 先物比率
	騰落率		(為替ノ・ヘッジ・円ベース) (参考指数)	騰落率		騰落幅	騰落幅				
(期首) 2020年1月10日	円	%		%	円	%	%	%	%	%	%
	14,454	-	277.09	-	109.57	1.82	-	△0.20	-	97.8	-
1月末	14,553	0.7	278.50	0.5	109.06	1.51	△0.31	△0.43	△0.24	97.6	-
2月末	14,596	1.0	283.38	2.3	109.43	1.15	△0.67	△0.61	△0.41	97.2	-
3月末	13,951	△3.5	273.73	△1.2	108.83	0.67	△1.15	△0.47	△0.27	97.5	-
4月末	14,097	△2.5	273.05	△1.5	106.87	0.64	△1.18	△0.59	△0.39	97.8	-
5月末	14,517	0.4	278.14	0.4	107.53	0.65	△1.17	△0.45	△0.25	97.7	-
6月末	14,862	2.8	282.71	2.0	107.74	0.66	△1.16	△0.45	△0.26	96.0	-
(期末) 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	-

(注1) 騰落率および騰落幅は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過 (2020年1月11日から2020年7月10日まで)



基準価額の推移

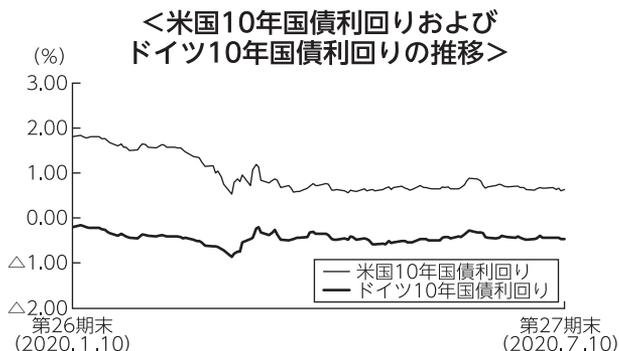
当ファンドの基準価額は、前期末比で3.6%上昇しました。

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上昇（利回りは低下）したことなどから、基準価額は上昇しました。

投資環境

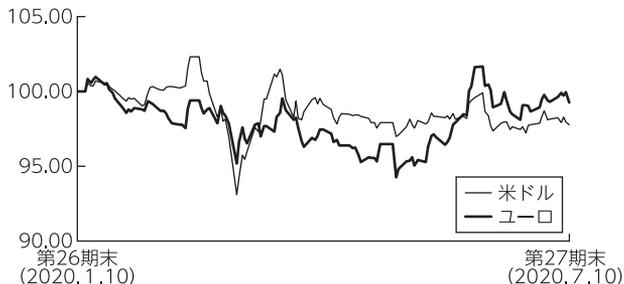
●海外債券市場と為替市場



米国国債市場は、3月上旬にかけ新型コロナウイルスの感染拡大懸念を受けリスク回避姿勢が高まったことなどから上昇（利回りは低下）しました。ドイツ国債市場は、感染拡大懸念が上昇要因となった一方で各国の財政出動などが下落要因となり、期を通じては上昇しました。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、欧州ともに全般的に拡大しました。

先進国の高利回り債市場および新興国の公社債市場は下落しました。

＜米ドルおよびユーロの推移＞



為替市場（対円）は、米ドル、ユーロともに下落しました。3月上旬にかけては新型コロナウイルスの感染拡大懸念を受け、円買い需要が高まったことなどから、米ドル、ユーロともに下落しました。期末にかけては、米国や欧州域内主要国の段階的な経済活動の再開を背景に、リスク選好姿勢が高まったことなどから上昇しましたが、期を通じては米ドル、ユーロともに下落しました。

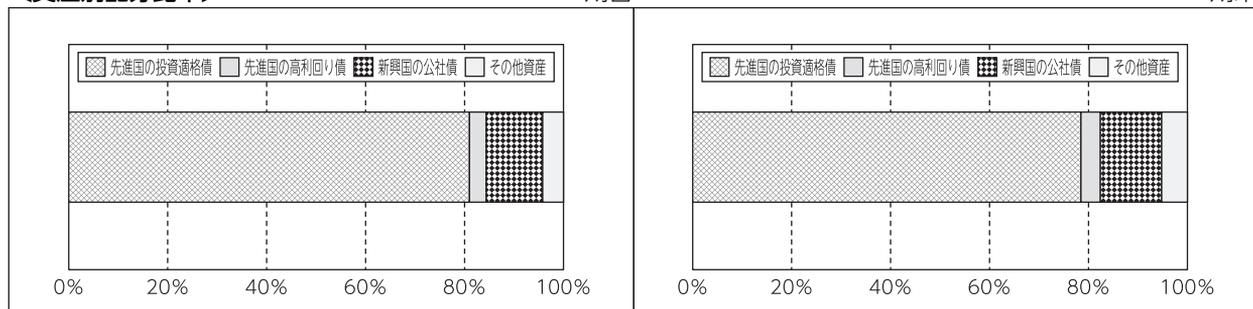
ポートフォリオについて

資産配分比率は、先進国の投資適格債を基本配分比率（60%）より高めに維持しました。先進国の高利回り債および新興国の公社債については、基本配分比率（それぞれ20%）より低めとしました。投資通貨は、米ドル、ユーロを中心とし、英ポンド、カナダドルなどへの配分を維持しました。また、修正デュレーションは長期化しました。上記の通り運用を行った結果、保有する債券の価格が上昇したことから基準価額は上昇しました。

〔資産別配分比率〕

期首

期末



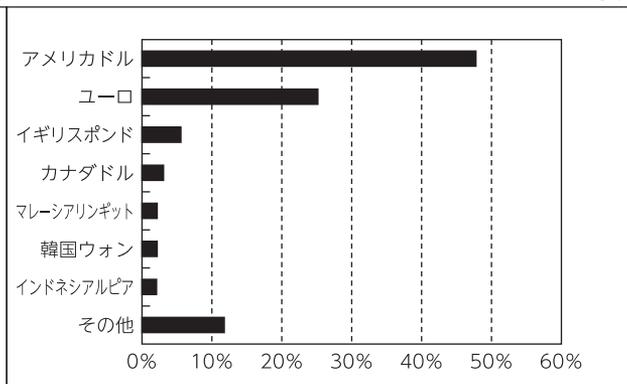
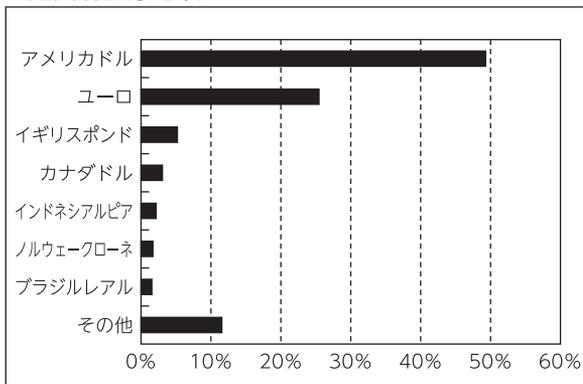
(注1) 上記比率は、ルミス・グローバル債券マザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) その他資産には現金、経過利息等を含みます。

〔通貨別配分比率〕

期首

期末

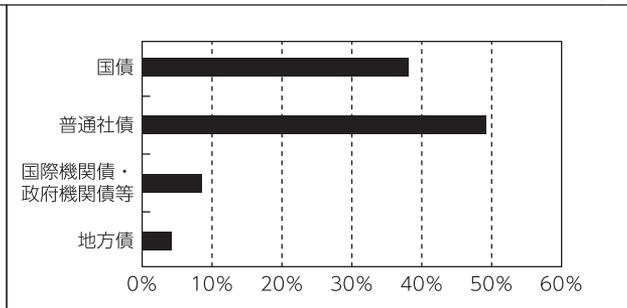
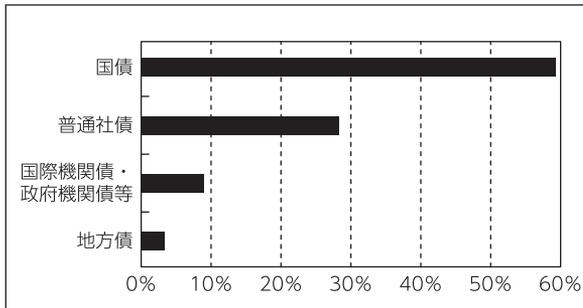


(注) 上記比率は、ルーミス・グローバル債券マザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。

〔種別組入比率〕

期首

期末

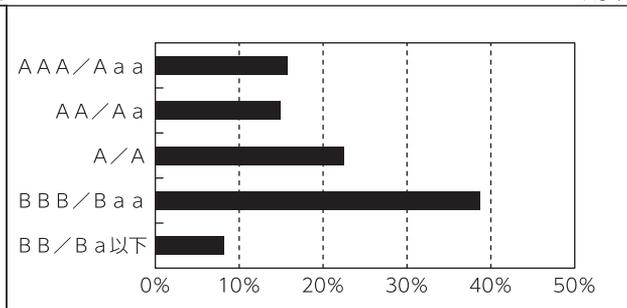
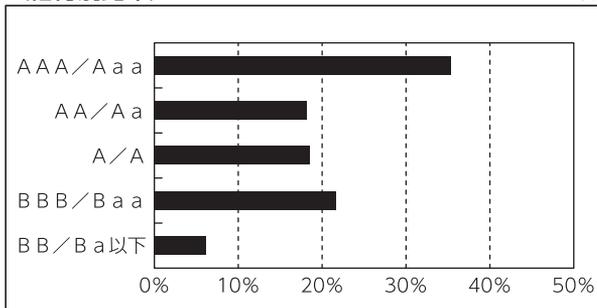


(注) 上記比率は、ルーミス・グローバル債券マザーファンドの債券部分に対する評価額の割合です。

〔格付別比率〕

期首

期末



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

(注2) ファンドの格付は、S & P、Moody'sのうち高い方の格付を採用しています。

今後の運用方針

米国とドイツの国債利回りについては、新型コロナウイルスの感染拡大に伴う世界景気への影響や各国の財政動向などが意識される中、短期的にはそれらの動向に左右される展開を予想します。債券種別配分については、引き続き相対的に利回り水準が高い社債に投資妙味があると考えます。

このような中、当ファンドは、ファンダメンタルズ分析の下、流動性に留意しつつ、割安な銘柄への投資機会を探っていきます。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) 有価証券取引税 (公社債)	0円 (0)	0.001% (0.001)	(a) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(b) その他費用 (保管費用) (その他)	6 (6) (0)	0.040 (0.039) (0.001)	(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	6	0.041	
期中の平均基準価額は14,397円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■ 売買及び取引の状況 (2020年1月11日から2020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 2,447	千アメリカ・ドル 6,457 (-)
		特殊債証券	229	- (400)
		社債証券	4,754	2,105 (215)
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 219	千カナダ・ドル 272 (-)
		地方債証券	千オーストラリア・ドル 162	千オーストラリア・ドル - (-)
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 367	千シンガポール・ドル 155 (-)
国	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 111	千イギリス・ポンド 49 (-)
		社債証券	-	- (102)

			買付額	売付額
外	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ -	千デンマーク・クローネ 280 (-)
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 1,563	千ノルウェー・クローネ 1,151 (-)
		特殊債券	-	1,570 (-)
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 4,267	千メキシコ・ペソ -
	ブラジル	国債証券	千ブラジル・リアル 278	千ブラジル・リアル 536 (-)
	韓国	国債証券	千韓国・ウォン 459,713	千韓国・ウォン 272,702 (-)
	ロシア	国債証券	千ロシア・ルーブル -	千ロシア・ルーブル -
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 655	千マレーシア・リンギット -
	タイ	国債証券	千タイ・バーツ 2,369	千タイ・バーツ -
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 324	千ポーランド・ズロチ 319 (-)
国	ユ ー ロ	ジャーჯィー	千ユーロ 社債券 87	千ユーロ -
		オランダ	国債証券 -	128 (-)
	ベルギー	社債券 95	- (-)	
	フ ラ ン ス	国債証券	-	864 (-)
		社債券	183	- (-)

				買付額	売付額
				千ユーロ	千ユーロ
外 国	ユ ー ロ	ド イ ツ	国債証券	508	891 (-)
			社債証券	265	92 (-)
	イ ン ク	ス ペ イ ン	国債証券	97	237 (-)
			特殊債証券	99	102 (-)
			社債証券	99	108 (-)
	ク オ ー ク	イ タ リ ア	国債証券	762	751 (-)
			社債証券	182	- (-)
			ア メ リ カ	社債証券	380

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

■利害関係人との取引状況等 (2020年1月11日から2020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 8,857	千アメリカ・ドル 9,583	千円 1,026,666	% 46.0	% 5.8	% 32.3	% 11.1	% 2.6
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 780	千カナダ・ドル 852	千円 67,131	3.0	—	1.7	0.7	0.7
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 530	千オーストラリア・ドル 602	千円 44,785	2.0	—	2.0	—	—
シンガポール	千シンガポール・ドル 190	千シンガポール・ドル 224	千円 17,265	0.8	—	0.8	—	—
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 45	千ニュージーランド・ドル 51	千円 3,606	0.2	—	—	0.2	—
イギリス	千イギリス・ポンド 635	千イギリス・ポンド 878	千円 118,546	5.3	—	3.6	1.6	0.1
スイス	千スイス・フラン 155	千スイス・フラン 159	千円 18,162	0.8	—	0.8	—	—
デンマーク	千デンマーク・クローネ 1,395	千デンマーク・クローネ 1,568	千円 25,421	1.1	—	1.1	—	—
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 2,005	千ノルウェー・クローネ 2,109	千円 23,816	1.1	—	—	1.1	—
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 940	千スウェーデン・クローナ 998	千円 11,551	0.5	—	—	0.5	—
メキシコ	千メキシコ・ペソ 5,592	千メキシコ・ペソ 6,501	千円 30,684	1.4	—	1.0	0.4	—
コロンビア	千コロンビア・ペソ 653,800	千コロンビア・ペソ 756,255	千円 22,385	1.0	—	1.0	—	—
インドネシア	千インドネシア・ルピア 5,900,000	千インドネシア・ルピア 6,278,201	千円 47,086	2.1	—	1.8	—	0.3
ブラジル	千ブラジル・レアル 963	千ブラジル・レアル 1,122	千円 22,489	1.0	1.0	0.6	0.5	—
韓国	千韓国・ウォン 538,000	千韓国・ウォン 543,414	千円 48,472	2.2	—	0.8	1.1	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 1,917	千円 48,089	2.2	—	1.8	0.4	—
タイ	千タイ・バーツ 2,295	千タイ・バーツ 2,356	千円 8,059	0.4	—	0.4	—	—
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 695	千ポーランド・ズロチ 758	千円 20,480	0.9	—	0.9	—	—

区 分	当 期 末							
	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	うち B B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
	千 ー ー	千 ー ー	千 円	%	%	%	%	%
ユ ー ロ								
ジャージー	100	99	12,004	0.5	—	0.5	—	—
イギリス	100	99	11,985	0.5	—	0.5	—	—
オランダ	240	248	29,973	1.3	—	1.3	—	—
ベルギー	200	209	25,303	1.1	—	0.6	0.6	—
フランス	410	514	62,119	2.8	—	2.8	—	—
ドイツ	615	644	77,886	3.5	0.6	3.1	0.4	—
スペイン	630	765	92,403	4.1	—	3.6	0.5	—
イタリア	945	941	113,731	5.1	—	5.1	—	—
フィンランド	100	101	12,310	0.6	0.6	—	0.6	—
ハンガリー	65	69	8,362	0.4	—	0.4	—	—
カナダ	365	378	45,689	2.0	—	—	2.0	—
アメリカ	375	391	47,232	2.1	—	1.1	1.1	—
ケイマン諸島	115	123	14,863	0.7	—	0.7	—	—
合 計	—	—	千円 2,158,569	96.7	7.9	70.2	22.6	3.9

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

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

(注3) 無格付銘柄については、B B 格以下に含めて表示しています。

(B) 個別銘柄開示

外国（外貨建）公社債銘柄別

銘 柄	当 期 末						
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
BRAZIL 4.625 01/13/28	国債証券	4.6250	200	211	22,704	2028/01/13	
REPUBLIC OF CHILE 2.45 01/31/31	国債証券	2.4500	200	208	22,315	2031/01/31	
US T N/B 0.125 05/31/22	国債証券	0.1250	235	234	25,158	2022/05/31	
US T N/B 0.625 05/15/30	国債証券	0.6250	150	150	16,104	2030/05/15	
US T N/B 0.25 05/31/25	国債証券	0.2500	205	204	21,951	2025/05/31	
US T N/B 2.5 12/31/20	国債証券	2.5000	295	298	31,955	2020/12/31	
PETROLEOS MEXICANOS 6.35 02/12/48	特殊債券	6.3500	15	11	1,238	2048/02/12	
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR 3.375 02/05/30	特殊債券	3.3750	210	215	23,073	2030/02/05	
SP POWERASSETS LTD 2.7 09/14/22	特殊債券	2.7000	200	207	22,238	2022/09/14	
PETROLEOS MEXICANOS 6.75 09/21/47	特殊債券	6.7500	30	23	2,533	2047/09/21	
WALT DISNEY COMPANY/THE 3.6 01/13/51	社債証券	3.6000	165	194	20,803	2051/01/13	
ENTERPRISE PRODUCTS OPER 3.95 01/31/60	社債証券	3.9500	35	37	4,052	2060/01/31	
JPMORGAN CHASE & CO 3.2 01/25/23	社債証券	3.2000	180	191	20,537	2023/01/25	
UNITED AIR 2016-1 B PTT 3.65 01/07/26	社債証券	3.6500	35	26	2,801	2026/01/07	

銘柄	当 期 末					
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
BNP PARIBAS 01/13/31	社 債 券	3.0520	200	213	22,881	2031/01/13
CITIGROUP INC 01/29/31	社 債 券	2.6660	235	247	26,540	2031/01/29
QUICKEN LOANS INC 5.25 01/15/28	社 債 券	5.2500	15	15	1,684	2028/01/15
ENTERPRISE PRODUCTS OPER 2.8 01/31/30	社 債 券	2.8000	5	5	569	2030/01/31
AMERICAN TOWER CORP 2.9 01/15/30	社 債 券	2.9000	85	92	9,941	2030/01/15
COCA-COLA FEMSA SAB CV 2.75 01/22/30	社 債 券	2.7500	150	161	17,285	2030/01/22
ITAU UNIBANCO HLDG SA/KY 2.9 01/24/23	社 債 券	2.9000	200	199	21,347	2023/01/24
BANCO BRADESCO (CAYMAN) 2.85 01/27/23	社 債 券	2.8500	200	199	21,357	2023/01/27
AIR LEASE CORP 2.25 01/15/23	社 債 券	2.2500	5	4	530	2023/01/15
TOLL BROS FINANCE CORP 4.35 02/15/28	社 債 券	4.3500	85	89	9,560	2028/02/15
ANHEUSER-BUSCH CO/INBEV 4.7 02/01/36	社 債 券	4.7000	130	156	16,801	2036/02/01
ALTRIA GROUP INC 4.8 02/14/29	社 債 券	4.8000	55	65	6,989	2029/02/14
T-MOBILE USA INC 4.75 02/01/28	社 債 券	4.7500	90	94	10,169	2028/02/01
EMBRAER NETHERLANDS FINA 5.4 02/01/27	社 債 券	5.4000	10	8	945	2027/02/01
BOEING CO 3.75 02/01/50	社 債 券	3.7500	15	13	1,468	2050/02/01
HCA INC 4.5 02/15/27	社 債 券	4.5000	5	5	602	2027/02/15
LADDER CAP FIN LLLP/CORP 4.25 02/01/27	社 債 券	4.2500	25	19	2,135	2027/02/01
AIR LEASE CORP 3.0 02/01/30	社 債 券	3.0000	10	9	1,010	2030/02/01
HCA INC 5.875 02/15/26	社 債 券	5.8750	20	22	2,396	2026/02/15
VALVOLINE INC 4.25 02/15/30	社 債 券	4.2500	15	15	1,613	2030/02/15
CENTENE CORP 3.375 02/15/30	社 債 券	3.3750	35	36	3,863	2030/02/15
BOEING CO 3.825 03/01/59	社 債 券	3.8250	10	8	952	2059/03/01
CVS HEALTH CORP 4.78 03/25/38	社 債 券	4.7800	35	44	4,784	2038/03/25
AT&T INC 4.5 03/09/48	社 債 券	4.5000	65	78	8,405	2048/03/09
CVS HEALTH CORP 4.3 03/25/28	社 債 券	4.3000	50	58	6,319	2028/03/25
CVS HEALTH CORP 4.1 03/25/25	社 債 券	4.1000	50	56	6,079	2025/03/25
COMCAST CORP 4.0 03/01/48	社 債 券	4.0000	15	19	2,058	2048/03/01
CHARTER COMM OPT LLC/CAP 4.8 03/01/50	社 債 券	4.8000	100	117	12,572	2050/03/01
ENERGY TRANSFER OPERATNG 5.15 03/15/45	社 債 券	5.1500	60	56	6,081	2045/03/15
CITIGROUP INC 03/31/31	社 債 券	4.4120	60	71	7,701	2031/03/31
CIGNA CORP 3.4 03/15/50	社 債 券	3.4000	125	140	15,043	2050/03/15
FREEMPORT-MCMORAN INC 4.25 03/01/30	社 債 券	4.2500	30	29	3,186	2030/03/01
FREEMPORT-MCMORAN INC 3.875 03/15/23	社 債 券	3.8750	10	10	1,086	2023/03/15
FREEMPORT-MCMORAN INC 4.125 03/01/28	社 債 券	4.1250	20	19	2,121	2028/03/01
ALLY FINANCIAL INC 4.625 03/30/25	社 債 券	4.6250	15	16	1,722	2025/03/30
AMERICAN TOWER CORP 2.4 03/15/25	社 債 券	2.4000	100	105	11,313	2025/03/15
CHARTER COMM OPT LLC/CAP 3.7 04/01/51	社 債 券	3.7000	65	66	7,170	2051/04/01
JPMORGAN CHASE & CO 04/22/51	社 債 券	3.1090	15	16	1,796	2051/04/22
JPMORGAN CHASE & CO 04/22/41	社 債 券	3.1090	10	11	1,195	2041/04/22
AMERICA MOVIL SAB DE CV 3.625 04/22/29	社 債 券	3.6250	200	223	23,995	2029/04/22
CHARTER COMM OPT LLC/CAP 2.8 04/01/31	社 債 券	2.8000	25	25	2,753	2031/04/01
BANK OF AMERICA CORP 04/29/31	社 債 券	2.5920	35	37	4,010	2031/04/29
T-MOBILE USA INC 4.375 04/15/40	社 債 券	4.3750	50	58	6,312	2040/04/15
AEP TRANSMISSION CO LLC 3.65 04/01/50	社 債 券	3.6500	15	18	1,959	2050/04/01
BROADCOM INC 4.25 04/15/26	社 債 券	4.2500	105	118	12,651	2026/04/15
DOMINION ENERGY INC 3.375 04/01/30	社 債 券	3.3750	35	39	4,268	2030/04/01
HCA INC 5.25 04/15/25	社 債 券	5.2500	45	51	5,560	2025/04/15

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	
T-MOBILE USA INC 3.875 04/15/30	社 債 券	3.8750	135	151	16,187	2030/04/15
BROADCOM INC 5.0 04/15/30	社 債 券	5.0000	70	81	8,745	2030/04/15
CHEVRON PHILLIPS CHEM CO 5.125 04/01/25	社 債 券	5.1250	55	63	6,836	2025/04/01
ANGLO AMERICAN CAPITAL 5.375 04/01/25	社 債 券	5.3750	200	227	24,394	2025/04/01
GENERAL ELECTRIC CO 4.25 05/01/40	社 債 券	4.2500	25	25	2,733	2040/05/01
KEURIG DR PEPPER INC 3.8 05/01/50	社 債 券	3.8000	70	83	8,963	2050/05/01
NEW YORK LIFE INSURANCE 3.75 05/15/50	社 債 券	3.7500	50	58	6,320	2050/05/15
GENERAL ELECTRIC CO 4.35 05/01/50	社 債 券	4.3500	80	82	8,807	2050/05/01
CONSTELLATION BRANDS INC 3.75 05/01/50	社 債 券	3.7500	15	17	1,873	2050/05/01
AIR PRODUCTS & CHEMICALS 2.8 05/15/50	社 債 券	2.8000	15	16	1,795	2050/05/15
UNITEDHEALTH GROUP INC 2.9 05/15/50	社 債 券	2.9000	40	44	4,749	2050/05/15
CCO HLDGS LLC/CAP CORP 4.5 05/01/32	社 債 券	4.5000	55	55	5,978	2032/05/01
NISOURCE INC 3.6 05/01/30	社 債 券	3.6000	20	23	2,482	2030/05/01
TENET HEALTHCARE CORP 5.125 05/01/25	社 債 券	5.1250	65	63	6,815	2025/05/01
IPALCO ENTERPRISES INC 4.25 05/01/30	社 債 券	4.2500	30	32	3,509	2030/05/01
SABINE PASS LIQUEFACTION 4.5 05/15/30	社 債 券	4.5000	35	39	4,241	2030/05/15
ALLY FINANCIAL INC 3.875 05/21/24	社 債 券	3.8750	5	5	556	2024/05/21
BOEING CO 3.1 05/01/26	社 債 券	3.1000	5	5	545	2026/05/01
ALLY FINANCIAL INC 5.8 05/01/25	社 債 券	5.8000	15	16	1,805	2025/05/01
HCA INC 4.125 06/15/29	社 債 券	4.1250	50	56	6,068	2029/06/15
BOEING CO 2.25 06/15/26	社 債 券	2.2500	5	4	522	2026/06/15
AT&T INC 4.8 06/15/44	社 債 券	4.8000	5	6	652	2044/06/15
AT&T INC 4.35 06/15/45	社 債 券	4.3500	50	57	6,207	2045/06/15
FORD FOUNDATION/THE 3.859 06/01/47	社 債 券	3.8590	65	83	8,965	2047/06/01
AT&T 3.65 06/01/51	社 債 券	3.6500	115	125	13,411	2051/06/01
GREAT-WEST LIFECO FINANC 4.15 06/03/47	社 債 券	4.1500	45	52	5,608	2047/06/03
HCA INC 5.5 06/15/47	社 債 券	5.5000	20	25	2,720	2047/06/15
VODAFONE GROUP PLC 4.875 06/19/49	社 債 券	4.8750	60	78	8,424	2049/06/19
ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR 4.5 06/01/50	社 債 券	4.5000	50	62	6,658	2050/06/01
QUEST DIAGNOSTICS INC 2.95 06/30/30	社 債 券	2.9500	50	53	5,729	2030/06/30
NOKIA OYJ 4.375 06/12/27	社 債 券	4.3750	45	48	5,147	2027/06/12
OWENS CORNING 3.875 06/01/30	社 債 券	3.8750	30	32	3,436	2030/06/01
GATX CORP 4.0 06/30/30	社 債 券	4.0000	20	21	2,354	2030/06/30
REGENCY CENTERS LP 3.7 06/15/30	社 債 券	3.7000	60	65	6,987	2030/06/15
HCA INC 5.25 06/15/26	社 債 券	5.2500	30	34	3,728	2026/06/15
NXP BV/NXP FDG/NXP USA 4.3 06/18/29	社 債 券	4.3000	85	97	10,490	2029/06/18
ROYAL BK SCOTLND GRP PLC 6.1 06/10/23	社 債 券	6.1000	10	11	1,187	2023/06/10
EMBRAER NETHERLANDS FINA 5.05 06/15/25	社 債 券	5.0500	85	75	8,114	2025/06/15
DELTA AIRLINES 2015B 4.25 07/30/23	社 債 券	4.2500	45	41	4,448	2023/07/30
CROWN CASTLE INTL CORP 4.15 07/01/50	社 債 券	4.1500	10	11	1,269	2050/07/01
ENTERPRISE PRODUCTS OPER 3.125 07/31/29	社 債 券	3.1250	5	5	584	2029/07/31
AES CORP/THE 3.95 07/15/30	社 債 券	3.9500	15	15	1,675	2030/07/15
DELL INT LLC / EMC CORP 6.2 07/15/30	社 債 券	6.2000	85	100	10,810	2030/07/15
BOEING CO 3.95 08/01/59	社 債 券	3.9500	20	18	1,942	2059/08/01
CONSTELLATION BRANDS INC 3.15 08/01/29	社 債 券	3.1500	100	109	11,751	2029/08/01

銘柄	当 期 末					
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
CVS HEALTH CORP 3.25 08/15/29	社 債 券	3.2500	170	189	20,341	2029/08/15
BANK OF AMERICA CORP 4.2 08/26/24	社 債 券	4.2000	245	272	29,201	2024/08/26
MCDONALD'S CORP 3.625 09/01/49	社 債 券	3.6250	100	114	12,273	2049/09/01
SIMON PROPERTY 3.25 09/13/49	社 債 券	3.2500	80	77	8,339	2049/09/13
ENEL FINANCE INTL NV 6.8 09/15/37	社 債 券	6.8000	155	217	23,338	2037/09/15
BANCO SANTANDER CHILE 3.875 09/20/22	社 債 券	3.8750	200	210	22,572	2022/09/20
HCA INC 3.5 09/01/30	社 債 券	3.5000	10	9	1,061	2030/09/01
SIMON PROPERTY 2.45 09/13/29	社 債 券	2.4500	35	34	3,744	2029/09/13
FREEMPORT-MCMORAN INC 5.0 09/01/27	社 債 券	5.0000	5	5	542	2027/09/01
HCA INC 5.375 09/01/26	社 債 券	5.3750	15	16	1,767	2026/09/01
COMCAST CORP 4.7 10/15/48	社 債 券	4.7000	45	63	6,794	2048/10/15
AIR LEASE CORP 4.625 10/01/28	社 債 券	4.6250	5	5	560	2028/10/01
UNITED AIR 2016-2 B PTT 3.65 10/07/25	社 債 券	3.6500	66	48	5,206	2025/10/07
CIGNA CORP 3.875 10/15/47	社 債 券	3.8750	5	5	632	2047/10/15
ENTERPRISE PRODUCTS OPER 4.15 10/16/28	社 債 券	4.1500	5	5	613	2028/10/16
AIR LEASE CORP 3.25 10/01/29	社 債 券	3.2500	5	4	510	2029/10/01
DELL INT LLC / EMC CORP 5.3 10/01/29	社 債 券	5.3000	15	16	1,779	2029/10/01
SANTANDER HOLDINGS USA 3.244 10/05/26	社 債 券	3.2440	20	20	2,246	2026/10/05
GENERAL MOTORS CO 6.125 10/01/25	社 債 券	6.1250	105	118	12,720	2025/10/01
BROADCOM INC 4.3 11/15/32	社 債 券	4.3000	30	33	3,580	2032/11/15
BOEING CO 3.85 11/01/48	社 債 券	3.8500	5	4	494	2048/11/01
CIGNA CORP 4.125 11/15/25	社 債 券	4.1250	10	11	1,236	2025/11/15
DIAMONDBACK ENERGY INC 3.5 12/01/29	社 債 券	3.5000	145	144	15,467	2029/12/01
ROYAL BK SCOTLAND GRP PLC 6.0 12/19/23	社 債 券	6.0000	70	78	8,409	2023/12/19
CENTENE CORP 4.625 12/15/29	社 債 券	4.6250	75	81	8,715	2029/12/15
小 計	—	—	8,857	9,583	1,026,666	—
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 2.0 06/01/28	国 債 証 券	2.0000	225	252	19,897	2028/06/01
CANADA 2.25 06/01/29	国 債 証 券	2.2500	195	225	17,767	2029/06/01
IBRD 2.2 01/18/22	特 殊 債 券	2.2000	180	184	14,571	2022/01/18
PSP CAPITAL INC 2.09 11/22/23	特 殊 債 券	2.0900	180	189	14,894	2023/11/22
小 計	—	—	780	852	67,131	—
(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 4.0 05/20/26	地 方 債 証 券	4.0000	140	165	12,323	2026/05/20
QUEENSLAND 2.75 08/20/27	地 方 債 証 券	2.7500	390	436	32,462	2027/08/20
小 計	—	—	530	602	44,785	—
(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	190	224	17,265	2027/03/01
小 計	—	—	190	224	17,265	—
(ニュージーランド)		%	千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル	千円	
NEW ZEALAND 5.5 04/15/23	国 債 証 券	5.5000	45	51	3,606	2023/04/15
小 計	—	—	45	51	3,606	—

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	
(イギリス)		%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	国債証券	3.2500	300	471	63,550	2044/01/22
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国債証券	5.0000	210	259	35,024	2025/03/07
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国債証券	1.5000	105	127	17,209	2047/07/22
AXA SA 7.125 12/15/20	社債証券	7.1250	20	20	2,762	2020/12/15
小 計	—	—	635	878	118,546	—
(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	159	18,162	2025/11/24
小 計	—	—	155	159	18,162	—
(デンマーク)		%	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	千円	
DENMARK 1.75 11/15/25	国債証券	1.7500	1,395	1,568	25,421	2025/11/15
小 計	—	—	1,395	1,568	25,421	—
(ノルウェー)		%	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円	
NORWAY 2.0 05/24/23	国債証券	2.0000	2,005	2,109	23,816	2023/05/24
小 計	—	—	2,005	2,109	23,816	—
(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	940	998	11,551	2023/11/13
小 計	—	—	940	998	11,551	—
(メキシコ)		%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円	
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	3,901	4,642	21,913	2029/05/31
MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	国債証券	8.0000	1,690	1,858	8,771	2023/12/07
小 計	—	—	5,592	6,501	30,684	—
(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	653,800	756,255	22,385	2026/08/26
小 計	—	—	653,800	756,255	22,385	—
(インドネシア)		%	千インドネシア・ルピア	千インドネシア・ルピア	千円	
INDONESIA GOV'T 8.25 05/15/29	国債証券	8.2500	5,100,000	5,466,690	41,000	2029/05/15
IBRD 8.4 10/12/21	特殊債券	8.4000	800,000	811,511	6,086	2021/10/12
小 計	—	—	5,900,000	6,278,201	47,086	—
(ブラジル)		%	千ブラジル・レアル	千ブラジル・レアル	千円	
BRAZIL NTN 01/01/27	国債証券	10.0000	280	334	6,712	2027/01/01
BRAZIL NTN 01/01/29	国債証券	10.0000	233	283	5,689	2029/01/01
BRAZIL 8.5 01/05/24	国債証券	8.5000	450	503	10,087	2024/01/05
小 計	—	—	963	1,122	22,489	—
(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	274,583	24,492	2025/03/10
KOREA TREASURY BOND 2.0 12/10/21	国債証券	2.0000	76,000	77,444	6,908	2021/12/10
KOREA TREASURY BOND 1.375 12/10/29	国債証券	1.3750	192,000	191,386	17,071	2029/12/10
小 計	—	—	538,000	543,414	48,472	—
(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	683	17,144	2027/03/15
MALAYSIA 3.906 07/15/26	国債証券	3.9060	825	891	22,351	2026/07/15
MALAYSIA 3.795 09/30/22	国債証券	3.7950	330	342	8,592	2022/09/30
小 計	—	—	1,785	1,917	48,089	—

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	
(タイ) THAILAND 1.6 12/17/29	国債証券	% 1.6000	千タイ・パーツ 2,295	千タイ・パーツ 2,356	千円 8,059	2029/12/17
小 計	-	-	2,295	2,356	8,059	-
(ポーランド) POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	% 2.5000	千ポーランド・ズロチ 695	千ポーランド・ズロチ 758	千円 20,480	2026/07/25
小 計	-	-	695	758	20,480	-
(ユーロ・・・ジャージー) HEATHROW FUNDING LTD 1.875 03/14/34	社債証券	% 1.8750	千ユーロ 100	千ユーロ 99	千円 12,004	2034/03/14
小 計	-	-	100	99	12,004	-
(ユーロ・・・イギリス) CHANNEL LINK 06/30/50	特殊債券	% 1.7610	千ユーロ 100	千ユーロ 99	千円 11,985	2050/06/30
小 計	-	-	100	99	11,985	-
(ユーロ・・・オランダ) SYNGENTA FINANCE NV 3.375 04/16/26 COOPERATIEVE RABOBANK UA 0.0 06/21/27	特殊債券 特殊債券	% 3.3750 0.0000	千ユーロ 140 100	千ユーロ 146 101	千円 17,671 12,302	2026/04/16 2027/06/21
小 計	-	-	240	248	29,973	-
(ユーロ・・・ベルギー) ING BELGIUM SA 0.625 05/30/25 ANHEUSER-BUSCH INBEV 2.0 01/23/35	特殊債券 社債証券	% 0.6250 2.0000	千ユーロ 100 100	千ユーロ 104 104	千円 12,628 12,674	2025/05/30 2035/01/23
小 計	-	-	200	209	25,303	-
(ユーロ・・・フランス) FRANCE OAT 4.5 04/25/41 FRANCE OAT 0.5 05/25/26 UNIBAIL-RODAMCO-WESTFLD 0.875 03/29/32 UNIBAIL-RODAMCO-WESTFLD 2.625 04/09/30	国債証券 国債証券 社債証券 社債証券	% 4.5000 0.5000 0.8750 2.6250	千ユーロ 120 90 100 100	千ユーロ 222 95 89 107	千円 26,847 11,496 10,763 13,011	2041/04/25 2026/05/25 2032/03/29 2030/04/09
小 計	-	-	410	514	62,119	-
(ユーロ・・・ドイツ) DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30 COMMERZBANK AG 0.625 05/28/25 KFW 0.25 09/15/25 VOLKSWAGEN FIN SERV AG 3.375 04/06/28 DEUTSCHE BANK AG 05/19/31 FRESENIUS MEDICAL CARE A 1.5 05/29/30 FRESENIUS SE & CO KGAA 1.625 10/08/27 DEUTSCHE TELEKOM AG 1.75 12/09/49	国債証券 特殊債券 特殊債券 社債証券 社債証券 社債証券 社債証券 社債証券	% 0.0000 0.6250 0.2500 3.3750 5.6250 1.5000 1.6250 1.7500	千ユーロ 85 70 195 20 100 60 80 5	千ユーロ 89 73 202 22 105 62 84 5	千円 10,778 8,844 24,487 2,736 12,780 7,500 10,153 604	2030/02/15 2025/05/28 2025/09/15 2028/04/06 2031/05/19 2030/05/29 2027/10/08 2049/12/09
小 計	-	-	615	644	77,886	-
(ユーロ・・・スペイン) SPAIN 4.2 01/31/37 SPAIN 1.95 07/30/30 SPAIN 2.7 10/31/48 BANCO SANTANDER SA 0.1 02/27/32 SANTAN CONSUMER FINANCE 0.375 01/17/25 CAIXABANK 04/17/30	国債証券 国債証券 国債証券 特殊債券 社債証券 社債証券	% 4.2000 1.9500 2.7000 0.1000 0.3750 2.2500	千ユーロ 180 85 65 100 100 100	千ユーロ 277 98 89 101 98 99	千円 33,456 11,891 10,783 12,279 11,939 12,052	2037/01/31 2030/07/30 2048/10/31 2032/02/27 2025/01/17 2030/04/17
小 計	-	-	630	765	92,403	-

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…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	740	752	90,854	2030/04/01
UNICREDIT SPA 09/23/29	社債証券	2.0000	205	189	22,876	2029/09/23
小 計	—	—	945	941	113,731	—
(ユーロ…フィンランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NOKIA OYJ 2.0 03/15/24	社債証券	2.0000	100	101	12,310	2024/03/15
小 計	—	—	100	101	12,310	—
(ユーロ…ハンガリー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
HUNGARY 1.75 10/10/27	国債証券	1.7500	65	69	8,362	2027/10/10
小 計	—	—	65	69	8,362	—
(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	172	20,790	2025/01/15
PROVINCE OF ALBERTA 0.625 04/18/25	地方債証券	0.6250	100	102	12,416	2025/04/18
ONTARIO PROVINCE 0.625 04/17/25	地方債証券	0.6250	100	103	12,482	2025/04/17
小 計	—	—	365	378	45,689	—
(ユーロ…アメリカ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.375 03/27/25	社債証券	3.3750	175	196	23,673	2025/03/27
PROLOGIS EURO FINANCE 1.5 09/10/49	社債証券	1.5000	100	96	11,626	2049/09/10
BOSTON SCIENTIFIC CORP 0.625 12/01/27	社債証券	0.6250	100	98	11,932	2027/12/01
小 計	—	—	375	391	47,232	—
(ユーロ…ケイマン諸島)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
XLIT LTD 06/29/47	社債証券	3.2500	115	123	14,863	2047/06/29
小 計	—	—	115	123	14,863	—
合 計	—	—	—	—	2,158,569	—

■投資信託財産の構成

2020年7月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 2,158,569	% 95.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	93,079	4.1
投 資 信 託 財 産 総 額	2,251,649	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、2,230,934千円、99.1％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、2020年7月10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=107.13円、1カナダ・ドル=78.78円、1オーストラリア・ドル=74.38円、1シンガポール・ドル=76.88円、1ニュージーランド・ドル=70.20円、1イギリス・ポンド=134.90円、1スイス・フラン=113.85円、1トルコ・リラ=15.61円、1デンマーク・クローネ=16.21円、1ノルウェー・クローネ=11.29円、1スウェーデン・クローナ=11.57円、1メキシコ・ペソ=4.72円、1アルゼンチン・ペソ=1.51円、100コロンビア・ペソ=2.96円、100インドネシア・ルピア=0.75円、1ブラジル・リアル=20.04円、100韓国・ウォン=8.92円、1ロシア・ルーブル=1.51円、1マレーシア・リンギット=25.08円、1南アフリカ・ランド=6.35円、1タイ・バーツ=3.42円、1ポーランド・ズロチ=26.99円、100ハンガリー・フォリント=34.17円、1ユーロ=120.76円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年7月10日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,251,649,157円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	55,489,081
公 社 債(評価額)	2,158,569,949
未 収 入 金	17,725,300
未 収 利 息	17,311,135
前 払 費 用	2,553,692
(B) 負 債	18,689,963
未 払 金	18,689,963
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	2,232,959,194
元 本	1,490,945,944
次 期 繰 越 損 益 金	742,013,250
(D) 受 益 権 総 口 数	1,490,945,944口
1万口当たり基準価額(C / D)	14,977円

(注1) 期首元本額 1,616,522,304円
追加設定元本額 -円
一部解約元本額 125,576,360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) 1,490,945,944円
期末元本合計 1,490,945,944円

■損益の状況

当期 自2020年1月11日 至2020年7月10日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	31,973,199円
受 取 利 息	31,911,133
そ の 他 収 益 金	62,951
支 払 利 息	△885
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	48,334,070
売 買 益	149,793,361
売 買 損	△101,459,291
(C) そ の 他 費 用	△899,553
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	79,407,716
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	720,029,174
(F) 解 約 差 損 益 金	△57,423,640
(G) 合 計(D + E + F)	742,013,250
次 期 繰 越 損 益 金(G)	742,013,250

(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。