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	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。 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。 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。 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。	
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	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。 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。	

<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。

第204期　<決算日　2024年 2 月13日>
第205期　<決算日　2024年 3 月11日>
第206期　<決算日　2024年 4 月10日>
第207期　<決算日　2024年 5 月10日>
第208期　<決算日　2024年 6 月10日>
第209期　<決算日　2024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、2024年７月10日に第209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。

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
https://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	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	純資産総額
		(分配落)	税込み分配金	期中騰落率		期中騰落率	(対米ドル)		期中騰落幅		期中騰落幅			
		円	円	%		%	円	%	%	%	%	%	%	百万円
第31作成期	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
	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
第32作成期	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
	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
第33作成期	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
	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
第34作成期	198期(2023年８月10日)	6,508	5	1.8	332.17	2.1	143.96	4.01	△0.05	2.50	△0.14	95.3	－	2,053
	199期(2023年９月11日)	6,517	5	0.2	335.38	1.0	146.97	4.26	0.25	2.61	0.11	95.5	－	2,053
	200期(2023年10月10日)	6,430	5	△1.3	329.00	△1.9	148.60	4.80	0.54	2.77	0.16	95.7	－	2,024
	201期(2023年11月10日)	6,627	5	3.1	340.86	3.6	151.43	4.62	△0.18	2.65	△0.12	96.3	－	2,084
	202期(2023年12月11日)	6,592	5	△0.5	337.67	△0.9	145.40	4.23	△0.39	2.28	△0.37	96.6	－	2,065
	203期(2024年１月10日)	6,685	5	1.5	344.03	1.9	144.69	4.01	△0.22	2.19	△0.09	97.3	－	2,093
第35作成期	204期(2024年２月13日)	6,812	5	2.0	352.87	2.6	149.39	4.18	0.17	2.36	0.17	97.4	－	2,125
	205期(2024年３月11日)	6,787	5	△0.3	353.10	0.1	146.82	4.07	△0.11	2.27	△0.09	95.2	－	2,110
	206期(2024年４月10日)	6,920	5	2.0	360.07	2.0	151.82	4.36	0.29	2.37	0.10	95.7	－	2,144
	207期(2024年５月10日)	7,028	5	1.6	367.48	2.1	155.70	4.45	0.09	2.50	0.13	96.2	－	2,165
	208期(2024年６月10日)	7,087	5	0.9	371.98	1.2	157.01	4.43	△0.02	2.62	0.12	97.0	－	2,171
	209期(2024年７月10日)	7,338	5	3.6	386.17	3.8	161.55	4.30	△0.13	2.58	△0.04	91.7	－	1,513

（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㈱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）。

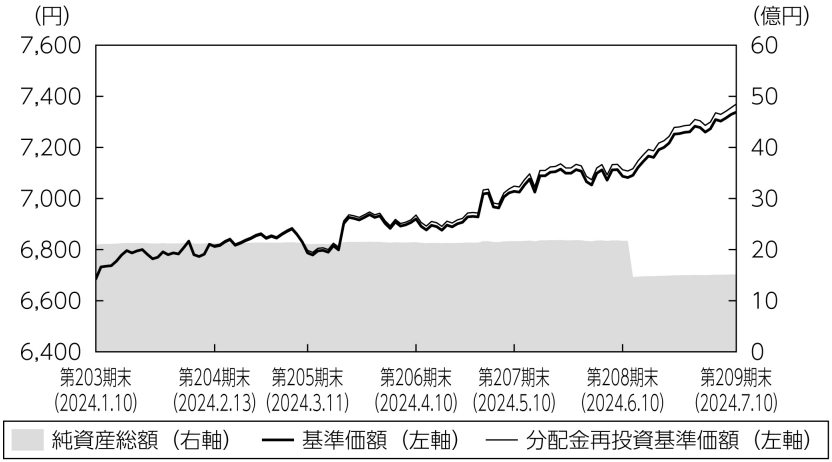
■過去６ヶ月間の基準価額と市況の推移

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(為替ノーヘッジ・円ベース)(参考指数)		為替	米国10年国債利回り		ドイツ10年国債利回り		債券組入比率	債券先物比率
			騰落率		騰落率	(対米ドル)		騰落幅		騰落幅		
	(期　首)	円	%		%	円	%	%	%	%	%	%
第204期	2024年１月10日	6,685	－	344.03	－	144.69	4.01	－	2.19	－	97.3	－
	１月末	6,787	1.5	351.63	2.2	147.55	4.03	0.02	2.27	0.08	97.2	－
	(期　末)											
	2024年２月13日	6,817	2.0	352.87	2.6	149.39	4.18	0.17	2.36	0.17	97.4	－
	(期　首)											
第205期	2024年２月13日	6,812	－	352.87	－	149.39	4.18	－	2.36	－	97.4	－
	２月末	6,852	0.6	355.97	0.9	150.67	4.26	0.08	2.46	0.10	95.0	－
	(期　末)											
	2024年３月11日	6,792	△0.3	353.10	0.1	146.82	4.07	△0.11	2.27	△0.09	95.2	－
	(期　首)											
第206期	2024年３月11日	6,787	－	353.10	－	146.82	4.07	－	2.27	－	95.2	－
	３月末	6,926	2.0	360.55	2.1	151.41	4.20	0.13	2.30	0.03	95.3	－
	(期　末)											
	2024年４月10日	6,925	2.0	360.07	2.0	151.82	4.36	0.29	2.37	0.10	95.7	－
	(期　首)											
第207期	2024年４月10日	6,920	－	360.07	－	151.82	4.36	－	2.37	－	95.7	－
	４月末	7,018	1.4	366.37	1.7	156.90	4.61	0.25	2.53	0.16	96.1	－
	(期　末)											
	2024年５月10日	7,033	1.6	367.48	2.1	155.70	4.45	0.09	2.50	0.13	96.2	－
	(期　首)											
第208期	2024年５月10日	7,028	－	367.48	－	155.70	4.45	－	2.50	－	96.2	－
	５月末	7,053	0.4	369.51	0.6	156.74	4.55	0.10	2.65	0.15	97.1	－
	(期　末)											
	2024年６月10日	7,092	0.9	371.98	1.2	157.01	4.43	△0.02	2.62	0.12	97.0	－
	(期　首)											
第209期	2024年６月10日	7,087	－	371.98	－	157.01	4.43	－	2.62	－	97.0	－
	６月末	7,283	2.8	382.33	2.8	161.07	4.29	△0.14	2.45	△0.17	91.8	－
	(期　末)											
	2024年７月10日	7,343	3.6	386.17	3.8	161.55	4.30	△0.13	2.58	△0.04	91.7	－

(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204期～第209期の運用経過（2024年１月11日から2024年７月10日まで）

基準価額等の推移



第204期首：　6,685円
第209期末：　7,338円
（既払分配金30円）
騰　落　率：　10.2%
（分配金再投資ベース）

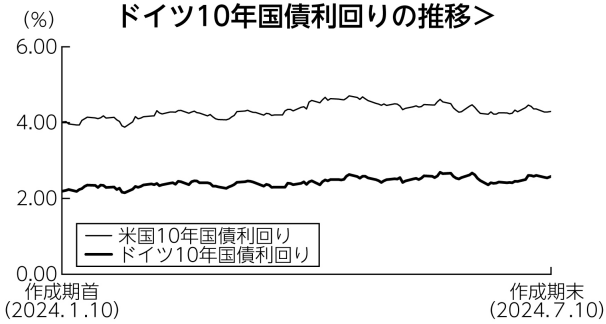
（注１）分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
（注２）分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
（注３）分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
（注４）当ファンドはベンチマークを定めておりません。

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、米ドル、ユーロなどの通貨は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>

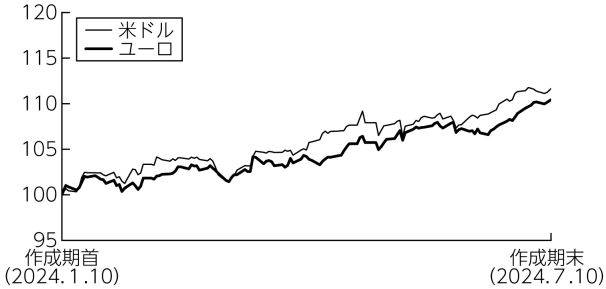


(注) 値は前営業日のものを用いております。

米国国債市場は、米国の雇用統計や消費者物価指数が市場予想を上回ったことから、インフレの根強さが意識されたことを背景に、ＦＲＢ（米連邦準備理事会）による利下げ開始時期の後退や利下げペースの鈍化を織り込んだことなどから下落しました。ドイツ国債市場は、ＥＣＢ（欧州中央銀行）は利下げを行ったものの、追加利下げについては慎重な姿勢を示したことや、米国国債利回りの上昇に連れたことなどを受けて、下落しました。投資適格社債市場は、米国、欧州ともに上昇しました。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。

<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。

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、ＦＲＢによる利下げ観測の後退や、日銀が慎重な金融引き締め姿勢を示す中で日米の金利差が意識されたことなどが上昇要因となりました。ユーロも、ＥＣＢによる利下げペースの鈍化や内外金利差が意識され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

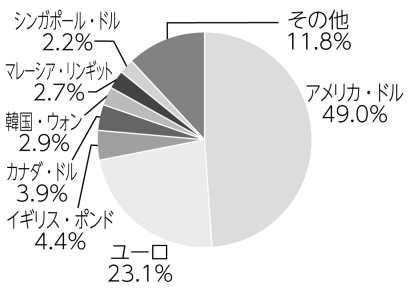
「ルーミス・グローバル債券マザーファンド」受益証券の組入比率を高位に維持しました。なお、実質組入外貨建資産に対して為替ヘッジを行いませんでした。

●ルーミス・グローバル債券マザーファンド

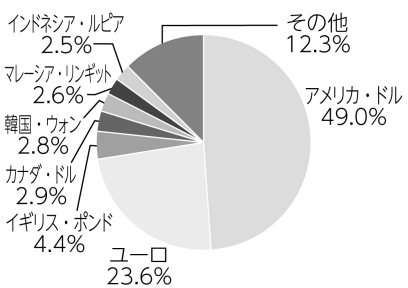
資産配分比率は、先進国の投資適格債を基本配分比率（60%）より高めに維持しました。先進国の高利回り債および新興国の公社債については、基本配分比率（それぞれ20%）より低めとしました。投資通貨は、米ドル、ユーロを中心とし、英ポンド、カナダドルなどへの配分を維持しました。上記の通り運用を行った結果、保有する債券の価格が下落したものの、米ドルやユーロなどが対円で上昇したことから、基準価額は上昇しました。

〔通貨別配分比率〕

作成期首



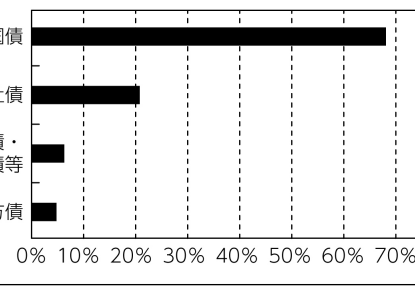
作成期末



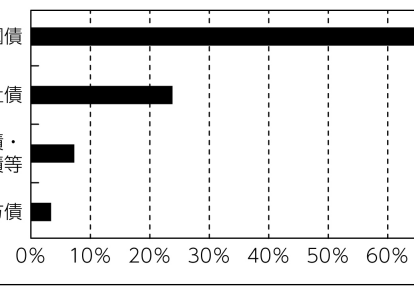
（注１）上記比率は、ルーミス・グローバル債券マザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。
（注２）現金等はその他として表示しています。
（注３）上位８位以下をその他に含めて集計しています。

〔種別組入比率〕

作成期首

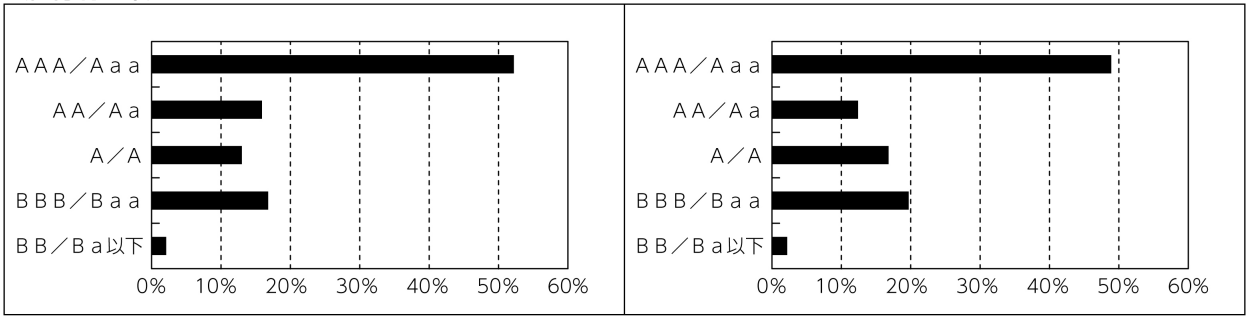


作成期末



（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。

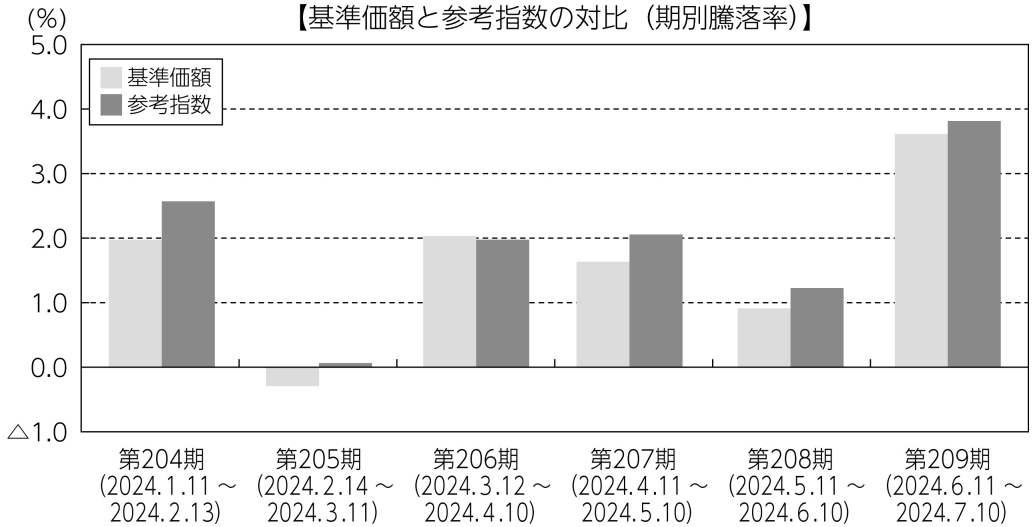
〔格付別比率〕



（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）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204期	第205期	第206期	第207期	第208期	第209期
	2024年1月11日～2024年2月13日	2024年2月14日～2024年3月11日	2024年3月12日～2024年4月10日	2024年4月11日～2024年5月10日	2024年5月11日～2024年6月10日	2024年6月11日～2024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	0.07%	0.07%	0.07%	0.07%	0.07%	0.07%
当期の収益	5円	5円	5円	5円	5円	5円
当期の収益以外	－円	－円	－円	－円	－円	－円
翌期繰越分配対象額	283円	285円	295円	307円	319円	333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、追加利上げの可能性が低下し、今後の利下げの時期・回数が焦点となっています。しかし、経済環境は予想以上に好調を維持しており、インフレの沈静が進まない場合に、ＦＲＢがタカ派姿勢に転じるリスクには引き続き留意する必要があります。欧州は、景気に底打ちの兆候が見られるものの、当面は、ＥＣＢの利下げ時期やその程度を念頭に、同行の政策スタンスや、域内のインフレ動向等に左右されやすい推移を見込みます。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

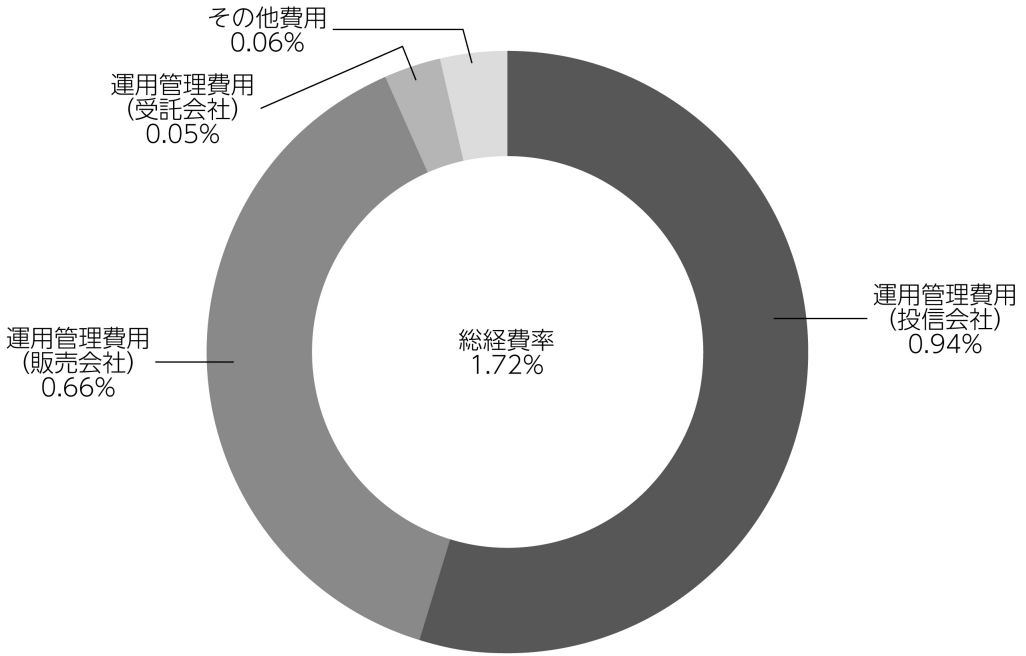
項目	第204期～第209期 (2024年1月11日 ～2024年7月10日)		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	57円	0.825%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は6,960円です。
(投信会社)	(33)	(0.468)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(23)	(0.330)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(2)	(0.027)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) その他費用	2	0.029	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保管費用)	(2)	(0.027)	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)	(0.002)	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	59	0.854	

(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1.72%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（2024年１月11日から2024年７月10日まで）

	第　204　期　～　第　209　期			
	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ルーミス・グローバル債券マザーファンド	－	－	420,899	840,000

■利害関係人との取引状況等（2024年１月11日から2024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34作成期末	第35作成期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
ルーミス・グローバル債券マザーファンド	1,113,287	692,388	1,442,383

■投資信託財産の構成

2024年7月10日現在

項目	第35作成期末	
	評価額	比率
	千円	%
ルーミス・グローバル債券マザーファンド	1,442,383	95.1
コール・ローン等、その他	75,085	4.9
投資信託財産総額	1,517,468	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨てであります。%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、1,440,598千円、98.5%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、2024年7月10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=161.55円、1カナダ・ドル=118.49円、1オーストラリア・ドル=108.77円、1シンガポール・ドル=119.59円、1ニュージーランド・ドル=98.98円、1イギリス・ポンド=206.57円、1スイス・フラン=179.88円、1デンマーク・クローネ=23.42円、1ノルウェー・クローネ=15.24円、1スウェーデン・クローナ=15.32円、1メキシコ・ペソ=9.026円、1アルゼンチン・ペソ=0.176円、100コロンビア・ペソ=4.021円、100インドネシア・ルピア=1.00円、1ブラジル・レアル=29.784円、100韓国・ウォン=11.67円、1マレーシア・リンギット=34.30円、1南アフリカ・ランド=8.89円、1タイ・バーツ=4.43円、1ポーランド・ズロチ=41.037円、100ハンガリー・フォリント=44.307円、1ユーロ=174.70円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	(2024年2月13日)、第204期末	(2024年3月11日)、第205期末	(2024年4月10日)、第206期末	(2024年5月10日)、第207期末	(2024年6月10日)、第208期末	(2024年7月10日)現在第209期末
(A)資産	**2,132,619,165円**	**2,118,399,938円**	**2,149,778,070円**	**2,170,566,077円**	**2,176,294,011円**	**1,517,468,539円**
コール・ローン等	7,464,472	55,777,016	41,477,835	24,381,815	7,487,573	75,085,248
ルーミス・グローバル債券マザーファンド(評価額)	2,125,154,693	2,062,622,922	2,108,300,235	2,146,184,262	2,168,806,438	1,442,383,291
(B)負債	**7,211,048**	**8,390,940**	**5,312,559**	**5,147,977**	**4,586,866**	**3,708,552**
未払収益分配金	1,560,141	1,554,496	1,549,566	1,540,544	1,532,246	1,031,422
未払解約金	2,392,956	4,235,430	863,025	700,600	−	585,900
未払信託報酬	3,250,835	2,595,337	2,893,633	2,900,490	3,047,947	2,086,668
その他未払費用	7,116	5,677	6,335	6,343	6,673	4,562
(C)純資産総額(A−B)	**2,125,408,117**	**2,110,008,998**	**2,144,465,511**	**2,165,418,100**	**2,171,707,145**	**1,513,759,987**
元本	3,120,282,735	3,108,992,254	3,099,132,276	3,081,089,148	3,064,492,801	2,062,845,259
次期繰越損益金	△994,874,618	△998,983,256	△954,666,765	△915,671,048	△892,785,656	△549,085,272
(D)受益権総口数	**3,120,282,735口**	**3,108,992,254口**	**3,099,132,276口**	**3,081,089,148口**	**3,064,492,801口**	**2,062,845,259口**
1万口当たり基準価額(C／D)	**6,812円**	**6,787円**	**6,920円**	**7,028円**	**7,087円**	**7,338円**

(注) 第203期末における元本額は3,132,076,516円、当作成期間（第204期～第209期）中における追加設定元本額は941,631円、同解約元本額は1,070,172,888円です。

■損益の状況

項目	第204期 [自 2024年1月11日 至 2024年2月13日]	第205期 [自 2024年2月14日 至 2024年3月11日]	第206期 [自 2024年3月12日 至 2024年4月10日]	第207期 [自 2024年4月11日 至 2024年5月10日]	第208期 [自 2024年5月11日 至 2024年6月10日]	第209期 [自 2024年6月11日 至 2024年7月10日]
(A)配当等収益	**△65円**	**△97円**	**1,479円**	**1,654円**	**828円**	**3,795円**
受取利息	－	－	1,526	1,654	828	3,795
支払利息	△65	△97	△47	－	－	－
(B)有価証券売買損益	**44,295,380**	**△3,552,811**	**45,596,288**	**37,883,158**	**22,539,314**	**55,011,819**
売買益	44,420,175	40,152	45,677,295	37,895,165	22,623,239	55,468,689
売買損	△124,795	△3,592,963	△81,007	△12,007	△83,925	△456,870
(C)信託報酬等	**△3,257,951**	**△2,601,014**	**△2,899,968**	**△2,906,833**	**△3,054,620**	**△2,091,230**
(D)当期損益金(A＋B＋C)	**41,037,364**	**△6,153,922**	**42,697,799**	**34,977,979**	**19,485,522**	**52,924,384**
(E)前期繰越損益金	**△822,108,591**	**△779,760,980**	**△784,931,600**	**△739,415,375**	**△702,140,286**	**△460,537,247**
(F)追加信託差損益金	**△212,243,250**	**△211,513,858**	**△210,883,398**	**△209,693,108**	**△208,598,646**	**△140,440,987**
(配当等相当額)	(29,309,598)	(29,206,657)	(29,117,209)	(28,951,005)	(28,798,518)	(19,388,169)
(売買損益相当額)	(△241,552,848)	(△240,720,515)	(△240,000,607)	(△238,644,113)	(△237,397,164)	(△159,829,156)
(G)合計(D＋E＋F)	**△993,314,477**	**△997,428,760**	**△953,117,199**	**△914,130,504**	**△891,253,410**	**△548,053,850**
(H)収益分配金	**△1,560,141**	**△1,554,496**	**△1,549,566**	**△1,540,544**	**△1,532,246**	**△1,031,422**
次期繰越損益金(G＋H)	**△994,874,618**	**△998,983,256**	**△954,666,765**	**△915,671,048**	**△892,785,656**	**△549,085,272**
追加信託差損益金	△212,243,250	△211,513,858	△210,883,398	△209,693,108	△208,598,646	△140,440,987
(配当等相当額)	(29,309,788)	(29,206,792)	(29,117,373)	(28,951,194)	(28,798,728)	(19,388,354)
(売買損益相当額)	(△241,553,038)	(△240,720,650)	(△240,000,771)	(△238,644,302)	(△237,397,374)	(△159,829,341)
分配準備積立金	59,266,451	59,427,356	62,610,844	65,845,958	69,238,234	49,430,806
繰越損益金	△841,897,819	△846,896,754	△806,394,211	△771,823,898	△753,425,244	△458,075,091

(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204期から第209期まではルーミス・グローバル債券マザーファンド4,981,161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204期	第205期	第206期	第207期	第208期	第209期
(a)経費控除後の配当等収益	5,394,267円	1,932,765円	4,924,574円	5,143,351円	5,282,458円	3,856,863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	29,309,788	29,206,792	29,117,373	28,951,194	28,798,728	19,388,354
(d)分配準備積立金	55,432,325	59,049,087	59,235,836	62,243,151	65,488,022	46,605,365
(e)当期分配対象額(a＋b＋c＋d)	90,136,380	90,188,644	93,277,783	96,337,696	99,569,208	69,850,582
(f)1万口当たり当期分配対象額	288.87	290.09	300.98	312.67	324.91	338.61
(g)分配金	1,560,141	1,554,496	1,549,566	1,540,544	1,532,246	1,031,422
(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204期	第205期	第206期	第207期	第208期	第209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。

〇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。

〇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35期（決算日　2024年７月10日）

（計算期間　2024年１月11日～2024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35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		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			期中騰落幅		期中騰落幅			
	円	%		%	円	%	%	%	%	%	%	百万円
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
34期（2024年１月10日）	18,690	5.9	344.03	5.8	144.69	4.01	△0.05	2.19	△0.45	97.9	－	2,080
35期（2024年７月10日）	20,832	11.5	386.17	12.2	161.55	4.30	0.29	2.58	0.39	96.3	－	1,442

（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）。

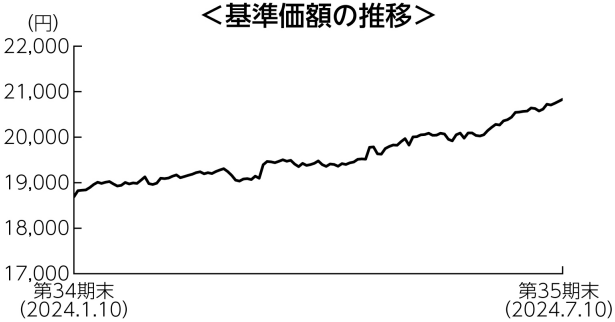
■当期中の基準価額と市況の推移

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(為替ノーヘッジ・円ベース)(参考指数)		為替	米国10年国債利回り		ドイツ10年国債利回り		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率	(対米ドル)		騰落幅		騰落幅		
(期　首)	円	%		%	円	%	%	%	%	%	%
2024年１月10日	18,690	－	344.03	－	144.69	4.01	－	2.19	－	97.9	－
１月末	18,995	1.6	351.63	2.2	147.55	4.03	0.02	2.27	0.08	97.5	－
２月末	19,220	2.8	355.97	3.5	150.67	4.26	0.25	2.46	0.27	97.5	－
３月末	19,472	4.2	360.55	4.8	151.41	4.20	0.19	2.30	0.11	97.2	－
４月末	19,777	5.8	366.37	6.5	156.90	4.61	0.60	2.53	0.34	97.1	－
５月末	19,919	6.6	369.51	7.4	156.74	4.55	0.54	2.65	0.46	97.4	－
６月末	20,641	10.4	382.33	11.1	161.07	4.29	0.28	2.45	0.26	96.6	－
(期　末)											
2024年７月10日	20,832	11.5	386.17	12.2	161.55	4.30	0.29	2.58	0.39	96.3	－

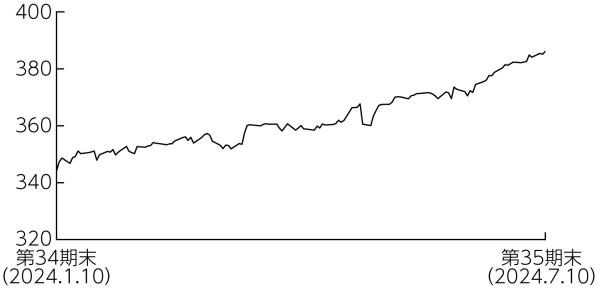
(注１) 騰落率および騰落幅は期首比です。
(注２) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2024年１月11日から2024年７月10日まで）

＜基準価額の推移＞



＜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）の推移＞



基準価額の推移

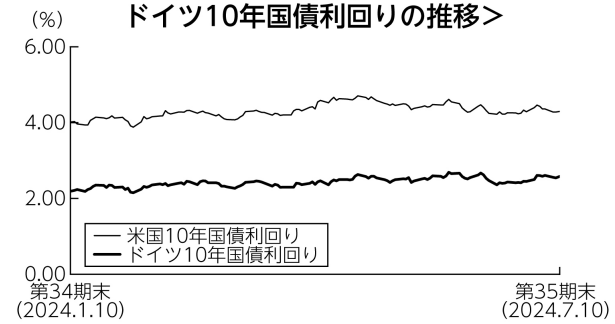
当ファンドの基準価額は、前期末比で11.5％上昇しました。

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、米ドル、ユーロなどの通貨は対円で上昇したことから、基準価額は上昇しました。

投資環境

＜米国10年国債利回りおよびドイツ10年国債利回りの推移＞

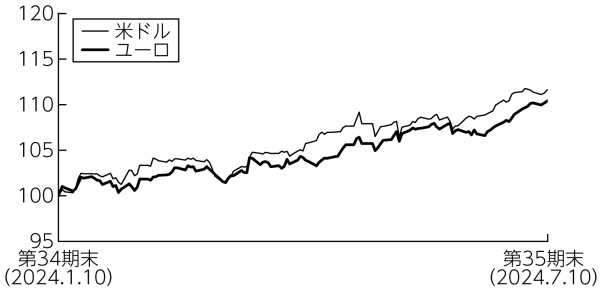


（注）値は前営業日のものを用いております。

米国国債市場は、米国の雇用統計や消費者物価指数が市場予想を上回ったことから、インフレの根強さが意識されたことを背景に、ＦＲＢ（米連邦準備理事会）による利下げ開始時期の後退や利下げペースの鈍化を織り込んだことなどから下落しました。ドイツ国債市場は、ＥＣＢ（欧州中央銀行）は利下げを行ったものの、追加利下げについては慎重な姿勢を示したことや、米国国債利回りの上昇に連れたことなどを受けて、下落しました。投資適格社債市場は、米国、欧州ともに上昇しました。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。

<米ドルおよびユーロの推移>



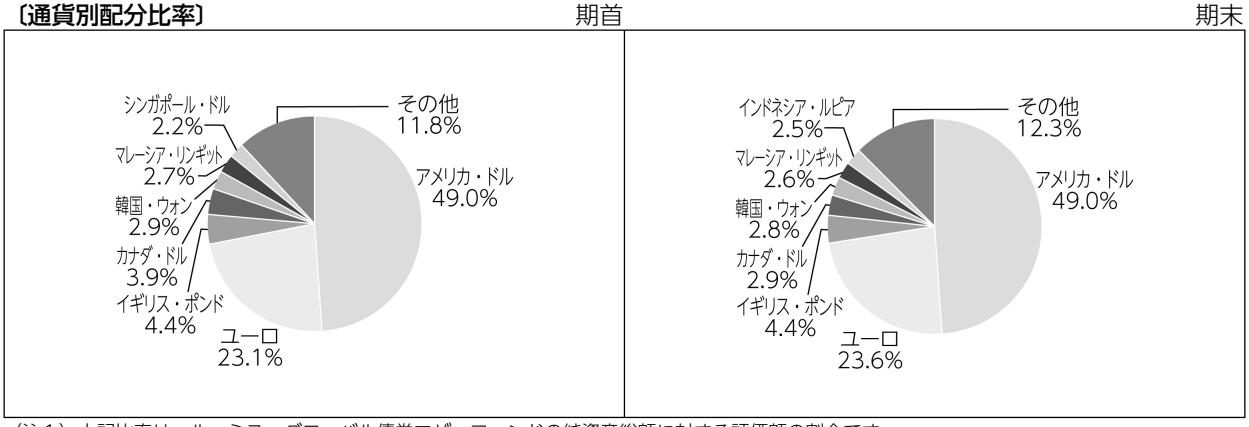
(注) 期首の値を100として指数化しています。

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、ＦＲＢによる利下げ観測の後退や、日銀が慎重な金融引き締め姿勢を示す中で日米の金利差が意識されたことなどが上昇要因となりました。ユーロも、ＥＣＢによる利下げペースの鈍化や内外金利差が意識され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

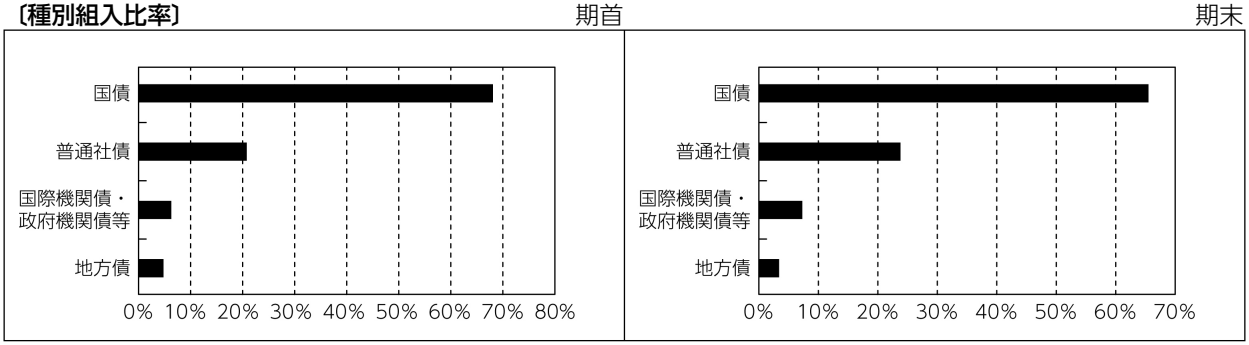
資産配分比率は、先進国の投資適格債を基本配分比率（60%）より高めに維持しました。先進国の高利回り債および新興国の公社債については、基本配分比率（それぞれ20%）より低めとしました。投資通貨は、米ドル、ユーロを中心とし、英ポンド、カナダドルなどへの配分を維持しました。上記の通り運用を行った結果、保有する債券の価格が下落したものの、米ドルやユーロなどが対円で上昇したことから、基準価額は上昇しました。

〔通貨別配分比率〕



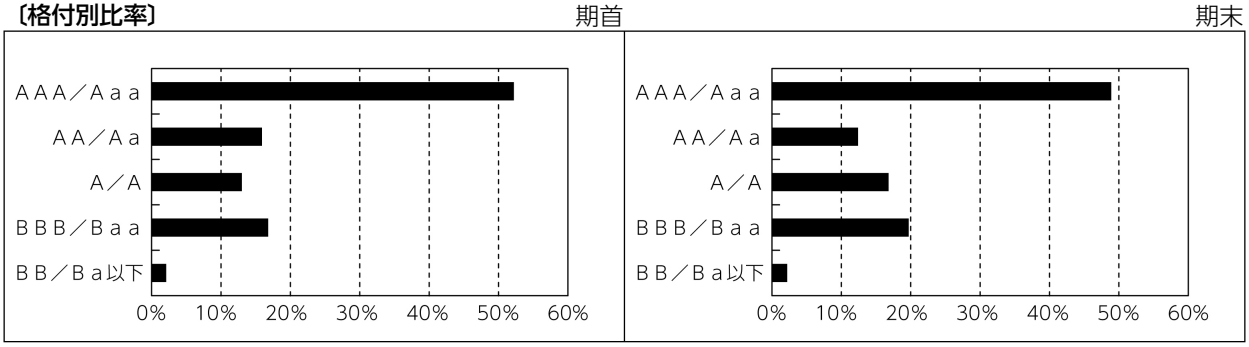
(注１) 上記比率は、ルーミス・グローバル債券マザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。
(注２) 現金等はその他として表示しています。
(注３) 上位８位以下をその他に含めて集計しています。

〔種別組入比率〕



（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〕



（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）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、追加利上げの可能性が低下し、今後の利下げの時期・回数が焦点となっています。しかし、経済環境は予想以上に好調を維持しており、インフレの沈静が進まない場合に、ＦＲＢがタカ派姿勢に転じるリスクには引き続き留意する必要があります。欧州は、景気に底打ちの兆候が見られるものの、当面は、ＥＣＢの利下げ時期やその程度を念頭に、同行の政策スタンスや、域内のインフレ動向等に左右されやすい推移を見込みます。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	5円	0.026%	(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)	(5)	(0.026)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
合計	5	0.026	
期中の平均基準価額は19,598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（2024年１月11日から2024年７月10日まで）

公社債

			買付額	売付額
外国	アメリカ	国債証券	千アメリカ・ドル 2,766	千アメリカ・ドル 4,228 (375)
		社債券	175	926 (10)
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル －	千カナダ・ドル 265 (－)
		地方債証券	－	45 (－)
		特殊債券	－	84 (－)
	オーストラリア	地方債証券	千オーストラリア・ドル －	千オーストラリア・ドル 131 (－)
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 110	千シンガポール・ドル 275 (－)
	ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランド・ドル －	千ニュージーランド・ドル 14 (－)
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド －	千イギリス・ポンド 287 (－)

			買付額	売付額
外国	イギリス	特殊債券	千イギリス・ポンド 52	千イギリス・ポンド － (－)
		社債券	50	－ (－)
	スイス	社債券	千スイス・フラン －	千スイス・フラン 59 (－)
	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 92 (－)
	スウェーデン	地方債証券	千スウェーデン・クローナ －	千スウェーデン・クローナ 264 (－)
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ －	千メキシコ・ペソ 2,709 (－)
	コロンビア	国債証券	千コロンビア・ペソ －	千コロンビア・ペソ 168,217 (－)
	インドネシア	国債証券	千インドネシア・ルピア 1,675,520	千インドネシア・ルピア 1,846,300 (－)
	ブラジル	国債証券	千ブラジル・レアル 678	千ブラジル・レアル 951 (－)
	韓国	国債証券	千韓国・ウォン 243,630	千韓国・ウォン 456,194 (－)
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット －	千マレーシア・リンギット 696 (－)
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカ・ランド －	千南アフリカ・ランド 460 (－)

				買付額	売付額
外国	タイ		国債証券	千タイ・バーツ －	千タイ・バーツ 795 (－)
	ポーランド		国債証券	千ポーランド・ズロチ －	千ポーランド・ズロチ 70 (－)
	ユーロ	国際機関	特殊債券	千ユーロ －	千ユーロ 55 (－)
		アイルランド	国債証券	－	43 (－)
		ベルギー	特殊債券	－	97 (－)
		フランス	国債証券	－	154 (－)
		ドイツ	国債証券	828	1,274 (－)
			特殊債券	－	76 (－)
			社債券	－	86 (－)
		スペイン	国債証券	84	80 (－)
			地方債証券	42	－ (－)
		イタリア	国債証券	186	68 (－)
		カナダ	地方債証券	－	259 (－)

(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（2024年1月11日から2024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BB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
	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	4,923	4,375	706,820	49.0	0.6	29.6	11.0	8.5
	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円					
カナダ	435	353	41,868	2.9	－	0.9	2.0	－
	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円					
オーストラリア	205	192	20,960	1.5	－	0.5	0.9	－
	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円					
シンガポール	255	256	30,672	2.1	－	－	2.1	－
	千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル	千円					
ニュージーランド	20	19	1,976	0.1	－	－	0.1	－
	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円					
イギリス	315	304	62,887	4.4	－	3.4	－	1.0
	千スイス・フラン	千スイス・フラン	千円					
スイス	95	94	17,010	1.2	－	－	－	1.2
	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	千円					
デンマーク	120	117	2,750	0.2	－	0.2	－	－
	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円					
ノルウェー	130	127	1,946	0.1	－	－	－	0.1
	千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ	千円					
スウェーデン	370	362	5,559	0.4	－	－	－	0.4
	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円					
メキシコ	450	423	3,822	0.3	－	－	0.3	－
	千コロンビア・ペソ	千コロンビア・ペソ	千円					
コロンビア	218,800	211,225	8,493	0.6	－	－	0.6	－
	千インドネシア・ルピア	千インドネシア・ルピア	千円					
インドネシア	3,519,000	3,556,547	35,565	2.5	－	1.3	1.2	－
	千ブラジル・レアル	千ブラジル・レアル	千円					
ブラジル	481	444	13,232	0.9	0.9	0.8	0.1	－
	千韓国・ウォン	千韓国・ウォン	千円					
韓国	349,080	342,248	39,940	2.8	－	2.8	－	－
	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円					
マレーシア	1,095	1,105	37,926	2.6	－	－	2.6	－
	千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド	千円					
南アフリカ	1,080	915	8,137	0.6	0.6	0.6	－	－
	千タイ・バーツ	千タイ・バーツ	千円					
タイ	1,460	1,398	6,193	0.4	－	0.4	－	－

区分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB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
	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	%	%	%	%	%
ポーランド	70	66	2,725	0.2	−	−	0.2	−
	千ユーロ	千ユーロ	千円					
ユーロ								
国際機関	90	77	13,524	0.9	−	0.9	−	−
デンマーク	100	104	18,221	1.3	−	1.3	−	−
アイルランド	185	184	32,198	2.2	−	0.3	1.3	0.6
オランダ	100	91	15,975	1.1	−	−	1.1	−
ルクセンブルグ	200	175	30,626	2.1	−	1.1	1.1	−
フランス	230	187	32,690	2.3	−	1.8	−	0.5
ドイツ	680	557	97,439	6.8	−	3.9	−	2.8
スイス	130	120	20,998	1.5	−	−	1.5	−
スペイン	355	333	58,178	4.0	−	4.0	−	−
イタリア	115	114	19,982	1.4	−	1.4	−	−
			千円					
合計	−	−	1,388,326	96.3	2.1	55.1	26.1	15.1

（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、BB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	
（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	172	27,838	2031/01/31
US T N/B 1.5 01/31/27	国債証券	1.5000	150	139	22,507	2027/01/31
US T N/B 2.25 02/15/52	国債証券	2.2500	40	25	4,152	2052/02/15
US T N/B 1.875 02/15/51	国債証券	1.8750	150	88	14,270	2051/02/15
US T N/B 4.25 02/15/54	国債証券	4.2500	15	14	2,327	2054/02/15
US T N/B 4.0 02/15/34	国債証券	4.0000	165	161	26,041	2034/02/15
US T N/B 4.875 04/30/26	国債証券	4.8750	350	351	56,723	2026/04/30
US T N/B 3.375 05/15/33	国債証券	3.3750	95	88	14,319	2033/05/15
US T N/B 4.625 06/30/25	国債証券	4.6250	350	348	56,314	2025/06/30
TSY INFL 0.625 07/15/32	国債証券	0.6250	90	87	14,157	2032/07/15
US T N/B 2.75 07/31/27	国債証券	2.7500	355	338	54,661	2027/07/31
US T N/B 1.75 08/15/41	国債証券	1.7500	435	290	46,860	2041/08/15
US T N/B 2.75 08/15/32	国債証券	2.7500	95	85	13,753	2032/08/15
US T N/B 3.875 08/15/33	国債証券	3.8750	305	295	47,712	2033/08/15

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	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 4.125 10/31/27	国債証券	4.1250	140	138	22,447	2027/10/31
US T N/B 1.625 11/15/50	国債証券	1.6250	135	74	12,049	2050/11/15
US T N/B 1.375 11/15/31	国債証券	1.3750	105	86	13,897	2031/11/15
US T N/B 1.375 12/31/28	国債証券	1.3750	295	260	42,078	2028/12/31
UNITED AIR 2016-1 B PTT 3.65 01/07/26	社債券	3.6500	19	19	3,111	2026/01/07
CONTINENTAL RESOURCES 5.75 01/15/31	社債券	5.7500	10	9	1,604	2031/01/15
AMERICAN TOWER CORP 2.9 01/15/30	社債券	2.9000	15	13	2,154	2030/01/15
AES CORP/THE 2.45 01/15/31	社債券	2.4500	20	16	2,684	2031/01/15
T-MOBILE USA INC 3.3 02/15/51	社債券	3.3000	15	10	1,666	2051/02/15
TOLL BROS FINANCE CORP 4.35 02/15/28	社債券	4.3500	50	48	7,831	2028/02/15
AT&T 5.4 02/15/34	社債券	5.4000	25	25	4,079	2034/02/15
T-MOBILE USA INC 4.75 02/01/28	社債券	4.7500	55	54	8,783	2028/02/01
AMGEN INC 5.65 03/02/53	社債券	5.6500	55	54	8,847	2053/03/02
CF INDUSTRIES INC 5.15 03/15/34	社債券	5.1500	10	9	1,567	2034/03/15
CF INDUSTRIES INC 5.375 03/15/44	社債券	5.3750	10	9	1,504	2044/03/15
GATX CORP 6.05 03/15/34	社債券	6.0500	10	10	1,672	2034/03/15
FREEPORT-MCMORAN INC 4.25 03/01/30	社債券	4.2500	5	4	770	2030/03/01
HCA INC 3.625 03/15/32	社債券	3.6250	65	57	9,317	2032/03/15
CHARTER COMM OPT LLC/CAP 3.7 04/01/51	社債券	3.7000	10	6	996	2051/04/01
CONTINENTAL RESOURCES 2.875 04/01/32	社債券	2.8750	20	16	2,637	2032/04/01
UNITEDHEALTH GROUP INC 4.5 04/15/33	社債券	4.5000	50	48	7,788	2033/04/15
BROADCOM INC 3.469 04/15/34	社債券	3.4690	25	21	3,483	2034/04/15
MORGAN STANLEY 04/21/34	社債券	5.2500	25	24	4,009	2034/04/21
BANK OF AMERICA CORP 04/25/34	社債券	5.2880	40	39	6,447	2034/04/25
JPMORGAN CHASE & CO 04/22/35	社債券	5.7660	10	10	1,670	2035/04/22
T-MOBILE USA INC 5.15 04/15/34	社債券	5.1500	20	19	3,210	2034/04/15
T-MOBILE USA INC 3.875 04/15/30	社債券	3.8750	35	32	5,330	2030/04/15
ENERGY TRANSFER LP 5.95 05/15/54	社債券	5.9500	25	24	3,980	2054/05/15
NEW YORK LIFE INSURANCE 3.75 05/15/50	社債券	3.7500	30	22	3,660	2050/05/15
PFIZER INVESTMENT ENTER 5.3 05/19/53	社債券	5.3000	50	48	7,881	2053/05/19
UNITEDHEALTH GROUP INC 2.9 05/15/50	社債券	2.9000	10	6	1,063	2050/05/15
GLENCORE FUNDING LLC 5.7 05/08/33	社債券	5.7000	15	15	2,435	2033/05/08
ONCOR ELECTRIC DELIVERY 5.55 06/15/54	社債券	5.5500	35	34	5,630	2054/06/15
CF INDUSTRIES INC 4.95 06/01/43	社債券	4.9500	5	4	711	2043/06/01
FORD FOUNDATION/THE 3.859 06/01/47	社債券	3.8590	65	53	8,569	2047/06/01
AT&T 3.65 06/01/51	社債券	3.6500	40	28	4,647	2051/06/01
GREAT-WEST LIFECO FINANC 4.15 06/03/47	社債券	4.1500	25	20	3,250	2047/06/03
JPMORGAN CHASE & CO 06/01/34	社債券	5.3500	25	25	4,056	2034/06/01
HCA INC 5.5 06/01/33	社債券	5.5000	20	19	3,222	2033/06/01
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 5.4 06/24/31	社債券	5.4000	15	15	2,423	2031/06/24
CROWN CASTLE INTL CORP 4.15 07/01/50	社債券	4.1500	10	7	1,270	2050/07/01
AES CORP/THE 3.95 07/15/30	社債券	3.9500	20	18	2,978	2030/07/15
T-MOBILE USA INC 5.05 07/15/33	社債券	5.0500	45	44	7,184	2033/07/15

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	
OVINTIV INC 6.25 07/15/33	社債券	6.2500	15	15	2,516	2033/07/15
CVS HEALTH CORP 3.25 08/15/29	社債券	3.2500	30	27	4,429	2029/08/15
OVINTIV INC 6.5 08/15/34	社債券	6.5000	11	11	1,878	2034/08/15
VMWARE INC 2.2 08/15/31	社債券	2.2000	30	24	3,987	2031/08/15
VERIZON COMMUNICATIONS 2.85 09/03/41	社債券	2.8500	10	7	1,149	2041/09/03
CVS HEALTH CORP 2.125 09/15/31	社債券	2.1250	55	44	7,194	2031/09/15
GLENCORE FUNDING LLC 2.5 09/01/30	社債券	2.5000	5	4	688	2030/09/01
GLENCORE FUNDING LLC 2.625 09/23/31	社債券	2.6250	30	24	4,022	2031/09/23
T-MOBILE USA INC 3.4 10/15/52	社債券	3.4000	10	6	1,121	2052/10/15
UNITED AIR 2016-2 B PTT 3.65 10/07/25	社債券	3.6500	37	36	5,914	2025/10/07
GLENCORE FUNDING LLC 6.5 10/06/33	社債券	6.5000	10	10	1,702	2033/10/06
CITIGROUP INC 11/17/33	社債券	6.2700	10	10	1,705	2033/11/17
OVINTIV INC 7.375 11/01/31	社債券	7.3750	10	10	1,776	2031/11/01
BROADCOM INC 5.15 11/15/31	社債券	5.1500	25	24	4,034	2031/11/15
MERCK & CO INC 2.15 12/10/31	社債券	2.1500	85	71	11,513	2031/12/10
CENTENE CORP 4.625 12/15/29	社債券	4.6250	45	42	6,932	2029/12/15
小計	－	－	4,923	4,375	706,820	－
(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	110	104	12,382	2029/06/01
ONTARIO (PROVINCE OF) 1.9 12/02/51	地方債証券	1.9000	175	107	12,685	2051/12/02
IBRD 1.2 07/22/26	特殊債券	1.2000	150	141	16,800	2026/07/22
小計	－	－	435	353	41,868	－
(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	75	69	7,507	2030/02/20
QUEENSLAND 2.75 08/20/27	地方債証券	2.7500	130	123	13,453	2027/08/20
小計	－	－	205	192	20,960	－
(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	255	256	30,672	2027/03/01
小計	－	－	255	256	30,672	－
(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	20	19	1,976	2027/04/15
小計	－	－	20	19	1,976	－
(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	3,410	2044/01/22
UK TREASURY 3.25 01/31/33	国債証券	3.2500	90	84	17,447	2033/01/31
UK TREASURY 0.25 01/31/25	国債証券	0.2500	70	68	14,144	2025/01/31
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	35	32	6,759	2055/12/07
ELECTRICITE DE FRANCE SA 6.125 06/02/34	特殊債券	6.1250	50	51	10,599	2034/06/02
ENEL SPA 5.75 06/22/37	社債券	5.7500	50	50	10,525	2037/06/22
小計	－	－	315	304	62,887	－
(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	社債券	1.0000	95	94	17,010	2025/11/24
小計	－	－	95	94	17,010	－

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	
(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 2.25 11/15/33	国債証券	2.2500	120	117	2,750	2033/11/15
小計	－	－	120	117	2,750	－
(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	127	1,946	2025/03/13
小計	－	－	130	127	1,946	－
(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	370	362	5,559	2025/05/12
小計	－	－	370	362	5,559	－
(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	450	423	3,822	2029/05/31
小計	－	－	450	423	3,822	－
(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	218,800	211,225	8,493	2026/08/26
小計	－	－	218,800	211,225	8,493	－
(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	809,400	8,094	2031/02/15
INDONESIA GOV'T 6.625 02/15/34	国債証券	6.6250	1,075,000	1,047,340	10,473	2034/02/15
INDONESIA GOV'T 8.25 05/15/29	国債証券	8.2500	1,613,000	1,699,807	16,998	2029/05/15
小計	－	－	3,519,000	3,556,547	35,565	－
(ブラジル)		%	千ブラジル・レアル	千ブラジル・レアル	千円	
BRAZIL NTN 01/01/29	国債証券	10.0000	64	60	1,799	2029/01/01
BRAZIL NTN 01/01/31	国債証券	10.0000	417	383	11,433	2031/01/01
小計	－	－	481	444	13,232	－
(韓国)		%	千韓国・ウォン	千韓国・ウォン	千円	
KOREA TREASURY BOND 4.125 12/10/33	国債証券	4.1250	147,080	157,842	18,420	2033/12/10
KOREA TREASURY BOND 1.375 12/10/29	国債証券	1.3750	202,000	184,405	21,520	2029/12/10
小計	－	－	349,080	342,248	39,940	－
(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	636	21,822	2027/03/15
MALAYSIA 3.906 07/15/26	国債証券	3.9060	465	469	16,103	2026/07/15
小計	－	－	1,095	1,105	37,926	－
(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	1,080	915	8,137	2031/02/28
小計	－	－	1,080	915	8,137	－
(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	1,460	1,398	6,193	2029/12/17
小計	－	－	1,460	1,398	6,193	－
(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	70	66	2,725	2026/07/25
小計	－	－	70	66	2,725	－
(ユーロ･･･国際機関)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
EUROPEAN UNION 1.0 07/06/32	特殊債券	1.0000	90	77	13,524	2032/07/06
小計	－	－	90	77	13,524	－

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…デンマーク)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DANSKE BANK A/S 06/21/30	社債券	4.7500	100	104	18,221	2030/06/21
小計	－	－	100	104	18,221	－
(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	55	53	9,268	2026/05/15
IRISH 0.0 10/18/31	国債証券	0.0000	30	24	4,280	2031/10/18
AIB GROUP PLC 02/16/29	社債券	5.7500	100	106	18,650	2029/02/16
小計	－	－	185	184	32,198	－
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
COOPERATIEVE RABOBANK UA 0.0 06/21/27	特殊債券	0.0000	100	91	15,975	2027/06/21
小計	－	－	100	91	15,975	－
(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	社債券	1.6250	100	86	15,177	2030/01/17
BLACKSTONE PP EUR HOLD 1.0 05/04/28	社債券	1.0000	100	88	15,448	2028/05/04
小計	－	－	200	175	30,626	－
(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	30	33	5,913	2041/04/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	0.5000	40	38	6,660	2026/05/25
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	国債証券	0.0000	110	86	15,116	2032/05/25
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	国債証券	0.5000	50	28	5,000	2044/06/25
小計	－	－	230	187	32,690	－
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 2.2 02/15/34	国債証券	2.2000	35	33	5,932	2034/02/15
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	国債証券	2.3000	25	24	4,297	2033/02/15
BUNDESSCHAT 2.9 06/18/26	国債証券	2.9000	55	54	9,601	2026/06/18
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.7500	95	113	19,743	2034/07/04
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	国債証券	0.0000	240	114	19,919	2052/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	国債証券	0.0000	45	37	6,616	2031/08/15
COMMERZBANK AG 0.625 05/28/25	特殊債券	0.6250	70	68	11,926	2025/05/28
KFW 0.25 09/15/25	特殊債券	0.2500	115	111	19,401	2025/09/15
小計	－	－	680	557	97,439	－
(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	120	20,998	2028/01/14
小計	－	－	130	120	20,998	－
(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	75	80	14,050	2037/01/31
SPAIN 3.25 04/30/34	国債証券	3.2500	85	84	14,766	2034/04/30
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	1.9500	50	47	8,223	2030/07/30
COMMUNITY OF MADRID SPAI 2.398 06/02/31	地方債証券	2.3980	45	42	7,409	2031/06/02
BANCO SANTANDER SA 0.1 02/27/32	特殊債券	0.1000	100	78	13,728	2032/02/27
小計	－	－	355	333	58,178	－
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 3.85 07/01/34	国債証券	3.8500	115	114	19,982	2034/07/01
小計	－	－	115	114	19,982	－
合計	－	－	－	－	1,388,326	－

■投資信託財産の構成

2024年7月10日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	1,388,326	95.0
コール・ローン等、その他	73,631	5.0
投資信託財産総額	1,461,957	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨てであります。%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、1,440,598千円、98.5%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、2024年7月10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=161.55円、1カナダ・ドル=118.49円、1オーストラリア・ドル=108.77円、1シンガポール・ドル=119.59円、1ニュージーランド・ドル=98.98円、1イギリス・ポンド=206.57円、1スイス・フラン=179.88円、1デンマーク・クローネ=23.42円、1ノルウェー・クローネ=15.24円、1スウェーデン・クローナ=15.32円、1メキシコ・ペソ=9.026円、1アルゼンチン・ペソ=0.176円、100コロンビア・ペソ=4.021円、100インドネシア・ルピア=1.00円、1ブラジル・レアル=29.784円、100韓国・ウォン=11.67円、1マレーシア・リンギット=34.30円、1南アフリカ・ランド=8.89円、1タイ・バーツ=4.43円、1ポーランド・ズロチ=41.037円、100ハンガリー・フォリント=44.307円、1ユーロ=174.70円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年7月10日)現在

項目	当期末
(A) 資産	**1,461,957,930円**
コール・ローン等	51,411,372
公社債(評価額)	1,388,326,352
未収入金	10,243,325
未収利息	10,537,182
前払費用	1,439,699
(B) 負債	**19,568,444**
未払金	19,568,444
(C) 純資産総額(A−B)	**1,442,389,486**
元本	692,388,293
次期繰越損益金	750,001,193
(D) 受益権総口数	**692,388,293口**
1万口当たり基準価額(C／D)	**20,832円**

(注1) 期首元本額 1,113,287,597円
追加設定元本額 −円
一部解約元本額 420,899,304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) 692,388,293円
期末元本合計 692,388,293円

■損益の状況

当期 自2024年1月11日 至2024年7月10日

項目	当期
(A) 配当等収益	**32,711,151円**
受取利息	32,711,096
その他収益金	73
支払利息	△18
(B) 有価証券売買損益	**169,486,745**
売買益	203,816,999
売買損	△34,330,254
(C) その他費用	**△530,452**
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	**201,667,444**
(E) 前期繰越損益金	**967,434,445**
(F) 解約差損益金	**△419,100,696**
(G) 合計(D＋E＋F)	**750,001,193**
次期繰越損益金(G)	**750,001,193**

(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。