

運用報告書(全体版)

当ファンドの仕組みは次のとおりです。

商 品 分 類	追加型投信／海外／債券	
信 託 期 間	無期限	
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、信託財産の長期的な成長を目指して、運用を行います。	
主 要 投 資 対 象	ルーミス グローバル ボンドファンド (為替ヘッジあり・ 年 2 回 決 算 型)	朝日Nvest グローバル ボンド マザーファンド受益証券を主 要投資対象とします。
	朝日 N v e s t グローバル ボンド 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。
組 入 制 限	ルーミス グローバル ボンドファンド (為替ヘッジあり・ 年 2 回 決 算 型)	株式への実質投資割合は、純資 産総額の20%以下とします。外 貨建資産への実質投資割合に は、制限を設けません。
	朝日 N v e s t グローバル ボンド マザーファンド	株式への投資割合は、純資産総 額の20%以下とします。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	毎決算時(2月24日、8月24日。休業日の場合は翌 営業日)に、配当等収益および売買益などのうち から、基準価額水準等を勘案して、分配を行う方 針です。ただし、分配対象額が少額の場合は分配 を行わないこともあります。	

ルーミス グローバル ボンドファンド
(為替ヘッジあり・年2回決算型)

第53期

(決算日 2026年 8 月24日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、当ファンドは、このたび、上記の決算を行いました。ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも、一層のお引立てを賜りますようお願い申し上げます。

朝日ライフ アセットマネジメント株式会社
東京都杉並区和泉一丁目22番19号

<お問い合わせ先>

ホームページ： <https://www.alamco.co.jp/>

フリーダイヤル： 0 1 2 0 - 2 8 3 - 1 0 4

〔受付時間〕 営業日の午前9時～午後5時

○本報告書の表記について

・原則として、数量、額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数で表記する場合があります。－印は、組入れ、異動などの該当がないことを示します。

○最近５期の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額		参 考	指 数	債 券 組 入 比 率	純 資 産 総 額
		税 込 分 配	み 期 金 騰 落				
	円	円	%		%	%	百万円
49期(2024年8月26日)	7,843	10	0.8	14,901	1.2	91.5	2,154
50期(2025年2月25日)	7,632	10	△2.6	14,560	△2.3	95.5	2,101
51期(2025年8月25日)	7,599	10	△0.3	14,549	△0.1	98.2	2,010
52期(2026年2月24日)	7,677	10	1.2	14,736	1.3	96.9	2,007
53期(2026年8月24日)	7,418	10	△3.2	14,345	△2.7	96.9	1,962

(注) 基準価額および分配金は1万口当たりの値です。

(注) 基準価額の騰落率は分配金込みで計算しています。

(注) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、債券組入比率は実質比率で記載しています。

(注) 債券組入比率には新株予約権付社債(転換社債)を含んでいます。

(注) 参考指数は、FTSE世界国債インデックス(除く日本)をファンドの計理基準に適合するように調整した数値を表示しています。この数値はインデックス構成国の現地通貨ベースのリターン(前営業日)から対顧客電信売買相場の仲値の1ヵ月フォワードレート(当日)に基づくヘッジコストを控除した構成各国の円ヘッジベースのリターンを国別構成比で加重して算出しており、当ファンド設定日の前日を10,000として指数化しています。(以下同じです。)

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額		参 考	指 数	債 券 組 入 比 率
		騰 落	率			
(期 首)	円	%			%	%
2026年2月24日	7,677	—		14,736	—	96.9
2月末	7,686	0.1		14,753	0.1	97.4
3月末	7,481	△2.6		14,445	△2.0	95.3
4月末	7,496	△2.4		14,425	△2.1	97.5
5月末	7,534	△1.9		14,498	△1.6	98.0
6月末	7,574	△1.3		14,575	△1.1	97.6
7月末	7,447	△3.0		14,373	△2.5	97.5
(期 末)						
2026年8月24日	7,428	△3.2		14,345	△2.7	96.9

(注) 基準価額は1万口当たりの値です。

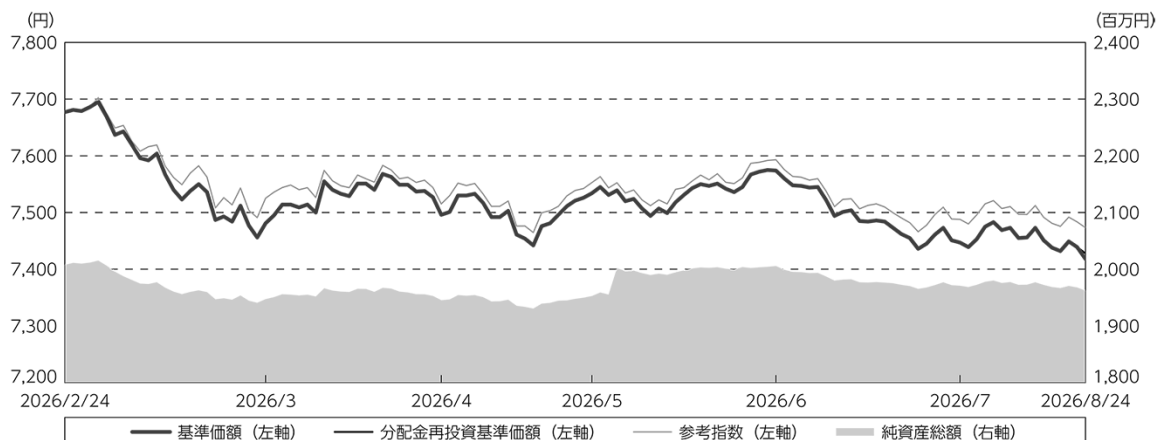
(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比で計算しています。

(注) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、債券組入比率は実質比率で記載しています。

(注) 債券組入比率には新株予約権付社債(転換社債)を含んでいます。

◎運用経過(2026年2月25日～2026年8月24日)

○当期中の基準価額等の推移



期 首：7,677円

期 末：7,418円(既払分配金(税込み):10円)

騰落率：△ 3.2% (分配金再投資ベース)

(注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に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) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様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。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) 分配金再投資基準価額および参考指数は、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

(注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しています。

○基準価額の主な変動要因

主な上昇要因としては、期中において投資適格社債を含む保有債券の利息収入を安定的に確保したことが挙げられます。

主な下落要因としては、中東情勢の緊迫化に伴うエネルギー価格の上昇によりインフレ懸念が高まりグローバルに各国の国債利回りの上昇傾向が続いたこと、および海外との短期金利差を背景に為替ヘッジに係るコストが相応にかかったことが挙げられます。

○投資環境

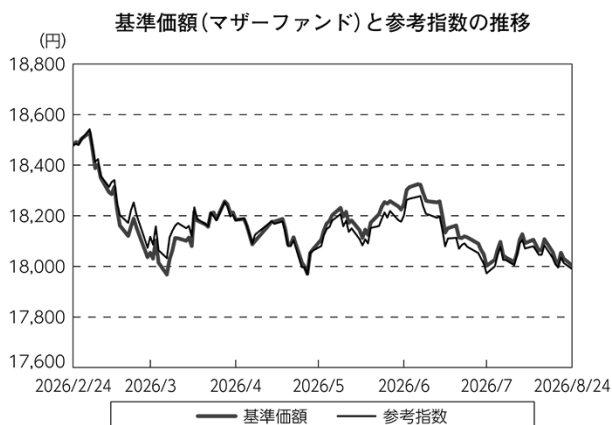
当期の前半については、米国とイスラエルがイランを軍事攻撃し、中東情勢が緊迫する中、原油、天然ガスなどのエネルギー価格の上昇を通じて米国の物価上昇圧力が高まるとの懸念が強まったことから、米国債券市場において国債利回りの上昇基調が続きました。ユーロ圏債券市場においては、一時期、米国とイランの停戦交渉が進むとの期待が高まったものの、中東情勢の緊迫化を背景にエネルギー価格の上昇がサービスを含めた全般的な物価上昇圧力に繋がるとの見方や欧州中央銀行が利上げに動く可能性が意識されたことなどから国債利回りは上昇傾向となりました。

当期の後半については、ホルムズ海峡を巡る不透明感が強まり、エネルギー価格の上昇が米国内の物価上昇に繋がるとの見方や利上げへの警戒感などから米国債券市場において国債利回りは引き続き上昇傾向となりました。ユーロ圏債券市場においては、戦闘終結期待が広がり、一時国債利回りは低下したものの、その後中東を巡る米国とイランの対立が激しさを増すとの見方が広がり、再び物価上昇圧力の高まりや欧州中央銀行による追加利上げが意識されたことから同利回りは上昇基調に転じました。

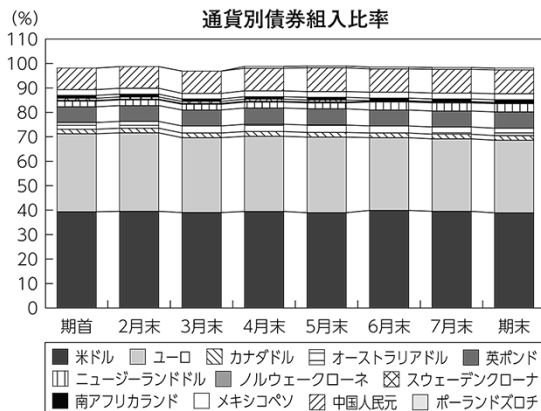
なお、当期の社債市場については、中東情勢の不透明感の強まりを受けて社債のスプレッド（国債との利回り較差）はやや拡大傾向で推移した後、堅調な企業ファンダメンタルズや中東情勢の経済への悪影響に関する過度な警戒感が次第に後退したこと、および旺盛な投資家需要などを背景に同スプレッドは縮小傾向を辿った後、低水準で横ばい推移しました。

○当ファンドのポートフォリオ

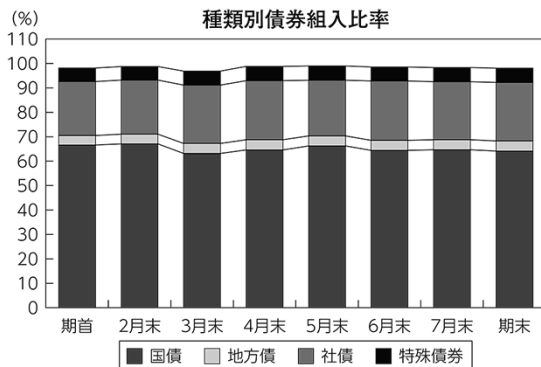
主要投資対象である朝日Nvest グローバル ボンドマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券に投資することにより、実質的な運用をマザーファンドで行っています。マザーファンドは主として日本を除く世界各国の公社債に投資するとともに、外貨建資産の為替リスクを原則ヘッジすることにより、信託財産の長期的成長を図ることを目的としています。



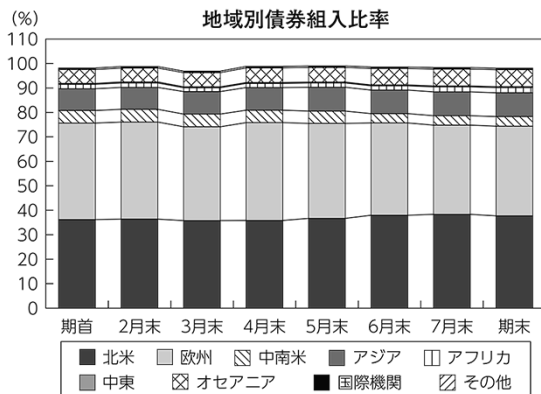
（注）参考指数は、期首の基準価額をもとに指数化したものです。



(注) 純資産総額に対する比率です。



(注) 純資産総額に対する比率です。



(注) 純資産総額に対する比率です。

運用にあたっては、ルーミス・セイレス・アンド・カンパニー・エル・ピー(以下「ルーミス・セイレス社」といいます。)に外貨建資産の運用指図(為替ヘッジ取引の指図を含みます。)に関する権限を委託しています。

ポートフォリオ全体のデュレーション(金利変動に対する債券価格の変動率)は概ね期首と同程度を維持しました。ポートフォリオの平均格付けはA+と期首と同水準を維持しました。また組入銘柄数は期首の126銘柄から期末は135銘柄へ増加しました。

投資国(地域、国際機関を含みます。)数は、期首と同じ24ヵ国となりました。通貨別の組入比率については、主にユーロの組入比率を引き下げ、ニュージーランドドルの組入比率を引き上げました。

当期の売買につきましては、主に国債の比率を引き下げる一方、社債の比率を引き上げました。個別銘柄では、DIAMONDBACK ENERGY(アメリカ、エネルギー)、AIB GROUP(アイルランド、銀行)、SEVERN TRENT(イギリス、水道)などの銘柄を全部売却する一方、CAIXABANK(スペイン、銀行)、ALLIANZ(ドイツ、保険)、VISTRA OPERATIONS(アメリカ、電力)などの銘柄を新規で組み入れました。

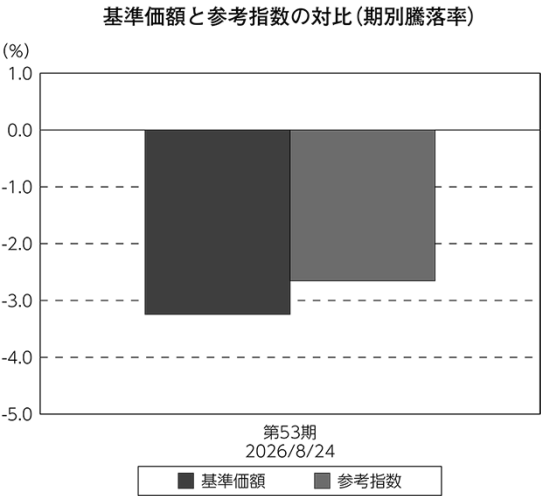
エマージング諸国の債券につきましては、主に中国などの組入比率を引き上げた結果、組入比率は前期末からやや上昇しました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークはありません。

コメントは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。基準価額は分配金再投資ベースです。

参考指数が2.7%下落したのに対し、基準価額は3.2%の下落となり、参考指数を0.6%下回る結果となりました。控除される信託報酬等のコストが主なマイナスの乖離要因となりました。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込み(税込み)です。

○分配金

当期の分配金につきましては、収益分配方針に基づき、基準価額水準などを勘案して、1万口当たり10円とさせていただきました。

なお、収益分配にあてず信託財産内に留保した利益につきましては、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項 目	第53期
	2026年 2 月25日～ 2026年 8 月24日
当期分配金	10
(対基準価額比率)	0.135%
当期の収益	10
当期の収益以外	－
翌期繰越分配対象額	1,666

(注) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益および当期の収益以外は、小数点以下を切捨てて表示しているため、合計した額が当期分配金と一致しない場合があります。

○今後の運用方針

マザーファンドへの投資により、信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。マザーファンドは、引き続き、日本を除く世界各国の国債、地方債および社債等にグローバルな視点から幅広く投資機会を追求し、信託財産の長期的な成長を目指して運用を行っていきます。また、為替変動リスクの低減を図るため、原則として為替ヘッジを行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2026年 2 月25日～2026年 8 月24日)

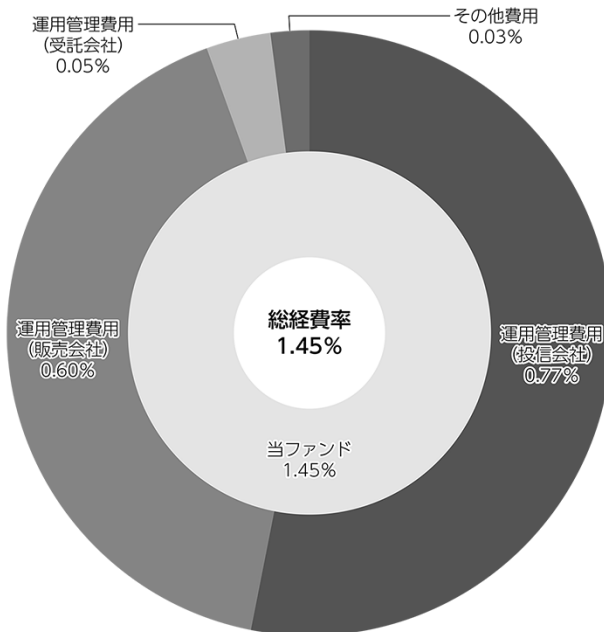
項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 53	% 0.709	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(29)	(0.382)	委託した資金の運用の対価
(販 売 会 社)	(23)	(0.300)	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の 情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(2)	(0.027)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用	1	0.017	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(1)	(0.014)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および 資金の送金・資産の移転等に要する費用です。
(監 査 費 用)	(0)	(0.003)	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です。
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	54	0.726	
期中の平均基準価額は、7,536円です。			

- (注) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含みます。)は、追加・解約により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。
- (注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しています。
- (注) その他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。
- (注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含みます。)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

(参考情報)

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(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除く。)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1.45%です。



(注) 当ファンドの費用は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) 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) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注) 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は異なります。

○売買及び取引の状況

(2026年2月25日～2026年8月24日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
朝日Nvest グローバル ボンドマザーファンド	21,958	40,000	17,692	32,000

○利害関係人との取引状況等

(2026年2月25日～2026年8月24日)

該当事項はございません。

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

(2026年8月24日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
朝日Nvest グローバル ボンドマザーファンド	1,072,923	1,077,189	1,939,372

(注) 親投資信託の当期末の受益権口数は、2,764,899千口です。

○投資信託財産の構成

(2026年8月24日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
朝日Nvest グローバル ボンドマザーファンド	1,939,372	98.0
コール・ローン等、その他	39,486	2.0
投資信託財産総額	1,978,858	100.0

(注) 朝日Nvest グローバル ボンドマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(4,992,621千円)の投資信託財産総額(5,006,067千円)に対する比率は99.7%です。

(注) 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、当期末における邦貨換算レートは1オフショア人民元＝23.6291円、1米ドル＝158.81円、1カナダドル＝115.18円、1メキシコペソ＝9.3872円、1ユーロ＝185.55円、1英ポンド＝216.81円、1スウェーデンクローナ＝16.78円、1ノルウェークローネ＝17.08円、1ポーランドズロチ＝43.0043円、1オーストラリアドル＝113.90円、1ニュージーランドドル＝94.97円、1南アフリカランド＝9.93円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2026年8月24日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,978,858,188
コール・ローン等	39,484,626
朝日Nvest グローバル ボンドマザーファンド(評価額)	1,939,372,643
未収利息	919
(B) 負債	16,711,561
未払収益分配金	2,645,240
未払解約金	36,476
未払信託報酬	13,976,152
その他未払費用	53,693
(C) 純資産総額(A－B)	1,962,146,627
元本	2,645,240,111
次期繰越損益金	△ 683,093,484
(D) 受益権総口数	2,645,240,111口
1万口当たり基準価額(C／D)	7,418円

(注) 期首元本額は2,615,198,999円、期中追加設定元本額は101,353,976円、期中一部解約元本額は71,312,864円です。また、1口当たり純資産額は0.7418円です。

(注) 投資信託財産計算規則第55条の6第10号に規定する額は以下のとおりです。

元本の欠損(当期末)683,093,484円

○損益の状況 (2026年2月25日～2026年8月24日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	98,905
受取利息	98,905
(B) 有価証券売買損益	△ 50,600,529
売買益	639,221
売買損	△ 51,239,750
(C) 信託報酬等	△ 14,029,845
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	△ 64,531,469
(E) 前期繰越損益金	△487,891,126
(F) 追加信託差損益金	△128,025,649
(配当等相当額)	(213,572,769)
(売買損益相当額)	(△341,598,418)
(G) 計(D＋E＋F)	△680,448,244
(H) 収益分配金	△ 2,645,240
次期繰越損益金(G＋H)	△683,093,484
追加信託差損益金	△128,025,649
(配当等相当額)	(213,803,414)
(売買損益相当額)	(△341,829,063)
分配準備積立金	227,116,474
繰越損益金	△782,184,309

(注) (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) (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) 信託財産の運用指図に係る権限の一部を委託するために要した費用として、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対して年1万分の40の率を乗じて得た金額を信託報酬等の中から支弁しています。

(注) (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) 収益分配金の計算過程

項 目	当 期
(a) 配当等収益(経費控除後)	20,934,843円
(b) 有価証券売買等損益(経費控除後)	0円
(c) 収益調整金	213,803,414円
(d) 分配準備積立金	208,826,871円
(e) 分配対象額(a＋b＋c＋d)	443,565,128円
(1万口当たり分配対象額)	(1,676円)
(f) 収益分配金	2,645,240円
(1万口当たり収益分配金)	(10円)

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金（税込み）	10円
-----------------	-----

◇収益分配金のお支払いは、決算日から起算して5営業日までに開始します。

◇収益分配金を再投資する方のお手取り収益分配金は、決算日の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰入れて再投資しました。

◇課税上の取扱い

- ・追加型株式投資信託の収益分配金には、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）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）とがあります。
- ・収益分配金落ち後の基準価額が、当該受益者の個別元本と同額または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。収益分配金落ち後の基準価額が、当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
- ・受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にそ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、その後の当該受益者の個別元本となります。
- ・個人の受益者の普通分配金については、20.315%（所得税15.315%、地方税5%）の税率による源泉徴収が行われ、原則として確定申告の必要はありません。なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除の適用はありません。）または申告分離課税を選択することもできます。
- ・法人の受益者の場合は、税率が異なります。

※上記は、決算日現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

※税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

○お知らせ

- ・「一般社団法人投資信託協会」と「一般社団法人日本投資顧問業協会」が統合し、「一般社団法人資産運用業協会」となったため、投資信託約款に所要の変更を行いました。（2026年4月1日）

当ファンドの仕組みは次のとおりです。

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、信託財産の長期的な成長を目指して、運用を行います。
主要運用対象	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資割合は、純資産総額の20%以下とします。 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	騰落率	参考指数	騰落率	債組入比率	純資産総額
	円	%		%	%	百万円
49期(2024年8月26日)	18,409	1.6	14,901		92.5	5,848
50期(2025年2月25日)	18,061	△1.9	14,560	△2.3	96.4	5,378
51期(2025年8月25日)	18,136	0.4	14,549	△0.1	99.4	5,103
52期(2026年2月24日)	18,480	1.9	14,736	1.3	98.1	5,150
53期(2026年8月24日)	18,004	△2.6	14,345	△2.7	98.1	4,977

(注) 基準価額は1万口当たりの値です。

(注) 債券組入比率には新株予約権付社債(転換社債)を含んでいます。

(注) 参考指数は、FTSE世界国債インデックス(除く日本)をファンドの計理基準に適合するように調整した数値を表示しています。この数値はインデックス構成国の現地通貨ベースのリターン(前営業日)から対顧客電信売買相場の仲値の1ヵ月フォワードレート(当日)に基づくヘッジコストを控除した構成各国の円ヘッジベースのリターンを国別構成比で加重して算出しており、当ファンド設定日の前日を10,000として指数化しています。(以下同じです。)

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	参考指数	騰落率	債組入比率
(期首) 2026年2月24日	円 18,480	% —		% —	% 98.1
2月末	18,504	0.1	14,753	0.1	98.7
3月末	18,029	△2.4	14,445	△2.0	96.9
4月末	18,087	△2.1	14,425	△2.1	98.8
5月末	18,202	△1.5	14,498	△1.6	99.0
6月末	18,323	△0.8	14,575	△1.1	98.6
7月末	18,035	△2.4	14,373	△2.5	98.3
(期末) 2026年8月24日	18,004	△2.6	14,345	△2.7	98.1

(注) 基準価額は1万口当たりの値です。

(注) 騰落率は期首比で計算しています。

(注) 債券組入比率には新株予約権付社債(転換社債)を含んでいます。

○当期の運用経過、今後の運用方針
前述の2～6ページをご覧ください。

○1万口当たりの費用明細 (2026年2月25日～2026年8月24日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 3	% 0.015	(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)	(3)	(0.014)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用です。 信託事務の処理等に関するその他の費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	
合 計	3	0.015	
期中の平均基準価額は、18,196円です。			

(注) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含みます。)は、追加・解約により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。
(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しています。
(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含みます。)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

○売買及び取引の状況

(2026年2月25日～2026年8月24日)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外 国	アメリカ	国債証券	千米ドル 2,773	千米ドル 3,672
		特殊債券	—	—
		社債券（投資法人債券を含む）	1,445	(8) 914
	カナダ	国債証券	千カナダドル 163	千カナダドル 161
		社債券（投資法人債券を含む）	—	—
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	1,156	1,459
		社債券（投資法人債券を含む）	217	101
	イタリア	国債証券	1,037	893
	フランス	国債証券	1,147	1,404
		社債券（投資法人債券を含む）	99	97
	オランダ	社債券（投資法人債券を含む）	99	—
	スペイン	国債証券	842	1,010
	ベルギー	国債証券	—	23
	アイルランド	国債証券	—	140
	その他	国債証券	200	—
		社債券（投資法人債券を含む）	235	613
	イギリス	国債証券	千英ポンド 253	千英ポンド 329
		社債券（投資法人債券を含む）	98	—
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ —	千スウェーデンクローナ 1,809
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 838	千ポーランドズロチ —
	ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランドドル 508	千ニュージーランドドル —
		国債証券	—	—
	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 731
	中国オフショア	国債証券	千オフショア人民元 5,587	千オフショア人民元 5,492

(注) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれていません。)
(注) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれていません。
(注) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれていません。

○利害関係人との取引状況等

(2026年2月25日～2026年8月24日)

該当事項はございません。

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

(2026年8月24日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

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
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	13,873	12,191	1,936,142	38.9	1.5	25.8	10.3	2.9
カナダ	千カナダドル 948	千カナダドル 816	94,053	1.9	—	1.5	0.3	—
メキシコ	千メキシコペソ 14,042	千メキシコペソ 12,985	121,897	2.4	—	2.4	—	—
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	633	547	101,538	2.0	—	1.7	—	0.3
イタリア	2,049	2,011	373,165	7.5	—	4.5	3.0	—
フランス	1,624	1,417	262,968	5.3	—	5.3	—	—
オランダ	400	378	70,182	1.4	—	1.0	0.4	—
スペイン	2,062	1,921	356,612	7.2	—	4.6	1.8	0.8
ベルギー	174	164	30,513	0.6	—	0.6	—	—
その他	1,583	1,528	283,666	5.7	0.4	2.8	2.9	—
イギリス	千英ポンド 1,656	千英ポンド 1,527	331,177	6.7	—	3.7	1.4	1.6
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 720	千スウェーデンクローナ 639	10,736	0.2	—	—	0.2	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 1,140	千ノルウェークローネ 1,014	17,329	0.3	—	—	0.3	—
ポーランド	千ポーランドズロチ 882	千ポーランドズロチ 830	35,716	0.7	—	0.7	—	—
オーストラリア	千オーストラリアドル 1,359	千オーストラリアドル 1,315	149,791	3.0	—	—	0.8	2.2
ニュージーランド	千ニュージーランドドル 1,876	千ニュージーランドドル 1,775	168,634	3.4	—	3.4	—	—
南アフリカ	千南アフリカランド 5,267	千南アフリカランド 5,368	53,306	1.1	1.1	1.1	—	—
中国オフショア	千オフショア人民元 19,740	千オフショア人民元 20,503	484,472	9.7	—	6.9	2.8	—
合 計	—	—	4,881,905	98.1	2.9	66.0	24.3	7.7

(注) 評価額(邦貨換算金額)は、期末の評価額(外貨建金額)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) 組入比率は、純資産総額に対する評価額(邦貨換算金額)の割合です。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(注) 無格付は最低格付とみなしてBB格以下に含めて計算しています。

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄			当 期 末				
			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			%	千米ドル	千米ドル	千円	
アメリカ	国債証券	SOUTH AFRICA GOVT	7. 1	200	212	33, 764	2036/11/19
		US TREASURY BOND	1. 75	1, 599	1, 036	164, 642	2041/ 8 /15
		US TREASURY BOND	2. 875	60	44	7, 053	2043/ 5 /15
		US TREASURY BOND	1. 25	1, 190	536	85, 171	2050/ 5 /15
		US TREASURY BOND	4. 25	432	366	58, 142	2054/ 8 /15
		US TREASURY BOND	4. 75	60	55	8, 772	2055/ 8 /15
		US TREASURY NOTE	0. 75	202	192	30, 562	2028/ 1 /31
		US TREASURY NOTE	2. 375	584	555	88, 211	2029/ 5 /15
		US TREASURY NOTE	3. 75	1, 903	1, 861	295, 592	2030/ 6 /30
		US TREASURY NOTE	2. 75	259	235	37, 384	2032/ 8 /15
		US TREASURY NOTE	4. 25	215	211	33, 583	2033/ 3 /31
		US TREASURY NOTE	4. 375	1, 752	1, 704	270, 714	2036/ 5 /15
	特殊債券 (除く金融債)	FHMS K074 A2CMBS	3. 6	709	701	111, 368	2028/ 1 /25
		INTERAMER DEV BK	4. 5	185	185	29, 521	2030/ 2 /15
	普通社債券 (含む投資法人横券)	AKER BP ASA	4. 0	160	152	24, 296	2031/ 1 /15
		AT&T INC	5. 125	48	45	7, 258	2036/ 4 /30
		AT&T INC	3. 65	92	58	9, 309	2051/ 6 / 1
		BEIGNET INVESTOR LLC	6. 581	113	108	17, 239	2049/ 5 /30
		BOEING CO	6. 528	50	53	8, 479	2034/ 5 / 1
		BOEING CO	5. 805	120	112	17, 851	2050/ 5 / 1
		BROADCOM INC	2. 45	65	57	9, 147	2031/ 2 /15
		BROADCOM INC	5. 15	190	188	29, 884	2031/11/15
		BROADCOM INC	3. 419	45	39	6, 260	2033/ 4 /15
		BROADCOM INC	4. 8	45	42	6, 677	2034/10/15
		BROADCOM INC	4. 95	15	13	2, 203	2036/ 1 /15
		BROADCOM INC	4. 8	10	9	1, 453	2036/ 2 /15
		CAIXABANK SA	5. 402	239	231	36, 797	2037/ 4 /22
		CIVITAS RESOURCES INC	8. 625	10	10	1, 673	2030/11/ 1
		CIVITAS RESOURCES INC	8. 75	110	115	18, 291	2031/ 7 / 1
		CMDC 2025-1A A2ABS	5. 656	35	35	5, 561	2050/ 2 /25
		CMDC 2025-3A A2ABS	5. 286	60	58	9, 360	2050/ 7 /25
		CONTINENTAL RES	5. 75	113	114	18, 251	2031/ 1 /15
		CONTINENTAL RES	2. 875	80	70	11, 131	2032/ 4 / 1
		CVS HEALTH CORP	5. 625	38	34	5, 404	2053/ 2 /21
		CVS HEALTH CORP	5. 875	29	26	4, 257	2053/ 6 / 1
		CVS HEALTH CORP	6. 05	73	69	10, 968	2054/ 6 / 1
		CYRUS 2025-1A A2ABS	5. 91	60	60	9, 576	2050/ 2 /20
		DEUTSCHE BANK NY	4. 999	150	149	23, 764	2030/ 9 /11
		ENERGY TRANSFER LP	6. 3	42	40	6, 427	2056/ 1 /15
		FOUNDRY JV HOLDCO LLC	6. 2	200	205	32, 573	2037/ 1 /25
		GLENCORE FUNDING LLC	2. 5	22	19	3, 172	2030/ 9 / 1
		GLENCORE FUNDING LLC	2. 625	80	70	11, 258	2031/ 9 /23
		GLENCORE FUNDING LLC	6. 5	65	68	10, 939	2033/10/ 6
		GLENCORE FUNDING LLC	5. 673	20	20	3, 187	2035/ 4 / 1
		GSKY 2026-A A2ABS	5. 26	100	100	15, 902	2070/12/15
		HCA INC	3. 5	85	53	8, 575	2051/ 7 /15

銘 柄			当 期 末				
			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			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	普通社債券 (含む投資法人債券)	HCA INC	4.625	74	56	9,036	2052/3/15
		HCA INC	5.7	85	76	12,109	2055/11/15
		HYPER 2025-1A A2ABS	5.18	80	77	12,285	2055/9/27
		JPMORGAN CHASE & CO	5.193	39	37	5,942	2037/2/5
		MORGAN STANLEY	4.809	121	118	18,873	2032/4/16
		MORGAN STANLEY	5.605	62	61	9,768	2037/7/17
		NAVTR 2021-1 AABS	2.771	151	144	22,907	2046/11/15
		NVIDIA CORP	4.75	81	78	12,447	2033/6/15
		NVIDIA CORP	5.55	80	73	11,600	2046/6/15
		NVIDIA CORP	5.625	73	65	10,335	2056/6/15
		OVINTIV INC	7.375	9	9	1,563	2031/11/1
		OVINTIV INC	6.25	47	49	7,792	2033/7/15
		OVINTIV INC	6.5	95	100	15,937	2034/8/15
		RWE FINANCE US LLC	5.125	150	143	22,742	2035/9/18
		SM ENERGY CO	7.0	125	127	20,310	2032/8/1
		STEEL DYNAMICS	5.25	22	21	3,430	2035/5/15
		T-MOBILE USA INC	3.4	97	59	9,402	2052/10/15
		UNITEDHEALTH GROUP INC	5.0	13	12	2,023	2034/4/15
		UNITEDHEALTH GROUP INC	5.15	46	45	7,219	2034/7/15
		UNITEDHEALTH GROUP INC	5.375	5	4	706	2054/4/15
		UNITEDHEALTH GROUP INC	5.625	45	41	6,580	2054/7/15
		VISTRA OPERATIONS CO LLC	5.25	16	15	2,417	2035/10/15
		VISTRA OPERATIONS CO LLC	5.35	89	84	13,484	2036/1/31
		VISTRA OPERATIONS CO LLC	5.55	93	90	14,305	2036/4/30
WILLIAMS COS INC	5.15	60	57	9,148	2036/3/15		
ZURICH FINANCE IRELAND	6.25	200	202	32,146	2055/11/22		
小 計						1,936,142	
カナダ				千カナダドル	千カナダドル		
	国債証券 地方債証券 普通社債券 (含む投資法人債券)	CANADA GOVT	2.75	196	149	17,174	2055/12/1
		ONTARIO PROVINCE	4.05	390	398	45,892	2032/2/2
		ONTARIO PROVINCE	1.9	215	121	14,005	2051/12/2
		FASTR 2025-AA A2ABS	3.28	147	147	16,981	2029/11/15
小 計						94,053	
メキシコ				千メキシコペソ	千メキシコペソ		
	国債証券	MEXICAN BONOS	8.0	14,042	12,985	121,897	2036/2/21
小 計						121,897	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	2.5	82	81	15,124	2028/6/14
		DEUTSCHLAND REP	—	137	52	9,752	2052/8/15
	普通社債券 (含む投資法人債券)	ALLIANZ SE	4.851	100	103	19,163	2054/7/26
		COMMERZBANK AG	3.75	100	98	18,185	2034/6/6
		COMMERZBANK AG	3.875	100	96	17,972	2037/3/3
		DEUTSCHE BANK AG	4.5	100	102	18,940	2035/7/12
		DEUTSCHE TELEKOM AG	3.25	4	3	709	2035/6/4
		DEUTSCHE TELEKOM AG	3.25	5	4	876	2036/3/20
		DEUTSCHE TELEKOM AG	3.625	5	4	815	2045/2/3

銘柄			当 期 末				
			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			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	BTPS	3. 15	826	816	151,455	2031/ 6 / 1
		BTPS	3. 65	1,187	1,161	215,446	2035/ 8 / 1
		BTPS	4. 1	36	33	6,262	2046/ 4 /30
フランス	国債証券	FRANCE O. A. T.	3. 7	1,175	1,135	210,608	2036/11/25
		FRANCE O. A. T.	0. 5	59	35	6,623	2040/ 5 /25
		FRANCE O. A. T.	0. 5	290	147	27,378	2044/ 6 /25
	普通社債券 (含む投資法人債券)	AXA SA	4. 375	100	98	18,358	2055/ 7 /24
オランダ	普通社債券 (含む投資法人債券)	ING GROEP NV	4. 25	100	99	18,432	2038/ 5 /18
		RABOBANK	1. 25	200	178	33,199	2032/ 5 /31
		TEVA PHARM FIN IV BV	4. 125	100	99	18,550	2031/ 6 / 1
スペイン	国債証券	SPAIN GOVT	1. 25	358	332	61,690	2030/10/31
		SPAIN GOVT	3. 4	859	837	155,332	2036/10/31
		SPAIN GOVT	2. 7	175	136	25,365	2048/10/31
	地方債証券	COMUNIDAD MADRID	4. 3	220	219	40,807	2026/ 9 /15
		COMUNIDAD MADRID	2. 398	150	143	26,685	2031/ 6 / 2
	普通社債券 (含む投資法人債券)	BANCO SANTANDER SA	0. 1	300	251	46,731	2032/ 2 /27
ベルギー	国債証券	BELGIUM GOVT	3. 1	174	164	30,513	2035/ 6 /22
その他	国債証券	BRAZIL REP OF	4. 875	100	98	18,209	2033/ 4 /23
		MEXICAN UTD STS	2. 375	310	296	54,954	2030/ 2 /11
		MOROCCO GOVT	4. 75	100	100	18,557	2035/ 4 / 2
		ROMANIA GOVT	6. 125	105	104	19,311	2037/10/ 7
	普通社債券 (含む投資法人債券)	CHANNEL LINK ENT	2. 706	125	124	23,036	2050/ 6 /30
		DNB BANK ASA	3. 125	138	135	25,080	2031/ 5 /20
		NATL GRID ELECT TRAN PLC	3. 563	100	97	18,036	2034/ 2 / 3
		SPAREBANK 1 BOKR	0. 05	375	351	65,194	2028/11/ 3
		UBS GROUP AG	2. 875	130	125	23,203	2032/ 4 / 2
UNITED UTIL WATER FIN	3. 75	100	97	18,081	2034/ 5 /23		
小 計						1,478,647	
イギリス				千英ポンド	千英ポンド		
	国債証券	UK TREASURY	4. 375	211	210	45,540	2030/ 3 / 7
		UK TREASURY	4. 375	565	452	98,206	2054/ 7 /31
	地方債証券	ONTARIO PROVINCE	0. 25	370	365	79,317	2026/12/15
	普通社債券 (含む投資法人債券)	ANGLIAN WATER OSPREY FIN	6. 75	100	99	21,572	2031/ 8 /27
		ANGLIAN WATER SERV FIN	6. 25	100	93	20,278	2041/11/10
		INTESA SANPAOLO SPA	5. 148	110	108	23,518	2030/ 6 /10
		SOCIETE GENERALE SA	5. 75	100	100	21,705	2032/ 1 /22
UNITED UTIL WATER FIN	5. 75	100	97	21,036	2036/ 6 /26		
小 計						331,177	
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		
	国債証券	SWEDEN GOVT	0. 125	720	639	10,736	2031/ 5 /12
小 計						10,736	
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		
	国債証券	NORWEGIAN GOVT	1. 375	1,140	1,014	17,329	2030/ 8 /19
小 計						17,329	

銘 柄	当 期 末				
	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	
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	
国債証券 POLAND GOVT	5. 0	882	830	35, 716	2035/10/25
小 計				35, 716	
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		
特殊債券 NEW SOUTH WALES TREASURY	3. 0	395	368	42, 025	2030/ 2 /20
(除く金融債) QUEENSLAND TREASURY CORP	2. 75	964	946	107, 766	2027/ 8 /20
小 計				149, 791	
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		
国債証券 NEW ZEALAND GOVT	3. 5	1, 876	1, 775	168, 634	2033/ 4 /14
小 計				168, 634	
南アフリカ		千南アフリカランド	千南アフリカランド		
国債証券 SOUTH AFRICA GOVT	8. 875	5, 267	5, 368	53, 306	2035/ 2 /28
小 計				53, 306	
中国オフショア		千オフショア人民元	千オフショア人民元		
国債証券 CHINA GOVERNMENT BOND	2. 55	930	956	22, 606	2028/10/15
CHINA GOVERNMENT BOND	2. 37	4, 780	4, 910	116, 036	2029/ 1 /15
CHINA GOVERNMENT BOND	2. 69	1, 850	1, 979	46, 765	2032/ 8 /15
CHINA GOVERNMENT BOND	2. 88	5, 360	5, 846	138, 150	2033/ 2 /25
CHINA GOVERNMENT BOND	2. 27	2, 340	2, 466	58, 291	2034/ 5 /25
CHINA GOVERNMENT BOND	1. 83	1, 260	1, 278	30, 208	2035/ 8 /25
CHINA GOVERNMENT BOND	1. 92	3, 220	3, 064	72, 413	2055/ 1 /15
小 計				484, 472	
合 計				4, 881, 905	

(注) 評価額(邦貨換算金額)は、期末の評価額(外貨建金額)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) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等によりデータを入手しています。

○投資信託財産の構成

(2026年 8 月24日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	4, 881, 905	97. 5
コール・ローン等、その他	124, 162	2. 5
投資信託財産総額	5, 006, 067	100. 0

(注) 当期末における外貨建純資産(4, 992, 621千円)の投資信託財産総額(5, 006, 067千円)に対する比率は99. 7%です。

(注) 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、当期末における邦貨換算レートは1オフショア人民元＝23. 6291円、1米ドル＝158. 81円、1カナダドル＝115. 18円、1メキシコペソ＝9. 3872円、1ユーロ＝185. 55円、1英ポンド＝216. 81円、1スウェーデンクローナ＝16. 78円、1ノルウェークローネ＝17. 08円、1ポーランドズロチ＝43. 0043円、1オーストラリアドル＝113. 90円、1ニュージーランドドル＝94. 97円、1南アフリカランド＝9. 93円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2026年8月24日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	9,940,697,254
コール・ローン等	61,056,665
公社債(評価額)	4,881,905,635
未収入金	4,941,448,994
未収利息	44,544,059
前払費用	11,741,901
(B) 負債	4,962,853,363
未払金	4,962,853,363
(C) 純資産総額(A－B)	4,977,843,891
元本	2,764,899,206
次期繰越損益金	2,212,944,685
(D) 受益権総口数	2,764,899,206口
1万口当たり基準価額(C／D)	18,004円

(注) 期首元本額は2,786,976,605円、期中追加設定元本額は38,655,068円、期中一部解約元本額は60,732,467円です。また、1口当たり純資産額は1.8004円です。

(注) 当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は、【元本の内訳】の通りです。

【元本の内訳】

ALAMCO 年金グローバル ボンドファンド(適格機関投資家専用) 1,687,709,335円
ルミス グローバル ボンドファンド(為替ヘッジあり・年2回決算型) 1,077,189,871円

○損益の状況 (2026年2月25日～2026年8月24日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	90,392,550
受取利息	90,355,519
その他収益金	37,031
(B) 有価証券売買損益	△ 222,054,220
売買益	215,564,084
売買損	△ 437,618,304
(C) 保管費用等	△ 739,504
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	△ 132,401,174
(E) 前期繰越損益金	2,363,268,460
(F) 追加信託差損益金	31,344,932
(G) 解約差損益金	△ 49,267,533
(H) 計(D＋E＋F＋G)	2,212,944,685
次期繰越損益金(H)	2,212,944,685

(注) (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) (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) (G)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。

○お知らせ

- ・「一般社団法人投資信託協会」と「一般社団法人日本投資顧問業協会」が統合し、「一般社団法人資産運用業協会」となったため、投資信託約款に所要の変更を行いました。(2026年4月1日)