

## 運用報告書 (全体版)

### ルーミス米国投資適格債券ファンド [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	2003年10月31日から無期限です。	
運用方針	主として米国の米ドル建て公社債に投資を行い、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	ルーミス米国投資適格債券ファンド 【毎月決算型】	ルーミス米国投資適格債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	ルーミス米国投資適格債券マザーファンド	主として米国の米ドル建て公社債を主要投資対象とします。
運用方法	<p>投資を行う公社債の格付けについては、原則として取得時においてBBB-（Baa3）格以上の格付けを有する公社債に投資を行うとともに、ファンド全体の加重平均格付けをA-（A3）格以上に維持します。</p> <p>格付けは、S&amp;Pグローバル・レーティング（S&amp;P社）もしくはムーディーズ・インベスターズ・サービス（Moody's社）による格付けを基準とします。</p> <p>※「加重平均格付け」とは、各組入公社債等の格付けを、それぞれの公社債等の組入比率に応じて加重平均して算出した格付けであり、ファンドにかかる信用格付けではありません。</p> <p>実質組入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。公社債の組入比率は、高位に保つことを基本とします。</p> <p>ルーミス米国投資適格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	ルーミス米国投資適格債券ファンド 【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。
	ルーミス米国投資適格債券マザーファンド	外貨建資産への投資には制限を設けません。
分配方針	<p>第3期以降の毎期、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、売買益については、原則として毎年6月および12月の決算時に分配を行います。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247期	<決算日	2024年5月20日>
第248期	<決算日	2024年6月20日>
第249期	<決算日	2024年7月22日>
第250期	<決算日	2024年8月20日>
第251期	<決算日	2024年9月20日>
第252期	<決算日	2024年10月21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、「ルーミス米国投資適格債券ファンド [毎月決算型]」は、2024年10月21日に第252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

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

# ルームス米国投資適格債券ファンド [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・米国政府/クレジット指数		為替		債券組比率	債券利率	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	(為替ノーヘッジ・円ベース) (参考指数)	期中騰落率	(対米ドル)	期中騰落率				
第38作成期	223期(2022年5月20日)	円 8,300	円 15	% △2.2	487.09	% △1.6	円 127.85	% △1.2	% 95.4	% -	百万円 4,904	
	224期(2022年6月20日)	8,575	15	3.5	507.19	4.1	135.25	5.8	95.9	-	5,384	
	225期(2022年7月20日)	8,816	15	3.0	522.65	3.0	138.17	2.2	95.3	-	5,969	
	226期(2022年8月22日)	8,788	15	△0.1	522.19	△0.1	137.17	△0.7	96.2	-	6,503	
	227期(2022年9月20日)	8,900	15	1.4	530.42	1.6	143.28	4.5	94.3	-	7,268	
	228期(2022年10月20日)	8,888	15	0.0	531.78	0.3	149.98	4.7	95.5	-	8,108	
第39作成期	229期(2022年11月21日)	8,558	15	△3.5	510.56	△4.0	140.36	△6.4	95.8	-	8,450	
	230期(2022年12月20日)	8,390	15	△1.8	511.67	0.2	134.54	△4.1	96.0	-	8,671	
	231期(2023年1月20日)	8,177	15	△2.4	488.39	△4.5	128.71	△4.3	93.9	-	9,490	
	232期(2023年2月20日)	8,299	15	1.7	499.01	2.2	134.45	4.5	95.6	-	11,568	
	233期(2023年3月20日)	8,336	15	0.6	500.07	0.2	132.68	△1.3	96.6	-	12,600	
	234期(2023年4月20日)	8,429	15	1.3	508.81	1.7	134.92	1.7	95.8	-	16,087	
第40作成期	235期(2023年5月22日)	8,489	15	0.9	520.09	2.2	137.72	2.1	96.1	-	20,395	
	236期(2023年6月20日)	8,763	15	3.4	532.30	2.3	142.23	3.3	95.1	-	26,378	
	237期(2023年7月20日)	8,656	15	△1.0	528.92	△0.6	139.70	△1.8	95.9	-	30,584	
	238期(2023年8月21日)	8,680	15	0.5	536.11	1.4	145.33	4.0	96.9	-	35,108	
	239期(2023年9月20日)	8,789	15	1.4	545.06	1.7	147.84	1.7	97.1	-	38,286	
	240期(2023年10月20日)	8,516	15	△2.9	535.92	△1.7	149.96	1.4	96.2	-	39,777	
第41作成期	241期(2023年11月20日)	8,892	15	4.6	555.07	3.6	149.95	△0.0	96.5	-	45,585	
	242期(2023年12月20日)	8,943	15	0.7	556.36	0.2	144.03	△3.9	96.6	-	50,293	
	243期(2024年1月22日)	9,096	15	1.9	568.55	2.2	148.20	2.9	96.7	-	54,870	
	244期(2024年2月20日)	9,151	15	0.8	572.87	0.8	150.38	1.5	96.8	-	58,181	
	245期(2024年3月21日)	9,214	15	0.9	582.01	1.6	150.79	0.3	97.5	-	60,621	
	246期(2024年4月22日)	9,265	15	0.7	583.81	0.3	154.80	2.7	97.0	-	63,326	
第42作成期	247期(2024年5月20日)	9,495	15	2.6	596.55	2.2	155.91	0.7	97.9	-	66,781	
	248期(2024年6月20日)	9,775	15	3.1	615.08	3.1	158.16	1.4	97.5	-	72,637	
	249期(2024年7月22日)	9,745	15	△0.2	614.96	△0.0	157.54	△0.4	97.6	-	74,764	
	250期(2024年8月20日)	9,291	15	△4.5	586.64	△4.6	146.45	△7.0	97.6	-	73,059	
	251期(2024年9月20日)	9,190	15	△0.9	582.10	△0.8	142.76	△2.5	98.1	-	74,465	
	252期(2024年10月21日)	9,442	15	2.9	599.22	2.9	149.43	4.7	97.7	-	78,239	

(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・米国政府/クレジット指数(為替ノーヘッジ・円ベース)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・米国政府/クレジット指数(為替ノーヘッジ・円ベース)は、Bloomberg Finance L.P.および、同インデックスの管理者であるBloomberg Index Services Limited(以下「BISL」)をはじめとする関連会社(以下、総称して「ブルームバーグ」)のサービスマークであり、アセットマネジメントOne(株)による特定の目的での使用のために使用許諾されています。ブルームバーグはアセットマネジメントOne(株)とは提携しておらず、また、ルームス米国投資適格債券ファンド[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、ルームス米国投資適格債券ファンド[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・米国政府/クレジット指数 (為替ノーヘッジ・円ベース) (参考指数)		為替		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率	騰落率	(対米ドル)	騰落率				
第247期	(期首) 2024年4月22日	円	%	583.81	%	円	%	%	%
	4月末	9,265	-	583.81	-	154.80	-	97.0	-
	(期末) 2024年5月20日	9,413	1.6	592.87	1.6	156.90	1.4	97.8	-
第248期	(期首) 2024年5月20日	9,510	2.6	596.55	2.2	155.91	0.7	97.9	-
	5月末	9,495	-	596.55	-	155.91	-	97.9	-
	(期末) 2024年6月20日	9,482	△0.1	597.71	0.2	156.74	0.5	98.1	-
第249期	(期首) 2024年6月20日	9,790	3.1	615.08	3.1	158.16	1.4	97.5	-
	6月末	9,775	-	615.08	-	158.16	-	97.5	-
	(期末) 2024年7月22日	9,904	1.3	623.27	1.3	161.07	1.8	97.4	-
第250期	(期首) 2024年7月22日	9,760	△0.2	614.96	△0.0	157.54	△0.4	97.6	-
	7月末	9,745	-	614.96	-	157.54	-	97.6	-
	(期末) 2024年8月20日	9,481	△2.7	607.69	△1.2	152.44	△3.2	98.0	-
第251期	(期首) 2024年8月20日	9,306	△4.5	586.64	△4.6	146.45	△7.0	97.6	-
	8月末	9,291	-	586.64	-	146.45	-	97.6	-
	(期末) 2024年9月20日	9,203	△0.9	583.89	△0.5	144.80	△1.1	97.5	-
第252期	(期首) 2024年9月20日	9,205	△0.9	582.10	△0.8	142.76	△2.5	98.1	-
	9月末	9,190	-	582.10	-	142.76	-	98.1	-
	(期末) 2024年10月21日	9,181	△0.1	581.51	△0.1	142.73	△0.0	97.8	-
		9,457	2.9	599.22	2.9	149.43	4.7	97.7	-

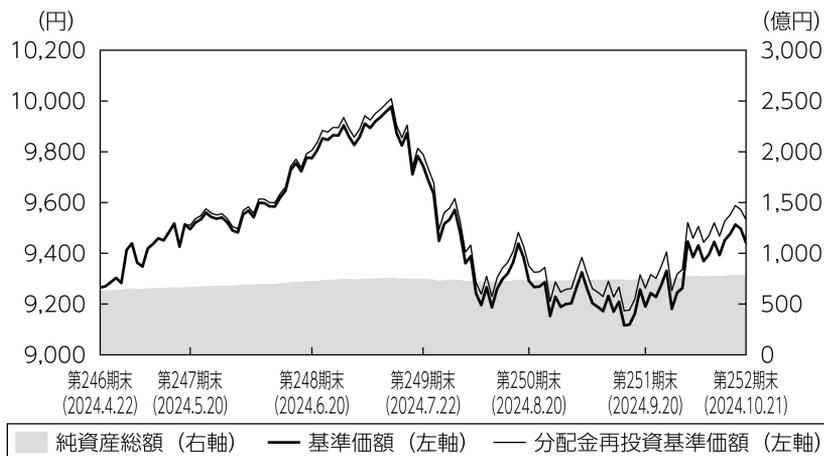
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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247期～第252期の運用経過（2024年4月23日から2024年10月21日まで）

### 基準価額等の推移



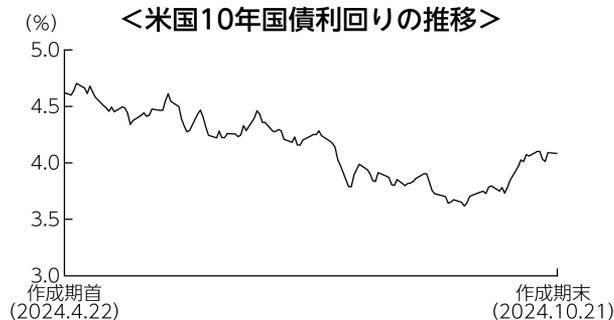
第247期首： 9,265円  
第252期末： 9,442円  
(既払分配金90円)  
騰落率： 2.9%  
(分配金再投資ベース)

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

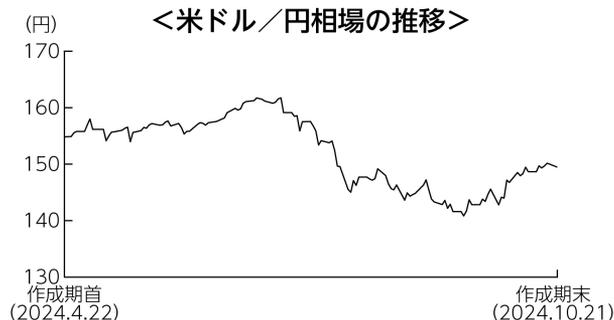
### 基準価額の主な変動要因

「ルーミス米国投資適格債券マザーファンド」受益証券への投資を通じて、米国の米ドル建て投資適格債券に投資を行った結果、社債市場が堅調に推移したことなどから、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



(注) 値は前営業日のものを用いています。



米国国債市場は上昇（利回りは低下）しました。作成期初から9月中旬は、米国の雇用統計やインフレ指標の軟化、9月のF R B（米連邦準備理事会）による0.5%の大幅利下げなどから上昇しました。その後は、経済指標の上振れなどが下落要因となりましたが、作成期を通じては上昇しました。

米国の投資適格社債市場も上昇しました。米国国債利回りの低下に加えて、銀行やR E I Tセクターを中心に信用スプレッドが縮小したことが上昇要因となりました。

米ドルは対円で下落しました。

7月上旬にかけては、日銀が金融政策の現状維持を決定したことなどから上昇しましたが、その後は米国の軟調な経済指標とF R Bによる利下げ観測の高まりを受けて下落しました。9月には大幅利下げが実施され一段と下落しましたが、作成期末にかけては米国経済指標の上振れにより市場の利下げ前倒し観測が後退し、下落幅を一部縮小しました。

## ポートフォリオについて

### ●当ファンド

「ルーミス米国投資適格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。

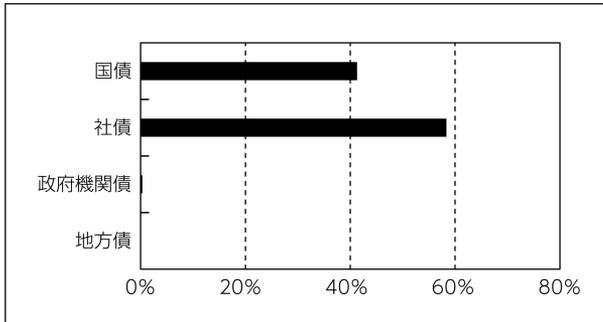
### ●ルーミス米国投資適格債券マザーファンド

米国の米ドル建て投資適格債券に投資を行い、個別銘柄の選別により分散されたポートフォリオの構築を行いました。当作成期末時点における債券の組入比率は、国債を4割程度、普通社債を6割程度とし、組入比率を高位に維持しました。ファンド全体の加重平均格付<sup>(\*)</sup>については、当ファンドの運用の基本方針に従い、A格以上を維持しました。上記の通り運用を行った結果、社債市場が堅調に推移したことなどから基準価額は上昇しました。

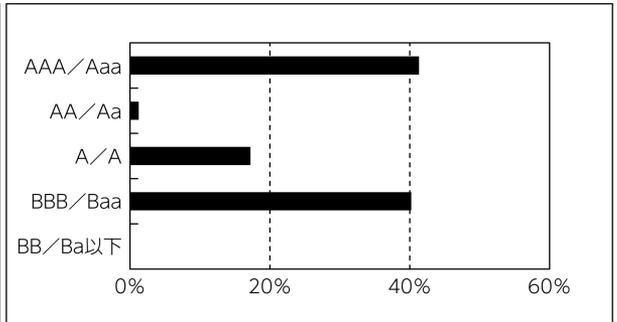
(\*)「当ファンドの概要」をご参照ください。

### 作成期末

#### 【種別保有比率】



#### 【格付別保有比率】



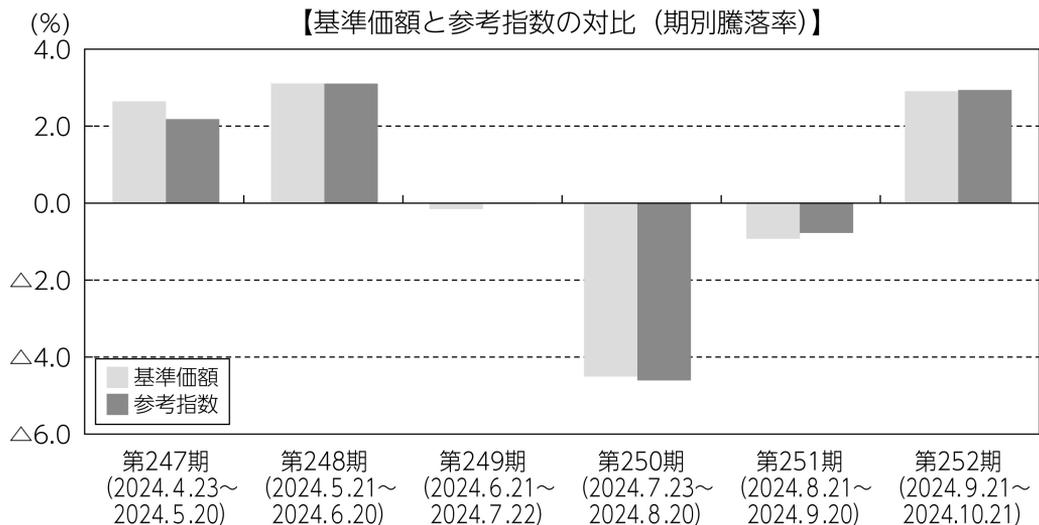
(注) 比率はルーミス米国投資適格債券マザーファンドの債券部分を100%として算出したものを用いています。

(注1) 比率はルーミス米国投資適格債券マザーファンドの債券部分を100%として算出したものを用いています。

(注2) 格付はS & P、Moody'sの高いほう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247期	第248期	第249期	第250期	第251期	第252期
	2024年4月23日 ～2024年5月20日	2024年5月21日 ～2024年6月20日	2024年6月21日 ～2024年7月22日	2024年7月23日 ～2024年8月20日	2024年8月21日 ～2024年9月20日	2024年9月21日 ～2024年10月21日
当期分配金（税引前）	15円	15円	15円	15円	15円	15円
対基準価額比率	0.16%	0.15%	0.15%	0.16%	0.16%	0.16%
当期の収益	15円	15円	15円	15円	15円	15円
当期の収益以外	-円	-円	-円	-円	-円	-円
翌期繰越分配対象額	1,152円	1,427円	1,442円	1,453円	1,464円	1,483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

「ルーミス米国投資適格債券マザーファンド」収益証券の組入比率を高位に維持する方針です。

### ●ルーミス米国投資適格債券マザーファンド

米国は、9月のFOMC（米連邦公開市場委員会）で利下げが開始されました。今後も追加利下げの実施が見込まれるものの、FRBは各種経済指標を見極めながら、追加利下げのペースを慎重に検討することが予想されます。

引き続き発行体のクオリティを重視しつつ米国の米ドル建て投資適格債券に投資を行い、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。

## ■ 1 万口当たりの費用明細

項目	第247期～第252期 (2024年4月23日 ～2024年10月21日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	44円	
(投信会社)	(23)	(0.247)	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)	(18)	(0.192)	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)	( 3)	(0.027)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) その他費用	1	0.014	(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)	(0.013)	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	45	0.479	

(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。

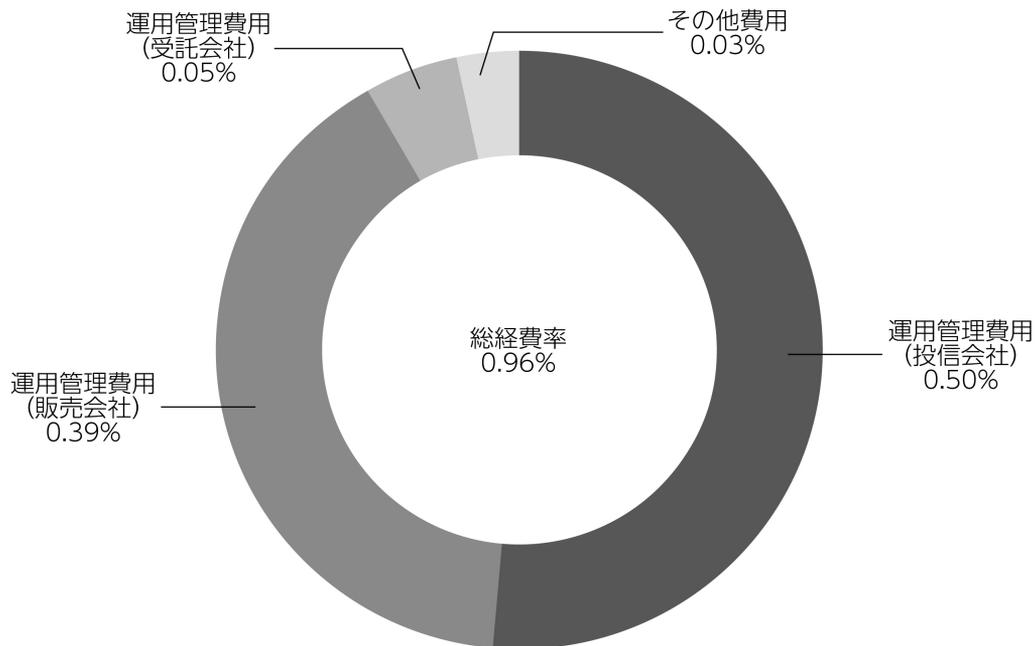
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.96%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4月23日から2024年10月21日まで）

	第 247 期 ~ 第 252 期			
	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
ルーミス米国投資適格債券マザーファンド	千□ 4,112,970	千円 12,830,000	千□ -	千円 -

■利害関係人との取引状況等（2024年4月23日から2024年10月21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41作成期末	第42作成期末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
ルーミス米国投資適格債券マザーファンド	千□ 20,703,724	千□ 24,816,695	千円 77,725,890

## ■投資信託財産の構成

2024年10月21日現在

項 目	第42作成期末	
	評 価 額	比 率
ルーミス米国投資適格債券マザーファンド	千円 77,725,890	% 99.1
コール・ローン等、その他	739,115	0.9
投資信託財産総額	78,465,005	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) 期末のルーミス米国投資適格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、95,311,785千円、100.0％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10月21日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=149.43円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年5月20日)、 (2024年6月20日)、 (2024年7月22日)、 (2024年8月20日)、 (2024年9月20日)、 (2024年10月21日)現在

項 目	第247期末	第248期末	第249期末	第250期末	第251期末	第252期末
<b>(A) 資 産</b>	<b>66,949,936,134円</b>	<b>72,978,217,484円</b>	<b>74,967,596,424円</b>	<b>73,269,960,754円</b>	<b>74,720,270,104円</b>	<b>78,465,005,315円</b>
コール・ローン等	495,481,126	591,228,494	383,928,539	327,293,762	612,371,714	739,115,248
ルーミス米国投資適格債券マザーファンド(評価額)	66,454,455,008	72,386,988,990	74,583,667,885	72,942,666,992	74,107,898,390	77,725,890,067
<b>(B) 負 債</b>	<b>168,920,228</b>	<b>341,111,388</b>	<b>202,769,550</b>	<b>210,590,840</b>	<b>254,597,370</b>	<b>225,827,242</b>
未払収益分配金	105,494,586	111,459,234	115,078,037	117,948,891	121,547,897	124,290,610
未払解約金	16,575,083	174,468,057	26,382,030	38,156,695	74,312,141	40,433,289
未払信託報酬	46,732,180	55,046,617	61,159,146	54,351,097	58,592,969	60,954,391
その他未払費用	118,379	137,480	150,337	134,157	144,363	148,952
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>66,781,015,906</b>	<b>72,637,106,096</b>	<b>74,764,826,874</b>	<b>73,059,369,914</b>	<b>74,465,672,734</b>	<b>78,239,178,073</b>
元 本	70,329,724,602	74,306,156,588	76,718,691,831	78,632,594,070	81,031,931,840	82,860,406,992
次期繰越損益金	△3,548,708,696	△1,669,050,492	△1,953,864,957	△5,573,224,156	△6,566,259,106	△4,621,228,919
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>70,329,724,602口</b>	<b>74,306,156,588口</b>	<b>76,718,691,831口</b>	<b>78,632,594,070口</b>	<b>81,031,931,840口</b>	<b>82,860,406,992口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	9,495円	9,775円	9,745円	9,291円	9,190円	9,442円

(注) 第246期末における元本額は68,348,420,221円、当作成期間(第247期~第252期)中における追加設定元本額は16,261,577,127円、同解約元本額は1,749,590,356円です。

## ■損益の状況

[自 2024年4月23日 至 2024年5月20日] [自 2024年5月21日 至 2024年6月20日] [自 2024年6月21日 至 2024年7月22日] [自 2024年7月23日 至 2024年8月20日] [自 2024年8月21日 至 2024年9月20日] [自 2024年9月21日 至 2024年10月21日]

項 目	第247期	第248期	第249期	第250期	第251期	第252期
(A)配 当 等 収 益	21,577円	23,656円	29,438円	62,489円	83,887円	95,634円
受 取 利 息	21,577	23,656	29,438	62,489	83,887	95,634
(B)有価証券売買損益	1,746,930,899	2,207,078,466	△75,683,085	△3,328,855,708	△620,782,946	2,252,804,949
売 買 益	1,748,732,627	2,212,548,092	156,534	12,026,058	3,795,133	2,257,991,574
売 買 損	△1,801,728	△5,469,626	△75,839,619	△3,340,881,766	△624,578,079	△5,186,625
(C)信 託 報 酬 等	△46,850,559	△55,184,097	△61,309,483	△54,485,254	△58,737,332	△61,103,343
(D)当期損益金(A + B + C)	1,700,101,917	2,151,918,025	△136,963,130	△3,383,278,473	△679,436,391	2,191,797,240
(E)前期繰越損益金	3,584,306,361	5,159,142,612	7,175,386,204	6,895,850,909	3,376,353,280	2,566,440,818
(F)追加信託差損益金	△8,727,622,388	△8,868,651,895	△8,877,209,994	△8,967,847,701	△9,141,628,098	△9,255,176,367
(配当等相当額)	(2,920,591,091)	(3,402,013,539)	(3,778,306,031)	(4,088,471,631)	(4,480,450,429)	(4,778,609,176)
(売買損益相当額)	(△11,648,213,479)	(△12,270,665,434)	(△12,655,516,025)	(△13,056,319,332)	(△13,622,078,527)	(△14,033,785,543)
(G)合 計 (D + E + F)	△3,443,214,110	△1,557,591,258	△1,838,786,920	△5,455,275,265	△6,444,711,209	△4,496,938,309
(H)収 益 分 配 金	△105,494,586	△111,459,234	△115,078,037	△117,948,891	△121,547,897	△124,290,610
次期繰越損益金(G + H)	△3,548,708,696	△1,669,050,492	△1,953,864,957	△5,573,224,156	△6,566,259,106	△4,621,228,919
追加信託差損益金	△8,727,622,388	△8,868,651,895	△8,877,209,994	△8,967,847,701	△9,141,628,098	△9,255,176,367
(配当等相当額)	(2,924,092,395)	(3,409,632,598)	(3,783,455,830)	(4,092,331,890)	(4,485,188,131)	(4,782,563,813)
(売買損益相当額)	(△11,651,714,783)	(△12,278,284,493)	(△12,660,665,824)	(△13,060,179,591)	(△13,626,816,229)	(△14,037,740,180)
分配準備積立金	5,178,913,692	7,199,601,403	7,283,692,542	7,333,792,275	7,383,879,446	7,509,577,329
繰 越 損 益 金	-	-	△360,347,505	△3,939,168,730	△4,808,510,454	△2,875,629,881

(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247期～第252期まではルーミス米国投資適格債券マザーファンド93,286,364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247期	第248期	第249期	第250期	第251期	第252期
(a)経費控除後の配当等収益	210,578,393円	246,796,997円	223,384,375円	196,973,772円	211,106,402円	275,586,594円
(b)経費控除後の有価証券売買等損益	1,489,523,524	1,905,121,028	0	0	0	0
(c)収 益 調 整 金	2,924,092,395	3,409,632,598	3,783,455,830	4,092,331,890	4,485,188,131	4,782,563,813
(d)分 配 準 備 積 立 金	3,584,306,361	5,159,142,612	7,175,386,204	7,254,767,394	7,294,320,941	7,358,281,345
(e)当期分配対象額(a + b + c + d)	8,208,500,673	10,720,693,235	11,182,226,409	11,544,073,056	11,990,615,474	12,416,431,752
(f)1万円当たり当期分配対象額	1,167.15	1,442.77	1,457.56	1,468.10	1,479.74	1,498.48
(g)分 配 金	105,494,586	111,459,234	115,078,037	117,948,891	121,547,897	124,290,610
(h)1万円当たり分配金	15	15	15	15	15	15

## ■分配金のお知らせ

決算期	第247期	第248期	第249期	第250期	第251期	第252期
1万口当たり分配金	15円	15円	15円	15円	15円	15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。

# ルーミス米国投資適格債券マザーファンド

## 運用報告書

第42期（決算日 2024年10月21日）

（計算期間 2024年4月23日～2024年10月21日）

ルーミス米国投資適格債券マザーファンドの第42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	2003年10月31日から無期限です。
運用方針	<p>主として米国の米ドル建て公社債に投資を行い、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として運用を行います。</p> <p>投資を行う公社債の格付けについては、原則として取得時においてBBB-（Baa3）格以上の格付けを有する公社債に投資を行うとともに、ファンド全体の加重平均格付けをA-（A3）格以上に維持します。</p> <p>格付けは、S&amp;Pグローバル・レーティング（S&amp;P社）もしくはムーディーズ・インベスターズ・サービス（Moody's社）による格付けを基準とします。</p> <p>※「加重平均格付け」とは、各組入公社債等の格付けを、それぞれの公社債等の組入比率に応じて加重平均して算出した格付けであり、ファンドにかかる信用格付けではありません。</p> <p>実質組入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>公社債の組入比率は、高位に保つことを基本とします。</p> <p>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>
主要投資対象	主として米国の米ドル建て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・米国政府/クレジット指数 (為替ノーヘッジ・円ベース) (参考指数)		為替 (対米ドル)		債券組入率	債券先比率	純資産総額
	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率			
38期(2022年10月20日)	円	%		%	円	%	%	%	百万円
	27,525	6.6	531.78	7.5	149.98	15.9	96.5	-	8,023
39期(2023年4月20日)	26,572	△3.5	508.81	△4.3	134.92	△10.0	98.1	-	15,708
40期(2023年10月20日)	27,358	3.0	535.92	5.3	149.96	11.1	97.1	-	39,392
41期(2024年4月22日)	30,292	10.7	583.81	8.9	154.80	3.2	98.0	-	71,259
42期(2024年10月21日)	31,320	3.4	599.22	2.6	149.43	△3.5	98.4	-	95,312

(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・米国政府/クレジット指数(為替ノーヘッジ・円ベース)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・米国政府/クレジット指数(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、ルミス米国投資適格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、ルミス米国投資適格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)。

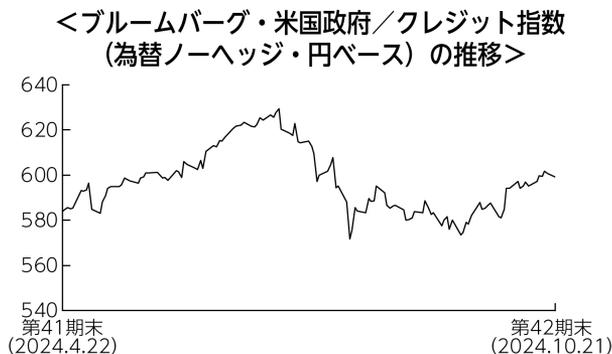
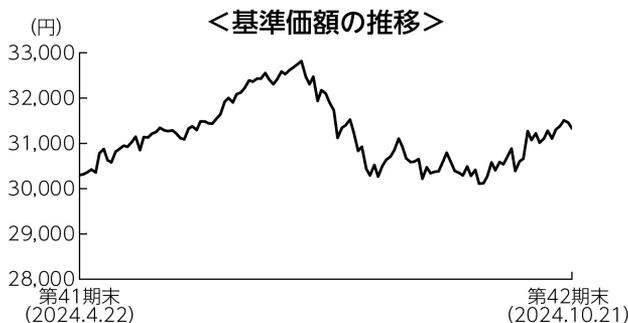
## ■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ブルームバーグ・米国政府/クレジット指数 (為替ノーヘッジ・円ベース) (参考指数)		為替 (対米ドル)		債券組入率	債券先物比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首) 2024年4月22日	円	%		%	円	%	%	%
	30,292	-	583.81	-	154.80	-	98.0	-
4月末	30,783	1.6	592.87	1.6	156.90	1.4	98.3	-
5月末	31,085	2.6	597.71	2.4	156.74	1.3	98.6	-
6月末	32,552	7.5	623.27	6.8	161.07	4.1	98.0	-
7月末	31,230	3.1	607.69	4.1	152.44	△1.5	98.5	-
8月末	30,381	0.3	583.89	0.0	144.80	△6.5	97.9	-
9月末	30,383	0.3	581.51	△0.4	142.73	△7.8	98.3	-
(期末) 2024年10月21日	31,320	3.4	599.22	2.6	149.43	△3.5	98.4	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(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4月23日から2024年10月21日まで)



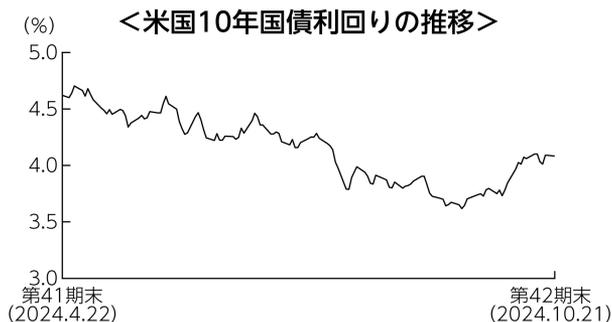
### 基準価額の推移

当ファンドの基準価額は、前期末比で3.4%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

米国の米ドル建て投資適格債券に投資を行った結果、社債市場が堅調に推移したことなどから、基準価額は上昇しました。

### 投資環境

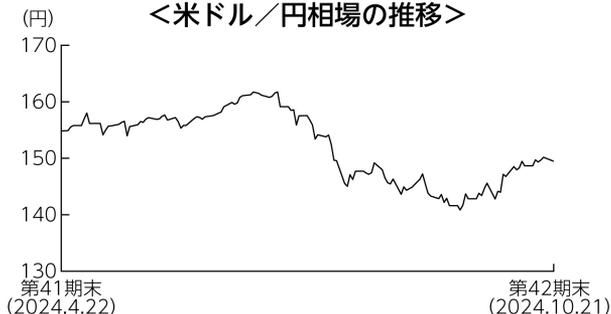


米国国債市場は上昇（利回りは低下）しました。期初から9月中旬は、米国の雇用統計やインフレ指標の軟化、9月のF R B（米連邦準備理事会）による0.5%の大幅利下げなどから上昇しました。その後は、経済指標の上振れなどが下落要因となりましたが、期を通じては上昇しました。

米国の投資適格社債市場も上昇しました。米国国債利回りの低下に加えて、銀行やR E I Tセクターを中心に信用スプレッドが縮小したことが上昇要因となりました。

(注) 値は前営業日のものを用いています。

## <米ドル／円相場の推移>



米ドルは対円で下落しました。

7月上旬にかけては、日銀が金融政策の現状維持を決定したことなどから上昇しましたが、その後は米国の軟調な経済指標とF R Bによる利下げ観測の高まりを受けて下落しました。9月には大幅利下げが実施され一段と下落しましたが、期末にかけては米国経済指標の上振れにより市場の利下げ前倒し観測が後退し、下落幅を一部縮小しました。

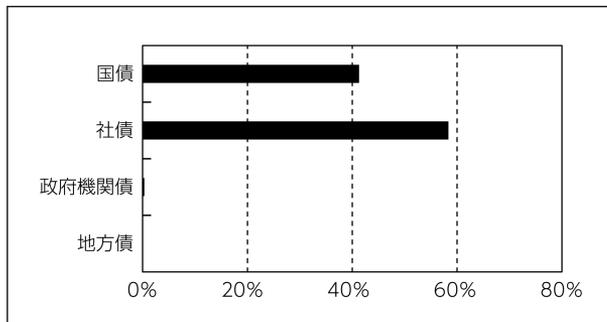
## ポートフォリオについて

米国の米ドル建て投資適格債券に投資を行い、個別銘柄の選別により分散されたポートフォリオの構築を行いました。当期末時点における債券の組入比率は、国債を4割程度、普通社債を6割程度とし、組入比率を高位に維持しました。ファンド全体の加重平均格付<sup>(\*)</sup>については、当ファンドの運用の基本方針に従い、A格以上を維持しました。上記の通り運用を行った結果、社債市場が堅調に推移したことなどから基準価額は上昇しました。

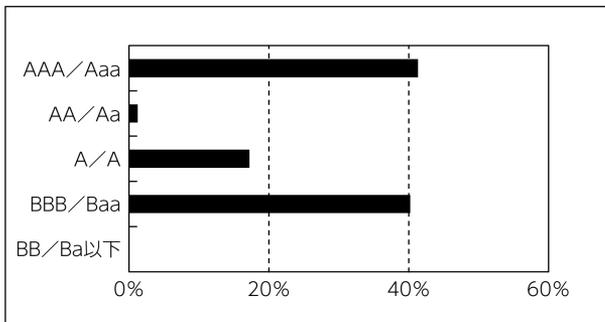
(\*) 「当ファンドの概要」をご参照ください。

期末

### 〔種別保有比率〕



### 〔格付別保有比率〕



(注) 比率はルーミス米国投資適格債券マザーファンドの債券部分を100%として算出したものを用いています。

(注1) 比率はルーミス米国投資適格債券マザーファンドの債券部分を100%として算出したものを用いています。

(注2) 格付はS & P、Moody'sの高いほうの格付を採用しています。

## 今後の運用方針

米国は、9月のFOMC（米連邦公開市場委員会）で利下げが開始されました。今後も追加利下げの実施が見込まれるものの、FRBは各種経済指標を見極めながら、追加利下げのペースを慎重に検討することが予想されます。

引き続き発行体のクオリティを重視しつつ米国の米ドル建て投資適格債券に投資を行い、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。

## ■ 1 万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) その他費用 (保管費用)	4円	0.013%	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(その他)	(4)	(0.013)	
合計	(0)	(0.000)	
合計	4	0.013	
期中の平均基準価額は31,192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4月23日から2024年10月21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 311,110	千アメリカ・ドル 244,061 (22,765)
		特殊債券	524	— (—)
		社債券	226,931	118,334 (2,025)

(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4月23日から2024年10月21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
アメリカ	千アメリカ・ドル 652,792	千アメリカ・ドル 627,561	千円 93,776,486	% 98.4	% -	% 65.0	% 18.5	% 14.9
合 計	-	-	千円 93,776,486	98.4	-	65.0	18.5	14.9

(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相場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。

(B) 個別銘柄開示

外国（外貨建）公社債銘柄別

銘 柄	当 期 末						償 還 年 月 日
	種類	利率	額面金額	評 価 額			
				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 4.0 01/31/31	国債証券	4.0000	1,480	1,483	221,674	2031/01/31	
US T N/B 3.625 02/15/53	国債証券	3.6250	8,190	7,139	1,066,789	2053/02/15	
US T N/B 2.375 02/15/42	国債証券	2.3750	860	645	96,525	2042/02/15	
US T N/B 4.25 02/15/54	国債証券	4.2500	185	180	26,992	2054/02/15	
US T N/B 4.25 02/28/31	国債証券	4.2500	645	655	97,959	2031/02/28	
US T N/B 3.875 02/15/43	国債証券	3.8750	4,650	4,334	647,757	2043/02/15	
US T N/B 4.5 02/15/44	国債証券	4.5000	4,925	4,966	742,152	2044/02/15	
US T N/B 3.5 02/15/33	国債証券	3.5000	2,570	2,474	369,731	2033/02/15	
US T N/B 4.625 04/30/31	国債証券	4.6250	1,445	1,499	224,086	2031/04/30	
US T N/B 3.5 04/30/30	国債証券	3.5000	845	827	123,693	2030/04/30	
US T N/B 3.625 05/15/53	国債証券	3.6250	9,585	8,361	1,249,446	2053/05/15	
US T N/B 4.625 05/15/54	国債証券	4.6250	3,500	3,637	543,598	2054/05/15	
US T N/B 4.625 05/31/31	国債証券	4.6250	1,710	1,774	265,182	2031/05/31	
US T N/B 3.25 05/15/42	国債証券	3.2500	1,340	1,150	171,894	2042/05/15	
US T N/B 4.625 05/15/44	国債証券	4.6250	5,060	5,185	774,841	2044/05/15	
US T N/B 3.875 05/15/43	国債証券	3.8750	14,080	13,091	1,956,285	2043/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/32	国債証券	2.8750	445	412	61,628	2032/05/15	
US T N/B 3.375 05/15/33	国債証券	3.3750	17,565	16,727	2,499,652	2033/05/15	
US T N/B 3.75 05/31/30	国債証券	3.7500	5,230	5,184	774,650	2030/05/31	
US T N/B 4.875 05/31/26	国債証券	4.8750	3,715	3,763	562,353	2026/05/31	
US T N/B 4.625 06/30/26	国債証券	4.6250	5,425	5,478	818,716	2026/06/30	
US T N/B 3.75 06/30/30	国債証券	3.7500	5,085	5,038	752,935	2030/06/30	
US T N/B 4.125 07/31/31	国債証券	4.1250	1,440	1,453	217,129	2031/07/31	
US T N/B 4.0 07/31/30	国債証券	4.0000	1,620	1,625	242,937	2030/07/31	
US T N/B 2.75 07/31/27	国債証券	2.7500	85	82	12,326	2027/07/31	
US T N/B 4.125 08/15/53	国債証券	4.1250	10,160	9,700	1,449,592	2053/08/15	
US T N/B 4.375 08/15/43	国債証券	4.3750	6,100	6,060	905,683	2043/08/15	
US T N/B 3.375 08/15/42	国債証券	3.3750	8,035	7,000	1,046,107	2042/08/15	
US T N/B 1.75 08/15/41	国債証券	1.7500	600	410	61,321	2041/08/15	
US T N/B 4.125 08/15/44	国債証券	4.1250	1,010	967	144,521	2044/08/15	
US T N/B 2.75 08/15/32	国債証券	2.7500	3,220	2,949	440,716	2032/08/15	
US T N/B 3.875 08/15/33	国債証券	3.8750	7,690	7,590	1,134,303	2033/08/15	
US T N/B 3.875 08/15/34	国債証券	3.8750	11,260	11,076	1,655,108	2034/08/15	

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 3.75 08/31/31	国債証券	3.7500	2,190	2,160	322,905	2031/08/31
US T N/B 4.125 08/31/30	国債証券	4.1250	165	166	24,893	2030/08/31
US T N/B 3.125 08/31/27	国債証券	3.1250	30	29	4,393	2027/08/31
US T N/B 3.625 08/31/29	国債証券	3.6250	4,705	4,653	695,323	2029/08/31
US T N/B 3.625 09/30/31	国債証券	3.6250	6,855	6,712	1,003,055	2031/09/30
US T N/B 3.5 09/30/26	国債証券	3.5000	33,850	33,567	5,016,020	2026/09/30
US T N/B 3.5 09/30/29	国債証券	3.5000	5,175	5,087	760,190	2029/09/30
US T N/B 4.875 10/31/30	国債証券	4.8750	1,140	1,196	178,851	2030/10/31
US T N/B 3.0 11/15/44	国債証券	3.0000	10,165	8,167	1,220,504	2044/11/15
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4.2500	3,535	3,518	525,707	2040/11/15
US T N/B 3.75 11/15/43	国債証券	3.7500	3,470	3,154	471,409	2043/11/15
US T N/B 4.0 11/15/42	国債証券	4.0000	2,085	1,982	296,239	2042/11/15
US T N/B 4.75 11/15/43	国債証券	4.7500	7,700	8,031	1,200,141	2043/11/15
US T N/B 2.0 11/15/41	国債証券	2.0000	2,080	1,475	220,423	2041/11/15
US T N/B 4.5 11/15/33	国債証券	4.5000	6,000	6,200	926,506	2033/11/15
US T N/B 4.375 11/30/30	国債証券	4.3750	1,225	1,252	187,213	2030/11/30
US T N/B 4.875 11/30/25	国債証券	4.8750	2,040	2,055	307,093	2025/11/30
US T BILL 11/05/24	国債証券	-	13,815	13,787	2,060,336	2024/11/05
US T BILL 12/19/24	国債証券	-	13,170	13,071	1,953,221	2024/12/19
UNIV VA-A-TXBL 3.227 09/01/19	地方債証券	3.2270	120	74	11,098	2119/09/01
NBN CO LTD 1.45 05/05/26	特殊債券	1.4500	200	191	28,544	2026/05/05
ANTARES HOLDINGS 7.95 08/11/28	特殊債券	7.9500	1,765	1,862	278,296	2028/08/11
DICK'S SPORTING GOODS 4.1 01/15/52	社債証券	4.1000	1,890	1,416	211,602	2052/01/15
SOCIETE GENERALE 01/19/55	社債証券	7.1320	890	910	136,069	2055/01/19
LEAR CORP 3.55 01/15/52	社債証券	3.5500	1,075	749	112,006	2052/01/15
GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.5 01/23/25	社債証券	3.5000	100	99	14,884	2025/01/23
PNC FINANCIAL SERVICES 01/24/34	社債証券	5.0680	2,080	2,085	311,591	2034/01/24
CREDIT AGRICOLE SA 01/10/35	社債証券	6.2510	2,170	2,300	343,700	2035/01/10
DEUTSCHE BANK NY 01/07/33	社債証券	3.7420	400	350	52,304	2033/01/07
STANDARD CHARTERED PLC 01/12/33	社債証券	3.6030	200	177	26,580	2033/01/12
PROTECTIVE LIFE CORP 3.4 01/15/30	社債証券	3.4000	1,110	1,033	154,403	2030/01/15
JABIL INC 3.0 01/15/31	社債証券	3.0000	180	160	24,036	2031/01/15
EQT CORP 5.0 01/15/29	社債証券	5.0000	1,920	1,920	286,953	2029/01/15
ENERGY TRANSFER OPERATING 4.75 01/15/26	社債証券	4.7500	535	535	79,958	2026/01/15
AIR LEASE CORP 2.875 01/15/32	社債証券	2.8750	2,165	1,888	282,132	2032/01/15
KEY BANK NA 5.0 01/26/33	社債証券	5.0000	750	734	109,793	2033/01/26
ENTERPRISE PRODUCTS OPER 2.8 01/31/30	社債証券	2.8000	1,275	1,175	175,643	2030/01/31
SEMPRA INFRASTRUCTURE PA 3.25 01/15/32	社債証券	3.2500	1,070	906	135,408	2032/01/15
GENERAL MOTORS FINL CO 3.1 01/12/32	社債証券	3.1000	1,435	1,246	186,201	2032/01/12
NATIONAL RURAL UTIL COOP 5.8 01/15/33	社債証券	5.8000	1,025	1,094	163,558	2033/01/15
AKER BP ASA 3.75 01/15/30	社債証券	3.7500	1,485	1,404	209,926	2030/01/15
AMERICAN HONDA FINANCE 2.35 01/08/27	社債証券	2.3500	1,740	1,671	249,817	2027/01/08
WESTPAC BANKING CORP 2.65 01/16/30	社債証券	2.6500	1,435	1,320	197,263	2030/01/16
PIONEER NATURAL RESOURCE 2.15 01/15/31	社債証券	2.1500	1,265	1,099	164,255	2031/01/15
BNP PARIBAS 01/13/27	社債証券	1.3230	600	574	85,902	2027/01/13
OWL ROCK CAPITAL CORP 2.625 01/15/27	社債証券	2.6250	625	588	87,919	2027/01/15
MDC HOLDINGS INC 2.5 01/15/31	社債証券	2.5000	925	814	121,675	2031/01/15
TRUIST FINANCIAL CORP 01/26/29	社債証券	4.8730	1,170	1,176	175,739	2029/01/26
DEVON ENERGY CORPORATION 4.5 01/15/30	社債証券	4.5000	1,905	1,871	279,617	2030/01/15
AIRCATTLE LTD 2.85 01/26/28	社債証券	2.8500	1,705	1,589	237,581	2028/01/26
CVS HEALTH CORP 5.25 01/30/31	社債証券	5.2500	515	520	77,772	2031/01/30
FS KKR CAPITAL CORP 3.4 01/15/26	社債証券	3.4000	2,415	2,356	352,105	2026/01/15
SANTANDER HOLDINGS USA 01/06/28	社債証券	2.4900	2,350	2,228	333,024	2028/01/06
AERCAP IRELAND CAP/GLOBA 5.1 01/19/29	社債証券	5.1000	150	151	22,705	2029/01/19

銘 柄	当 期 末						償 還 年 月 日
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額			
				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 01/20/28	社 債 券	2.5910	1,620	1,549	231,559	2028/01/20	
SIXTH STREET LENDING PAR 5.75 01/15/30	社 債 券	5.7500	635	625	93,529	2030/01/15	
ATHENE GLOBAL FUNDING 5.583 01/09/29	社 債 券	5.5830	1,830	1,877	280,509	2029/01/09	
ENTERPRISE PRODUCTS OPER 3.3 02/15/53	社 債 券	3.3000	1,385	968	144,772	2053/02/15	
EXPEDIA INC 3.8 02/15/28	社 債 券	3.8000	1,955	1,909	285,364	2028/02/15	
DEUTSCHE BANK NY 02/10/34	社 債 券	7.0790	1,280	1,373	205,220	2034/02/10	
T-MOBILE USA INC 3.3 02/15/51	社 債 券	3.3000	2,620	1,846	275,985	2051/02/15	
DELL INT LLC / EMC CORP 4.85 02/01/35	社 債 券	4.8500	2,245	2,200	328,840	2035/02/01	
ANHEUSER-BUSCH CO/INBEV 4.9 02/01/46	社 債 券	4.9000	1,005	962	143,891	2046/02/01	
ALEXANDRIA REAL ESTATE E 1.875 02/01/33	社 債 券	1.8750	2,390	1,890	282,428	2033/02/01	
TARGET CORP 2.35 02/15/30	社 債 券	2.3500	1,775	1,611	240,864	2030/02/15	
UNION PACIFIC CORP 2.4 02/05/30	社 債 券	2.4000	2,140	1,942	290,336	2030/02/05	
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 3.0 02/10/27	社 債 券	3.0000	120	115	17,300	2027/02/10	
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 2.15 02/13/30	社 債 券	2.1500	1,740	1,553	232,131	2030/02/13	
SYSCO CORPORATION 2.4 02/15/30	社 債 券	2.4000	855	766	114,561	2030/02/15	
GENERAL MOTORS FINL CO 2.9 02/26/25	社 債 券	2.9000	70	69	10,382	2025/02/26	
BANK OF NOVA SCOTIA 2.2 02/03/25	社 債 券	2.2000	560	555	83,007	2025/02/03	
PHILIP MORRIS INTL INC 5.375 02/15/33	社 債 券	5.3750	1,810	1,864	278,652	2033/02/15	
AMGEN INC 2.45 02/21/30	社 債 券	2.4500	1,560	1,410	210,735	2030/02/21	
CENTENE CORP 3.375 02/15/30	社 債 券	3.3750	2,130	1,921	287,167	2030/02/15	
AVOLON HOLDINGS FNDG LTD 2.75 02/21/28	社 債 券	2.7500	2,355	2,192	327,597	2028/02/21	
OTIS WORLDWIDE CORP 2.565 02/15/30	社 債 券	2.5650	1,825	1,653	247,031	2030/02/15	
MITSUBISHI UFJ FIN GRP 2.193 02/25/25	社 債 券	2.1930	250	247	37,008	2025/02/25	
WW GRAINGER INC 1.85 02/15/25	社 債 券	1.8500	570	564	84,316	2025/02/15	
BOEING CO 2.196 02/04/26	社 債 券	2.1960	1,390	1,339	200,181	2026/02/04	
JABIL INC 5.45 02/01/29	社 債 券	5.4500	500	511	76,390	2029/02/01	
AUTOZONE INC 4.5 02/01/28	社 債 券	4.5000	1,895	1,898	283,711	2028/02/01	
ORACLE CORP 4.1 03/25/61	社 債 券	4.1000	1,445	1,102	164,757	2061/03/25	
AMGEN INC 5.75 03/02/63	社 債 券	5.7500	780	798	119,349	2063/03/02	
BURLINGTON NORTH SANTA FE 5.5 03/15/55	社 債 券	5.5000	1,200	1,251	187,027	2055/03/15	
NUTRIEN LTD 5.8 03/27/53	社 債 券	5.8000	605	630	94,167	2053/03/27	
MPLX LP 4.125 03/01/27	社 債 券	4.1250	2,035	2,021	302,001	2027/03/01	
RAIZEN FUELS FINANCE 6.95 03/05/54	社 債 券	6.9500	265	277	41,492	2054/03/05	
HCA INC 4.625 03/15/52	社 債 券	4.6250	1,035	872	130,408	2052/03/15	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 3.75 03/09/27	社 債 券	3.7500	1,285	1,266	189,295	2027/03/09	
FORTUNE BRANDS INNOVATIO 4.5 03/25/52	社 債 券	4.5000	1,188	986	147,377	2052/03/25	
BARCLAYS PLC 03/10/42	社 債 券	3.8110	200	163	24,390	2042/03/10	
WARNERMEDIA HOLDINGS INC 5.391 03/15/62	社 債 券	5.3910	1,865	1,406	210,182	2062/03/15	
SOUTHERN CAL EDISON 3.65 03/01/28	社 債 券	3.6500	610	595	88,978	2028/03/01	
GATX CORP 6.05 03/15/34	社 債 券	6.0500	430	456	68,270	2034/03/15	
SYNCHRONY FINANCIAL 5.15 03/19/29	社 債 券	5.1500	1,730	1,720	257,113	2029/03/19	
AIB GROUP PLC 03/28/35	社 債 券	5.8710	500	520	77,800	2035/03/28	
PHILLIPS 66 CO 4.95 03/15/35	社 債 券	4.9500	2,200	2,154	321,887	2035/03/15	
MCDONALD'S CORP 2.125 03/01/30	社 債 券	2.1250	1,650	1,470	219,710	2030/03/01	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY 2.05 03/05/30	社 債 券	2.0500	1,895	1,678	250,791	2030/03/05	
AMERICAN ELECTRIC POWER 2.3 03/01/30	社 債 券	2.3000	2,310	2,058	307,642	2030/03/01	
CIGNA CORP 2.4 03/15/30	社 債 券	2.4000	1,311	1,176	175,774	2030/03/15	
JM SMUCKER CO 2.375 03/15/30	社 債 券	2.3750	1,990	1,787	267,123	2030/03/15	
ONEOK INC 3.1 03/15/30	社 債 券	3.1000	2,250	2,080	310,928	2030/03/15	
MARTIN MARIETTA MATERIAL 2.5 03/15/30	社 債 券	2.5000	105	94	14,165	2030/03/15	
KITE REALTY GROUP LP 5.5 03/01/34	社 債 券	5.5000	1,865	1,902	284,300	2034/03/01	
JOHN DEERE CAPITAL CORP 1.75 03/09/27	社 債 券	1.7500	105	99	14,850	2027/03/09	
STANDARD CHARTERED PLC 03/15/33	社 債 券	4.8660	200	197	29,493	2033/03/15	
AMPHENOL CORP 2.05 03/01/25	社 債 券	2.0500	350	346	51,739	2025/03/01	

銘柄	当 期 末					
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償 還 年 月 日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
CIGNA CORP 3.4 03/01/27	社 債 券	3.4000	600	586	87,568	2027/03/01
RAIZEN FUELS FINANCE 6.45 03/05/34	社 債 券	6.4500	620	647	96,824	2034/03/05
HSBC HOLDINGS PLC 4.95 03/31/30	社 債 券	4.9500	800	812	121,412	2030/03/31
EBAY INC 1.9 03/11/25	社 債 券	1.9000	1,485	1,467	219,244	2025/03/11
DEUTSCHE BANK NY 1.686 03/19/26	社 債 券	1.6860	150	144	21,580	2026/03/19
AT&T 1.7 03/25/26	社 債 券	1.7000	990	951	142,251	2026/03/25
BLUE OWL CREDIT INCOME 6.65 03/15/31	社 債 券	6.6500	1,905	1,942	290,195	2031/03/15
JOHN DEERE CAPITAL CORP 4.9 03/03/28	社 債 券	4.9000	1,880	1,920	286,909	2028/03/03
SOUTHERN CAL EDISON 5.3 03/01/28	社 債 券	5.3000	580	595	88,983	2028/03/01
NATWEST GROUP PLC 03/02/27	社 債 券	5.8470	825	837	125,159	2027/03/02
AMERICAN EXPRESS CO 2.55 03/04/27	社 債 券	2.5500	1,550	1,489	222,591	2027/03/04
CELANESE US HOLDINGS LLC 6.05 03/15/25	社 債 券	6.0500	212	212	31,750	2025/03/15
NISOURCE INC 5.25 03/30/28	社 債 券	5.2500	1,765	1,806	269,985	2028/03/30
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 5.6 03/30/28	社 債 券	5.6000	690	706	105,611	2028/03/30
MACQUARIE AIRFINANCE HLD 5.15 03/17/30	社 債 券	5.1500	265	262	39,288	2030/03/17
MAIN STREET CAPITAL CORP 6.95 03/01/29	社 債 券	6.9500	400	413	61,837	2029/03/01
MACQUARIE AIRFINANCE HLD 6.4 03/26/29	社 債 券	6.4000	210	218	32,658	2029/03/26
SIXTH STREET SPECIALTY 6.125 03/01/29	社 債 券	6.1250	1,745	1,770	264,611	2029/03/01
ENERGY TRANSFER PARTNERS 5.3 04/15/47	社 債 券	5.3000	1,300	1,205	180,067	2047/04/15
BANK OF AMERICA CORP 3.705 04/24/28	社 債 券	3.7050	2,395	2,347	350,858	2028/04/24
CENTERPOINT ENER HOUSTON 5.3 04/01/53	社 債 券	5.3000	80	79	11,874	2053/04/01
GENERAL MOTORS FINL CO 4.35 04/09/25	社 債 券	4.3500	405	403	60,315	2025/04/09
COREBRIDGE FINANCIAL INC 4.4 04/05/52	社 債 券	4.4000	1,950	1,629	243,539	2052/04/05
CENTERPOINT ENER HOUSTON 4.95 04/01/33	社 債 券	4.9500	115	115	17,290	2033/04/01
WESTERN MIDSTREAM OPERAT 6.15 04/01/33	社 債 券	6.1500	175	183	27,484	2033/04/01
GENERAL MOTORS 5.0 04/01/35	社 債 券	5.0000	1,005	966	144,451	2035/04/01
NATIONAL RURAL UTIL COOP 04/30/43	社 債 券	8.4269	196	196	29,360	2043/04/30
CSL FINANCE PLC 4.95 04/27/62	社 債 券	4.9500	1,925	1,780	266,080	2062/04/27
BANK OF AMERICA CORP 04/25/34	社 債 券	5.2880	1,570	1,603	239,668	2034/04/25
AVERY DENNISON CORP 2.65 04/30/30	社 債 券	2.6500	2,170	1,962	293,197	2030/04/30
GLP CAPITAL LP / FIN II 5.375 04/15/26	社 債 券	5.3750	2,235	2,241	334,944	2026/04/15
PUBLIC SERVICE ENTERPRIS 8.625 04/15/31	社 債 券	8.6250	475	557	83,326	2031/04/15
BANK OF AMERICA CORP 04/23/27	社 債 券	3.5590	640	630	94,187	2027/04/23
PROLOGIS LP 2.125 04/15/27	社 債 券	2.1250	1,160	1,101	164,632	2027/04/15
CDW LLC/CDW FINANCE 4.25 04/01/28	社 債 券	4.2500	2,240	2,196	328,276	2028/04/01
EDISON INTERNATIONAL 4.95 04/15/25	社 債 券	4.9500	5	4	746	2025/04/15
TD SYNEX CORP 6.1 04/12/34	社 債 券	6.1000	280	293	43,829	2034/04/12
MARRIOTT INTERNATIONAL 4.9 04/15/29	社 債 券	4.9000	1,845	1,871	279,586	2029/04/15
MORGAN STANLEY 04/20/29	社 債 券	5.1640	3,100	3,158	471,982	2029/04/20
CHENIERE ENERGY INC 5.65 04/15/34	社 債 券	5.6500	1,225	1,256	187,723	2034/04/15
CANADIAN IMPERIAL BANK 5.26 04/08/29	社 債 券	5.2600	1,880	1,936	289,385	2029/04/08
MERITAGE HOMES CORP 3.875 04/15/29	社 債 券	3.8750	1,965	1,869	279,302	2029/04/15
TIME WARNER CABLE INC 6.55 05/01/37	社 債 券	6.5500	180	177	26,463	2037/05/01
LIBERTY MUTUAL GROUP INC 3.95 05/15/60	社 債 券	3.9500	740	527	78,862	2060/05/15
BOEING CO 5.93 05/01/60	社 債 券	5.9300	725	686	102,607	2060/05/01
JPMORGAN CHASE & CO 05/13/31	社 債 券	2.9560	1,590	1,446	216,147	2031/05/13
BOEING CO 6.858 05/01/54	社 債 券	6.8580	345	373	55,825	2054/05/01
BOEING CO 5.705 05/01/40	社 債 券	5.7050	400	387	57,875	2040/05/01
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT 5.8 05/21/54	社 債 券	5.8000	570	594	88,775	2054/05/21
PINE STREET TRUST III 6.223 05/15/54	社 債 券	6.2230	830	878	131,283	2054/05/15
LEAR CORP 5.25 05/15/49	社 債 券	5.2500	260	237	35,416	2049/05/15
ENERGY TRANSFER OPERATNG 3.75 05/15/30	社 債 券	3.7500	295	279	41,762	2030/05/15
SHERWIN-WILLIAMS CO 2.3 05/15/30	社 債 券	2.3000	1,800	1,607	240,261	2030/05/15
BARCLAYS PLC 05/09/34	社 債 券	6.2240	1,200	1,278	191,005	2034/05/09

銘柄	当 期 末						償 還 年 月 日
	種類	利率	額面金額	評 価 額			
				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		
BP CAP MARKETS AMERICA 3.119 05/04/26	社 債 券	3.1190	1,225	1,204	180,047	2026/05/04	
CROWN CASTLE INC 5.1 05/01/33	社 債 券	5.1000	1,620	1,623	242,525	2033/05/01	
COMCAST CORP 4.8 05/15/33	社 債 券	4.8000	1,840	1,849	276,362	2033/05/15	
GENERAL DYNAMICS CORP 3.5 05/15/25	社 債 券	3.5000	555	551	82,465	2025/05/15	
PILGRIM'S PRIDE CORP 6.875 05/15/34	社 債 券	6.8750	1,680	1,848	276,167	2034/05/15	
NVR INC 3.0 05/15/30	社 債 券	3.0000	785	720	107,735	2030/05/15	
PFIZER INVESTMENT ENTER 4.75 05/19/33	社 債 券	4.7500	1,790	1,791	267,722	2033/05/19	
MOHAWK INDUSTRIES INC 3.625 05/15/30	社 債 券	3.6250	55	52	7,811	2030/05/15	
FMC CORP 5.65 05/18/33	社 債 券	5.6500	1,845	1,878	280,714	2033/05/18	
LYB INT FINANCE III 5.625 05/15/33	社 債 券	5.6250	1,785	1,870	279,453	2033/05/15	
KEURIG DR PEPPER INC 4.417 05/25/25	社 債 券	4.4170	15	14	2,236	2025/05/25	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL IN 5.625 05/15/30	社 債 券	5.6250	2,115	2,190	327,320	2030/05/15	
IPALCO ENTERPRISES INC 4.25 05/01/30	社 債 券	4.2500	1,670	1,602	239,444	2030/05/01	
NETFLIX INC 6.375 05/15/29	社 債 券	6.3750	1,715	1,854	277,059	2029/05/15	
BOEING CO 6.298 05/01/29	社 債 券	6.2980	390	407	60,948	2029/05/01	
ENACT HOLDINGS INC 6.25 05/28/29	社 債 券	6.2500	1,815	1,871	279,608	2029/05/28	
ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR 4.35 06/01/40	社 債 券	4.3500	1,115	1,028	153,719	2040/06/01	
ALBEMARLE CORP 5.65 06/01/52	社 債 券	5.6500	2,080	1,922	287,344	2052/06/01	
SOUTHWESTERN PUBLIC SERV 6.0 06/01/54	社 債 券	6.0000	690	735	109,888	2054/06/01	
VIATRIS INC 3.85 06/22/40	社 債 券	3.8500	1,630	1,246	186,207	2040/06/22	
GATX CORP 6.05 06/05/54	社 債 券	6.0500	430	453	67,774	2054/06/05	
DUKE ENERGY CORP 5.8 06/15/54	社 債 券	5.8000	1,800	1,846	275,962	2054/06/15	
HCA INC 4.125 06/15/29	社 債 券	4.1250	1,410	1,375	205,525	2029/06/15	
VODAFONE GROUP PLC 5.75 06/28/54	社 債 券	5.7500	1,900	1,917	286,584	2054/06/28	
AIR LEASE CORP 3.75 06/01/26	社 債 券	3.7500	1,120	1,105	165,130	2026/06/01	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 06/05/28	社 債 券	3.6910	700	685	102,403	2028/06/05	
VALERO ENERGY CORP 6.625 06/15/37	社 債 券	6.6250	315	350	52,325	2037/06/15	
ENERGY TRANSFER OPERATNG 6.05 06/01/41	社 債 券	6.0500	135	137	20,615	2041/06/01	
UNUM GROUP 4.0 06/15/29	社 債 券	4.0000	1,355	1,317	196,934	2029/06/15	
SOUTHERN CAL EDISON 2.25 06/01/30	社 債 券	2.2500	1,200	1,064	159,123	2030/06/01	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 06/08/34	社 債 券	6.3770	1,745	1,866	278,868	2034/06/08	
TRUIST FINANCIAL CORP 06/08/34	社 債 券	5.8670	750	786	117,462	2034/06/08	
PACIFIC GAS & ELECTRIC 3.25 06/01/31	社 債 券	3.2500	2,090	1,887	282,075	2031/06/01	
GATX CORP 3.1 06/01/51	社 債 券	3.1000	910	603	90,200	2051/06/01	
CVS HEALTH CORP 5.3 06/01/33	社 債 券	5.3000	1,445	1,445	215,971	2033/06/01	
AIRCASTE LTD 4.25 06/15/26	社 債 券	4.2500	725	717	107,248	2026/06/15	
CITIGROUP INC 4.4 06/10/25	社 債 券	4.4000	150	149	22,326	2025/06/10	
REGENCY CENTERS LP 3.7 06/15/30	社 債 券	3.7000	1,745	1,657	247,738	2030/06/15	
CABOT CORP 5.0 06/30/32	社 債 券	5.0000	1,275	1,277	190,958	2032/06/30	
ENERGY CORP 2.8 06/15/30	社 債 券	2.8000	1,915	1,738	259,767	2030/06/15	
VIATRIS INC 4.0 06/22/50	社 債 券	4.0000	245	172	25,733	2050/06/22	
BOSTON SCIENTIFIC CORP 2.65 06/01/30	社 債 券	2.6500	2,090	1,899	283,895	2030/06/01	
UNICREDIT SPA 06/03/27	社 債 券	1.9820	400	382	57,123	2027/06/03	
OWL ROCK TECHNOLOGY FINA 3.75 06/17/26	社 債 券	3.7500	285	274	40,952	2026/06/17	
ARES CAPITAL CORP 2.875 06/15/27	社 債 券	2.8750	2,160	2,041	304,990	2027/06/15	
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 5.4 06/24/31	社 債 券	5.4000	965	985	147,226	2031/06/24	
NXP BV/NXP FDG/NXP USA 3.875 06/18/26	社 債 券	3.8750	1,830	1,811	270,756	2026/06/18	
GARTNER INC 3.625 06/15/29	社 債 券	3.6250	2,020	1,915	286,302	2029/06/15	
ALLY FINANCIAL INC 06/13/29	社 債 券	6.9920	1,805	1,902	284,220	2029/06/13	
F&G ANNUITIES & LIFE INC 6.5 06/04/29	社 債 券	6.5000	980	1,005	150,229	2029/06/04	
BRIGHTHSE FIN GBLB FUND 5.65 06/10/29	社 債 券	5.6500	560	573	85,736	2029/06/10	
APPLIED MATERIALS INC 4.8 06/15/29	社 債 券	4.8000	715	731	109,272	2029/06/15	
COREBRIDGE GLOB FUNDING 5.2 06/24/29	社 債 券	5.2000	745	759	113,473	2029/06/24	
AMERICAN HOMES 4 RENT 3.375 07/15/51	社 債 券	3.3750	60	41	6,143	2051/07/15	

銘柄	当 期 末						償 還 年 月 日
	種類	利率	額面金額	評 価 額			
				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		
LOWE'S COS INC 5.75 07/01/53	社 債 券	5.7500	1,365	1,410	210,732	2053/07/01	
UNITEDHEALTH GROUP INC 5.625 07/15/54	社 債 券	5.6250	2,030	2,102	314,135	2054/07/15	
CITIGROUP INC 07/24/28	社 債 券	3.6680	1,160	1,132	169,247	2028/07/24	
ORIX CORP 3.7 07/18/27	社 債 券	3.7000	415	406	60,752	2027/07/18	
EQUIFAX INC 7.0 07/01/37	社 債 券	7.0000	420	476	71,224	2037/07/01	
MORGAN STANLEY 07/22/28	社 債 券	3.5910	1,570	1,530	228,652	2028/07/22	
CROWN CASTLE INTL CORP 4.15 07/01/50	社 債 券	4.1500	390	318	47,530	2050/07/01	
AES CORP/THE 3.95 07/15/30	社 債 券	3.9500	355	335	50,086	2030/07/15	
CABOT CORP 4.0 07/01/29	社 債 券	4.0000	1,055	1,037	154,989	2029/07/01	
STANDARD CHARTERED PLC 07/06/34	社 債 券	6.2960	1,200	1,288	192,592	2034/07/06	
NEWMONT CORP 2.6 07/15/32	社 債 券	2.6000	2,255	1,973	294,868	2032/07/15	
OVINTIV INC 6.25 07/15/33	社 債 券	6.2500	1,765	1,856	277,478	2033/07/15	
JPMORGAN CHASE & CO 07/22/35	社 債 券	5.2940	1,545	1,583	236,641	2035/07/22	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 07/23/35	社 債 券	5.3300	2,805	2,854	426,513	2035/07/23	
CELANESE US HOLDINGS LLC 6.379 07/15/32	社 債 券	6.3790	905	956	142,861	2032/07/15	
US BANCORP 3.0 07/30/29	社 債 券	3.0000	2,320	2,155	322,098	2029/07/30	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 3.04 07/16/29	社 債 券	3.0400	800	747	111,750	2029/07/16	
mitsubishi UFJ FIN GRP 07/20/32	社 債 券	2.3090	795	684	102,233	2032/07/20	
ARES CAPITAL CORP 3.25 07/15/25	社 債 券	3.2500	185	182	27,271	2025/07/15	
ENEL FINANCE INTL NV 2.25 07/12/31	社 債 券	2.5000	2,055	1,767	264,065	2031/07/12	
AES CORP/THE 3.3 07/15/25	社 債 券	3.3000	85	83	12,551	2025/07/15	
IMPERIAL BRANDS FIN PLC 5.875 07/01/34	社 債 券	5.8750	1,340	1,373	205,265	2034/07/01	
OWL ROCK CAPITAL CORP 3.4 07/15/26	社 債 券	3.4000	435	420	62,887	2026/07/15	
TORONTO-DOMINION BANK 5.523 07/17/28	社 債 券	5.5230	1,220	1,263	188,852	2028/07/17	
CELANESE US HOLDINGS LLC 6.33 07/15/29	社 債 券	6.3300	915	962	143,756	2029/07/15	
ARES CAPITAL CORP 2.15 07/15/26	社 債 券	2.1500	525	499	74,584	2026/07/15	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 07/26/30	社 債 券	5.4630	2,015	2,058	307,620	2030/07/26	
GOLUB CAPITAL BDC 6.0 07/15/29	社 債 券	6.0000	1,875	1,901	284,071	2029/07/15	
AVIATION CAPITAL GROUP 5.375 07/15/29	社 債 券	5.3750	635	642	96,027	2029/07/15	
ESSENT GROUP LTD 6.25 07/01/29	社 債 券	6.2500	685	707	105,751	2029/07/01	
BLACKSTONE HOLDINGS FINA 2.85 08/05/51	社 債 券	2.8500	2,845	1,812	270,866	2051/08/05	
VIRGINIA ELEC & POWER CO 5.55 08/15/54	社 債 券	5.5500	300	308	46,089	2054/08/15	
GLOBAL PAYMENTS INC 5.95 08/15/52	社 債 券	5.9500	1,860	1,888	282,130	2052/08/15	
BANK OF AMERICA CORP 08/15/35	社 債 券	5.4250	1,470	1,486	222,068	2035/08/15	
WESTLAKE CHEMICAL CORP 3.6 08/15/26	社 債 券	3.6000	2,165	2,127	317,941	2026/08/15	
BOSTON GAS COMPANY 3.001 08/01/29	社 債 券	3.0010	45	41	6,190	2029/08/01	
VMWARE INC 2.2 08/15/31	社 債 券	2.2000	2,265	1,921	287,059	2031/08/15	
XCEL ENERGY INC 5.45 08/15/33	社 債 券	5.4500	1,795	1,840	275,034	2033/08/15	
TD SYNEX CORP 2.65 08/09/31	社 債 券	2.6500	1,900	1,620	242,132	2031/08/09	
BRUNSWICK CORP 2.4 08/18/31	社 債 券	2.4000	2,275	1,886	281,830	2031/08/08	
BANCO SANTANDER SA 6.921 08/08/33	社 債 券	6.9210	1,400	1,534	229,284	2033/08/08	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 08/23/28	社 債 券	4.4820	2,195	2,193	327,779	2028/08/23	
PENSKE TRUCK LEASING/PTL 6.05 08/01/28	社 債 券	6.0500	915	955	142,738	2028/08/01	
SYNCHRONY FINANCIAL 08/02/30	社 債 券	5.9350	540	555	82,953	2030/08/02	
KINDER MORGAN INC 5.1 08/01/29	社 債 券	5.1000	1,245	1,266	189,222	2029/08/01	
CITIBANK NA 4.838 08/06/29	社 債 券	4.8380	1,395	1,414	211,388	2029/08/06	
TELEFONICA 8.25 09/15/30	社 債 券	8.2500	505	589	88,024	2030/09/15	
AT&T 3.5 09/15/53	社 債 券	3.5000	188	133	20,011	2053/09/15	
AT&T 3.55 09/15/55	社 債 券	3.5500	660	468	69,964	2055/09/15	
KROGER CO 5.5 09/15/54	社 債 券	5.5000	635	626	93,637	2054/09/15	
AT&T 3.65 09/15/59	社 債 券	3.6500	2,007	1,414	211,439	2059/09/15	
PECO ENERGY CO 5.25 09/15/54	社 債 券	5.2500	2,150	2,159	322,767	2054/09/15	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP 2.55 09/15/26	社 債 券	2.5500	1,810	1,748	261,353	2026/09/15	
CONAGRA BRANDS INC 8.25 09/15/30	社 債 券	8.2500	570	671	100,385	2030/09/15	

銘柄	当 期 末						償 還 年 月 日
	種類	利率	額面金額	評 価 額			
				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		
VERIZON COMMUNICATIONS 2.85 09/03/41	社 債 券	2.8500	2,400	1,757	262,619	2041/09/03	
GATX CORP 5.45 09/15/33	社 債 券	5.4500	1,480	1,515	226,456	2033/09/15	
BERKSHIRE HATHAWAY ENERG 8.48 09/15/28	社 債 券	8.4800	360	411	61,512	2028/09/15	
GLENCORE FUNDING LLC 2.5 09/01/30	社 債 券	2.5000	1,190	1,054	157,592	2030/09/01	
ANGLO AMERICAN CAPITAL 2.625 09/10/30	社 債 券	2.6250	2,000	1,770	264,569	2030/09/10	
CAIXABANK SA 09/13/34	社 債 券	6.8400	1,645	1,813	270,940	2034/09/13	
ROYALTY PHARMA PLC 5.4 09/02/34	社 債 券	5.4000	765	771	115,217	2034/09/02	
MICRON TECHNOLOGY INC 5.875 09/15/33	社 債 券	5.8750	1,790	1,888	282,172	2033/09/15	
PPL CAPITAL FUNDING INC 5.25 09/01/34	社 債 券	5.2500	340	343	51,394	2034/09/01	
REGENCY CENTERS LP 2.95 09/15/29	社 債 券	2.9500	265	245	36,752	2029/09/15	
HCA INC 5.45 09/15/34	社 債 券	5.4500	250	252	37,763	2034/09/15	
BUNGE LTD FINANCE CORP 4.65 09/17/34	社 債 券	4.6500	2,200	2,149	321,246	2034/09/17	
SANTANDER UK GROUP HLDGS 09/11/30	社 債 券	4.8580	2,370	2,366	353,679	2030/09/11	
CANADIAN NATL RAILWAY 4.375 09/18/34	社 債 券	4.3750	1,140	1,110	165,920	2034/09/18	
NISSAN MOTOR ACCEPTANCE 7.05 09/15/28	社 債 券	7.0500	1,715	1,798	268,777	2028/09/15	
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 6.1 09/21/28	社 債 券	6.1000	1,165	1,216	181,738	2028/09/21	
MOHAWK INDUSTRIES INC 5.85 09/18/28	社 債 券	5.8500	645	674	100,736	2028/09/18	
AIB GROUP PLC 09/13/29	社 債 券	6.6080	1,300	1,380	206,234	2029/09/13	
BLACKSTONE SECURED LEND 2.85 09/30/28	社 債 券	2.8500	2,110	1,922	287,228	2028/09/30	
AERCAP IRELAND CAP/GLOBA 4.625 09/10/29	社 債 券	4.6250	1,240	1,231	184,054	2029/09/10	
GOLUB CAPITAL CAP FND 5.8 09/12/29	社 債 券	5.8000	820	807	120,737	2029/09/12	
NISSAN MOTOR ACCEPTANCE 5.55 09/13/29	社 債 券	5.5500	550	541	80,905	2029/09/13	
ORACLE CORP 4.2 09/27/29	社 債 券	4.2000	2,215	2,187	326,931	2029/09/27	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 6.75 10/01/37	社 債 券	6.7500	810	914	136,619	2037/10/01	
WILLIAMS COMPANIES INC 3.5 10/15/51	社 債 券	3.5000	1,215	872	130,369	2051/10/15	
HP ENTERPRISE CO 5.6 10/15/54	社 債 券	5.6000	1,190	1,166	174,266	2054/10/15	
ONEAMERICA FINL PARTNERS 4.25 10/15/50	社 債 券	4.2500	15	11	1,689	2050/10/15	
EASTERN ENERGY GAS 5.65 10/15/54	社 債 券	5.6500	530	531	79,443	2054/10/15	
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 4.6 10/10/31	社 債 券	4.6000	2,225	2,219	331,717	2031/10/10	
FERGUSON ENTERPRISES INC 5.0 10/03/34	社 債 券	5.0000	720	713	106,638	2034/10/03	
HP ENTERPRISE CO 10/15/45	社 債 券	6.3500	1,685	1,827	273,133	2045/10/15	
SUNOCO LOGISTICS PARTNER 5.4 10/01/47	社 債 券	5.4000	505	472	70,603	2047/10/01	
GEORGETOWN UNIVERSITY 5.215 10/01/18	社 債 券	5.2150	30	28	4,246	2118/10/01	
JPMORGAN CHASE & CO 10/15/30	社 債 券	2.7390	2,960	2,712	405,382	2030/10/15	
NEWMONT CORP 2.25 10/01/30	社 債 券	2.2500	340	301	45,053	2030/10/01	
SMITHFIELD FOODS INC 3.0 10/15/30	社 債 券	3.0000	10	8	1,315	2030/10/15	
GRAY OAK PIPELINE LLC 3.45 10/15/27	社 債 券	3.4500	10	9	1,434	2027/10/15	
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 2.375 10/15/27	社 債 券	2.3750	205	192	28,727	2027/10/15	
GLENCORE FUNDING LLC 6.375 10/06/30	社 債 券	6.3750	725	780	116,653	2030/10/06	
AERCAP IRELAND CAP/GLOBA 3.0 10/29/28	社 債 券	3.0000	1,265	1,187	177,394	2028/10/29	
DANSKE BANK A/S 10/02/30	社 債 券	4.6130	550	544	81,312	2030/10/02	
GRAY OAK PIPELINE LLC 2.6 10/15/25	社 債 券	2.6000	20	19	2,917	2025/10/15	
KBC GROUP NV 10/16/30	社 債 券	4.9320	965	969	144,837	2030/10/16	
STANDARD CHARTERED PLC 10/15/30	社 債 券	5.0050	835	837	125,111	2030/10/15	
MORGAN STANLEY 10/18/30	社 債 券	4.6540	2,225	2,222	332,102	2030/10/18	
AERCAP IRELAND CAP/GLOBA 4.625 10/15/27	社 債 券	4.6250	575	575	86,067	2027/10/15	
DARDEN RESTAURANTS INC 4.55 10/15/29	社 債 券	4.5500	795	785	117,303	2029/10/15	
NATIONAL BANK OF CANADA 4.5 10/10/29	社 債 券	4.5000	1,045	1,037	155,052	2029/10/10	
NORINCHUKIN BANK 5.094 10/16/29	社 債 券	5.0940	290	294	43,989	2029/10/16	
JBS USA/FOOD/FINANCE 7.25 11/15/53	社 債 券	7.2500	1,880	2,165	323,656	2053/11/15	
CORNING INC 5.45 11/15/79	社 債 券	5.4500	1,080	1,030	153,937	2079/11/15	
SOUTHERN CALIF GAS CO 6.35 11/15/52	社 債 券	6.3500	260	294	44,031	2052/11/15	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.5 11/16/26	社 債 券	3.5000	810	794	118,722	2026/11/16	
JACKSON FINANCIAL INC 4.0 11/23/51	社 債 券	4.0000	2,650	1,880	281,004	2051/11/23	

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	
BROADCOM INC 3.137 11/15/35	社 債 券	3.1370	2,710	2,278	340,547	2035/11/15
TIME WARNER CABLE LLC 5.875 11/15/40	社 債 券	5.8750	1,360	1,220	182,430	2040/11/15
WILLIAMS COMPANIES INC 3.5 11/15/30	社 債 券	3.5000	1,295	1,212	181,247	2030/11/15
EPR PROPERTIES 3.6 11/15/31	社 債 券	3.6000	665	587	87,810	2031/11/15
FORD MOTOR CREDIT CO LLC 7.122 11/07/33	社 債 券	7.1220	1,905	2,048	306,127	2033/11/07
WESTERN MIDSTREAM OPERAT 5.45 11/15/34	社 債 券	5.4500	2,385	2,370	354,231	2034/11/15
DEUTSCHE BANK NY 11/24/26	社 債 券	2.1290	600	581	86,903	2026/11/24
INTESA SANPAOLO SPA 7.2 11/28/33	社 債 券	7.2000	1,620	1,822	272,344	2033/11/28
VAR ENERGI ASA 8.0 11/15/32	社 債 券	8.0000	1,590	1,836	274,446	2032/11/15
MSCI INC 4.0 11/15/29	社 債 券	4.0000	1,945	1,864	278,634	2029/11/15
BLACKSTONE PRIVATE CRE 7.3 11/27/28	社 債 券	7.3000	1,780	1,885	281,726	2028/11/27
ATMOS ENERGY CORP 5.0 12/15/54	社 債 券	5.0000	735	701	104,814	2054/12/15
KKR GROUP FIN CO X LLC 3.25 12/15/51	社 債 券	3.2500	75	51	7,693	2051/12/15
ORIX CORP 3.25 12/04/24	社 債 券	3.2500	145	144	21,615	2024/12/04
AT&T 3.8 12/01/57	社 債 券	3.8000	135	99	14,819	2057/12/01
NATIONAL OILWELL VARCO I 3.6 12/01/29	社 債 券	3.6000	930	877	131,135	2029/12/01
CHOICE HOTELS INTL INC 3.7 12/01/29	社 債 券	3.7000	2,370	2,225	332,571	2029/12/01
METLIFE INC 5.3 12/15/34	社 債 券	5.3000	245	252	37,804	2034/12/15
DIAMONDBACK ENERGY INC 3.5 12/01/29	社 債 券	3.5000	1,945	1,842	275,281	2029/12/01
HELMERICH & PAYNE INC 5.5 12/01/34	社 債 券	5.5000	785	759	113,538	2034/12/01
CENTENE CORP 4.625 12/15/29	社 債 券	4.6250	235	224	33,599	2029/12/15
EQUIFAX INC 2.6 12/15/25	社 債 券	2.6000	670	654	97,845	2025/12/15
合 計	-	-	652,792	627,561	93,776,486	-

## ■投資信託財産の構成

2024年10月21日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 93,776,486	% 98.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,535,529	1.6
投 資 信 託 財 産 総 額	95,312,015	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、95,311,785千円、100.0%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10月21日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝149.43円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年10月21日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	95,312,015,930円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	544,640,951
公 社 債(評価額)	93,776,486,846
未 収 利 息	930,855,898
前 払 費 用	60,032,235
(B) 負 債	-
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	95,312,015,930
元 本	30,432,143,831
次 期 繰 越 損 益 金	64,879,872,099
(D) 受 益 権 総 口 数	30,432,143,831口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	31,320円

(注1) 期首元本額 23,524,236,060円  
追加設定元本額 6,907,907,771円  
一部解約元本額 0円

(注2) 期末における元本の内訳  
ルーミス米国投資適格債券ファンド [年2回決算型] 5,615,448,407円  
ルーミス米国投資適格債券ファンド [毎月決算型] 24,816,695,424円  
期末元本合計 30,432,143,831円

## ■損益の状況

当期 自2024年4月23日 至2024年10月21日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,842,789,264円
受 取 利 息	1,842,776,700
そ の 他 収 益 金	12,564
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	644,920,981
売 買 益	3,904,602,456
売 買 損	△3,259,681,475
(C) そ の 他 費 用	△11,083,251
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	2,476,626,994
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	47,735,152,876
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	14,668,092,229
(G) 合 計(D+E+F)	64,879,872,099
次 期 繰 越 損 益 金(G)	64,879,872,099

(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)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。