

LM・グローバル・プレミア小型株ファンド (年1回決算型)

運用報告書（全体版）

第2期 決算日 2020年12月7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、「LM・グローバル・プレミア小型株ファンド(年1回決算型)」は、2020年12月7日に第2期の決算を行いましたので、期中の運用状況と収益分配金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。

レッグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社

〒100-6536 東京都千代田区丸の内一丁目5番1号

レッグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社（金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第417号）はフランクリン・リソース・インク傘下の資産運用会社です。

レッグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社は、2021年4月1日付でフランクリン・テンプレトン・インベストメンツ株式会社を吸収合併し、商号を「フランクリン・テンプレトン・ジャパン株式会社」に変更する予定です。

<https://www.leggmason.co.jp>

◇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／内外／株式	
信託期間	2018年12月7日～2028年12月6日	
運用方針	主に日本を含む先進国および新興国の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている小型株式に投資を行うことにより、信託財産の中長期的成長を目指します。	
主要運用対象	当ファンド	「LM・グローバル・プレミア小型株マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。
	LM・グローバル・プレミア小型株マザーファンド	日本を含む先進国および新興国の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている小型株式を主要投資対象とします。
組入制限	株式への実質投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。	
分配方針	決算時（毎年12月6日、休業日の場合は翌営業日）に、基準価額水準等を勘案して収益の分配を行います。	

当報告書に関するお問合わせ先：
レッグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社

お問合わせ窓口

電話番号：03-5219-5947

○設定以来の運用実績

決算期	基準 (分配落)	価額			株組入比率	株式先物比率	純資産総額
		税金 分	み 配 金	騰 落 率			
(設定日) 2018年12月7日	円 10,000	円 —	% —	% —	% —	百万円 367	
1期(2019年12月6日)	11,703	0	17.0	92.2	—	14,966	
2期(2020年12月7日)	12,227	0	4.5	95.4	—	12,541	

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「株式組入比率」「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 株式先物比率は買建比率－売建比率。

(注) 市場に広く認知されているベンチマーク等で、当ファンドのリスク特性を正確に反映する指標が見当たらないため、現状では、当ファンドの収益率およびリスク特性を特定のベンチマーク等と比較しておりません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準	価額		株組入比率	株式先物比率
		騰落率	騰落率		
(期首) 2019年12月6日	円 11,703	% —	% —	% 92.2	% —
12月末	12,240	4.6	—	93.5	—
2020年1月末	11,936	2.0	—	93.6	—
2月末	10,959	△6.4	—	96.0	—
3月末	8,542	△27.0	—	95.8	—
4月末	9,812	△16.2	—	97.0	—
5月末	10,471	△10.5	—	95.9	—
6月末	10,537	△10.0	—	95.7	—
7月末	10,657	△8.9	—	97.3	—
8月末	11,288	△3.5	—	96.5	—
9月末	10,992	△6.1	—	95.8	—
10月末	10,631	△9.2	—	96.8	—
11月末	12,093	3.3	—	96.6	—
(期末) 2020年12月7日	12,227	4.5	—	95.4	—

(注) 騰落率は期首比です。

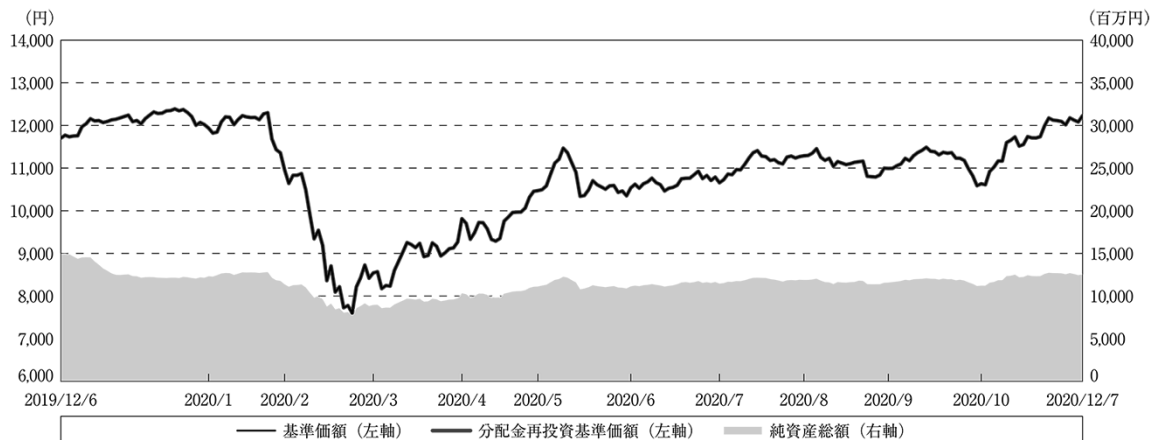
(注) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「株式組入比率」「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 株式先物比率は買建比率－売建比率。

○運用経過

期中の基準価額等の推移

(2019年12月7日～2020年12月7日)



期首：11,703円

期末：12,227円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率：4.5% (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は、期首(2019年12月6日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (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おります。

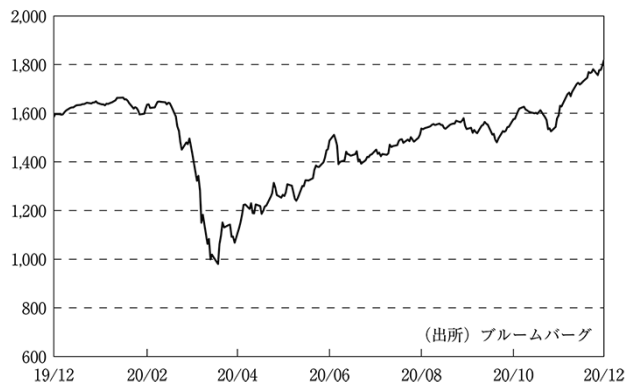
○基準価額の主な変動要因

当期の当ファンドのパフォーマンス(騰落率)はプラスとなりました。株式市場の上昇を反映して、株式要因がプラスとなりました。一方、為替要因はマイナスとなりました。

当ファンドが主要投資対象としているグローバル小型株の代表的な動きを示すMSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス・スモールキャップ指数(MSCI ACWI Small Cap Index)は、上昇しました。

米国株式については、前半は、新型コロナウイルスの感染拡大により、景気後退懸念が高まったことから、株価は急落しました。しかしその後、米連邦準備制度理事会(FRB)による緊急利下げや、トランプ米政権の経済対策などを受けて、株価は反発するなど、値動きの激しい展開となりました。後半は、新型コロナウイルスの感染再拡大などで上値を抑えられた場面もありましたが、経済活動の再開やワクチン開発への期待などを背景に、株価は上昇基調となりました。欧州株式については、前半は、新型コロナウイルスの感染地域が広がり、リスク回避姿勢が高まったことから、株価は急落しました。しかしその後、各国が相次いで金融・財政支援策を発表したことなどから、株価は持ち直しました。後半は、経済活動の再開や新型コロナウイルスのワクチン開発への期待などが下支えとなったものの、欧州における新型コロナウイルスの感染再拡大が重石となり、株価は概ね横ばいで推移しました。為替市場では、米ドルは対円で下落しました。一方、ユーロは対円で上昇しました。

MSCI ACWI Small Cap Index (米ドルベース)



当ファンドのポートフォリオ

(2019年12月7日～2020年12月7日)

当ファンドは、主に「LM・グローバル・プレミア小型株マザーファンド」受益証券への投資を通じて、主に日本を含む先進国および新興国の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている小型株式に投資を行うことにより、信託財産の中長期的成長を目指して運用に努めてまいりました。当期においては、数多くある小型銘柄の中で、質の高いプレミア企業を厳選して投資を行い、中長期的に優れた投資成果の獲得を目指してポートフォリオの構築を行いました。

分配金につきましては、基準価額動向や保有株式の配当収入等を勘案し、以下の通りとさせていただきます。なお、収益分配に充当しなかった利益につきましては信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づき運用を行います。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第2期
	2019年12月7日～ 2020年12月7日
当期分配金	—
(対基準価額比率)	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	2,227

(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、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合計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

個別企業に対する定量的および定性的なファンダメンタルズ分析に基づき、競争力、収益性、財務の安定性に優れていると評価された銘柄を厳選し、ポートフォリオを構築します。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年12月7日～2020年12月7日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	203	1.875	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(103)	(0.949)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(96)	(0.882)	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 ）	(5)	(0.044)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	25	0.227	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 株 式 ）	(25)	(0.227)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	3	0.024	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（ 株 式 ）	(3)	(0.024)	
(d) そ の 他 費 用	10	0.094	(d) 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 ）	(6)	(0.054)	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及び資金の 送金・資産の移転等に要する費用
（ 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係る費用
（ 印 刷 等 費 用 ）	(3)	(0.029)	印刷等費用は、印刷業者等に支払う法定書類の作成、印刷、交付および届出に 係る費用
（ 業 務 委 託 等 費 用 ）	(1)	(0.009)	計理及びこれに付随する業務の委託等の費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.001)	権利処理に伴う費用（外国税額分も含む）及び金銭信託手数料
合 計	241	2.220	
期中の平均基準価額は、10,846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む）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あります。

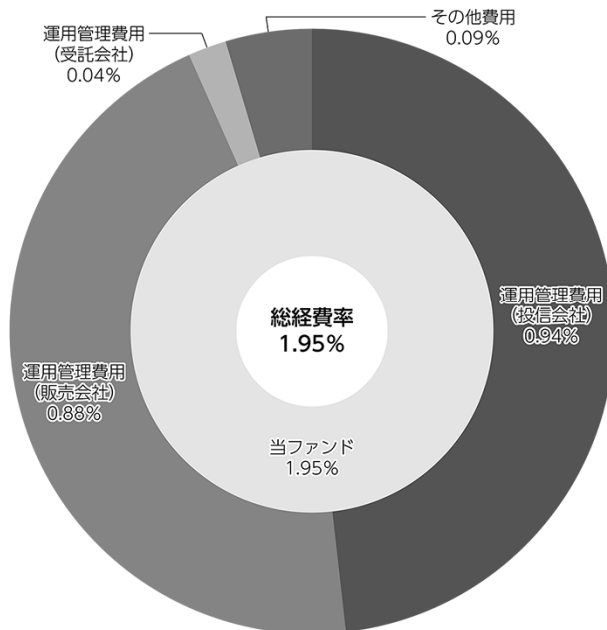
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）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あります。

(参考情報)

○総経費率

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1.95%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、親投資信託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

(2019年12月7日～2020年12月7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
LM・グローバル・プレミア小型株マザーファンド	5,928,536 千口	6,890,259 千円	8,619,385 千口	10,253,244 千円

(注) 単位未満は切捨て。

○株式売買比率

(2019年12月7日～2020年12月7日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
	LM・グローバル・プレミア小型株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	26,935,498千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	17,264,008千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.56

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注) 単位未満は切捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2019年12月7日～2020年12月7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。

○第二種金融商品取引業を兼業している投資信託委託会社の自己取引状況

(2019年12月7日～2020年12月7日)

該当事項はございません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2019年12月7日～2020年12月7日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2020年12月7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
LM・グローバル・プレミア小型株マザーファンド	千口 12,681,572	千口 9,990,723	千円 12,653,251

(注) 単位未満は切捨て。

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「運用報告書」をご参照ください。

○投資信託財産の構成

(2020年12月7日現在)

項 目	当 期 末	比 率
	評 価 額	
LM・グローバル・プレミア小型株マザーファンド	千円 12,653,251	% 98.2
コール・ローン等、その他	235,122	1.8
投資信託財産総額	12,888,373	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

(注) LM・グローバル・プレミア小型株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（16,732,095千円）の投資信託財産総額（19,853,681千円）に対する比率は84.3%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、12月7日における邦貨換算レートは1米ドル=104.08円、1カナダドル=81.45円、1ブラジルレアル=20.29円、1ユーロ=126.25円、1イギリスポンド=139.74円、1スイスフラン=116.79円、1スウェーデンクローナ=12.32円、1ノルウェークローネ=11.83円、1デンマーククローネ=16.96円、1オーストラリアドル=77.33円、1インドルピー=1.42円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年12月7日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	12,888,373,434	
LM・グローバル・プレミア小型株マザーファンド(評価額)	12,653,251,335	
未収入金	235,122,099	
(B) 負債	346,386,357	
未払解約金	235,122,099	
未払信託報酬	109,086,770	
その他未払費用	2,177,488	
(C) 純資産総額(A-B)	12,541,987,077	
元本	10,257,226,887	
次期繰越損益金	2,284,760,190	
(D) 受益権総口数	10,257,226,887口	
1万口当たり基準価額(C/D)	12,227円	

<注記事項>

元本の状況

期首元本額

12,788,765,414円

期中追加設定元本額

6,083,918,092円

期中一部解約元本額

8,615,456,619円

○損益の状況 (2019年12月7日～2020年12月7日)

項 目	当 期	円
(A) 有価証券売買損益	945,918,609	
売買益	1,356,488,903	
売買損	△ 410,570,294	
(B) 信託報酬等	△ 219,520,278	
(C) 当期損益金(A+B)	726,398,331	
(D) 前期繰越損益金	517,261,714	
(E) 追加信託差損益金	1,041,100,145	
(配当等相当額)	(425,379,891)	
(売買損益相当額)	(615,720,254)	
(F) 計(C+D+E)	2,284,760,190	
(G) 収益分配金	0	
次期繰越損益金(F+G)	2,284,760,190	
追加信託差損益金	1,041,100,145	
(配当等相当額)	(432,102,443)	
(売買損益相当額)	(608,997,702)	
分配準備積立金	1,243,660,045	

(注) 損益の状況の中で(A)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) 損益の状況の中で(B)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) 損益の状況の中で(E)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) 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するため要する費用として、委託者報酬のうち販売会社へ支払う手数料を除いた額の100分の50相当額を支払っております。

<分配金の計算過程>

決 算 期	当 期
(A) 配 当 等 取 益(費用控除後)	123,809,849円
(B) 有 価 証 券 売 買 等 損 益 (費用控除後、繰越欠損金補填後)	602,588,482
(C) 收 益 調 整 金	1,041,100,145
(D) 分 配 準 備 積 立 金	517,261,714
分 配 対 象 取 益 額(A+B+C+D)	2,284,760,190
(1万口当たり収益分配対象額)	(2,227)
取 益 分 配 金	0
(1万口当たり収益分配金)	(0)

LM・グローバル・プレミア小型株マザーファンド

運用状況のご報告

第2期 決算日 2020年12月7日

(計算期間：2019年12月7日～2020年12月7日)

－ 受益者のみなさまへ －

法令・諸規則に基づき、「LM・グローバル・プレミア小型株マザーファンド」の第2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。

商 品 分 類	親投資信託
信 託 期 間	無期限
運 用 方 針	小型株式に投資を行うことにより、信託財産の中長期的成長を目指します。
主 要 運 用 対 象	日本を含む先進国および新興国の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている小型株式を主要投資対象とします。
組 入 制 限	株式への投資割合には、制限を設けません。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額	騰落率		株組入比率	株先物比率	純資産総額
		騰	落			
(設定日) 2018年12月7日	円 10,000	% —	% —	% —	% —	百万円 489
1期(2019年12月6日)	11,911	19.1	91.4	—	—	26,970
2期(2020年12月7日)	12,665	6.3	94.6	—	—	19,567

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

(注) 株式先物比率は買建比率－売建比率。

(注) 市場に広く認知されているベンチマーク等で、当ファンドのリスク特性を正確に反映する指標が見当たらないため、現状では、当ファンドの収益率およびリスク特性を特定のベンチマーク等と比較しておりません。

○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		株組入比率	株先物比率
		騰	落		
(期首) 2019年12月6日	円 11,911	% —	% —	% 91.4	% —
12月末	12,473	4.7	93.3	—	—
2020年1月末	12,185	2.3	93.3	—	—
2月末	11,208	△ 5.9	95.5	—	—
3月末	8,764	△ 26.4	95.1	—	—
4月末	10,070	△ 15.5	96.2	—	—
5月末	10,756	△ 9.7	95.0	—	—
6月末	10,833	△ 9.1	95.6	—	—
7月末	10,974	△ 7.9	97.0	—	—
8月末	11,641	△ 2.3	96.1	—	—
9月末	11,355	△ 4.7	95.2	—	—
10月末	11,002	△ 7.6	96.0	—	—
11月末	12,522	5.1	95.7	—	—
(期末) 2020年12月7日	12,665	6.3	94.6	—	—

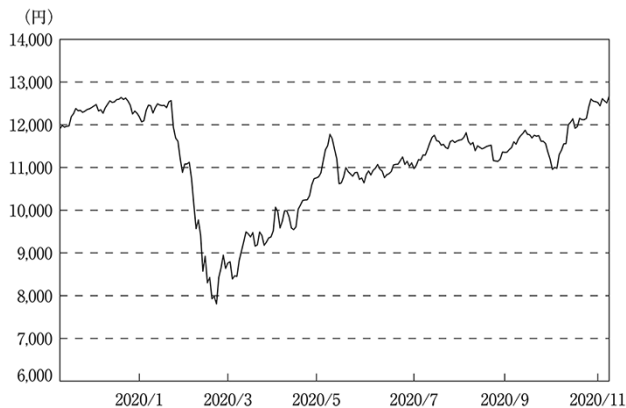
(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式先物比率は買建比率－売建比率。

○運用経過

期中の基準価額等の推移

(2019年12月7日～2020年12月7日)



○基準価額の主な変動要因

当期の当ファンドのパフォーマンス（騰落率）はプラスとなりました。

株式市場の上昇を反映して、株式要因がプラスとなりました。一方、為替要因はマイナスとなりました。

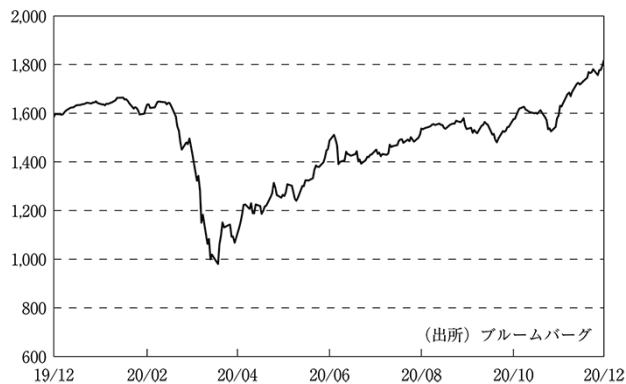
投資環境

当ファンドが主要投資対象としているグローバル小型株の代表的な動きを示すMSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス・スモールキャップ指数(MSCI ACWI Small Cap Index)は、上昇しました。

米国株式については、前半は、新型コロナウイルスの感染拡大により、景気後退懸念が高まったことから、株価は急落しました。しかしその後、米連邦準備制度理事会(FRB)による緊急利下げや、トランプ米政権の経済対策などを受けて、株価は反発するなど、値

動きの激しい展開となりました。後半は、新型コロナウイルスの感染再拡大などで上値を抑えられる場面もありましたが、経済活動の再開やワクチン開発への期待などを背景に、株価は上昇基調となりました。欧州株式については、前半は、新型コロナウイルスの感染地域が広がり、リスク回避姿勢が高まったことから、株価は急落しました。しかしその後、各国が相次いで金融・財政支援策を発表したことなどから、株価は持ち直しました。後半は、経済活動の再開や新型コロナウイルスのワクチン開発への期待などが下支えとなったものの、欧州における新型コロナウイルスの感染再拡大が重石となり、株価は概ね横ばいで推移しました。為替市場では、米ドルは対円で下落しました。一方、ユーロは対円で上昇しました。

MSCI ACWI Small Cap Index (米ドルベース)



当ファンドのポートフォリオ

当ファンドは、主に日本を含む先進国および新興国の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている小型株式に投資を行うことにより、信託財産の中長期的成長を目指して運用に努めてまいりました。当期においては、数多くある小型銘柄の中で、質の高いプレミア企業を厳選して投資を行い、中長期的に優れた投資成果の獲得を目指してポートフォリオの構築を行いました。

○今後の運用方針

個別企業に対する定量的および定性的なファンダメンタルズ分析に基づき、競争力、収益性、財務の安定性に優れていると評価された銘柄を厳選し、ポートフォリオを構築します。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年12月7日～2020年12月7日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式)	円 25 (25)	% 0.228 (0.228)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式)	3 (3)	0.024 (0.024)	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	6 (6) (0)	0.055 (0.054) (0.001)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の 送金・資産の移転等に要する費用 権利処理に伴う費用（外国税額も含む）及び金銭信託手数料
合 計	34	0.307	
期中の平均基準価額は、11,148円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）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あります。

○売買及び取引の状況

(2019年12月7日～2020年12月7日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 304 (86)	千円 775,388 (-)	千株 576	千円 1,663,583
	アメリカ	百株 5,282	千米ドル 27,226	百株 4,962	千米ドル 34,646
外 国	カナダ	5,136	千カナダドル 7,032	5,133	千カナダドル 12,922
	ブラジル	7,867	千ブラジルリアル 11,595	10,589	千ブラジルリアル 27,664
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	672	2,422	1,087	6,121
	イタリア	1,236	2,150	-	-
	フランス	112	755	1,795	7,501
	オランダ	710	1,003	1,399	2,197
	スペイン	1,284	720	3,301	2,483
	オーストリア	8	107	242	2,969
	その他	6,766	2,329	1,120	502
	イギリス	15,718	千イギリスポンド 8,383	33,796	千イギリスポンド 21,180
	スイス	159 (237)	千スイスフラン 3,672 (-)	421 (-)	千スイスフラン 12,660 (53)
	スウェーデン	9,576	千スウェーデンクローナ 65,363	11,731	千スウェーデンクローナ 107,251
	ノルウェー	1,688	千ノルウェークローネ 22,401	780	千ノルウェークローネ 16,033
	デンマーク	4,929	千デンマーククローネ 27,404	310	千デンマーククローネ 12,894
オーストラリア	21,792 (623)	千オーストラリアドル 13,437 (313)	23,789	千オーストラリアドル 13,450	
ニュージーランド	6,648	千ニュージーランドドル 1,345	14,335	千ニュージーランドドル 2,339	
インド	310	千インドルピー 51,240	633	千インドルピー 107,035	

(注) 金額は受渡し代金。

(注) 単位未満は切捨て。

(注) ()内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

○株式売買比率

(2019年12月7日～2020年12月7日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	26,935,498千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	17,264,008千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.56

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注) 単位未満は切捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2019年12月7日～2020年12月7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

(2020年12月7日現在)

国内株式

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
		千株	千株	千円
電気機器 (9.1%)				
コーセル	269.7		170.7	202,962
情報・通信業 (39.9%)				
TKC	89.4		49.9	338,322
NSD	107.5		148.3	279,693
福井コンピュータホールディングス	70.9		85.9	270,155
卸売業 (12.5%)				
アズワン	40.9		18.8	277,676
サービス業 (38.5%)				
ベネフィット・ワン	160.2		88.4	272,272
テクノプロ・ホールディングス	28.2		27.7	227,971
メイテック	79		70.5	356,025
合 計	株 数 ・ 金 額	845	660	2,225,077
	銘 柄 数 < 比 率 >	8	8	< 11.4% >

(注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

(注) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する株式評価額の比率。

(注) 評価額の単位未満は切り捨て。

外国株式

銘	柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
ARCOSA INC		—	248	1,360	141,604	資本財・サービス
CMC MATERIALS INC		—	244	3,722	387,461	情報技術
CABOT MICROELECTRONICS CORP		450	—	—	—	情報技術
CAL-MAINE FOODS INC		271	—	—	—	生活必需品
DORMAN PRODUCTS INC		—	146	1,399	145,677	一般消費財・サービス
ESCO TECHNOLOGIES INC		—	233	2,318	241,325	資本財・サービス
FARO TECHNOLOGIES INC		—	243	1,629	169,579	情報技術
FIRSTSERVICE CORP		285	99	1,308	136,165	不動産
FORRESTER RESEARCH INC		—	372	1,636	170,340	資本財・サービス
INNOSPEC INC		243	321	2,800	291,455	素材
INTER PARFUMS INC		490	521	3,019	314,268	生活必需品
JOHN BEAN TECHNOLOGIES CORP		286	235	2,942	306,219	資本財・サービス
KADANT INC		359	219	2,980	310,237	資本財・サービス
KENNEDY-WILSON HOLDINGS INC		2,528	2,747	4,617	480,612	不動産
LCI INDUSTRIES		423	223	2,885	300,291	一般消費財・サービス
MANHATTAN ASSOCIATES INC		—	279	2,914	303,317	情報技術
MARCUS & MILLICHAP INC		1,076	870	3,206	333,726	不動産
QUAKER CHEMICAL CORP		298	128	3,155	328,444	素材
ROGERS CORP		—	167	2,571	267,648	情報技術
SIMPSON MANUFACTURING CO INC		378	267	2,425	252,480	資本財・サービス
UNIFIRST CORP/MA		192	96	1,839	191,419	資本財・サービス
WOLVERINE WORLD WIDE INC		545	486	1,489	155,072	一般消費財・サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	7,832	8,152	50,224	5,227,349	
		14	20	—	<26.7%>	
(カナダ)				千カナダドル		
PASON SYSTEMS INC		4,004	5,626	4,292	349,662	エネルギー
STELLA-JONES INC		1,737	787	3,545	288,819	素材
MORNEAU SHEPELL INC		1,492	1,327	3,998	325,686	資本財・サービス
ALTUS GROUP LTD		1,397	892	4,372	356,106	不動産
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	8,630	8,633	16,209	1,320,276	
		4	4	—	<6.7%>	
(ブラジル)				千ブラジルレアル		
TOTVS SA		2,485	—	—	—	情報技術
ODONTOPREV S. A.		11,516	11,279	15,486	314,218	ヘルスケア
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	14,002	11,279	15,486	314,218	
		2	1	—	<1.6%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
AMADEUS FIRE AG		343	193	2,331	294,298	資本財・サービス
NORMA GROUP SE		1,016	751	2,808	354,550	資本財・サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,359	944	5,139	648,849	
		2	2	—	<3.3%>	

銘柄	株数	期末			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア) CAREL INDUSTRIES SPA	百株 —	百株 1,236	千ユーロ 2,227	千円 281,261	情報技術
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,236 —	2,227 —	281,261 <1.4%>	
(ユーロ…フランス) NEURONES	880	—	—	—	情報技術
THERMADOR GROUPE	319	—	—	—	資本財・サービス
GAZTRANSPORT ET TECHNIGA SA	482	—	—	—	エネルギー
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,683 3	— —	— <—%>	
(ユーロ…オランダ) INTERTRUST NV	2,298	1,609	2,253	284,445	資本財・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,298 1	1,609 1	2,253 —	284,445 <1.5%>
(ユーロ…スペイン) APPLUS SERVICES SA	2,017	—	—	—	資本財・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,017 1	— —	— <—%>	
(ユーロ…オーストリア) MAYR-MELNHOF KARTON AG	234	—	—	—	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	234 1	— —	— <—%>	
(ユーロ…その他) MAREL HF	—	5,646	2,664	336,451	資本財・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	— —	5,646 1	2,664 —	336,451 <1.7%>
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	7,592 8	9,436 5	12,285 —	1,551,007 <7.9%>
(イギリス) DISCOVERIE GROUP PLC	5,708	4,131	2,520	352,161	情報技術
DIPLOMA PLC	1,376	917	1,973	275,792	資本財・サービス
ADVANCED MEDICAL SOLUTIONS	11,600	—	—	—	ヘルスケア
VICTREX PLC	1,175	1,059	2,226	311,131	素材
XP POWER LTD	870	395	1,864	260,584	資本財・サービス
RESTORE PLC	—	6,456	2,330	325,710	資本財・サービス
ABCAM PLC	2,279	—	—	—	ヘルスケア
POLYPIPE GROUP PLC	4,967	—	—	—	資本財・サービス
FDM GROUP HOLDINGS PLC	3,930	2,236	2,356	329,357	情報技術
ROTORK PLC	9,695	8,329	2,513	351,297	資本財・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	41,603 9	23,526 7	15,786 —	2,206,034 <11.3%>
(スイス) FORBO HOLDING AG-REG	21	—	—	—	一般消費財・サービス
DORMAKABA HOLDING AG	59	59	2,950	344,622	資本財・サービス
KARDEX HOLDING AG-B	198	137	2,563	299,367	資本財・サービス
LEM HOLDING SA-REG	19	11	1,929	225,402	情報技術
VZ HOLDING AG	105	—	—	—	金融
VZ HOLDING AG	—	306	2,397	279,971	金融

銘柄	株数	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(スイス)	百株	百株	千スイスフラン	千円		
VAT GROUP AG	235	100	1,991	232,608		資本財・サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	640	616	11,832	1,381,971	
	銘柄 数 < 比 率 >	6	5	—	< 7.1% >	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローナ		
LOOMIS AB-B	945	—	—	—	—	資本財・サービス
KARNOV GROUP AB	—	4,002	20,493	252,477		コミュニケーション・サービス
LOOMIS AB	—	1,110	28,015	345,146		資本財・サービス
HEXPOL AB	4,352	2,635	23,061	284,121		素材
DOMETIC GROUP AB	3,559	2,263	24,450	301,234		一般消費財・サービス
BRAVIDA HOLDING AB	5,701	2,390	25,337	312,157		資本財・サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	14,558	12,403	121,358	1,495,138	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	5	—	< 7.6% >	
(ノルウェー)				千ノルウェークローネ		
TGS NOPEC GEOPHYSICAL CO ASA	1,273	2,181	28,731	339,897		エネルギー
小 計	株 数 ・ 金 額	1,273	2,181	28,731	339,897	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 1.7% >	
(デンマーク)				千デンマーククローネ		
OSSUR HF	—	4,719	22,133	375,392		ヘルスケア
SIMCORP A/S	354	255	20,942	355,177		情報技術
小 計	株 数 ・ 金 額	354	4,974	43,076	730,569	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	2	—	< 3.7% >	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
HANSEN TECHNOLOGIES LTD	13,112	8,246	3,191	246,790		情報技術
IRESS LTD	—	2,590	2,626	203,129		情報技術
TECHNOLOGY ONE LTD	6,304	4,563	4,088	316,161		情報技術
IPH LTD	5,058	6,812	4,693	362,973		資本財・サービス
BRAVURA SOLUTIONS LTD	11,355	12,245	3,991	308,699		情報技術
小 計	株 数 ・ 金 額	35,831	34,457	18,592	1,437,752	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	5	—	< 7.3% >	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
GENTRACK GROUP LTD	7,686	—	—	—		情報技術
小 計	株 数 ・ 金 額	7,686	—	—	—	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	—	—	< —% >	
(インド)				千インドルピー		
ATA ENGINEERING LTD	1,298	975	197,869	280,975		資本財・サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	1,298	975	197,869	280,975	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 1.4% >	
合 計	株 数 ・ 金 額	141,305	116,637	—	16,285,192	
	銘柄 数 < 比 率 >	55	56	—	< 83.2% >	

(注) 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) 邦貨換算金額欄の< >内は、純資産総額に対する株式評価額の比率。

(注) 株数・評価額の単位未満は切捨て。

○投資信託財産の構成

(2020年12月7日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 18,510,269	% 93.2
コール・ローン等、その他	1,343,412	6.8
投資信託財産総額	19,853,681	100.0

(注) 金額の単位未満は切捨て。

(注) 当期末における外貨建純資産 (16,732,095千円) の投資信託財産総額 (19,853,681千円) に対する比率は84.3%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相場場の仲値により邦貨換算したものです。なお、12月7日における邦貨換算レートは、1米ドル=104.08円、1カナダドル=81.45円、1ブラジルレアル=20.29円、1ユーロ=126.25円、1イギリスポンド=139.74円、1スイスフラン=116.79円、1スウェーデンクローナ=12.32円、1ノルウェークローネ=11.83円、1デンマーククローネ=16.96円、1オーストラリアドル=77.33円、1インドルピー=1.42円です。

○特定資産の価格等の調査

(2019年12月7日～2020年12月7日)

該当事項はございません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年12月7日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	19,854,705,362
コール・ローン等	1,100,352,385
株式(評価額)	18,510,269,735
未収入金	224,397,793
未収配当金	19,685,449
(B) 負債	286,808,116
未払金	16,024,716
未払解約金	270,781,648
未払利息	1,752
(C) 純資産総額(A-B)	19,567,897,246
元本	15,450,767,127
次期繰越損益金	4,117,130,119
(D) 受益権総口数	15,450,767,127口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,665円

<注記事項>

(注) 元本の状況

期首元本額	22,643,515,949円
期中追加設定元本額	6,956,084,961円
期中一部解約元本額	14,148,833,783円

(注) 期末における元本の内訳

LM・グローバル・プレミア小型株ファンド(年1回決算型)	9,990,723,518円
LM・グローバル・プレミア小型株ファンド(年2回決算型)	5,460,043,609円

○損益の状況 (2019年12月7日～2020年12月7日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	263,907,621
受取配当金	260,820,324
受取利息	3,419,567
その他収益金	120
支払利息	△ 332,390
(B) 有価証券売買損益	1,123,314,933
売買益	3,511,770,709
売買損	△2,388,455,776
(C) 保管費用等	△ 9,940,965
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,377,281,589
(E) 前期繰越損益金	4,326,735,680
(F) 追加信託差損益金	1,146,196,084
(G) 解約差損益金	△2,733,083,234
(H) 計(D+E+F+G)	4,117,130,119
次期繰越損益金(H)	4,117,130,119

(注) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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。