

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成31年4月26日

【発行者名】 マルチ・マネージャー・アクセス
(Multi Manager Access)

【代表者の役職氏名】 メンバー・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ
クリスティアン・シェーン (Christian Schön)
メンバー・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ
マデュ・ラマチャンドラン (Madhu Ramachandran)

【本店の所在の場所】 ルクセンブルグ大公国、ルクセンブルグL - 1855、J.F.ケネディ通り33A
(33A avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg, Grand Duchy of
Luxembourg)

【代理人の氏名又は名称】 弁護士 三 浦 健
弁護士 大 西 信 治

【代理人の住所又は所在地】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所

【事務連絡者氏名】 弁護士 三 浦 健
弁護士 大 西 信 治
弁護士 江 橋 翔

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所

【電話番号】 03 (6212) 8316

【届出の対象とした募集(売出)外国投資証券に係る外国投資法人の名称】
マルチ・マネージャー・アクセス
- エマージング・マーケット・デッド
- US マルチ・クレジット
- ハイ・イールド
(Multi Manager Access
- Emerging Markets Debt
- US Multi Credit
- High Yield)

【届出の対象とした募集(売出)外国投資証券の形態及び金額】
記名式無額面投資証券
エマージング・マーケット・デッド
クラスF - a c c 投資証券
クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券
US マルチ・クレジット
クラスF - a c c 投資証券
クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券
ハイ・イールド
クラスF - a c c 投資証券
クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券
上限見込額は以下のとおりである。

エマージング・マーケット・デッド

クラスF - a c c 投資証券：11億9,760万米ドル(約1,329億円)を上限とする。

クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券

() 当初募集期間

1,000億円を上限とする。

() 継続募集期間

1,000億円を上限とする。

U S マルチ・クレジット

クラスF - a c c 投資証券：13億9,890万米ドル(約1,553億円)を上限とする。

クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券

() 当初募集期間

1,000億円を上限とする。

() 継続募集期間

1,000億円を上限とする。

ハイ・イールド

クラスF - a c c 投資証券：11億4,850万米ドル(約1,275億円)を上限とする。

クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券

() 当初募集期間

1,000億円を上限とする。

() 継続募集期間

1,000億円を上限とする。

(注1) 上限見込額は、便宜上、ファンドの投資証券の2018年12月末日現在の1口当たりの純資産価格または当初発行価格に基づいて算出されている。エマージング・マーケット・デッドクラスF - a c c 投資証券については119.76米ドル(約13,293円)、エマージング・マーケット・デッドクラスF - a c c 円ヘッジ投資証券については10,000円、U S マルチ・クレジットクラスF - a c c 投資証券については139.89米ドル(約15,528円)、U S マルチ・クレジットクラスF - a c c 円ヘッジ投資証券については10,000円、ハイ・イールドクラスF - a c c 投資証券については114.85米ドル(約12,748円)、ハイ・イールドクラスF - a c c 円ヘッジ投資証券については10,000円に1,000万口をそれぞれ乗じて算出した金額である。

(注2) 米ドルの円貨換算は、特に記載がない限り、2018年12月28日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=111.00円)による。

【縦覧に供する場所】

該当事項なし

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出しましたので、平成31年3月13日付をもって提出した有価証券届出書(以下「原届出書」といいます。)の関係情報を新たな情報により訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

なお、本訂正届出書のうち外貨数字の円換算については、直近の為替レートを用いておりますので、訂正前の換算レートとは異なります。

2【訂正箇所および訂正事項】

半期報告書に係る訂正

半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正内容は、以下のとおりです。

原届出書の下記事項については、半期報告書の記載内容と同一内容に更新または追加されます。

原届出書		半期報告書		訂正の方法
第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 1 外国投資法人の概況	(1) 主要な経営指標等の推移	1 外国投資法人の概況	(1) 主要な経営指標等の推移	追加 または 更新
	(5) 外国投資法人の出資総額		(2) 外国投資法人の出資総額	追加
	(6) 主要な投資主の状況		(3) 主要な投資主の状況	更新
3 投資リスク		2 外国投資法人の運用状況	(3) 投資リスク	追加 または 更新
5 運用状況	(1) 投資状況	2 外国投資法人の運用状況	(1) 投資状況	更新
	(3) 運用実績		(2) 運用実績	追加 または 更新
第2 財務ハイライト情報		4 外国投資法人の経理状況	(1) 資産及び負債の状況 「純資産計算書」 「運用計算書」 「重要な会計方針の要約」の注記	追加
第三部 外国投資法人の詳細情報 第1 外国投資法人の追加情報 2 役員状況		1 外国投資法人の概況	(4) 役員状況	更新
5 その他			(5) その他	更新
第4 関係法人の状況 1 資産運用会社の概況	(1) 名称、資本金の額及び事業の内容	3 資産運用会社の概況	(1) 名称及び資本金の額	更新
	(3) 大株主の状況		(2) 大株主の状況	更新
	(4) 役員状況		(3) 役員状況	更新
	(5) 事業内容及び営業の概況		(4) 事業内容及び営業の概況	更新
第5 外国投資法人の経理状況 1 財務諸表		4 外国投資法人の経理状況		追加
第6 販売及び買戻しの実績		5 販売及び買戻しの実績		追加

* 半期報告書の記載内容は、以下のとおりです。

[次へ](#)

1 外国投資法人の概況

マルチ・マネージャー・アクセス のサブ・ファンドであるエマージング・マーケット・デッド、U S マルチ・クレジットおよびハイ・イールド (以下、マルチ・マネージャー・アクセス を「本投資法人」、エマージング・マーケット・デッド、U S マルチ・クレジットおよび/またはハイ・イールドを個別にまたは総称して「ファンド」または「サブ・ファンド」ということがある。) の概況は以下のとおりである。

(1) 主要な経営指標等の推移

(エマージング・マーケット・デッド)

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	2017年1月末日 に終了する 中間会計年度末	2017年7月末日 に終了する 会計年度末	2018年1月末日 に終了する 中間会計年度末	2018年7月末日 に終了する 会計年度末	2019年1月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	- 39,722,245.01	251,219,775.17	247,749,693.78	- 230,820,085.68	- 1,772,841.39
(b) 経常利益金額 または経常損失金額	- 39,722,245.01	251,219,775.17	247,749,693.78	- 230,820,085.68	- 1,772,841.39
(c) 当期純利益金額 または当期純損失金額	- 39,722,245.01	251,219,775.17	247,749,693.78	- 230,820,085.68	- 1,772,841.39
(d) 出資総額 ⁽²⁾	3,407,282,085.58	3,961,608,683.51	4,325,634,831.02	4,860,620,178.24	4,815,514,601.02
(e) 発行済投資口総数 (クラスF - a c c 投資証券)	9,608,289.9090口	10,673,939.5500口	10,982,002.6930口	13,018,469.5970口	12,457,206.6330口
(f) 純資産額	3,407,282,085.58	3,961,608,683.51	4,325,634,831.02	4,860,620,178.24	4,815,514,601.02
(g) 資産総額	3,503,614,291.66	4,008,540,898.18	4,573,283,096.09	4,899,019,238.50	5,643,466,678.05
(h) 1口当たり純資産価格 (クラスF - a c c 投資証券)	116.02	121.90	126.40	122.25	124.82
(i) 1口当たり当期 純利益金額または 当期純損失金額 (クラスF - a c c 投資証券)	1.66	7.07	4.41	- 1.05	3.00
(j) 分配総額	6,141,795.22	6,141,795.22	5,994,441.30	5,994,441.30	9,576,575.17
(k) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	97.25%	98.83%	94.58%	99.22%	85.33%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾ (クラスF - a c c 投資証券)	13.95%	6.50%	8.95%	0.29%	- 1.25%

(1) 営業収益には投資収益および実現および未実現利益 (損失) を含めている。以下同じ。

(2) サブ・ファンドは変動資本を有する会社型投資信託であり、純資産総額を記載している。以下同じ。

(3) 自己資本利益率は、当該会計年度の1口当たり純資産価格の前年度に対する増減の比率であるが、当該会計年度に初めて当該投資証券が発行された場合には、当初募集価格に対する増減の比率で表すものとする。以下同じ。

(4) 「主要な経営指標等の推移 (e) 発行済投資口総数、(h) 1口当たり純資産価格、(i) 1口当たり当期純利益金額または当期純損失金額、(k) 1口当たり分配金額および(m) 自己資本利益率」は、日本で販売しているクラスのみ記載している。以下同じ。

(注1) サブ・ファンドにはクラスF - a c c 投資証券およびクラスF - a c c 円ヘッジ投資証券以外の投資証券も存在する。クラスB 投資証券は2018年7月20日にクラスF - a c c 投資証券に名称を変更した。クラスF - a c c 投資証券およびクラスF - a c c 円ヘッジ投資証券以外の投資証券は日本で販売されていないため、以下、「投資証券」というときは、クラスF - a c c 投資証券およびクラスF - a c c 円ヘッジ投資証券を指すものとする。エマージング・マーケット・デッドは2013年12月2日に運用を開始し、クラスB 投資証券 (現クラスF - a c c 投資証券) は2013年12月2日に運用を開始した。U S マルチ・クレジットは2007年11月27日に運用を開始し、クラスB 投資証券 (現クラスF - a c c 投資証券) は2007年11月27日に運用を開始した。ハイ・イールドは2016年4月13日に運用を開始し、クラスB 投資証券 (現クラスF - a c c 投資証券) は2016年4月13日に運用を開始した。なお、クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券は、2019年4月1日に募集を開始した。以下同じ。

(注2) 名称の一部に「F」を含むクラスの投資証券は、年次財務報告書が作成された後に、取締役会の提案を経て、定時投資主総会により、分配がなされるか否か、またその額が決定される。以下同じ。

(注3) 各取引に使用された1口当たりの純資産価格は、純資産価格の調整の結果、上記および財務書類に記載の価格と異なる場合がある (財務書類に対する注記1参照)。以下同じ。

(US マルチ・クレジット)

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	2017年1月末日 に終了する 中間会計年度末	2017年7月末日 に終了する 会計年度末	2018年1月末日 に終了する 中間会計年度末	2018年7月末日 に終了する 会計年度末	2019年1月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ^(1)	- 97,812,784.44	89,756,127.71	88,656,694.35	- 149,044,227.76	39,382,289.75
(b) 経常利益金額 または経常損失金額	- 97,812,784.44	89,756,127.71	88,656,694.35	- 149,044,227.76	39,382,289.75
(c) 当期純利益金額 または当期純損失金額	- 97,812,784.44	89,756,127.71	88,656,694.35	- 149,044,227.76	39,382,289.75
(d) 出資総額 ^(2)	3,135,144,814.25	4,000,760,877.51	4,738,767,059.74	4,684,064,365.96	4,554,018,506.46
(e) 発行済投資口総数 (クラス F - a c c 投資証券)	11,588,665.2130口	13,139,693.3440口	14,967,666.2130口	14,919,985.7850口	14,133,543.7510口
(f) 純資産額	3,135,144,814.25	4,000,760,877.51	4,738,767,059.74	4,684,064,365.96	4,554,018,506.46
(g) 資産総額	3,173,201,288.53	4,071,822,166.70	4,916,284,774.89	4,710,062,577.57	4,564,362,055.62
(h) 1口当たり純資産価格 (クラス F - a c c 投資証券)	136.51	140.30	140.26	139.19	142.56
(i) 1口当たり当期 純利益金額または 当期純損失金額 (クラス F - a c c 投資証券)	- 2.01	1.86	- 0.08	- 1.16	3.35
(j) 分配総額	2,559,850.38	2,559,850.38	3,881,773.83	3,881,773.83	6,219,391.52
(k) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	98.80%	98.25%	96.39%	99.45%	99.77%
(m) 自己資本利益率 ^(3) (クラス F - a c c 投資証券)	3.36%	1.34%	2.75%	- 0.79%	1.64%

(ハイ・イールド)

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	2017年1月末日 に終了する 中間会計年度末	2017年7月末日 に終了する 会計年度末	2018年1月末日 に終了する 中間会計年度末	2018年7月末日 に終了する 会計年度末	2019年1月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	134,470,655.36	473,914,928.97	156,161,105.16	-21,517,501.04	-61,547,460.22
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	134,470,655.36	473,914,928.97	156,161,105.16	-21,517,501.04	-61,547,460.22
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	134,470,655.36	473,914,928.97	156,161,105.16	-21,517,501.04	-61,547,460.22
(d) 出資総額 ⁽²⁾	4,701,476,265.88	3,202,987,682.90	3,496,170,503.17	3,391,096,914.21	4,192,199,174.56
(e) 発行済投資口総数 (クラスF - a c c 投資証券)	13,271,728.8130口	8,919,728.0640口	9,266,454.6250口	9,338,538.8570口	11,349,743.1350口
(f) 純資産額	4,701,476,265.88	3,202,987,682.90	3,496,170,503.17	3,391,096,914.21	4,192,199,174.56
(g) 資産総額	4,812,127,449.67	4,435,502,587.74	3,676,148,206.18	3,414,008,751.29	4,233,420,506.64
(h) 1口当たり純資産価格 (クラスF - a c c 投資証券)	109.69	115.38	118.04	118.11	119.17
(i) 1口当たり当期 純利益金額または 当期純損失金額 (クラスF - a c c 投資証券)	5.06	15.08	2.57	2.64	0.75
(j) 分配総額	1,853,836.62	1,853,836.62	7,276,818.73	7,276,818.73	6,428,148.63
(k) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	97.70%	72.21%	95.10%	99.33%	98.69%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾ (クラスF - a c c 投資証券)	9.69%	10.86%	7.61%	2.37%	0.96%

(2) 外国投資法人の出資総額

2019年2月末日現在の各サブ・ファンドの出資総額および各クラス投資証券の発行済投資証券総数は以下のとおりである。

(エマージング・マーケット・デッド)

	出資総額		発行済投資証券総数 (口)	
	米ドル	百万円	クラスF - a c c 投資証券	
2019年2月末日現在	5,031,455,360.43	557,837		12,780,670.5270

(US マルチ・クレジット)

	出資総額		発行済投資証券総数 (口)	
	米ドル	百万円	クラスF - a c c 投資証券	
2019年2月末日現在	4,651,960,530.04	515,763		14,243,760.9240

(ハイ・イールド)

	出資総額		発行済投資証券総数 (口)	
	米ドル	百万円	クラスF - a c c 投資証券	
2019年2月末日現在	4,238,802,567.82	469,956		11,323,477.2860

(3) 主要な投資主の状況

1993年4月5日付ルクセンブルグ法第41条により課されるルクセンブルグ銀行機密規定(改訂済)により、当該サブ・ファンドの主要な投資主に関する情報は公開できない。

(4) 役員状況

(2019年2月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有株式
アンドレアス・ エバーソルド (Andreas Aebersold)	チェアマン・ オブ・ザ・ ボード・オブ・ ディレクターズ	ユービーエス・スイス・エイ・ジー、 エグゼクティブ・ディレクター	該当なし
マデュ・ラマチャンドラン (Madhu Ramachandran)	メンバー・オブ・ ザ・ボード・オブ・ ディレクターズ	UBSヨーロッパSE ルクセンブル グ支店 エグゼクティブ・ディレクター	該当なし
クリスティアン・シェーン (Christian Schön)	メンバー・オブ・ ザ・ボード・オブ・ ディレクターズ	UBSヨーロッパSE ルクセンブル グ支店 エグゼクティブ・ディレクター	該当なし
ジェレミー・ステンハム (Jeremy Stenham)	メンバー・オブ・ ザ・ボード・オブ・ ディレクターズ	英国ロンドン・インディペンデント・ ディレクター 公認会計士	該当なし

(注) 本投資法人に従業員はいない。本投資法人の独立監査法人はプライスウォーターハウスクーパース・ソシエテ・コーペラティブ(PricewaterhouseCoopers, Société coopérative)である。

(5) その他

a. 定款の変更

本投資法人の定款は、商事会社に関する1915年8月10日法(改正済み)によって定められている定足数および過半数の要件に従って、投資主総会において追加または変更することができる。

修正版は、ルクセンブルグの官報、ルクセンブルグの日刊紙、および必要な場合は本投資法人の投資証券を販売するそれぞれの国の公的刊行物において公告し、投資主総会で承認を受けた後、すべての投資主を法的に拘束する。

日本の投資主に対しては、定款の重要事項の変更は、公告または通知書によって知らされる。

b. 事業譲渡または事業譲受

投資法人、サブ・ファンドおよび投資証券クラスの解散および合併

本投資法人、サブ・ファンドおよび投資証券クラスの解散

定足数および必要な過半数に関する法律要件を満たす投資主総会により、いつでも本投資法人を解散することができる。

本投資法人の純資産総額が所定の最低資本金の3分の2または4分の1以下になる場合、取締役会は、本投資法人を清算するか否かについて投資主総会の採決を求めなければならない。本投資法人が清算する場合、債務の履行は一名以上の清算人が実行するものとする。本投資法人が解散する場合、清算は投資主総会で指名される一名以上の清算人が実行するものとする。当該総会では清算人の職務および報酬の範囲も決定する。清算人は投資主の最善の利益にかなうように本投資法人の資産を売却し、サブ・ファンドの投資証券クラスの清算による正味収入を投資主の保有数に比例して当該サブ・ファンドの投資証券クラスの投資主に配分するものとする。投資主に分配できない清算収入は取得時効期間の満了までルクセンブルグの供託金庫(Caisse de Consignation)に滞りなく預託される。

サブ・ファンドもしくは投資証券クラスの純資産総額がサブ・ファンドの投資証券クラスを経済的に合理的に管理できない水準(1,000万ユーロまたはサブ・ファンドについての他の通貨建ての相当する金額と見積もられている。)未満に落ち込んだ場合、または政治もしくは経済の状況の変化がある場合、取締役会は、一もしくは複数のサブ・ファンドの投資証券クラスの清算を要求することができる。

取締役会の権利にかかわらず、取締役会の提案に基づいて、サブ・ファンドの投資主総会において、サブ・ファンドが発行した投資証券を回収し、投資主に対して投資主が保有する投資証券の純資産価額を返還することにより、本投資法人の資本を減額することができる。純資産価額は上記の決定が効力を発生する日に計算し、サブ・ファンドの資産の処分によって生じた代金および清算に起因する費用を織り込むものとする。

投資主総会または取締役会による投資証券の回収の決定は、書留郵便で送付されるか、またはルクセンブルグの官報、ならびにルクセンブルグの日刊紙および必要があれば本投資法人の投資証券を販売する各国の特定の公的刊行物を通じて関係するサブ・ファンドの投資主に公表される。買戻しのために投資主により呈示された未精算の投資証券の対価は、時効期間の満了まで、ルクセンブルグの供託金庫(Caisse de Consignation)に預託されるものとする。

サブ・ファンド同士またはサブ・ファンドとその他のUCIの合併

前記「本投資法人、サブ・ファンドおよび投資証券クラスの解散」に記載される状況と同じ状況の場合、取締役会は、2010年法の規定に従い、サブ・ファンドの投資証券の消却および対応する投資主への他のサブ・ファンドまたは他のUCITSの投資証券の割当てを決定することができる。本項において取締役会が付与された権限にかかわらず、本項に記載されたファンド同士を合併する決定もまた、関連サブ・ファンドの投資主総会において採択することができる。

合併の決定は、ルクセンブルグの日刊紙に公告するか書留郵便により、投資主に通知される。かかる決定の公告から30日以内に投資主は保有する投資証券の一部または全部を、「有価証券届出書 第三部 外国投資法人の詳細情報 第2 手続等 2 買戻し手続等 海外における買戻し手続等」に記載するガイドラインに従って、無料で純資産価額で買い戻す権限を有する。買戻しのために提出されなかった投資証券は、かかる決定が効力を生じた日において計算された関連するサブ・ファンドの投資証券の純資産額に基づいて交換される。

投資主総会

サブ・ファンドの清算および合併のいずれの場合についても、投資主総会の定足数は要求されず、決定は、総会に出席する投資主または委任状により投票を行う投資主の単純多数によって承認することができる。

c . 出資の状況その他の重要事項

該当事項なし。

d . 訴訟事件その他の重要事項

半期報告書提出前6か月以内において、訴訟事件その他投資法人に重要な影響を及ぼすことが予想される事実はない。

[次へ](#)

2 外国投資法人の運用状況

(1) 投資状況

資産別および地域別の投資状況

(エマージング・マーケット・デッド)

(2019年2月末日現在)

資産の種類	国・地域名	時価合計(米ドル)	投資比率 (%)
債券	メキシコ	261,273,676.75	5.09
	トルコ	247,548,064.72	4.83
	ケイマン諸島	236,053,323.22	4.60
	アルゼンチン	204,905,128.08	4.00
	オランダ	199,759,137.90	3.89
	インドネシア	162,400,668.58	3.17
	コロンビア	157,823,403.09	3.08
	ナイジェリア	124,931,381.24	2.44
	エクアドル	110,409,574.94	2.15
	ドミニカ共和国	106,648,455.24	2.08
	チリ	105,739,206.77	2.06
	エジプト	104,997,990.70	2.05
	中国	99,901,653.82	1.95
	南アフリカ	98,967,762.62	1.93
	アラブ首長国連邦	96,580,354.69	1.88
	ブラジル	95,053,929.18	1.85
	ルクセンブルグ	89,315,887.95	1.74
	ウクライナ	86,047,172.51	1.68
	香港	82,642,152.12	1.61
	英領ヴァージン諸島	82,564,351.05	1.61
	ペルー	79,207,485.49	1.54
	カタール	76,385,628.93	1.49
	イギリス	70,875,084.26	1.38
	スリランカ	65,977,980.23	1.29
	ロシア連邦	64,338,572.15	1.25
	サウジアラビア	62,550,020.24	1.22
	カザフスタン	60,759,849.56	1.18
	オマーン	57,743,808.52	1.13
	ハンガリー	55,458,779.19	1.08
	ベネズエラ	55,111,557.16	1.07
	コートジボワール	49,692,663.46	0.97
アゼルバイジャン	49,455,642.50	0.96	
シンガポール	48,268,798.57	0.94	
モンゴル	46,972,039.07	0.92	
レバノン	46,679,917.49	0.91	

パラグアイ	42,298,473.18	0.82
インド	39,601,747.80	0.77
ルーマニア	39,252,331.11	0.77
米国	38,467,466.74	0.75
パナマ	37,725,653.91	0.74
クウェート	37,089,431.25	0.72
コスタリカ	34,460,937.57	0.67
バミューダ	32,502,639.33	0.63
マレーシア	32,475,271.22	0.63
韓国	31,508,557.04	0.61
ベラルーシ	31,045,346.50	0.61
アンゴラ	30,324,647.50	0.59
ガーナ	29,949,060.00	0.58
グアテマラ	28,712,705.16	0.56
モーリシャス	27,880,800.00	0.54
ウルグアイ	27,069,372.76	0.53
クロアチア	25,463,179.12	0.50
ケニア	24,587,972.50	0.48
パキスタン	23,910,841.52	0.47
フィリピン	22,680,327.55	0.44
バーレーン	22,650,496.29	0.44
アイルランド	22,461,295.57	0.44
セルビア	22,214,452.50	0.43
リトアニア	21,177,495.03	0.41
エルサルバドル	20,785,024.91	0.41
ザンビア	20,434,102.50	0.40
ジャマイカ	18,951,949.87	0.37
オーストリア	17,847,074.13	0.35
ガボン	17,084,720.50	0.33
チュニジア	16,690,137.86	0.33
マケドニア(旧ユーロスラビア)	16,401,164.56	0.32
ホンデュラス	15,792,574.41	0.31
カナダ	15,614,176.54	0.30
モロッコ	15,482,050.25	0.30
イスラエル	15,280,900.24	0.30
ポーランド	14,802,110.85	0.29
マカオ	13,890,042.71	0.27
タイ	12,944,478.42	0.25
バハマ	12,499,888.93	0.24
ヨルダン	11,267,320.00	0.22
マン島	10,641,562.05	0.21
セネガル	8,780,263.44	0.17

	ナミビア	8,032,003.75	0.16
	イラク	7,824,220.00	0.15
	国際機関	6,966,531.40	0.14
	ノルウェー	6,834,000.00	0.13
	エチオピア	6,664,155.00	0.13
	ボリビア	5,863,672.44	0.11
	ウズベキスタン	4,978,984.48	0.10
	アルバニア	4,972,991.57	0.10
	トリニダード・アンド・トバゴ	4,949,000.00	0.10
	スリナム	3,879,328.32	0.08
	スペイン	3,205,950.00	0.06
	トーゴ	2,904,237.50	0.06
	タジキスタン	2,706,625.00	0.05
	マーシャル諸島	2,584,481.25	0.05
	グルジア	2,199,575.00	0.04
	アルメニア	1,699,425.00	0.03
	パプアニューギニア	1,398,140.00	0.03
	キュラソー	1,390,350.00	0.03
	ベトナム	1,357,642.00	0.03
	ベリーズ	1,044,912.50	0.02
	小計	4,725,197,370.52	92.13
従来型 オプション	ルクセンブルグ	28,106.24	0.00
	アイルランド	3,189.25	0.00
	小計	31,295.49	0.00
株式	ブラジル	962,154.95	0.02
	コロンビア	818,908.70	0.02
	小計	1,781,063.65	0.03
ポートフォリオ合計		4,727,009,729.66	92.17
現金・その他資産(負債控除後)		401,730,266.05	7.83
資産総額		5,128,739,995.71	100.00
負債総額		97,284,635.28	1.90
合計 (純資産総額)		5,031,455,360.43 (約557,837百万円)	98.10

(注) 投資比率とは、サブ・ファンドの資産総額に対する当該資産の時価の比率をいう。以下同じ。

(U S マルチ・クレジット)

(2019年 2 月末日現在)

資産の種類	国・地域名	時価合計 (米ドル)	投資比率 (%)
債券	米国	3,517,369,278.22	74.65
	イギリス	206,155,718.47	4.38
	カナダ	142,786,709.90	3.03
	オランダ	87,118,949.10	1.85
	アイルランド	60,536,358.31	1.28
	日本	50,130,315.72	1.06
	フランス	49,424,619.52	1.05
	オーストラリア	38,222,330.05	0.81
	スイス	24,221,890.05	0.51
	中国	22,606,362.26	0.48
	ガンジー	22,182,169.59	0.47
	バミューダ	21,932,076.69	0.47
	スペイン	18,668,763.18	0.40
	ケイマン諸島	16,672,907.44	0.35
	ルクセンブルグ	13,182,602.62	0.28
	韓国	11,060,476.72	0.23
	ノルウェー	10,574,625.40	0.22
	香港	9,068,149.26	0.19
	スウェーデン	8,150,070.32	0.17
	チリ	6,582,532.90	0.14
	デンマーク	6,117,064.47	0.13
	フィンランド	5,302,960.82	0.11
	イタリア	5,074,115.52	0.11
	ニュージーランド	4,891,398.35	0.10
	メキシコ	4,862,770.00	0.10
	ドイツ	3,674,271.26	0.08
	キュラソー	3,488,550.00	0.07
	アラブ首長国連邦	3,247,498.75	0.07
	ブラジル	2,773,597.50	0.06
	ジャージー	2,240,486.25	0.05
	インド	1,951,297.01	0.04
	カタール	1,859,927.50	0.04
サウジアラビア	1,089,360.00	0.02	
ペルー	980,334.00	0.02	
マカオ	810,883.60	0.02	
小計		4,385,011,420.75	93.07

モーゲージ	米国	46,493,676.65	0.99
担保証券 /	ケイマン諸島	34,483,386.95	0.73
資産担保証券 /			
その他割引債	小計	80,977,063.60	1.72
短期金融商品	米国	18,496,830.34	0.39
株式	米国	338,983.05	0.01
ポートフォリオ合計		4,484,824,297.74	95.19
現金・その他資産(負債控除後)		226,779,010.10	4.81
資産総額		4,711,603,307.84	100.00
負債総額		59,642,777.80	1.27
合計 (純資産総額)		4,651,960,530.04 (約515,763百万円)	98.73

(ハイ・イールド)

(2019年2月末日現在)

資産の種類	国・地域名	時価合計 (米ドル)	投資比率 (%)
債券	米国	2,246,339,479.95	52.35
	オランダ	316,630,150.04	7.38
	フランス	305,787,381.34	7.13
	ルクセンブルグ	182,585,111.85	4.26
	カナダ	173,677,760.23	4.05
	ドイツ	154,897,632.90	3.61
	イギリス	144,144,824.21	3.36
	イタリア	117,951,415.63	2.75
	アイルランド	58,928,138.78	1.37
	スペイン	57,386,448.29	1.34
	スウェーデン	55,280,640.24	1.29
	ケイマン諸島	30,698,410.64	0.72
	デンマーク	26,074,971.40	0.61
	ジャージー	20,000,354.49	0.47
	オーストラリア	17,976,487.44	0.42
	バミューダ	16,998,720.86	0.40
	日本	16,106,437.41	0.38
	フィンランド	15,184,198.08	0.35
	オーストリア	14,683,923.86	0.34
	チェコ共和国	11,237,425.49	0.26
	ベルギー	10,758,324.46	0.25
	メキシコ	9,139,221.85	0.21
	ポルトガル	8,036,728.24	0.19
	スイス	5,425,636.62	0.13
	ルーマニア	4,948,701.65	0.12
	ノルウェー	2,910,306.00	0.07
	バハマ	1,907,603.25	0.04
	ジャマイカ	1,700,750.00	0.04
	ガーンジー	1,581,018.89	0.04
	マン島	1,495,373.64	0.03
	ハンガリー	1,015,684.25	0.02
	英領ヴァージン諸島	433,708.80	0.01
	ニュージーランド	264,162.00	0.01
キュラソー	243,750.00	0.01	
小計	4,032,430,882.78	93.98	

モーゲージ 担保証券/ 資産担保証券/ その他割引債	ルクセンブルグ	3,114,081.59	0.07
短期金融商品	米国	998,696.53	0.02
株式	米国	175,776.20	0.00
ポートフォリオ合計		4,036,719,437.10	94.08
現金・その他資産(負債控除後)		254,094,338.82	5.92
資産総額		4,290,813,775.92	100.00
負債総額		52,011,208.10	1.21
合計 (純資産総額)		4,238,802,567.82 (約469,956百万円)	98.79

(2) 運用実績

純資産等の推移

2019年2月末日および同日前1年以内における各月末の総資産および純資産の推移は次のとおりである。

(エマージング・マーケット・デッド)

	資産総額		純資産総額		1口当たり純資産価格	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	(クラスF - a c c 投資証券)	
					米ドル	円
2018年3月末日	6,068,600	672,826	6,013,945	666,766	124.22	13,772
4月末日	5,899,187	654,043	5,844,554	647,986	122.85	13,620
5月末日	5,879,374	651,846	5,670,241	628,660	121.17	13,434
6月末日	4,866,551	539,555	4,806,483	532,895	119.31	13,228
7月末日	4,899,019	543,154	4,860,620	538,897	122.25	13,554
8月末日	4,812,797	533,595	4,755,896	527,286	119.57	13,257
9月末日	5,968,892	661,771	5,846,336	648,183	121.44	13,464
10月末日	5,649,383	626,347	5,547,188	615,017	119.33	13,230
11月末日	5,496,560	609,404	5,443,307	603,499	118.56	13,145
12月末日	5,480,284	607,599	5,446,114	603,811	119.76	13,278
2019年1月末日	5,643,467	625,691	4,815,515	533,896	124.82	13,839
2月末日	5,128,740	568,623	5,031,455	557,837	126.14	13,985

(注1) エマージング・マーケット・デッドは2013年12月2日に運用を開始し、クラスB 投資証券(現クラスF - a c c 投資証券)は2013年12月2日に運用を開始した。

(注2) クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券は2019年4月1日に募集を開始した。以下同じ。

(注3) クラスB 投資証券は2018年7月20日にクラスF - a c c 投資証券に名称を変更した。以下、同じ。

(US マルチ・クレジット)

	資産総額		純資産総額		1口当たり純資産価格	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	(クラスF - a c c 投資証券)	
					米ドル	円
2018年3月末日	4,817,360	534,101	4,755,910	527,288	138.85	15,394
4月末日	4,750,041	526,637	4,723,807	523,728	138.25	15,328
5月末日	4,813,192	533,639	4,719,611	523,263	138.84	15,393
6月末日	4,800,566	532,239	4,671,432	517,922	138.50	15,355
7月末日	4,710,063	522,205	4,684,064	519,322	139.19	15,432
8月末日	4,752,227	526,879	4,730,527	524,474	140.01	15,523
9月末日	4,739,389	525,456	4,707,628	521,935	139.69	15,487
10月末日	4,563,439	505,948	4,536,614	502,974	138.94	15,404
11月末日	4,543,183	503,703	4,484,873	497,238	138.68	15,375
12月末日	4,502,042	499,141	4,481,337	496,846	139.89	15,510
2019年1月末日	4,564,362	506,051	4,554,019	504,904	142.56	15,806
2月末日	4,711,603	522,375	4,651,961	515,763	143.13	15,869

(注) クラスB 投資証券は2018年7月20日にクラスF - a c c 投資証券に名称を変更した。以下、同じ。

(ハイ・イールド)

	資産総額		純資産総額		1口当たり純資産価格	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	(クラスF - a c c 投資証券)	
					米ドル	円
2018年3月末日	3,706,057	410,891	3,459,322	383,535	116.50	12,916
4月末日	3,685,928	408,659	3,437,586	381,125	117.25	13,000
5月末日	3,674,207	407,359	3,377,911	374,509	116.63	12,931
6月末日	3,452,550	382,784	3,384,039	375,188	116.60	12,927
7月末日	3,414,009	378,511	3,391,097	375,971	118.11	13,095
8月末日	3,447,637	382,240	3,422,323	379,433	118.77	13,168
9月末日	4,581,966	508,003	4,416,074	489,610	119.36	13,233
10月末日	4,310,241	477,876	4,230,874	469,077	117.91	13,073
11月末日	4,540,289	503,382	4,138,157	458,797	116.50	12,916
12月末日	4,073,796	451,662	4,051,188	449,155	114.85	12,733
2019年1月末日	4,233,421	469,359	4,192,199	464,789	119.17	13,212
2月末日	4,290,814	475,723	4,238,803	469,956	121.10	13,426

(注1) ハイ・イールドは2016年4月13日に運用を開始し、クラスF - a c c 投資証券は2016年4月13日に運用を開始した。

(注2) クラスB 投資証券は2018年7月20日にクラスF - a c c 投資証券に名称を変更した。以下、同じ。

ファンドのクラスF - a c c 投資証券は、ルクセンブルグ証券取引所に上場されている。同取引所での実質的な取引実績はない。

分配の推移

クラスF - a c c 投資証券

該当事項なし。

自己資本利益率(収益率)の推移

2019年2月末日までの1年間における自己資本利益率(収益率)は次のとおりである。

(エマージング・マーケット・デッド)

収益率(%) (注)
(クラスF - a c c 投資証券)
1.55

(US マルチ・クレジット)

収益率(%) (注)
(クラスF - a c c 投資証券)
3.08

(ハイ・イールド)

収益率(%) (注)
(クラスF - a c c 投資証券)
3.47

(注1) 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$

a = 2019年2月末日の1口当たり純資産価格(当該期間の分配金の合計金額を加えた金額)

b = 2018年2月末日の1口当たり純資産価格(分配落の額)。

(注2) クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券は、2019年4月1日に募集を開始した。

(3) 投資リスク

当中間計算期間において、2019年3月13日提出の有価証券届出書「第二部 ファンド情報 第1
ファンドの状況 3 投資リスク」に記載される投資リスクについて、重要な変更はない。

本投資法人が将来にわたり営業活動を継続するにあたり重要な疑義を生じさせるような事象または
状況、その他本投資法人の経営に重要な影響を及ぼす事象は、半期報告書提出日現在、存在しな
い。

[次へ](#)

3 資産運用会社の概況

(1) 名称及び資本金の額

UBSファンド・マネジメント(ルクセンブルグ)エス・エイ(「管理会社」)

資本金(株主資本)の額

2019年2月末日現在の株主資本総額は、13,000,000ユーロ(約16億円)

(注)ユーロの円貨換算は、便宜上、2019年2月28日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1ユーロ=126.09円)による。

ユービーエス・スイス・エイ・ジー(「投資運用会社」)

資本金(株主資本)の額

2019年2月末日現在の株主資本総額は、10,000,000スイスフラン(約11億円)

(注)スイスフランの円貨換算は、便宜上、2019年2月28日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1スイスフラン=110.84円)による。

(2) 大株主の状況

UBSファンド・マネジメント(ルクセンブルグ)エス・エイ

(2019年2月末日現在)

名 称	住 所	所有株式数 (株)	比率 (%)
ユービーエス・アセット・ マネジメント・エイ・ジー (UBS Asset Management AG)	バーンホフ・シュトラッセ45、 CH-8001 チューリッヒ、スイス	6,500	100

ユービーエス・スイス・エイ・ジー

(2019年2月末日現在)

名 称	住 所	所有株式数 (株)	比率 (%)
ユービーエス・エイ・ジー (UBS AG)	バーンホフ・シュトラッセ45、 CH-8001 チューリッヒ、スイス	100,000,000	100

(3) 役員状況

UBSファンド・マネジメント(ルクセンブルグ) エス・エイ

(2019年2月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有株式
アンドレ・ミュラー・ ウェグナー (André Müller-Wegner)	チェアマン	ユービーエス・エイ・ジー、バー ゼル・アンド・チューリッヒ、ス イス、マネージング・ディレク ター	該当なし
ギルバート・シントゲン (Gilbert Schintgen)	ディレクター / ボード・メンバー	ルクセンブルグ、マネージング・ ディレクター	該当なし
パスカル・キストラ (Pascal Kistler)	ディレクター / ボード・メンバー	UBS ビジネス・ソリューション ズ・エイ・ジー、スイス、チュ ーリッヒ、マネージング・ディレ クター	該当なし
アンドレアス・シュラター (Andreas Schlatter)	ヴァイス・チェア マン	スイス、キュッティンゲン、イン ディペンデント・ディレクター、 数学者(博士)	該当なし

ユービーエス・スイス・エイ・ジー

(2019年2月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有ユー ビーエス・ グループ・ エイ・ジー 株式(2018年 12月31日現 在)
ルーカス・ゲーヴィラー (Lukas Gähwiler)	チェアマン	2017年4月21日就任	非公開
セルジオ・エルモッティ (Sergio Ermotti)	ディレクター / ボード・メンバー	2017年4月21日就任	3,473,196株
フベルト・エミル・マルク ス・アケーマン (Hubert Emil Markus Achermann)	ディレクター / ボード・メンバー	2015年6月21日就任	非公開
ダニエル・ジェイ・クリティ ン (Daniel J. Crittin)	ディレクター / ボード・メンバー	2016年4月25日就任	非公開
ガブリエラ・フーバー (Gabriela Huber)	ヴァイス・チェア マン	2015年6月12日就任	非公開
クリスチャン・エッカード・ ブルーム (Christian Eckehard Bluhm)	ディレクター / ボード・メンバー	2016年4月25日就任	259,745株

(4) 事業の内容及び営業の概況

UBSファンド・マネジメント(ルクセンブルグ)エス・エイ

管理会社は、本投資法人と管理会社契約を締結し、当該契約に詳述された業務を遂行する。

2019年2月末日現在、管理会社は以下のとおり、326本の投資信託/投資法人の管理・運用を行っている。

国別(設立国)	種類別(基本的性格)	本数	純資産額の合計(通貨別)
ルクセンブルグ	オープン・エンド型 投資信託/投資法人	295	612,308,762.68オーストラリア・ドル
			3,390,457,166.56カナダ・ドル
			11,236,364,948.86スイス・フラン
			990,994,406.92中国元
			956,620,100.38デンマーク・クローネ
			33,439,529,441.09ユーロ
			1,148,891,783.35英ポンド
			428,442,303.95香港ドル
			256,903,083,649.65日本円
			76,175,517.58シンガポール・ドル
			96,632,398,816.34米ドル
アイルランド	オープン・エンド型 投資信託/投資法人	31	292,582,801.86オーストラリア・ドル
			652,593,372.90スイス・フラン
			2,036,781,054.49ユーロ
			1,533,313,613.84英ポンド
			9,544,103,918.51米ドル

ユービーエス・スイス・エイ・ジー

ユービーエス・スイス・エイ・ジーは、本投資法人との間で、投資運用契約を締結している。

2018年12月末日現在、ユービーエス・スイス・エイ・ジーは以下の89本のファンドを運用している。

国別(設立国)	種類別(基本的性格)	本数	純資産額の合計(通貨別)
スイス (ポートフォリオ・マネジャー)	オープン・エンド型ファンド	5	24億スイスフラン
スイス (共同ポートフォリオ・マネ ジャー)	オープン・エンド型ファンド	9	39億スイスフラン
ケイマン諸島 (ポートフォリオ・マネジャー)	ヘッジ・ファンド	5	91億スイスフラン
ルクセンブルグ (ポートフォリオ・マネジャー)	オープン・エンド型ファンド	39	267億スイスフラン
ルクセンブルグ (共同ポートフォリオ・マネ ジャー)	オープン・エンド型ファンド	31	129億スイスフラン

(注)一部のファンドについては、ユービーエス・スイス・エイ・ジーは、管理会社の選定およびアセット・アロケーションについてのみ責任を負っている。

[次へ](#)

4 外国投資法人の経理状況

- a . ファンドの日本語の中間財務書類は、ルクセンブルグにおける法令に準拠して作成された原文の中間財務書類を翻訳したものである。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。
- b . ファンドの原文の中間財務書類は、マルチ・マネージャー・アクセス および全てのサブ・ファンドにつき一括して作成されている。日本語の作成にあたっては、関係するサブ・ファンドに関連する部分のみを翻訳している。なお、各サブ・ファンドには下記のクラス投資証券以外のクラス投資証券も存在するが、本書においては下記のクラス投資証券に関する部分を抜粋して日本語に記載している。
- エマージング・マーケット・デッド
クラスF - a c c 投資証券
 - US マルチ・クレジット
クラスF - a c c 投資証券
 - ハイ・イールド
クラスF - a c c 投資証券
- c . ファンドの原文の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。
- d . 原文の中間財務書類は、米ドルで表示されている。日本語の中間財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円による金額は、2019年2月28日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル=110.87円）で換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

(1) 資産及び負債の状況

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド
純資産計算書

2019年1月31日現在

	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	4,762,491,565.90	528,017,440
投資有価証券、未実現評価(損)益	(82,782,832.69)	(9,178,133)
投資有価証券合計(注1)	4,679,708,733.21	518,839,307
現金預金、要求払預金および預託金勘定	219,433,980.41 *	24,328,645
その他の流動資産(委託証拠金)	2,559,038.08	283,721
投資有価証券売却未収金(注1)	389,214,431.56	43,152,204
発行未収金	299,434,705.78	33,198,326
有価証券に係る未収利息	67,903,908.05	7,528,506
金融先物に係る未実現(損)益(注1)	1,659,629.67	184,003
先渡為替契約に係る未実現(損)益(注1)	(17,339,552.73)	(1,922,436)
スワップに係る未実現(損)益(注1)	891,804.02	98,874
資産合計	5,643,466,678.05	625,691,151
負 債		
当座借越	(849,127.34)	(94,143)
投資有価証券購入未払金(注1)	(43,036,750.26)	(4,771,485)
買戻未払金	(780,299,858.62)	(86,511,845)
報酬引当金(注2)	(3,576,593.83)	(396,537)
年次税引当金(注3)	(41,466.95)	(4,597)
その他の手数料および報酬に係る引当金(注2)	(148,280.03)	(16,440)
引当金合計	(3,766,340.81)	(417,574)
負債合計	(827,952,077.03)	(91,795,047)
期末現在純資産	4,815,514,601.02	533,896,104

* 2019年1月31日現在、U B SヨーロッパSEに対する52,566.31米ドルの現金が、取引相手方に対する担保となっている。

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - U S マルチ・クレジット
純資産計算書

2019年1月31日現在

	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	4,446,369,840.94	492,969,024
投資有価証券、未実現評価(損)益	(56,611,040.78)	(6,276,466)
投資有価証券合計(注1)	4,389,758,800.16	486,692,558
現金預金、要求払預金および預託金勘定	121,315,756.70	13,450,278
その他の流動資産(委託証拠金)	1,377,598.50	152,734
投資有価証券売却未収金(注1)	10,943,753.95	1,213,334
発行未収金	8,956,627.74	993,021
有価証券に係る未収利息	40,913,695.80	4,536,101
金融先物に係る未実現(損)益(注1)	1,366,740.53	151,531
先渡為替契約に係る未実現(損)益(注1)	(10,270,917.76)	(1,138,737)
資産合計	4,564,362,055.62	506,050,821
負 債		
当座借越に係る未払利息	(5,115.43)	(567)
投資有価証券購入未払金(注1)	(5,266,662.06)	(583,915)
買戻未払金	(2,939,668.03)	(325,921)
報酬引当金(注2)	(1,981,041.90)	(219,638)
年次税引当金(注3)	(39,215.17)	(4,348)
その他の手数料および報酬に係る引当金(注2)	(111,846.57)	(12,400)
引当金合計	(2,132,103.64)	(236,386)
負債合計	(10,343,549.16)	(1,146,789)
期末現在純資産	4,554,018,506.46	504,904,032

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

純資産計算書

2019年1月31日現在

	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	4,114,922,428.88	456,221,450
投資有価証券、未実現評価(損)益	(81,746,218.98)	(9,063,203)
投資有価証券合計(注1)	4,033,176,209.90	447,158,246
現金預金、要求払預金および預託金勘定	126,306,875.17 *	14,003,643
その他の流動資産(委託証拠金)	13,212,891.23	1,464,913
投資有価証券売却未収金(注1)	9,296,194.78	1,030,669
発行未収金	8,708,404.27	965,501
有価証券に係る未収利息	62,935,487.33	6,977,657
その他の未収金	1.35	0
金融先物に係る未実現(損)益(注1)	(4,531,844.40)	(502,446)
オプションに係る未実現(損)益、先物型	(41,422.94)	(4,593)
先渡為替契約に係る未実現(損)益(注1)	(16,606,960.94)	(1,841,214)
スワップに係る未実現(損)益(注1)	964,670.89	106,953
資産合計	4,233,420,506.64	469,359,332
負 債		
当座借越	(7,544,020.50)	(836,406)
投資有価証券購入未払金(注1)	(24,668,801.08)	(2,735,030)
買戻未払金	(6,540,100.29)	(725,101)
報酬引当金(注2)	(2,300,672.46)	(255,076)
年次税引当金(注3)	(36,099.51)	(4,002)
その他の手数料および報酬に係る引当金(注2)	(131,638.24)	(14,595)
引当金合計	(2,468,410.21)	(273,673)
負債合計	(41,221,332.08)	(4,570,209)
期末現在純資産	4,192,199,174.56	464,789,122

* 2019年1月31日現在、パークレイズに対する180,000.00米ドル、ビー・エヌ・ビー・バリバに対する360,000.00米ドル、メリルリ
ンチに対する50,000.00米ドルおよびU B SヨーロッパS Eに対する1,586,787.44米ドルの現金が、取引相手方に対する担保となっ
ている。

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド
運用計算書

自2018年8月1日 至2019年1月31日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	1,287,918.87	142,792
有価証券に係る利息	154,525,404.30	17,132,232
スワップに係る受取利息(注1)	1,771,976.05	196,459
分配金	1,648.46	183
その他の収益(注4)	9,676,031.66	1,072,782
収益合計	<u>167,262,979.34</u>	<u>18,544,447</u>
費 用		
スワップに係る支払利息(注1)	(850,662.50)	(94,313)
定率報酬(注2)	(20,502,668.61)	(2,273,131)
年次税(注3)	(282,522.67)	(31,323)
当座借越に係る利息	(119,288.81)	(13,226)
その他の手数料および報酬(注2)	(98,749.16)	(10,948)
その他の費用	(3,482.99)	(386)
費用合計	<u>(21,857,374.74)</u>	<u>(2,423,327)</u>
投資純(損)益	<u>145,405,604.60</u>	<u>16,121,119</u>
実現(損)益(注1)		
無オプション市場価格証券に係る実現(損)益	(101,064,498.96)	(11,205,021)
オプションに係る実現(損)益	(579,227.12)	(64,219)
金融先物に係る実現(損)益	(4,264,123.78)	(472,763)
先渡為替契約に係る実現(損)益	(77,191,638.95)	(8,558,237)
スワップに係る実現(損)益	1,328,204.87	147,258
外国為替に係る実現(損)益	(8,587,530.99)	(952,100)
実現(損)益合計	<u>(190,358,814.93)</u>	<u>(21,105,082)</u>
当期実現純(損)益	<u>(44,953,210.33)</u>	<u>(4,983,962)</u>
未実現評価(損)益の変動(注1)		
無オプション市場価格証券に係る未実現評価(損)益	68,392,289.37	7,582,653
オプションに係る未実現評価(損)益	(73,150.00)	(8,110)
金融先物に係る未実現評価(損)益	2,306,285.08	255,698
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	(24,913,945.88)	(2,762,209)
スワップに係る未実現評価(損)益	(2,531,109.63)	(280,624)
未実現評価(損)益の変動合計	<u>43,180,368.94</u>	<u>4,787,408</u>
運用の結果による純資産の純増(減)	<u>(1,772,841.39)</u>	<u>(196,555)</u>

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

運用計算書

自2018年8月1日 至2019年1月31日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	209,807.38	23,261
有価証券に係る利息	85,072,596.69	9,431,999
分配金	27,255.94	3,022
収益合計	85,309,660.01	9,458,282
費 用		
定率報酬 (注2)	(12,028,513.00)	(1,333,601)
年次税 (注3)	(229,217.67)	(25,413)
当座借越に係る利息	(32,311.97)	(3,582)
その他の手数料および報酬 (注2)	(87,677.87)	(9,721)
費用合計	(12,377,720.51)	(1,372,318)
投資純 (損) 益	72,931,939.50	8,085,964
実現 (損) 益 (注1)		
無オプション市場価格証券に係る実現 (損) 益	(27,229,368.77)	(3,018,920)
利回り評価有価証券および短期金融商品に係る 実現 (損) 益	24,202.99	2,683
金融先物に係る実現 (損) 益	(1,588,141.33)	(176,077)
先渡為替契約に係る実現 (損) 益	(52,841,898.22)	(5,858,581)
外国為替に係る実現 (損) 益	(460,760.72)	(51,085)
実現 (損) 益合計	(82,095,966.05)	(9,101,980)
当期実現純 (損) 益	(9,164,026.55)	(1,016,016)
未実現評価 (損) 益の変動 (注1)		
無オプション市場価格証券に係る 未実現評価 (損) 益	59,989,623.81	6,651,050
利回り評価有価証券および短期金融商品に係る 未実現評価 (損) 益	(1,285.90)	(143)
金融先物に係る未実現評価 (損) 益	2,268,306.68	251,487
先渡為替契約に係る未実現評価 (損) 益	(13,710,328.29)	(1,520,064)
未実現評価 (損) 益の変動合計	48,546,316.30	5,382,330
運用の結果による純資産の純増 (減)	39,382,289.75	4,366,314

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

運用計算書

自2018年8月1日 至2019年1月31日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	1,033,523.06	114,587
有価証券に係る利息	106,055,976.74	11,758,426
スワップに係る受取利息(注1)	1,956,126.84	216,876
分配金	14,409.33	1,598
その他の収益(注4)	6,023,856.36	667,865
収益合計	115,083,892.33	12,759,351
費 用		
スワップに係る支払利息(注1)	(891,296.78)	(98,818)
定率報酬(注2)	(13,287,236.63)	(1,473,156)
年次税(注3)	(218,989.48)	(24,279)
当座借越に係る利息	(180,075.44)	(19,965)
その他の手数料および報酬(注2)	(100,098.72)	(11,098)
費用合計	(14,677,697.05)	(1,627,316)
投資純(損)益	100,406,195.28	11,132,035
実現(損)益(注1)		
無オプション市場価格証券に係る実現(損)益	(40,516,117.54)	(4,492,022)
利回り評価有価証券および短期金融商品に係る 実現(損)益	83,569.56	9,265
金融先物に係る実現(損)益	16,988,772.36	1,883,545
オプションに係る実現(損)益、先物型	(31,379.92)	(3,479)
先渡為替契約に係る実現(損)益	(26,976,967.78)	(2,990,936)
スワップに係る実現(損)益	(2,361,904.56)	(261,864)
外国為替に係る実現(損)益	(2,571,394.33)	(285,090)
実現(損)益合計	(55,385,422.21)	(6,140,582)
当期実現純(損)益	45,020,773.07	4,991,453
未実現評価(損)益の変動(注1)		
無オプション市場価格証券に係る 未実現評価(損)益	(82,451,592.28)	(9,141,408)
利回り評価有価証券および短期金融商品に係る 未実現評価(損)益	1,029.81	114
金融先物に係る未実現評価(損)益	(2,858,307.64)	(316,901)
オプションに係る未実現評価(損)益、先物型	(41,422.94)	(4,593)
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	(20,699,996.77)	(2,295,009)
スワップに係る未実現評価(損)益	(517,943.47)	(57,424)
未実現評価(損)益の変動合計	(106,568,233.29)	(11,815,220)
運用の結果による純資産の純増(減)	(61,547,460.22)	(6,823,767)

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

純資産変動計算書

	自2018年8月1日 至2019年1月31日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	4,860,620,178.24	538,896,959
発行額	1,484,137,061.49	164,546,276
買戻額	(1,517,893,222.15)	(168,288,822)
純発行(買戻)合計	(33,756,160.66)	(3,742,546)
支払分配金	(9,576,575.17)	(1,061,755)
投資純(損)益	145,405,604.60	16,121,119
実現(損)益合計	(190,358,814.93)	(21,105,082)
未実現評価(損)益の変動合計	43,180,368.94	4,787,408
運用の結果による純資産の純増(減)	(1,772,841.39)	(196,555)
期末現在純資産	4,815,514,601.02	533,896,104

発行済投資証券数の変動表

クラス F - a c c	自2018年8月1日 至2019年1月31日	
	(口)	
期首現在発行済投資証券数	13,018,469.5970	
期中発行投資証券数	3,739,471.2130	
期中買戻投資証券数	(4,300,734.1770)	
期末現在発行済投資証券数	12,457,206.6330	

最重要数値

日付	ISIN	2019年1月31日	2018年7月31日	2017年7月31日
純資産額(米ドル)		4,815,514,601.02	4,860,620,178.24	3,961,608,683.51
クラス F - a c c	LU0985399996			
発行済投資証券数(口)		12,457,206.6330	13,018,469.5970	10,673,939.5500
1口当たり純資産価格(米ドル)		124.82	122.25	121.90
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) ¹		124.82	122.25	121.90

¹ 注記1を参照

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

純資産変動計算書

	自2018年8月1日 至2019年1月31日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	4,684,064,365.96	519,322,216
発行額	433,052,327.93	48,012,512
買戻額	(596,261,085.66)	(66,107,467)
純発行(買戻)合計	(163,208,757.73)	(18,094,955)
支払分配金	(6,219,391.52)	(689,544)
投資純(損)益	72,931,939.50	8,085,964
実現(損)益合計	(82,095,966.05)	(9,101,980)
未実現評価(損)益の変動合計	48,546,316.30	5,382,330
運用の結果による純資産の純増(減)	39,382,289.75	4,366,314
期末現在純資産	4,554,018,506.46	504,904,032

発行済投資証券数の変動表

クラス F - a c c	自2018年8月1日 至2019年1月31日	
	(口)	
期首現在発行済投資証券数	14,919,985.7850	
期中発行投資証券数	1,267,864.6820	
期中買戻投資証券数	(2,054,306.7160)	
期末現在発行済投資証券数	14,133,543.7510	

最重要数値

日付	ISIN	2019年1月31日	2018年7月31日	2017年7月31日
純資産額(米ドル)		4,554,018,506.46	4,684,064,365.96	4,000,760,877.51
クラス F - a c c	LU0313364738			
発行済投資証券数(口)		14,133,543.7510	14,919,985.7850	13,139,693.3440
1口当たり純資産価格(米ドル)		142.56	139.19	140.30
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) ¹		142.56	139.19	140.30

¹ 注記1を参照

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

組入証券の構造

地域別分類	純資産割合%	業種別分類	純資産割合%
アメリカ合衆国	76.91	金融および持株会社	23.02
イギリス	4.66	銀行および金融機関	21.37
カナダ	2.84	エネルギー・水道	6.23
オランダ	1.91	医薬品・化粧品・医療品	5.62
アイルランド	1.28	石油	4.35
ケイマン諸島	1.19	不動産	3.62
フランス	1.09	通信	2.96
日本	0.93	保険	2.87
オーストラリア	0.92	ヘルスケア、社会事業	2.15
スイス	0.53	食品・清涼飲料	2.11
中国	0.50	モーゲージおよび貸付機関	1.99
ガーンジー	0.48	グラフィックデザイン・出版・メディア	1.89
パミューダ	0.48	インターネット、ソフトウェア・ITサービス	1.82
スペイン	0.45	たばこ・アルコール	1.61
ルクセンブルグ	0.29	交通・運輸	1.53
韓国	0.24	国債および中央政府債	1.40
ノルウェー	0.23	バイオテクノロジー	1.35
香港	0.20	小売り・百貨店	1.21
スウェーデン	0.17	コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置	1.15
チリ	0.14	電気装置・部品	1.05
デンマーク	0.13	各種サービス	0.64
フィンランド	0.12	電子工学・半導体	0.56
イタリア	0.11	航空宇宙産業	0.55
メキシコ	0.11	宿泊・仕出し・レジャー	0.54
ドイツ	0.08	化学	0.52
キュラソー島	0.08	非分類会社	0.50
アラブ首長国連邦	0.07	その他消費財	0.47
ブラジル	0.06	農業・漁業	0.43
ジャージー	0.05	公的、非営利機関	0.41
インド	0.04	林業、紙・パルプ製品	0.35
カタール	0.04	建築業・資材	0.32
サウジアラビア	0.02	州、連邦州	0.26
ペルー	0.02	機械工学・産業機器	0.26
マカオ	0.02	自動車	0.25
合計	96.39	投資信託	0.24
		環境サービスおよびリサイクル	0.16
		貴金属および宝石	0.16
		包装業	0.13
		鉱業・石炭・鋼鉄	0.12
		各種貿易会社	0.10
		市および地方当局	0.09
		ゴム・タイヤ	0.03
		合計	96.39

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

純資産変動計算書

自2018年8月1日 至2019年1月31日

	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	3,391,096,914.21	375,970,915
発行額	1,273,331,910.47	141,174,309
買戻額	(404,254,041.27)	(44,819,646)
純発行(買戻)合計	869,077,869.20	96,354,663
支払分配金	(6,428,148.63)	(712,689)
投資純(損)益	100,406,195.28	11,132,035
実現(損)益合計	(55,385,422.21)	(6,140,582)
未実現評価(損)益の変動合計	(106,568,233.29)	(11,815,220)
運用の結果による純資産の純増(減)	(61,547,460.22)	(6,823,767)
期末現在純資産	4,192,199,174.56	464,789,122

発行済投資証券数の変動表

自2018年8月1日 至2019年1月31日

クラスF - a c c

(口)

期首現在発行済投資証券数	9,338,538.8570
期中発行投資証券数	3,275,077.2410
期中買戻投資証券数	(1,263,872.9630)
期末現在発行済投資証券数	11,349,743.1350

最重要数値

日付	ISIN	2019年1月31日	2018年7月31日	2017年7月31日
純資産額(米ドル)		4,192,199,174.56	3,391,096,914.21	3,202,987,682.90
クラスF - a c c	LU1344275315			
発行済投資証券数(口)		11,349,743.1350	9,338,538.8570	8,919,728.0640
1口当たり純資産価格(米ドル)		119.17	118.11	115.38
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) ¹		119.17	118.11	115.38

¹ 注記1を参照

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

組入証券の構造

地域別分類	純資産割合%	業種別分類	純資産割合%
アメリカ合衆国	53.24	金融および持株会社	32.16
オランダ	7.55	通信	8.97
フランス	7.54	石油	5.59
ルクセンブルグ	4.45	銀行および金融機関	4.60
カナダ	4.23	ヘルスケア、社会事業	4.12
ドイツ	3.56	インターネット、ソフトウェア・ITサービス	3.38
イギリス	3.54	各種サービス	3.37
イタリア	2.80	不動産	2.96
スペイン	1.42	宿泊・仕出し・レジャー	2.64
アイルランド	1.40	化学	2.49
スウェーデン	1.36	エネルギー・水道	2.47
ケイマン諸島	0.73	医薬品・化粧品・医療品	2.30
デンマーク	0.64	包装業	1.85
ジャージー	0.51	機械工学・産業機器	1.49
バミューダ	0.45	鉱業・石炭・鋼鉄	1.47
オーストラリア	0.43	建築業・資材	1.40
フィンランド	0.36	交通・運輸	1.37
オーストリア	0.35	食品・清涼飲料	1.30
日本	0.32	電気装置・部品	1.21
チェコ共和国	0.27	その他消費財	1.14
ベルギー	0.23	保険	1.02
メキシコ	0.22	コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置	0.97
スイス	0.13	自動車	0.96
ルーマニア	0.10	小売り・百貨店	0.90
ポルトガル	0.09	航空宇宙産業	0.81
ノルウェー	0.07	非分類会社	0.72
ジャマイカ	0.05	グラフィックデザイン・出版・メディア	0.70
バハマ	0.04	林業・紙・パルプ製品	0.60
ガーンジー	0.04	繊維・衣服・革製品	0.53
マン島	0.03	電子工学・半導体	0.49
ハンガリー	0.03	農業・漁業	0.42
英国領バージン諸島	0.01	バイオテクノロジー	0.31
ニュージーランド	0.01	貴金属および宝石	0.25
キュラソー島	0.01	たばこ・アルコール	0.23
合計	96.21	環境サービスおよびリサイクル	0.21
		モーゲージおよび貸付機関	0.19
		非鉄金属	0.17
		各種貿易会社	0.11
		投資信託	0.10
		ゴム・タイヤ	0.08
		国債および中央政府債	0.07
		時計および装身具類	0.05
		写真および光学	0.04
		合計	96.21

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス

財務書類に対する注記

2019年1月31日現在

注1 - 重要な会計方針の要約

財務書類は、ルクセンブルグにおける投資信託に関する一般に公正妥当と認められる会計原則に従って作成されている。重要な会計方針は、以下のように要約される。

a) 純資産額の計算

投資証券クラスの投資証券1口当たりの純資産価格は、当該投資証券クラスの参照通貨で表示され、営業日(以下「評価日」という。)毎に計算される。投資証券1口当たりの純資産価格は、各投資証券クラスに帰属するサブ・ファンドの純資産総額をサブ・ファンドの特定の投資証券クラスの発行済投資証券口数で除することにより計算される。

この場合の「営業日」は、ルクセンブルグの通常の銀行営業日(即ち、銀行が通常の営業時間に営業を行っている各日)を指し、法定外休日ならびにサブ・ファンドが投資する主要各国の取引所の休業日またはサブ・ファンドの投資対象の50%以上を適切に評価することができない日等を含まない。

サブ・ファンドの各投資証券クラスに帰属する純資産価額の百分率は、サブ・ファンドの発行済投資証券総数に対する各投資証券クラスの発行済投資証券の比率により決定され、投資証券の発行または買戻しの度に変動する。

単一の取引日におけるサブ・ファンドの全投資証券クラスの発行または買戻しの合計が純資本の流入または流出に影響する場合、関連取引日におけるサブ・ファンドの投資証券クラスの純資産額は、調整されることがある(シングル・スイング・プライシング(SSP))。最大調整額は、純資産価額の1%に達する。サブ・ファンドに発生する可能性のある見積取引費用および課税金ならびに本投資法人が投資する資産の見積呼値スプレッドは考慮される。純資本が該当サブ・ファンドに流入する場合、調整は純資産額の増加を導く。純資本が該当サブ・ファンドから流出する場合、調整は純資産額の減少となる。

b) 評価原則

- 証券取引所に上場されている証券、派生商品およびその他の投資対象は、その最終市場価格で評価される。同一の証券、派生商品もしくはその他の投資対象が複数の証券取引所に上場されている場合には、当該投資対象の主要市場である証券取引所における入手可能な最新の見積りが適用される。

証券取引所における取引がごく僅かな証券、派生商品およびその他の投資対象で、証券トレーダー間に市場と一致する値付が行われる流通市場が存在する場合、本投資法人は証券、派生商品およびその他の投資対象をそれらの価格に基づき評価できる。証券取引所に上場されていないが、認知され、公開され、かつ秩序ある方法で運用されている他の規制ある市場で取引されている証券、派生商品およびその他の投資対象商品は、当該市場における入手可能な最終価格で評価される。

- 証券取引所に上場されておらずまたは他の規制ある市場でも取引されていない、適正価格を入手することができない証券、派生商品およびその他の投資対象は、本投資法人が誠実に選択するその他の原則に従って予想売買価格に基づき本投資法人が評価する。

- 証券取引所に上場されていない派生商品(OTC派生商品)の評価は、独立の値付機関を参照に行われる。派生商品に利用可能である独立の値付機関が1社のみの場合、得られた評価価格の妥当性は、派生商品が由来する対象商品の市場価格に基づき本投資法人が認めた計算方法によって検証される。
- その他のUCITSおよび/またはその他のUCIsの投資証券は、その最終純資産価額で評価される。
- 短期金融商品に関して、評価は、純取得価格をベースに以後の利回りを確保しつつ、買戻価格に向けて漸進的に調整される。市場環境に重大な変動が生じた場合、異なる投資対象の評価基準は、新たな市場利回りに沿ってもたらされる。
主に短期金融商品に投資するサブ・ファンドに関して、残存する満期までの期間が12か月を超えない証券は、短期金融商品に関する指針に従って評価される。
- 関連するサブ・ファンドの会計通貨以外の通貨で表示され、為替取引によるヘッジを行わない証券およびその他の投資対象は、外部の価格提供会社から入手した為替相場の仲値(売買相場の仲値)で評価される。
- 定期預金および信託投資資産は、額面価額に累積利息を付して評価される。
- スワップ取引の価値は、外部のサービス提供会社によって計算され、また別の外部サービス提供会社より入手可能な第二の独立した評価も利用される。かかる計算は、流入および流出の両方のすべてのキャッシュ・フローの正味現在価値に基づいている。特定の場合に、ブルームバーグより入手可能なモデルと市場データに基づいた、内部での算出額、および/またはブローカー・ステイトメントの評価を利用することもできる。評価方法は、各有価証券によって異なり、UBS評価方針に従って決定される。
- 主に短期金融商品に投資するサブ・ファンドに関して、該当する評価日以降、第二評価日まで(同日を含む)にサブ・ファンドが稼得する受取利息は、当該サブ・ファンドの資産の評価に含まれる。したがって、特定の評価日における投資証券1口当たり純資産価格には、二評価日現在の期待利子収益が含まれる。

本投資法人またはその投資主の利益のために(例えば、マーケット・タイミングの実行回避)を正当化する状況下において、取締役会は、本投資法人の資産額を調整するために公正価値の値付技法を適用するなどして適切な測定を行う。

特別な状況に起因して、上記の規則による評価が実行不可能または不正確になった場合、本投資法人は、誠実に純資産額の適切な評価を遂行するために他の一般に認められておりかつ精査が可能な評価基準を用いる権限を付与されている。

特別な状況のもとで、爾後に発行もしくは買戻される投資証券の価格に影響を及ぼすさらなる評価は、一評価日中に施行されることがある。

c) 先渡為替契約の評価

未決済の先渡為替契約の未実現(損)益は、評価日の実勢先渡為替レートに基づいて評価される。

d) 金融先物契約の評価

金融先物契約は、評価日に適用される直近の入手可能な公表価格に基づいて評価される。実現損益および未実現損益の変動は、運用計算書に記載される。実現損益は、先入先出法に従って計算される。すなわち、最初の取得契約が最初に売却されるものと考えられる。

e) 証券売買実現純(損)益

証券売買実現損益は、売却証券の平均原価に基づいて計算される。

f) オプションの評価

規制ある市場で取引される未決済オプションは、決済価格または当該商品の入手可能な直近の市場価格で評価される。OTCオプションは、ブルームバーグ・オプション・プライサー・ファンクショナルリティーから入手した日足価格に基づき値洗いされ、第三者値付機関と照合される。

オプションに係る実現損益およびオプションに係る未実現評価(損)益は、オプションに係る実現(損)益およびオプションに係る未実現評価(損)益のポジションに基づき、それぞれ運用計算書および純資産変動計算書に開示される。

g) 外貨換算

個々のサブ・ファンドの基準通貨以外の通貨建て保有される銀行勘定、その他の純資産および投資有価証券評価額は、評価日の最終現物相場の仲値で換算される。個々のサブ・ファンドの通貨以外の通貨建て収益および費用は、支払日の最終現物相場の仲値で換算される。為替差損益は運用計算書に計上される。

個々のサブ・ファンドの基準通貨以外の通貨建て証券の取得原価は、取得日の最終現物相場の仲値で換算される。

h) 組入証券取引の会計処理

組入証券取引は、取引日の翌銀行営業日に会計処理される。

i) 連結財務書類

連結財務書類は、ユーロで表示される。本投資法人の2019年1月31日現在の連結純資産計算書および連結運用計算書の各種科目は、各サブ・ファンドの財務書類の対応する科目をユーロに換算した金額の合計に等しい。

以下の為替レートが、2019年1月31日現在の連結財務書類の換算に用いられた。

$$\frac{\text{為替レート}}{1 \text{ ユーロ}} = 1.147450 \text{ 米ドル}$$

j) 有価証券売却未収金、有価証券購入未払金

「有価証券売却未収金」の勘定科目には、外貨取引による未収金が含まれる。また「有価証券購入未払金」の勘定科目には、外貨取引による未払金が含まれる。

k) 収益の認識

源泉税控除後の配当金は、当該証券が「配当落ち」として最初に記載される日に収益として認識される。受取利息は、日々ベースで発生する。

1) スワップ

本投資法人は、当該種類の取引を専門とする一流金融機関との間で取交わされることを条件に、金利スワップ契約、金利スワップションおよびクレジット・デフォルト・スワップにかかる金利先渡契約を締結することができる。

未実現(損)益の変動は、運用計算書において「スワップに係る未実現評価(損)益」として反映されている。

未実現(損)益は、未払または未収の経過利息を含む。

手仕舞い時または満期時に発生するスワップに係る利益または損失は、運用計算書において「スワップに係る実現(損)益」として記録される。

注2 - 定率報酬

本投資法人および、さらに具体的には、その異なるクラスの投資証券クラスは、以下の表に記載されるとおり、該当する投資証券クラスに帰属する平均純資産に基づき計算され、毎月支払われる、月額定率報酬(以下「定率報酬」という。)を負担する。

マルチ・マネージャー・アクセス	上限定率報酬(年率)
	Fクラス
- エマージング・マーケット・デッド	1.25%
- ハイ・イールド	1.25%
- US マルチ・クレジット	0.85%

マルチ・マネージャー・アクセス	実効定率報酬(年率)
- エマージング・マーケット・デッド F - a c c	0.75%
- ハイ・イールド F - a c c	0.65%
- US マルチ・クレジット F - a c c	0.51%

上記の表に従い、定率報酬は本投資法人、各サブ・ファンドおよびクラスの以下の報酬、コストおよび費用をカバーする。

1. 保管受託銀行の報酬、コストおよび費用。
2. 管理事務代行会社の報酬、コストおよび費用。
3. 管理会社の報酬、コストおよび費用。
4. 投資運用会社および為替マネージャーの報酬、コストおよび費用。
5. ポートフォリオ・マネージャーおよびその委託先(複数の場合あり)の報酬、コストおよび費用。
6. 本投資法人の投資証券に関する販売活動における報酬、コストおよび費用。(外国の管轄当局に対して本投資法人の登録を維持するために発生するコストおよび報酬を含む。)

本投資法人の運用費用および管理事務費用

定率報酬がカバーする報酬、コストおよび費用に加え、本投資法人は、以下を含む(これらに限らない。)あらゆる運用費用および管理事務費用を負担する。

- 本投資法人の資産および所得に賦課される可能性があるすべての租税(適用ある年次税を含む。)
- 本投資法人のポートフォリオに組み込まれた有価証券その他の資産(派生商品を含む。)に関する取引に課される通常の銀行手数料(かかる手数料は、取得価格に加算され、売却価格からは減額される。)
- 本投資法人が適正に負担する手数料、費用およびあらゆる合理的な立替費用
- 投資主の利益のために行為するに際し本投資法人、管理会社、投資運用会社またはポートフォリオ・マネージャーが負担する法務手数料および費用(疑義を避けるために付言すると、本投資法人またはそのいずれかのサブ・ファンドの組織再編に関する一切の法務手数料および費用を含む。)
- 年次報告書および半期報告書ならびに適用ある法令に基づき必要なその他の報告書および文書を投資主(投資証券の実質的保有者を含む。)の利益に適う言語において作成し配布(印刷は含まない。)するためのコスト
- 投資主に対する通知作成コストおよび本投資法人の資産管理に関するあらゆる取引コスト(ブローカーの通常の手数料、報酬、租税等)
- ルクセンブルグ内外における本投資法人の承認および監督に関する手数料およびコスト
- 定款、英文販売目論見書ならびに年次報告書および半期報告書の印刷コストおよび費用、ならびに、定款および本投資法人に関するその他の一切の文書(本投資法人または本投資法人の投資証券募集について管轄権を有するあらゆる機関(各国の証券業協会を含む。)に対する登録届出書、目論見書および説明覚書等)を必要な言語によって作成および/または提出し、印刷するコストおよび費用
- 純資産価額の公表および投資者に対する通知の公告に関連するコストおよび費用
- 証券取引所または規制ある市場への本投資法人の投資証券の上場に関連して請求される手数料および費用
- 投資主への配当金支払における手数料およびその他のコスト
- 監査における手数料、コストおよび費用(監査人の報酬および費用を含む。)
- KIIDの作成、翻訳および監督機関への提出に関する手数料および費用

本投資法人は、定期的にまたは繰り返し発生する管理事務費用およびその他の費用を、見積額に基づき毎年またはその他のある期間を通じて自身の勘定で負担することがある。

個々のサブ・ファンドおよび/または個々の投資証券クラスに正確に配分可能なすべてのコストは、当該サブ・ファンドおよびクラスに請求される。コストが複数または全部のサブ・ファンドもしくはクラスに関係する場合は、それぞれの純資産価額に比例して、または本投資法人もしくは管理会社が合理的に決定する基準により、関係するサブ・ファンドまたは投資証券のクラスに請求される。

その投資方針の条項に従ってその他の投資信託(UCIまたはUCITS)に投資するサブ・ファンドに関して、サブ・ファンドおよび当該対象ファンドの両段階で支払が生じることがある。当該サブ・ファンドの資産における対象ファンドの管理報酬の最高限度は、あらゆるトレーラー・フィーを考慮して、投資金額の最高3%までである。管理会社により、または共同経営もしくは支配により、または実質的な直接保有もしくは間接保有により、管理会社と関係する別の会社により直接もしくは間接的に運用されるファンドの受益証券への投資を行う場合、サブ・ファンドが行う投資については、一切の対象ファンドの発行または買戻手数料は課せられない。サブ・ファンドの現在発生中の費用の詳細は、KIIDで参照することができる。

新サブ・ファンド設定に関する費用は、各サブ・ファンドについてのみ、5年を限度に償却される。

本投資法人の投資証券の販売に関して、管理会社が受領し販売会社に支払われる、ならびに販売会社が受領し販売取扱会社および委託業者に支払われる販売活動に関する報酬、コストおよび費用は、当該報酬の受領および保有に適用されるあらゆる法令上の制限および条件を満たす。適用される法令上の制限および条件に従い、販売会社は、本投資法人の販売業務を賄うために手数料を支払うことができる。

注3 - 年次税

本投資法人は、毎四半期末に支払われるルクセンブルグ大公国の「年次税」の対象となっている。当該税金は、毎四半期末に各クラスの純資産総額に基づき計算される。当該税金は、0.05%の料率で純資産総額に課せられる。機関投資家に対して留保されるクラスに関して、料率は0.01%に減額される。

既に年次税を支払っているルクセンブルグの他の投資信託において保有されている投資証券に表章される純資産については、年次税は課されない。

注4 - その他の収益

その他の収益は、主にシングル・スイング・プライシングにより生じた収益により構成される。

注5 - 分配

各サブ・ファンドまたは投資証券クラスの投資主総会は、取締役会の提案によりサブ・ファンドの年次決算の終了後に、各サブ・ファンドまたは投資証券クラスから分配を行うかおよび支払われる特別分配金の程度を決定する。本投資法人の純資産額が法律に規定されている最低額を下回る場合には、分配の支払は行われない。分配が行われる場合、支払は年度末後4か月以内に行われる。

取締役会は、中間分配金を支払い、また分配金支払を停止する権限を有している。

注6 - 金融先物、オプションおよびスワップ契約

2019年1月31日現在、サブ・ファンドごとの金融先物、オプションおよびスワップ契約ならびに関連する通貨は、以下のように要約される。

a) 金融先物

マルチ・マネージャー・アクセス	債券に係る金融先物	
	(購入)	(売却)
- エマージング・マーケット・デッド	235,007,969.01 米ドル	389,506,227.12 米ドル
- ハイ・イールド	94,817,476.14 米ドル	152,156,611.39 米ドル
- US マルチ・クレジット	276,783,562.73 米ドル	196,406,140.65 米ドル

マルチ・マネージャー・アクセス	通貨に係る金融先物	
	(購入)	(売却)
- ハイ・イールド	- 米ドル	450,363,718.75 米ドル

債券または通貨に係る金融先物契約(もしあれば)は、当該金融先物の時価(契約数×想定取引規模×当該先物の市場価格)に基づき計算される。

b) オプション

マルチ・マネージャー・アクセス	投資証券 に係るオプション、従来型	
	(売却)	
本サブ・ファンドは該当していない。		

c) スワップ

マルチ・マネージャー・アクセス	クレジット・デフォルト・スワップ	
	(購入)	(売却)
- エマージング・マーケット・デッド	76,062,311.31 米ドル	- 米ドル
- ハイ・イールド	804,175.34 米ドル	24,230,911.43 米ドル

マルチ・マネージャー・アクセス	指数に係るスワップおよび フォワード・スワップ	
	(購入)	(売却)
- ハイ・イールド	- 米ドル	9,321,072.57 米ドル

注7 - 総費用比率(TER)

この比率は、スイス・ファンド資産運用協会(SFAMA)の「TERの計算ならびに開示に関するガイドライン」現行版に従って計算された。比率はまた、純資産の百分率として遡及的に計算され、純資産(運用費用)に対し継続ベースで請求されるすべての費用および手数料の合計を表す。

過去12か月におけるTER

マルチ・マネージャー・アクセス	総経費率(TER)
- エマージング・マーケット・デッド F - a c c	0.76%
- ハイ・イールド F - a c c	0.66%
- US マルチ・クレジット F - a c c	0.52%

運用期間が12か月に満たないクラス受益証券のTERについては、年率換算されている。

取引費用および為替ヘッジに関連して発生したその他の費用は、TERに含まれない。

注8 - その他のUCITSまたはUCIsへの投資

2019年1月31日現在、マルチ・マネージャー・アクセスは、その他のUCITSおよび/またはUCIs(以下「対象ファンド」という。)への投資を有している。報酬はサブ・ファンドおよび対象ファンドの両段

階で生じる可能性がある。対象ファンドに課せられる管理報酬の割合の最大値は、以下のとおりである。

投資ファンド	管理報酬
AMUNDI RESPONSIBLE INVESTING-GREEN BOND-I-USD-CAPITALISATION	0.40%
FOCUSED SICAV - WORLD BANK BOND USD F-ACC	0.13%
FOCUSED SICAV - WORLD BANK LONG TERM BOND USD F-ACC	0.13%
FOCUSED SICAV-US CORPORATE BOND SUSTAIN USD F-ACC	0.19%
HERMES SDG ENGAGEMENT EQUITY FUND-SHS-XHEDGED US-ACC	0.70%
HERMES-GLOBAL EQUITY ESG FUND-F-HEDGED USD-ACC	0.55%
ISHARES GREEN BOND INDEX FUND IE-D-HEDGED-USD-CAP	0.17%
MIROVA FDS GLOBAL SUSTAINABLE EQUITY SHS-H-SI/A(USD)NPF-CAP	0.75%
PICTET - GLOBAL ENVIRONMENTAL OPPORTUNITIES-HJ-USD-CAP	0.72%
UBS (LUX) EQUITY SICAV - LONG TERM THEMES (USD) F-ACC	0.54%
UBS ETF - MSCI EMU HEDGED TO USD UCITS ETF-A-CAP	0.28%
UBS ETF - MSCI SWITZERLAND 20/35 UCITS A-CAP	0.20%
UBS ETF - SUSTAINABLE DEVELOPMENT BANK BONDS UCITS-ETF-A-ACC	0.18%
UBS IRL ETF PLC-GLOBAL GENDER EQUALITY UCITS ETF-USD HDG-ACC	0.30%
UBS IRL ETF-MSCI ACWI ESG UNIVERSAL-A-HDG USD-ETF-ACC	0.48%
UBS IRL ETF-MSCI ACWI SOCIALLY RESPONSIBLE-A-HDG USD-ETF-ACC	0.48%
XTRACKERS MSCI USA UCITS ETF DR-1 C-USD CAP	0.01%

管理報酬は、不動産ファンドに対しては適用されない。

注9 - 適用法、業務地および公認言語

ルクセンブルグ地方裁判所は、投資主、本投資法人および保管受託銀行との間のすべての法的紛争処理を行う場所である。ルクセンブルグ法が適用される。しかし、他の国の投資者の賠償請求に関する件については、本投資法人および/または保管受託銀行は、本投資法人の投資証券が売買された国の裁判管轄権に自らを服することを選択することができる。

当財務書類については英語版が公認されたものである。しかし、本投資法人の投資証券の購入および売却が可能なその他の国の投資主に対して投資証券が販売される場合、本投資法人および保管受託銀行は、当該国の言語への承認された翻訳(すなわち、本投資法人によって承認されたもの)に自らが拘束されるものと認めることができる。

[次へ](#)

(2) 投資有価証券明細表等

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
無記名株式			
コロンビア USD FONTERA ENERGY COR COM NPV	86 360.00	773 725.15	0.02
コロンビア合計		773 725.15	0.02
無記名株式合計		773 725.15	0.02
預託証券			
ブラジル USD 01 SA SPON ADR EACH REP 5 ORD (PO)	420 155.00	764 682.10	0.02
ブラジル合計		764 682.10	0.02
預託証券合計		764 682.10	0.02
アセット・バック証券、固定利付債			
米ドル USD BUENOS AIRES, PROVINCE OF-REG-S STEP-UP 06-15.05.35	1 200 000.00	750 000.00	0.01
米ドル合計		750 000.00	0.01
アセット・バック証券、固定利付債合計		750 000.00	0.01
ノート、固定利付債			
ユーロ			
EUR ARGENTINA, REPUBLIC OF STEP-UP 05-31.12.38	14 300 000.00	9 771 282.59	0.20
EUR ARGENTINA, REPUBLIC OF 7.82000% 05-31.12.33	13 600 000.00	19 541 830.11	0.41
EUR CENTRAL BANK OF TUNISIA-REG-S 6.75000% 18-31.10.23	5 100 000.00	5 734 955.10	0.12
EUR DIGI COMMUNICATIONS NV-REG-S 5.00000% 16-15.10.23	420 000.00	500 688.09	0.01
EUR MACEDONIA GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.62500% 16-26.07.23	6 330 000.00	8 257 530.70	0.17
EUR MACEDONIA GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 2.75000% 18-18.01.25	5 834 000.00	6 744 429.97	0.14
EUR SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 3.75000% 14-24.07.26	1 450 000.00	1 767 623.77	0.04
ユーロ合計		52 318 340.33	1.09
米ドル			
USD ABENGOA TRANSMISION SUR SA-REG-S 6.87500% 14-30.04.43	3 165 000.00	3 434 422.20	0.07
USD ABJA INVESTMENT CO PTE LTD-REG-S 5.45000% 18-24.01.28	7 934 000.00	7 140 600.00	0.15
USD ABU DHABI CRUDE OIL PIPELINE LLC-REG-S 3.65000% 17-02.11.29	4 769 000.00	4 667 658.75	0.10
USD ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO PJSC-REG-S 4.87500% 18-23.04.30	922 000.00	956 575.00	0.02
USD ABU DHABI, GOVERNMENT OF-REG-S 3.12500% 16-03.05.26	10 761 000.00	10 586 133.75	0.22
USD ABU DHABI, GOVERNMENT OF-REG-S 3.12500% 17-11.10.27	7 900 000.00	7 702 500.00	0.16
USD ABU DHABI, GOVERNMENT OF-REG-S 4.12500% 17-11.10.47	900 000.00	887 625.00	0.02
USD ABU DHABI, GOVERNMENT OF-REG-S 2.50000% 17-11.10.22	8 840 000.00	8 663 200.00	0.18
USD ADANI TRANSMISSION LTD-REG-S 4.00000% 16-03.08.26	1 720 000.00	1 544 947.00	0.03
USD AEROPUERTO INTERNACIONAL DE TOCU-REG-S 6.00000% 18-18.11.48	4 022 000.00	4 191 989.83	0.09
USD AEROPUERTOS ARGENTINA 2000 SA-REG-S 6.87500% 17-01.02.27	1 420 000.00	1 329 120.00	0.03
USD AEROPUERTOS DOMINICANOS-REG-S 6.75000% 17-30.03.29	6 760 000.00	6 736 340.00	0.14
USD AES EL SALVADOR TRUST II-REG-S 6.75000% 13-28.03.23	1 378 000.00	1 272 927.50	0.03
USD AFREN PLC-REG-S 6.62500% 13-09.12.20	993 000.00	329.46	0.00
USD AGUA Y SANEAMIENTOS ARGENTINOS SA-REG-S 6.62500% 18-01.02.23	9 501 000.00	7 365 887.78	0.15

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD AI CANDELARIA SPAIN SLU-REG-S 7.50000% 18-15.12.28	3 190 000.00	3 138 960.00	0.07
USD AKBANK TAS-REG-S 5.00000% 12-24.10.22	2 710 000.00	2 571 112.50	0.05
USD ALIBABA GROUP HOLDING LTD 4.00000% 17-06.12.37	1 200 000.00	1 113 230.64	0.02
USD ALIBABA GROUP HOLDING LTD 4.20000% 17-06.12.47	680 000.00	628 945.87	0.01
USD ALTICE FINANCING SA-REG-S 6.62500% 15-15.02.23	1 796 000.00	1 805 518.80	0.04
USD ALTICE FINCO SA-144A 8.12500% 13-15.01.24	6 217 000.00	6 123 745.00	0.13
USD AMBER CIRCLE FUNDING LTD-REG-S 3.25000% 12-04.12.22	1 459 000.00	1 442 272.56	0.03
USD ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT-144A 3.37500% 12-01.11.22	1 000 000.00	942 520.00	0.02
USD ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT-REG-S 3.37500% 12-01.11.22	9 535 000.00	8 998 656.25	0.19
USD ANGOLAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 9.37500% 18-08.05.48	14 001 000.00	14 718 551.25	0.31
USD ARCOR SAIC-REG-S 6.00000% 16-06.07.23	6 141 000.00	5 903 036.25	0.12
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF 7.12500% 18-28.06.117	363 000.00	282 232.50	0.01
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF 4.62500% 18-11.01.23	1 950 000.00	1 674 075.00	0.03
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF 5.87500% 18-11.01.28	11 716 000.00	9 314 220.00	0.19
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF 6.87500% 18-11.01.48	35 456 000.00	27 123 840.00	0.56
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF 8.280% 10-31.12.33	2 719 000.00	3 302 267.42	0.07
USD AZURE POWER ENERGY LTD-REG-S 5.50000% 17-03.11.22	4 452 000.00	4 329 147.06	0.09
USD BAHAMAS GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 6.00000% 17-21.11.28	12 277 000.00	12 369 077.50	0.26
USD BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.75000% 17-20.09.29	240 000.00	243 000.00	0.01
USD BAIDU INC 4.12500% 15-30.06.25	1 702 000.00	1 702 348.91	0.04
USD BANCO ABC BRASIL SA REG-S-SUB 7.87500% 10-08.04.20	1 510 000.00	1 567 810.35	0.03
USD BANCO BTG PACTUAL SA/CAY ISL SA-REG-S 5.50000% 17-31.01.23	1 000 000.00	989 500.00	0.02
USD BANCO DE BOGOTA SA-REG-S-SUB 5.37500% 13-19.02.23	800 000.00	822 000.00	0.02
USD BANCO DE BOGOTA SA-REG-S-SUB 6.25000% 16-12.05.26	17 308 000.00	18 050 080.50	0.37
USD BANCO DE BOGOTA SA-REG-S 4.37500% 17-03.08.27	600 000.00	573 525.00	0.01
USD BANCO DE CREDITO E INVERSIONES-REG-S 3.50000% 17-12.10.27	3 561 000.00	3 338 437.50	0.07
USD BANCO DEL CREDITO DEL PERU-REG-S 5.37500% 10-16.09.20	1 180 000.00	1 218 645.00	0.03
USD BANCO DEL ESTADO DE CHILE-REG-S 3.87500% 12-08.02.22	894 000.00	890 647.50	0.02
USD BANCO INBURSA SA-REG-S 4.37500% 17-11.04.27	1 000 000.00	946 250.00	0.02
USD BANCO NACIONAL DE COM EXTER SNC-REG-S 4.37500% 15-14.10.25	850 000.00	823 437.50	0.02
USD BANCO NACIONAL DE COSTA RICA-REG-S 6.25000% 13-01.11.23	810 000.00	796 651.20	0.02
USD BANCO NACIONAL DE COSTA RICA-REG-S 5.87500% 16-25.04.21	2 000 000.00	1 965 000.00	0.04
USD BANCOLOMBIA SA 5.95000% 11-03.06.21	1 190 000.00	1 243 550.00	0.03
USD BANQUE OUEST AFRICAINE DE DEV-REG-S 5.00000% 17-27.07.27	2 941 000.00	2 874 827.50	0.06
USD BECLE SA DE CV-REG-S 3.75000% 15-13.05.25	4 098 000.00	3 913 589.99	0.08
USD BELARUS INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.87500% 17-28.02.23	23 089 000.00	23 752 808.75	0.49
USD BELARUS INTERNATIONAL BOND-REG-S 7.62500% 17-29.06.27	8 126 000.00	8 491 670.00	0.18
USD BERMUDA, GOVERNMENT OF-REG-S 3.71700% 16-25.01.27	3 480 000.00	3 379 950.00	0.07
USD BHARTI AIRTEL LTD-REG-S 4.37500% 15-10.06.25	2 900 000.00	2 724 482.72	0.06
USD BOLIVIA, REPUBLIC OF-REG-S 4.50000% 17-20.03.28	15 954 000.00	14 444 512.29	0.30
USD BOS FUNDING LTD-REG-S 3.37400% 15-08.06.20	850 000.00	839 375.00	0.02
USD BRASKEM FINANCE LTD-REG-S 5.75000% 11-15.04.21	2 732 000.00	2 831 034.99	0.06
USD BRAZIL LOAN TRUST 1-REG-S 5.47700% 13-24.07.23	2 920 000.00	1 837 487.90	0.04
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 5.62500% 09-07.01.41	390 000.00	393 510.00	0.01
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 4.25000% 13-07.01.25	5 000 000.00	5 045 000.00	0.10
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 4.62500% 17-13.01.28	6 840 000.00	6 801 661.80	0.14
USD BUENOS AIRES, PROVINCE OF-REG-S 9.95000% 15-09.06.21	2 237 698.00	2 170 567.06	0.05
USD BUENOS AIRES, PROVINCE OF-REG-S 5.75000% 16-15.06.19	4 470 000.00	4 470 000.00	0.09
USD CABLEVISION SA/ARGENTINA-REG-S 6.50000% 16-15.06.21	9 934 000.00	9 747 737.50	0.20
USD CBQ FINANCE LTD-REG-S 2.87500% 14-24.06.19	800 000.00	797 000.00	0.02
USD CELEO REDES OPERACION CHILE SA-REG-S 5.20000% 17-22.06.47	1 014 000.00	942 566.81	0.02
USD CEMEX SAB DE CV-REG-S 5.70000% 14-11.01.25	1 230 000.00	1 234 305.00	0.03
USD CEMEX SAB DE CV-REG-S 7.75000% 16-16.04.26	6 060 000.00	6 544 800.00	0.14
USD CEMIG GERACAO E TRANSMISSAO SA-REG-S 9.25000% 17-05.12.24	12 777 000.00	13 942 717.25	0.29
USD CENCOSUD SA-144A 6.62500% 15-12.02.45	400 000.00	386 500.00	0.01
USD CENCOSUD SA-REG-S 4.37500% 17-17.07.27	2 210 000.00	2 012 757.50	0.04
USD CENCOSUD SA-REG-S 6.62500% 15-12.02.45	1 010 000.00	975 912.50	0.02
USD CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA-REG-S 5.75000% 11-27.10.21	1 045 000.00	1 064 332.50	0.02

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD CENTRAL AMERICAN BOTTLING CORP-REG-S 5.75000% 17-31.01.27	6 770 000.00	6 727 687.50	0.14
USD CENTRAL CHINA REAL ESTATE-REG-S 8.75000% 15-23.01.21	2 488 000.00	2 533 495.07	0.05
USD CERRO DEL AGUILA SA-REG-S 4.12500% 17-16.08.27	455 000.00	427 131.25	0.01
USD CHILE, REPUBLIC OF 2.25000% 12-30.10.22	21 870 000.00	21 257 640.00	0.44
USD CHILE, REPUBLIC OF 3.24000% 18-06.02.28	353 000.00	346 293.00	0.01
USD CHINA CINDA FINANCE 2017 I LTD-REG-S 4.10000% 17-09.03.24	1 966 000.00	1 932 180.25	0.04
USD CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD-REG-S 6.87500% 18-23.04.21	1 480 000.00	1 480 000.00	0.03
USD CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 4.12500% 18-14.03.21	550 000.00	552 175.25	0.01
USD CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 5.12500% 18-14.03.28	10 040 000.00	10 506 709.40	0.22
USD CNOOC FINANCE 2011 LTD-REG-S 5.75000% 11-26.01.41	800 000.00	949 052.00	0.02
USD COCA-COLA ICECEK AS-REG-S 4.21500% 17-19.09.24	5 450 000.00	5 170 687.50	0.11
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 3.87500% 17-25.04.27	8 635 000.00	8 531 380.00	0.18
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 4.50000% 18-15.03.29	7 394 000.00	7 567 759.00	0.16
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 5.20000% 19-15.05.49	588 000.00	605 640.00	0.01
USD COMETA ENERGIA SA DE CV-REG-S 6.37500% 18-24.04.35	10 197 000.00	9 762 505.83	0.20
USD COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD-REG-S 4.75000% 16-23.02.27	1 020 000.00	993 225.00	0.02
USD COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD-REG-S 4.87500% 13-15.01.24	913 000.00	910 717.50	0.02
USD CONSORCIO TRANSMANTARO-REG-S 4.37500% 13-07.05.23	1 200 000.00	1 201 500.00	0.02
USD CONTROLADORA MABE SA DE CV-REG-S 5.60000% 18-23.10.28	3 120 000.00	3 053 388.00	0.06
USD CORP FINANCIERA DE DESARROLLO SA-REG-S 4.75000% 12-08.02.22	2 674 000.00	2 738 176.00	0.06
USD CORP FINANCIERA DE DESARROLLO SA-REG-S 4.75000% 15-15.07.25	1 900 000.00	1 954 862.50	0.04
USD CORP LINDLEY SA-REG-S 6.75000% 11-23.11.21	351 000.00	369 787.27	0.01
USD CORP LINDLEY SA-REG-S 4.62500% 13-12.04.23	1 133 000.00	1 135 634.22	0.02
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 3.87500% 11-03.11.21	1 869 000.00	1 908 917.91	0.04
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 4.25000% 12-17.07.42	392 000.00	370 440.00	0.01
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 4.50000% 13-13.08.23	10 784 000.00	11 215 360.00	0.23
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 4.50000% 17-01.08.47	986 000.00	972 309.39	0.02
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 4.37500% 19-05.02.49	1 240 000.00	1 160 590.40	0.02
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 4.25000% 12-26.01.23	6 408 000.00	5 911 380.00	0.12
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 7.00000% 14-04.04.44	4 074 000.00	3 641 137.50	0.08
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 7.15800% 15-12.03.45	9 369 000.00	8 443 811.25	0.18
USD CREDIT BK MOSCOW/CBOM FIN-REG-S LPN 5.87500% 16-07.11.21	2 800 000.00	2 789 500.00	0.06
USD CROATIA, REPUBLIC OF-REG-S 6.75000% 09-05.11.19	1 919 000.00	1 964 576.25	0.04
USD CSN RESOURCES SA-REG-S 7.62500% 18-13.02.23	1 642 000.00	1 598 897.50	0.03
USD DELEK & AVNER TAMAR BOND LTD-144A 4.43500% 14-30.12.20	726 099.00	726 099.00	0.02
USD DELEK & AVNER TAMAR BOND LTD-144A 5.08200% 14-30.12.23	2 135 349.00	2 135 349.00	0.04
USD DELEK & AVNER TAMAR BOND LTD-144A 5.41200% 14-30.12.25	3 316 196.00	3 316 196.00	0.07
USD DEVELOPMENT BANK OF KAZAKHSTAN-REG-S 4.12500% 12-10.12.22	1 645 000.00	1 636 775.00	0.03
USD DEVELOPMENT BK PHILIPPINES 5.50000% 11-25.03.21	786 000.00	814 689.00	0.02
USD DIGICEL LTD-REG-S 6.75000% 15-01.03.23	1 481 000.00	1 206 570.70	0.03
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 5.50000% 15-27.01.25	1 904 000.00	1 939 700.00	0.04
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.85000% 15-27.01.45	16 552 000.00	17 089 940.00	0.35
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.87500% 16-29.01.26	15 572 000.00	16 755 472.00	0.35
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.50000% 18-15.02.48	21 287 000.00	21 063 486.50	0.44
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.00000% 18-19.07.28	7 503 000.00	7 728 090.00	0.16
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S 9.65000% 16-13.12.26	8 515 000.00	8 302 125.00	0.17
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S 9.62500% 17-02.06.27	7 407 000.00	7 166 272.49	0.15
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S 8.87500% 17-23.10.27	15 093 000.00	14 055 356.24	0.29
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S 7.87500% 18-23.01.28	11 529 000.00	10 180 107.00	0.21
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 5.57700% 18-21.02.23	10 680 000.00	10 372 950.00	0.22
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.90300% 18-21.02.48	25 583 000.00	23 632 296.25	0.49
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 6.58800% 18-21.02.28	1 650 000.00	1 536 562.50	0.03
USD EL PUERTO DE LIVERPOOL SA DE CV-REG-S 3.87500% 16-06.10.26	900 000.00	841 504.50	0.02
USD EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 7.75000% 02-24.01.23	6 599 000.00	6 937 198.75	0.14
USD EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 7.62500% 11-01.02.41	1 498 000.00	1 481 147.50	0.03
USD EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 5.87500% 12-30.01.25	4 969 000.00	4 739 183.75	0.10
USD EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 6.37500% 14-18.01.27	1 589 000.00	1 527 426.25	0.03
USD EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 8.25000% 02-10.04.32	2 333 000.00	2 449 649.99	0.05

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD EMBRAER NETHERLANDS FINANCE BV 5.40000% 17-01.02.27	602 000.00	635 110.00	0.01
USD EMIRATES SEMB CORP WATER & POWER-REG-S 4.45000% 17-01.08.35	250 000.00	240 000.00	0.00
USD EMPRESA DE TRANSPORTE DE PASA MET-REG-S 4.75000% 14-04.02.24	2 000 000.00	2 070 000.00	0.04
USD EMPRESA ELECTRICA ANGAMOS SA-REG-S 4.87500% 14-25.05.29	2 531 000.00	2 276 140.96	0.05
USD EMPRESA ELECTRICA GUACOLDA SA-REG-S 4.56000% 15-30.04.25	700 000.00	632 625.00	0.01
USD EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO-REG-S 3.75000% 16-05.08.26	3 057 000.00	2 954 590.50	0.06
USD EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO-REG-S 4.50000% 17-14.09.47	838 000.00	752 105.00	0.02
USD EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO-REG-S 5.25000% 18-06.11.29	9 200 000.00	9 688 750.01	0.20
USD ENEL CHILE SA 4.87500% 18-12.06.28	2 060 000.00	2 103 775.00	0.04
USD ESKOM HOLDINGS SOC LTD-REG-S 6.75000% 13-06.08.23	2 520 000.00	2 479 050.00	0.05
USD ESKOM HOLDINGS SOC LTD-REG-S 7.12500% 15-11.02.25	9 000 000.00	8 865 000.00	0.18
USD EUROTORG LLC VIA BONITRON INC-REG-S 8.75000% 17-30.10.22	1 410 000.00	1 418 319.00	0.03
USD EVRAZ GROUP SA-REG-S 5.37500% 17-20.03.23	1 385 000.00	1 381 537.50	0.03
USD EXPORT CREDIT BANK OF TURKEY-REG-S 5.37500% 16-24.10.23	7 564 000.00	7 062 885.00	0.15
USD EXPORT CREDIT BANK OF TURKEY-REG-S 6.12500% 18-03.05.24	2 330 000.00	2 201 850.00	0.05
USD FENIX POWER PERU SA-REG-S 4.31700% 17-20.09.27	2 004 000.00	1 890 779.75	0.04
USD FIBRIA OVERSEAS FINANCE LTD 5.50000% 17-17.01.27	724 000.00	742 462.00	0.02
USD FIBRIA OVERSEAS FINANCE LTD 4.00000% 17-14.01.25	2 834 000.00	2 748 299.84	0.06
USD FINANSBANK AS-REG-S 6.25000% 14-30.04.19	1 170 000.00	1 171 462.50	0.02
USD FIRST QUANTUM MINERALS LTD-144A 7.25000% 17-01.04.23	1 280 000.00	1 225 612.80	0.03
USD FIRST QUANTUM MINERALS LTD-REG-S 7.25000% 17-01.04.23	1 252 000.00	1 198 802.52	0.02
USD FIRST QUANTUM MINERALS LTD-REG-S 6.87500% 18-01.03.26	3 819 000.00	3 408 457.50	0.07
USD FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV 4.37500% 13-10.05.43	650 000.00	630 500.00	0.01
USD FRESNILLO PLC-REG-S 5.50000% 13-13.11.23	4 022 000.00	4 142 660.00	0.09
USD GAZ CAPITAL SA/GAZPROM-REG-S LPN 6.51000% 07-07.03.22	1 484 000.00	1 561 910.00	0.03
USD GAZ CAPITAL SA/GAZPROM-REG-S LPN 4.95000% 12-19.07.22	800 000.00	813 000.00	0.02
USD GEOPARK LTD-REG-S 6.50000% 17-21.09.24	5 332 000.00	5 158 710.00	0.11
USD GERDAU TRADE INC-REG-S 4.87500% 17-24.10.27	290 000.00	283 040.00	0.01
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 7.62500% 18-16.05.29	8 479 000.00	8 076 247.50	0.17
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 8.62700% 18-16.06.49	10 588 000.00	9 846 840.00	0.20
USD GLOBAL LIMAN ISLETMELERI-REG-S 8.12500% 14-14.11.21	5 740 000.00	5 544 151.20	0.12
USD GLOBO COMUNICACOES PARTICIPACOES-REG-S 5.12500% 17-31.03.27	290 000.00	280 205.25	0.01
USD GLOBO COMUNICACOES E PARTICIPACO-REG-S 4.87500% 12-11.04.22	210 000.00	210 787.50	0.00
USD GLOBO COMUNICACOES E PARTICIPACO-REG-S 4.84300% 15-08.06.25	400 000.00	392 000.00	0.01
USD GMR HYDERABAD INTNATL AIRPORT LTD-REG-S 4.25000% 17-27.10.27	2 798 000.00	2 343 478.89	0.05
USD GNL QUINTERO SA-REG-S 4.63400% 14-31.07.29	3 523 000.00	3 505 385.00	0.07
USD GOL FINANCE-REG-S 7.00000% 17-31.01.25	4 471 000.00	4 118 908.75	0.09
USD GOLD FIELDS OROGEN HLDING BVI LTD-REG-S 4.87500% 10-07.10.20	9 022 000.00	9 078 387.50	0.19
USD GOLDEN LEGACY PTE LTD-REG-S 8.25000% 16-07.06.21	1 167 000.00	1 210 762.50	0.03
USD GRAN TIERRA ENERGY INTL HLDG LTD-REG-S 6.25000% 18-15.02.25	3 790 000.00	3 572 075.00	0.07
USD GREENKO DUTCH BV-REG-S 4.87500% 17-24.07.22	1 370 000.00	1 323 604.95	0.03
USD GROWTHPOINT PROPERTIES INT PTY-REG-S 5.87200% 18-02.05.23	8 620 000.00	8 749 300.00	0.18
USD GRUMA SA DE CV-REG-S 4.87500% 14-01.12.24	5 377 000.00	5 447 304.27	0.11
USD GRUPO CEMENTO DE CHIHUA SAB DE CV-REG-S 5.25000% 17-23.06.24	2 660 000.00	2 606 800.00	0.05
USD GRUPO KUO SAB DE CV-REG-S 5.75000% 17-07.07.27	3 569 000.00	3 380 735.25	0.07
USD GTH FINANCE BV-REG-S 7.25000% 16-26.04.23	4 116 000.00	4 328 838.36	0.09
USD GTH FINANCE BV-REG-S 6.25000% 16-26.04.20	800 000.00	813 048.00	0.02
USD GTL TRADE FINANCE INC-REG-S 7.25000% 14-16.04.44	705 000.00	756 958.50	0.02
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 5.75000% 12-06.06.22	7 940 000.00	8 297 300.00	0.17
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 4.50000% 16-03.05.26	4 930 000.00	4 819 075.00	0.10
USD HANWIHA TOTAL PETROCHEMICAL CO LTD-REG-S 3.87500% 19-23.01.24	689 000.00	692 496.68	0.01
USD HARVEST OPERATIONS CORP-REG-S 3.00000% 17-21.09.22	200 000.00	196 882.12	0.00
USD HONDURAS, REPUBLIC OF-REG-S 6.25000% 17-19.01.27	17 911 000.00	18 381 163.74	0.38
USD HONDURAS, REPUBLIC OF-REG-S 7.50000% 13-15.03.24	3 940 000.00	4 240 425.00	0.09
USD HRVATSKA ELEKTROPRIVREDA-REG-S 5.87500% 15-23.10.22	731 000.00	771 205.00	0.02
USD HUNGARY, REPUBLIC OF 6.25000% 10-29.01.20	1 660 000.00	1 709 717.00	0.04
USD HUNGARY, REPUBLIC OF 6.37500% 11-29.03.21	8 840 000.00	9 366 156.80	0.19
USD HUNGARY, REPUBLIC OF 7.62500% 11-29.03.41	3 204 000.00	4 609 755.00	0.10

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD HUNGARY, REPUBLIC OF 5.37500% 13-21.02.23	2 400 000.00	2 562 180.00	0.05
USD HUNGARY, REPUBLIC OF 5.75000% 13-22.11.23	8 922 000.00	9 733 232.85	0.20
USD HUNGARY, REPUBLIC OF 4.00000% 14-25.03.19	5 050 000.00	5 053 686.50	0.10
USD HUNGARY, REPUBLIC OF 5.37500% 14-25.03.24	10 326 000.00	11 152 080.00	0.23
USD HYUNDAI CAPITAL SERVICES INC-REG-S 3.62500% 17-29.08.27	1 385 000.00	1 299 220.02	0.03
USD HYUNDAI CAPITAL SERVICES INC-REG-S 3.75000% 18-05.03.23	300 000.00	297 563.46	0.01
USD IHS NETHERLANDS HOLDCO BV-REG-S 9.50000% 16-27.10.21	6 601 000.00	6 782 527.50	0.14
USD INDIKA ENERGY CAPITAL III PTE LTD-REG-S 5.87500% 17-09.11.24	1 682 000.00	1 533 302.79	0.03
USD INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM TBK PT-REG-S 5.71000% 18-15.11.23	8 775 000.00	9 268 637.62	0.19
USD INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM TBK PT-REG-S 6.53000% 18-15.11.28	2 275 000.00	2 513 875.00	0.05
USD INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM TBK PT-REG-S 6.75700% 18-15.11.48	6 592 000.00	7 251 220.43	0.15
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 3.50000% 17-11.01.28	2 300 000.00	2 199 375.00	0.05
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 4.75000% 18-11.02.29	2 491 000.00	2 615 550.00	0.05
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 7.75000% 08-17.01.38	1 924 000.00	2 577 630.90	0.05
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 12-17.01.42	6 776 000.00	7 131 740.00	0.15
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 16-08.01.47	971 000.00	1 028 046.25	0.02
USD INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA-REG-S 4.87500% 17-14.01.48	742 000.00	609 460.25	0.01
USD INKIA ENERGY LTD-REG-S 5.87500% 17-09.11.27	4 778 000.00	4 539 100.00	0.09
USD INSTITUTO COSTARRICENSE DE ELEC-REG-S 6.95000% 11-10.11.21	1 700 000.00	1 636 250.00	0.03
USD INSTITUTO COSTARRICENSE DE ELEC-REG-S 6.37500% 13-15.05.43	540 000.00	396 162.90	0.01
USD INVERSIONES CMPC SA-REG-S 4.37500% 17-04.04.27	1 340 000.00	1 327 437.50	0.03
USD IRSA PROPIEDADES COMERCIALES SA-REG-S 8.75000% 16-23.03.23	554 000.00	541 535.00	0.01
USD ISRAEL CHEMICALS LTD-144A-REG-S 6.37500% 18-31.05.38	830 000.00	846 600.00	0.02
USD ISRAEL ELECTRIC CORP LTD-144A-REG-S 5.00000% 14-12.11.24	5 448 000.00	5 734 020.00	0.12
USD ISRAEL ELECTRIC CORP LTD-REG-S 6.87500% 13-21.06.23	1 872 000.00	2 096 640.00	0.04
USD IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S STEP-UP 10-31.12.32	31 002 000.00	25 812 265.20	0.54
USD JAMAICA, GOVERNMENT OF 8.00000% 08-24.06.19	1 100 000.00	378 691.83	0.01
USD JAMAICA, GOVERNMENT OF 6.75000% 15-28.04.28	2 570 000.00	2 821 860.00	0.06
USD JAMAICA, GOVERNMENT OF 7.87500% 15-28.07.45	2 589 000.00	3 055 020.00	0.06
USD JBS INVESTMENTS GMBH-REG-S 7.25000% 14-03.04.24	634 000.00	654 015.38	0.01
USD JBS INVESTMENTS II GMBH-REG-S 7.00000% 18-15.01.26	2 260 000.00	2 293 900.00	0.05
USD JD.COM INC 3.87500% 16-29.04.26	2 020 000.00	1 877 499.10	0.04
USD JORDAN, KINGDOM OF-REG-S 6.12500% 15-29.01.26	4 876 000.00	4 839 430.00	0.10
USD JORDAN, KINGDOM OF-REG-S 5.75000% 16-31.01.27	2 334 000.00	2 246 475.00	0.05
USD JSC GEORGIAN RAILWAY-REG-S 7.75000% 12-11.07.22	1 380 000.00	1 449 000.00	0.03
USD KAZAGRO NATL MANAGEMENT HLDNG-REG-S 4.62500% 13-24.05.23	1 396 000.00	1 413 450.00	0.03
USD KAZAKHSTAN TEMIR ZHOLY NATIONAL-REG-S 4.85000% 17-17.11.27	2 848 000.00	2 855 120.00	0.06
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO-REG-S 3.87500% 17-19.04.22	5 798 000.00	5 783 505.00	0.12
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO-REG-S 4.75000% 17-19.04.27	8 012 000.00	8 092 120.00	0.17
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO-REG-S 5.75000% 17-19.04.47	14 532 000.00	14 532 000.00	0.30
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO-REG-S 4.75000% 18-24.04.25	6 207 000.00	6 393 210.00	0.13
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO-REG-S 6.37500% 18-24.10.48	8 021 000.00	8 589 688.90	0.18
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO-REG-S 5.37500% 18-24.04.30	5 614 000.00	5 820 847.83	0.12
USD KENYA, REPUBLIC OF-REG-S 6.87500% 14-24.06.24	6 320 000.00	6 320 000.00	0.13
USD KENYA, REPUBLIC OF-REG-S 7.25000% 18-28.02.28	3 423 000.00	3 341 703.75	0.07
USD KENYA, REPUBLIC OF-REG-S 8.25000% 18-28.02.48	15 260 000.00	14 630 525.00	0.30
USD KOC HOLDING AS-REG-S 5.25000% 16-15.03.23	6 235 000.00	6 079 125.00	0.13
USD KOKS OAO FINANCE LTD-REG-S 7.50000% 17-04.05.22	430 000.00	432 150.00	0.01
USD KOREA EAST-WEST POWER CO LTD-REG-S 3.87500% 18-19.07.23	582 000.00	589 811.14	0.01
USD KOSMOS ENERGY LTD-144A 7.87500% 15-01.08.21	390 000.00	390 487.50	0.01
USD KOSMOS ENERGY LTD-REG-S 7.87500% 14-01.08.21	2 120 000.00	2 122 650.00	0.04
USD KOSMOS ENERGY LTD-REG-S 7.87500% 15-01.08.21	1 770 000.00	1 773 002.63	0.04
USD KUWAIT INTERNATIONAL GOVT BOND-REG-S 3.50000% 17-20.03.27	15 180 000.00	15 202 770.00	0.32
USD LATVIA GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 2.75000% 12-12.01.20	7 856 000.00	7 803 954.00	0.16
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S 6.65000% 15-26.02.30	4 913 000.00	4 028 660.00	0.08
USD LIGHT SERVICOS DE ELETRICIDADE SA-REG-S 7.25000% 18-03.05.23	6 114 000.00	6 118 585.50	0.13
USD LIQUID TELECOMMUNICATIONS FIN-REG-S 8.50000% 17-13.07.22	14 746 000.00	15 040 920.00	0.31
USD LISTRINDO CAPITAL BV-REG-S 4.95000% 16-14.09.26	1 190 000.00	1 123 258.85	0.02

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD LITHUANIA, REPUBLIC OF-REG-S 6.12500% 11-09.03.21	6 983 000.00	7 382 287.94	0.15
USD LLPL CAPITAL PTE LTD-REG-S 6.87500% 19-04.02.39	5 450 000.00	5 579 437.50	0.12
USD LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD-REG-S 8.75000% 18-12.12.20	1 040 000.00	1 066 000.00	0.02
USD MARB BONDCO PLC-REG-S 7.00000% 17-15.03.24	1 200 000.00	1 167 000.00	0.02
USD MARFRIG HOLDINGS EUROPE BV-REG-S 6.87500% 14-24.06.19	1 200 000.00	1 200 000.00	0.02
USD MARFRIG HOLDINGS EUROPE BV-REG-S 8.00000% 16-08.06.23	6 823 000.00	7 031 783.80	0.15
USD MEDCO PLATINUM ROAD PTE LTD-REG-S 6.75000% 18-30.01.25	5 501 000.00	5 005 910.00	0.10
USD MEDCO STRAITS SERVICES TRUST-REG-S 8.50000% 17-17.08.22	330 000.00	340 205.25	0.01
USD MELCO RESORTS FINANCE LTD-REG-S 4.87500% 17-06.06.25	1 665 000.00	1 570 927.50	0.03
USD METINVEST BV-REG-S 8.50000% 18-23.04.26	4 040 000.00	3 812 750.00	0.08
USD MEXICAN, UNITED STATES OF 4.60000% 15-23.01.46	3 500 000.00	3 225 250.00	0.07
USD MEXICHEM SAB DE CV-REG-S 6.75000% 12-19.09.42	935 000.00	953 840.25	0.02
USD MEXICHEM SAB DE CV-REG-S 5.87500% 14-17.09.44	1 603 000.00	1 492 793.75	0.03
USD MEXICHEM SAB DE CV-REG-S 5.50000% 17-15.01.48	650 000.00	585 000.00	0.01
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-REG-S 4.25000% 16-31.10.26	820 000.00	758 910.00	0.02
USD MEXICO GEN DE ENERGIA S DE RL-REG-S 5.50000% 12-06.12.32	400 000.00	335 840.22	0.01
USD MEXICO, UNITED STATES OF 6.05000% 08-11.01.40	362 000.00	396 390.00	0.01
USD MEXICO, UNITED STATES OF 5.75000% 10-12.10.110	11 132 000.00	10 965 020.00	0.23
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.35000% 16-15.01.47	449 000.00	399 610.00	0.01
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.60000% 17-10.02.48	900 000.00	832 500.00	0.02
USD MEXICO, UNITED STATES OF 3.75000% 18-11.01.28	2 800 000.00	2 669 800.00	0.06
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.50000% 19-22.04.29	631 000.00	633 208.50	0.01
USD MHP LUX SA-REG-S 6.95000% 18-03.04.26	2 616 000.00	2 334 780.00	0.05
USD MHP SA-REG-S 7.75000% 17-10.05.24	4 052 000.00	3 884 855.00	0.08
USD MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-REG-S 5.12500% 17-15.01.28	2 670 000.00	2 476 425.00	0.05
USD MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-REG-S 6.00000% 15-15.03.25	5 264 000.00	5 318 219.20	0.11
USD MINERVA LUXEMBOURG SA-REG-S 6.50000% 16-20.09.26	4 184 000.00	3 995 720.00	0.08
USD MINSUR SA-REG-S 6.25000% 14-07.02.24	200 000.00	209 750.00	0.00
USD MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 5.12500% 12-05.12.22	6 005 000.00	5 809 837.50	0.12
USD MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 5.62500% 17-01.05.23	11 169 000.00	10 940 761.48	0.23
USD MTN MAURITIUS INVESTMENTS LTD-REG-S 4.75500% 14-11.11.24	5 860 000.00	5 537 700.00	0.11
USD MTN MAURITIUS INVESTMENTS LTD-REG-S 6.50000% 16-13.10.26	13 558 000.00	13 713 917.00	0.28
USD MTN MAURITIUS INVESTMENTS LTD-REG-S 5.37300% 16-13.02.22	1 850 000.00	1 838 437.50	0.04
USD MYRIAD INTERNATIONAL HOLDINGS BV-REG-S 4.85000% 17-06.07.27	3 769 000.00	3 750 155.00	0.08
USD NAMIBIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.50000% 11-03.11.21	2 467 000.00	2 482 418.75	0.05
USD NAMIBIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 15-29.10.25	5 809 000.00	5 547 595.00	0.12
USD NEERG ENERGY LTD-REG-S 6.00000% 17-13.02.22	7 050 000.00	6 811 463.25	0.14
USD NEXEN INC 5.87500% 05-10.03.35	2 001 000.00	2 337 178.60	0.05
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF 5.62500% 17-27.06.22	2 900 000.00	2 910 875.00	0.06
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 6.75000% 11-28.01.21	1 700 000.00	1 748 875.00	0.04
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.87500% 17-16.02.32	6 329 000.00	6 305 266.25	0.13
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.14300% 18-23.02.30	29 820 000.00	28 701 750.00	0.60
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.69600% 18-23.02.38	10 633 000.00	10 220 971.25	0.21
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.62500% 18-21.11.25	11 322 000.00	11 789 032.49	0.24
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 8.74700% 18-21.01.31	18 114 000.00	19 155 555.00	0.40
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 9.24800% 18-21.01.49	7 283 000.00	7 738 187.50	0.16
USD NORTHERN LIGHTS/REP OF ANGOLA-REG-S LPN 7.00000% 12-17.08.19	2 814 000.00	528 284.54	0.01
USD NOSTRUM OIL & GAS FINANCE BV-REG-S 8.00000% 17-25.07.22	4 313 000.00	2 895 187.51	0.06
USD NOSTRUM OIL & GAS FINANCE BV-REG-S 7.00000% 18-16.02.25	232 000.00	151 747.72	0.00
USD OCP SA-REG-S 5.62500% 14-25.04.24	4 826 000.00	5 031 105.00	0.10
USD OCP SA-REG-S 6.87500% 14-25.04.44	6 113 000.00	6 495 062.50	0.13
USD OCP SA-REG-S 6.87500% 15-22.10.25	4 641 000.00	4 548 180.00	0.09
USD OIL AND GAS HOLDING CO BSCC/THE-REG-S 7.62500% 18-07.11.24	1 860 000.00	1 973 925.00	0.04
USD OIL AND GAS HOLDING CO BSCC/THE-REG-S 8.37500% 18-07.11.28	3 720 000.00	3 980 400.00	0.08
USD OLEODUCTO CENTRAL SA-REG-S 4.00000% 14-07.05.21	859 000.00	855 778.75	0.02
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 4.75000% 16-15.06.26	9 045 000.00	8 072 662.50	0.17
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.37500% 17-08.03.27	8 860 000.00	8 040 450.00	0.17
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.50000% 17-08.03.47	12 289 000.00	10 292 037.50	0.21

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.62500% 18-17.01.28	2 200 000.00	2 007 500.00	0.04
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.75000% 18-17.01.48	27 816 000.00	23 747 910.00	0.49
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.93200% 18-31.10.25	5 237 000.00	5 092 982.50	0.11
USD ONGC VIDESH LTD-REG-S 3.75000% 13-07.05.23	700 000.00	686 311.50	0.01
USD ORAZUL ENERGY EGENOR S EN C POR A-REG-S 5.62500% 17-28.04.27	7 357 000.00	6 763 841.87	0.14
USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 8.25000% 14-15.04.24	2 014 000.00	2 129 674.09	0.04
USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 8.25000% 15-30.09.25	1 010 000.00	1 067 989.15	0.02
USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 6.87500% 17-05.12.27	7 414 000.00	7 190 356.69	0.15
USD PAMPA ENERGIA SA-REG-S 7.50000% 17-24.01.27	4 380 000.00	3 903 675.00	0.08
USD PAMPA ENERGIA SA-REG-S 7.37500% 16-21.07.23	3 797 000.00	3 611 896.25	0.07
USD PANAMA, REPUBLIC OF 4.50000% 17-15.05.47	430 000.00	435 160.00	0.01
USD PAPUA NEW GUINEA GOVT INTL BOND-REG-S 8.37500% 18-04.10.28	1 319 000.00	1 412 866.64	0.03
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 4.70000% 17-27.03.27	1 766 000.00	1 801 320.00	0.04
USD PATRIMONIO EN FIDEICOMISO-REG-S 5.75000% 18-03.04.28	1 540 000.00	1 522 675.00	0.03
USD PCCW CAPITAL NO 4 LTD-REG-S 5.75000% 12-17.04.22	1 524 000.00	1 604 299.56	0.03
USD PERTAMINA PT-REG-S 5.62500% 13-20.05.43	5 488 000.00	5 522 300.00	0.11
USD PERTAMINA PT-REG-S 6.50000% 11-27.05.41	2 496 000.00	2 773 680.00	0.06
USD PERTAMINA PT-REG-S 6.00000% 12-03.05.42	420 000.00	442 050.00	0.01
USD PERU LNG SRL-REG-S 5.37500% 18-22.03.30	1 051 000.00	1 061 510.00	0.02
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 5.50000% 11-22.11.21	882 000.00	919 515.87	0.02
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 4.32500% 15-28.05.25	3 047 000.00	3 080 897.88	0.06
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 4.55000% 16-29.03.26	4 490 000.00	4 574 187.50	0.09
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 4.40000% 18-01.03.28	21 868 000.00	21 915 125.54	0.46
USD PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS-REG-S 5.87500% 18-26.01.23	2 714 000.00	2 554 552.50	0.05
USD PETROAMAZONAS EP-REG-S 4.62500% 17-06.11.20	1 910 000.00	1 827 612.15	0.04
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 6.87500% 09-20.01.40	2 560 000.00	2 581 299.19	0.05
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 4.375% 13-20.05.23	7 734 000.00	7 715 825.10	0.16
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 6.25000% 14-17.03.24	7 967 000.00	8 408 218.03	0.17
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 6.12500% 17-17.01.22	4 080 000.00	4 288 120.80	0.09
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 7.37500% 17-17.01.27	3 208 000.00	3 468 650.00	0.07
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 5.29900% 18-27.01.25	270 000.00	269 487.00	0.01
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 5.99900% 18-27.01.28	18 743 000.00	18 705 514.00	0.39
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 12.75000% 11-17.02.22	2 320 000.00	686 720.00	0.01
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 8.50000% 16-27.10.20	34 620 000.00	16 314 675.00	0.34
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 5.37500% 07-12.04.27	25 979 600.00	6 446 188.25	0.13
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 5.50000% 07-12.04.37	980 000.00	242 550.00	0.01
USD PETROLEOS DEL PERU SA-REG-S 4.75000% 17-19.06.32	17 407 000.00	17 211 171.25	0.36
USD PETROLEOS DEL PERU SA-REG-S 5.62500% 17-19.06.47	4 516 000.00	4 582 385.20	0.10
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.50000% 11-02.06.41	780 000.00	678 600.00	0.01
USD PETROLEOS MEXICANOS 4.87500% 12-24.01.22	21 655 000.00	21 113 625.00	0.44
USD PETROLEOS MEXICANOS 5.50000% 12-27.06.44	4 097 000.00	3 282 721.25	0.07
USD PETROLEOS MEXICANOS 5.37500% 18-13.03.22	1 030 000.00	1 017 125.00	0.02
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.50000% 18-13.03.27	4 622 000.00	4 434 809.00	0.09
USD PETROLEOS MEXICANOS 5.35000% 18-12.02.28	3 170 000.00	2 818 367.75	0.06
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.35000% 18-12.02.48	3 962 000.00	3 328 476.20	0.07
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.50000% 18-23.01.29	3 001 000.00	2 831 443.50	0.06
USD PETROLEUM CO OF TRINIDAD&TOB LTD REG-S 9.75000% 09-14.08.19	5 050 000.00	4 747 000.00	0.10
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 9.50000% 05-02.02.30	1 370 000.00	2 062 062.35	0.04
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 3.00000% 18-01.02.28	3 390 000.00	3 262 875.00	0.07
USD PHOSAGRO BOND FUNDING LTD-REG-S LPN 3.95000% 17-03.11.21	5 070 000.00	4 966 135.47	0.10
USD PLA ADMINIST INDUST S DE RL DE CV-REG-S 5.25000% 15-10.11.22	2 435 000.00	2 459 350.00	0.05
USD POLAND, REPUBLIC OF 3.00000% 12-17.03.23	3 266 000.00	3 236 024.33	0.07
USD POLAND, REPUBLIC OF 3.25000% 16-06.04.26	11 415 000.00	11 354 272.20	0.24
USD POLYUS FINANCE PLC-REG-S 5.25000% 17-07.02.23	1 410 000.00	1 401 187.50	0.03
USD POLYUS FINANCE PLC-REG-S 4.70000% 18-29.01.24	1 150 000.00	1 104 000.00	0.02
USD POWER SECTOR ASST & LIAB MGT CORP-REG-S 7.39000% 09-02.12.24	1 327 000.00	1 578 645.64	0.03
USD PROVINCE OF CORDOBA-REG-S 7.12500% 16-10.06.21	966 000.00	874 230.00	0.02
USD PROVINCE OF CORDOBA-REG-S 7.45000% 17-01.09.24	720 000.00	597 600.00	0.01

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD PTT PUBLIC COMPANY LTD-REG-S 4.50000% 12-25.10.42	1 454 000.00	1 363 321.29	0.03
USD QATAR, STATE OF-144A 5.10300% 18-23.04.48	200 000.00	214 750.00	0.00
USD QATAR, STATE OF-REG-S 4.50000% 11-20.01.22	5 930 000.00	6 137 550.00	0.13
USD QATAR, STATE OF-REG-S 2.37500% 16-02.06.21	3 614 000.00	3 550 755.00	0.07
USD QATAR, STATE OF-REG-S 3.87500% 18-23.04.23	4 348 000.00	4 429 525.00	0.09
USD QATAR, STATE OF-REG-S 4.50000% 18-23.04.28	5 397 000.00	5 693 835.00	0.12
USD QATAR, STATE OF-REG-S 5.10300% 18-23.04.48	16 041 000.00	17 224 023.75	0.36
USD REDE D'OR FINANCE SARL-REG-S 4.95000% 18-17.01.28	1 434 000.00	1 337 205.00	0.03
USD RELIANCE HOLDINGS USA INC-REG-S 5.40000% 12-14.02.22	420 000.00	436 272.90	0.01
USD RELIANCE INDUSTRIES LTD-REG-S 3.66700% 17-30.11.27	8 446 000.00	7 873 403.43	0.16
USD RELIANCE INDUSTRIES LTD-REG-S 4.12500% 15-28.01.25	4 410 000.00	4 366 936.35	0.09
USD REPUBLIC OF AZERBAIJAN-REG-S 4.75000% 14-18.03.24	4 541 000.00	4 603 438.75	0.10
USD REPUBLIC OF TAJIKISTAN INTER BOND-REG-S 7.12500% 17-14.09.27	2 950 000.00	2 640 250.00	0.05
USD REPUBLIC OF TURKEY 7.25000% 18-23.12.23	3 135 000.00	3 291 750.00	0.07
USD RKPF OVERSEAS 2019 A LTD-REG-S 7.87500% 19-01.02.23	863 000.00	869 472.50	0.02
USD RKPF OVERSEAS 2019 B LTD-REG-S 7.75000% 19-18.04.21	375 000.00	382 560.00	0.01
USD ROLTA AMERICAS LLC *DEFAULT* 8.87500% 14-24.07.19	2 190 000.00	332 201.10	0.01
USD ROMANIA-REG-S 5.12500% 18-15.06.48	3 500 000.00	3 447 500.00	0.07
USD RONESANS GAYRIMENKUL YATIRIM AS-REG-S 7.25000% 18-26.04.23	3 737 000.00	3 026 970.00	0.06
USD RSHB CAPITAL SA-REG-S LPN 8.50000% 13-16.10.23	1 838 000.00	1 874 760.00	0.04
USD RUMO LUXEMBOURG SARL-REG-S 7.37500% 17-09.02.24	1 706 000.00	1 801 962.50	0.04
USD RUMO LUXEMBOURG SARL-REG-S 5.87500% 18-18.01.25	1 640 000.00	1 621 714.00	0.03
USD RUSSIA, FEDERATION OF-REG-S 5.62500% 12-04.04.42	2 800 000.00	2 999 500.00	0.06
USD SACI FALABELLA-REG-S 4.37500% 14-27.01.25	322 000.00	322 000.00	0.01
USD SAKA ENERGI INDONESIA PT-REG-S 4.45000% 17-05.05.24	600 000.00	564 000.00	0.01
USD SANDS CHINA LTD 5.40000% 19-08.08.28	3 807 000.00	3 786 061.50	0.08
USD SASOL FINANCING USA LLC 5.87500% 18-27.03.24	19 262 000.00	19 839 860.00	0.41
USD SASOL FINANCING USA LLC 6.50000% 18-26.09.28	1 037 000.00	1 090 716.60	0.02
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 4.37500% 19-16.04.29	2 100 000.00	2 134 125.00	0.04
USD SB CAPITAL SA FOR SBERBK-REG-S-SUB LPN 5.12500% 12-29.10.22	1 110 000.00	1 107 225.00	0.02
USD SENEGAL, REPUBLIC OF-REG-S 6.75000% 18-13.03.48	1 393 000.00	1 239 770.00	0.03
USD SEPLAT PETROLEUM DEVELOPMENT CO-REG-S 9.25000% 18-01.04.23	1 012 000.00	1 028 445.00	0.02
USD SERBIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 7.25000% 11-28.09.21	16 398 000.00	17 824 626.00	0.37
USD SHINHAN BANK-REG-S 2.87500% 17-28.03.22	1 100 000.00	1 083 428.50	0.02
USD SIGMA ALIMENTOS-REG-S 4.12500% 16-02.05.26	1 781 000.00	1 718 130.70	0.04
USD SIGMA FINANCE NETHERLANDS BV-REG-S 4.87500% 18-27.03.28	1 544 000.00	1 528 560.00	0.03
USD SINOCHEM OVERSEAS CAPITAL-REG-S 4.50000% 10-12.11.20	1 146 000.00	1 163 493.69	0.02
USD SINOCHEM OVERSEAS CAPITAL CO LTD-REG-S 6.30000% 10-12.11.40	500 000.00	606 572.50	0.01
USD SINOPEC GROUP OVERSEAS DEV12 LTD-REG-S 4.87500% 12-17.05.42	377 000.00	402 087.46	0.01
USD SK TELECOM CO LTD-REG-S 3.75000% 18-16.04.23	240 000.00	240 763.13	0.00
USD SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHIL-REG-S 5.50000% 10-21.04.20	4 099 000.00	4 190 715.12	0.09
USD SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHIL-REG-S 3.62500% 13-03.04.23	300 000.00	291 000.00	0.01
USD SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHIL-REG-S 4.37500% 14-28.01.25	4 650 000.00	4 581 900.75	0.10
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.87500% 07-30.05.22	1 497 000.00	1 575 592.50	0.03
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.37500% 14-24.07.44	1 900 000.00	1 769 375.00	0.04
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 4.87500% 16-14.04.26	1 726 000.00	1 708 740.00	0.04
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.65000% 17-27.09.47	1 930 000.00	1 833 500.00	0.04
USD SOUTHERN COPPER CORP 7.50000% 05-27.07.35	705 000.00	851 287.50	0.02
USD SOUTHERN COPPER CORP 6.75000% 10-16.04.40	2 230 000.00	2 564 500.00	0.05
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-144A 6.12500% 15-03.06.25	430 000.00	410 112.50	0.01
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 6.25000% 10-04.10.20	5 001 000.00	5 011 177.04	0.10
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 6.25000% 11-27.07.21	1 200 000.00	1 201 458.00	0.02
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 5.87500% 12-25.07.22	5 492 000.00	5 388 393.41	0.11
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 6.12500% 15-03.06.25	7 150 000.00	6 810 375.00	0.14
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 6.82500% 16-18.07.26	8 084 000.00	7 873 128.85	0.16
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 5.75000% 16-18.01.22	1 200 000.00	1 180 890.00	0.02
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 6.20000% 17-11.05.27	7 334 000.00	6 811 929.21	0.14
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 5.75000% 18-18.04.23	6 850 000.00	6 608 982.75	0.14

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 6.75000% 18-18.04.28	13 795 000.00	13 174 225.00	0.27
USD SSB #1 PLC-REG-S LPN STEP-UP 15-20.03.25	1 300 000.00	1 262 625.00	0.03
USD STAR ENERGY GEOTHERMAL WAYANG-REG-S 6.75000% 18-24.04.33	3 160 000.00	2 997 560.20	0.06
USD STATE BANK OF INDIA LONDON-REG-S 4.50000% 18-28.09.23	800 000.00	812 146.40	0.02
USD STATE GRID OVERSEAS INVESTMENT-REG-S 2.12500% 16-18.05.21	2 806 000.00	2 729 213.81	0.06
USD STUDIO CITY CO LTD-REG-S 7.25000% 16-30.11.21	5 320 000.00	5 478 429.60	0.11
USD STUDIO CITY FINANCE LTD-REG-S 7.25000% 19-11.02.24	602 000.00	608 628.02	0.01
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 7.35000% 18-19.07.21	1 310 000.00	1 303 450.00	0.03
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 8.35000% 18-19.04.23	1 573 000.00	1 533 675.00	0.03
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 8.62500% 18-27.07.20	248 000.00	252 960.00	0.01
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 8.37500% 19-15.01.21	2 565 000.00	2 609 412.98	0.05
USD SURA ASSET MANAGEMENT SA-REG-S 4.37500% 17-11.04.27	830 000.00	792 650.00	0.02
USD SUZANO AUSTRIA GMBH-REG-S 6.00000% 19-15.01.29	632 000.00	661 230.00	0.01
USD TAQA ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO-REG-S 3.62500% 12-12.01.23	1 020 000.00	1 019 082.00	0.02
USD TECPETROL SA-REG-S 4.87500% 17-12.12.22	6 881 000.00	6 410 339.60	0.13
USD TERMOCANDELARIA POWER LTD-REG-S 7.87500% 19-30.01.29	1 680 000.00	1 729 896.00	0.04
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 2.20000% 16-21.07.21	1 140 000.00	1 077 567.03	0.02
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 2.80000% 16-21.07.23	8 914 000.00	8 021 488.16	0.17
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 3.15000% 16-01.10.26	5 025 000.00	4 172 265.69	0.09
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 4.10000% 16-01.10.46	7 637 000.00	5 607 665.20	0.12
USD THIRD PAKISTAN INTERNATIONAL SUK-REG-S 5.62500% 17-05.12.22	1 898 000.00	1 855 295.00	0.04
USD TMK OAO VIA TMK CAPITAL SA-REG-S LPN 6.75000% 13-03.04.20	1 000 000.00	1 013 750.00	0.02
USD TRANSNET SOC LTD-REG-S 4.00000% 12-26.07.22	1 000 000.00	958 000.00	0.02
USD TRANSPORTADORA DE GAS DEL SUR SA-REG-S 6.75000% 18-02.05.25	630 000.00	587 349.00	0.01
USD TRUST F/1401-REG-S 5.25000% 14-15.12.24	2 494 000.00	2 484 647.50	0.05
USD TULLOW OIL PLC-REG-S-SUB 6.25000% 14-15.04.22	3 750 000.00	3 698 437.50	0.08
USD TUPRAS TURKIYE PETROL-REG-S 4.50000% 17-18.10.24	2 182 000.00	1 982 892.50	0.04
USD TURK TELEKOMUNIKASYON AS-REG-S 4.87500% 14-19.06.24	854 000.00	785 680.00	0.02
USD TURKCELL ILETISIM HIZMETLERI AS-REG-S 5.80000% 18-11.04.28	2 870 000.00	2 640 400.00	0.05
USD TURKEY, REPUBLIC OF 7.37500% 05-05.02.25	850 000.00	890 375.00	0.02
USD TURKEY, REPUBLIC OF 7.00000% 05-05.06.20	420 000.00	431 025.00	0.01
USD TURKEY, REPUBLIC OF 6.87500% 06-17.03.36	2 270 000.00	2 227 437.50	0.05
USD TURKEY, REPUBLIC OF 7.50000% 09-07.11.19	23 357 000.00	23 853 336.25	0.50
USD TURKEY, REPUBLIC OF 6.75000% 10-30.05.40	420 000.00	406 350.00	0.01
USD TURKEY, REPUBLIC OF 6.00000% 11-14.01.41	6 281 000.00	5 574 387.50	0.12
USD TURKEY, REPUBLIC OF 5.12500% 11-25.03.22	620 000.00	611 475.00	0.01
USD TURKEY, REPUBLIC OF 6.25000% 12-26.09.22	5 450 000.00	5 545 375.00	0.12
USD TURKEY, REPUBLIC OF 3.25000% 13-23.03.23	20 034 000.00	18 281 025.00	0.38
USD TURKEY, REPUBLIC OF 4.87500% 13-16.04.43	24 046 000.00	18 876 110.00	0.39
USD TURKEY, REPUBLIC OF 4.87500% 16-09.10.26	3 000 000.00	2 718 750.00	0.06
USD TURKEY, REPUBLIC OF 6.00000% 17-25.03.27	5 929 000.00	5 714 073.75	0.12
USD TURKEY, REPUBLIC OF 5.75000% 17-11.05.47	6 462 000.00	5 508 855.00	0.11
USD TURKEY, REPUBLIC OF 5.12500% 18-17.02.28	12 478 000.00	11 245 797.50	0.23
USD TURKEY, REPUBLIC OF 7.62500% 19-26.04.29	3 257 000.00	3 415 860.17	0.07
USD TURKIYE GARANTI BANKASI AS-REG-S 5.25000% 12-13.09.22	2 218 000.00	2 132 052.50	0.04
USD TURKIYE GARANTI BANKASI AS-REG-S 5.87500% 17-16.03.23	1 480 000.00	1 426 350.00	0.03
USD TURKIYE IS BANKASI-REG-S 6.12500% 17-25.04.24	5 579 000.00	4 979 257.50	0.10
USD UKRAINE GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.19	1 177 000.00	1 179 942.50	0.02
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.20	7 353 000.00	7 279 470.00	0.15
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.22	2 673 000.00	2 579 445.00	0.05
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.23	1 049 000.00	1 001 795.00	0.02
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.24	8 105 000.00	7 557 912.50	0.16
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.25	20 273 000.00	18 600 477.50	0.39
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.26	10 804 000.00	9 804 630.00	0.20
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.27	11 151 000.00	10 063 777.50	0.21
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.37500% 17-25.09.32	31 463 000.00	26 743 550.00	0.56
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 8.99400% 18-01.02.24	1 103 000.00	1 083 697.50	0.02
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 9.75000% 18-01.11.28	1 743 000.00	1 725 570.00	0.04

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD UNIFIN FINANCIERA SA DE CV-REG-S 7.37500% 18-12.02.26	5 712 000.00	5 077 968.00	0.11
USD UNION ANDINA DE CEMENTOS SAA-REG-S 5.87500% 14-30.10.21	1 104 000.00	1 126 080.00	0.02
USD UPL CORP LTD-REG-S 4.50000% 18-08.03.28	3 850 000.00	3 587 296.79	0.07
USD URUGUAY, REPUBLIC OF 4.12500% 12-20.11.45	690 000.00	643 424.99	0.01
USD VALE OVERSEAS LTD 4.37500% 12-11.01.22	1 540 000.00	1 539 230.00	0.03
USD VALE OVERSEAS LTD 6.87500% 06-21.11.36	3 737 000.00	4 121 163.60	0.09
USD VALE OVERSEAS LTD 6.25000% 16-10.08.26	5 849 000.00	6 236 496.25	0.13
USD VEB FINANCE PLC-REG-S LPN 6.02500% 12-05.07.22	307 000.00	313 140.00	0.01
USD VEB FINANCE PLC-REG-S LPN 5.94200% 13-21.11.23	246 000.00	247 845.00	0.01
USD VEDANTA RESOURCES PLC-REG-S 8.25000% 11-07.06.21	2 772 000.00	2 869 671.42	0.06
USD VEDANTA RESOURCES PLC-REG-S 6.37500% 17-30.07.22	3 689 000.00	3 522 995.00	0.07
USD VENEZUELA, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 7.75000% 09-13.10.19	6 103 700.00	1 861 628.50	0.04
USD VENEZUELA, REPUBLIC OF REG-S *DEFAULTED* 8.25000% 09-13.10.24	19 069 700.00	6 102 304.00	0.13
USD VENEZUELA, REPUBLIC OF *DEFAULTED* 7.65000% 05-21.04.25	1 420 000.00	443 750.00	0.01
USD VOLCAN CIA MINERA SAA-REG-S 5.37500% 12-02.02.22	1 733 000.00	1 763 322.64	0.04
USD VOTORANTIM CIMENTOS INTL SA-REG-S 7.25000% 11-05.04.41	7 395 000.00	7 711 284.15	0.16
USD WTT INVESTMENT LTD/HONG KONG-REG-S 5.50000% 17-21.11.22	5 817 000.00	5 788 496.70	0.12
USD WYNN MACAU LTD-REG-S 4.87500% 17-01.10.24	850 000.00	784 125.00	0.02
USD YAPI VE KREDI BANKASI AS-REG-S 4.00000% 13-22.01.20	270 000.00	262 912.50	0.01
USD YPF SA-REG-S 6.95000% 17-21.07.27	2 336 000.00	2 096 560.00	0.04
USD YPF SA-REG-S 7.00000% 17-15.12.47	3 251 000.00	2 656 067.00	0.06
USD YPF SA-REG-S 8.50000% 15-28.07.25	7 040 000.00	6 892 160.00	0.14
USD YPF SA-REG-S 8.75000% 14-04.04.24	730 000.00	732 336.00	0.02
USD ZAMBIA, REPUBLIC OF-REG-S 8.50000% 14-14.04.24	4 150 000.00	3 413 375.00	0.07
USD ZAMBIA, REPUBLIC OF-REG-S 8.97000% 15-30.07.27	12 330 000.00	10 172 250.00	0.21
USD ZENITH BANK PLC-REG-S 7.37500% 17-30.05.22	7 760 000.00	7 905 500.00	0.16
米ドル合計		2 215 411 893.15	46.00
ノート、固定利付債合計		2 267 730 233.48	47.09
ノート、変動利付債			
ユーロ			
EUR ARGENTINA, REPUBLIC OF VAR 10-31.12.33	1 100 000.00	1 558 877.81	0.03
ユーロ合計		1 558 877.81	0.03
米ドル			
USD AKBANK TAS-REG-S-SUB 6.797%/VAR 18-27.04.28	9 571 000.00	8 266 951.25	0.17
USD BANCO DE CREDITO DEL PERU/P-REG-S-SUB 6.125%/VAR 12-24.04.27	2 250 000.00	2 373 750.00	0.05
USD BANCO DO BRASIL CAYMAN-REG-S-SUB 6.250%/VAR 13-PRP	10 506 000.00	9 484 816.80	0.20
USD BANCO DO BRASIL CAYMAN-REG-S-SUB 9.000%/VAR 14-PRP	14 734 000.00	15 691 710.00	0.33
USD BANCO GNB SUDAMERIS SA-REG-S-SUB 6.500%/VAR 17-03.04.27	491 000.00	499 101.50	0.01
USD BANCO INTL PERU-REG-S 6.625%/3M LIBOR+576BP 14-19.03.29	1 187 000.00	1 267 122.50	0.03
USD BANCO MACRO SA-REG-S-SUB 6.750%/VAR 16-04.11.26	1 398 000.00	1 165 582.50	0.02
USD BANCO MER DEL NORTE SA/GRAND CY-144A-SUB 6.875%/VAR 17-PRP	1 460 000.00	1 445 400.00	0.03
USD BANCO MER DEL NORTE SA/GRAND CY-REG-S-SUB 7.625%/VAR 17-PRP	4 805 000.00	4 766 560.00	0.10
USD BANCO MERCANTIL DEL NORTE-REG-S-SUB 5.750%/VAR 16-04.10.31	1 781 000.00	1 669 865.60	0.03
USD BANCO MERCANTIL DEL NORT SA/G CA-REG-S-SUB 6.875%/VAR 17-PRP	7 976 000.00	7 896 240.00	0.16
USD BANCO NACIONAL DE COM EXT-REG-S-SUB 3.800%/VAR 16-11.08.26	2 558 000.00	2 475 082.43	0.05
USD BBVA BANCO CONTINENTAL SA-REG-S-SUB 5.250%/VAR 14-22.09.29	928 000.00	953 520.00	0.02
USD CAIX ECO FED-REG-S-SUB 7.250%/VAR 14-23.07.24	1 800 000.00	1 818 000.00	0.04
USD CK HUTCHISON CAPITAL SEC 17 LTD-REG-S-SUB 4.000%/VAR 17-PRP	2 925 000.00	2 755 847.25	0.06
USD COLOMBIA TELECOMUNICACIONES SA-REG-S-SUB 8.500%/VAR 15-PRP	2 977 000.00	3 084 916.25	0.06
USD CORP FINANCIERA DE DESARROL-REG-S-SUB 5.250%/VAR 14-15.07.29	1 380 000.00	1 400 582.70	0.03
USD CREDIT BK MOSCOW/CBOM FIN-REG-S-SUB 7.500%/VAR 17-05.10.27	14 370 000.00	11 783 400.00	0.24
USD CREDIT BK MOSCOW/CBOM FIN-REG-S-SUB 8.875%/VAR 17-PRP	320 000.00	256 000.00	0.01
USD ENERGY RESOURCES LLC (PIK) VAR 17-30.09.22	3 931 227.00	3 691 775.97	0.08
USD HANWHA LIFE INSURANCE CO-REG-S-SUB 4.700%/VAR 18-23.04.48	1 665 000.00	1 592 780.63	0.03

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD HUARONG FINANCE 2017 CO-REG-S 3M LIBOR+185BP 17-27.04.22	923 000.00	920 312.78	0.02
USD MONGOLIAN MINING CORP (PIK) VAR 17-PRP	2 675 901.00	1 311 191.49	0.03
USD PETROLEOS MEXICANOS 3M LIBOR+365BP 18-11.03.22	3 048 000.00	3 075 432.00	0.06
USD PTTEP TREASURY CENTER CO LTD-REG-S-SUB 4.600%/VAR 17-PRP	1 500 000.00	1 413 082.50	0.03
USD PTTEP TREASURY CENTER CO LTD-REG-S-SUB 4.875%/VAR 17-PRP	254 000.00	252 467.11	0.01
USD SB CAPITAL SA FOR SBERBANK-REG-S-SUB 5.500%/VAR 14-26.02.24	3 709 000.00	3 708 072.75	0.08
USD TURKIYE GARANTI BANK AS-REG-S-SUB 6.125%/VAR 17-24.05.27	4 527 000.00	3 927 172.50	0.08
USD VTB EURASIA LTD-REG-S-SUB 9.500%/VAR 12-PRP	940 000.00	940 000.00	0.02
米ドル合計		99 886 736.51	2.08
ノート、変動利付債合計		101 445 614.32	2.11
中期債券、固定利付債			
ユーロ			
EUR EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 5.62500% 18-16.04.30	2 216 000.00	2 307 544.90	0.05
EUR EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 4.75000% 18-16.04.26	7 738 000.00	8 312 933.89	0.17
EUR GLOBALWORTH REAL ESTATE INVEST-REG-S 3.00000% 18-29.03.25	1 370 000.00	1 516 396.77	0.03
EUR INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 3.75000% 16-14.06.28	6 028 000.00	7 781 432.17	0.16
EUR KAZAKHSTAN, REPUBLIC OF-REG-S 2.37500% 18-09.11.28	1 346 000.00	1 558 051.29	0.03
EUR KAZAKHSTAN, REPUBLIC OF-REG-S 1.55000% 18-09.11.23	5 639 000.00	6 591 791.87	0.14
EUR NE PROPERTY COOPERATIEF UA-REG-S 1.75000% 17-23.11.24	2 040 000.00	2 077 458.22	0.04
EUR PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 5.12500% 16-15.03.23	3 520 000.00	4 230 877.64	0.09
EUR ROMANIA-REG-S 2.37500% 17-19.04.27	170 000.00	194 091.17	0.01
EUR ROMANIA-REG-S 2.87500% 18-11.03.29	2 980 000.00	3 312 544.72	0.07
EUR ROMANIA-REG-S 3.37500% 18-08.02.38	4 490 000.00	4 662 605.70	0.10
EUR ROMANIA-REG-S 3.87500% 15-29.10.35	2 260 000.00	2 541 372.26	0.05
EUR ROMANIA-REG-S 4.12500% 18-11.03.39	3 160 000.00	3 544 358.30	0.07
EUR TURKEY, REPUBLIC OF 3.25000% 17-14.06.25	570 000.00	611 533.48	0.01
ユーロ合計		49 242 992.38	1.02
米ドル			
USD ABQ FINANCE LTD-REG-S 3.62500% 16-13.04.21	3 863 000.00	3 814 712.50	0.08
USD ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO PJSC-REG-S 4.37500% 16-22.06.26	1 290 000.00	1 306 125.00	0.03
USD ACCESS BANK PLC-REG-S 10.50000% 16-19.10.21	2 788 000.00	3 000 585.00	0.06
USD AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK-REG-S 4.75000% 14-29.07.19	4 365 000.00	4 384 642.50	0.09
USD AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK-REG-S 4.12500% 17-20.06.24	2 647 000.00	2 541 225.88	0.05
USD AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK-REG-S 5.25000% 18-11.10.23	2 719 000.00	2 775 337.68	0.06
USD ARAB PETROLEUM INVESTMENTS CORP-REG-S 4.12500% 18-18.09.23	2 350 000.00	2 381 953.42	0.05
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF 6.87500% 17-22.04.21	7 384 000.00	7 044 336.00	0.15
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF 7.50000% 17-22.04.26	1 873 000.00	1 657 605.00	0.03
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF 7.62500% 17-22.04.46	9 337 000.00	7 562 970.00	0.16
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF 6.62500% 17-06.07.28	1 500 000.00	1 233 750.00	0.03
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF 7.12500% 17-06.07.36	3 727 000.00	2 953 647.50	0.06
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF 6.87500% 17-26.01.27	2 910 000.00	2 458 950.00	0.05
USD AZURE ORBIT IV INTL FIN LTD-REG-S 3.75000% 18-25.01.23	1 781 000.00	1 752 018.19	0.04
USD BANCO DO BRASIL CAYMAN-REG-S 4.87500% 18-19.04.23	613 000.00	619 436.50	0.01
USD BANCO DO BRASIL SA/CAYMAN-REG-S 4.62500% 17-15.01.25	4 366 000.00	4 279 378.56	0.09
USD BANK OF EAST ASIA LTD/THE-SUB 6.12500% 10-16.07.20	560 000.00	579 460.50	0.01
USD BANK OF THE PHILIPPINE ISLANDS-REG-S 4.25000% 18-04.09.23	699 000.00	707 398.49	0.02
USD BANKOK BANK PCL HONG KONG-REG-S 4.05000% 18-19.03.24	7 632 000.00	7 745 602.32	0.16
USD BATELCO INTERNATIONAL FINANCE-REG-S 4.25000% 13-01.05.20	2 558 000.00	2 538 815.00	0.05
USD BHARAT PETROLEUM CORP LTD-REG-S 4.00000% 15-08.05.25	590 000.00	573 211.55	0.01
USD BHARAT PETROLEUM CORP LTD-REG-S 4.37500% 19-24.01.22	1 109 000.00	1 120 226.85	0.02
USD BOCOM LEASING MGT HONG KONG-REG-S 4.37500% 19-22.01.24	526 000.00	532 514.51	0.01
USD CBQ FINANCE LTD-REG-S 5.00000% 18-24.05.23	1 410 000.00	1 439 137.65	0.03
USD CDBL FUNDING 1-REG-S 3.00000% 17-24.04.23	1 280 000.00	1 223 639.42	0.03
USD CDBL FUNDING 2-REG-S 3.00000% 17-01.08.22	1 183 000.00	1 144 150.36	0.02

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD CHARMING LIGHT INVESTMENTS LTD-REG-S 4.37500% 17-21.12.27	3 204 000.00	3 088 864.25	0.06
USD CHINA EVERGRANDE GROUP-REG-S 9.50000% 17-29.03.24	3 337 000.00	3 103 410.00	0.06
USD DAR AL-ARKAN SUKUK CO LTD-REG-S 6.87500% 17-10.04.22	3 158 000.00	2 984 310.00	0.06
USD DP WORLD CRESCENT LTD-REG-S 4.84800% 18-26.09.28	8 370 000.00	8 432 775.00	0.18
USD DP WORLD LTD-REG-S 5.62500% 18-25.09.48	4 810 000.00	4 749 875.00	0.10
USD DP WORLD-REG-S 6.85000% 07-02.07.37	1 970 000.00	2 295 050.00	0.05
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 5.87500% 15-11.06.25	1 852 000.00	1 743 195.00	0.04
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 8.50000% 17-31.01.47	11 523 000.00	11 105 636.94	0.23
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.50000% 17-31.01.27	5 940 000.00	5 888 025.00	0.12
USD EQUATE PETROCHEMICAL BV-REG-S 4.25000% 16-03.11.26	6 752 000.00	6 693 932.80	0.14
USD ESKOM HOLDINGS SOC LTD-REG-S 6.35000% 18-10.08.28	8 582 000.00	8 775 095.00	0.18
USD EXIMCH/ AVI FUNDING CO LTD-REG-S 3.80000% 15-16.09.25	7 393 000.00	7 365 313.21	0.15
USD EXPORT CREDIT BANK OF TURKEY-REG-S 5.37500% 16-08.02.21	1 220 000.00	1 195 600.00	0.03
USD EXPORT-IMPORT BANK OF INDIA-REG-S 4.00000% 13-14.01.23	851 000.00	853 157.29	0.02
USD FINANSBANK AS-REG-S 4.87500% 17-19.05.22	2 656 000.00	2 509 521.60	0.05
USD GREENLAND GLOBAL INVESTMENT LTD-REG-S 7.87500% 19-24.10.20	815 000.00	825 187.50	0.02
USD HLP FINANCE LTD-REG-S 4.75000% 12-25.06.22	640 000.00	658 092.80	0.01
USD HLP FINANCE LTD-REG-S 4.45000% 14-16.04.21	1 471 000.00	1 490 351.01	0.03
USD HUARONG FINANCE II CO LTD-REG-S 5.50000% 15-16.01.25	4 280 000.00	4 381 029.40	0.09
USD HUARONG FINANCE II CO LTD-REG-S 5.00000% 15-19.11.25	490 000.00	488 519.59	0.01
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.87500% 10-13.03.20	3 940 000.00	4 053 570.50	0.08
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 4.12500% 15-15.01.25	9 779 000.00	9 877 523.42	0.21
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.87500% 14-15.01.24	2 386 000.00	2 607 647.47	0.05
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 6.75000% 14-15.01.44	3 071 000.00	3 850 465.86	0.08
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.12500% 15-15.01.45	2 413 000.00	2 503 752.93	0.05
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 4.75000% 15-08.01.26	10 648 000.00	11 088 028.60	0.23
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 5.95000% 15-08.01.46	1 529 000.00	1 760 261.25	0.04
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 4.75000% 17-18.07.47	533 000.00	529 668.75	0.01
USD IPIC GMTN LTD-REG-S 5.50000% 11-01.03.22	1 300 000.00	1 374 750.00	0.03
USD ISRAEL ELECTRIC CORP LTD-144A-REG-S 4.25000% 18-14.08.28	2 000 000.00	1 987 500.00	0.04
USD KAZAKHSTAN, REPUBLIC OF-REG-S 6.50000% 15-21.07.45	2 030 000.00	2 527 350.00	0.05
USD KOOKMIN BANK-REG-S-SUB 4.50000% 19-01.02.29	2 550 000.00	2 557 873.38	0.05
USD KSA SUKUK LTD-REG-S 4.30300% 18-19.01.29	5 900 000.00	5 988 500.00	0.12
USD KUWAIT PROJECTS CO SPC LTD-REG-S 4.80000% 14-05.02.19	6 900 000.00	6 898 068.00	0.14
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S 8.25000% 06-12.04.21	6 745 000.00	6 424 612.50	0.13
USD LEBANON, REPUBLIC OF 6.37500% 10-09.03.20	7 578 000.00	7 274 880.00	0.15
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S 6.10000% 10-04.10.22	3 253 000.00	2 858 573.75	0.06
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S 6.00000% 11-20.05.19	1 144 000.00	1 133 990.00	0.02
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S 5.45000% 11-28.11.19	4 446 000.00	4 368 195.00	0.09
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S 6.60000% 11-27.11.26	3 028 000.00	2 535 950.00	0.05
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S 5.80000% 14-14.04.20	3 700 000.00	3 482 625.00	0.07
USD MDC-GMTN B.V-REG-S 4.50000% 18-07.11.28	797 000.00	843 664.35	0.02
USD MEXICO, UNITED STATES OF 3.62500% 12-15.03.22	1 690 000.00	1 685 775.00	0.04
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.75000% 12-08.03.44	604 000.00	569 270.00	0.01
USD MEXICO, UNITED STATES OF 3.50000% 14-21.01.21	4 000 000.00	4 000 000.00	0.08
USD MEXICO, UNITED STATES OF 5.55000% 14-21.01.45	661 000.00	694 050.00	0.01
USD MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 10.87500% 16-06.04.21	5 272 000.00	5 832 150.00	0.12
USD MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 8.75000% 17-09.03.24	13 465 000.00	14 736 836.57	0.31
USD NAN FUNG TREASURY LTD-REG-S 3.87500% 17-03.10.27	4 514 000.00	4 087 969.90	0.09
USD NAN FUNG TREASURY LTD-REG-S 5.00000% 18-05.09.28	1 623 000.00	1 581 340.96	0.03
USD NATIONAL BANK OF OMAN LTD-REG-S 5.62500% 18-25.09.23	7 963 000.00	7 654 433.75	0.16
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 6.50000% 17-28.11.27	10 949 000.00	10 497 353.75	0.22
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.62500% 17-28.11.47	3 070 000.00	2 889 637.50	0.06
USD NTPC LTD-REG-S 4.50000% 18-19.03.28	1 540 000.00	1 498 389.20	0.03
USD NWD MTN LTD-REG-S 5.25000% 14-26.02.21	1 200 000.00	1 233 104.16	0.03
USD OVERSEA-CHINESE BANKING CORP-REG-S-SUB 4.25000% 14-19.06.24	8 592 000.00	8 686 125.36	0.18
USD PANAMA, REPUBLIC OF 9.37500% 99-01.04.29	2 566 000.00	3 682 210.00	0.08
USD PERTAMINA PT-REG-S 6.50000% 18-07.11.48	506 000.00	562 158.41	0.01

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 4.12500% 17-15.05.27	2 500 000.00	2 395 462.50	0.05
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 5.25000% 17-15.05.47	1 583 000.00	1 515 722.50	0.03
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 5.45000% 18-21.05.28	1 353 000.00	1 417 166.02	0.03
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 6.15000% 18-21.05.48	4 450 000.00	4 778 187.50	0.10
USD PETROLEOS MEXICANOS 5.62500% 16-23.01.46	11 469 000.00	9 116 708.10	0.19
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 10.62500% 00-16.03.25	580 000.00	810 355.70	0.02
USD POWER FINANCE CORP LTD-REG-S 3.75000% 17-06.12.27	2 990 000.00	2 600 455.62	0.05
USD QNB FINANCE LTD-REG-S 2.12500% 16-07.09.21	3 000 000.00	2 876 250.00	0.06
USD RIZAL COMMERCIAL BANKING CORP-REG-S 4.12500% 18-16.03.23	1 020 000.00	998 580.00	0.02
USD ROMANIA-REG-S 4.87500% 14-22.01.24	6 006 000.00	6 246 240.00	0.13
USD ROMANIA-REG-S 6.12500% 14-22.01.44	242 000.00	269 225.00	0.01
USD ROMANIA-REG-S 6.75000% 12-07.02.22	10 940 000.00	11 801 525.00	0.25
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 2.37500% 16-26.10.21	23 162 000.00	22 525 045.00	0.47
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 3.25000% 16-26.10.26	1 600 000.00	1 528 000.00	0.03
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 4.62500% 17-04.10.47	3 714 000.00	3 491 160.00	0.07
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 4.50000% 18-17.04.30	1 164 000.00	1 185 825.00	0.03
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 5.00000% 18-17.04.49	3 250 000.00	3 217 500.00	0.07
USD SECOND PAKISTAN INTL SUKUK CO LTD-REG-S 6.75000% 14-03.12.19	1 220 000.00	1 220 000.00	0.03
USD SECURITY BANK CORP-REG-S 4.50000% 18-25.09.23	2 377 000.00	2 396 455.75	0.05
USD SHARJAH SUKUK PROGRAM LTD-REG-S 4.22600% 18-14.03.28	2 570 000.00	2 576 425.00	0.05
USD SHINHAN BANK-REG-S-SUB 3.87500% 16-24.03.26	955 000.00	926 698.57	0.02
USD SHINHAN BANK-REG-S-SUB 4.50000% 18-26.03.28	1 831 000.00	1 832 088.16	0.04
USD SIAM COMMERCIAL BK CAYMAN ISLAND-REG-S 3.90000% 19-11.02.24	1 599 000.00	1 609 654.78	0.03
USD SIAM COMMERCIAL BK CAYMAN ISLAND-REG-S 4.40000% 19-11.02.29	2 302 000.00	2 338 866.53	0.05
USD STANDARD BANK PLC-SUB 8.12500% 09-02.12.19	1 950 000.00	2 004 990.00	0.04
USD STATE OIL OF THE AZERBAIJAN REP-REG-S 4.75000% 13-13.03.23	5 747 000.00	5 775 735.00	0.12
USD TC ZIRAAT BANKASI AS-REG-S 4.75000% 16-29.04.21	3 314 000.00	3 160 727.50	0.07
USD TC ZIRAAT BANKASI AS-REG-S 5.12500% 17-03.05.22	3 026 000.00	2 817 962.50	0.06
USD TC ZIRAAT BANKASI AS-REG-S 5.12500% 17-29.09.23	324 000.00	292 815.00	0.01
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.59500% 18-19.01.28	850 000.00	823 578.01	0.02
USD THAIOIL TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 4.62500% 18-20.11.28	3 317 000.00	3 417 946.93	0.07
USD THAIOIL TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 5.37500% 18-20.11.48	6 033 000.00	6 418 116.55	0.13
USD TURKIYE BANKASI AS-REG-S 5.37500% 16-06.10.21	7 208 000.00	6 847 600.00	0.14
USD TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO-REG-S 5.50000% 16-27.10.21	295 000.00	282 462.50	0.01
USD TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO-REG-S 5.75000% 18-30.01.23	2 257 000.00	2 105 374.74	0.04
USD VANKE REAL ESTAT HONG KONG CO LTD-REG-S 3.97500% 17-09.11.27	1 480 000.00	1 369 969.40	0.03
USD VANKE REAL ESTAT HONG KONG CO LTD-REG-S 5.35000% 18-11.03.24	1 000 000.00	1 035 316.80	0.02
USD VIGOROUS CHAMPION INTERNATIONAL-REG-S 4.37500% 18-10.09.23	1 280 000.00	1 285 339.90	0.03
USD VLL INTERNATIONAL INC-REG-S 5.75000% 17-28.11.24	2 133 000.00	1 991 294.15	0.04
USD YAPI VE KREDI BANKASI AS-REG-S 6.10000% 18-16.03.23	2 550 000.00	2 358 750.00	0.05
米ドル合計		434 077 602.80	9.02
中期債券、固定利付債合計		483 320 595.18	10.04
中期債券、変動利付債			
米ドル			
USD DBS GROUP HOLDINGS LTD-REG-S-SUB 4.520%/VAR 18-11.12.28	898 000.00	919 022.18	0.02
USD HUARONG FINANCE 2017 CO-REG-S 4.000%/VAR 17-PRP	6 409 000.00	6 018 403.50	0.13
USD ICBCIL FINANCE CO LTD-REG-S 3M LIBOR+110BP 18-15.05.23	231 000.00	229 178.91	0.00
USD LEADER GOAL INTERNATIONAL LTD-REG-S 4.250%/VAR 18-PRP	500 000.00	481 250.00	0.01
USD OLAM INTERNATIONAL LTD-REG-S-SUB 5.350%/VAR 16-PRP	1 655 000.00	1 572 250.00	0.03
USD PARKWAY PANTAI LTD-REG-S 4.250%/VAR 17-PRP	5 781 000.00	5 451 107.24	0.11
USD QNB FINANCE LTD-REG-S 3M LIBOR+135BP 18-31.05.21	2 420 000.00	2 435 125.00	0.05
USD WING LUNG BANK LTD-REG-S-SUB 3.750%/H15T5Y+175BP 17-22.11.27	2 467 000.00	2 370 941.06	0.05
米ドル合計		19 477 277.89	0.40
中期債券、変動利付債合計		19 477 277.89	0.40

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
債券、固定利付債			
ユーロ			
EUR ALBANIA, REPUBLIC OF-REG-S 3.50000% 18-09.10.25	4 266 000.00	4 922 409.34	0.10
EUR ARGENTINA, REPUBLIC OF-REG-S 5.00000% 16-15.01.27	200 000.00	183 018.27	0.01
EUR ARGENTINA, REPUBLIC OF 3.37500% 17-15.01.23	2 570 000.00	2 502 918.34	0.05
EUR ARGENTINA, REPUBLIC OF 5.25000% 17-15.01.28	4 730 000.00	4 267 323.52	0.09
EUR ARGENTINA, REPUBLIC OF 6.25000% 17-09.11.47	410 000.00	357 545.42	0.01
EUR CEMEX FINANCE LLC-REG-S 4.62500% 16-15.06.24	138 000.00	164 682.02	0.00
EUR CENTRAL BANK OF TUNISIA-REG-S 5.62500% 17-17.02.24	3 730 000.00	3 980 389.30	0.08
EUR CROATIA, REPUBLIC OF-REG-S 3.00000% 17-20.03.27	2 000 000.00	2 469 886.12	0.05
EUR CROATIA, REPUBLIC OF-REG-S 2.75000% 17-27.01.30	4 717 000.00	5 574 897.30	0.12
EUR GAZ CAPITAL SA/GAZPROM-REG-S LPN 2.94900% 18-24.01.24	1 294 000.00	1 497 272.63	0.03
EUR IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 5.12500% 17-15.06.25	4 500 000.00	5 098 980.94	0.11
EUR IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 6.62500% 18-22.03.48	4 841 000.00	4 971 550.87	0.10
EUR MACEDONIA GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 3.97500% 14-24.07.21	1 129 000.00	1 366 721.96	0.03
EUR NE PROPERTY COOPERATIEF UA-REG-S 3.75000% 15-26.02.21	3 090 000.00	3 536 756.45	0.07
EUR PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 2.87500% 18-25.10.25	807 000.00	957 244.39	0.02
EUR REPUBLIC OF TURKEY 5.20000% 18-16.02.26	6 039 000.00	7 120 010.44	0.15
EUR SENEGAL, REPUBLIC OF-REG-S 4.75000% 18-13.03.28	2 590 000.00	2 841 875.07	0.06
EUR TURKEY, REPUBLIC OF 4.62500% 19-31.03.25	1 715 000.00	1 975 256.29	0.04
ユーロ合計		53 788 738.67	1.12
米ドル			
USD 21VIANET GROUP INC-REG-S 7.00000% 17-17.08.20	5 120 000.00	5 068 800.00	0.11
USD ABJA INVESTMENT CO PTE LTD-REG-S 5.95000% 14-31.07.24	2 856 000.00	2 877 377.16	0.06
USD ABU DHABI CRUDE OIL PIPELINE LLC-REG-S 4.60000% 17-02.11.47	11 312 000.00	11 453 400.00	0.24
USD ACWA POWER MGMT & INVEST ONE LTD-REG-S 5.95000% 17-15.12.39	2 260 000.00	2 203 500.00	0.05
USD ADCB FINANCE CAYMAN LTD-REG-S 4.00000% 18-29.03.23	3 748 000.00	3 752 685.00	0.08
USD AHB SUKUK CO LTD-REG-S 4.37500% 18-19.09.23	2 350 000.00	2 385 250.00	0.05
USD AKBANK TAS-REG-S 5.12500% 15-31.03.25	1 702 000.00	1 514 780.00	0.03
USD AKCB FINANCE LTD-REG-S 4.75000% 18-09.10.23	3 810 000.00	3 876 675.00	0.08
USD ALTICE FINANCING SA-144A 7.50000% 16-15.05.26	1 570 000.00	1 487 575.00	0.03
USD ALTICE FINANCING SA-REG-S 7.50000% 16-15.05.26	12 512 000.00	11 670 317.76	0.24
USD ANGOLAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 9.50000% 15-12.11.25	5 150 000.00	5 729 375.00	0.12
USD ANGOLAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 8.25000% 18-09.05.28	6 515 000.00	6 710 450.00	0.14
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF STEP-UP 05-31.12.38	33 824 808.00	20 041 198.74	0.42
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF (PIK) 8.28000% 05-31.12.33	4 392 431.00	5 419 352.55	0.11
USD ARMENIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.00000% 13-30.09.20	1 660 000.00	1 689 050.00	0.03
USD BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.00000% 14-19.09.44	8 527 000.00	7 419 717.89	0.15
USD BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 7.00000% 16-12.10.28	1 927 000.00	1 994 445.00	0.04
USD BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 7.50000% 17-20.09.47	1 544 000.00	1 536 280.00	0.03
USD BELARUS INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.20000% 18-28.02.30	1 409 000.00	1 331 505.00	0.03
USD BELIZE, GOVERNMENT OF-REG-S STEP-DOWN 13-20.02.34	1 790 000.00	1 011 350.00	0.02
USD BHARTI AIRTEL INTL NETHERLANDS BV-REG-S 5.35000% 14-20.05.24	1 500 000.00	1 509 031.35	0.03
USD BIZ FINANCE PLC FOR UKREXIMBANK-REG-S 9.62500% 15-27.04.22	3 981 000.00	3 976 023.75	0.08
USD BLUESTAR FINANCE HOLDINGS LTD-REG-S 3.50000% 16-30.09.21	1 583 000.00	1 555 701.17	0.03
USD BRASKEM FINANCE LTD 6.45000% 14-03.02.24	2 533 000.00	2 741 972.50	0.06
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 8.25000% 04-20.01.34	460 000.00	586 730.00	0.01
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 7.12500% 06-20.01.37	690 000.00	810 750.00	0.02
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 5.00000% 14-27.01.45	6 034 000.00	5 569 382.00	0.12
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 6.00000% 16-07.04.26	698 000.00	763 263.00	0.02
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 5.62500% 16-21.02.47	4 473 000.00	4 450 635.00	0.09
USD CEMENTOS PROGRESO TRUST-REG-S 7.12500% 13-06.11.23	2 500 000.00	2 571 875.00	0.05
USD CENTRAL BANK OF TUNISIA-REG-S 5.75000% 15-30.01.25	5 297 000.00	4 608 390.00	0.10
USD CHILE, REPUBLIC OF 3.12500% 16-21.01.26	1 822 000.00	1 794 670.00	0.04
USD CHINA AOYUAN PROPERTY GROUP LTD-REG-S 8.50000% 19-23.01.22	1 710 000.00	1 735 650.00	0.04
USD CHINA EVERGRANDE GROUP-REG-S 8.25000% 17-23.03.22	2 336 000.00	2 214 306.08	0.05

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD CHINA EVERGRANDE GROUP-REG-S 7.5000% 17-28.06.23	5 763 000.00	5 184 308.36	0.11
USD CHINA EVERGRANDE GROUP-REG-S 8.7500% 17-28.06.25	6 620 000.00	5 858 700.00	0.12
USD CHINA EVERGRANDE GROUP-REG-S 7.0000% 19-23.03.20	2 527 000.00	2 501 464.67	0.05
USD CHINA EVERGRANDE GROUP-REG-S 6.2500% 19-28.06.21	2 527 000.00	2 365 916.38	0.05
USD CHINA EVERGRANDE GROUP-REG-S 8.2500% 19-23.03.22	1 600 000.00	1 516 648.00	0.03
USD CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN-REG-S 5.9500% 14-08.05.24	200 000.00	217 253.00	0.00
USD CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN-REG-S 6.4500% 14-11.06.34	550 000.00	651 719.75	0.01
USD CHINA REINSURANCE FINANCE CORP-REG-S 3.3750% 17-09.03.22	2 301 000.00	2 223 951.02	0.05
USD CHINA SCE PROPERTY HOLDINGS LTD-REG-S 5.8750% 17-10.03.22	1 120 000.00	1 044 385.21	0.02
USD CHINA SCE PROPERTY HOLDINGS LTD-REG-S 7.4500% 18-17.04.21	2 066 000.00	2 055 670.00	0.04
USD CHINA SCE PROPERTY HOLDINGS LTD-REG-S 8.7500% 19-15.01.21	3 661 000.00	3 734 220.00	0.08
USD CHINALCO CAPITAL HOLDINGS LTD-REG-S 4.0000% 16-25.08.21	2 429 000.00	2 362 202.50	0.05
USD CHINALCO CAPITAL HOLDINGS LTD-REG-S 4.2500% 17-21.04.22	3 162 000.00	3 039 472.50	0.06
USD CHOUZHOU INTERNATIONAL INVESTMENT-REG-S 4.0000% 17-05.12.20	2 943 000.00	2 847 352.50	0.06
USD CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 4.1250% 17-19.07.27	3 980 000.00	3 902 728.30	0.08
USD CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 4.6250% 18-14.03.23	5 674 000.00	5 792 331.27	0.12
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 10.3750% 03-28.01.33	660 000.00	1 001 210.10	0.02
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 8.1250% 04-21.05.24	2 000 000.00	2 385 000.00	0.05
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 7.3750% 06-18.09.37	763 000.00	966 148.75	0.02
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 6.1250% 09-18.01.41	1 306 000.00	1 488 840.00	0.03
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 4.3750% 11-12.07.21	2 840 000.00	2 907 450.00	0.06
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 4.0000% 13-26.02.24	19 610 000.00	19 845 320.00	0.41
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 5.6250% 14-26.02.44	2 426 000.00	2 644 340.00	0.05
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 5.0000% 15-15.06.45	23 978 000.00	24 241 758.00	0.50
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 2.6250% 13-15.03.23	11 820 000.00	11 376 750.00	0.24
USD COMCEL TRUST VIA COMUNICACIONES-REG-S 6.8750% 14-06.02.24	14 400 000.00	14 880 183.84	0.31
USD COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD-REG-S 5.7500% 12-14.02.42	900 000.00	860 625.00	0.02
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 5.6250% 13-18.10.43	967 000.00	1 099 962.50	0.02
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 4.8750% 14-04.11.44	1 458 000.00	1 501 965.99	0.03
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 5.6250% 16-15.12.26	960 000.00	933 614.40	0.02
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 4.7500% 18-17.01.23	1 460 000.00	1 350 500.00	0.03
USD CREDIT BK MOSCOW/CBOM FIN-REG-S LPN 5.5500% 18-14.02.23	1 533 000.00	1 467 847.50	0.03
USD CROATIA, REPUBLIC OF-REG-S 6.0000% 13-26.01.24	12 134 000.00	13 362 567.50	0.28
USD CSN RESOURCES SA-REG-S 6.5000% 10-21.07.20	1 854 000.00	1 823 872.50	0.04
USD DEVELOPMENT BANK OF MONGOLIA LLC-REG-S 7.2500% 18-23.10.23	2 118 000.00	2 126 524.95	0.04
USD DIB SUKUK LTD-REG-S 3.6250% 18-06.02.23	460 000.00	449 650.00	0.01
USD DNO ASA-144A-REG-S 8.7500% 18-31.05.23	6 000 000.00	6 090 000.00	0.13
USD DOLPHIN ENERGY LTD-REG-S 5.8880% 09-15.06.19	3 730 000.00	326 882.28	0.01
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 7.5000% 10-06.05.21	22 556 000.00	23 401 850.00	0.49
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 5.8750% 13-18.04.24	5 909 000.00	6 101 042.50	0.13
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.6000% 13-28.01.24	790 000.00	839 770.00	0.02
USD DP WORLD CRESCENT LTD-REG-S 3.9080% 16-31.05.23	285 000.00	284 287.50	0.01
USD EA PARTNERS I BV-REG-S 6.8750% 15-28.09.20	4 113 000.00	2 308 421.25	0.05
USD EA PARTNERS II BV-REG-S 6.7500% 16-01.06.21	1 710 000.00	820 800.00	0.02
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S 7.9500% 14-20.06.24	27 221 000.00	25 723 845.00	0.53
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S 10.5000% 15-24.03.20	10 611 000.00	11 035 440.00	0.23
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S 10.7500% 16-28.03.22	12 194 000.00	12 864 670.00	0.27
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S 8.7500% 17-02.06.23	3 088 000.00	3 046 312.00	0.06
USD EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 7.6500% 05-15.06.35	3 841 000.00	3 833 414.03	0.08
USD EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 7.3750% 09-01.12.19	5 320 000.00	5 386 101.00	0.11
USD ELDORADO INTL.FINANCE GMBH-REG-S 8.6250% 16-16.06.21	6 475 000.00	6 745 396.00	0.14
USD EMG SUKUK LTD-REG-S 4.5640% 14-18.06.24	678 000.00	677 152.50	0.01
USD EMIRATES NBD PJSC-REG-S 3.2500% 17-14.11.22	500 000.00	487 500.00	0.01
USD EMIRATES REIT SUKUK LTD-REG-S 5.1250% 17-12.12.22	3 132 000.00	2 842 290.00	0.06
USD ESKOM HOLDINGS SOC LTD-REG-S 5.7500% 11-26.01.21	6 070 000.00	5 956 187.50	0.12
USD ETHIOPIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.6250% 14-11.12.24	8 481 000.00	8 544 607.50	0.18
USD EXPORT CREDIT BANK OF TURKEY-REG-S 8.2500% 19-24.01.24	2 365 000.00	2 447 775.00	0.05
USD EXPORT-IMPORT BANK OF INDIA-REG-S 3.3750% 16-05.08.26	380 000.00	354 302.50	0.01

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD EZDAN SUKUK CO LTD-REG-S 4.37500% 16-18.05.21	2 627 000.00	2 186 977.50	0.05
USD FAB SUKUK CO LTD-REG-S 3.87500% 19-22.01.24	640 000.00	641 600.00	0.01
USD FANTASIA HOLDINGS GROUP CO LTD-REG-S 8.37500% 18-08.03.21	3 900 000.00	3 334 500.00	0.07
USD FIDELITY BANK PLC-REG-S 10.50000% 17-16.10.22	3 318 000.00	3 359 475.00	0.07
USD FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 3.00000% 12-13.08.19	270 000.00	269 325.00	0.01
USD FITA INTERNATIONAL LTD 7.00000% 10-10.02.20	1 162 000.00	1 199 648.80	0.02
USD FORMOSA GROUP CAYMAN LTD-REG-S 3.37500% 15-22.04.25	1 603 000.00	1 570 386.97	0.03
USD FUFENG GROUP LTD-REG-S 5.87500% 18-28.08.21	600 000.00	606 434.46	0.01
USD GABON, REPUBLIC OF-REG-S 6.37500% 13-12.12.24	14 523 186.00	13 815 180.68	0.29
USD GABON, REPUBLIC OF-REG-S 6.95000% 15-16.06.25	3 200 000.00	3 056 000.00	0.06
USD GCL NEW ENERGY HOLDINGS LTD-REG-S 7.10000% 18-30.01.21	3 928 000.00	3 531 920.12	0.07
USD GEORGIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.87500% 11-12.04.21	700 000.00	739 375.00	0.02
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 8.12500% 14-18.01.26	1 340 000.00	1 361 775.00	0.03
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 10.75000% 15-14.10.30	7 141 000.00	8 390 675.00	0.17
USD GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD-REG-S 3.87500% 15-04.06.25	2 942 000.00	2 695 386.85	0.06
USD GOHL CAPITAL LTD-REG-S 4.25000% 17-24.01.27	10 990 000.00	10 490 009.95	0.22
USD GOME ELECTRICAL APPL HOLDING LTD-REG-S 5.00000% 17-10.03.20	2 425 000.00	2 297 687.50	0.05
USD GREENKO INVESTMENT CO-REG-S 4.87500% 16-16.08.23	3 646 000.00	3 382 084.29	0.07
USD GTL TRADE FIN/ GERDAU HOLDINGS-REG-S 5.89300% 14-29.04.24	632 000.00	664 990.40	0.01
USD GTLK EUROPE LTD-REG-S 5.95000% 16-19.07.21	1 270 000.00	1 273 175.00	0.03
USD GUANGXI COMMUNICATIONS INVESTMENT-REG-S 3.00000% 16-04.11.19	718 000.00	703 855.40	0.01
USD HAITIAN BVI INTL INVT DEV-REG-S 3.87500% 17-12.12.20	2 539 000.00	2 465 315.25	0.05
USD HALYK SAVINGS BANK OF KAZAKHSTAN-REG-S 5.50000% 12-21.12.22	3 711 977.00	3 674 857.23	0.08
USD HESTEEL HONG KONG CO LTD-REG-S 4.25000% 17-07.04.20	3 500 000.00	3 450 317.50	0.07
USD HK RED STAR MAC UNIV HOME FURN-REG-S 3.37500% 17-21.09.22	2 189 000.00	1 833 287.50	0.04
USD HONGKONG INTERNATIONAL QINGDAO-REG-S 4.25000% 17-04.12.22	2 224 000.00	2 026 742.32	0.04
USD HPHT FINANCE 17 LTD-REG-S 2.75000% 17-11.09.22	635 000.00	611 821.66	0.01
USD HTA GROUP LTD/MAURITIUS-REG-S 9.12500% 17-08.03.22	5 160 000.00	5 256 750.00	0.11
USD HUBI SCI TECH INV GRP HNG KNG LTD-REG-S 4.37500% 18-05.03.21	1 468 000.00	1 403 775.00	0.03
USD ICD SUKUK CO LTD-REG-S 3.50800% 14-21.05.20	2 700 000.00	2 680 927.20	0.06
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 8.50000% 05-12.10.35	553 000.00	776 713.39	0.02
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 11.625000% 09-04.03.19	1 080 000.00	1 087 359.23	0.02
USD IRAQ INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.80000% 06-15.01.28	9 499 000.00	9 000 302.50	0.19
USD IRAQ INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.75000% 17-09.03.23	2 928 000.00	2 917 020.00	0.06
USD ITAU CORPBANCA-REG-S 3.87500% 14-22.09.19	20 068 000.00	20 068 000.00	0.42
USD IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 6.37500% 15-03.03.28	5 753 000.00	5 501 306.25	0.11
USD IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 6.12500% 17-15.06.33	6 428 000.00	5 736 990.00	0.12
USD JAMAICA, GOVERNMENT OF 9.25000% 05-17.10.25	496 000.00	613 800.00	0.01
USD JAMAICA, GOVERNMENT OF 8.00000% 07-15.03.39	4 730 000.00	5 605 050.00	0.12
USD JORDAN, KINGDOM OF-REG-S 7.37500% 17-10.10.47	5 988 000.00	5 658 660.00	0.12
USD JSW STEEL LTD-REG-S 5.25000% 17-13.04.22	3 060 000.00	3 039 390.90	0.06
USD KAISA GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 7.25000% 17-30.06.20	1 750 000.00	1 621 313.75	0.03
USD KAISA GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 8.50000% 17-30.06.22	11 614 000.00	9 541 307.48	0.20
USD KAISA GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 9.37500% 17-30.06.24	6 678 000.00	5 147 769.69	0.11
USD KAZAKHSTAN TEMIR ZHOLY FINANCE BV-REG-S 6.95000% 12-10.07.42	3 407 000.00	3 747 700.00	0.08
USD KAZAKHSTAN, REPUBLIC OF-REG-S 4.87500% 14-14.10.44	2 508 000.00	2 602 050.00	0.05
USD KING POWER CAPITAL LTD-REG-S 5.62500% 14-03.11.24	4 120 000.00	4 402 299.93	0.09
USD KOREA HOUSING FINANCE CORP-REG-S 3.00000% 17-31.10.22	3 280 000.00	3 221 780.98	0.07
USD KUWAIT INTERNATIONAL GOVT BOND-REG-S 2.75000% 17-20.03.22	19 535 000.00	19 290 812.50	0.40
USD KUWAIT PROJECTS CO SPC LTD-REG-S 5.00000% 16-15.03.23	1 597 000.00	1 612 970.00	0.03
USD KUWAIT PROJECTS CO SPC LTD-REG-S 4.50000% 17-23.02.27	6 363 000.00	5 925 543.75	0.12
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S 6.00000% 12-27.01.23	2 205 000.00	1 962 450.00	0.04
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S 6.20000% 15-26.02.25	340 000.00	289 000.00	0.01
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S 7.05000% 15-02.11.35	966 000.00	792 120.00	0.02
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S 6.65000% 15-03.11.28	4 566 000.00	3 789 780.00	0.08
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S 6.65000% 16-22.04.24	2 422 000.00	2 131 360.00	0.04
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S 6.85000% 17-23.03.27	2 939 000.00	2 468 760.00	0.05
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S 7.25000% 17-23.03.37	3 495 000.00	2 848 425.00	0.06

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD LITHUANIA, REPUBLIC OF-REG-S 7.37500% 10-11.02.20	12 221 000.00	12 734 648.63	0.26
USD LONGFOR PROPERTIES CO LTD-REG-S 3.90000% 18-16.04.23	860 000.00	833 162.84	0.02
USD LONGFOR PROPERTIES CO LTD-REG-S 4.50000% 18-16.01.28	1 700 000.00	1 565 062.33	0.03
USD LS FINANCE 2022 LTD-REG-S 4.25000% 12-16.10.22	1 560 000.00	1 521 327.60	0.03
USD MAF GLOBAL SECURITIES LTD-REG-S 4.75000% 14-07.05.24	6 970 000.00	7 022 275.00	0.15
USD MARBLE II PTE LTD-REG-S 5.30000% 17-20.06.22	686 000.00	681 345.49	0.01
USD METINVEST BV-REG-S 7.75000% 18-23.04.23	9 528 000.00	9 075 420.00	0.19
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-REG-S 5.50000% 16-31.10.46	261 000.00	231 311.25	0.00
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-REG-S 5.50000% 17-31.07.47	8 673 000.00	7 683 410.70	0.16
USD MINEJESA CAPITAL BV-REG-S 4.62500% 17-10.08.30	5 580 000.00	5 335 875.00	0.11
USD MINEJESA CAPITAL BV-REG-S 5.62500% 17-10.08.37	13 495 000.00	12 663 738.63	0.26
USD MINMETALS BOUNTIOUS FIN BVI LTD-REG-S 4.20000% 16-27.07.26	2 000 000.00	1 965 710.00	0.04
USD MOROCCO, KINGDOM OF THE-REG-S 5.50000% 12-11.12.42	533 000.00	556 985.00	0.01
USD MOROCCO, KINGDOM OF-REG-S 4.25000% 12-11.12.22	1 145 000.00	1 155 018.75	0.02
USD MYRIAD INTERNATIONAL HOLDINGS BV-REG-S 5.50000% 15-21.07.25	1 245 000.00	1 293 243.75	0.03
USD NAKILAT INC-REG-S 6.06700% 06-31.12.33	2 305 000.00	2 593 125.00	0.05
USD NIGERIA, REPUBLIC OF-REG-S 6.37500% 13-12.07.23	594 000.00	603 652.50	0.01
USD NWD FINANCE BVI LTD-REG-S 5.75000% 16-PRP	1 540 000.00	1 395 418.48	0.03
USD OI SA (PIK) 10.00000% 18-27.07.25	3 842 000.00	3 892 426.25	0.08
USD OIL INDIA INTERNATIONAL PTE LTD-REG-S 4.00000% 17-21.04.27	800 000.00	754 412.00	0.02
USD OIL INDIA LTD-REG-S 5.12500% 19-04.02.29	1 978 000.00	1 975 717.98	0.04
USD OILFLOW SPV 1 DAC-REG-S 12.00000% 17-13.01.22	3 860 000.00	3 850 999.45	0.08
USD OSCHADBANK VIA SSB #1 PLC-REG-S LPN STEP UP/DOWN 15-10.03.23	5 607 000.00	5 607 000.00	0.12
USD OZTEL HOLDINGS SPC-REG-S 6.62500% 18-24.04.28	6 511 000.00	6 120 340.00	0.13
USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 7.25000% 14-15.04.19	10 364 000.00	10 363 999.99	0.21
USD PANAMA, REPUBLIC OF 8.87500% 97-30.09.27	520 000.00	705 900.00	0.01
USD PANAMA, REPUBLIC OF 7.12500% 05-29.01.26	200 000.00	241 000.00	0.00
USD PANAMA, REPUBLIC OF 6.70000% 06-26.01.36	5 879 000.00	7 439 874.50	0.15
USD PANAMA, REPUBLIC OF 4.30000% 13-29.04.53	5 280 000.00	5 174 400.00	0.11
USD PANAMA, REPUBLIC OF 4.00000% 14-22.09.24	630 000.00	647 325.00	0.01
USD PANAMA, REPUBLIC OF 3.75000% 15-16.03.25	8 510 000.00	8 637 650.00	0.18
USD PANAMA, REPUBLIC OF 4.50000% 18-16.04.50	5 915 000.00	5 944 575.00	0.12
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 4.62500% 13-25.01.23	11 970 000.00	12 194 437.50	0.25
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 5.00000% 16-15.04.26	6 962 000.00	7 205 670.00	0.15
USD PCPD CAPITAL LTD-REG-S 4.75000% 17-09.03.22	2 050 000.00	1 992 500.19	0.04
USD PERU, REPUBLIC OF 7.35000% 05-21.07.25	6 877 000.00	8 493 095.00	0.18
USD PERU, REPUBLIC OF 8.75000% 03-21.11.33	3 812 000.00	5 759 932.00	0.12
USD PERUSAHAAN GAS NEGARA PT-REG-S 5.12500% 14-16.05.24	1 702 000.00	1 749 239.01	0.04
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 3.40000% 17-29.03.22	560 000.00	555 954.00	0.01
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 4.15000% 17-29.03.27	9 636 000.00	9 551 347.74	0.20
USD PETROAMAZONAS EP-REG-S 4.62500% 17-16.02.20	2 100 000.00	2 047 804.50	0.04
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 8.75000% 16-23.05.26	6 238 000.00	7 300 019.50	0.15
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 9.75000% 12-17.05.35	3 003 000.00	915 915.00	0.02
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 6.00000% 14-16.05.24	33 023 021.00	8 255 755.25	0.17
USD PETROLEOS MEXICANOS 5.50000% 10-21.01.21	7 020 000.00	7 058 610.00	0.15
USD PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 7.87500% 02-22.05.22	2 868 000.00	3 263 999.10	0.07
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 7.75000% 06-14.01.31	1 165 000.00	1 601 438.13	0.03
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 6.37500% 09-23.10.34	889 000.00	1 144 209.68	0.02
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 3.70000% 17-02.02.42	6 300 000.00	6 140 641.50	0.13
USD POLY REAL ESTATE FINANCE-REG-S 4.75000% 18-17.09.23	1 280 000.00	1 282 746.63	0.03
USD POSCO-REG-S 4.00000% 18-01.08.23	544 000.00	549 649.49	0.01
USD PROVEN HONOUR CAPITAL LTD-REG-S 4.12500% 15-19.05.25	1 000 000.00	937 955.00	0.02
USD PROVINCE OF JUJUY ARGENTINA-REG-S 8.62500% 17-20.09.22	3 611 000.00	2 803 887.34	0.06
USD PTTEP CANADA INTERNATIONAL FIN-REG-S 6.35000% 12-12.06.42	1 020 000.00	1 214 621.10	0.03
USD QIB SUKUK LTD-REG-S 3.25100% 17-23.05.22	1 150 000.00	1 116 937.50	0.02
USD RAS LAFFAN LIQUIFIED NATURAL GAS-REG-S 5.29800% 05-30.09.20	13 990 000.00	3 132 486.91	0.06
USD ROMANIA-REG-S 4.37500% 13-22.08.23	1 336 000.00	1 356 040.00	0.03
USD RUSSIA, FEDERATION OF-REG-S 4.75000% 16-27.05.26	4 000 000.00	4 070 000.00	0.08

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)	
USD	RUSSIA, FEDERATION OF-REG-S STEP-UP 00-31.03.30	70.00	32.17	0.00
USD	RUSSIA, FEDERATION OF-REG-S 4.87500% 13-16.09.23	22 000 000.00	22 770 000.00	0.47
USD	RUSSIA, FEDERATION OF-REG-S 5.87500% 13-16.09.43	17 600 000.00	19 404 000.00	0.40
USD	RZD CAP PLC/RUSSIAN RAILWAYS LPN-REG-S 5.70000% 12-05.04.22	634 000.00	651 435.00	0.01
USD	SABIC CAPITAL II BV-REG-S 4.00000% 18-10.10.23	5 521 000.00	5 576 210.00	0.12
USD	SABIC CAPITAL II BV-REG-S 4.50000% 18-10.10.28	2 333 000.00	2 373 827.50	0.05
USD	SAMARCO MINERACAO SA-REG-S 4.12500% 12-01.11.22	13 388 000.00	8 099 740.00	0.17
USD	SANDS CHINA LTD 5.12500% 19-08.08.25	5 180 000.00	5 206 990.39	0.11
USD	SANDS CHINA LTD-REG-S 5.12500% 18-08.08.25	2 650 000.00	2 677 825.00	0.06
USD	SAUDI ELECTRICITY GLOBAL SUKIK CO REG-S 5.50000% 14-08.04.44	1 751 000.00	1 799 152.50	0.04
USD	SAUDI ELECTRICITY GLOBAL SUKUK CO-REG-S 4.22200% 18-27.01.24	3 182 000.00	3 197 910.00	0.07
USD	SAUDI ELECTRICITY GLOBAL SUKUK CO-REG-S 4.72300% 18-27.09.28	1 256 000.00	1 260 710.00	0.03
USD	SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 5.25000% 19-16.01.50	15 834 000.00	16 269 435.00	0.34
USD	SCENERY JOURNEY LTD-REG-S 13.00000% 18-06.11.22	1 980 000.00	2 098 800.00	0.04
USD	SENEGAL, REPUBLIC OF-REG-S 6.25000% 17-23.05.33	1 404 000.00	1 305 720.00	0.03
USD	SERBIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 4.87500% 13-25.02.20	4 400 000.00	4 455 000.00	0.09
USD	SFC CAPITAL LTD-REG-S 5.37500% 16-16.06.23	3 803 000.00	3 736 447.50	0.08
USD	SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.50000% 10-09.03.20	9 566 000.00	9 745 362.50	0.20
USD	SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.87500% 13-16.09.25	8 003 000.00	8 393 146.25	0.17
USD	SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 4.30000% 16-12.10.28	16 106 000.00	15 018 845.00	0.31
USD	SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.00000% 16-12.10.46	3 339 000.00	2 996 752.50	0.06
USD	SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.87500% 18-22.06.30	6 449 000.00	6 626 347.50	0.14
USD	SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 6.30000% 18-22.06.48	1 623 000.00	1 651 402.50	0.03
USD	SOUTHERN GAS CORRIDOR CJSC-REG-S 6.87500% 16-24.03.26	17 218 000.00	18 896 755.00	0.39
USD	SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 6.85000% 15-03.11.25	8 055 000.00	7 924 106.25	0.16
USD	SSMS PLANTATION HOLDINGS PTE LTD-REG-S 7.75000% 18-23.01.23	3 242 000.00	2 929 276.81	0.06
USD	STATE OIL OF THE AZERBAIJAN REP-REG-S 6.95000% 15-18.03.30	12 457 000.00	13 702 700.00	0.28
USD	SUHYUP BANK-REG-S 3.62500% 19-29.01.24	1 848 000.00	1 856 243.19	0.04
USD	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 6.87500% 17-08.08.20	4 254 000.00	4 239 642.74	0.09
USD	SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP-REG-S 3.75000% 18-23.01.23	2 049 000.00	1 972 296.91	0.04
USD	TABREED SUKUK SPC LTD-REG-S 5.50000% 18-31.10.25	2 052 000.00	2 136 645.00	0.04
USD	TEWOO GROUP FINANCE NO 3 LTD-REG-S 4.62500% 17-06.04.20	2 814 000.00	2 645 160.00	0.05
USD	THETA CAPITAL PTE LTD-REG-S 7.00000% 14-11.04.22	1 146 000.00	861 350.79	0.02
USD	THIRD PAKISTAN INTERNATIONAL SUK-REG-S 5.50000% 16-13.10.21	396 000.00	390 933.18	0.01
USD	THREE GORGES FIN I CAYMAN ISLANDS-REG-S 3.15000% 16-02.06.26	2 000 000.00	1 901 970.00	0.04
USD	TIANQI FINCO CO LTD-REG-S 3.75000% 17-28.11.22	2 053 000.00	1 816 905.00	0.04
USD	TIMES CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 6.25000% 18-17.01.21	2 494 000.00	2 437 885.00	0.05
USD	TNB GLOBAL VENTURES CAPITAL-REG-S 4.85100% 18-01.11.28	3 137 000.00	3 222 535.64	0.07
USD	TRADE & DEVELOPMENT BANK MONGOLIA-REG-S 9.37500% 15-19.05.20	4 008 000.00	4 173 069.48	0.09
USD	TSINGHUA UNIC LTD-REG-S 5.37500% 18-31.01.23	1 781 000.00	1 655 719.31	0.03
USD	TURKEY, REPUBLIC OF 7.00000% 08-11.03.19	3 300 000.00	3 308 250.00	0.07
USD	TURKEY, REPUBLIC OF 5.62500% 10-30.03.21	280 000.00	283 500.00	0.01
USD	TURKEY, REPUBLIC OF 5.75000% 14-22.03.24	1 820 000.00	1 792 700.00	0.04
USD	TURKEY, REPUBLIC OF 6.12500% 18-24.10.28	9 262 000.00	8 891 520.00	0.18
USD	TURKEY, REPUBLIC OF-REG-S 5.00400% 17-06.04.23	10 520 000.00	10 125 500.00	0.21
USD	TURKIYE BANKASI AS-REG-S 5.00000% 14-30.04.20	2 393 000.00	2 354 113.75	0.05
USD	TURKIYE GARANTI BANKASI AS-REG-S 6.25000% 11-20.04.21	2 336 000.00	2 350 600.00	0.05
USD	TURKIYE IS BANKASI AS-REG-S-SUB 6.00000% 12-24.10.22	2 089 000.00	1 859 210.00	0.04
USD	UNIFIN FINANCIERA SA DE CV-REG-S 7.25000% 16-27.09.23	686 000.00	661 990.00	0.01
USD	UNITED BANK FOR AFRICA PLC-REG-S 7.75000% 17-08.06.22	7 241 000.00	7 313 410.00	0.15
USD	URUGUAY, REPUBLIC OF 7.62500% 06-21.03.36	811 715.00	1 090 944.96	0.02
USD	URUGUAY, REPUBLIC OF 5.10000% 14-18.06.50	4 131 500.00	4 234 787.50	0.09
USD	URUGUAY, REPUBLIC OF 4.97500% 18-20.04.55	12 300 921.00	12 380 876.99	0.26
USD	URUGUAY, REPUBLIC OF 4.37500% 19-23.01.31	588 000.00	599 760.00	0.01
USD	VALE OVERSEAS LTD 6.87500% 09-10.11.39	3 860 000.00	4 255 264.00	0.09
USD	VENEZUELA, REPUBLIC OF *DEFAULTED* 9.25000% 97-15.09.27	1 002 000.00	329 407.50	0.01
USD	VENEZUELA, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 12.75000% 10-23.08.22	2 305 600.00	763 188.18	0.02
USD	VENEZUELA, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 11.95000% 11-05.08.31	6 682 000.00	2 246 822.50	0.05

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD VENEZULA, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 11.75000% 11-21.10.26	6 498 600.00	2 160 784.50	0.04
USD VENEZULA, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.00000% 05-09.12.20	1 200 000.00	369 600.00	0.01
USD VENEZULA, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 9.00000% 08-07.05.23	378 000.00	120 960.00	0.00
USD VENEZULA, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 9.25000% 08-07.05.28	3 977 000.00	1 232 870.00	0.03
USD VIETNAM, SOCIALIST REPUBLIC-REG-S 4.80000% 14-19.11.24	1 300 000.00	1 357 928.00	0.03
USD WAKALA GLOBAL SUKUK BHD-REG-S 4.64600% 11-06.07.21	541 000.00	559 910.66	0.01
USD WOORI BANK-REG-S-SUB 4.75000% 14-30.04.24	3 272 000.00	3 330 127.08	0.07
USD XINGSHENG BVI CO LTD-REG-S 4.50000% 18-20.09.21	928 000.00	926 366.07	0.02
USD YAPI VE KREDI BANKASI AS-REG-S 5.12500% 14-22.10.19	900 000.00	897 750.00	0.02
USD YAPI VE KREDI BANKASI AS-REG-S 5.75000% 17-24.02.22	1 857 000.00	1 771 113.75	0.04
USD ZAMBIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.37500% 12-20.09.22	9 143 000.00	7 131 539.99	0.15
米ドル合計		1 171 306 581.16	24.32

債券、固定利付債合計		1 225 095 319.83	25.44
------------	--	------------------	-------

債券、変動利付債

米ドル

USD ABSA GROUP LIMITED-REG-S-SUB 6.250%/VAR 18-25.04.28	6 508 000.00	6 459 190.00	0.13
USD ADIB CAPITAL INVEST 2 LTD-REG-S-SUB 7.125%/VAR 18-PRP	2 479 000.00	2 609 147.50	0.05
USD AKBANK TAS-REG-S-SUB 7.200%/VAR 17-16.03.27	760 000.00	689 700.00	0.01
USD AL AHLI BANK OF KUWAIT KSCP 7.250%/VAR 18-PRP	2 440 000.00	2 470 500.00	0.05
USD BANCO DO BRASIL CAYMAN-REG-S-SUB 9.250%/VAR 12-PRP	336 000.00	361 095.84	0.01
USD BANK OF EAST ASIA LTD/THE-REG-S-SUB 5.625%/VAR 17-PRP	720 000.00	701 758.80	0.01
USD BAOXIN AUTO FINANCE I LTD-REG-S 8.750%/VAR 16-PRP	1 770 000.00	1 767 787.50	0.04
USD BLUESTAR FINANCE HOLDINGS LTD-REG-S 6.250%/VAR 18-PRP	620 000.00	640 150.00	0.01
USD CCB LIFE INSURANCE CO LTD-REG-S-SUB 4.500%/VAR 17-21.04.77	4 352 000.00	3 923 502.08	0.08
USD CCCI TREASURE LTD-REG-S 3.500%/VAR 15-PRP	1 410 000.00	1 397 662.50	0.03
USD CELESTIAL MILES LTD-REG-S 5.750%/VAR 19-PRP	1 237 000.00	1 241 997.48	0.03
USD CHALCO HONG KONG INVESTMENT CO-REG-S 4.250%/VAR 16-PRP	1 185 000.00	1 158 983.33	0.02
USD CHAMPION SINCERITY HOLDINGS LTD-REG-S 8.125%/VAR 19-PRP	281 000.00	288 433.86	0.01
USD CHINA CONSTRUCTION BANK-REG-S-SUB 3.875%/VAR 15-13.05.25	9 780 000.00	9 737 016.90	0.20
USD CHINA LIFE INSURANCE CO LTD-REG-S-SUB 4.000%/VAR 15-03.07.75	5 140 000.00	4 972 950.00	0.10
USD CHINA MINMETALS CORP-REG-S 3.750%/VAR 17-PRP	9 116 000.00	8 565 256.86	0.18
USD CHINA MINMETALS CORP-REG-S 4.450%/VAR 18-PRP	9 716 000.00	9 643 130.00	0.20
USD DIANJIANG INTERNATIONAL FINANCE LTD-REG-S 4.600%/VAR 18-PRP	5 147 000.00	4 969 093.95	0.10
USD DIB TIER 1 SUKUK 3 LTD-REG-S-SUB 6.250%/VAR 19-PRP	1 400 000.00	1 442 000.00	0.03
USD EMIRATES NBD TIER 1 LTD-REG-S-SUB 5.750%/VAR 13-PRP	5 282 000.00	5 282 000.00	0.11
USD FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S-SUB 5.250%/VAR 15-PRP	1 215 000.00	1 221 074.99	0.03
USD FIRSTRAND BANK LTD-REG-S-SUB 6.250%/VAR 18-23.04.28	1 220 000.00	1 244 400.00	0.03
USD FRANSION BRILLIANT LTD-REG-S-SUB 5.750%/VAR 17-PRP	1 770 000.00	1 588 575.00	0.03
USD HEUNGKUK LIFE INSURANCE CO-REG-S-SUB 4.475%/VAR 17-09.11.47	6 980 000.00	6 229 650.00	0.13
USD HUARONG FINANCE 2017 CO-REG-S 4.500%/VAR 17-PRP	2 640 000.00	2 557 671.60	0.05
USD KYOBO LIFE INSURANCE CO LTD-REG-S-SUB 3.950%/VAR 17-24.07.47	1 032 000.00	986 235.96	0.02
USD MAF GLOBAL SECURITIES LTD-REG-S-SUB 5.500%/VAR 17-PRP	1 764 000.00	1 693 440.00	0.04
USD MAF GLOBAL SECURITIES LTD-REG-S-SUB 6.375%/VAR 18-PRP	8 810 000.00	8 182 287.50	0.17
USD NBK TIER 1 FINANCING LTD-REG-S-SUB 5.750%/VAR 15-PRP	2 710 000.00	2 750 650.00	0.06
USD NOOR TIER 1 SUKUK LTD-REG-S-SUB 6.250%/VAR 16-PRP	2 276 000.00	2 278 845.00	0.05
USD OVERSEAS CHINESE TOWN ASIA HOLDINGS-REG-S 4.300%/VAR 17-PRP	763 000.00	748 693.75	0.02
USD PETRON CORP-REG-S 4.600%/VAR 18-PRP	3 160 000.00	2 962 500.00	0.06
USD QATAR REINSURANCE CO LTD-REG-S-SUB 4.950%/VAR 17-PRP	5 364 000.00	5 176 260.00	0.11
USD SHENZHEN INTERNATIONAL HLDS-REG-S 3.950%/VAR 17-PRP	750 000.00	714 375.00	0.02
USD SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD-REG-S-SUB 5.875%/VAR 18-PRP	6 142 000.00	6 188 065.00	0.13
USD SINO OCEAN LAND TREASURE-REG-S-SUB 4.900%/VAR 17-PRP	4 851 000.00	3 794 816.02	0.08
USD SINO-OCEAN LAND TREASURE-REG-S 3M LIBOR+230BP 18-31.07.21	1 018 000.00	1 018 058.94	0.02
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S VAR 15-31.05.40	23 982 000.00	14 661 995.25	0.30

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD URUGUAY, REPUBLIC OF (PIK) 7.87500% 03-15.01.33	5 992 423.00	8 113 740.74	0.17
USD WISDOM GLORY GROUP LTD-REG-S 5.250%/VAR 17-PRP	2 504 000.00	2 467 028.44	0.05
米ドル合計		142 899 719.79	2.97
債券、変動利付債合計		142 899 719.79	2.97
転換社債、固定利付債			
ユーロ			
EUR AABAR INVESTMENTS PJSC-REG-S 1.00000% 15-27.03.22	2 400 000.00	2 343 193.87	0.05
ユーロ合計		2 343 193.87	0.05
米ドル			
USD DP WORLD-REG-S 1.75000% 14-19.06.24	5 200 000.00	4 962 932.00	0.10
米ドル合計		4 962 932.00	0.10
転換社債、固定利付債合計		7 306 125.87	0.15
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品 合計		4 249 563 293.61	88.25
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD 1MDB ENERGY LTD-REG-S 5.99000% 12-11.05.22	13 300 000.00	13 599 250.00	0.28
USD AGROMERCANTIL SENIOR TRUST-REG-S 6.25000% 14-10.04.19	2 333 000.00	2 332 591.72	0.05
USD ALFA SAB DE CV-REG-S 6.87500% 14-25.03.44	4 322 000.00	4 418 596.70	0.09
USD BANCO DEL CREDITO DEL PERU-REG-S 4.25000% 13-01.04.23	135 000.00	136 333.13	0.00
USD BANCO GENERAL SA-REG-S 4.12500% 17-07.08.27	1 390 000.00	1 310 075.00	0.03
USD BANCO SANTANDER SA-REG-S 4.12500% 12-09.11.22	950 000.00	944 062.50	0.02
USD BANGKOK BANK PUBLIC CO LTD HK-REG-S-SUB 9.02500% 97-15.03.29	315 000.00	415 806.99	0.01
USD BANISTMO SA-REG-S 3.65000% 17-19.09.22	3 099 000.00	3 019 588.12	0.06
USD BRAZIL MINAS SPE-REG-S 5.33300% 13-15.02.28	12 166 000.00	12 166 000.00	0.25
USD C&W SENIOR FIN DESIGNATD ACT V CO-REG-S 6.87500% 17-15.09.27	3 094 000.00	2 947 035.00	0.06
USD C&W SENIOR FIN DESIGNATD ACT V CO-REG-S 7.50000% 18-15.10.26	1 911 000.00	1 897 259.91	0.04
USD CENCOSUD SA-REG-S 5.15000% 15-12.02.25	588 000.00	586 530.00	0.01
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 4.37500% 13-30.04.25	2 220 000.00	1 955 808.90	0.04
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 5.62500% 13-30.04.43	8 124 000.00	6 519 510.00	0.14
USD CROATIA, REPUBLIC OF-REG-S 6.37500% 11-24.03.21	4 300 000.00	4 536 500.00	0.09
USD DIGICEL GROUP ONE LTD-REG-S 8.25000% 19-30.12.22	3 819 000.00	3 150 675.00	0.07
USD DIGICEL GROUP ONE LTD-REG-S 8.25000% 19-30.09.22	2 735 000.00	1 490 575.00	0.03
USD DIGICEL GROUP TWO LTD-REG-S STEP-UP 19-01.04.24	5 610 850.00	2 496 828.25	0.05
USD DIGICEL LTD-144A 6.75000% 15-01.03.23	7 734 000.00	6 300 889.80	0.13
USD DIGICEL LTD-REG-S 6.00000% 13-15.04.21	11 435 000.00	10 577 375.00	0.22
USD DOLPHIN ENERGY LTD-REG-S 5.500000% 12-15.12.21	365 000.00	382 337.50	0.01
USD DTEK FINANCE PLC (PIK) 10.75000% 16-31.12.24	8 522 874.00	8 213 919.82	0.17
USD ECOPETROL SA 5.37500% 15-26.06.26	4 036 000.00	4 182 305.00	0.09
USD ECOPETROL SA 5.87500% 13-18.09.23	3 450 000.00	3 661 312.50	0.08
USD ECOPETROL SA 5.87500% 14-28.05.45	12 321 000.00	12 148 506.00	0.25
USD ECOPETROL SA 7.37500% 13-18.09.43	3 334 000.00	3 867 440.00	0.08
USD ELEMENTIA SAB DE CV-REG-S 5.50000% 14-15.01.25	6 907 000.00	6 518 481.25	0.14
USD EMBRAER NETHERLANDS FINANCE BV 5.05000% 15-15.06.25	7 130 000.00	7 356 805.30	0.15
USD EMBRAER OVERSEAS LTD-REG-S 5.69600% 13-16.09.23	717 000.00	756 435.00	0.02
USD ENERGUATE TRUST-REG-S 5.87500% 17-03.05.27	5 070 000.00	4 729 422.75	0.10
USD FIRST QUANTUM MINERALS LTD-REG-S 7.50000% 17-01.04.25	2 289 000.00	2 077 267.50	0.04

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD GENNEIA SA-REG-S 8.75000% 17-20.01.22	1 171 000.00	1 084 638.75	0.02
USD GRUPO AVAL LTD-REG-S 4.75000% 12-26.09.22	4 082 000.00	4 022 851.82	0.08
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 4.87500% 13-13.02.28	2 550 000.00	2 508 422.25	0.05
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 4.37500% 17-05.06.27	3 107 000.00	2 978 261.45	0.06
USD HIDROVIAS INTERNATIONAL FIN SARL-REG-S 5.95000% 18-24.01.25	2 551 000.00	2 394 751.25	0.05
USD HONDURAS, REPUBLIC OF-REG-S 8.75000% 13-16.12.20	4 223 000.00	4 539 725.00	0.09
USD HUNT OIL CO OF PERU LLC SUCUAL DL-REG-S 6.37500% 18-01.06.28	3 738 000.00	3 941 253.75	0.08
USD INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CN/NY 3.53800% 17-08.11.27	1 522 000.00	1 470 137.85	0.03
USD INVERSIONES CMPC SA-REG-S 4.75000% 14-15.09.24	555 000.00	568 902.75	0.01
USD JSL EUROPE SA-REG-S 7.75000% 17-26.07.24	3 460 000.00	3 416 750.00	0.07
USD KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV-144A 3.80000% 14-08.04.24	140 000.00	136 048.08	0.00
USD KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV-144A 3.25000% 15-12.03.25	307 000.00	287 251.47	0.01
USD LATAM FINANCE LTD-REG-S 6.87500% 17-11.04.24	1 540 000.00	1 553 860.00	0.03
USD LUKOIL INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 4.56300% 13-24.04.23	6 432 000.00	6 423 960.00	0.13
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.00000% 13-02.10.23	23 120 000.00	23 351 200.00	0.48
USD MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-REG-S 6.62500% 18-15.10.26	2 517 000.00	2 573 632.50	0.05
USD NEMAK SAB DE CV-REG-S 4.75000% 18-23.01.25	940 000.00	907 100.00	0.02
USD NEW COTA1 LLC/CAPITAL CORP-144A(PIK)10.62500% 13-01.05.19	71 881.00	39 534.55	0.00
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 6.10000% 14-11.08.44	10 030 000.00	10 920 162.50	0.23
USD PERU, REPUBLIC OF 5.62500% 10-18.11.50	2 419 000.00	2 942 108.75	0.06
USD PETRA DIAMONS US TREASURY PLC-REG-S 7.25000% 17-01.05.22	4 723 000.00	4 439 620.00	0.09
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 6.85000% 15-05.06.115	4 261 000.00	4 135 300.50	0.09
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 6.00000% 13-15.11.26	22 988 469.00	5 701 140.31	0.12
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 6.00000% 14-28.10.22	31 450 000.00	6 232 132.00	0.13
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.00000% 10-05.03.20	384 000.00	388 800.00	0.01
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.37500% 14-23.01.45	6 853 000.00	5 862 741.50	0.12
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.37500% 17-04.02.21	810 000.00	820 530.00	0.02
USD RAIZEN FUELS FINANCE SA-REG-S 5.30000% 17-20.01.27	944 000.00	935 740.00	0.02
USD RAS LAFFAN LIQ NATURAL GAS CO LTD-REG-S 6.33200% 06-30.09.27	4 920 000.00	5 461 200.00	0.11
USD RIO ENERGY SA/UGEN SA/UENSA SA-REG-S 6.87500% 18-01.02.25	3 156 000.00	2 501 130.00	0.05
USD SACI FALABELLA-REG-S 3.75000% 17-30.10.27	2 078 000.00	1 945 008.00	0.04
USD SAMARCO MINERACAO SA-REG-S *DEFAULT* 5.75000% 13-24.10.23	2 950 000.00	1 825 312.50	0.04
USD SAMARCO MINERACAO SA-REG-S 5.37500% 14-26.09.24	1 280 000.00	781 184.00	0.02
USD ST MARYS CEMENT INC CANADA-REG-S 5.75000% 16-28.01.27	1 080 000.00	1 103 128.20	0.02
USD STONEWAY CAPITAL CORPORATION-REG-S 10.00000% 17-01.03.27	4 246 000.00	3 823 011.93	0.08
USD SURINAME, REPUBLIC OF-REG-S 9.25000% 16-26.10.26	4 032 000.00	3 822 799.68	0.08
USD SUZANO AUSTRIA GMBH-REG-S 6.00000% 18-15.01.29	1 649 000.00	1 725 266.25	0.04
USD SUZANO AUSTRIA GMBH-REG-S 5.75000% 16-14.07.26	700 000.00	732 375.00	0.02
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE CO BV 3.65000% 11-10.11.21	1 426 000.00	1 377 365.99	0.03
USD TRANSPORTADORA DE GAS INTER-REG-S 5.55000% 18-01.11.28	9 160 000.00	9 636 777.99	0.20
USD TRANSPORTADORA DE GAS DEL PERU SA-REG-S 4.25000% 13-30.04.28	1 773 000.00	1 753 053.75	0.04
USD TRUST F/1401-REG-S 6.95000% 14-30.01.44	2 936 000.00	2 928 660.00	0.06
USD VM HOLDING SA-REG-S 5.37500% 17-04.05.27	15 374 000.00	15 243 321.00	0.32
USD VTR FINANCE B V-REG-S 6.87500% 14-15.01.24	9 686 000.00	9 927 181.40	0.21
USD YINGDE GASES INVESTMENT LTD-REG-S 6.25000% 18-19.01.23	4 903 000.00	4 728 698.35	0.10
米ドル合計		308 587 554.71	6.41
ノート、固定利付債合計		308 587 554.71	6.41
ノート、変動利付債			
米ドル			
USD BANCOLOMBIA SA-SUB 4.875%/VAR 17-18.10.27	5 763 000.00	5 702 776.65	0.12
USD BBVA BANCOMER SA/TEXAS-REG-S-SUB 5.125%/VAR 18-18.01.33	13 353 000.00	11 984 317.49	0.25
USD EP PETROECU NOBLE SOVRGN FD-REG-S 3M LIBOR+563BP 14-24.09.19	2 640 000.00	417 121.38	0.01
USD ITAU UNIBANCO HOLDING SA-REG-S-SUB 6.500%/VAR 18-PRP	1 385 000.00	1 362 840.00	0.02
米ドル合計		19 467 055.52	0.40
ノート、変動利付債合計		19 467 055.52	0.40

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
中期債券、固定利付債			
米ドル			
USD BANCO INTL PERU-REG-S 3.37500% 18-18.01.23	2 220 000.00	2 153 400.00	0.04
USD ICD SUKUK CO LTD-REG-S 5.00000% 17-01.02.27	3 546 000.00	3 519 405.00	0.07
USD PETROLEOS MEXICANO 4.62500% 17-21.09.23	780 000.00	741 780.00	0.02
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.87500% 17-04.02.26	1 416 000.00	1 405 096.80	0.03
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.75000% 17-21.09.47	13 121 000.00	11 434 951.50	0.24
米ドル合計		19 254 633.30	0.40
中期債券、固定利付債合計		19 254 633.30	0.40
債券、固定利付債			
米ドル			
USD 1MDB GLOBAL INV-REG-S 4.40000% 13-09.03.23	10 000 000.00	9 246 750.00	0.19
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 7.45000% 14-30.04.44	2 986 000.00	3 265 937.50	0.07
USD EL FONDO MIVIVIENDA-REG-S 3.50000% 13-31.01.23	1 950 000.00	1 906 125.00	0.04
USD INDO ENERGY FINANCE II BV-REG-S 6.37500% 13-24.01.23	2 043 000.00	1 997 032.50	0.04
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 6.62500% 07-17.02.37	3 403 000.00	4 100 189.63	0.08
USD INVERSIONES CMPC SA-REG-S 4.37500% 13-15.05.23	1 045 000.00	1 058 585.00	0.02
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 9.00000% 11-17.11.21	2 611 961.00	763 998.59	0.02
USD REPUBLIC OF AZERBAIJAN-REG-S 3.50000% 17-01.09.32	8 260 000.00	7 062 300.00	0.15
USD SABLE INTERNATIONAL FINANCE LTD-REG-S 6.87500% 15-01.08.22	899 000.00	924 990.09	0.02
USD SURA ASSET MANAGEMENT SA-REG-S 4.87500% 14-17.04.24	1 965 000.00	1 994 475.00	0.04
USD TELEFONICA CELULAR DEL PARAGUAY-REG-S 6.75000% 12-13.12.22	2 111 000.00	2 142 665.00	0.04
USD TENGIZCHEVROIL FINANCE CO INT-REG-S 4.00000% 16-15.08.26	1 320 000.00	1 271 490.00	0.03
USD TULLOW OIL PLC-REG-S 7.00000% 18-01.03.25	6 924 000.00	6 681 660.00	0.14
米ドル合計		42 416 198.31	0.88
債券、固定利付債合計		42 416 198.31	0.88
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品 合計		389 725 441.84	8.09
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されていない譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD AXTEL SAB DE CV-REG-S 6.37500% 17-14.11.24	2 400 000.00	2 307 000.00	0.05
USD CELULOSA ARAUCO Y CONSTITUCION SA 5.50000% 18-02.11.47	326 000.00	315 405.00	0.01
USD COLBUN SA-REG-S 3.95000% 17-11.10.27	897 000.00	862 914.00	0.02
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S 10.75000% 19-31.01.29	12 134 000.00	12 346 345.00	0.26
USD GREENKO DUTCH BV-REG-S 5.25000% 17-24.07.24	6 744 000.00	6 273 639.72	0.13
USD INRETAIL PHARMA SA-REG-S 5.37500% 18-02.05.23	3 580 000.00	3 662 996.22	0.07
USD INTERCORP FINANCIAL SERVICES INC-REG-S 4.12500% 17-19.10.27	355 000.00	327 886.87	0.01
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 5.60000% 18-13.03.48	2 410 000.00	2 479 287.50	0.05
USD PUMA INTL FINANCING-REG-S 5.12500% 17-06.10.24	3 095 000.00	2 705 122.85	0.06
USD SUZANO AUSTRIA GMBH-REG-S 7.00000% 17-16.03.47	5 136 000.00	5 559 720.00	0.11
米ドル合計		36 840 317.16	0.77
ノート、固定利付債合計		36 840 317.16	0.77

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
中期債券、固定利付債			
米ドル			
USD RURAL ELECTRIFICATION CORP LTD-REG-S 3.87500% 17-07.07.27	700 000.00	661 076.50	0.01
米ドル合計		661 076.50	0.01
中期債券、固定利付債合計		661 076.50	0.01
転換社債、変動利付債			
米ドル			
USD YAPI VE KREDI BANKASI AS-REG-S-SUB VAR 19-PRP	2 780 000.00	2 911 549.60	0.06
米ドル合計		2 911 549.60	0.06
転換社債、変動利付債合計		2 911 549.60	0.06
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されていない譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		40 412 943.26	0.84
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されていない派生商品			
通貨に係るオプション、従来型			
ユーロ			
EUR EUR/USD PUT 1.10000 15.02.19	19 023 995.00	7 054.50	0.00
ユーロ合計		7 054.50	0.00
通貨に係るオプション、従来型合計		7 054.50	0.00
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されていない派生商品合計		7 054.50	0.00
投資有価証券合計		4 679 708 733.21	97.18
派生商品			
公認の証券取引所に上場されている派生商品			
債券に係る金融先物			
EUR EURO-BUND FUTURE 07.03.19	-332.00	-1 138 132.71	-0.02
EUR EURO-BOBL FUTURE 07.03.19	-182.00	-167 068.72	0.00
EUR EURO-BUXL FUTURE 07.03.19	-63.00	-557 178.77	-0.01
USD US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 20.03.19	278.00	2 181 887.92	0.04
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 20.03.19	-98.00	-606 124.12	-0.01
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 29.03.19	-620.00	-236 590.31	-0.01
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 29.03.19	-445.00	-260 283.79	-0.01
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 20.03.19	470.00	1 586 016.57	0.03
USD US LONG BOND FUTURE 20.03.19	177.00	857 103.60	0.02
債券に係る金融先物合計		1 659 629.67	0.03
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		1 659 629.67	0.03

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)	
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されていない派生商品				
クレジット・デフォルト・スワップ*				
USD	BNP/BRAZIL CREDIT DEFAULT SWAP RECEIVER 1.00000% 18-20.12.20	12 080 000.00	-12 420.01	0.00
USD	CITIGROUP/BRAZIL CREDIT DEFAULT SWAP RECEIVER 1.00000% 18-20.12.20	2 200 000.00	-2 261.93	0.00
USD	CITIGROUP/BRAZIL CREDIT DEFAULT SWAP RECEIVER 1.00000% 18-20.12.20	10 905 000.00	-11 211.94	0.00
USD	CITIBANK/BRAZIL CREDIT DEFAULT SWAP RECEIVER 1.00000% 18-20.12.23	11 450 000.00	331 345.41	0.01
USD	BARCLAYS/MEX CREDIT DEFAULT SWAP RECEIVER 1.00000% 18-20.12.23	18 000 000.00	261 187.98	0.01
USD	BNP PARIBAS/MEX CREDIT DEFAULT SWAP RECEIVER 1.00000% 18-20.12.23	5 203 000.00	75 497.83	0.00
USD	BARCLAYS/MEX CREDIT DEFAULT SWAP RECEIVER 1.00000% 19-20.12.23	9 397 000.00	136 354.63	0.00
USD	BNP PARIBAS/MEX CREDIT DEFAULT SWAP RECEIVER 1.00000% 18-20.12.23	7 809 000.00	113 312.05	0.00
クレジット・デフォルト・スワップ合計			891 804.02	0.02
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されていない派生商品合計			891 804.02	0.02
派生商品合計			2 551 433.69	0.05

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)		
先渡為替契約					
先渡為替契約 (購入 / 売却)					
USD	2 460 402.85	EUR 2 160 922.73	29.3.2019	-31 011.47	0.00
USD	65 932 774.30	EUR 57 320 884.60	8.2.2019	127 446.65	0.00
USD	10 484 269.96	EUR 9 185 954.68	29.3.2019	-106 584.93	0.00
USD	1 603 906.64	EUR 1 405 287.52	29.3.2019	-16 305.60	0.00
USD	78 840 637.85	EUR 68 580 000.00	5.3.2019	-44 379.81	0.00
EUR	3 491 652.00	USD 3 998 494.97	5.3.2019	17 822.17	0.00
USD	666 483.16	EUR 581 074.00	29.3.2019	-3 460.32	0.00
USD	34 297 222.81	EUR 29 654 691.84	19.2.2019	226 873.59	0.00
EUR	1 978 486.57	USD 2 283 832.34	8.2.2019	-12 496.89	0.00
SGD	20 103 916.57	USD 14 862 000.00	22.2.2019	94 967.60	0.00
GBP	69 436 433.52	USD 89 446 000.00	22.2.2019	1 987 374.91	0.04
EUR	1 609 830 427.99	USD 1 850 946 000.00	22.2.2019	-629 733.53	-0.01
CHF	1 675 245 038.19	USD 1 710 867 000.00	22.2.2019	-19 111 233.68	-0.40
USD	21 065 759.01	EUR 18 395 000.00	28.3.2019	-140 674.47	0.00
EUR	163 966.66	USD 187 970.17	28.3.2019	1 056.63	0.00
EUR	9 000 000.00	USD 10 318 784.40	28.3.2019	56 747.06	0.00
CHF	27 858 740.00	USD 28 000 000.00	22.2.2019	133 307.64	0.00
EUR	26 331 819.55	USD 30 000 000.00	22.2.2019	265 420.00	0.01
GBP	1 162 764.56	USD 1 500 000.00	22.2.2019	31 119.65	0.00
USD	871 863.35	EUR 763 213.10	29.3.2019	-8 075.59	0.00
SGD	326 179.20	USD 240 000.00	22.2.2019	2 671.71	0.00
USD	2 938 630.75	EUR 2 592 000.00	8.2.2019	-37 028.30	0.00
USD	790 323.52	EUR 692 360.10	8.2.2019	-4 517.38	0.00
USD	192 000 000.00	CHF 190 092 288.00	22.2.2019	34 217.67	0.00
USD	41 000 000.00	EUR 35 842 262.57	22.2.2019	-196 588.35	0.00
GBP	607 652.01	USD 800 000.00	22.2.2019	151.61	0.00
USD	3 122 403.09	EUR 2 721 195.00	5.3.2019	-7 686.08	0.00
CHF	84 396 840.00	USD 85 000 000.00	1.2.2019	68 884.18	0.00
EUR	162 686 958.80	USD 186 000 000.00	1.2.2019	675 150.86	0.01
GBP	6 077 415.64	USD 8 000 000.00	1.2.2019	-5 463.60	0.00
USD	85 000 000.00	CHF 84 234 490.00	22.2.2019	-64 680.65	0.00
USD	187 000 000.00	EUR 163 280 417.09	22.2.2019	-672 196.08	-0.01
SGD	2 704 008.00	USD 2 000 000.00	1.2.2019	10 938.16	0.00
USD	2 000 000.00	SGD 2 703 184.00	22.2.2019	-11 122.33	0.00
USD	8 000 000.00	GBP 6 071 097.10	22.2.2019	5 624.87	0.00
USD	1 307 382.83	EUR 1 143 000.00	8.2.2019	-4 800.16	0.00
EUR	605 972.17	USD 696 072.96	29.3.2019	2 576.61	0.00
EUR	1 047 948.23	USD 1 198 345.57	8.2.2019	4 716.41	0.00
EUR	3 676 571.00	USD 4 202 809.64	19.2.2019	21 211.93	0.00
EUR	5 432 284.47	USD 6 233 942.99	8.2.2019	2 409.81	0.00
EUR	2 012 985.22	USD 2 314 926.96	19.2.2019	-2 203.23	0.00
先渡為替契約 (購入 / 売却) 合計				-17 339 552.73	-0.36
現金預金、要求払預金および預託金勘定ならびにその他の流動資産				221 993 018.49**	4.61
当座借越およびその他の短期負債				-849 127.34	-0.02
その他の資産および負債				-70 549 904.30	-1.46
純資産総額				4 815 514 601.02	100.00

* 額面が正：サブ・ファンドは「プロテクションの受取側」、額面が負：サブ・ファンドは「プロテクションの支払側」

** 2019年1月31日現在、UBSヨーロッパSEに対する52,566.31米ドルの現金が、取引相手方に対する担保となっている。

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
預託証券			
アメリカ合衆国			
USD US BANCORP 0% BDS 29/12/49 USD1000	339 000.00	333 799.74	0.01
アメリカ合衆国合計		333 799.74	0.01
預託証券合計		333 799.74	0.01
アセット・バック証券、変動利付債			
米ドル			
USD MIDOCEAN CREDIT CLO III -144A 3M LIBOR+112BP 18-21.04.31	3 000 000.00	2 969 309.40	0.07
USD OCP CLO LTD-144A 3M LIBOR+126BP 17-15.07.30	2 000 000.00	1 989 855.20	0.04
USD PALMER SQUARE CLO LTD-144A 3M LIBOR+130BP 17-21.05.29	5 000 000.00	4 999 280.50	0.11
USD SLM STUDENT LOAN TRUST 2005-5-SUB 3M LIBOR+75BP 05-25.10.40	2 500 000.00	2 500 598.50	0.05
USD SLM STUDENT LOAN TRUST 2006-2-SUB 3M LIBOR+17BP 06-25.01.41	1 500 000.00	1 385 523.05	0.03
USD TRINITAS CLO VI LTD-144A 3M LIBOR+132BP 17-25.07.29	4 000 000.00	3 993 932.80	0.09
USD ZAIS CLO 6 LTD-144A 3M LIBOR+137BP 17-15.07.29	3 000 000.00	3 001 666.50	0.07
米ドル合計		20 840 165.95	0.46
アセット・バック証券、変動利付債合計		20 840 165.95	0.46
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD 21ST CENTURY FOX AMERICA INC 6.15000% 07-01.03.37	1 305 000.00	1 616 872.29	0.04
USD ABBOTT LABORATORIES 3.40000% 16-30.11.23	3 998 000.00	4 048 359.61	0.09
USD ABBOTT LABORATORIES 3.75000% 16-30.11.26	641 000.00	654 247.16	0.01
USD ABBVIE INC 2.30000% 16-14.05.21	3 640 000.00	3 574 886.63	0.08
USD ABBVIE INC 2.50000% 15-14.05.20	4 300 000.00	4 274 363.05	0.09
USD ABBVIE INC 3.20000% 16-14.05.26	4 882 000.00	4 609 065.58	0.10
USD ABBVIE INC 3.60000% 15-14.05.25	7 860 000.00	7 750 155.02	0.17
USD ABBVIE INC 3.75000% 18-14.11.23	2 030 000.00	2 054 955.60	0.05
USD ABBVIE INC 4.25000% 18-14.11.28	5 015 000.00	4 988 476.01	0.11
USD ABN AMRO BANK NV-REG-S-SUB 4.75000% 15-28.07.25	4 300 000.00	4 374 757.65	0.10
USD ABU DHABI, GOVERNMENT OF-144A 4.12500% 17-11.10.47	985 000.00	971 456.25	0.02
USD ACTIVISION BLIZZARD INC 3.40000% 17-15.06.27	650 000.00	614 259.28	0.01
USD ADANI PORTS&SPECIAL ECO ZONE LTD-REG-S 4.00000% 17-30.07.27	1 075 000.00	977 126.63	0.02
USD ADANI TRANSMISSION LTD-REG-S 4.00000% 16-03.08.26	1 075 000.00	965 591.87	0.02
USD AERCAP IRE CAP LTD/GLB AVIA TRUST 5.00000% 15-01.10.21	3 050 000.00	3 114 514.51	0.07
USD AERCAP IRE CAP LTD/GLB AVIA TRUST 3.95000% 16-01.02.22	8 724 000.00	8 662 991.41	0.19
USD AERCAP IRE CAP LTD/GLB AVIA TRUST 4.45000% 18-01.10.25	2 000 000.00	1 956 981.00	0.04
USD AERCAP IRE CAP LTD/GLB AVIA TRUST 4.87500% 19-16.01.24	1 000 000.00	1 016 416.00	0.02
USD AES CORP 4.00000% 18-15.03.21	1 976 000.00	1 971 060.00	0.04
USD AETNA INC 2.80000% 16-15.06.23	600 000.00	583 515.42	0.01
USD AETNA INC 3.50000% 14-15.11.24	1 000 000.00	990 114.29	0.02
USD AIR LEASE CORP 2.12500% 16-15.01.20	900 000.00	891 742.45	0.02
USD AIR LEASE CORP 3.00000% 16-15.09.23	750 000.00	714 289.45	0.02
USD AIR LEASE CORP 3.25000% 18-01.03.25	2 600 000.00	2 430 868.65	0.05
USD AIR LEASE CORP 3.62500% 17-01.12.27	804 000.00	732 529.22	0.02
USD ALABAMA POWER CO 2.45000% 17-30.03.22	2 000 000.00	1 962 374.94	0.04
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC 4.30000% 15-15.01.26	1 700 000.00	1 711 304.83	0.04
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC 4.70000% 18-01.07.30	2 280 000.00	2 340 721.64	0.05
USD ALIBABA GROUP HOLDING LTD 2.80000% 17-06.06.23	5 071 000.00	4 925 818.79	0.11
USD ALIBABA GROUP HOLDING LTD 3.40000% 17-06.12.27	6 475 000.00	6 191 942.79	0.14

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD ALLERGAN FUNDING SCS 3.45000% 15-15.03.22	2 570 000.00	2 564 345.35	0.06
USD AMEREN CORP 2.70000% 15-15.11.20	2 000 000.00	1 981 337.08	0.04
USD AMERICAN CAMPUS COMMUN OPER PARTN 4.12500% 14-01.07.24	585 000.00	589 883.69	0.01
USD AMERICAN CAMPUS COMMUN OPER PARTN 3.35000% 15-01.10.20	1 375 000.00	1 371 882.61	0.03
USD AMERICAN EXPRESS CO 3.40000% 18-27.02.23	1 750 000.00	1 756 058.15	0.04
USD AMERICAN EXPRESS CO 4.20000% 18-06.11.25	2 410 000.00	2 496 092.43	0.05
USD AMERICAN HOMES 4 RENT LP 4.25000% 18-15.02.28	2 415 000.00	2 326 183.02	0.05
USD AMERICAN INTERNATIONAL GROUP 4.87500% 12-01.06.22	1 100 000.00	1 158 818.43	0.03
USD AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC 4.12500% 13-15.02.24	2 935 000.00	3 001 538.50	0.07
USD AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC-SUB 3.75000% 15-10.07.25	1 100 000.00	1 083 127.17	0.02
USD AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC 3.90000% 16-01.04.26	3 510 000.00	3 475 941.66	0.08
USD AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC 4.20000% 18-01.04.28	2 980 000.00	2 988 444.13	0.07
USD AMERICAN TOWER CORP 3.50000% 13-31.01.23	1 260 000.00	1 254 186.39	0.03
USD AMERICAN TOWER CORP 2.80000% 15-01.06.20	2 755 000.00	2 745 773.91	0.06
USD AMERICAN TOWER CORP 3.37500% 16-15.10.26	3 740 000.00	3 565 862.42	0.08
USD AMERISOURCEBERGEN CORP 3.45000% 17-15.12.27	1 195 000.00	1 128 729.72	0.02
USD AMGEN INC 2.12500% 15-01.05.20	2 200 000.00	2 181 966.36	0.05
USD AMGEN INC 2.25000% 16-19.08.23	1 995 000.00	1 911 166.44	0.04
USD AMGEN INC 2.60000% 16-19.08.26	2 650 000.00	2 462 075.01	0.05
USD AMGEN INC 2.65000% 17-11.05.22	3 800 000.00	3 747 271.09	0.08
USD AMGEN INC 2.70000% 15-01.05.22	7 507 000.00	7 401 715.00	0.16
USD AMGEN INC 3.87500% 11-15.11.21	1 900 000.00	1 936 148.64	0.04
USD ANADARKO PETROLEUM CORP 4.85000% 16-15.03.21	2 907 000.00	2 979 237.21	0.07
USD ANADARKO PETROLEUM CORP 5.55000% 16-15.03.26	1 230 000.00	1 319 017.07	0.03
USD ANALOG DEVICES INC 2.85000% 18-12.03.20	1 535 000.00	1 533 863.85	0.03
USD ANALOG DEVICES INC 3.12500% 16-05.12.23	2 585 000.00	2 519 502.31	0.06
USD ANDEAVR LOGIST LP/TESRO LOGIST FIN CORP 4.25000% 17-01.12.27	525 000.00	510 653.79	0.01
USD ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC-144A 4.87500% 15-14.05.25	1 800 000.00	1 833 169.86	0.04
USD ANHEUSER-BUSCH COS-REG-S 3.65000% 18-01.02.26	12 895 000.00	12 669 379.92	0.28
USD ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 4.15000% 19-23.01.25	1 450 000.00	1 489 243.53	0.03
USD ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 3.50000% 18-12.01.24	6 450 000.00	6 472 565.33	0.14
USD ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 4.00000% 18-13.04.28	3 840 000.00	3 806 122.75	0.08
USD ANHEUSER-BUSCH INBEV FINANCE INC 2.65000% 16-01.02.21	3 359 000.00	3 345 205.46	0.07
USD ANTERO RESOURCES CORP 5.00000% 17-01.03.25	458 000.00	441 970.00	0.01
USD ANTHEM INC 3.65000% 17-01.12.27	3 100 000.00	3 048 998.46	0.07
USD ANTHEM INC 3.70000% 11-15.08.21	4 655 000.00	4 708 694.02	0.10
USD ANZ NEW ZEALAND INT ' L LTD/LDN-144A 2.75000% 18-22.01.21	2 375 000.00	2 353 499.84	0.05
USD APPALACHIAN POWER CO 4.60000% 11-30.03.21	660 000.00	677 703.25	0.01
USD APPALACHIAN POWER CO 3.40000% 15-01.06.25	5 300 000.00	5 271 346.14	0.12
USD APPALACHIAN POWER CO 3.30000% 17-01.06.27	2 490 000.00	2 390 493.57	0.05
USD APPLE INC 2.50000% 17-09.02.22	4 500 000.00	4 473 989.91	0.10
USD APPLE INC 2.75000% 17-13.01.25	3 700 000.00	3 648 226.86	0.08
USD APPLE INC 2.85000% 16-23.02.23	3 850 000.00	3 862 040.88	0.08
USD APPLE INC 2.85000% 17-11.05.24	5 805 000.00	5 781 645.26	0.13
USD APPLE INC 3.00000% 17-20.06.27	1 085 000.00	1 059 731.73	0.02
USD APPLE INC 3.00000% 17-13.11.27	3 445 000.00	3 350 305.98	0.07
USD APPLE INC 3.20000% 15-13.05.25	4 320 000.00	4 347 522.72	0.10
USD APPLE INC 3.25000% 16-23.02.26	5 525 000.00	5 525 467.97	0.12
USD ARCELORMITTAL 6.12500% 15-01.06.25	1 980 000.00	2 129 490.00	0.05
USD ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-144A 7.25000% 16-15.05.24	400 000.00	413 500.00	0.01
USD ASTRAZENCA PLC 3.37500% 15-16.11.25	1 686 000.00	1 655 358.25	0.04
USD ASTRAZENCA PLC 3.50000% 18-17.08.23	10 625 000.00	10 700 624.49	0.24
USD AT&T INC 3.00000% 15-30.06.22	1 280 000.00	1 269 943.68	0.03
USD AT&T INC 3.40000% 15-15.05.25	13 215 000.00	12 927 291.09	0.28
USD AT&T INC 3.80000% 16-15.03.22	6 875 000.00	6 982 251.38	0.15
USD AT&T INC 3.95000% 16-15.01.25	1 000 000.00	1 009 367.70	0.02
USD AT&T INC 4.10000% 18-15.02.28	2 475 000.00	2 456 073.87	0.05
USD AT&T INC 4.30000% 18-15.02.30	1 875 000.00	1 857 893.87	0.04

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK-REG-S-SUB-4.40000% 16-19.05.26	6 800 000.00	6 726 696.00	0.15
USD AUTOZONE INC 3.12500% 16-21.04.26	2 550 000.00	2 405 840.18	0.05
USD AXIS SPECIALTY FINANCE PLC 2.65000% 14-01.04.19	2 000 000.00	1 998 474.44	0.04
USD BAIDU INC 2.87500% 17-06.07.22	929 000.00	905 579.91	0.02
USD BAIDU INC 4.37500% 18-14.05.24	1 655 000.00	1 692 646.95	0.04
USD BAIDU INC 4.87500% 18-14.11.28	8 475 000.00	8 851 615.44	0.19
USD BALL CORP 4.00000% 13-15.11.23	250 000.00	250 600.00	0.01
USD BALTIMORE GAS & ELECTRIC CO 2.40000% 16-15.08.26	2 755 000.00	2 539 680.57	0.06
USD BANCO SANTANDER SA 3.50000% 17-11.04.22	600 000.00	596 934.68	0.01
USD BANCO SANTANDER SA 3.12500% 17-23.02.23	2 800 000.00	2 720 623.16	0.06
USD BANCO SANTANDER SA 3.84800% 18-12.04.23	3 800 000.00	3 778 464.37	0.08
USD BANCO SANTANDER SA 4.25000% 17-11.04.27	800 000.00	778 266.33	0.02
USD BANCO SANTANDER SA-SUB 5.17900% 15-19.11.25	4 600 000.00	4 741 370.42	0.10
USD BANK OF AMERICA CORP 4.00000% 14-01.04.24	4 762 000.00	4 912 601.11	0.11
USD BANK OF AMERICA CORP 4.10000% 13-24.07.23	5 300 000.00	5 492 744.04	0.12
USD BANK OF IRELAND GROUP PLC-144A 4.50000% 18-25.11.23	2 447 000.00	2 424 542.53	0.05
USD BARCLAYS BANK PLC 2.65000% 18-11.01.21	2 540 000.00	2 513 226.35	0.06
USD BARCLAYS PLC 3.65000% 15-16.03.25	3 185 000.00	3 042 431.34	0.07
USD BARCLAYS PLC 3.68400% 17-10.01.23	2 230 000.00	2 181 611.19	0.05
USD BARCLAYS PLC 4.33700% 17-10.01.28	900 000.00	866 474.81	0.02
USD BARCLAYS PLC 4.37500% 16-12.01.26	2 040 000.00	2 005 280.28	0.04
USD BARCLAYS PLC-SUB 4.37500% 14-11.09.24	9 920 000.00	9 718 141.29	0.21
USD BARCLAYS PLC-SUB 4.83600% 17-09.05.28	3 450 000.00	3 313 866.35	0.07
USD BARRICK AUSTRALIAN FINANCE PTY LTD 5.95000% 09-15.10.39	430 000.00	474 238.40	0.01
USD BAT CAPITAL CORP 2.76400% 18-15.08.22	6 795 000.00	6 605 031.11	0.15
USD BAT CAPITAL CORP 3.22200% 18-15.08.24	5 220 000.00	4 992 544.61	0.11
USD BAT CAPITAL CORP 3.55700% 18-15.08.27	3 905 000.00	3 572 795.20	0.08
USD BAXALTA INC 2.87500% 15-23.06.20	178 000.00	176 812.90	0.00
USD BAXALTA INC 3.60000% 16-23.06.22	279 000.00	278 207.46	0.01
USD BAXALTA INC 4.00000% 16-23.06.25	1 340 000.00	1 329 163.06	0.03
USD BBVA BANCOMER SA/TEXAS-144A-SUB 6.50000% 11-10.03.21	955 000.00	991 767.50	0.02
USD BECTON DICKINSON AND CO 2.13300% 17-06.06.19	1 750 000.00	1 742 183.49	0.04
USD BECTON DICKINSON AND CO 2.89400% 17-06.06.22	3 730 000.00	3 662 776.23	0.08
USD BEMIS CO INC 6.80000% 09-01.08.19	1 750 000.00	1 779 859.38	0.04
USD BIOGEN INC 3.62500% 15-15.09.22	3 000 000.00	3 049 361.70	0.07
USD BLACK HILLS CORP 3.95000% 16-15.01.26	575 000.00	571 349.18	0.01
USD BLOCK FINANCIAL LLC 4.12500% 15-01.10.20	895 000.00	905 436.86	0.02
USD BMW US CAPITAL LLC-REG-S 2.00000% 16-11.04.21	1 200 000.00	1 169 018.72	0.03
USD BNZ INTERNATIONAL FUND LTD/LONDON-144A 3.37500% 18-01.03.23	7 030 000.00	6 972 846.10	0.15
USD BOEING CO 1.87500% 16-15.06.23	2 075 000.00	1 987 904.66	0.04
USD BOEING CO 3.45000% 18-01.11.28	2 700 000.00	2 718 384.57	0.06
USD BOSTON PROPERTIES LP 2.75000% 16-01.10.26	1 974 000.00	1 816 216.30	0.04
USD BOSTON PROPERTIES LP 3.20000% 17-15.01.25	2 015 000.00	1 949 610.29	0.04
USD BOSTON SCIENTIFIC CORP 6.00000% 09-15.01.20	1 000 000.00	1 027 205.30	0.02
USD BP CAPITAL MARKETS AMERICA INC 3.79000% 18-06.02.24	2 585 000.00	2 664 039.22	0.06
USD BP CAPITAL MARKETS PLC 3.27900% 17-19.09.27	9 925 000.00	9 715 208.72	0.21
USD BP CAPITAL MARKETS PLC 3.79600% 18-21.09.25	2 690 000.00	2 771 799.41	0.06
USD BP CAPITAL MARKETS PLC 2.75000% 18-10.05.23	3 125 000.00	3 079 700.59	0.07
USD BP CAPITAL MARKETS PLC 2.52000% 18-19.09.22	2 250 000.00	2 207 216.84	0.05
USD BURLINGTON NORTHERN SANTA FE LLC 3.65000% 15-01.09.25	2 300 000.00	2 349 882.40	0.05
USD CA INC 3.60000% 17-15.08.22	1 640 000.00	1 613 860.34	0.04
USD CAMDEN PROPERTY TRUST 3.50000% 14-15.09.24	1 250 000.00	1 242 733.79	0.03
USD CAMPBELL SOUP CO 3.30000% 18-15.03.21	3 205 000.00	3 199 215.77	0.07
USD CAMPBELL SOUP CO 4.15000% 18-15.03.28	1 005 000.00	964 687.62	0.02
USD CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 2.70000% 18-02.02.21	3 850 000.00	3 831 712.27	0.08
USD CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD 3.80000% 14-15.04.24	1 000 000.00	1 004 712.10	0.02
USD CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD 2.95000% 17-15.01.23	4 620 000.00	4 514 523.42	0.10
USD CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD 3.85000% 17-01.06.27	310 000.00	303 769.20	0.01

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)	
USD	CANADIAN PACIFIC RAILWAY CO 4.50000% 11-15.01.22	1 800 000.00	1 848 987.90	0.04
USD	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 3.30000% 17-30.10.24	2 200 000.00	2 144 250.42	0.05
USD	CAPITAL ONE NA 2.95000% 14-23.07.21	3 800 000.00	3 764 445.30	0.08
USD	CARDINAL HEALTH INC 3.07900% 17-15.06.24	1 920 000.00	1 831 929.05	0.04
USD	CBS CORP 2.90000% 16-15.01.27	1 000 000.00	906 782.75	0.02
USD	CBS CORP 3.37500% 17-15.02.28	2 050 000.00	1 901 319.75	0.04
USD	CCO LLC/CAPITAL 3.57900% 16-23.07.20	1 500 000.00	1 503 872.10	0.03
USD	CCO LLC/CAPITAL 4.50000% 18-01.02.24	2 770 000.00	2 821 729.47	0.06
USD	CELGENE CORP 2.75000% 17-15.02.23	6 150 000.00	6 001 855.42	0.13
USD	CELGENE CORP 3.25000% 18-20.02.23	8 850 000.00	8 809 426.20	0.19
USD	CELGENE CORP 3.45000% 17-15.11.27	500 000.00	478 011.76	0.01
USD	CELGENE CORP 3.87500% 15-15.08.25	3 735 000.00	3 751 697.31	0.08
USD	CENOVUS ENERGY INC 4.25000% 17-15.04.27	3 375 000.00	3 231 508.41	0.07
USD	CENTENE CORP 5.62500% 16-15.02.21	150 000.00	152 250.00	0.00
USD	CENTERPOINT ENERGY INC 3.60000% 18-01.11.21	1 550 000.00	1 562 738.37	0.03
USD	CENTERPOINT ENERGY INC 4.25000% 18-01.11.28	1 066 000.00	1 082 152.67	0.02
USD	CENTERPOINT ENERGY RESOURCES CORP 3.55000% 18-01.04.23	1 510 000.00	1 519 026.18	0.03
USD	CERRO DEL AGUILA SA-144A 4.12500% 17-16.08.27	1 018 000.00	955 647.50	0.02
USD	CHEVRON CORP 2.56600% 16-16.05.23	5 000 000.00	4 938 953.75	0.11
USD	CHUBB INA HOLDINGS INC 2.87500% 15-03.11.22	4 815 000.00	4 811 214.93	0.11
USD	CHURCH & DWIGHT CO INC 3.15000% 17-01.08.27	2 610 000.00	2 473 362.29	0.05
USD	CIGNA CORP 3.05000% 17-15.10.27	1 250 000.00	1 157 923.15	0.03
USD	CIGNA CORP 3.25000% 15-15.04.25	4 550 000.00	4 443 805.73	0.10
USD	CIGNA CORP 4.50000% 11-15.03.21	3 340 000.00	3 402 453.99	0.07
USD	CISCO SYSTEMS INC 2.20000% 16-28.02.21	5 200 000.00	5 148 333.43	0.11
USD	CIT GROUP INC 4.12500% 18-09.03.21	979 000.00	981 447.50	0.02
USD	CIT GROUP INC 5.25000% 18-07.03.25	674 000.00	694 220.00	0.02
USD	CITIGROUP 8.50000% 09-22.05.19	1 400 000.00	1 424 029.46	0.03
USD	CITIGROUP INC 2.45000% 17-10.01.20	2 000 000.00	1 990 995.48	0.04
USD	CITIGROUP INC 2.70000% 17-27.10.22	3 850 000.00	3 768 766.31	0.08
USD	CITIGROUP INC 2.75000% 17-25.04.22	2 000 000.00	1 974 809.70	0.04
USD	CITIGROUP INC 2.90000% 16-08.12.21	12 750 000.00	12 669 969.52	0.28
USD	CITIGROUP INC 3.20000% 16-21.10.26	3 160 000.00	3 040 317.05	0.07
USD	CITIGROUP INC 3.40000% 16-01.05.26	1 800 000.00	1 751 820.25	0.04
USD	CITIGROUP INC 3.70000% 16-12.01.26	7 015 000.00	7 012 545.03	0.15
USD	CITIGROUP INC 4.50000% 11-14.01.22	1 800 000.00	1 871 716.50	0.04
USD	CITIGROUP INC-SUB 4.40000% 15-10.06.25	6 835 000.00	6 974 008.18	0.15
USD	CITIGROUP INC-SUB 4.45000% 15-29.09.27	14 695 000.00	14 909 843.84	0.33
USD	CITIGROUP INC-SUB 4.12500% 16-25.07.28	4 840 000.00	4 798 865.08	0.11
USD	CITIZENS FINANCIAL GROUP INC-SUB 4.30000% 15-03.12.25	3 960 000.00	3 938 063.30	0.09
USD	CK HUTCHISON INTNL 17 II LTD-REG-S 2.75000% 17-29.03.23	1 950 000.00	1 894 376.25	0.04
USD	CMS ENERGY CORP 2.95000% 16-15.02.27	1 650 000.00	1 523 515.85	0.03
USD	CMS ENERGY CORP 3.00000% 16-15.05.26	1 700 000.00	1 604 363.11	0.04
USD	CMS ENERGY CORP 3.87500% 14-01.03.24	1 500 000.00	1 512 311.55	0.03
USD	CNA FINANCIAL CORP 3.95000% 14-15.05.24	2 360 000.00	2 351 545.58	0.05
USD	CNH INDUSTRIAL CAPITAL LLC 3.87500% 16-15.10.21	8 655 000.00	8 633 362.50	0.19
USD	CNH INDUSTRIAL CAPITAL LLC 4.37500% 17-05.04.22	822 000.00	827 178.60	0.02
USD	COLORADO INTERSTATE GAS/ ISSUING-REG-S 4.15000% 16-15.08.26	5 030 000.00	4 961 068.02	0.11
USD	COLUMBIA PROPERTY TRUST OPERATING PARTN 3.65000% 16-15.08.26	2 100 000.00	1 963 323.47	0.04
USD	COMCAST CORP 3.00000% 17-01.02.24	3 095 000.00	3 064 859.03	0.07
USD	COMCAST CORP 3.55000% 18-01.05.28	2 926 000.00	2 888 299.02	0.06
USD	COMCAST CORP 3.60000% 14-01.03.24	1 500 000.00	1 528 797.60	0.03
USD	COMCAST CORP 3.95000% 18-15.10.25	10 596 000.00	10 965 478.27	0.24
USD	COMCAST CORP 4.15000% 18-15.10.28	7 050 000.00	7 299 863.28	0.16
USD	COMCAST CORP 4.25000% 18-15.10.30	3 775 000.00	3 913 065.72	0.09
USD	COMPASS BANK 3.50000% 18-11.06.21	1 975 000.00	1 978 135.91	0.04
USD	CONAGRA BRANDS INC 4.30000% 18-01.05.24	8 110 000.00	8 159 999.77	0.18
USD	CONAGRA BRANDS INC 4.85000% 18-01.11.28	2 720 000.00	2 756 604.94	0.06

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD CONAGRA INC 4.6000% 18-01.11.25	6 395 000.00	6 476 066.22	0.14
USD CONCHO RESOURCES INC 4.3000% 18-15.08.28	2 050 000.00	2 071 779.20	0.05
USD CONOCOPHILLIPS CO 4.9500% 16-15.03.26	735 000.00	804 081.62	0.02
USD CONSTELLATION BRANDS INC 2.7000% 17-09.05.22	1 965 000.00	1 915 017.12	0.04
USD CONSTELLATION BRANDS INC 4.4000% 18-15.11.25	3 415 000.00	3 519 437.87	0.08
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-144A 3.6250% 17-01.08.27	579 000.00	564 999.78	0.01
USD CORPORATE OFFICE PROPERTIES LP 3.7000% 14-15.06.21	875 000.00	869 310.16	0.02
USD COX COMMUNICATION INC-REG-S 3.3500% 16-15.09.26	1 130 000.00	1 065 421.94	0.02
USD COX COMMUNICATION INC-REG-S 3.5000% 17-15.08.27	1 100 000.00	1 045 937.51	0.02
USD CRANE CO 4.4500% 13-15.12.23	1 760 000.00	1 821 187.45	0.04
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-144A 3.5740% 17-09.01.23	1 900 000.00	1 879 876.38	0.04
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-144A 4.2820% 17-09.01.28	530 000.00	522 226.16	0.01
USD CREDIT SUISSE GRP FDNG GUERNSEY 3.7500% 16-26.03.25	3 975 000.00	3 879 939.66	0.09
USD CREDIT SUISSE GRP FDNG GUERNSEY 2.7500% 16-26.03.20	6 300 000.00	6 263 629.28	0.14
USD CREDIT SUISSE GRP FDNG GUERNSEY 3.8000% 16-15.09.22	4 100 000.00	4 106 349.26	0.09
USD CREDIT SUISSE GRP FDNG GUERNSEY 3.8000% 16-09.06.23	3 000 000.00	2 979 234.99	0.07
USD CREDIT SUISSE-REG-S-SUB 6.5000% 13-08.08.23	2 400 000.00	2 534 280.00	0.06
USD CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 4.8750% 14-15.04.22	3 545 000.00	3 672 672.82	0.08
USD CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 3.4000% 16-15.02.21	3 500 000.00	3 501 510.95	0.08
USD CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 3.7000% 16-15.05.26	2 250 000.00	2 183 922.88	0.05
USD CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 3.1500% 18-15.07.23	2 317 000.00	2 263 421.97	0.05
USD CSX CORP 3.2500% 17-01.06.27	3 145 000.00	3 033 252.80	0.07
USD CVS HEALTH CORP 2.1250% 16-01.06.21	4 355 000.00	4 259 995.80	0.09
USD CVS HEALTH CORP 2.7500% 12-01.12.22	5 850 000.00	5 715 786.73	0.13
USD CVS HEALTH CORP 3.3500% 18-09.03.21	3 000 000.00	3 012 915.00	0.07
USD CVS HEALTH CORP 3.5000% 15-20.07.22	8 845 000.00	8 930 892.91	0.20
USD CVS HEALTH CORP 3.7000% 18-09.03.23	17 665 000.00	17 817 818.15	0.39
USD CVS HEALTH CORP 3.8750% 15-20.07.25	10 239 000.00	10 273 674.37	0.23
USD CVS HEALTH CORP 4.1000% 18-25.03.25	2 495 000.00	2 540 224.12	0.06
USD CVS HEALTH CORP 4.3000% 18-25.03.28	14 470 000.00	14 671 177.86	0.32
USD CVS HEALTH CORP 4.7500% 16-01.12.22	3 000 000.00	3 126 104.10	0.07
USD CVS HEALTH CORP 5.0500% 18-25.03.48	4 670 000.00	4 793 972.62	0.11
USD DANSKE BANK AS-144A 3.8750% 18-12.09.23	2 960 000.00	2 833 423.15	0.06
USD DDR CORP 3.6250% 15-01.02.25	1 550 000.00	1 496 065.46	0.03
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP-REG-S 5.4500% 16-15.06.23	11 325 000.00	11 865 662.29	0.26
USD DELTA AIR LINES INC 2.8750% 17-13.03.20	2 600 000.00	2 585 264.94	0.06
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 3.1500% 18-22.01.21	3 800 000.00	3 694 211.84	0.08
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 3.9500% 18-27.02.23	435 000.00	415 770.15	0.01
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 4.2500% 18-04.02.21	2 115 000.00	2 098 297.95	0.05
USD DEVON ENERGY CORP 3.2500% 12-15.05.22	3 370 000.00	3 331 177.36	0.07
USD DISCOVER BANK 4.2000% 13-08.08.23	750 000.00	760 926.08	0.02
USD DISCOVER BANK 4.6500% 18-13.09.28	3 250 000.00	3 290 495.33	0.07
USD DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC 2.9500% 17-20.03.23	1 350 000.00	1 307 331.73	0.03
USD DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC 3.9500% 17-20.03.28	1 965 000.00	1 872 711.10	0.04
USD DOLLAR GENERAL CORP 3.2500% 13-15.04.23	1 600 000.00	1 581 887.97	0.03
USD DOLLAR TREE INC 3.7000% 18-15.05.23	6 408 000.00	6 332 203.43	0.14
USD DOLLAR TREE INC 4.0000% 18-15.05.25	2 590 000.00	2 540 930.95	0.06
USD DOMINION ENERGY INC 2.8500% 16-15.08.26	5 550 000.00	5 179 242.68	0.11
USD DOW CHEMICAL CO 3.0000% 12-15.11.22	9 165 000.00	9 120 938.07	0.20
USD DOWDUPONT INC 3.7660% 18-15.11.20	310 000.00	314 143.49	0.01
USD DOWDUPONT INC 4.2050% 18-15.11.23	5 000 000.00	5 182 609.00	0.11
USD DOWDUPONT INC 4.4930% 18-15.11.25	3 328 000.00	3 494 533.12	0.08
USD DR HORTON INC 2.5500% 17-01.12.20	6 100 000.00	5 995 221.58	0.13
USD DR HORTON INC 4.0000% 15-15.02.20	1 130 000.00	1 134 761.60	0.03
USD DTE ENERGY CO 2.8500% 16-01.10.26	1 900 000.00	1 761 133.54	0.04
USD DTE ENERGY CO 3.7000% 18-01.08.23	6 760 000.00	6 778 961.80	0.15
USD DUKE ENERGY CORP 2.6500% 16-01.09.26	5 850 000.00	5 454 424.11	0.12
USD DUKE ENERGY CORP 3.1500% 17-15.08.27	1 415 000.00	1 349 954.04	0.03

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD DUKE ENERGY CORP 3.75000% 14-15.04.24	1 700 000.00	1 728 509.34	0.04
USD DUKE ENERGY CORP 3.95000% 13-15.10.23	3 000 000.00	3 065 718.00	0.07
USD DUKE REALTY LP 3.62500% 13-15.04.23	2 250 000.00	2 259 866.70	0.05
USD DUN & BRADSTREET CORP 4.00000% 15-15.06.20	3 450 000.00	3 480 187.50	0.08
USD EBAY INC 3.60000% 17-05.06.27	2 000 000.00	1 903 501.38	0.04
USD EDISON INTERNATIONAL 2.95000% 16-15.03.23	920 000.00	863 839.64	0.02
USD EDISON INTERNATIONAL 2.40000% 17-15.09.22	1 895 000.00	1 731 586.46	0.04
USD EDISON INTERNATIONAL 4.12500% 18-15.03.28	2 119 000.00	1 859 284.96	0.04
USD EDP FINANCE BV-REG-S 3.62500% 17-15.07.24	2 200 000.00	2 102 763.03	0.05
USD EL PASO ELECTRIC CO 3.30000% 12-15.12.22	2 595 000.00	2 535 201.73	0.06
USD ELECTRONIC ARTS INC 3.70000% 16-01.03.21	1 995 000.00	2 020 615.00	0.04
USD ELI LILLY & CO 2.75000% 15-01.06.25	2 850 000.00	2 777 850.40	0.06
USD EMPRESA NACIONAL DE ELECTRICIDAD SA/CHI 4.25000% 14-15.04.24	348 000.00	351 480.00	0.01
USD EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO-REG-S 3.75000% 16-05.08.26	213 000.00	205 864.50	0.00
USD ENBRIDGE ENERGY PARTNERS LP 9.87500% 08-01.03.19	1 415 000.00	1 421 990.95	0.03
USD ENBRIDGE ENERGY PARTNERS LP 5.87500% 15-15.10.25	1 650 000.00	1 824 742.09	0.04
USD ENCANA CORP 3.90000% 11-15.11.21	7 599 000.00	7 653 658.84	0.17
USD ENEL CHILE SA 4.87500% 18-12.06.28	2 626 000.00	2 681 802.50	0.06
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 3.62500% 17-25.05.27	1 850 000.00	1 662 679.86	0.04
USD ENERGY TRANSFER EQUITY LP 5.50000% 15-01.06.27	494 000.00	512 525.00	0.01
USD ENERGY TRANSFER EQUITY LP 4.25000% 17-15.03.23	1 750 000.00	1 763 125.00	0.04
USD ENERGY TRANSFER LP/REGENCY FIN CORP 5.00000% 14-01.10.22	5 045 000.00	5 222 212.69	0.11
USD ENERGY TRANSFER PARTNERS LP 4.65000% 11-01.06.21	2 300 000.00	2 354 704.12	0.05
USD ENERGY TRANSFER PARTNERS LP 3.60000% 13-01.02.23	1 800 000.00	1 777 199.83	0.04
USD ENERGY TRANSFER PARTNERS LP 4.15000% 13-01.10.20	3 925 000.00	3 963 475.20	0.09
USD ENERGY TRANSFER PARTNERS LP 4.75000% 15-15.01.26	2 155 000.00	2 163 444.16	0.05
USD ENERGY TRANSFER PARTNERS LP 4.95000% 18-15.06.28	1 500 000.00	1 519 095.00	0.03
USD ENI SPA-144A 4.00000% 18-12.09.23	1 485 000.00	1 497 851.04	0.03
USD ENLINK MIDSTREAM PARTNERS LP 4.15000% 15-01.06.25	595 000.00	556 325.00	0.01
USD ENERGY CORP 4.00000% 15-15.07.22	2 330 000.00	2 347 299.09	0.05
USD ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC 2.85000% 16-15.04.21	4 645 000.00	4 633 975.42	0.10
USD ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LP 4.15000% 18-16.10.28	6 765 000.00	6 896 289.71	0.15
USD EOG RESOURCES INC 2.62500% 12-15.03.23	1 431 000.00	1 405 755.31	0.03
USD EOG RESOURCES INC 4.15000% 16-15.01.26	800 000.00	835 708.24	0.02
USD EPR PROPERTIES 4.50000% 17-01.06.27	700 000.00	679 350.89	0.02
USD EPR PROPERTIES 4.75000% 16-15.12.26	1 780 000.00	1 778 663.40	0.04
USD EPR PROPERTIES 5.25000% 13-15.07.23	1 000 000.00	1 035 043.10	0.02
USD EQT CORP 2.50000% 17-01.10.20	420 000.00	409 845.74	0.01
USD EQT CORP 3.00000% 17-01.10.22	6 500 000.00	6 240 339.50	0.14
USD EQT CORP 3.90000% 17-01.10.27	1 505 000.00	1 363 069.91	0.03
USD EQT MIDSTREAM PARTNERS LP 5.50000% 18-15.07.28	645 000.00	646 614.17	0.01
USD EQT MIDSTREAM PARTNERS LP 4.75000% 18-15.07.23	3 380 000.00	3 427 908.12	0.08
USD EQUIFAX INC 2.30000% 16-01.06.21	180 000.00	174 353.05	0.00
USD EQUINOR ASA 2.45000% 12-17.01.23	1 800 000.00	1 777 095.61	0.04
USD ESSEX PORTFOLIO LP 3.25000% 13-01.05.23	1 990 000.00	1 956 836.17	0.04
USD EVERSOURCE ENERGY 2.90000% 17-01.10.24	4 410 000.00	4 272 371.48	0.09
USD EXELON CORP 3.40000% 16-15.04.26	2 790 000.00	2 695 829.41	0.06
USD EXELON CORP-SUB STEP-UP 17-01.06.22	1 280 000.00	1 270 156.90	0.03
USD EXELON GENERATION CO LLC 4.00000% 10-01.10.20	4 265 000.00	4 306 977.84	0.09
USD EXELON GENERATION CO LLC 2.95000% 15-15.01.20	2 820 000.00	2 812 953.42	0.06
USD EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO 3.40000% 16-01.03.27	710 000.00	683 665.30	0.02
USD EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO 3.00000% 16-15.07.23	2 106 000.00	2 060 999.22	0.05
USD FEDEX CORP 3.25000% 16-01.04.26	2 000 000.00	1 922 382.72	0.04
USD FIDELITY NATIONAL INFO SERVICES 3.87500% 14-05.06.24	183 000.00	183 005.82	0.00
USD FIDELITY NATIONAL INFO SERVICES 3.62500% 15-15.10.20	980 000.00	986 444.09	0.02
USD FIDELITY NATIONAL INFO SERVICES 2.25000% 16-15.08.21	2 750 000.00	2 674 071.15	0.06
USD FIRSTENERGY CORP 2.85000% 17-15.07.22	5 285 000.00	5 152 748.26	0.11
USD FIRSTENERGY CORP 3.90000% 17-15.07.27	1 205 000.00	1 179 032.36	0.03

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD FISERV INC 3.80000% 18-01.10.23	1 495 000.00	1 496 266.41	0.03
USD FORD MOTOR CO 5.29100% 16-08.12.46	1 000 000.00	801 301.81	0.02
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 5.75000% 11-01.02.21	2 035 000.00	2 068 591.95	0.05
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 5.87500% 11-02.08.21	4 678 000.00	4 798 327.99	0.11
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.25000% 12-20.09.22	3 735 000.00	3 611 250.11	0.08
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.20000% 15-15.01.21	2 505 000.00	2 449 203.95	0.05
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.02100% 16-03.05.19	2 500 000.00	2 492 679.65	0.05
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.09600% 16-04.05.23	6 200 000.00	5 593 939.27	0.12
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.81000% 17-09.01.24	2 605 000.00	2 365 696.94	0.05
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.33900% 17-28.03.22	3 495 000.00	3 306 187.17	0.07
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.97900% 17-03.08.22	3 850 000.00	3 572 593.64	0.08
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.81300% 18-12.10.21	1 400 000.00	1 359 836.80	0.03
USD FRESENIUS MED CARE US FIN II INC-144A 5.62500% 12-31.07.19	1 000 000.00	1 009 784.90	0.02
USD FRESENIUS MED CARE US FIN II INC-144A 4.12500% 14-15.10.20	2 000 000.00	2 010 040.00	0.04
USD FRESENIUS MEDICAL CARE US FINANCE-144A 5.75000% 11-15.02.21	750 000.00	774 450.00	0.02
USD FRESENIUS US FINANCE II INC-144A 4.25000% 14-01.02.21	1 600 000.00	1 610 400.00	0.04
USD FS INVESTMENT CORP 4.25000% 14-15.01.20	4 330 000.00	4 342 944.10	0.10
USD GATX CORP 4.35000% 18-15.02.24	5 425 000.00	5 507 927.09	0.12
USD GE CAPITAL INTL FUNDING CO 2.34200% 16-15.11.20	1 730 000.00	1 689 141.35	0.04
USD GENERAL ELECTRIC CO 3.37500% 14-11.03.24	3 500 000.00	3 392 834.41	0.07
USD GENERAL MILLS INC 4.00000% 18-17.04.25	4 255 000.00	4 295 391.01	0.09
USD GENERAL MILLS INC 4.20000% 18-17.04.28	3 606 000.00	3 627 949.36	0.08
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 3.50000% 14-10.07.19	980 000.00	980 964.32	0.02
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 4.37500% 14-25.09.21	3 045 000.00	3 069 599.03	0.07
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 4.00000% 15-15.01.25	2 875 000.00	2 724 217.78	0.06
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 4.20000% 16-01.03.21	2 525 000.00	2 539 396.04	0.06
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 5.25000% 16-01.03.26	3 000 000.00	2 988 683.61	0.07
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 3.50000% 17-07.11.24	6 175 000.00	5 738 755.39	0.13
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO 3.85000% 18-05.01.28	2 830 000.00	2 525 312.83	0.06
USD GILEAD SCIENCES INC 3.50000% 14-01.02.25	1 030 000.00	1 034 452.18	0.02
USD GILEAD SCIENCES INC 3.65000% 15-01.03.26	4 314 000.00	4 325 357.04	0.10
USD GILEAD SCIENCES INC 1.95000% 16-01.03.22	2 600 000.00	2 514 615.61	0.06
USD GILEAD SCIENCES INC 2.50000% 16-01.09.23	1 205 000.00	1 168 703.11	0.03
USD GILEAD SCIENCES INC 2.95000% 16-01.03.27	1 245 000.00	1 186 488.68	0.03
USD GLAXOSMITHKLINE CAPITAL INC 3.37500% 18-15.05.23	2 675 000.00	2 713 740.15	0.06
USD GLAXOSMITHKLINE CAPITAL INC 3.62500% 18-15.05.25	2 500 000.00	2 558 253.75	0.06
USD GLP CAPITAL LP / GLP FINANC II INC 5.25000% 18-01.06.25	785 000.00	802 293.55	0.02
USD GOLDCORP INC 3.62500% 14-09.06.21	1 600 000.00	1 603 844.48	0.04
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 6.00000% 10-15.06.20	730 000.00	758 671.11	0.02
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 5.75000% 12-24.01.22	1 600 000.00	1 716 867.84	0.04
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC-SUB 4.25000% 15-21.10.25	5 425 000.00	5 475 362.45	0.12
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 3.00000% 17-26.04.22	4 390 000.00	4 341 973.40	0.10
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 3.20000% 18-23.02.23	9 875 000.00	9 820 210.14	0.22
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.87500% 16-25.02.21	2 265 000.00	2 256 679.83	0.05
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 3.50000% 16-16.11.26	3 430 000.00	3 304 787.64	0.07
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.30000% 16-13.12.19	2 000 000.00	1 989 958.14	0.04
USD GRAPHIC PACKAGING INTERNATIONAL INC 4.12500% 16-15.08.24	416 000.00	399 360.00	0.01
USD HCA INC 4.75000% 12-01.05.23	220 000.00	226 050.00	0.01
USD HCA INC 5.37500% 18-01.09.26	1 469 000.00	1 503 433.36	0.03
USD HCA INC 6.50000% 11-15.02.20	435 000.00	446 962.50	0.01
USD HCP INC 3.87500% 14-15.08.24	2 690 000.00	2 674 121.36	0.06
USD HEALTHCARE REALTY TRUST 3.87500% 15-01.05.25	2 000 000.00	1 965 095.68	0.04
USD HEALTHCARE REALTY TRUST 3.62500% 17-15.01.28	1 836 000.00	1 735 449.37	0.04
USD HEALTHCARE TRUST OF AMERICA HOLDINGS LP 3.75000% 17-01.07.27	2 070 000.00	1 991 148.81	0.04
USD HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO STEP-UP/DOWN 16-15.10.25	490 000.00	511 908.98	0.01
USD HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO 3.50000% 18-05.10.21	2 365 000.00	2 384 164.78	0.05
USD HEWLETT-PACKARD CO 3.75000% 10-01.12.20	69 000.00	69 749.00	0.00
USD HIGHWOODS REALTY LP 3.20000% 14-15.06.21	2 000 000.00	1 977 954.12	0.04

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD HOME DEPOT INC/THE 1.80000% 17-05.06.20	2 125 000.00	2 098 684.79	0.05
USD HOME DEPOT INC/THE 2.62500% 15-01.06.22	2 300 000.00	2 292 665.48	0.05
USD HOME DEPOT INC/THE 2.00000% 16-01.04.21	2 075 000.00	2 048 748.87	0.05
USD HOME DEPOT INC/THE 3.25000% 18-01.03.22	745 000.00	756 855.71	0.02
USD HOME DEPOT INC/THE 3.90000% 18-06.12.28	3 160 000.00	3 306 520.35	0.07
USD HOSPITALITY PROPERTIES TRUST 4.65000% 14-15.03.24	1 769 000.00	1 761 379.65	0.04
USD HOSPITALITY PROPERTIES TRUST 5.25000% 16-15.02.26	5 000 000.00	4 965 764.85	0.11
USD HSBC HOLDINGS PLC 2.95000% 16-25.05.21	7 000 000.00	6 973 585.50	0.15
USD HSBC HOLDINGS PLC 2.65000% 16-05.01.22	2 500 000.00	2 463 233.40	0.05
USD HUDSON PACIFIC PROPERTIES LP 3.95000% 17-01.11.27	1 200 000.00	1 116 894.25	0.02
USD HUMANA INC 2.90000% 17-15.12.22	3 750 000.00	3 662 400.08	0.08
USD HUNTINGTON BANCSHARES INC/OH 3.15000% 16-14.03.21	5 520 000.00	5 531 684.18	0.12
USD HUSKY ENERGY INC 3.95000% 12-15.04.22	6 375 000.00	6 444 898.69	0.14
USD IHS MARKIT LTD 4.12500% 18-01.08.23	4 158 000.00	4 142 532.24	0.09
USD IHS MARKIT LTD 4.75000% 18-01.08.28	985 000.00	981 700.25	0.02
USD IMPERIAL BRANDS FINANCE PLC-144A 2.95000% 15-21.07.20	685 000.00	678 027.14	0.02
USD INDIANA MICHIGAN POWER CO 3.20000% 13-15.03.23	862 000.00	860 297.57	0.02
USD ING GROEP NV 3.15000% 17-29.03.22	2 000 000.00	1 985 237.34	0.04
USD ING GROEP NV 3.95000% 17-29.03.27	1 710 000.00	1 667 303.81	0.04
USD INGERSOLL-RAND LUXEMBOURG FINANCE SA 2.62500% 14-01.05.20	1 375 000.00	1 361 940.22	0.03
USD INTEL CORP 2.87500% 17-11.05.24	1 600 000.00	1 592 622.03	0.04
USD INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC 3.40000% 18-25.09.20	2 975 000.00	2 985 992.62	0.07
USD INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC 4.45000% 18-26.09.28	1 955 000.00	2 017 829.20	0.04
USD INTERNATIONAL LEASE FINANCE CORP 4.62500% 13-15.04.21	2 500 000.00	2 531 399.25	0.06
USD INTERNATIONAL PAPER CO 3.00000% 16-15.02.27	495 000.00	462 225.86	0.01
USD INTERPUBLIC GROUP OF COS INC 3.75000% 18-01.10.21	1 614 000.00	1 632 317.94	0.04
USD ITC HOLDINGS CORP 3.65000% 14-15.06.24	2 833 000.00	2 818 956.36	0.06
USD ITC HOLDINGS CORP 3.25000% 16-30.06.26	1 350 000.00	1 295 575.86	0.03
USD ITC HOLDINGS CORP 4.05000% 13-01.07.23	675 000.00	686 331.63	0.02
USD JERSEY CENTRAL POWER & LIGHT CO 7.350% 09-01.02.19	261 000.00	261 000.00	0.01
USD JM SMUCKER CO/THE 2.50000% 15-15.03.20	578 000.00	574 311.02	0.01
USD JM SMUCKER CO/THE 3.00000% 15-15.03.22	950 000.00	935 002.79	0.02
USD JOHN DEERE CAPITAL CORP 3.65000% 18-12.10.23	2 845 000.00	2 919 735.31	0.06
USD JOHNSON & JOHNSON 2.90000% 17-15.01.28	2 055 000.00	2 003 352.79	0.04
USD JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC STEP-UP 16-02.07.24	1 270 000.00	1 249 939.53	0.03
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.90000% 15-15.07.25	2 500 000.00	2 550 237.00	0.06
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.30000% 16-01.04.26	1 750 000.00	1 715 499.33	0.04
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.20000% 16-15.06.26	7 930 000.00	7 700 934.42	0.17
USD JPMORGAN CHASE & CO 2.95000% 16-01.10.26	1 800 000.00	1 719 506.23	0.04
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 3.87500% 14-10.09.24	22 223 000.00	22 535 708.72	0.49
USD JUNIPER NETWORKS INC 4.50000% 14-15.03.24	448 000.00	452 197.36	0.01
USD JUNIPER NETWORKS INC 4.35000% 15-15.06.25	510 000.00	508 623.54	0.01
USD KAISER FOUNDATION HOSPITALS 3.15000% 17-01.05.27	3 890 000.00	3 797 391.31	0.08
USD KANSAS CITY POWER & LIGHT CO 3.15000% 13-15.03.23	1 700 000.00	1 672 385.98	0.04
USD KEURIG DR PEPPER INC 3.20000% 11-15.11.21	3 545 000.00	3 521 077.25	0.08
USD KEYBANK NA/CLEVELAND OH 2.50000% 16-22.11.21	1 435 000.00	1 412 505.79	0.03
USD KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC 3.30000% 15-30.10.19	3 500 000.00	3 496 551.77	0.08
USD KILROY REALTY LP 3.45000% 17-15.12.24	446 000.00	431 289.48	0.01
USD KILROY REALTY LP 4.37500% 15-01.10.25	1 500 000.00	1 515 445.20	0.03
USD KILROY REALTY LP 4.75000% 18-15.12.28	1 430 000.00	1 479 545.50	0.03
USD KIMBERLY-CLARK CORP 3.95000% 18-01.11.28	2 399 000.00	2 505 088.10	0.06
USD KINDER MORGAN ENERGY PARTNERS LP 3.45000% 12-15.02.23	1 840 000.00	1 830 480.69	0.04
USD KINDER MORGAN ENERGY PARTNERS LP 4.25000% 14-01.09.24	5 100 000.00	5 228 503.17	0.11
USD KINDER MORGAN INC 3.15000% 17-15.01.23	4 600 000.00	4 529 448.70	0.10
USD KLA-TENCOR CORP 4.12500% 14-01.11.21	1 646 000.00	1 671 136.72	0.04
USD KOREA HYDRO&NUCLEAR POWER CO LTD-144A 3.75000% 18-25.07.23	6 450 000.00	6 519 791.57	0.14
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 3.95000% 16-15.07.25	4 900 000.00	4 896 622.78	0.11
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 4.00000% 18-15.06.23	8 211 000.00	8 359 193.77	0.18

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD KROGER CO 2.60000% 16-01.02.21	1 615 000.00	1 594 006.36	0.04
USD KROGER CO 4.50000% 19-15.01.29	730 000.00	733 790.38	0.02
USD L BRANDS INC 7.00000% 10-01.05.20	1 350 000.00	1 400 625.00	0.03
USD LAM RESEARCH CORP 2.75000% 15-15.03.20	1 600 000.00	1 595 450.21	0.04
USD LEVEL 3 FINANCING INC 5.12500% 16-01.05.23	175 000.00	173 468.75	0.00
USD LEVEL 3 FINANCING INC 5.37500% 16-15.01.24	150 000.00	149 250.00	0.00
USD LG&E AND KU ENERGY LLC 4.37500% 12-01.10.21	2 000 000.00	2 038 646.20	0.04
USD LIBERTY PROPERTY LP 4.75000% 10-01.10.20	805 000.00	820 283.33	0.02
USD LIBERTY PROPERTY LP 3.37500% 12-15.06.23	1 000 000.00	989 175.58	0.02
USD LIBERTY PROPERTY LP 4.37500% 19-01.02.29	1 125 000.00	1 142 019.12	0.03
USD LIFE STORAGE LP 3.87500% 17-15.12.27	535 000.00	514 619.78	0.01
USD LINCOLN NATIONAL CORP 4.20000% 12-15.03.22	2 700 000.00	2 759 998.86	0.06
USD LINCOLN NATIONAL CORP 3.80000% 18-01.03.28	3 135 000.00	3 082 112.24	0.07
USD LLOYDS BANK PLC 3.30000% 18-07.05.21	515 000.00	516 790.60	0.01
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.05000% 18-16.08.23	2 470 000.00	2 489 478.17	0.05
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC-SUB 4.50000% 14-04.11.24	1 520 000.00	1 488 523.51	0.03
USD LOCKHEED MARTIN CORP 3.55000% 15-15.01.26	2 100 000.00	2 127 300.42	0.05
USD MANUFACTURERS & TRADERS TRUST CO 2.50000% 17-18.05.22	2 290 000.00	2 244 234.99	0.05
USD MARATHON OIL CORP 2.70000% 15-01.06.20	3 200 000.00	3 164 197.06	0.07
USD MARATHON OIL CORP 6.80000% 02-15.03.32	1 080 000.00	1 239 715.48	0.03
USD MARKEL CORP 4.90000% 12-01.07.22	1 765 000.00	1 824 515.45	0.04
USD MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD 3.12500% 14-15.10.21	1 900 000.00	1 888 670.93	0.04
USD MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD 3.12500% 16-15.06.26	1 400 000.00	1 311 034.04	0.03
USD MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD 4.65000% 18-01.12.28	1 905 000.00	1 967 383.60	0.04
USD MARSH & MCLENNAN COS INC 3.30000% 16-14.03.23	2 550 000.00	2 517 015.55	0.06
USD MARTIN MARIETTA MATERIALS INC 3.50000% 17-15.12.27	1 205 000.00	1 108 071.76	0.02
USD MCKESSON CORP 3.95000% 18-16.02.28	1 020 000.00	1 001 553.47	0.02
USD MEAD JOHNSON NUTRITION CO 4.12500% 15-15.11.25	1 583 000.00	1 648 380.28	0.04
USD MEDTRONIC INC 3.15000% 15-15.03.22	6 095 000.00	6 149 822.09	0.14
USD MEXICHEM SAB DE CV-144A 4.00000% 17-04.10.27	2 200 000.00	2 045 285.00	0.05
USD MICROSOFT CORP 2.37500% 13-01.05.23	4 470 000.00	4 420 536.36	0.10
USD MICROSOFT CORP 2.37500% 15-12.02.22	4 300 000.00	4 273 669.08	0.09
USD MICROSOFT CORP 3.30000% 17-06.02.27	7 032 000.00	7 126 768.86	0.16
USD MID-AMERICA APARTMENTS LP 4.30000% 13-15.10.23	1 000 000.00	1 023 145.20	0.02
USD MID-AMERICA APARTMENTS LP 3.75000% 14-15.06.24	1 300 000.00	1 292 241.66	0.03
USD MINERVA LUXEMBOURG SA-144A 6.50000% 16-20.09.26	280 000.00	267 400.00	0.01
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 2.95000% 16-01.03.21	1 093 000.00	1 084 889.94	0.02
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 2.99800% 17-22.02.22	400 000.00	396 188.00	0.01
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 3.45500% 18-02.03.23	5 320 000.00	5 326 543.60	0.12
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 3.76100% 18-26.07.23	1 070 000.00	1 083 342.90	0.02
USD MOLINA HEALTHCARE INC 5.37500% 16-15.11.22	1 685 000.00	1 718 700.00	0.04
USD MOLSON COORS BREWING CO 3.00000% 16-15.07.26	1 695 000.00	1 573 302.66	0.03
USD MOODY 'S CORP 2.75000% 17-15.12.21	2 500 000.00	2 463 542.00	0.05
USD MOODY 'S CORP 3.25000% 18-07.06.21	2 000 000.00	2 002 094.00	0.04
USD MOODY 'S CORP 4.50000% 12-01.09.22	3 110 000.00	3 220 832.31	0.07
USD MORGAN STANLEY 2.50000% 16-21.04.21	2 915 000.00	2 877 627.45	0.06
USD MORGAN STANLEY 2.62500% 16-17.11.21	5 405 000.00	5 330 312.14	0.12
USD MORGAN STANLEY 2.75000% 17-19.05.22	9 480 000.00	9 338 616.23	0.21
USD MORGAN STANLEY 3.62500% 17-20.01.27	2 200 000.00	2 162 489.80	0.05
USD MORGAN STANLEY 5.50000% 11-28.07.21	1 110 000.00	1 173 264.34	0.03
USD MORGAN STANLEY-SUB 5.00000% 13-24.11.25	3 850 000.00	4 068 120.98	0.09
USD MOSAIC CO 3.25000% 17-15.11.22	4 525 000.00	4 470 457.37	0.10
USD MPLX LP 3.37500% 18-15.03.23	3 120 000.00	3 095 087.74	0.07
USD MPLX LP 4.12500% 17-01.03.27	3 390 000.00	3 314 872.95	0.07
USD MPLX LP 4.87500% 16-01.12.24	7 905 000.00	8 242 193.30	0.18
USD MYLAN INC 4.55000% 19-15.04.28	640 000.00	614 565.39	0.01
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD/NY 1.87500% 16-12.07.21	2 485 000.00	2 414 456.10	0.05
USD NATIONAL OILWELL VARCO INC 2.60000% 12-01.12.22	1 305 000.00	1 250 190.10	0.03
USD NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC 3.80000% 07-15.10.17	2 000 000.00	2 016 788.80	0.04

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC 3.90000% 14-15.06.24	1 931 000.00	1 940 366.12	0.04
USD NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC 4.30000% 18-15.10.28	2 640 000.00	2 677 726.92	0.06
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 3.35000% 18-24.09.23	2 670 000.00	2 724 889.06	0.06
USD NEWELL BRANDS INC 3.85000% 16-01.04.23	3 965 000.00	3 899 523.70	0.09
USD NEWFIELD EXPLORATION CO 5.37500% 15-01.01.26	849 000.00	872 347.50	0.02
USD NEWMONT MINING CORP 5.12500% 09-01.10.19	2 415 000.00	2 442 898.32	0.05
USD NEXTERA ENERGY CAPITAL HOLDINGS INC 4.50000% 11-01.06.21	3 130 000.00	3 206 639.30	0.07
USD NISOURCE INC 2.65000% 17-17.11.22	2 563 000.00	2 482 841.84	0.05
USD NISOURCE INC 3.49000% 17-15.05.27	4 220 000.00	4 079 627.44	0.09
USD NOBLE ENERGY INC 3.90000% 14-15.11.24	2 755 000.00	2 703 699.37	0.06
USD NOBLE ENERGY INC 4.15000% 11-15.12.21	2 800 000.00	2 832 116.28	0.06
USD NORDEA BANK ABP-REG-S 3.75000% 18-30.08.23	2 774 000.00	2 768 165.50	0.06
USD NORFOLK SOUTHERN CORP 3.65000% 18-01.08.25	1 730 000.00	1 740 277.24	0.04
USD NORTHROP GRUMMAN CORP 2.55000% 17-15.10.22	2 500 000.00	2 455 655.18	0.05
USD O' REILLY AUTOMOTIVE INC 3.55000% 16-15.03.26	825 000.00	800 419.89	0.02
USD O' REILLY AUTOMOTIVE INC 3.60000% 17-01.09.27	2 250 000.00	2 175 962.99	0.05
USD OASIS PETROLEUM INC 6.87500% 12-15.01.23	5 790 000.00	5 739 337.50	0.13
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 3.40000% 16-15.04.26	850 000.00	850 391.77	0.02
USD OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC 4.50000% 15-15.01.25	693 000.00	688 384.29	0.02
USD ONCOR ELECTRIC DELIVERY CO 4.10000% 19-15.11.48	1 200 000.00	1 199 322.67	0.03
USD ONEOK INC 4.25000% 12-01.02.22	1 830 000.00	1 859 893.97	0.04
USD ONEOK INC 4.55000% 18-15.07.28	1 980 000.00	2 005 364.79	0.04
USD ONEOK PARTNERS LP 3.80000% 15-15.03.20	2 600 000.00	2 610 143.38	0.06
USD ONEOK PARTNERS LP 4.90000% 15-15.03.25	1 510 000.00	1 570 013.59	0.03
USD ORACLE CORP 1.90000% 16-15.09.21	2 100 000.00	2 054 421.62	0.05
USD ORACLE CORP 2.40000% 16-15.09.23	7 755 000.00	7 558 948.17	0.17
USD ORACLE CORP 2.95000% 15-15.05.25	6 225 000.00	6 136 034.85	0.13
USD ORACLE CORP 2.95000% 17-15.11.24	3 410 000.00	3 378 166.15	0.07
USD ORANGE SA 1.62500% 16-03.11.19	7 000 000.00	6 929 441.47	0.15
USD OWENS CORNING 3.40000% 16-15.08.26	1 600 000.00	1 441 763.11	0.03
USD PACKAGING CORP OF AMERICA 2.45000% 17-15.12.20	2 000 000.00	1 972 301.90	0.04
USD PEPSICO INC 2.00000% 17-15.04.21	2 620 000.00	2 589 078.34	0.06
USD PEPSICO INC 2.25000% 17-02.05.22	1 950 000.00	1 923 902.38	0.04
USD PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD-144A 5.50000% 15-15.07.22	4 800 000.00	4 800 720.00	0.11
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 6.25000% 14-17.03.24	285 000.00	300 783.50	0.01
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 6.12500% 17-17.01.22	39 000.00	40 989.39	0.00
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 5.29900% 18-27.01.25	1 390 000.00	1 387 359.00	0.03
USD PFIZER INC 3.20000% 18-15.09.23	2 850 000.00	2 892 056.88	0.06
USD PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 2.12500% 16-10.05.23	2 000 000.00	1 904 444.64	0.04
USD PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 2.00000% 17-21.02.20	2 155 000.00	2 136 415.92	0.05
USD PHILLIPS 66 PARTNERS LP 3.75000% 17-01.03.28	2 840 000.00	2 701 907.53	0.06
USD PITNEY BOWES INC 3.62500% 17-15.09.20	1 585 000.00	1 561 225.00	0.03
USD PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP 5.75000% 09-15.01.20	395 000.00	403 234.69	0.01
USD PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP 3.65000% 12-01.06.22	6 760 000.00	6 695 223.99	0.15
USD PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP 2.60000% 14-15.12.19	3 000 000.00	2 979 211.89	0.07
USD PNC BANK NATIONAL ASSOCIATION-SUB 3.80000% 13-25.07.23	7 755 000.00	7 867 681.70	0.17
USD PNC BANK NATIONAL ASSOCIATION-SUB 4.20000% 13-01.11.25	770 000.00	795 052.64	0.02
USD PPL CAPITAL FUNDING INC 3.95000% 14-15.03.24	4 880 000.00	4 918 679.37	0.11
USD PRINCIPAL FINANCIAL GROUP 3.40000% 15-15.05.25	2 747 000.00	2 702 572.38	0.06
USD PRINCIPAL FINANCIAL GROUP 3.10000% 16-15.11.26	1 500 000.00	1 431 509.64	0.03
USD PROGRESS ENERGY INC 4.40000% 11-15.01.21	5 000 000.00	5 100 827.00	0.11
USD PSEG POWER LLC 3.00000% 16-15.06.21	3 765 000.00	3 715 985.72	0.08
USD PUBLIC SERVICE CO OF NEW MEXICO 3.85000% 15-01.08.25	1 000 000.00	996 476.62	0.02
USD PULTEGROUP INC 5.00000% 16-15.01.27	445 000.00	428 173.44	0.01
USD QATAR, STATE OF-144A 3.87500% 18-23.04.23	1 819 000.00	1 853 106.25	0.04
USD QUALCOMM INC 2.60000% 17-30.01.23	6 885 000.00	6 714 433.77	0.15
USD QUEST DIAGNOSTICS INC 3.45000% 16-01.06.26	2 110 000.00	2 010 305.85	0.04
USD QUESTAR MARKET RESOURCES INC 6.87500% 10-01.03.21	3 037 000.00	3 143 902.40	0.07
USD QWEST CORP 6.75000% 11-01.12.21	1 090 000.00	1 164 959.30	0.03

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD RABOBANK NEDERLAND NV-SUB 4.37500% 15-04.08.25	5 870 000.00	5 945 833.35	0.13
USD RABOBANK NEDERLAND-SUB 4.62500% 13-01.12.23	5 000 000.00	5 127 431.50	0.11
USD RAYMOND JAMES FINANCIAL INC 5.62500% 12-01.04.24	2 000 000.00	2 165 045.80	0.05
USD REALTY INCOME CORP 3.25000% 12-15.10.22	2 000 000.00	1 991 719.92	0.04
USD REALTY INCOME CORP 3.87500% 18-15.04.25	4 535 000.00	4 564 126.03	0.10
USD REALTY INCOME CORP 4.12500% 14-15.10.26	1 000 000.00	1 017 717.40	0.02
USD REGENCY CENTERS LP 3.75000% 14-15.06.24	360 000.00	358 174.93	0.01
USD REGIONS FINANCIAL CORP 3.80000% 18-14.08.23	4 735 000.00	4 773 976.16	0.10
USD REPUBLIC SERVICES INC 2.90000% 16-01.07.26	2 445 000.00	2 322 763.11	0.05
USD REPUBLIC SERVICES INC 3.95000% 18-15.05.28	1 944 000.00	1 977 350.10	0.04
USD REPUBLIC SERVICES INC 5.50000% 10-15.09.19	1 000 000.00	1 014 977.10	0.02
USD REYNOLDS GROUP INC/LLC/LUX 5.75000% 12-15.10.20	480 000.00	466 939.35	0.01
USD RIO TINTO FINANCE USA LTD 3.75000% 15-15.06.25	3 370 000.00	3 435 748.70	0.08
USD ROCKWELL COLLINS INC 2.80000% 17-15.03.22	2 215 000.00	2 169 596.79	0.05
USD ROGERS COMMUNICATIONS INC 3.62500% 15-15.12.25	1 520 000.00	1 499 219.63	0.03
USD ROGERS COMMUNICATIONS INC 2.90000% 16-15.11.26	2 000 000.00	1 869 960.74	0.04
USD ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC-SUB 6.10000% 13-10.06.23	3 145 000.00	3 298 570.04	0.07
USD ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC 3.87500% 16-12.09.23	4 075 000.00	4 002 841.49	0.09
USD ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC-SUB 6.12500% 12-15.12.22	2 586 000.00	2 718 104.26	0.06
USD ROYAL BANK OF SCOTLAND PLC-SUB 5.12500% 14-28.05.24	2 115 000.00	2 124 194.12	0.05
USD ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD 2.65000% 17-28.11.20	1 980 000.00	1 951 945.18	0.04
USD SALESFORCE.COM INC 3.25000% 18-11.04.23	5 382 000.00	5 466 897.82	0.12
USD SANDS CHINA LTD 4.60000% 19-08.08.23	800 000.00	803 119.04	0.02
USD SANTANDER HOLDINGS USA INC 4.40000% 18-13.07.27	4 500 000.00	4 401 364.82	0.10
USD SANTANDER HOLDINGS USA INC 3.40000% 18-18.01.23	1 840 000.00	1 809 716.58	0.04
USD SANTANDER UK GROUP HOLD PLC 2.87500% 15-16.10.20	2 500 000.00	2 477 307.58	0.05
USD SANTANDER UK GROUP HOLD PLC 3.57100% 17-10.01.23	6 370 000.00	6 238 013.79	0.14
USD SANTANDER UK PLC 3.40000% 18-01.06.21	2 820 000.00	2 822 542.51	0.06
USD SASOL FINANCING USA LLC 5.87500% 18-27.03.24	3 010 000.00	3 100 300.00	0.07
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-144A 4.37500% 19-16.04.29	1 068 000.00	1 085 355.00	0.02
USD SCENTRE GROUP TRUST 1 / 2-144A 2.37500% 14-05.11.19	3 800 000.00	3 776 731.61	0.08
USD SEMGRP/ROSE ROCK FIN CORP 5.62500% 15-15.11.23	2 816 000.00	2 618 880.00	0.06
USD SEMPRA ENERGY 2.90000% 18-01.02.23	2 385 000.00	2 316 966.28	0.05
USD SEMPRA ENERGY 3.40000% 18-01.02.28	5 487 000.00	5 123 684.27	0.11
USD SEMPRA ENERGY 9.80000% 08-15.02.19	2 220 000.00	2 224 765.46	0.05
USD SENIOR HOUSING PROPERTIES TRUST 6.75000% 10-15.04.20	820 000.00	831 943.79	0.02
USD SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 3.50000% 18-13.11.23	2 600 000.00	2 669 182.88	0.06
USD SHIRE ACQUISITIONS INVT IRELAND DAC 1.90000% 16-23.09.19	3 100 000.00	3 075 881.97	0.07
USD SHIRE ACQUISITIONS INVT IRELAND DAC 2.40000% 16-23.09.21	8 705 000.00	8 472 116.96	0.19
USD SHIRE ACQUISITIONS INVT IRELAND DAC 2.87500% 16-23.09.23	3 005 000.00	2 888 425.50	0.06
USD SHIRE ACQUISITIONS INVT IRELAND DAC 3.20000% 16-23.09.26	3 015 000.00	2 807 404.50	0.06
USD SIMON PROPERTY GROUP LP 3.30000% 16-15.01.26	1 700 000.00	1 668 038.54	0.04
USD SIMON PROPERTY GROUP LP 2.62500% 17-15.06.22	850 000.00	834 322.44	0.02
USD SK TELECOM CO LTD-144A 3.75000% 18-16.04.23	2 505 000.00	2 512 965.15	0.06
USD SOUTHERN CO 2.75000% 15-15.06.20	3 200 000.00	3 189 355.11	0.07
USD SOUTHERN CO 3.25000% 16-01.07.26	615 000.00	587 038.31	0.01
USD SOUTHERN CO GAS CAPITAL CORP 3.25000% 16-15.06.26	1 665 000.00	1 565 204.39	0.03
USD SOUTHERN POWER CO 1.95000% 16-15.12.19	2 400 000.00	2 378 646.91	0.05
USD SOUTHWEST GAS CORP 3.70000% 18-01.04.28	1 250 000.00	1 249 856.20	0.03
USD SOUTHWESTERN ELECTRIC POWER 3.55000% 12-15.02.22	1 000 000.00	1 000 605.30	0.02
USD SPECTRA ENERGY PARTNERS LP 3.50000% 15-15.03.25	900 000.00	880 807.47	0.02
USD SPIRE INC 3.54300% 17-27.02.24	1 500 000.00	1 473 198.00	0.03
USD SPIRIT REALTY LP 4.45000% 17-15.09.26	4 565 000.00	4 390 796.35	0.10
USD SPRINGLEAF FINANCE CORP 7.12500% 18-15.03.26	3 000 000.00	2 857 500.00	0.06
USD SPRINT CORP 7.62500% 18-01.03.26	163 000.00	169 316.25	0.00
USD STANDARD CHARTERED PLC-144A-SUB 3.95000% 13-11.01.23	1 009 000.00	1 005 946.29	0.02
USD STARBUCKS CORP 3.80000% 18-15.08.25	4 368 000.00	4 403 835.07	0.10
USD STATE STREET CORP-SUB 3.10000% 13-15.05.23	1 900 000.00	1 892 721.71	0.04
USD STRYKER CORP 2.62500% 16-15.03.21	1 323 000.00	1 310 322.26	0.03

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD STRYKER CORP 3.50000% 16-15.03.26	1 000 000.00	990 052.24	0.02
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 2.78400% 17-12.07.22	5 150 000.00	5 055 961.00	0.11
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 3.10200% 18-17.01.23	4 090 000.00	4 042 310.60	0.09
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 3.74800% 18-19.07.23	2 740 000.00	2 779 813.03	0.06
USD SUNOCO LOGISTICS PARTNERS OPERATIONS LP 4.00000% 17-01.10.27	1 000 000.00	948 473.96	0.02
USD SUNTRUST BANK 4.05000% 18-03.11.25	5 250 000.00	5 387 040.75	0.12
USD SUZANO AUSTRIA GMBH-REG-S 6.00000% 19-15.01.29	2 620 000.00	2 741 175.00	0.06
USD SYNCHRONY BANK 3.00000% 17-15.06.22	5 000 000.00	4 780 229.10	0.11
USD SYNCHRONY FINANCIAL 4.25000% 14-15.08.24	1 225 000.00	1 195 845.22	0.03
USD SYNCHRONY FINANCIAL 4.50000% 15-23.07.25	4 550 000.00	4 427 897.34	0.10
USD T-MOBILE USA INC 4.75000% 18-01.02.28	56 000.00	53 690.00	0.00
USD T-MOBILE USA INC 6.50000% 13-15.01.24	657 000.00	679 995.00	0.02
USD TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD-144A 4.40000% 18-26.11.23	2 853 000.00	2 928 205.08	0.06
USD TAQA ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO-144A 4.37500% 18-23.04.25	2 229 000.00	2 267 896.05	0.05
USD TD AMERITRADE HOLDING COPR 3.75000% 18-01.04.24	5 000 000.00	5 108 013.00	0.11
USD TELEFLEX INC 4.62500% 17-15.11.27	172 000.00	167 700.00	0.00
USD TELEFONICA EMISIONES SAU 5.46200% 11-16.02.21	1 700 000.00	1 775 231.46	0.04
USD TELEFONICA EMISIONES SA 4.10300% 17-08.03.27	3 980 000.00	3 957 625.88	0.09
USD TENET HEALTHCARE CORP 4.62500% 17-15.07.24	225 000.00	220 383.00	0.00
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 2.20000% 16-21.07.21	5 940 000.00	5 614 691.39	0.12
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 3.15000% 16-01.10.26	6 750 000.00	5 604 536.00	0.12
USD TEXAS INSTRUMENTS INC 2.90000% 17-03.11.27	2 019 000.00	1 963 224.27	0.04
USD THE HERSHEY CO 3.10000% 18-15.05.21	2 015 000.00	2 023 778.95	0.04
USD THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 3.00000% 16-15.04.23	2 000 000.00	1 971 637.18	0.04
USD TIME WARNER CABLE LLC 5.00000% 09-01.02.20	1 000 000.00	1 014 745.80	0.02
USD TIME WARNER INC 2.95000% 16-15.07.26	1 095 000.00	1 011 712.33	0.02
USD TIME WARNER INC 3.55000% 14-01.06.24	3 300 000.00	3 280 193.96	0.07
USD TIME WARNER INC 3.80000% 16-15.02.27	2 100 000.00	2 048 438.53	0.04
USD TIME WARNER INC 3.87500% 15-15.01.26	1 000 000.00	986 045.14	0.02
USD TIME WARNER INC 4.05000% 13-15.12.23	1 800 000.00	1 845 442.98	0.04
USD TIME WARNER INC 4.70000% 10-15.01.21	1 850 000.00	1 904 947.22	0.04
USD TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.75000% 14-10.04.24	1 200 000.00	1 240 366.56	0.03
USD TOTAL CAPITAL SA 3.88300% 18-11.10.28	4 405 000.00	4 598 480.82	0.10
USD TOTAL SYSTEM SERVICES INC 3.80000% 16-01.04.21	2 515 000.00	2 522 311.36	0.06
USD TRANSCANADA PIPELINES LTD 2.50000% 12-01.08.22	1 950 000.00	1 898 681.15	0.04
USD TRANSCANADA PIPELINES LTD 4.25000% 18-15.05.28	2 482 000.00	2 532 565.29	0.06
USD TRANSOCEAN PROTEUS LTD-144A 6.25000% 16-01.12.24	150 000.00	120 597.60	0.00
USD TRIMBLE INC 4.15000% 18-15.06.23	1 460 000.00	1 457 354.69	0.03
USD TRINITY ACQUISITION PLC 4.40000% 16-15.03.26	700 000.00	700 162.05	0.02
USD TUCSON ELECTRIC POWER CO 5.15000% 11-15.11.21	220 000.00	228 739.81	0.01
USD TYCO ELECTRONICS GROUP SA 3.45000% 14-01.08.24	690 000.00	685 186.53	0.02
USD TYSON FOODS INC 3.90000% 18-28.09.23	1 000 000.00	1 013 804.70	0.02
USD TYSON FOODS INC 3.95000% 14-15.08.24	2 000 000.00	2 017 299.00	0.04
USD UBS GROUP FUNDING SWISS AG-144A 4.12500% 16-15.04.26	2 000 000.00	2 012 232.20	0.04
USD UBS GROUP FUNDING SWISS AG-REG-S 4.12500% 15-24.09.25	2 100 000.00	2 125 007.85	0.05
USD UBS GROUP FUNDING SWISS AG-REG-S 3.00000% 16-15.04.21	2 500 000.00	2 485 755.83	0.05
USD UDR INC 3.70000% 13-01.10.20	2 000 000.00	2 010 655.40	0.04
USD UNILEVER CAPITAL CORP 2.75000% 18-22.03.21	2 740 000.00	2 732 452.04	0.06
USD UNION ELECTRIC CO 2.95000% 17-15.06.27	1 555 000.00	1 486 267.39	0.03
USD UNION PACIFIC CORP 1.80000% 15-01.02.20	1 800 000.00	1 779 802.88	0.04
USD UNION PACIFIC CORP 3.95000% 18-10.09.28	3 780 000.00	3 874 462.20	0.09
USD UNITED AIRLINES 2014-2 CLAS A PAS THR 3.75000% 14-03.09.26	4 500 000.00	3 655 526.62	0.08
USD UNITED TECHNOLOGIES CORP 2.30000% 17-04.05.22	1 950 000.00	1 886 867.19	0.04
USD UNITED TECHNOLOGIES CORP 3.65000% 18-16.08.23	2 970 000.00	3 014 297.25	0.07
USD UNITED TECHNOLOGIES CORP 3.95000% 18-16.08.25	5 637 000.00	5 767 414.81	0.13
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 3.37500% 17-15.04.27	2 315 000.00	2 308 270.32	0.05
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 3.85000% 18-15.06.28	4 361 000.00	4 522 780.45	0.10
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 3.50000% 18-15.02.24	2 830 000.00	2 878 070.95	0.06
USD UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC-REG-S 4.75000% 16-01.08.22	2 000 000.00	2 020 000.00	0.04

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD VALE OVERSEAS LTD 6.25000% 16-10.08.26	1 805 000.00	1 924 581.25	0.04
USD VALERO ENERGY CORP 3.40000% 16-15.09.26	823 000.00	784 417.96	0.02
USD VENTAS REALITY LP 3.75000% 14-01.05.24	535 000.00	533 847.11	0.01
USD VENTAS REALITY LP 3.12500% 16-15.06.23	2 805 000.00	2 741 048.83	0.06
USD VENTAS REALITY LP 3.85000% 17-01.04.27	850 000.00	831 001.02	0.02
USD VEREIT OPERATING PARTNERSHIP LP 4.87500% 16-01.06.26	2 920 000.00	2 968 729.25	0.07
USD VEREIT OPERATING PARTNERSHIP LP 3.95000% 17-15.08.27	1 500 000.00	1 424 436.83	0.03
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 4.15000% 14-15.03.24	2 900 000.00	3 011 838.79	0.07
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.50000% 14-01.11.24	3 465 000.00	3 496 952.84	0.08
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 4.27200% 15-15.01.36	1 500 000.00	1 459 985.15	0.03
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.62500% 16-15.08.26	1 200 000.00	1 120 886.18	0.02
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 4.12500% 17-16.03.27	2 600 000.00	2 667 091.96	0.06
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 4.50000% 17-10.08.33	805 000.00	818 389.16	0.02
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.37600% 18-15.02.25	5 590 000.00	5 582 084.78	0.12
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 4.32900% 18-21.09.28	3 329 000.00	3 444 071.87	0.08
USD VIACOM INC 2.25000% 16-04.02.22	921 000.00	872 529.46	0.02
USD VIACOM INC 3.87500% 14-01.04.24	1 400 000.00	1 379 365.17	0.03
USD VISA INC 2.15000% 17-15.09.22	1 000 000.00	978 160.88	0.02
USD VISA INC 2.20000% 15-14.12.20	2 055 000.00	2 041 667.16	0.04
USD VMWARE INC 2.95000% 17-21.08.22	663 000.00	642 665.55	0.01
USD VODAFONE GROUP PLC 2.95000% 13-19.02.23	2 075 000.00	2 026 567.05	0.04
USD VODAFONE GROUP PLC 4.37500% 18-30.05.28	4 241 000.00	4 223 225.79	0.09
USD VORNADO REALTY LP 3.50000% 17-15.01.25	4 600 000.00	4 440 998.37	0.10
USD VOYA FINANCIAL INC 3.12500% 17-15.07.24	2 000 000.00	1 908 015.86	0.04
USD WABTEC CORP/DE 4.15000% 18-15.03.24	8 286 000.00	8 058 433.38	0.18
USD WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC 3.80000% 14-18.11.24	2 500 000.00	2 495 559.17	0.05
USD WALMART INC 3.40000% 18-26.06.23	5 548 000.00	5 685 595.95	0.12
USD WALMART INC 3.70000% 18-26.06.28	5 540 000.00	5 713 942.15	0.13
USD WELLCARE HEALTH PLANS INC 5.25000% 17-01.04.25	400 000.00	406 000.00	0.01
USD WELLS FARGO & CO 3.00000% 16-22.04.26	2 000 000.00	1 916 947.88	0.04
USD WELLS FARGO & CO 3.00000% 16-23.10.26	6 065 000.00	5 797 401.41	0.13
USD WELLS FARGO & CO 3.06900% 17-24.01.23	4 330 000.00	4 306 352.65	0.09
USD WELLS FARGO & CO-SUB 4.12500% 13-15.08.23	6 520 000.00	6 649 105.12	0.15
USD WELLS FARGO BANK NA 1.75000% 16-24.05.19	5 000 000.00	4 985 389.60	0.11
USD WELLS FARGO CO 3.50000% 12-08.03.22	5 000 000.00	5 056 364.00	0.11
USD WELLTOWER INC 3.95000% 18-01.09.23	4 700 000.00	4 736 435.81	0.10
USD WELLTOWER INC 4.00000% 15-01.06.25	3 467 000.00	3 471 273.08	0.08
USD WELLTOWER INC 4.12500% 12-01.04.19	1 000 000.00	1 000 767.40	0.02
USD WELLTOWER INC 4.95000% 10-15.01.21	1 990 000.00	2 042 448.64	0.04
USD WESTERN GAS PARTNERS LP 4.65000% 16-01.07.26	3 995 000.00	3 935 937.96	0.09
USD WESTERN GAS PARTNERS LP 4.75000% 18-15.08.28	1 693 000.00	1 654 536.64	0.04
USD WESTROCK MIV LLC 7.37500% 09-01.09.19	1 780 000.00	1 822 520.28	0.04
USD WEYERHAEUSER CO 3.25000% 12-15.03.23	2 400 000.00	2 359 540.70	0.05
USD WILLIAMS COS INC/THE LP 3.35000% 12-15.08.22	1 000 000.00	990 813.07	0.02
USD WILLIAMS COS INC/THE 4.50000% 13-15.11.23	3 300 000.00	3 390 477.09	0.07
USD WILLIAMS COS INC/THE 4.30000% 14-04.03.24	3 620 000.00	3 709 185.58	0.08
USD WILLIS NORTH AMERICA INC 3.60000% 17-15.05.24	2 600 000.00	2 547 813.53	0.06
USD WILLIS TOWERS WATSON PLC 5.75000% 11-15.03.21	600 000.00	627 563.64	0.01
USD WOODSIDE FINANCE LTD-REG-S 3.70000% 17-15.03.28	2 175 000.00	2 011 657.50	0.04
USD WR BERKLEY CORP 4.62500% 12-15.03.22	2 220 000.00	2 287 105.28	0.05
USD YARA INTERNATIONAL ASA-REG-S 4.75000% 18-01.06.28	6 150 000.00	6 186 828.66	0.14
USD ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC 3.55000% 15-01.04.25	1 101 000.00	1 065 600.84	0.02
USD ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC 2.70000% 15-01.04.20	5 285 000.00	5 258 774.72	0.12
USD ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC 3.15000% 15-01.04.22	3 780 000.00	3 733 031.96	0.08
USD ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC 3.70000% 18-19.03.23	1 000 000.00	990 692.82	0.02
米ドル合計		2 054 133 421.41	45.10
ノート、固定利付債合計		2 054 133 421.41	45.10

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
ノート、変動利付債			
米ドル			
USD AEGON NV-SUB 5.500%/VAR 18-11.04.48	1 182 000.00	1 111 080.00	0.02
USD AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC-SUB 5.750%/VAR 18-01.04.48	2 917 000.00	2 727 395.00	0.06
USD ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 3M LIBOR+74BP 18-12.01.24	1 581 000.00	1 541 370.97	0.03
USD ASTRAZENECA PLC 3M LIBOR+66.5BP 18-17.08.23	5 805 000.00	5 680 059.28	0.12
USD BANK OF AMERICA CORP 3.093%/VAR 17-01.10.25	4 450 000.00	4 333 852.06	0.09
USD BANK OF AMERICA CORP 3.366%/VAR 18-23.01.26	12 185 000.00	12 003 080.88	0.26
USD BANK OF AMERICA CORP 3.550%/3M LIBOR+78BP 18-05.03.24	9 755 000.00	9 808 046.71	0.22
USD BARCLAYS PLC 4.610%/VAR 18-15.02.23	4 020 000.00	4 038 540.64	0.09
USD BAYER US FINANCE II LLC-144A 3M LIBOR+63BP 18-25.06.21	665 000.00	658 001.54	0.01
USD BNP PARIBAS-144A-SUB 7.625%/VAR 16-PRP	946 000.00	995 882.58	0.02
USD CITIGROUP INC 2.876%/VAR 17-24.07.23	6 900 000.00	6 772 547.55	0.15
USD CITIGROUP INC 3.142%/3M LIBOR+72.2BP 18-24.01.23	6 240 000.00	6 197 650.12	0.14
USD CITIGROUP INC 3.520%/VAR 17-27.10.28	5 010 000.00	4 834 951.40	0.11
USD CITIGROUP INC-SUB 5.950%/VAR 15-PRP	3 100 000.00	3 127 125.00	0.07
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-144A 2.997%/VAR 17-14.12.23	3 240 000.00	3 118 615.73	0.07
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-144A 3.869%/VAR 18-12.01.29	1 300 000.00	1 241 081.43	0.03
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-144A-SUB 7.500%/VAR 13-PRP	1 535 000.00	1 628 177.57	0.04
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S-SUB 6.250%/VAR 14-PRP	1 600 000.00	1 581 865.60	0.03
USD DISCOVER BANK-SUB 4.682%/VAR 18-09.08.28	2 158 000.00	2 148 591.12	0.05
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3M LIBOR+111BP 17-26.04.22	2 300 000.00	2 308 620.40	0.05
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.905%/VAR 17-24.07.23	11 480 000.00	11 234 335.57	0.25
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.876%/3M LIBOR+82.1BP 17-31.10.22	3 000 000.00	2 955 569.01	0.06
USD HSBC HOLDINGS PLC 3.950%/VAR 18-18.05.24	8 000 000.00	8 111 816.80	0.18
USD HSBC HOLDINGS PLC 4.583%/VAR 18-19.06.29	2 933 000.00	2 997 566.48	0.07
USD ING GROEP NV-SUB 6.000%/VAR 15-PRP	1 000 000.00	999 200.00	0.02
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.782%/VAR 17-01.02.28	6 635 000.00	6 608 588.52	0.14
USD JPMORGAN CHASE & CO 2.776%/VAR 17-25.04.23	4 485 000.00	4 421 100.68	0.10
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.540%/VAR 17-01.05.28	2 075 000.00	2 029 749.06	0.04
USD JPMORGAN CHASE & CO 4.452%/3M LIBOR+133BP 18-05.12.29	11 365 000.00	11 906 264.94	0.26
USD METLIFE INC-SUB 6.400%/3M LIBOR+220.5BP 06-15.12.66	4 500 000.00	4 815 000.00	0.11
USD MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 3.922%/VAR 18-11.09.24	14 385 000.00	14 608 542.90	0.32
USD MORGAN STANLEY 3.591%/VAR 17-22.07.28	360 000.00	351 353.29	0.01
USD MORGAN STANLEY 3.737%/VAR 18-24.04.24	9 765 000.00	9 876 054.42	0.22
USD MORGAN STANLEY 3M LIBOR+93BP 17-22.07.22	3 000 000.00	3 008 522.10	0.07
USD MORGAN STANLEY 3M LIBOR+80BP 17-14.02.20	2 050 000.00	2 050 000.00	0.04
USD NATIONWIDE BUIL SOC-144A 3.766%/3M LIBOR+106.4BP 18-08.03.24	12 400 000.00	12 182 824.41	0.27
USD PRINCIPAL FINANCIAL GROUP-SUB 4.700%/VAR 15-15.05.55	2 686 000.00	2 638 995.00	0.06
USD PRUDENTIAL FINANCIAL-SUB 5.200%/3M LIBOR+304BP 13-15.03.44	1 074 000.00	1 047 150.00	0.02
USD RABOBANK NEDERLAND NV-144A-SUB 11.000000%/VAR 09-PRP	262 000.00	270 187.50	0.01
USD ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC-SUB 8.625%/VAR 16-PRP	2 900 000.00	3 087 630.00	0.07
USD ROYAL BK OF SCOTLAND GP PLC 4.519%/VAR 18-25.06.24	510 000.00	510 627.10	0.01
USD SOCIETE GENERALE SA-144A-SUB 7.375%/VAR 16-PRP	1 390 000.00	1 435 870.00	0.03
USD STANDARD CHARTERED PLC-144A-SUB 6.409%/3M LIBOR+151BP 06-PRP	200 000.00	154 500.00	0.00
USD TYSON FOODS INC 3M LIBOR+45BP 17-30.05.19	2 480 000.00	2 478 028.52	0.05
USD UBS GROUP FUNDING SWISS AG-144A 2.859%/VAR 17-15.08.23	1 960 000.00	1 907 006.19	0.04
USD VULCAN MATERIALS CO 3M LIBOR+65BP 18-01.03.21	805 000.00	799 950.14	0.02
USD WPP FINANCE UK 4.750%/RATING LINKED 12-21.11.21	5 708 000.00	5 833 366.52	0.13
米ドル合計		194 176 334.73	4.26
ノート、変動利付債合計		194 176 334.73	4.26

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
中期債券、固定利付債			
米ドル			
USD AIA GROUP LTD-144A 2.25000% 14-11.03.19	408 000.00	407 490.00	0.01
USD AMERICAN EXPRESS CREDIT CORP 2.70000% 17-03.03.22	2 275 000.00	2 253 765.95	0.05
USD AMERICAN HONDA FINANCE CORP 2.60000% 17-16.11.22	2 410 000.00	2 351 310.25	0.05
USD AMERICAN HONDA FINANCE CORP 3.55000% 19-12.01.24	4 330 000.00	4 390 571.50	0.10
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 4.20000% 14-26.08.24	2 515 000.00	2 574 435.99	0.06
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 4.45000% 16-03.03.26	10 545 000.00	10 813 877.47	0.24
USD BANK OF AMERICA CORP 2.62500% 16-19.04.21	875 000.00	868 672.11	0.02
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 4.18300% 16-25.11.27	4 650 000.00	4 644 851.05	0.10
USD BANK OF MONTREAL 3.10000% 18-13.04.21	6 540 000.00	6 566 218.21	0.14
USD BANK OF NEW YORK MELLON CORP 2.80000% 16-04.05.26	2 000 000.00	1 920 230.66	0.04
USD BANK OF NEW YORK MELLON CORP 2.20000% 16-16.08.23	2 000 000.00	1 929 213.56	0.04
USD BANK OF NEW YORK MELLON CORP 3.25000% 14-11.09.24	365 000.00	365 571.27	0.01
USD BANK OF NEW YORK MELLON CORP 2.95000% 18-29.01.23	3 550 000.00	3 545 607.51	0.08
USD BANK OF NEW YORK MELLON CORP 3.50000% 18-28.04.23	2 500 000.00	2 539 819.75	0.06
USD BANK OF NEW YORK MELLON CORP 3.45000% 18-11.08.23	5 930 000.00	6 026 230.26	0.13
USD BB&T CORP 3.20000% 18-03.09.21	2 325 000.00	2 334 951.93	0.05
USD CATERPILLAR FINANCIAL SERVICES CORP 3.15000% 18-07.09.21	1 650 000.00	1 658 814.80	0.04
USD CATERPILLAR FINANCIAL SERVICES CORP 3.65000% 18-07.12.23	2 115 000.00	2 166 597.54	0.05
USD CITIZENS BANK NA/PROVIDENCE RI 2.55000% 16-13.05.21	3 650 000.00	3 598 932.92	0.08
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 3.37500% 18-12.05.21	689 000.00	671 854.07	0.01
USD DP WORLD CRESCENT LTD-REG-S 4.84800% 18-26.09.28	4 700 000.00	4 735 250.00	0.10
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 4.00000% 14-03.03.24	3 600 000.00	3 672 249.84	0.08
USD HYUNDAI CAPITAL SERVICES INC-144A 1.62500% 16-30.08.19	2 000 000.00	1 981 259.80	0.04
USD ICBCIL FINANCE CO LTD-REG-S 2.37500% 16-19.05.19	8 680 000.00	8 649 948.97	0.19
USD JOHN DEERE CAPITAL CORP 3.12500% 18-10.09.21	991 000.00	998 228.75	0.02
USD JOHN DEERE CAPITAL CORP 3.20000% 19-10.01.22	1 570 000.00	1 588 908.92	0.04
USD MORGAN STANLEY 3.12500% 18-23.01.23	7 100 000.00	7 050 965.05	0.15
USD MORGAN STANLEY 3.12500% 16-27.07.26	2 200 000.00	2 110 074.47	0.05
USD MORGAN STANLEY 3.87500% 16-27.01.26	10 725 000.00	10 781 829.63	0.24
USD MORGAN STANLEY 4.00000% 15-23.07.25	3 260 000.00	3 339 077.49	0.07
USD MORGAN STANLEY-SUB 3.95000% 15-23.04.27	1 600 000.00	1 561 234.63	0.03
USD MORGAN STANLEY-SUB 4.35000% 14-08.09.26	7 435 000.00	7 522 967.20	0.17
USD MORGAN STANLEY-SUB 4.10000% 13-22.05.23	500 000.00	510 722.20	0.01
USD PNC BANK NATIONAL ASSOCIATION 2.15000% 16-29.04.21	3 000 000.00	2 944 087.53	0.06
USD PUBLIC SERVICE ELECTRIC & GAS CO 3.00000% 17-15.05.27	455 000.00	438 579.29	0.01
USD PUBLIC SERVICE ELECTRIC & GAS CO 3.70000% 18-01.05.28	835 000.00	847 425.55	0.02
USD PUBLIC SERVICE ELECTRIC & GAS CO 3.65000% 18-01.09.28	4 335 000.00	4 399 722.42	0.10
USD US BANCORP 2.62500% 17-24.01.22	2 455 000.00	2 450 478.09	0.05
USD WALT DISNEY CO/THE 1.80000% 17-05.06.20	2 000 000.00	1 976 731.52	0.04
USD WELLS FARGO & CO 2.62500% 17-22.07.22	8 215 000.00	8 059 517.82	0.18
USD WELLS FARGO & CO 3.30000% 14-09.09.24	1 400 000.00	1 394 322.53	0.03
USD WELLS FARGO & CO 3.75000% 19-24.01.24	4 795 000.00	4 878 669.39	0.11
USD WELLS FARGO & CO 4.15000% 19-24.01.29	4 242 000.00	4 356 380.44	0.10
米ドル合計		147 877 648.33	3.25
中期債券、固定利付債合計		147 877 648.33	3.25
中期債券、変動利付債			
米ドル			
USD BANK OF AMERICA CO 3.705%/VAR 17-24.04.28	290 000.00	285 931.71	0.01
USD BANK OF AMERICA CORP 3.824%/VAR 17-20.01.28	2 910 000.00	2 900 627.82	0.06
USD BANK OF AMERICA CORP 3.593%/VAR 17-21.07.28	16 480 000.00	16 147 353.17	0.36
USD BANK OF AMERICA CORP 3.970%/3M LIBOR+107BP 18-05.03.29	1 000 000.00	1 004 669.60	0.02
USD BANK OF NEW YORK MELLON CORP 2.661%/VAR 17-16.05.23	1 360 000.00	1 343 027.87	0.03

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD NORDEA BANK ABP-144A-SUB 5.500%/VAR 14-PRP	1 470 000.00	1 464 487.50	0.03
USD ROYAL BANK OF SC PLC-SUB 7.64000%/3M LIBOR+232BP 07-PRP	700 000.00	658 000.00	0.01
USD WELLS FARGO & CO 3.584%/VAR 17-22.05.28	4 350 000.00	4 307 349.33	0.10
米ドル合計		28 111 447.00	0.62
中期債券、変動利付債合計		28 111 447.00	0.62
債券、固定利付債			
米ドル			
USD 21ST CENTURY FOX AMERICA INC 7.75000% 94-20.01.24	478 000.00	569 871.50	0.01
USD ACE CAPITAL TRUST II-SUB 9.70000% 00-01.04.30	779 000.00	1 051 650.00	0.02
USD ANDEAVR LOGIST LP/TESRO LOGIST FIN CORP 3.50000% 17-01.12.22	2 470 000.00	2 445 200.63	0.05
USD BAIDU INC 3.87500% 18-29.09.23	3 000 000.00	3 007 335.00	0.07
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 8.05000% 97-15.06.27	281 000.00	342 321.56	0.01
USD BP CAPITAL MARKETS PLC 2.52100% 14-15.01.20	1 480 000.00	1 475 453.96	0.03
USD BRANCH BANKING & TRUST CO-SUB 3.80000% 14-30.10.26	4 000 000.00	4 022 246.80	0.09
USD BURLINGTON NORTHERN SANTA FE CORP 3.00000% 15-01.04.25	2 000 000.00	1 979 586.18	0.04
USD CITIGROUP INC-SUB 4.30000% 14-20.11.26	2 965 000.00	2 967 664.05	0.07
USD COMCAST CORP 3.37500% 14-15.02.25	5 940 000.00	5 962 019.58	0.13
USD COMMONWEALTH EDISON CO 3.70000% 18-15.08.28	520 000.00	526 317.63	0.01
USD DISCOVER BANK 4.25000% 14-13.03.26	500 000.00	497 390.03	0.01
USD DTE ENERGY CO 3.80000% 17-15.03.27	2 000 000.00	1 974 431.44	0.04
USD DUKE REALTY LP 3.87500% 13-15.02.21	1 000 000.00	1 009 303.70	0.02
USD ENERGY TRANSFER LP/REGENCY FIN CORP 5.87500% 14-01.03.22	330 000.00	348 766.37	0.01
USD ENERGY TRANSFER PARTNERS LP 4.20000% 17-15.04.27	790 000.00	760 083.95	0.02
USD ENTERGY ARKANSAS INC 3.05000% 13-01.06.23	1 035 000.00	1 022 811.23	0.02
USD ENTERGY LOUISIANA LLC 3.25000% 16-01.04.28	2 875 000.00	2 778 336.95	0.06
USD ENTERGY LOUISIANA LLC 4.00000% 18-15.03.33	465 000.00	473 328.57	0.01
USD ENTERGY TEXAS INC 4.00000% 19-30.03.29	3 895 000.00	3 899 780.72	0.09
USD EQUIFAX INC 3.95000% 18-15.06.23	900 000.00	905 482.53	0.02
USD EVERSOURCE ENERGY 2.75000% 17-15.03.22	1 270 000.00	1 253 061.59	0.03
USD EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO 4.50000% 16-25.02.26	2 470 000.00	2 551 047.12	0.06
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 4.35000% 17-17.01.27	10 950 000.00	10 251 010.37	0.23
USD GLENCORE FUNDING LLC-REG-S 4.62500% 14-29.04.24	1 165 000.00	1 182 358.50	0.03
USD HCA INC 5.37500% 15-01.02.25	154 000.00	158 957.26	0.00
USD HCP INC 4.00000% 15-01.12.22	1 240 000.00	1 247 583.71	0.03
USD HEATHROW FUNDING LTD-144A 4.87500% 11-15.07.21	2 183 000.00	2 241 035.49	0.05
USD INTERSTATE POWER & LIGHT CO 3.25000% 14-01.12.24	2 225 000.00	2 195 036.53	0.05
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.87500% 14-01.02.24	2 055 000.00	2 111 656.96	0.05
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 5.30000% 15-PRP	333 000.00	337 995.00	0.01
USD KERR-MCGEE CORP 6.95000% 04-01.07.24	665 000.00	751 087.24	0.02
USD KROGER CO 3.70000% 17-01.08.27	925 000.00	889 348.96	0.02
USD MICROSOFT CORP 2.00000% 16-08.08.23	2 275 000.00	2 209 906.95	0.05
USD MICROSOFT CORP 2.40000% 16-08.08.26	1 485 000.00	1 416 142.50	0.03
USD MIZUHO FINANCE GROUP CAYMAN 3-144A-SUB 4.60000% 14-27.03.24	2 000 000.00	2 039 827.00	0.04
USD PETRO-CANADA 7.87500% 96-15.06.26	4 500 000.00	5 370 366.60	0.12
USD PNC BANK NATIONAL ASSOCIATION-SUB 2.70000% 12-01.11.22	2 135 000.00	2 090 556.09	0.05
USD REYNOLDS AMERICAN INC 4.00000% 15-12.06.22	1 230 000.00	1 239 212.94	0.03
USD REYNOLDS AMERICAN INC 4.45000% 15-12.06.25	4 230 000.00	4 261 567.64	0.09
USD ROYAL BANK OF CANADA 2.35000% 15-30.10.20	5 000 000.00	4 951 899.50	0.11
USD SABIC CAPITAL II BV-REG-S 4.00000% 18-10.10.23	1 650 000.00	1 666 500.00	0.04
USD SANTANDER HOLDINGS USA INC 3.70000% 18-28.03.22	3 750 000.00	3 745 386.53	0.08
USD SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 3.25000% 15-11.05.25	2 000 000.00	2 019 404.00	0.04
USD SOUTH CAROLINA ELECTRIC & GAS CO 3.50000% 18-15.08.21	5 855 000.00	5 930 290.03	0.13
USD SOUTH CAROLINA ELECTRIC & GAS CO 4.25000% 18-15.08.28	1 000 000.00	1 047 260.90	0.02
USD SOUTHERN CALIFORNIA EDISON 3.40000% 18-01.06.23	1 069 000.00	1 050 090.56	0.02
USD SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 3.70000% 18-01.08.25	1 048 000.00	1 024 613.20	0.02

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD SOUTHWESTERN PUBLIC SERVICE CO 3.30000% 14-15.06.24	2 500 000.00	2 505 181.00	0.06
USD SPRINT CAPITAL CORPORATION 6.87500% 98-15.11.28	129 000.00	128 032.50	0.00
USD SUNTORY HOLDINGS LTD-144A 2.55000% 14-29.09.19	2 000 000.00	1 988 580.00	0.04
USD SYNCHRONY FINANCIAL 3.00000% 14-15.08.19	2 000 000.00	1 994 603.18	0.04
USD TOLEDO HOSPITAL 5.32500% 18-15.11.28	4 490 000.00	4 599 342.73	0.10
USD TOLEDO HOSPITAL 5.75000% 18-15.11.38	2 265 000.00	2 413 905.63	0.05
USD TOLEDO HOSPITAL 6.01500% 18-15.11.48	2 900 000.00	3 071 665.21	0.07
USD UBS GROUP FUNDING SWISS AG-REG-S 2.95000% 15-24.09.20	1 200 000.00	1 193 353.49	0.03
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 3.75000% 15-15.07.25	1 855 000.00	1 919 925.00	0.04
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 2.12500% 16-15.03.21	8 842 000.00	8 724 544.38	0.19
USD VODAFONE GROUP PLC 3.75000% 18-16.01.24	990 000.00	989 236.16	0.02
USD VODAFONE GROUP PLC 4.12500% 18-30.05.25	1 121 000.00	1 123 378.64	0.02
USD WESTAR ENERGY INC 2.55000% 16-01.07.26	2 500 000.00	2 348 347.40	0.05
USD WILLIAMS COS INC/THE 3.60000% 15-15.03.22	5 806 000.00	5 810 990.84	0.13
米ドル合計		142 063 671.71	3.12
債券、固定利付債合計		142 063 671.71	3.12
債券、変動利付債			
米ドル			
USD AMERICAN EXPRESS CO-SUB 4.900%/VAR 15-PRP	1 036 000.00	1 025 640.00	0.02
USD BANCO SANTANDER SA-REG-S-SUB 6.375%/VAR 14-PRP	2 000 000.00	1 959 456.00	0.04
USD BANK OF NEW YORK MELLON CORP-SUB 4.950%/VAR 15-PRP	889 000.00	899 072.37	0.02
USD BARCLAYS BANK PLC-144A-SUB 6.860%/6M LIBOR+173BP 02-PRP	188 000.00	189 410.00	0.00
USD CITIGROUP INC-SUB 5.950%/3M LIBOR+406.8BP 12-PRP	2 225 000.00	2 219 437.50	0.05
USD CLOVERIE PLC VIA SWISS RE-REG-S-SUB 4.500%/VAR 14-11.09.44	1 200 000.00	1 161 420.00	0.03
USD DEMETER INVESTMENTS BV-REG-S-SUB 5.125%/VAR 18-01.06.48	3 030 000.00	2 974 551.00	0.07
USD DNB BANK ASA-REG-S-SUB 6.500%/VAR 16-PRP	2 545 000.00	2 564 087.50	0.06
USD GENERAL ELECTRIC CO-SUB 5.000%/3M LIBOR+333BP 16-PRP	3 392 000.00	2 968 000.00	0.06
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC-SUB 5.700%/VAR 14-PRP	126 000.00	126 189.00	0.00
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC-SUB 5.375%/3M LIBOR+392.2BP 15-PRP	810 000.00	812 025.00	0.02
USD ING GROEP NV-REG-S-SUB 6.875%/VAR 16-PRP	2 035 000.00	2 081 279.97	0.05
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 5.000%/VAR 14-PRP	121 000.00	120 395.00	0.00
USD LLOYDS BANKING GROUP-144A-SUB 6.657%/3M LIBOR+127BP 09-PRP	672 000.00	658 976.64	0.01
USD METLIFE INC-SUB 5.250%/3M LIBOR+357.5BP 15-PRP	2 330 000.00	2 336 990.00	0.05
USD MORGAN STANLEY-SUB 5.500%/3M LIBOR+3.81BP 15-PRP	868 000.00	872 340.00	0.02
USD QBE INSURANCE GROUP LTD-REG-S-SUB 6.750%/VAR 14-02.12.44	2 810 000.00	2 908 462.40	0.06
USD STANDARD CHARTERED PLC-144A-SUB 7.500%/VAR 16-PRP	1 690 000.00	1 757 600.00	0.04
USD SUNTRUST BANKS INC-SUB 5.625%/VAR 14-PRP	824 000.00	828 120.00	0.02
USD SVENSKA HANDELSBANKEN AB-REG-S-SUB 5.250%/VAR 15-PRP	1 470 000.00	1 451 625.00	0.03
USD SWEDBANK AB-REG-S-SUB 5.500%/VAR 15-PRP	1 400 000.00	1 394 509.20	0.03
USD SWEDBANK-REG-S-SUB 6.000%/VAR 16-PRP	2 400 000.00	2 394 000.00	0.05
USD WESTPAC BANKING CORP-SUB 4.322%/VAR 16-23.11.31	6 400 000.00	6 201 600.00	0.14
米ドル合計		39 905 186.58	0.87
債券、変動利付債合計		39 905 186.58	0.87
地方債、固定利付債			
米ドル			
USD OREGON, STATE OF 5.76200% 03-01.06.23	3 000 000.00	2 580 061.30	0.06
米ドル合計		2 580 061.30	0.06
地方債、固定利付債合計		2 580 061.30	0.06

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
転換社債、変動利付債			
米ドル			
USD BARCLAYS PLC-REG-S-SUB 7.875%/VAR 16-PRP	2 970 000.00	3 088 800.00	0.07
米ドル合計		3 088 800.00	0.07
転換社債、変動利付債合計		3 088 800.00	0.07
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品 合計		2 633 110 536.75	57.82
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
割引手形、ゼロ・クーポン			
米ドル			
USD FANNIE MAE DN 0.00000% 06.02.18-01.02.19	2 000 000.00	2 000 000.00	0.05
USD FEDERAL HOME LOAN BANK SYSTEM DN 0.00000% 26.02.18-25.02.19	1 500 000.00	1 497 610.01	0.03
米ドル合計		3 497 610.01	0.08
割引手形、ゼロ・クーポン合計		3 497 610.01	0.08
アセット・バック証券、変動利付債			
米ドル			
USD ALLEGRO CLO VII LTD-144A 3M LIBOR+110BP 18-13.06.31	3 500 000.00	3 454 475.50	0.08
USD CIFC FUNDING LTD-144A 3M LIBOR+105BP 18-24.04.30	1 500 000.00	1 488 834.15	0.03
USD ENCORE CREDIT RECEIVABLES TRUST 1M LIBOR+73.5BP 05-25.10.35	2 875 000.00	221 419.53	0.00
USD PALMER SQUARE CLO LTD-144A 3M LIBOR+110BP 18-16.07.31	3 500 000.00	3 459 455.30	0.08
USD PARK PLACE SECURITIES SR 2005-WCW1 1M LIBOR+45BP 05-25.09.35	2 800 000.00	35 300.11	0.00
USD ROMARK CLO II-144A 3M LIBOR+117.5BP 18-25.07.31	5 500 000.00	5 437 616.25	0.12
USD SHACKLETON 2014-V-R CLO LTD-144A 3M LIBOR+110BP 18-07.05.31	3 750 000.00	3 706 916.25	0.08
米ドル合計		17 804 017.09	0.39
アセット・バック証券、変動利付債合計		17 804 017.09	0.39
モーゲージ・バック証券、固定利付債			
米ドル			
USD CD 2017-CD4 MORTGAGE TRUST-SUB 3.24820% 17-01.05.50	5 000 000.00	4 934 580.50	0.11
USD FANNIE MAE 2.95000% 16-01.05.31	900 000.00	825 244.34	0.02
USD FANNIE MAE 3.12000% 15-01.10.27	765 000.00	758 558.87	0.02
USD FANNIE MAE 3.34000% 15-01.08.30	765 000.00	723 109.40	0.02
USD FANNIE MAE 3.53000% 15-01.12.30	940 000.00	912 260.15	0.02
USD FANNIE MAE 3.57000% 14-01.10.29	750 000.00	715 283.05	0.01
USD FANNIE MAE 3.63000% 16-01.02.31	860 000.00	839 191.03	0.02
USD JPMD COMRCIAL MOTGE SECURITIES TRST-SUB 3.04770% 17-01.10.50	3 000 000.00	2 951 333.10	0.06
USD MORGAN STANLEY BANK OF AMERICA ML 2.84000% 16-01.11.49	2 500 000.00	2 401 361.50	0.05
USD MORGAN STANLEY BK OF AMERICA MERRI TRT 3.29500% 17-01.05.50	5 000 000.00	4 986 230.50	0.11
USD MORGAN STANLEY CAPITAL I TRUST 3.15300% 17-01.06.50	2 800 000.00	2 785 882.12	0.06
米ドル合計		22 833 034.56	0.50
モーゲージ・バック証券、固定利付債合計		22 833 034.56	0.50

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
モーゲージ・バック証券、変動利付債			
米ドル			
USD AMERICAN HOME MORTGAGE INVESTMENT 6M LIBOR+200BP 05-01.06.45	29 470 000.00	2 074 642.14	0.05
USD BANC OF AMERICA FUND TRUST 1M LIBOR+30BP 05-20.05.35	16 952 000.00	943 071.35	0.02
USD WAMU MORTGAGE PASS-TH TRUST 1M LIBOR+27BP 05-25.12.45	12 000 000.00	1 399 326.56	0.03
米ドル合計		4 417 040.05	0.10
モーゲージ・バック証券、変動利付債合計		4 417 040.05	0.10
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD 1011778 BC ULC/NEW RED FINANCE INC-144A 4.25000% 17-15.05.24	466 000.00	450 855.00	0.01
USD 21ST CENTURY FOX AMERICA INC 3.70000% 15-15.09.24	1 600 000.00	1 632 989.92	0.04
USD 21ST CENTURY FOX AMERICA INC 3.00000% 13-15.09.22	8 850 000.00	8 843 168.86	0.19
USD ABBOTT LABORATORIES 2.90000% 16-30.11.21	8 350 000.00	8 343 087.70	0.18
USD ACTIVISION BLIZZARD INC 2.60000% 17-15.06.22	2 946 000.00	2 877 863.54	0.06
USD AEP TRANSMISSION CO LLC 3.10000% 17-01.12.26	150 000.00	145 463.96	0.00
USD AERCAP IRE CAP LTD/GLB AVIA TRUST 4.50000% 15-15.05.21	2 000 000.00	2 023 678.00	0.04
USD AERCAP IRE CAP LTD/GLB AVIA TRUST 3.50000% 17-15.01.25	2 380 000.00	2 220 500.95	0.05
USD AETNA INC 2.75000% 12-15.11.22	2 300 000.00	2 246 023.76	0.05
USD AIRCASTLE LTD 5.50000% 15-15.02.22	6 795 000.00	6 982 334.07	0.15
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC 3.90000% 13-15.06.23	1 680 000.00	1 696 200.74	0.04
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITY INC 2.75000% 14-15.01.20	1 692 000.00	1 685 600.13	0.04
USD ALLERGAN FINANCE LLC 3.25000% 12-01.10.22	979 000.00	968 713.07	0.02
USD ALLERGAN FUNDING SCS 3.85000% 14-15.06.24	5 637 000.00	5 654 005.14	0.12
USD ALLERGAN SALES LLC-144A 5.00000% 13-15.12.21	2 000 000.00	2 073 395.20	0.05
USD ALLIANT ENERGY FINANCE LLC-144A 3.75000% 18-15.06.23	3 900 000.00	3 924 743.94	0.09
USD ALPEK SA DE CV-144A 4.50000% 12-20.11.22	1 780 000.00	1 780 000.00	0.04
USD ALTRIA GROUP INC 2.85000% 12-09.08.22	2 555 000.00	2 499 295.48	0.05
USD AMAZON.COM INC 2.40000% 18-22.02.23	2 220 000.00	2 187 832.40	0.05
USD AMAZON.COM INC 2.80000% 18-22.08.24	1 950 000.00	1 936 080.55	0.04
USD AMAZON.COM INC 3.15000% 18-22.08.27	1 810 000.00	1 792 308.55	0.04
USD AMCOR FINANCE USA INC-144A 3.62500% 16-28.04.26	2 550 000.00	2 448 280.50	0.05
USD AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC 3.65000% 18-01.12.21	380 000.00	385 139.08	0.01
USD AMERICAN EXPRESS CO 2.50000% 17-01.08.22	2 225 000.00	2 173 987.18	0.05
USD AMERICAN TOWER CORP 5.00000% 13-15.02.24	4 958 000.00	5 234 361.90	0.11
USD AMERICAN TOWER CORP 3.12500% 16-15.01.27	2 599 000.00	2 422 611.04	0.05
USD AMERICAN TOWER CORP 3.00000% 17-15.06.23	1 760 000.00	1 720 227.78	0.04
USD AMERIPRISE FINANCIAL INC 7.30000% 09-28.06.19	2 900 000.00	2 949 574.34	0.06
USD ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC-144A 3.75000% 17-10.04.22	200 000.00	198 167.11	0.00
USD ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 4.75000% 19-23.01.29	9 184 000.00	9 531 269.99	0.21
USD ANTERO RESOURCES FIN CORP 5.12500% 14-01.12.22	1 446 000.00	1 444 192.50	0.03
USD APACHE CORP 3.25000% 12-15.04.22	4 122 000.00	4 081 896.69	0.09
USD ARC PROPERTIES OPERATING PSHIP LP/CLARK 4.60000% 14-06.02.24	13 850 000.00	14 033 031.91	0.31
USD ARCH CAPITAL FINANCE LLC 4.01100% 16-15.12.26	1 300 000.00	1 323 222.81	0.03
USD ARCHER-DANIELS MIDLAND CO 3.37500% 18-15.03.22	3 885 000.00	3 934 301.42	0.09
USD ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-144A 4.25000% 17-15.09.22	840 000.00	831 432.00	0.02
USD ARES CAPITAL CORP 3.62500% 16-19.01.22	5 595 000.00	5 502 734.08	0.12
USD ASTRAZENCA PLC 3.12500% 17-12.06.27	1 200 000.00	1 138 677.99	0.03
USD AT&T INC 4.12500% 16-17.02.26	4 085 000.00	4 122 359.77	0.09
USD ATMOS ENERGY CORP 3.00000% 17-15.06.27	1 500 000.00	1 453 307.29	0.03
USD AVALON BAY COMMUNITIES INC 2.95000% 12-15.09.22	1 800 000.00	1 775 700.18	0.04
USD AVIATION CAPITAL GROUP-144A 2.87500% 17-20.01.22	4 350 000.00	4 219 671.61	0.09
USD AXALTA COATING SYSTEMS LLC-144A 4.87500% 16-15.08.24	450 000.00	439 312.50	0.01
USD BACARDI LTD-144A 4.45000% 18-15.05.25	1 700 000.00	1 685 278.00	0.04
USD BAKER HUGHES A GE CO/ CO-OBLIGATOR 2.77300% 18-15.12.22	2 700 000.00	2 639 606.81	0.06

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD BANQUE FEDER DU CREDIT MUTUE-144A 2.20000% 17-20.07.20	2 385 000.00	2 353 770.60	0.05
USD BAYER US FINANCE II LLC-144A 3.87500% 18-15.12.23	4 480 000.00	4 473 973.73	0.10
USD BAYER US FINANCE II LLC-144A 4.37500% 18-15.12.28	930 000.00	912 318.26	0.02
USD BAYER US FINANCE LLC-144A 2.37500% 14-08.10.19	1 750 000.00	1 737 828.66	0.04
USD BECTON DICKINSON AND CO 3.73400% 14-15.12.24	3 767 000.00	3 754 931.18	0.08
USD BECTON DICKINSON AND CO 3.36300% 17-06.06.24	5 066 000.00	4 964 453.50	0.11
USD BERKSHIRE HATHAWAY ENERGY CO 3.25000% 18-15.04.28	3 585 000.00	3 469 470.04	0.08
USD BERRY PLASTICS CORP-144A 4.50000% 18-15.02.26	158 000.00	148 915.00	0.00
USD BMW US CAPITAL LLC-144A 3.40000% 18-13.08.21	2 750 000.00	2 760 516.55	0.06
USD BNP PARIBAS SA-144A 2.95000% 17-23.05.22	1 065 000.00	1 043 656.51	0.02
USD BNP PARIBAS-144A 4.40000% 18-14.08.28	695 000.00	692 275.78	0.02
USD BNP PARIBAS-REG-S 3.37500% 18-09.01.25	1 185 000.00	1 141 317.41	0.03
USD BOSTON PROPERTIES LP 3.80000% 13-01.02.24	282 000.00	282 680.30	0.01
USD BOSTON SCIENTIFIC CORP 4.12500% 13-01.10.23	1 500 000.00	1 536 443.85	0.03
USD BP CAPITAL MARKETS PLC 3.56100% 11-01.11.21	2 600 000.00	2 638 720.24	0.06
USD BPCE SA-144A 4.00000% 18-12.09.23	1 975 000.00	1 968 105.18	0.04
USD BPCE SA-144A-SUB 5.15000% 14-21.07.24	2 425 000.00	2 471 899.01	0.05
USD BPCE SA-144A-SUB 5.70000% 13-22.10.23	566 000.00	590 815.08	0.01
USD BRIXMOR OPERATING PARTNERSHIP LP 3.85000% 15-01.02.25	2 000 000.00	1 944 592.84	0.04
USD BROADCOM CORP/CAYMAN FIN LTD 2.37500% 18-15.01.20	3 000 000.00	2 976 772.83	0.07
USD BROADCOM CORP/CAYMAN FIN LTD 3.00000% 18-15.01.22	4 775 000.00	4 674 172.10	0.10
USD BROADCOM CORP/CAYMAN FIN LTD 3.62500% 18-15.01.24	4 117 000.00	4 003 570.60	0.09
USD BROADCOM CORP/CAYMAN FIN LTD 3.87500% 18-15.01.27	4 390 000.00	4 033 722.92	0.09
USD BROADCOM CORP/CAYMAN FIN LTD 3.12500% 18-15.01.25	2 300 000.00	2 128 981.55	0.05
USD BUNGE LTD FINANCE CORP 3.50000% 15-24.11.20	954 000.00	954 349.35	0.02
USD BUNGE LTD FINANCE CORP 3.00000% 17-25.09.22	1 300 000.00	1 250 374.03	0.03
USD CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD 3.45000% 11-15.11.21	750 000.00	749 579.57	0.02
USD CAPITAL ONE NA 2.65000% 17-08.08.22	1 825 000.00	1 773 239.40	0.04
USD CARDINAL HEALTH INC 2.61600% 17-15.06.22	5 550 000.00	5 372 192.15	0.12
USD CARLYLE HOLDINGS FINANCE LLC-REG-S 3.87500% 13-01.02.23	777 000.00	785 857.41	0.02
USD CATALENT PHARMA SOLUTIONS INC-144A 4.87500% 17-15.01.26	304 000.00	294 880.00	0.01
USD CBS CORP 2.90000% 18-01.06.23	1 400 000.00	1 347 341.64	0.03
USD CBS CORP 3.37500% 12-01.03.22	1 000 000.00	995 326.40	0.02
USD CBS CORP 3.50000% 15-15.01.25	900 000.00	875 043.01	0.02
USD CBS CORP 3.70000% 18-01.06.28	1 035 000.00	982 811.85	0.02
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.12500% 17-01.05.27	233 000.00	225 129.26	0.00
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 4.00000% 17-01.03.23	788 000.00	768 575.80	0.02
USD CCO LLC/CAPITAL 3.75000% 17-15.02.28	2 815 000.00	2 608 329.70	0.06
USD CCO LLC/CAPITAL 4.46400% 16-23.07.22	2 890 000.00	2 947 832.95	0.06
USD CCO LLC/CAPITAL 4.90800% 16-23.07.25	2 150 000.00	2 210 295.03	0.05
USD CCO LLC/CAPITAL 5.37500% 17-01.05.47	700 000.00	666 068.00	0.01
USD CCO LLC/CAPITAL 6.48400% 16-23.10.45	500 000.00	538 153.45	0.01
USD CELGENE CORP 3.25000% 12-15.08.22	7 690 000.00	7 657 759.59	0.17
USD CELGENE CORP 3.62500% 14-15.05.24	2 000 000.00	1 993 344.78	0.04
USD CELULOSA ARAUCO Y CONSTITUCION SA 4.50000% 14-01.08.24	650 000.00	654 875.00	0.01
USD CENOVUS ENERGY INC 3.00000% 12-15.08.22	9 443 000.00	9 087 149.70	0.20
USD CENOVUS ENERGY INC 5.70000% 10-15.10.19	1 575 000.00	614 183.06	0.01
USD CENOVUS ENERGY INC 6.75000% 10-15.11.39	1 825 000.00	1 927 279.02	0.04
USD CENTENE CORP 4.75000% 14-15.05.22	1 175 000.00	1 195 915.00	0.03
USD CENTENE CORP-144A 5.37500% 18-01.06.26	363 000.00	374 797.50	0.01
USD CENTENNIAL RESOURCE PRODUCTION LLC-144A 5.37500% 17-15.01.26	100 000.00	96 500.00	0.00
USD CENTERPOINT ENERGY INC 2.50000% 17-01.09.22	725 000.00	697 649.08	0.02
USD CENTERPOINT ENERGY INC 3.85000% 18-01.02.24	6 255 000.00	6 298 394.69	0.14
USD CENTRAL GARDEN & PET CO 6.12500% 15-15.11.23	185 000.00	189 162.50	0.00
USD CHANGE HC HLDS LLC/CHNG HC FIN INC-144A 5.75000% 17-01.03.25	219 000.00	209 692.50	0.00
USD CHENIERE ENERGY PARTNERS LP 5.25000% 18-01.10.25	550 000.00	552 744.50	0.01
USD CHOBANI LLC/FINANCE CORP-144A 7.50000% 17-15.04.25	180 000.00	153 900.00	0.00
USD CHUBB INA HOLDINGS INC 3.35000% 14-15.05.24	2 600 000.00	2 617 456.92	0.06

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD CHURCHILL DOWNS INC-144A 4.75000% 17-15.01.28	250 000.00	239 687.50	0.01
USD CIMAREX ENERGY CO 3.90000% 17-15.05.27	2 090 000.00	2 017 369.99	0.04
USD CITIGROUP INC 2.65000% 15-26.10.20	2 125 000.00	2 109 358.58	0.05
USD CLEAN HARBORS INC 5.12500% 13-01.06.21	325 000.00	322 562.50	0.01
USD CLEAR CHANNEL INTERNATIONAL BV-144A 8.75000% 15-15.12.20	146 000.00	148 555.00	0.00
USD CLECO CORPORATE HOLDINGS LLC 3.74300% 17-01.05.26	2 400 000.00	2 297 895.22	0.05
USD CLEVELAND ELECTRIC ILLUMINATING CO-144A 3.50000% 17-01.04.28	530 000.00	500 851.32	0.01
USD CLOROX CO 3.90000% 18-15.05.28	2 000 000.00	2 043 354.20	0.04
USD COMCAST CORP 3.12500% 12-15.07.22	1 270 000.00	1 274 272.28	0.03
USD COMCAST CORP 3.37500% 15-15.08.25	4 650 000.00	4 659 643.16	0.10
USD COMMSCOPE INC-144A 5.00000% 14-15.06.21	1 500 000.00	1 490 625.00	0.03
USD COMPASS BANK-SUB 5.50000% 05-01.04.20	1 490 000.00	1 523 650.45	0.03
USD CONSTELLATION BRANDS INC 4.25000% 13-01.05.23	1 250 000.00	1 285 253.88	0.03
USD CONSTELLATION BRANDS INC 2.00000% 17-07.11.19	1 200 000.00	1 190 196.06	0.03
USD CONTINENTAL AIRLINES 4.00000% 12-29.10.24	2 170 000.00	1 613 733.59	0.04
USD CONTINENTAL RESOURCES INC 5.00000% 12-15.09.22	3 622 000.00	3 639 945.56	0.08
USD CONTINENTAL RESOURCES INC 3.80000% 14-01.06.24	2 295 000.00	2 267 601.97	0.05
USD CORPORATE OFFICE PROPERTIES LP 3.60000% 13-15.05.23	1 300 000.00	1 271 497.24	0.03
USD COVENTRY HEALTH CARE INC 5.45000% 11-15.06.21	1 900 000.00	1 977 294.47	0.04
USD COX COMMUNICATION INC-144A 3.35000% 16-15.09.26	1 250 000.00	1 178 564.10	0.03
USD COX COMMUNICATIONS INC-144A 3.15000% 17-15.08.24	1 940 000.00	1 882 822.15	0.04
USD CROWN AMERICAS LLC/CAPITAL CORP V 4.25000% 17-30.09.26	182 000.00	172 900.00	0.00
USD CROWNROCK LP / CROWNROCK FIN INC-144A 5.62500% 17-15.10.25	70 000.00	67 200.00	0.00
USD CSC HOLDINGS INC-144A 5.37500% 18-01.02.28	300 000.00	288 375.00	0.01
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 5.50000% 18-15.05.26	300 000.00	297 000.00	0.01
USD CSX CORP 2.60000% 16-01.11.26	2 000 000.00	1 842 487.84	0.04
USD CUBESMART LP 4.37500% 19-15.02.29	6 265 000.00	6 275 782.07	0.14
USD DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC-144A 2.45000% 15-18.05.20	1 400 000.00	1 385 554.91	0.03
USD DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC-144A 3.70000% 18-04.05.23	3 215 000.00	3 222 764.54	0.07
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP-144A 3.48000% 16-01.06.19	4 700 000.00	4 701 578.73	0.10
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP-144A 5.45000% 16-15.06.23	879 000.00	920 963.99	0.02
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP-144A 6.02000% 16-15.06.26	943 000.00	986 342.44	0.02
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP-REG-S 4.42000% 16-15.06.21	6 195 000.00	6 301 396.03	0.14
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP-REG-S 6.02000% 16-15.06.26	665 000.00	695 564.93	0.02
USD DEUTSCHE TELEKOM INTL FINANCE BV-144A 2.48500% 16-19.09.23	730 000.00	694 509.44	0.02
USD DEVON ENERGY CORP 5.85000% 15-15.12.25	1 950 000.00	2 124 802.29	0.05
USD DIAMONDBACK ENERGY INC-144A 4.75000% 16-01.11.24	35 000.00	34 912.50	0.00
USD DIAMONDBACK ENERGY INC 4.75000% 17-01.11.24	116 000.00	115 710.00	0.00
USD DIGITAL REALTY TRUST LP 3.62500% 12-01.10.22	4 550 000.00	4 524 549.30	0.10
USD DISCOVER BANK 3.10000% 15-04.06.20	5 000 000.00	4 987 936.10	0.11
USD DISCOVER BANK 3.35000% 18-06.02.23	2 521 000.00	2 484 203.21	0.05
USD DISCOVER BANK-SUB 7.00000% 10-15.04.20	600 000.00	625 621.32	0.01
USD DISCOVER BANK-SUB 8.70000% 09-18.11.19	300 000.00	311 985.69	0.01
USD DISCOVER FINANCIAL SERVICES 3.85000% 13-21.11.22	3 515 000.00	3 518 651.73	0.08
USD DOMINION ENERGY INC 3.90000% 15-01.10.25	1 500 000.00	1 508 677.20	0.03
USD DOMINION ENERGY INC 4.25000% 18-01.06.28	2 900 000.00	2 958 873.48	0.06
USD DOMINION ENERGY INC-SUB STEP-UP 16-01.04.21	7 350 000.00	7 403 294.12	0.16
USD DOMINION ENERGY INC-SUB STEP-UP 17-01.07.20	5 130 000.00	5 085 001.90	0.11
USD DOW CHEMICAL CO-144A 4.55000% 18-30.11.25	3 275 000.00	3 390 310.79	0.07
USD DTE ENERGY CO 3.50000% 14-01.06.24	2 100 000.00	2 060 394.61	0.05
USD DUKE ENERGY CORP 2.40000% 17-15.08.22	4 460 000.00	4 311 515.53	0.09
USD DUKE ENERGY CORP 3.05000% 12-15.08.22	2 685 000.00	2 670 204.39	0.06
USD DUQUESNE LIGHT HOLDINGS INC-144A 6.40000% 10-15.09.20	1 622 000.00	1 690 797.29	0.04
USD EASTMAN CHEMICAL CO 2.70000% 14-15.01.20	528 000.00	526 285.31	0.01
USD ECOLAB INC 4.35000% 11-08.12.21	1 306 000.00	1 353 066.41	0.03
USD EDP FINANCE BV-144A 4.12500% 14-15.01.20	491 000.00	491 314.24	0.01
USD ELANCO ANIMAL HEALTH INC-144A 3.91200% 18-27.08.21	1 520 000.00	1 521 960.50	0.03
USD ELANCO ANIMAL HEALTH INC-144A 4.27200% 18-28.08.23	7 050 000.00	7 099 809.66	0.16

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD ENBRIDGE ENERGY PARTNERS LP 4.20000% 11-15.09.21	1 280 000.00	1 299 592.32	0.03
USD ENBRIDGE INC 4.25000% 16-01.12.26	6 265 000.00	6 429 110.43	0.14
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-144A 3.62500% 17-25.05.27	1 880 000.00	1 689 642.24	0.04
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-144A 2.87500% 17-25.05.22	1 445 000.00	1 389 478.76	0.03
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-144A 3.50000% 17-06.04.28	460 000.00	405 476.30	0.01
USD ENERGY TRANSFER LP/REGENCY FIN CORP 4.50000% 13-01.11.23	1 000 000.00	1 018 140.20	0.02
USD ENERGY TRANSFER OPERATING LP 4.50000% 19-15.04.24	1 555 000.00	1 583 973.38	0.03
USD ENERSIS AMERICAS SA 4.00000% 16-25.10.26	686 000.00	665 420.00	0.01
USD ENLINK MIDSTREAM PARTNERS LP 4.40000% 14-01.04.24	10 250 000.00	9 840 000.00	0.22
USD ENSCO PLC 7.75000% 18-01.02.26	5 500 000.00	4 417 187.50	0.10
USD EOG RESOURCES INC 4.10000% 10-01.02.21	3 510 000.00	3 579 331.63	0.08
USD EPR PROPERTIES 4.50000% 15-01.04.25	865 000.00	862 563.54	0.02
USD ERAC USA FINANCE LLC-REG-S 2.35000% 14-15.10.19	1 700 000.00	1 691 559.86	0.04
USD ERP OPERATING LP 3.25000% 17-01.08.27	1 460 000.00	1 415 035.75	0.03
USD ERP OPERATING LTD PARTNERSHIP 4.62500% 11-15.12.21	2 000 000.00	2 078 251.40	0.05
USD EXELON GENERATION CO LLC 4.25000% 13-15.06.22	8 240 000.00	8 425 077.82	0.19
USD EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO 3.50000% 14-15.06.24	1 243 000.00	1 231 276.64	0.03
USD FAMILY DOLLAR STORES INC 5.00000% 11-01.02.21	1 500 000.00	1 530 000.00	0.03
USD FARMERS EXCHANGE CAPITAL-144A-SUB 7.05000% 98-15.07.28	1 915 000.00	2 145 566.76	0.05
USD FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES 3.50000% 13-15.04.23	1 481 000.00	1 471 939.17	0.03
USD FIFTH THIRD BANK 2.25000% 16-14.06.21	705 000.00	691 868.54	0.02
USD FIRST DATA CORP-144A 5.37500% 15-15.08.23	1 400 000.00	1 427 125.00	0.03
USD FIRST DATA CORP-144A 5.00000% 15-15.01.24	224 000.00	228 900.00	0.01
USD FIRST MIDWEST BANCORP INC/IL-SUB 5.87500% 16-29.09.26	6 695 000.00	7 070 678.54	0.16
USD FIRST QUALITY FINANCE CO INC-144A 5.00000% 17-01.07.25	241 000.00	232 565.00	0.01
USD FLORIDA GAS TRANSMISSION CO-144A 7.90000% 09-15.05.19	1 500 000.00	1 519 332.00	0.03
USD FMG RESOURCES AUGUST 2006 PTY LTD-144A 5.12500% 17-15.05.24	1 305 000.00	1 274 202.00	0.03
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.37500% 13-06.08.23	5 700 000.00	5 415 128.88	0.12
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.14000% 18-15.02.23	2 660 000.00	2 518 179.41	0.06
USD FORTIS INC 3.05500% 17-04.10.26	6 265 000.00	5 831 723.31	0.13
USD GANNETT CO INC-144A 4.87500% 14-15.09.21	545 000.00	543 637.50	0.01
USD GENERAL DYNAMICS CORP 3.37500% 18-15.05.23	1 093 000.00	1 112 056.56	0.02
USD GENERAL DYNAMICS CORP 3.00000% 18-11.05.21	1 675 000.00	1 685 084.84	0.04
USD GENERAL ELECTRIC CO 2.70000% 12-09.10.22	8 440 000.00	8 086 142.45	0.18
USD GENERAL MOTORS CO 4.20000% 17-01.10.27	4 300 000.00	3 962 664.49	0.09
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 3.70000% 15-24.11.20	2 000 000.00	2 000 503.00	0.04
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 4.15000% 18-19.06.23	2 525 000.00	2 486 413.86	0.05
USD GEORGIA-PACIFIC LLC-144A 5.40000% 10-01.11.20	651 000.00	675 134.20	0.01
USD GEORGIA-PACIFIC LLC-144A 3.73400% 13-15.07.23	2 508 000.00	2 536 169.85	0.06
USD GLENCORE FINANCE CANADA LTD-144A 4.95000% 11-15.11.21	3 080 000.00	3 171 229.60	0.07
USD GLENCORE FUNDING LLC-144A 4.12500% 13-30.05.23	1 445 000.00	1 448 225.81	0.03
USD GLP CAPITAL LP / GLP FINANC II INC 5.37500% 16-15.04.26	1 320 000.00	1 348 155.60	0.03
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.60000% 17-27.12.20	3 000 000.00	2 979 748.26	0.07
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.50000% 15-23.01.25	3 000 000.00	2 956 596.06	0.06
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.75000% 15-22.05.25	4 965 000.00	4 946 812.31	0.11
USD GROUP 1 AUTOMOTIVE INC-144A 5.25000% 15-15.12.23	390 000.00	374 400.00	0.01
USD GULF POWER CO 3.30000% 17-30.05.27	2 105 000.00	2 076 834.59	0.05
USD GULFPORT ENERGY CORP 6.37500% 17-15.05.25	59 000.00	55 902.50	0.00
USD HALFMOON PARENT INC-144A 3.40000% 18-17.09.21	5 690 000.00	5 715 318.23	0.13
USD HALFMOON PARENT INC-144A 3.75000% 18-15.07.23	1 559 000.00	1 579 864.10	0.03
USD HALFMOON PARENT INC-144A 4.12500% 18-15.11.25	2 127 000.00	2 170 104.72	0.05
USD HALFMOON PARENT INC-144A 4.37500% 18-15.10.28	12 725 000.00	13 066 372.29	0.29
USD HALFMOON PARENT INC-REG-S 3.75000% 18-15.07.23	3 800 000.00	3 850 855.40	0.08
USD HALFMOON PARENT INC-REG-S 4.12500% 18-15.11.25	5 400 000.00	5 509 433.70	0.12
USD HCA INC 5.00000% 14-15.03.24	1 000 000.00	1 040 500.00	0.02
USD HCP INC 4.25000% 13-15.11.23	2 800 000.00	2 841 966.12	0.06
USD HEALTHCARE TRUST OF AMERICA HOLDINGS LP 3.70000% 13-15.04.23	750 000.00	745 245.39	0.02
USD HERTZ CORP/THE-144A 5.50000% 16-15.10.24	197 000.00	161 540.00	0.00

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD HESS CORP 7.87500% 99-01.10.29	1 000 000.00	1 160 043.10	0.03
USD HESS INFRASTRUCTURE PART/FIN CORP-144A 5.62500% 17-15.02.26	435 000.00	430 650.00	0.01
USD HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO STEP-UP/DOWN 16-15.10.22	4 440 000.00	4 591 754.31	0.10
USD HOLOGIC INC-144A 4.37500% 17-15.10.25	335 000.00	329 010.20	0.01
USD HOSPITALITY PROPERTIES TRUST 3.95000% 17-15.01.28	1 188 000.00	1 060 664.47	0.02
USD HOST HOTELS & RESORTS LP 5.25000% 12-15.03.22	1 250 000.00	1 291 845.12	0.03
USD HOST HOTELS & RESORTS LP 3.87500% 17-01.04.24	4 121 000.00	4 043 031.05	0.09
USD HUMANA INC 3.95000% 17-15.03.27	1 055 000.00	1 047 513.11	0.02
USD HUSKY ENERGY INC 4.00000% 14-15.04.24	2 240 000.00	2 248 917.44	0.05
USD HYUNDAI CAPITAL AMERICA-144A 1.75000% 16-27.09.19	2 050 000.00	2 027 633.07	0.04
USD IHS MARKIT LTD-144A 4.00000% 17-01.03.26	1 206 000.00	1 149 430.52	0.03
USD ING BANK NV-144A-SUB 5.80000% 13-25.09.23	1 173 000.00	1 242 168.53	0.03
USD INTESA SANPAOLO SPA-144A 3.12500% 17-14.07.22	1 586 000.00	1 490 364.47	0.03
USD INTESA SANPAOLO SPA-144A 3.37500% 18-12.01.23	2 165 000.00	2 018 426.32	0.04
USD INVERSIONES CMPC SA-144A 4.37500% 17-04.04.27	1 434 000.00	1 420 556.25	0.03
USD INVISTA FINANCE LLC-144A 4.25000% 14-15.10.19	700 000.00	700 000.00	0.02
USD IPALCO ENTERPRISES INC 3.70000% 18-01.09.24	955 000.00	937 804.77	0.02
USD ITRON INC-144A 5.00000% 17-15.01.26	210 000.00	200 224.50	0.00
USD JACKSON NATIONAL LIFE GLOBAL FUND-144A 2.50000% 17-27.06.22	1 980 000.00	1 923 922.34	0.04
USD JACKSON NATIONAL LIFE GLOBAL FUND-REG-S 3.30000% 19-01.02.22	1 925 000.00	1 932 750.63	0.04
USD JERSEY CENTRAL POWER & LIGHT CO-144A 4.70000% 13-01.04.24	1 573 000.00	1 636 823.21	0.04
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 3.37500% 13-01.05.23	2 810 000.00	2 806 968.68	0.06
USD KEURIG DR PEPPER INC-144A 4.05700% 18-25.05.23	9 085 000.00	9 176 862.07	0.20
USD KEYBANK NA/CLEVELAND OH 2.40000% 17-09.06.22	4 480 000.00	4 368 243.04	0.10
USD KEYSpan GAS EAST CORP-144A 2.74200% 16-15.08.26	1 250 000.00	1 166 779.22	0.03
USD KEYSpan GAS EAST CORP-REG-S 2.74200% 16-15.08.26	3 500 000.00	3 266 981.80	0.07
USD KINDER MORGAN ENERGY PARTNERS LP 4.30000% 14-01.05.24	6 130 000.00	6 278 694.19	0.14
USD KINDER MORGAN ENERGY PARTNERS LP 5.80000% 05-15.03.35	1 973 000.00	2 076 054.92	0.05
USD KINDER MORGAN ENERGY PARTNERS LP 5.30000% 10-15.09.20	1 925 000.00	1 982 812.18	0.04
USD KINDER MORGAN ENERGY PARTNERS LP 3.50000% 13-01.09.23	1 325 000.00	1 311 296.28	0.03
USD KINDER MORGAN INC 5.00000% 13-15.02.21	9 665 000.00	9 962 254.80	0.22
USD KINDER MORGAN INC-144A 5.62500% 13-15.11.23	565 000.00	608 958.46	0.01
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 3.50000% 12-06.06.22	3 750 000.00	3 756 464.25	0.08
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 4.37500% 16-01.06.46	1 400 000.00	1 206 129.95	0.03
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 3.00000% 16-01.06.26	1 500 000.00	1 389 043.71	0.03
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 2.80000% 16-02.07.20	3 925 000.00	3 912 290.85	0.09
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 3.50000% 16-15.07.22	1 000 000.00	1 001 026.70	0.02
USD LABORATORY CORP AMERICA HOLDINGS 4.62500% 10-15.11.20	1 500 000.00	1 530 761.70	0.03
USD LABORATORY CORP AMERICA HOLDINGS 3.20000% 15-01.02.22	501 000.00	499 799.94	0.01
USD LABORATORY CORP AMERICA HOLDINGS 3.60000% 15-01.02.25	529 000.00	519 677.57	0.01
USD LAMB WESTON HOLDINGS INC-144A 4.62500% 16-01.11.24	75 000.00	74 625.00	0.00
USD LENNAR CORP STEP-UP/DOWN 13-15.11.22	700 000.00	702 625.00	0.02
USD LEUCADIA NATIONAL CORP 5.50000% 13-18.10.23	1 750 000.00	1 829 296.88	0.04
USD LEVEL 3 FINANCING INC 5.25000% 17-15.03.26	65 000.00	63 069.50	0.00
USD LINCOLN NATIONAL CORP 4.00000% 13-01.09.23	2 075 000.00	2 120 627.80	0.05
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC-SUB 4.58200% 16-10.12.25	4 315 000.00	4 216 563.46	0.09
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.37500% 18-22.03.28	400 000.00	398 289.02	0.01
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 3.75000% 17-11.01.27	4 800 000.00	4 599 277.54	0.10
USD LPL HOLDINGS INC-144A 5.75000% 17-15.09.25	796 000.00	782 706.80	0.02
USD LYB INTERNATIONAL FINANCE II BV 3.50000% 17-02.03.27	2 000 000.00	1 901 198.24	0.04
USD LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV 5.75000% 12-15.04.24	500 000.00	540 225.30	0.01
USD MACQUARIE GROUP LTD-144A 6.00000% 10-14.01.20	3 775 000.00	3 877 100.54	0.09
USD MARATHON OIL CORP 4.40000% 17-15.07.27	2 275 000.00	2 282 766.39	0.05
USD MARATHON PETROLEUM CORP-144A 4.75000% 18-15.12.23	2 430 000.00	2 523 575.41	0.06
USD MARATHON PETROLEUM CORP-144A 5.12500% 18-15.12.26	1 580 000.00	1 638 051.41	0.04
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-144A 2.00000% 16-15.04.21	3 000 000.00	2 930 770.59	0.06
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-144A 2.95000% 18-11.01.25	540 000.00	526 908.48	0.01
USD MATADOR RESOURCES CO 5.87500% 18-15.09.26	125 000.00	124 531.25	0.00

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD MATTHEWS INTERNATIONAL CORP-144A 5.25000% 17-01.12.25	250 000.00	235 625.00	0.01
USD MCCORMICK & CO 3.15000% 17-15.08.24	2 605 000.00	2 538 174.50	0.06
USD MCDONALD ' S CORP 3.70000% 15-30.01.26	3 330 000.00	3 350 398.58	0.07
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-144A 3.87500% 12-11.04.22	1 170 000.00	1 195 404.44	0.03
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I-144A 3.00000% 13-10.01.23	1 500 000.00	1 490 232.33	0.03
USD MICROCHIP TECHNOLOGY INC-144A 4.33300% 18-01.06.23	6 350 000.00	6 255 716.79	0.14
USD MOLSON COORS BREWING CO 2.25000% 17-15.03.20	2 130 000.00	2 107 265.81	0.05
USD MONDELEZ INTERNATIONAL HOLDING NET-144A 1.62500% 16-28.10.19	2 510 000.00	2 484 252.87	0.05
USD MORGAN STANLEY 3.70000% 14-23.10.24	5 020 000.00	5 057 212.26	0.11
USD MORGAN STANLEY 3.75000% 13-25.02.23	3 765 000.00	3 826 396.61	0.08
USD MORGAN STANLEY 3.87500% 14-29.04.24	2 000 000.00	2 038 855.40	0.04
USD MORGAN STANLEY 5.75000% 11-25.01.21	1 635 000.00	1 716 449.97	0.04
USD MOTIVA ENTERPRISES LLC-144A 5.75000% 10-15.01.20	946 000.00	962 422.56	0.02
USD MULTI-COLOR CORP-144A 4.87500% 17-01.11.25	150 000.00	142 500.00	0.00
USD MYLAN INC-144A 3.12500% 12-15.01.23	3 090 000.00	2 938 409.88	0.06
USD MYLAN NV 3.15000% 17-15.06.21	4 300 000.00	4 205 892.91	0.09
USD MYLAN NV 3.75000% 17-15.12.20	2 200 000.00	2 197 180.02	0.05
USD MYLAN NV 3.95000% 17-15.06.26	8 195 000.00	7 741 488.70	0.17
USD NABORS INDUSTRIES INC 4.62500% 12-15.09.21	7 000 000.00	6 623 750.00	0.15
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD/NY 3.70000% 18-04.11.21	2 670 000.00	2 698 942.80	0.06
USD NAVIENT CORP 6.62500% 16-26.07.21	790 000.00	811 725.00	0.02
USD NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-144A 2.00000% 16-13.04.21	4 000 000.00	3 915 506.72	0.09
USD NEWFIELD EXPLORATION CO 5.62500% 12-01.07.24	1 350 000.00	1 414 125.00	0.03
USD NEXTERA ENERGY CAPITAL HOLDINGS INC 3.55000% 17-01.05.27	1 375 000.00	1 334 222.06	0.03
USD NISOURCE INC 3.65000% 19-15.06.23	2 260 000.00	2 274 701.07	0.05
USD NORDEA BANK ABP-144A 3.75000% 18-30.08.23	1 065 000.00	1 062 760.00	0.02
USD NUTRIEN LTD 3.37500% 18-15.03.25	1 900 000.00	1 821 722.98	0.04
USD NXP BV / NXP FUNDING LLC-144A 4.12500% 15-15.06.20	2 250 000.00	2 249 999.99	0.05
USD NXP BV / NXP FUNDING LLC-144A 4.12500% 16-01.06.21	2 475 000.00	2 484 132.75	0.05
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 2.60000% 16-15.04.22	2 145 000.00	2 113 242.18	0.05
USD OI EUROPEAN GROUP BV-144A 4.00000% 17-15.03.23	99 000.00	95 782.50	0.00
USD ONCOR ELECTRIC DELIVERY CO 5.75000% 11-30.09.20	2 203 000.00	2 284 501.74	0.05
USD ONEOK PARTNERS LP 3.37500% 12-01.10.22	1 145 000.00	1 143 781.89	0.03
USD ONTARIO TEACHERS CADILLAC FAIRVIEW-144A 3.12500% 17-20.03.22	3 000 000.00	2 979 086.76	0.07
USD OWENS CORNING INC 4.20000% 12-15.12.22	1 800 000.00	1 794 589.15	0.04
USD PDC ENERGY INC 5.75000% 18-15.05.26	777 000.00	728 437.50	0.02
USD PEIDMONT OPERATING PARTNERSHIP LP 3.40000% 13-01.06.23	1 500 000.00	1 453 229.93	0.03
USD PENNSYLVANIA ELECTRIC CO-144A 3.25000% 17-15.03.28	305 000.00	285 567.49	0.01
USD PENSKE TRUCK LEASING/PTL FIN CORP-144A 3.90000% 18-01.02.24	2 500 000.00	2 476 666.18	0.05
USD PERNOD RICARD SA-144A 4.45000% 11-15.01.22	2 000 000.00	2 052 190.00	0.05
USD PHILLIPS 66 4.30000% 12-01.04.22	920 000.00	953 457.27	0.02
USD PHILLIPS 66 PARTNERS LP 3.55000% 16-01.10.26	2 445 000.00	2 324 047.24	0.05
USD PILGRIMS PRIDE CORP-144A 5.87500% 17-30.09.27	258 000.00	248 970.00	0.01
USD PIPELINE FUNDING CO LLC-144A 7.50000% 09-15.01.30	1 550 000.00	1 724 183.90	0.04
USD PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP 3.85000% 13-15.10.23	3 004 000.00	2 967 346.82	0.07
USD PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP 3.60000% 14-01.11.24	1 000 000.00	965 989.66	0.02
USD PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP 4.65000%15-15.10.25	1 250 000.00	1 267 726.50	0.03
USD PNC BANK NATIONAL ASSOCIATION 2.50000% 18-22.01.21	1 815 000.00	1 797 113.39	0.04
USD PNC BANK NATIONAL ASSOCIATION 3.50000% 18-08.06.23	2 625 000.00	2 659 744.50	0.06
USD PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC-SUB 3.90000% 14-29.04.24	5 170 000.00	5 231 964.51	0.11
USD POST HOLDINGS INC-144A 5.00000% 16-15.08.26	75 000.00	70 890.00	0.00
USD POST HOLDINGS INC-144A 5.75000% 17-01.03.27	196 000.00	192 042.76	0.00
USD PROVIDENCE HEALTH & SERV OBLIG 4.37900% 13-01.10.23	2 500 000.00	2 623 284.00	0.06
USD PSEG POWER LLC 3.85000% 18-01.06.23	4 730 000.00	4 761 911.89	0.10
USD PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC 2.65000% 17-15.11.22	2 500 000.00	2 444 770.05	0.05
USD PUBLIC SERVICE OKLAHOMA 5.15000% 09-01.12.19	1 000 000.00	1 016 712.30	0.02
USD QUICKEN LOANS INC-REG-S 5.75000% 15-01.05.25	1 885 000.00	1 819 025.00	0.04
USD QUINTILES IMS INC-144A 5.00000% 16-15.10.26	500 000.00	500 625.00	0.01

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD RABOBANK NEDERLAND NV-SUB 3.87500% 18-26.09.23	4 050 000.00	4 117 092.30	0.09
USD RECKITT BENCKISER TREAS SERV-144A 2.75000% 17-26.06.24	5 280 000.00	5 102 372.14	0.11
USD RECKITT BENCKISER TREAS SERV-REG-S 2.75000% 17-26.06.24	5 650 000.00	5 459 924.73	0.12
USD REGIONS BANK/BIRMINGHAM AL 2.75000% 18-01.04.21	6 850 000.00	6 776 364.49	0.15
USD RITE AID CORP-144A 6.12500% 15-01.04.23	602 000.00	507 937.50	0.01
USD ROCHE HOLDINGS INC-144A 2.25000% 14-30.09.19	1 500 000.00	1 496 124.47	0.03
USD ROCK-TENN CO 4.90000% 13-01.03.22	1 275 000.00	1 312 309.31	0.03
USD ROCKIES EXPRESS PIPELINE LLC-144A 5.62500% 10-15.04.20	755 000.00	768 212.50	0.02
USD RUBY PIPELINE LLC-144A 6.00000% 12-01.04.22	2 140 000.00	1 770 698.13	0.04
USD SABINE PASS LIQUEFACTION LLC 5.75000% 14-15.05.24	3 350 000.00	3 601 372.94	0.08
USD SABINE PASS LIQUEFACTION LLC 5.62500% 16-01.03.25	3 215 000.00	3 464 634.13	0.08
USD SANTANDER HOLDINGS USA INC/PA 2.65000% 15-17.04.20	1 640 000.00	1 628 797.93	0.04
USD SANTANDER UK PLC 3.75000% 18-15.11.21	2 695 000.00	2 722 922.35	0.06
USD SANTANDER UK PLC-144A-SUB 5.00000% 13-07.11.23	2 030 000.00	2 043 008.64	0.04
USD SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCH NV-144A 2.00000% 16-15.09.23	1 000 000.00	949 768.02	0.02
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 3.87500% 17-01.08.22	325 000.00	320 125.00	0.01
USD SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB 2.62500% 16-15.03.21	2 400 000.00	2 374 030.51	0.05
USD SMBC AVIATION CAPITAL FINANCE DAC-REG-S 2.65000% 16-15.07.21	9 915 000.00	9 656 849.79	0.21
USD SPRINT CORP 7.12500% 14-15.06.24	169 000.00	172 908.13	0.00
USD SPRINT NEXTEL CORP-144A 7.00000% 12-01.03.20	655 000.00	673 831.25	0.01
USD SPRINT SPECTRUM CO III LLC-144A STEP-DOWN 16-20.09.21	1 750 000.00	1 196 507.81	0.03
USD SPRINT SPECTRUM CO III LLC-144A 4.73800% 18-20.03.25	2 500 000.00	2 496 875.00	0.05
USD SUNCOR ENERGY INC 3.60000% 14-01.12.24	1 665 000.00	1 675 528.63	0.04
USD SUNOCO LOGISTICS PARTNERS OPERATIONS LP 4.25000% 14-01.04.24	1 260 000.00	1 268 450.69	0.03
USD SUNOCO LP/FINANCE CORP 4.87500% 18-15.01.23	748 000.00	736 780.00	0.02
USD TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD-REG-S 2.45000% 17-18.01.22	3 000 000.00	2 904 240.00	0.06
USD TARGA RESOURCES PARTNERS-144A 6.87500% 19-15.01.29	173 000.00	180 020.34	0.00
USD TC PIPELINES LP 3.90000% 17-25.05.27	1 800 000.00	1 728 689.99	0.04
USD TC PIPELINES LP 4.65000% 11-15.06.21	620 000.00	631 041.89	0.01
USD TENET HEALTHCARE CORP 4.37500% 13-01.10.21	190 000.00	189 762.50	0.00
USD TENET HEALTHCARE CORP-REG-S 6.25000% 19-01.02.27	505 000.00	508 156.25	0.01
USD TENET HEALTHCARE ESCROW CORP 6.00000% 14-01.10.20	971 000.00	1 002 848.80	0.02
USD TERVITA ESCROW CORP-144A 7.62500% 16-01.12.21	563 000.00	553 147.50	0.01
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE CO BV 3.65000% 11-10.11.21	3 578 000.00	3 455 971.59	0.08
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 6.00000% 18-15.04.24	5 300 000.00	5 363 626.50	0.12
USD TEXAS EASTERN TRANSMISSION LP-144A 2.80000% 12-15.10.22	1 375 000.00	1 330 753.88	0.03
USD THOMSON REUTERS CORP 4.30000% 13-23.11.23	2 516 000.00	2 552 166.75	0.06
USD TIME WARNER CABLE LLC 8.25000% 09-01.04.19	1 750 000.00	1 764 386.05	0.04
USD TIME WARNER INC 4.00000% 11-15.01.22	1 395 000.00	1 416 839.28	0.03
USD TOTAL SYSTEM SERVICES INC 3.75000% 13-01.06.23	688 000.00	681 360.96	0.01
USD TRANSCONTINENTAL GAS PIPE LINE 4.60000% 18-15.03.48	1 955 000.00	1 867 033.54	0.04
USD TRANSOCEAN GUARDIAN LTD-144A 5.87500% 18-15.01.24	290 000.00	275 420.25	0.01
USD TRANSOCEAN PONTUS LTD-144A 6.12500% 18-01.08.25	255 000.00	256 104.15	0.01
USD TUCSON ELECTRIC POWER CO 3.05000% 15-15.03.25	1 425 000.00	1 372 139.09	0.03
USD UBS GROUP FUNDING SWITZERLAND AG-REG-S 3.49100% 17-23.05.23	1 850 000.00	1 834 978.66	0.04
USD UNITED AIRLINES AA PASS THROUGH TRUST 3.50000% 18-01.03.30	1 350 000.00	1 307 913.62	0.03
USD UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC-144A 4.75000% 14-01.08.22	1 555 000.00	1 570 550.00	0.03
USD US BANK NA/CINCINNATI OH 3.40000% 18-24.07.23	3 785 000.00	3 832 606.97	0.08
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 6.12500% 15-15.04.25	70 000.00	66 150.00	0.00
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 5.50000% 17-01.11.25	957 000.00	951 018.75	0.02
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 9.25000% 18-01.04.26	85 000.00	91 375.00	0.00
USD VENTAS REALITY LP/VENT CAP CORP 3.25000% 12-15.08.22	2 000 000.00	1 984 384.06	0.04
USD VENTAS REALTY LP 4.12500% 15-15.01.26	1 960 000.00	1 962 260.28	0.04
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.45000% 12-01.11.22	5 000 000.00	4 905 297.40	0.11
USD VIACOM INC 3.87500% 11-15.12.21	833 000.00	838 863.32	0.02
USD VIRGINIA ELECTRIC & POWER CO 4.00000% 16-15.11.46	725 000.00	699 831.36	0.02
USD VM HOLDING SA-144A 5.37500% 17-04.05.27	730 000.00	723 795.00	0.02
USD VOLKSWAGEN GRP OF AMERICA FINANCE-144A 3.87500% 18-13.11.20	625 000.00	632 076.06	0.01

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD VOLKSWAGEN GRP OF AMERICA FINANCE-144A 4.25000% 18-13.11.23	7 175 000.00	7 257 009.54	0.16
USD WALGREEN CO 3.10000% 12-15.09.22	2 295 000.00	2 258 643.80	0.05
USD WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC 3.30000% 14-18.11.21	3 100 000.00	3 104 017.60	0.07
USD WASTE MANAGEMENT INC 3.15000% 17-15.11.27	1 700 000.00	1 648 342.92	0.04
USD WEA FIN LLC/ WESTF UK&EUR FIN PLC-144A 2.70000% 14-17.09.19	4 000 000.00	3 990 023.00	0.09
USD WEA FIN LLC/ WESTF UK&EUR FIN PLC-144A 3.75000% 14-17.09.24	605 000.00	608 081.21	0.01
USD WEA FIN LLC/ WESTF UK&EUR FIN PLC-REG-S 3.25000% 15-05.10.20	3 200 000.00	3 195 907.36	0.07
USD WELLS FARGO BANK NA 2.60000% 18-15.01.21	2 645 000.00	2 624 439.12	0.06
USD WELLTOWER INC 3.75000% 12-15.03.23	500 000.00	500 453.25	0.01
USD WELLTOWER INC 4.25000% 16-01.04.26	1 230 000.00	1 239 854.51	0.03
USD WESTPAC BANKING CORP 2.65000% 18-25.01.21	3 000 000.00	2 973 420.00	0.07
USD WILLIAMS COMPANIES INC 3.70000% 12-15.01.23	1 181 000.00	1 179 056.62	0.03
USD WILLIAMS COS INC/THE 3.75000% 17-15.06.27	4 225 000.00	4 110 538.33	0.09
USD WILLIAMS COS INC/THE 5.25000% 10-15.03.20	1 000 000.00	1 023 612.90	0.02
USD WILLIAMS COS INC/THE 4.00000% 11-15.11.21	640 000.00	646 601.67	0.01
USD WM WRIGLEY JR CO-144A 2.90000% 13-21.10.19	1 900 000.00	1 901 139.62	0.04
USD WRKCO INC-144A 3.00000% 17-15.09.24	1 630 000.00	1 541 261.73	0.03
USD WRKCO INC-144A 3.75000% 18-15.03.25	2 240 000.00	2 199 507.84	0.05
USD XYLEM INC/NY 4.87500% 12-01.10.21	500 000.00	515 105.05	0.01
USD YAMANA GOLD INC 4.95000% 14-15.07.24	1 462 000.00	1 440 508.60	0.03
USD ZAYO GROUP LLC/ CAPITAL INC-144A 5.75000% 17-15.01.27	221 000.00	213 527.99	0.00
USD ZF NORTH AMERICA CAPITAL INC-144A 4.00000% 15-29.04.20	1 518 000.00	1 513 126.34	0.03
米ドル合計		942 516 446.14	20.70

ノート、固定利付債合計	942 516 446.14	20.70
-------------	----------------	-------

ノート、変動利付債

米ドル			
USD AMERICAN EXPRESS CO 3M LIBOR+65BP 18-27.02.23	3 000 000.00	2 966 001.81	0.07
USD AT&T INC 3M LIBOR+118 BP 18-12.06.24	8 600 000.00	8 514 628.48	0.19
USD BANCO SANTANDER SA 3M LIBOR+112BP 18-12.04.23	400 000.00	394 996.00	0.01
USD BANK OF AMERICA CORP 2.738%/VAR 18-23.01.22	1 090 000.00	1 081 423.95	0.02
USD BANK OF AMERICA CORP 3.419%/VAR 18-20.12.28	9 553 000.00	9 217 007.90	0.20
USD BECTON DICKINSON & CO 3M LIBOR+87.5BP 18-29.12.20	5 740 000.00	5 714 691.31	0.13
USD BK OF AMERICA CORP 3.004%/VAR 18-20.12.23	2 861 000.00	2 824 496.38	0.06
USD BNP PARIBAS SA-REG-S 5.198%/VAR 19-10.01.30	2 650 000.00	2 755 248.99	0.06
USD CITIGROUP INC 4.044%/VAR 18-01.06.24	3 505 000.00	3 579 573.08	0.08
USD CITIZENS BANK NA/PROVIDENCE RI 3M LIBOR+95BP 18-29.03.23	9 370 000.00	9 343 468.93	0.21
USD CONAGRA BRANDS INC 3M LIBOR+50BP 17-09.10.20	2 000 000.00	1 983 480.00	0.04
USD DOMINION ENERGY INC-144A 3M LIBOR+55BP 17-01.06.19	3 000 000.00	2 999 263.41	0.07
USD DOWDUPONT INC 3M LIBOR+111BP 18-15.11.23	2 380 000.00	2 370 979.80	0.05
USD FARMERS EXCHANGE CAPITAL II-144A-SUB 6.151%/VAR 13-01.11.53	1 000 000.00	1 021 253.30	0.02
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.908%/VAR 17-05.06.23	1 030 000.00	1 008 506.27	0.02
USD HARTFORD FINANCIAL-144A-SUB 3M LIBOR+212.5BP 17-12.02.47	2 070 000.00	1 769 850.00	0.04
USD HSBC HOLDINGS PLC 3M LIBOR+65BP 18-11.09.21	7 500 000.00	7 493 572.50	0.17
USD HSBC HOLDINGS PLC 4.292%/VAR 18-12.09.26	2 120 000.00	2 146 049.08	0.05
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.559%/VAR 18-23.04.24	6 081 000.00	6 114 648.00	0.13
USD JPMORGAN CHASE & CO 4.023%/3M LIBOR+100BP 18-05.12.24	4 000 000.00	4 098 833.20	0.09
USD JPMORGAN CHASE BANK NA 2.604%/3M LIBOR+28BP 18-01.02.21	5 735 000.00	5 711 324.08	0.13
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 2.907%/3M LIBOR+81BP 17-07.11.23	3 410 000.00	3 275 673.25	0.07
USD MACQUARIE GROUP LTD-144A 3.189%/VAR 17-28.11.23	7 935 000.00	7 665 421.07	0.17
USD NATIONWIDE MUT INS-144A-SUB 5.81%/3M LIBOR+229BP 08-15.12.24	3 000 000.00	2 990 876.43	0.07
USD NEXTERA ENERGY CAP 3M LIBOR+55BP 18-28.08.21	1 000 000.00	989 533.91	0.02
USD PRUDENTIAL FINANCIAL INC-SUB 5.625%/VAR 12-15.06.43	7 090 000.00	7 342 545.80	0.16
USD REYNOLDS GROUP INC/LLC/LUX-144A 3M LIBOR+350BP 16-15.07.21	200 000.00	200 500.00	0.00
USD ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC 3M LIBOR+147BP 17-15.05.23	1 070 000.00	1 049 373.33	0.02
USD ROYAL BK OF SCOTLAND GP PLC 3.498%/VAR 17-15.05.23	1 900 000.00	1 855 254.77	0.04

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD STATE STREET CORP 3.776%/3M LIBOR+77BP 18-03.12.24	3 755 000.00	3 841 128.43	0.08
USD TEACHER INS&AN-144A-SUB 4.375%/3M LIBOR+266.1BP 14-15.09.54	400 000.00	405 956.84	0.01
USD TYSON FOODS INC 3M LIBOR+45BP 17-21.08.20	1 000 000.00	988 789.32	0.02
USD VOYA FINANCIAL INC-SUB 5.650%/VAR 13-15.05.53	1 470 000.00	1 425 900.00	0.03
USD VOYA FINANCIAL INC-SUB 4.700%/VAR 18-23.01.48	7 200 000.00	5 976 000.00	0.13
USD VULCAN MATERIALS CO 3M LIBOR+60BP 17-15.06.20	2 865 000.00	2 855 753.47	0.06
USD WELLS FARGO BANK NA 3.325%/VAR 18-23.07.21	5 500 000.00	5 518 051.00	0.12
米ドル合計		129 490 054.09	2.84
ノート、変動利付債合計		129 490 054.09	2.84
中期債券、固定利付債			
米ドル			
USD AIB GROUP PLC-144A 4.75000% 18-12.10.23	1 340 000.00	1 342 753.30	0.03
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 4.00000% 15-22.01.25	880 000.00	886 916.18	0.02
USD BNP PARIBAS-144A 3.50000% 18-01.03.23	2 105 000.00	2 086 952.05	0.05
USD BPCE SA-144A-SUB 4.62500% 14-11.07.24	4 620 000.00	4 571 835.26	0.10
USD GENERAL ELECTRIC CO 5.55000% 05-05.01.26	1 095 000.00	1 098 381.79	0.02
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 3.85000% 14-08.07.24	15 730 000.00	15 923 139.24	0.35
USD GUARDIAN LIFE GLOBAL FUNDING-144A 2.00000% 16-26.04.21	2 000 000.00	1 950 257.52	0.04
USD HYUNDAI CAPITAL AMERICA-144A 2.55000% 17-03.04.20	1 511 000.00	1 492 957.42	0.03
USD MCDONALD ' S CORP 3.35000% 18-01.04.23	2 400 000.00	2 420 725.20	0.05
USD NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CORP-144A 2.25000% 17-13.01.20	1 930 000.00	1 912 296.11	0.04
USD PNC BANK NATIONAL ASSOCIATION-SUB 2.95000% 13-30.01.23	3 500 000.00	3 442 369.35	0.08
USD PRINCIPAL LIFE GLOBAL FUNDING II-144A 2.62500% 15-19.11.20	2 000 000.00	1 988 034.96	0.04
USD RABOBANK NEDERLAND NVNY 2.50000% 16-19.01.21	4 000 000.00	3 969 082.40	0.09
USD SOCIETE GENERALE-144A 2.62500% 15-16.09.20	740 000.00	735 491.01	0.02
USD TORONTO-DOMINION BANK 2.12500% 16-07.04.21	5 000 000.00	4 919 686.75	0.11
USD TORONTO-DOMINION BANK 3.25000% 18-11.06.21	9 700 000.00	9 766 220.93	0.21
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 3.40000% 18-14.04.25	3 460 000.00	3 506 746.33	0.08
USD US BANCORP 3.95000% 18-17.11.25	3 025 000.00	3 137 729.65	0.07
USD WELLS FARGO & CO 2.60000% 15-22.07.20	4 500 000.00	4 485 070.22	0.10
USD WELLS FARGO & CO 3.00000% 15-19.02.25	3 500 000.00	3 413 836.79	0.07
USD WELLS FARGO & CO-SUB 3.45000% 13-13.02.23	1 670 000.00	1 661 913.63	0.04
米ドル合計		74 712 396.09	1.64
中期債券、固定利付債合計		74 712 396.09	1.64
中期債券、変動利付債			
米ドル			
USD AVALON BAY COMMUNITIES INC 3M LIBOR+43BP 17-15.01.21	3 000 000.00	2 978 803.65	0.07
USD BANK OF AMERICA CORP 2.881%/VAR 17-24.04.23	4 495 000.00	4 440 590.26	0.10
USD BANK OF AMERICA CORP 2.369%/VAR 17-21.07.21	6 630 000.00	6 565 735.48	0.14
USD BANK OF AMERICA CORP 3M LIBOR+79BP 18-05.03.24	3 000 000.00	2 970 000.00	0.06
USD BANK OF AMERICA CORP 3.499%/VAR 18-17.05.22	5 250 000.00	5 291 913.90	0.12
USD GENERAL ELECTRIC CO 3M LIBOR+48BP 06-15.08.36	8 476 000.00	6 094 952.68	0.13
米ドル合計		28 341 995.97	0.62
中期債券、変動利付債合計		28 341 995.97	0.62
債券、固定利付債			
米ドル			
USD ALLIANCE PIPELINE LTD-144A 6.99600% 01-31.12.19	5 600 000.00	380 156.84	0.01
USD ALTA WIND HOLDINGS LLC-144A 7.00000% 10-30.06.35	1 500 000.00	962 062.66	0.02

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD AMERICA WEST AIRLINES PASS THROUGH TRST 7.10000% 02-02.04.21	4 500 000.00	1 164 035.82	0.02
USD AMERICAN AIR 2013-2 CL B PASS TT-144A 5.60000% 14-15.07.20	4 347 000.00	1 995 854.46	0.04
USD AMERICAN AIRLINES 3.20000% 16-15.06.28	2 000 000.00	1 695 557.50	0.04
USD ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 2.50000% 12-15.07.22	3 120 000.00	3 040 330.33	0.07
USD ANTHEM INC 3.30000% 12-15.01.23	1 200 000.00	1 207 212.00	0.03
USD BNP PARIBAS 5.00000% 11-15.01.21	960 000.00	997 907.14	0.02
USD CAPITAL ONE BANK USA NA-SUB 3.37500% 13-15.02.23	8 300 000.00	8 137 391.88	0.18
USD COMCAST CORP 3.15000% 17-15.02.28	6 334 000.00	6 070 891.90	0.13
USD CONSOLIDATED EDISON CO OF NEW YORK INC 4.00000% 18-01.12.28	3 580 000.00	3 731 792.36	0.08
USD CONTINENTAL AIRLINES PASS THRU TRUST 5.98300% 07-19.04.22	3 000 000.00	2 139 629.25	0.05
USD CONTINENTAL AIRLINES PASS THROUGH TRUST 6.90300% 07-19.04.22	16 415 000.00	3 656 356.53	0.08
USD CONTINENTAL RESOURCES INC 4.50000% 13-15.04.23	7 953 000.00	8 101 728.26	0.18
USD COX ENTERPRISES INC-144A 7.37500% 97-15.07.27	280 000.00	325 873.99	0.01
USD DANONE-REG-S 2.58900% 16-02.11.23	8 910 000.00	8 569 040.05	0.19
USD DELTA AIR LINES INC PASS THROUGH TRUSTS 6.71800% 02-02.01.23	8 775 000.00	2 572 153.97	0.06
USD DELTA AIR LINES INC 6.82100% 07-10.08.22	1 700 000.00	814 522.43	0.02
USD DEUTSCHE TELEKOM INTL FINANCE BV-144A 4.37500% 18-21.06.28	1 200 000.00	1 212 566.28	0.03
USD DOW CHEMICAL CO 3.50000% 14-01.10.24	1 145 000.00	1 133 664.66	0.02
USD ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC 3.75000% 14-15.02.25	1 230 000.00	1 245 044.38	0.03
USD FARMERS INSURANCE EXCHANGE-144A-SUB 8.62500% 94-01.05.24	700 000.00	829 985.94	0.02
USD FIFTH THIRD BANCORP-SUB 4.30000% 13-16.01.24	2 200 000.00	2 254 035.52	0.05
USD FIVE CORNERS FUNDING TRUST-144A 4.41900% 13-15.11.23	11 320 000.00	11 749 796.63	0.26
USD IHO VERWALTUNGS GMBH-144A-SUB (PIK) 4.50000% 16-15.09.23	855 000.00	814 387.50	0.02
USD MAGNA INTERNATIONAL INC 3.62500% 14-15.06.24	2 800 000.00	2 822 484.84	0.06
USD METLIFE INC 4.36800% 13-15.09.23	975 000.00	1 028 119.66	0.02
USD METROPOLITAN EDISON CO-144A 4.00000% 14-15.04.25	2 400 000.00	2 434 164.24	0.05
USD MYLAN INC 4.20000% 13-29.11.23	2 190 000.00	2 157 527.12	0.05
USD NBD BANK NA MICHIGAN-SUB 8.25000% 94-01.11.24	1 300 000.00	1 603 729.40	0.03
USD NEXTERA ENERGY CAPITAL HOLDINGS INC 3.34200% 18-01.09.20	3 460 000.00	3 476 558.18	0.08
USD PEOPLES UNITED BANK-SUB 4.00000% 14-15.07.24	1 450 000.00	1 446 732.22	0.03
USD PUGET ENERGY INC 6.00000% 11-01.09.21	2 500 000.00	2 646 236.25	0.06
USD ROCHESTER GAS & ELECTRIC CORP-144A 3.10000% 17-01.06.27	2 000 000.00	1 937 600.04	0.04
USD SEAGATE HDD CAYMAN 4.87500% 17-01.03.24	5 470 000.00	5 232 424.22	0.11
USD SEALED AIR CORP-144A 5.50000% 15-15.09.25	480 000.00	490 800.00	0.01
USD SMBC AVIATION CAPITAL FINANCE DAC-144A 3.00000% 17-15.07.22	1 750 000.00	1 702 733.08	0.04
USD SUTTER HEALTH 3.69500% 18-15.08.28	9 125 000.00	9 252 509.10	0.20
USD SYDNEY AIRPORT FINANCE CO PTY LTD-144A 3.62500% 16-28.04.26	520 000.00	502 455.20	0.01
USD SYNCHRONY FINANCIAL 2.70000% 15-03.02.20	3 120 000.00	3 087 318.66	0.07
USD TENET HEALTHCARE CORP 4.50000% 13-01.04.21	115 000.00	115 230.00	0.00
USD US AIRWAYS 2012-1 CLASS A PAS THRO TRST 5.90000% 12-01.10.24	1 000 000.00	695 570.45	0.01
USD VENTAS REALTY LP/VENTAS CAP CORP 4.25000% 12-01.03.22	2 050 000.00	2 091 656.62	0.05
米ドル合計		117 525 827.56	2.58
債券、固定利付債合計		117 525 827.56	2.58
債券、変動利付債			
米ドル			
USD CITIZENS FINANCIAL GROUP INC-SUB 5.500%/VAR 15-PRP	301 000.00	302 324.40	0.01
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 4.223%/VAR 18-01.05.29	495 000.00	497 145.78	0.01
USD JP MORGAN CHASE & CO 3.514%/VAR 18-18.06.22	2 870 000.00	2 899 558.99	0.07
USD METLIFE CAPITAL TRUST IV-144A-SUB 7.875%/VAR 07-15.12.37	1 200 000.00	1 432 266.00	0.03
USD WELLS FARGO & CO-SUB 7.980%/3M LIBOR+377BP 08-PRP	1 955 000.00	1 964 775.00	0.04
米ドル合計		7 096 070.17	0.16
債券、変動利付債合計		7 096 070.17	0.16

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
財務省証券 (T-note)、固定利付債			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.12500% 18-15.11.28	32 116 300.00	33 463 678.34	0.73
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.62500% 18-31.12.23	27 055 000.00	27 279 047.86	0.60
米ドル合計		60 742 726.20	1.33
財務省証券 (T-note)、固定利付債合計		60 742 726.20	1.33
地方債、固定利付債			
米ドル			
USD CALIFORNIA, STATE OF 7.95000% 10-01.03.36	1 500 000.00	1 578 945.00	0.04
USD CALIFORNIA, STATE OF 4.60000% 18-01.04.38	3 600 000.00	3 709 224.00	0.08
USD HOUSTON TEXAS WATER & SEWER SYSTEM 3.82800% 14-15.05.28	800 000.00	826 664.00	0.02
USD LOS ANGELES DEPARTMENT OF POWER 5.51600% 10-01.07.27	1 520 000.00	1 771 088.80	0.04
USD LOS ANGELES UNIFIED SCHOOL DISTRICT 2.00000% 16-01.07.29	370 000.00	345 006.50	0.01
USD METROPOLITAN WATER DISTRICT 6.53800% 09-01.07.39	1 700 000.00	1 724 718.00	0.04
USD NEW YORK CITY TRANS FINANCE AUTH REV 5.26700% 10-01.05.27	1 400 000.00	1 564 276.00	0.03
USD NEW YORK STATE DORMITORY AUTH 5.50000% 10-15.03.30	1 765 000.00	2 026 308.25	0.05
USD RUTGERS STATE UNIVERSITY 4.14600% 18-01.05.48	5 655 000.00	5 667 667.20	0.12
USD SAN JOSE REDEVELOP AGENCY SUCCESSOR 3.07600% 17-01.08.25	1 550 000.00	1 538 731.50	0.03
USD UNIVERSITY OF CALIFORNIA 4.60100% 13-15.05.31	1 385 000.00	1 504 968.70	0.03
USD WASHINGTON, STATE OF 5.04000% 10-01.08.31	925 000.00	1 035 935.25	0.02
米ドル合計		23 293 533.20	0.51
地方債、固定利付債合計		23 293 533.20	0.51
地方債、変動利付債			
米ドル			
USD CALIFORNIA, STATE OF VAR 17-01.04.47	1 000 000.00	992 060.00	0.02
米ドル合計		992 060.00	0.02
地方債、変動利付債合計		992 060.00	0.02
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
合計		1 433 262 811.13	31.47
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されていない譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
アセット・バック証券、変動利付債			
米ドル			
USD NAVIENT STUDENT LOAN TRUST-144A VAR 16-25.06.65	1 000 000.00	1 032 893.70	0.02
USD RAMP SERIES 2006-RZ1 TRUST 1M LIBOR+40BP 06-25.03.36	2 140 000.00	502 200.49	0.01
米ドル合計		1 535 094.19	0.03
アセット・バック証券、変動利付債合計		1 535 094.19	0.03
モーゲージ・バック証券、固定利付債			
米ドル			
USD BANK 2017-BNK6-SUB 3.12500% 17-01.07.60	6 000 000.00	5 912 529.60	0.13
USD FANNIE MAE 3.11000% 15-01.06.27	770 000.00	727 056.46	0.01
USD FANNIE MAE 3.46000% 15-01.12.30	795 000.00	761 957.40	0.02

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD FANNIE MAE 3.50000% 15-01.08.30	795 000.00	760 091.27	0.02
USD FANNIE MAE 3.55000% 15-01.08.30	825 000.00	796 690.52	0.02
USD JP MORGAN CHASE COM MTG SEC TRUST-SUB 3.80460% 14-01.07.47	4 750 000.00	4 883 680.20	0.11
米ドル合計		13 842 005.45	0.31
モーゲージ・バック証券、固定利付債合計		13 842 005.45	0.31
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD AERCAP IRE CAP LTD/GLB AVIA TRUST 3.65000% 17-21.07.27	1 325 000.00	1 191 867.45	0.03
USD AIR CANADA CLASS AA PASS THR TRT-144A 3.30000% 17-15.01.30	1 750 000.00	1 631 598.79	0.04
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC 4.00000% 18-15.01.24	3 215 000.00	3 261 195.38	0.07
USD ALIMENTATION COUCHE TARD INC-144A 3.55000% 17-26.07.27	3 530 000.00	3 359 291.75	0.07
USD AMERICAN WATER CAPITAL CORP 2.95000% 17-01.09.27	3 250 000.00	3 099 517.55	0.07
USD ANHEUSER-BUSCH COS-144A 3.65000% 18-01.02.26	7 025 000.00	6 902 085.61	0.15
USD BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUT-144A 3.75000% 18-20.07.23	2 470 000.00	2 482 604.16	0.05
USD BAYER US FINANCE II LLC-144A 3.50000% 18-25.06.21	300 000.00	299 174.75	0.01
USD BAYER US FINANCE II LLC-144A 2.12500% 18-15.07.19	1 750 000.00	1 745 333.76	0.04
USD BAYLOR SCOTT & WHITE HOLDINGS 1.94700% 16-15.11.21	2 000 000.00	1 930 048.62	0.04
USD BP CAPITAL MARKETS PLC 3.21600% 18-28.11.23	3 765 000.00	3 765 754.51	0.08
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.00000% 17-01.02.28	850 000.00	807 500.00	0.02
USD CCO LLC/CAPITAL 4.20000% 17-15.03.28	1 450 000.00	1 401 068.24	0.03
USD CCO LLC/CAPITAL 5.05000% 19-30.03.29	2 342 000.00	2 391 880.85	0.05
USD CENTRAL GARDEN & PET CO 5.12500% 17-01.02.28	286 000.00	266 695.00	0.01
USD CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC-144A 8.62500% 18-15.01.24	108 000.00	111 240.00	0.00
USD CITIZENS BANK NA/PROVIDENCE RI 2.25000% 17-02.03.20	2 115 000.00	2 097 340.06	0.05
USD CITIZENS BANK NA/PROVIDENCE RI 2.20000% 17-26.05.20	4 250 000.00	4 195 299.23	0.09
USD CITIZENS BANK NA/PROVIDENCE RI 2.65000% 17-26.05.22	1 000 000.00	975 470.69	0.02
USD COMCAST CORP 3.70000% 18-15.04.24	2 385 000.00	2 441 629.20	0.05
USD COMPASS BANK 2.87500% 17-29.06.22	1 830 000.00	1 772 021.35	0.04
USD CONCHO RESOURCES INC 3.75000% 17-01.10.27	2 030 000.00	1 969 535.53	0.04
USD CUMBERLAND FARMS INC-144A 6.75000% 17-01.05.25	200 000.00	203 000.00	0.00
USD CVS HEALTH CORP 4.78000% 18-25.03.38	490 000.00	490 475.45	0.01
USD DANSKE BANK AS-144A 5.00000% 19-12.01.22	800 000.00	809 729.76	0.02
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 2.70000% 17-13.07.20	2 900 000.00	2 835 141.24	0.06
USD DIGITAL REALTY TRUST LP 3.70000% 17-15.08.27	1 560 000.00	1 497 452.58	0.03
USD DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC-144A 2.75000% 18-15.11.19	1 250 000.00	1 243 306.02	0.03
USD DXC TECHNOLOGY CO 2.87500% 17-27.03.20	2 989 000.00	2 970 961.35	0.07
USD EMERA US FINANCE LP 2.70000% 17-15.06.21	8 260 000.00	8 092 236.01	0.18
USD ENERGY TRANSFER OPERATING LP 5.25000% 19-15.04.29	1 885 000.00	1 951 250.59	0.04
USD ENSTAR GROUP LTD 4.50000% 17-10.03.22	6 870 000.00	6 921 618.43	0.15
USD EVERSOURCE ENERGY 4.25000% 18-01.04.29	2 765 000.00	2 877 376.24	0.06
USD FOX CORP-144A 4.03000% 19-25.01.24	5 225 000.00	5 329 785.28	0.12
USD FOX CORP-144A 4.70900% 19-25.01.29	4 147 000.00	4 326 202.64	0.09
USD HCA INC 5.87500% 19-01.02.29	545 000.00	570 887.50	0.01
USD HEALTHCARE TRUST OF AMERICA HOLDINGS LP 2.95000% 17-01.07.22	2 800 000.00	2 728 100.63	0.06
USD HUNTINGTON BANCSHARES INC/OH 4.00000% 18-15.05.25	4 400 000.00	4 479 130.48	0.10
USD HUNTINGTON NATIONAL BANK 2.50000% 17-07.08.22	2 610 000.00	2 543 122.35	0.06
USD IHS MARKIT LTD-144A 5.00000% 16-01.11.22	1 917 000.00	1 958 598.90	0.04
USD JACKSON NATIONAL LIFE GLOBAL FUND-REG-S 2.50000% 17-27.06.22	2 200 000.00	2 137 691.49	0.05
USD KFC HLDG/PIZZA HUT HLDG/TACO BELL-144A 4.75000% 17-01.06.27	300 000.00	290 625.00	0.01
USD MARSH & MCLENNAN COS INC 3.87500% 19-15.03.24	5 230 000.00	5 337 873.98	0.12
USD MARSH & MCLENNAN COS INC 4.37500% 19-15.03.29	6 785 000.00	7 017 935.15	0.15
USD MCKESSON CORP 4.75000% 18-30.05.29	1 415 000.00	1 463 689.87	0.03
USD NABORS INDUSTRIES INC 5.50000% 17-15.01.23	9 630 000.00	8 667 000.00	0.19
USD NEVADA POWER CO 3.70000% 19-01.05.29	2 550 000.00	2 579 177.10	0.06
USD NEXTERA ENERGY CAPITAL HOLDINGS INC 2.80000% 17-15.01.23	3 160 000.00	3 067 596.90	0.07

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD NOBLE ENERGY INC 3.85000% 17-15.01.28	2 163 000.00	2 044 498.95	0.05
USD NUVEEN LLC-REG-S 4.00000% 18-01.11.28	6 415 000.00	6 695 898.74	0.15
USD O' REILLY AUTOMOTIVE INC 4.35000% 18-01.06.28	2 415 000.00	2 448 918.92	0.05
USD ONEOK INC 4.00000% 17-13.07.27	536 000.00	521 909.96	0.01
USD PARSLEY ENERGY LLC/FINANCE CORP-144A 5.37500% 16-15.01.25	200 000.00	198 500.00	0.00
USD PROTECTIVE LIVE CORP-REG-S 4.30000% 18-30.09.28	5 700 000.00	5 753 545.23	0.13
USD REGIONS FINANCIAL CORP 2.75000% 17-14.08.22	3 750 000.00	3 659 043.00	0.08
USD SANTANDER HOLDINGS USA INC 4.45000% 18-03.12.21	1 290 000.00	1 311 605.69	0.03
USD SL GREEN OPERATING PARTNERSHIP LP 3.25000% 17-15.10.22	1 685 000.00	1 633 184.77	0.04
USD SMITHFIELD FOODS INC-REG-S 2.70000% 17-31.01.20	2 000 000.00	1 975 687.76	0.04
USD STRYKER CORP 3.65000% 18-07.03.28	1 160 000.00	1 147 974.34	0.03
USD TOTAL SYSTEM SERVICES INC 4.00000% 18-01.06.23	2 085 000.00	2 087 633.56	0.05
USD VALVOLINE INC 5.50000% 17-15.07.24	350 000.00	355 250.00	0.01
USD VIRGINIA ELECTRIC & POWER CO 3.80000% 18-01.04.28	565 000.00	570 300.21	0.01
USD WESTERN GAS PARTNERS LP 4.50000% 18-01.03.28	2 430 000.00	2 344 636.80	0.05
USD XCEL ENERGY INC 4.00000% 18-15.06.28	5 530 000.00	5 667 380.69	0.12
USD YAMANA GOLD INC 4.62500% 18-15.12.27	1 140 000.00	1 065 717.60	0.02
米ドル合計		169 969 803.64	3.73
ノート、固定利付債合計		169 969 803.64	3.73
ノート、変動利付債			
米ドル			
USD CONAGRA BRANDS INC 3M LIBOR+75BP 18-22.10.20	1 925 000.00	1 915 450.57	0.04
USD ENTERPRISE PRODUCTS-SUB 5.375%/VAR 18-15.02.78	1 975 000.00	1 715 826.34	0.04
USD GENERAL MILLS INC 3M LIBOR+101BP 18-17.10.23	1 005 000.00	999 488.11	0.02
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.272%/VAR 17-29.09.25	4 900 000.00	4 757 724.48	0.10
USD HALFMOON PARENT INC-144A 3M LIBOR+65BP 18-17.09.21	6 000 000.00	5 963 717.52	0.13
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.220%/VAR 17-01.03.25	17 153 000.00	16 868 661.41	0.37
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.509%/3M LIBOR+94.5BP 18-23.01.29	9 705 000.00	9 424 211.44	0.21
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.960%/3M LIBOR+124.5BP 19-29.01.27	3 874 000.00	3 942 519.44	0.09
USD KINDER MORGAN INC 3M LIBOR+128BP 17-15.01.23	3 175 000.00	3 164 852.22	0.07
USD MARTIN MARIETTA MATERIALS INC 3M LIBOR+65BP 17-22.05.20	1 835 000.00	1 830 115.70	0.04
USD SANTANDER UK GRP HOLD PLC 4.796%/3M LIBOR+157BP 18-15.11.24	3 710 000.00	3 760 974.28	0.08
USD WABTEC CORP 3M LIBOR+105BP 18-15.09.21	1 835 000.00	1 834 525.84	0.04
米ドル合計		56 178 067.35	1.23
ノート、変動利付債合計		56 178 067.35	1.23
中期債券、固定利付債			
米ドル			
USD AIG GLOBAL FUNDING-REG-S 1.95000% 17-18.10.19	1 595 000.00	1 587 693.99	0.03
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 3.60000% 19-11.01.24	7 570 000.00	7 658 570.51	0.17
USD RYDER SYSTEM INC 2.50000% 17-01.09.22	1 235 000.00	1 194 284.34	0.03
USD SUNTRUST BANK ATLANTA GA 3.00000% 18-02.02.23	2 515 000.00	2 484 577.70	0.05
米ドル合計		12 925 126.54	0.28
中期債券、固定利付債合計		12 925 126.54	0.28
中期債券、変動利付債			
米ドル			
USD MORGAN STANLEY 4.431%/VAR 19-23.01.30	935 000.00	968 054.03	0.02
米ドル合計		968 054.03	0.02
中期債券、変動利付債合計		968 054.03	0.02

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
債券、固定利付債			
米ドル			
USD ADVOCATE HEALTH & HOSPITALS CORP 3.82900% 18-15.08.28	980 000.00	1 002 574.11	0.02
USD ARES CAPITAL CORP 3.50000% 17-10.02.23	4 165 000.00	3 964 509.89	0.09
USD DUKE ENERGY FLORIDA LLC 3.80000% 18-15.07.28	1 575 000.00	1 606 250.68	0.03
USD ENTERGY ARKANSAS INC 4.00000% 18-01.06.28	5 500 000.00	5 547 730.10	0.12
USD NORTHWELL HEALTHCARE INC 3.39100% 17-01.11.27	8 000 000.00	7 625 912.08	0.17
米ドル合計		19 746 976.86	0.43
債券、固定利付債合計			0.43
債券、変動利付債			
米ドル			
USD ENTERPRISE PRODUCT OPERATING LP-SUB 4.875%/VAR 17-16.08.77	2 290 000.00	2 041 245.82	0.05
米ドル合計		2 041 245.82	0.05
債券、変動利付債合計			0.05
地方債、固定利付債			
米ドル			
USD FLORIDA ' S TURNPIKE ENTERPRISE 6.80000% 09-01.07.39	1 100 000.00	1 117 886.00	0.03
米ドル合計		1 117 886.00	0.03
地方債、固定利付債合計			0.03
転換社債、変動利付債			
米ドル			
USD BANK OF MONTREAL-SUB 4.338%/VAR 18-05.10.28	8 910 000.00	8 995 981.50	0.20
米ドル合計		8 995 981.50	0.20
転換社債、変動利付債合計			0.20
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されて いない譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計			6.31
			287 320 241.38
最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD AVIATION CAPITAL GROUP-144A 3.87500% 18-01.05.23	2 515 000.00	2 478 519.58	0.05
USD BRITISH AIRW CL AA PASS THR TRUST-144A 3.80000% 18-20.09.31	1 500 000.00	1 485 863.32	0.03
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 5.37500% 18-15.07.23	382 000.00	386 182.90	0.01
USD DANSKE BANK AS-144A 5.37500% 19-12.01.24	2 355 000.00	2 389 538.91	0.05
USD KEURIG DR PEPPER INC-144A 4.41700% 18-25.05.25	5 155 000.00	5 235 815.97	0.12
USD PENSKE TRUCK LEASING/PTL FIN CORP-144A 4.45000% 19-29.01.26	2 680 000.00	2 700 393.72	0.06
USD SPRINT SPECTRUM CO III LLC-144A 5.15200% 18-20.03.28	2 305 000.00	2 321 549.90	0.05
USD TRANSCOCEAN POSEIDON LTD-144A 6.87500% 19-01.02.27	106 000.00	107 643.00	0.00
USD USAA CAPITAL CORP-144A 3.00000% 18-01.07.20	5 250 000.00	5 251 374.98	0.12
USD VOLKSWAGEN GRP OF AMERICA FINANCE-144A 4.00000% 18-12.11.21	9 315 000.00	9 427 459.99	0.21
USD VOLKSWAGEN GRP OF AMERICA FINANCE-144A 4.62500% 18-13.11.25	1 445 000.00	1 459 400.01	0.03
USD WELLCARE HEALTH PLANS INC-144A 5.37500% 18-15.08.26	74 000.00	75 295.00	0.00
USD WRKCO INC-144A 4.65000% 18-15.03.26	730 000.00	751 781.74	0.02
米ドル合計		34 070 819.02	0.75
ノート、固定利付債合計			0.75

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
債券、固定利付債			
米ドル			
USD BMW US CAPITAL LLC-144A 3.10000% 18-12.04.21	2 000 000.00	1 994 391.88	0.04
米ドル合計		1 994 391.88	0.04
債券、固定利付債合計		1 994 391.88	0.04
最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		36 065 210.90	0.79
投資有価証券合計		4 389 758 800.16	96.39
派生商品			
公認の証券取引所に上場されている派生商品			
債券に係る金融先物			
USD US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 20.03.19	-29.00	-52 328.12	0.00
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 20.03.19	352.00	1 441 030.92	0.03
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 29.03.19	-345.00	-780 884.81	-0.02
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 29.03.19	208.00	300 797.29	0.01
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 20.03.19	489.00	1 728 375.69	0.04
USD US LONG BOND FUTURE 20.03.19	-173.00	-1 270 250.44	-0.03
債券に係る金融先物合計		1 366 740.53	0.03
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		1 366 740.53	0.03
派生商品合計		1 366 740.53	0.03
先渡為替契約			
先渡為替契約 (購入 / 売却)			
GBP 64 725 878.78	USD 83 378 000.00	22.2.2019	1 852 551.76
EUR 1 080 179 026.02	USD 1 241 965 000.00	22.2.2019	-422 544.48
CHF 1 034 342 028.14	USD 1 056 336 000.00	22.2.2019	-11 799 797.50
EUR 18 357 927.13	USD 21 000 000.00	22.2.2019	100 341.13
CHF 17 822 574.00	USD 18 000 000.00	22.2.2019	-1 771.89
GBP 1 215 304.02	USD 1 600 000.00	22.2.2019	303.22
先渡為替契約 (購入 / 売却) 合計			-10 270 917.76
現金預金、要求払預金および預託金勘定ならびにその他の流動資産		122 693 355.20	2.69
その他の資産および負債		50 470 528.33	1.12
純資産総額		4 554 018 506.46	100.00

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
無記名株式			
アメリカ合衆国			
USD APPROACH RESOURCES COM STK USD0.01	19 105.00	18 403.85	0.00
アメリカ合衆国合計		18 403.85	0.00
無記名株式合計		18 403.85	0.00
財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 20.09.18-21.03.19	1 000 000.00	996 866.67	0.02
米ドル合計		996 866.67	0.02
財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン合計		996 866.67	0.02
アセット・バック証券、固定利付債			
ユーロ			
EUR CRC BREEZE FINANCE SA 5.29000% 06-08.05.26	1 550 000.00	781 578.74	0.02
EUR CRC BREEZE FINANCE SA 6.11000% 06-08.05.26	550 000.00	153 918.79	0.00
EUR CRC BREEZE FINANCE SA 6.70800% 07-19.04.27	900 000.00	280 941.47	0.01
EUR CRC BREEZE FINANCE SA 4.52400% 07-19.04.27	4 100 000.00	1 922 846.28	0.05
ユーロ合計		3 139 285.28	0.08
アセット・バック証券、固定利付債合計		3 139 285.28	0.08
ノート、固定利付債			
スイスフラン			
CHF SELECTA GROUP BV-REG-S 5.87500% 18-01.02.24	1 375 000.00	1 358 230.02	0.03
スイスフラン合計		1 358 230.02	0.03
ユーロ			
EUR 3AB OPTIQUE DEVELOPPEMENT SAS-REG-S 4.00000% 17-01.10.23	2 485 000.00	2 737 272.86	0.07
EUR ADIENT GLOBAL HOLDINGS LTD-REG-S 3.50000% 16-15.08.24	2 000 000.00	1 731 547.94	0.04
EUR ALGECO SCOTSMAN GLOBAL FINANCE-REG-S 6.50000% 18-15.02.23	3 573 000.00	4 130 587.64	0.10
EUR ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP-REG-S 5.25000% 15-15.11.23	4 442 000.00	5 141 571.41	0.12
EUR ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP-REG-S 4.50000% 17-15.03.22	1 710 000.00	1 985 123.03	0.05
EUR ALTICE FINCO SA-REG-S 9.00000% 13-15.06.23	500 000.00	596 674.00	0.01
EUR ALTICE FINCO SA-REG-S 4.75000% 17-15.01.28	1 250 000.00	1 182 418.53	0.03
EUR ALTICE FRANCE-REG-S 5.87500% 18-01.02.27	5 210 000.00	6 023 051.11	0.14
EUR ARAMARK INTERNATIONAL FIN SARL-REG-S 3.12500% 17-01.04.25	500 000.00	587 350.97	0.01
EUR ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-REG-S 4.12500% 16-15.05.23	4 950 000.00	5 836 528.52	0.14
EUR ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-REG-S 6.75000% 16-15.05.24	4 260 000.00	5 163 583.52	0.12
EUR AVANTOR INC-REG-S 4.75000% 17-01.10.24	1 160 000.00	1 370 925.08	0.03
EUR AVIS BUDGET FINANCE PLC-REG-S 4.75000% 18-30.01.26	3 325 000.00	3 643 584.04	0.09
EUR BALL CORP 4.37500% 15-15.12.23	6 806 000.00	8 809 166.42	0.21
EUR BANIJAY GROUP SAS-REG-S 4.00000% 17-01.07.22	300 000.00	352 840.87	0.01
EUR BLITZ F18-674 GMBH-REG-S 6.00000% 18-30.07.26	2 175 000.00	2 492 584.12	0.06
EUR CEMEX SAB DE CV-REG-S 4.37500% 15-05.03.23	5 250 000.00	6 159 655.03	0.15
EUR CEMEX SAB DE CV-REG-S 2.75000% 17-05.12.24	1 910 000.00	2 114 922.48	0.05
EUR COTY INC-REG-S 4.00000% 18-15.04.23	1 175 000.00	1 247 606.61	0.03
EUR COTY INC-REG-S 4.75000% 18-15.04.26	1 800 000.00	1 830 469.62	0.04
EUR CROWN EUROPEAN HOLDINGS SA-REG-S 2.25000% 18-01.02.23	3 463 000.00	4 062 707.90	0.10

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR DIAMOND BC BV-REG-S 5.62500% 17-15.08.25	1 050 000.00	1 069 882.38	0.03
EUR DIGI COMMUNICATIONS NV-REG-S 5.00000% 16-15.10.23	1 740 000.00	2 074 279.21	0.05
EUR DKT FINANCE APS-REG-S 7.00000% 18-17.06.23	8 875 000.00	10 998 308.25	0.26
EUR DUFYR FINANCE SCA-REG-S 4.50000% 15-01.08.23	5 225 000.00	6 195 076.34	0.15
EUR DUFYR ONE BV-REG-S 2.50000% 17-15.10.24	900 000.00	1 031 283.39	0.02
EUR EDREAMS ODIGEO SA-REG-S 5.50000% 18-01.09.23	1 320 000.00	1 461 985.32	0.03
EUR EL CORTE INGLES SA-REG-S 3.00000% 18-15.03.24	5 540 000.00	6 469 389.64	0.15
EUR EQUINIX INC 2.87500% 17-01.02.26	1 300 000.00	1 466 773.86	0.04
EUR EQUINIX INC 2.87500% 18-15.03.24	3 300 000.00	3 829 184.08	0.09
EUR EUROPCAR MOBILITY GROUP-REG-S 5.75000% 15-15.06.22	5 550 000.00	6 527 556.18	0.16
EUR EUROPCAR MOBILITY GROUP-REG-S 4.12500% 17-15.11.24	3 957 000.00	4 438 299.31	0.11
EUR FINANCIAL & RISK US HOLDINGS INC-REG-S 6.87500% 18-15.11.26	3 000 000.00	3 137 702.03	0.07
EUR FINANCIAL & RISK US HOLDINGS INC-REG-S 4.50000% 18-15.05.26	5 950 000.00	6 661 013.80	0.16
EUR GALAPAGOS HOLDING SA-REG-S 7.00000% 14-15.06.22	600 000.00	131 566.62	0.00
EUR GARRETT LX 1 SARL/BORROWING LLC-REG-S 5.12500% 18-15.10.26	3 850 000.00	3 843 383.77	0.09
EUR GETLINK SE-REG-S 3.62500% 18-01.10.23	5 070 000.00	5 919 317.34	0.14
EUR INFOR US INC 5.75000% 16-15.05.22	3 600 000.00	4 244 706.71	0.10
EUR INTERNATIONAL DESIGN GROUP SPA-REG-S 6.50000% 18-15.11.25	4 895 000.00	5 349 971.28	0.13
EUR INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC-REG-S 4.75000% 15-15.02.23	5 150 000.00	6 314 927.38	0.15
EUR INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC-REG-S 3.50000% 18-15.07.24	2 750 000.00	3 112 888.41	0.07
EUR INTERTRUST GROUP BV-REG-S 3.37500% 18-15.11.25	2 730 000.00	3 129 781.87	0.07
EUR INTERXION HOLDING NV-REG-S 4.75000% 18-15.06.25	11 686 000.00	14 040 669.35	0.34
EUR JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-REG-S 4.50000% 18-15.01.26	1 550 000.00	1 403 295.32	0.03
EUR JAMES HARDIE INTERNATIONAL LTD-REG-S 3.62500% 18-01.10.26	2 560 000.00	2 886 971.73	0.07
EUR KLEOPATRA HOLDGS 1 SCA-REG-S (PIK) 8.50000% 17-30.06.23	2 800 000.00	1 596 829.97	0.04
EUR KRONOS INTERNATIONAL INC-REG-S 3.75000% 17-15.09.25	3 495 000.00	3 668 456.47	0.09
EUR LA FINANCIERE ATALIAN SA-REG-S 5.12500% 18-15.05.25	3 630 000.00	3 217 650.60	0.08
EUR LHMC FINCO SARL-REG-S 6.25000% 18-20.12.23	690 000.00	823 378.45	0.02
EUR LINCOLN FINANCE LTD-REG-S 6.87500% 16-15.04.21	5 307 000.00	6 249 409.00	0.15
EUR LOXAM SAS-REG-S 4.87500% 14-23.07.21	875 000.00	594 012.91	0.01
EUR MATTERHORN TELECOM SA-REG-S 4.00000% 17-15.11.27	2 350 000.00	2 508 075.56	0.06
EUR NETFLIX INC 3.62500% 17-15.05.27	3 610 000.00	4 126 644.91	0.10
EUR NETFLIX INC-REG-S 4.62500% 18-15.05.29	11 900 000.00	13 757 064.91	0.33
EUR NIDDA BONDCO GMBH-REG-S 5.00000% 17-30.09.25	850 000.00	896 248.69	0.02
EUR NIDDA HEALTHCARE HOLDING AG-REG-S 3.50000% 17-30.09.24	7 375 000.00	8 247 413.06	0.20
EUR NITROGENMUVEK RT-REG-S 7.00000% 18-14.05.25	1 110 000.00	1 128 789.60	0.03
EUR NOMAD FOODS BONDCO PLC-REG-S 3.25000% 17-15.05.24	2 600 000.00	3 015 192.10	0.07
EUR PERSTORP HOLDING AB-REG-S 7.62500% 16-30.06.21	4 750 000.00	4 525 129.71	0.11
EUR PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 4.75000% 14-14.01.25	350 000.00	438 254.19	0.01
EUR PIAGGIO & C SPA-REG-S 3.62500% 18-30.04.25	1 930 000.00	2 260 088.08	0.05
EUR PICARD BONDCO SA-REG-S 5.50000% 17-30.11.24	1 900 000.00	1 874 933.30	0.04
EUR PLAYTECH PLC-REG-S 3.75000% 18-12.10.23	1 300 000.00	1 472 293.09	0.04
EUR PRAGUE CE SARL-REG-S-SUB (PIK)10.00000% 17-15.12.22	4 000 000.00	4 635 239.02	0.11
EUR PROGROU AG-REG-S 3.00000% 18-31.03.26	5 500 000.00	6 277 842.39	0.15
EUR PROMONTORIA HOLDING-REG-S 6.75000% 18-15.08.23	2 210 000.00	2 510 505.86	0.06
EUR PSPC ESCROW CORP-REG-S 6.00000% 15-01.02.23	3 300 000.00	3 904 726.45	0.09
EUR PVH CORP-REG-S 3.12500% 17-15.12.27	2 500 000.00	2 785 230.88	0.07
EUR QUINTILES IMS INC-REG-S 2.87500% 17-15.09.25	4 075 000.00	4 629 100.16	0.11
EUR RAFFINERIE HEIDE GMBH-REG-S 6.37500% 17-01.12.22	1 460 000.00	1 457 517.79	0.03
EUR REKEEP SPA-REG-S 9.00000% 17-15.06.22	1 300 000.00	1 219 034.81	0.03
EUR SCHAEFFLER FINANCE BV-REG-S 3.25000% 15-15.05.25	2 500 000.00	2 925 801.28	0.07
EUR SCIENTIFIC GAMES INTERNATIONAL-REG-S 5.50000% 18-15.02.26	1 400 000.00	1 389 561.95	0.03
EUR SELECTA GROUP BV-REG-S 5.87500% 18-01.02.24	2 225 000.00	2 495 121.41	0.06
EUR SILGAN HOLDINGS INC 3.25000% 18-15.03.25	1 760 000.00	2 074 321.56	0.05
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 3.12500% 17-19.09.25	1 700 000.00	1 882 235.68	0.05
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 4.00000% 17-19.09.29	1 850 000.00	1 968 456.21	0.05
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 5.00000% 18-15.04.28	4 281 000.00	4 987 194.13	0.12
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 4.00000% 18-20.04.23	1 950 000.00	2 355 042.45	0.06

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 4.50000% 18-20.04.25	1 575 000.00	1 877 697.80	0.04
EUR SPCM SA-REG-S 2.87500% 15-15.06.23	2 600 000.00	3 013 120.18	0.07
EUR TELE COLUMBUS AG-REG-S 3.87500% 18-02.05.25	1 000 000.00	1 046 049.84	0.03
EUR TELENET FINANCE LUXEMBOURG-REG-S 3.50000% 17-01.03.28	3 700 000.00	4 193 556.84	0.10
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 3.25000% 18-15.04.22	910 000.00	1 080 151.48	0.03
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 4.50000% 18-01.03.25	1 165 000.00	1 399 801.70	0.03
EUR THOMAS COOK GROUP PLC-REG-S 6.25000% 16-15.06.22	2 050 000.00	1 858 060.05	0.04
EUR THYSSENKRUPP AG-REG-S 1.37500% 17-03.03.22	2 100 000.00	2 391 307.60	0.06
EUR UNILABS SUBHOLDING AB-REG-S 5.75000% 17-15.05.25	567 000.00	624 677.80	0.02
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 4.37500% 17-01.07.22	2 400 000.00	2 760 758.37	0.07
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 4.87500% 17-01.07.24	750 000.00	862 738.97	0.02
EUR VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-REG-S 4.50000% 15-15.05.23	12 402 000.00	14 072 344.40	0.34
EUR VERITAS US INC / BERMUDA LTD-REG-S 7.50000% 16-01.02.23	2 925 000.00	2 936 754.84	0.07
EUR VIRIDIAN GROUP FIN/ POWER & ENER-REG-S 4.00000% 17-15.09.25	1 275 000.00	1 415 041.65	0.03
EUR WIND TRE SPA-REG-S 2.62500% 17-20.01.23	8 050 000.00	8 322 290.53	0.20
EUR WIND TRE SPA-REG-S 3.12500% 17-20.01.25	3 920 000.00	3 963 866.02	0.09
EUR WMG ACQUISITION CORP-REG-S 3.62500% 18-15.10.26	3 375 000.00	3 869 855.44	0.09
ユーロ合計		336 523 255.41	8.03
英ポンド			
GBP ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-REG-S 4.75000% 17-15.07.27	2 750 000.00	3 282 869.91	0.08
GBP CPUK FINANCE LTD-REG-S 4.87500% 17-28.08.25	250 000.00	316 120.93	0.01
GBP EI GROUP PLC-REG-S 7.50000% 18-15.03.24	640 000.00	851 857.97	0.02
GBP HEATHROW FINANCE PLC-REG-S 5.75000% 14-03.03.25	2 058 000.00	2 808 797.17	0.07
GBP LA FINANCIERE ATALIAN SA-REG-S 6.62500% 18-15.05.25	2 225 000.00	2 187 840.00	0.05
GBP OCADO GROUP PLC-REG-S 4.00000% 17-15.06.24	590 000.00	772 197.31	0.02
GBP PINNACLE BIDCO PLC-REG-S 6.37500% 18-15.02.25	2 225 000.00	2 940 983.79	0.07
GBP SHOP DIRECT FUNDING PLC-REG-S 7.75000% 17-15.11.22	700 000.00	794 905.57	0.02
GBP STONEGATE PUB CO FIN PLC-REG-S 4.87500% 17-15.03.22	2 200 000.00	2 801 382.32	0.06
GBP VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC-REG-S 5.50000% 14-15.01.25	2 500 000.00	2 996 759.53	0.07
英ポンド合計		19 753 714.50	0.47
米ドル			
USD ACADIA HEALTHCARE CO INC 6.50000% 16-01.03.24	1 050 000.00	1 034 250.00	0.02
USD ADVANCED MICRO DEVICES INC 7.50000% 13-15.08.22	500 000.00	542 500.00	0.01
USD AECOM GLOBAL II LLC/URS FOX US LP STEP-UP/DOWN 14-01.04.22	2 480 000.00	2 480 000.00	0.06
USD AECOM TECHNOLOGY CORP 5.12500% 17-15.03.27	3 970 000.00	3 741 725.00	0.09
USD AES CORP 4.00000% 18-15.03.21	3 720 000.00	3 710 700.00	0.09
USD AES CORP 4.50000% 18-15.03.23	540 000.00	542 700.00	0.01
USD AES CORP 5.50000% 15-15.04.25	1 031 000.00	1 061 930.00	0.03
USD AES CORP 6.00000% 16-15.05.26	2 710 000.00	2 855 662.50	0.07
USD AKER BP ASA-144A 5.87500% 18-31.03.25	2 040 000.00	2 091 000.00	0.05
USD ALGECO SCOTSMAN GLOBAL FINANCE-144A 8.00000% 18-15.02.23	246 000.00	239 235.00	0.01
USD ALTICE FINANCING SA-144A 6.62500% 15-15.02.23	1 750 000.00	1 759 275.00	0.04
USD ALTICE FRANCE-144A 7.37500% 16-01.05.26	9 947 000.00	9 586 321.78	0.23
USD AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC-SUB 5.75000% 15-15.06.25	3 314 000.00	3 056 833.60	0.07
USD AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC-SUB 5.87500% 17-15.11.26	2 155 000.00	1 939 500.00	0.05
USD AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC-SUB 6.12500% 17-15.05.27	2 350 000.00	2 091 500.00	0.05
USD AMC NETWORKS INC 4.75000% 17-01.08.25	1 600 000.00	1 546 000.00	0.04
USD AMC NETWORKS INC 5.00000% 16-01.04.24	150 000.00	148 875.00	0.00
USD AMERICAN AXLE & MANUFACTURING INC 6.25000% 18-15.03.26	1 900 000.00	1 824 000.00	0.04
USD AMERICAN EQTY INVT LIFE HLD 5.00000% 17-15.06.27	3 325 000.00	3 317 486.39	0.08
USD AMERIGAS FINANCE LLC/AMERIGAS FIN CORP 5.62500% 16-20.05.24	2 100 000.00	2 073 750.00	0.05
USD AMERIGAS PARTNERS LP/FINANCE CORP 5.50000% 16-20.05.25	1 515 000.00	1 484 700.00	0.04
USD AMERIGAS PARTNERS LP/FINANCE CORP 5.75000% 17-20.05.27	3 645 000.00	3 480 975.00	0.08
USD ANIXTER INC 5.12500% 14-01.10.21	950 000.00	965 437.50	0.02
USD ANIXTER INC 5.50000% 16-01.03.23	250 000.00	255 000.00	0.01
USD ANTERO RESOURCES CORP 5.62500% 15-01.06.23	5 876 000.00	5 861 310.00	0.14

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD ANTERO RESOURCES CORP 5.0000% 17-01.03.25	1 227 000.00	1 184 055.00	0.03
USD ARAMARK SERVICES INC 5.12500% 15-15.01.24	960 000.00	969 993.60	0.02
USD ARCONIC INC 5.40000% 11-15.04.21	425 000.00	432 437.50	0.01
USD ARCONIC INC 6.15000% 10-15.08.20	2 400 000.00	2 466 000.00	0.06
USD ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-144A 4.62500% 16-15.05.23	2 800 000.00	2 800 000.00	0.07
USD ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-144A 7.25000% 16-15.05.24	4 663 000.00	4 820 376.25	0.12
USD ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-144A 6.00000% 17-15.02.25	680 000.00	661 300.00	0.02
USD B&G FOODS INC 5.25000% 17-01.04.25	1 640 000.00	1 608 020.00	0.04
USD BALL CORP 4.00000% 13-15.11.23	510 000.00	511 224.00	0.01
USD BANFF MERGER SUB INC-144A 9.75000% 18-01.09.26	1 475 000.00	1 404 937.50	0.03
USD BARRY CALLEBAUT SERVICES NV-REG-S 5.50000% 13-15.06.23	1 954 000.00	2 025 027.90	0.05
USD BAUSCH HEALTH COS INC-REG-S 6.50000% 17-15.03.22	1 600 000.00	1 654 000.00	0.04
USD BCP SINGAPORE VI CAYMAN FIN CO LTD-144A 8.00000% 14-15.04.21	2 613 000.00	2 335 368.75	0.06
USD BEAZER HOMES USA INC 7.25000% 13-01.02.23	30 000.00	28 425.00	0.00
USD BLUE CUBE SPINCO INC 9.75000% 16-15.10.23	1 160 000.00	1 293 400.00	0.03
USD BLUE CUBE SPINCO INC 10.00000% 16-15.10.25	3 900 000.00	4 455 750.00	0.11
USD BOMBARDIER INC-144A 8.75000% 16-01.12.21	2 421 000.00	2 570 012.55	0.06
USD BOYD GAMING CORP 6.37500% 17-01.04.26	1 150 000.00	1 173 000.00	0.03
USD CABLEVISION SYSTEMS CORP 8.00000% 10-15.04.20	2 450 000.00	2 548 000.00	0.06
USD CABLEVISION SYSTEMS CORP 5.87500% 12-15.09.22	3 565 000.00	3 582 825.00	0.09
USD CALIFORNIA RESOURCES CORP 6.00000% 15-15.11.24	805 000.00	571 550.00	0.01
USD CALPINE CORP 5.50000% 15-01.02.24	120 000.00	113 550.00	0.00
USD CAPITAL ONE FINANCIAL CORP-SUB 3.75000% 16-28.07.26	750 000.00	714 331.39	0.02
USD CDK GLOBAL INC 5.87500% 18-15.06.26	1 969 000.00	2 016 354.45	0.05
USD CEDAR FAIR LP/CANADA WL CO/MMC/MOP 5.37500% 18-15.04.27	650 000.00	645 937.50	0.02
USD CEDAR FAIR LP/CANADAS WONDERLAND 5.37500% 15-01.06.24	2 020 000.00	2 030 100.00	0.05
USD CENTENE CORP 4.75000% 16-15.01.25	2 220 000.00	2 250 525.00	0.05
USD CENTURYLINK INC 5.62500% 15-01.04.25	1 000 000.00	905 000.00	0.02
USD CENTURYLINK INC 6.45000% 11-15.06.21	2 100 000.00	2 137 380.00	0.05
USD CENTURYLINK INC 6.75000% 13-01.12.23	3 958 000.00	3 982 737.50	0.10
USD CENTURYLINK INC 7.50000% 16-01.04.24	1 645 000.00	1 669 675.00	0.04
USD CENTURYLINK INC 7.65000% 12-15.03.42	1 100 000.00	911 955.00	0.02
USD CF INDUSTRIES INC 4.95000% 13-01.06.43	1 400 000.00	1 160 670.00	0.03
USD CF INDUSTRIES INC 5.37500% 14-15.03.44	1 095 000.00	951 609.75	0.02
USD CHEMOURS CO/THE 7.00000% 16-15.05.25	1 815 000.00	1 894 406.25	0.05
USD CHESAPEAKE ENERGY CORP 5.37500% 13-15.06.21	850 000.00	829 812.50	0.02
USD CHESAPEAKE ENERGY CORP 5.75000% 13-15.03.23	1 850 000.00	1 739 000.00	0.04
USD CINEMARK USA INC 4.87500% 13-01.06.23	2 355 000.00	2 331 450.00	0.06
USD CIT GROUP INC 4.12500% 18-09.03.21	2 465 000.00	2 471 162.50	0.06
USD CIT GROUP INC-SUB 6.12500% 18-09.03.28	2 220 000.00	2 353 200.00	0.06
USD CITIGROUP INC-SUB 4.12500% 16-25.07.28	1 000 000.00	991 501.05	0.02
USD CLEARWATER SEAFOODS INC-144A 6.87500% 17-01.05.25	2 786 000.00	2 681 525.00	0.06
USD COLUMBIA HCA HEALTHCARE CORP 7.69000% 95-15.06.25	1 970 000.00	2 167 000.00	0.05
USD COOPER-STANDARD AUTOMOTIVE INC-144A 5.62500% 16-15.11.26	1 180 000.00	1 064 950.00	0.03
USD COVANTA HOLDING CORP 5.87500% 17-01.07.25	1 635 000.00	1 602 300.00	0.04
USD CRESTWOOD MIDSTREAM PART LP/FIN 6.25000% 16-01.04.23	6 644 000.00	6 702 135.00	0.16
USD CRESTWOOD MIDSTREAM PART LP/FIN 5.75000% 17-01.04.25	400 000.00	392 120.00	0.01
USD CSC HOLDINGS LLC 6.75000% 11-15.11.21	2 000 000.00	2 100 600.00	0.05
USD DAVITA INC 5.12500% 14-15.07.24	1 400 000.00	1 382 920.00	0.03
USD DAVITA INC 5.75000% 12-15.08.22	1 700 000.00	1 727 625.00	0.04
USD DIAMOND OFFSHORE DRILLING 5.70000% 09-15.10.39	700 000.00	479 500.00	0.01
USD DISH DBS CORP 6.75000% 11-01.06.21	3 288 000.00	3 348 860.88	0.08
USD DRAX FINCO PLC-144A 6.62500% 18-01.11.25	1 150 000.00	1 144 250.00	0.03
USD ENCOMPASS HEALTH CORP 5.75000% 16-15.09.25	8 025 000.00	8 105 250.00	0.19
USD ENERGY TRANSFER EQUITY LP 5.87500% 13-15.01.24	50 000.00	53 125.00	0.00
USD ENSCO PLC 5.75000% 14-01.10.44	1 105 000.00	721 012.50	0.02
USD FERRELLGAS L.P/FIN CORP 6.75000% 16-15.06.23	675 000.00	589 781.25	0.01
USD FIRST QUANTUM MINERALS LTD-144A 7.25000% 17-01.04.23	913 000.00	874 206.63	0.02
USD FREEPORT-MCMORAN INC 3.55000% 12-01.03.22	3 600 000.00	3 483 000.00	0.08

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD FREEPORT-MCMORAN INC 4.55000% 14-14.11.24	285 000.00	273 243.75	0.01
USD GENESIS ENERGY LP 6.50000% 17-01.10.25	6 497 000.00	6 139 665.00	0.15
USD GROUP 1 AUTOMOTIVE INC 5.00000% 15-01.06.22	500 000.00	495 625.00	0.01
USD GULFPORT ENERGY CORP 6.00000% 17-15.10.24	400 000.00	376 000.00	0.01
USD HALYARD HEALTH INC 6.25000% 15-15.10.22	2 400 000.00	2 442 000.00	0.06
USD HCA INC 5.37500% 18-01.09.26	3 510 000.00	3 592 274.40	0.09
USD HCA INC 5.62500% 18-01.09.28	1 725 000.00	1 783 753.50	0.04
USD HCA INC 5.87500% 15-15.02.26	3 610 000.00	3 808 550.00	0.09
USD HCA INC 6.50000% 11-15.02.20	3 200 000.00	3 288 000.00	0.08
USD HCA INC 7.50000% 11-15.02.22	11 049 000.00	12 098 655.00	0.29
USD HILTON WORLDWIDE FIN LLC/CORP 4.62500% 17-01.04.25	640 000.00	630 400.00	0.02
USD HILTON WORLDWIDE FIN LLC/CORP 4.87500% 17-01.04.27	2 150 000.00	2 125 382.50	0.05
USD HOSPITALITY PROPERTIES TRUST 4.95000% 17-15.02.27	350 000.00	339 054.28	0.01
USD HUNTSMAN INTERNATIONAL LLC 4.87500% 12-15.11.20	1 230 000.00	1 251 525.00	0.03
USD ICAHN ENTERPRISES LP/FINANCE CORP 6.25000% 17-01.02.22	2 335 000.00	2 398 488.65	0.06
USD ICAHN ENTERPRISES LP/FINANCE CORP 6.75000% 17-01.02.24	3 750 000.00	3 862 500.00	0.09
USD INEOS GROUP HOLDINGS SA-144A 5.62500% 16-01.08.24	5 000 000.00	4 797 350.00	0.11
USD INMARSAT FINANCE PLC-144A 4.87500% 14-15.05.22	1 495 000.00	1 446 412.50	0.03
USD INMARSAT FINANCE PLC-144A 6.50000% 16-01.10.24	2 602 000.00	2 523 940.00	0.06
USD KB HOME 7.50000% 12-15.09.22	650 000.00	689 812.50	0.02
USD L BRANDS INC 6.87500% 15-01.11.35	880 000.00	754 600.00	0.02
USD LAREDO PETROLEUM 6.25000% 15-15.03.23	2 800 000.00	2 680 160.00	0.06
USD LENNAR CORP 4.50000% 17-30.04.24	980 000.00	962 850.00	0.02
USD LENNAR CORP 4.75000% 16-01.04.21	850 000.00	859 562.50	0.02
USD LENNAR CORP 4.75000% 18-29.11.27	1 025 000.00	971 187.50	0.02
USD LEVEL 3 FINANCING INC 5.37500% 16-01.05.25	300 000.00	296 250.00	0.01
USD LEVEL 3 FINANCING INC 5.37500% 16-15.01.24	4 720 000.00	4 696 400.00	0.11
USD LINCOLN FINANCE LTD-144A 7.37500% 16-15.04.21	2 200 000.00	2 222 000.00	0.05
USD M/I HOMES INC 5.62500% 17-01.08.25	1 270 000.00	1 168 400.00	0.03
USD MALLINCKRODT INTERNATIONAL FINANCE 4.75000% 14-15.04.23	2 000 000.00	1 535 000.00	0.04
USD MANITOWOC FOODSERVICE INC 9.50000% 16-15.02.24	6 835 000.00	7 330 537.50	0.17
USD MATTEL INC 2.35000% 16-15.08.21	750 000.00	695 625.00	0.02
USD MDC HOLDINGS INC 6.00000% 13-15.01.43	2 820 000.00	2 333 550.00	0.06
USD MGM RESORTS INTL 5.25000% 13-31.03.20	1 050 000.00	1 065 750.00	0.03
USD MGM RESORTS INTL 7.75000% 12-15.03.22	1 500 000.00	1 629 375.00	0.04
USD MGM RESORTS INTL-144A 6.62500% 12-15.12.21	3 150 000.00	3 327 030.00	0.08
USD MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA-144A 5.12500% 17-15.01.28	3 250 000.00	3 063 125.00	0.07
USD MPT OPERATING PARTNERSHIP LP/FIN CORP 5.00000% 17-15.10.27	8 595 000.00	8 367 232.50	0.20
USD MSCI INC-144A 4.75000% 16-01.08.26	3 150 000.00	3 138 187.50	0.07
USD MURPHY OIL USA INC 5.62500% 17-01.05.27	245 000.00	241 325.00	0.01
USD MURPHY OIL USA INC 6.00000% 14-15.08.23	1 500 000.00	1 522 500.00	0.04
USD NAVIENT CORP 5.87500% 15-25.03.21	2 100 000.00	2 141 328.00	0.05
USD NAVIENT CORP 7.25000% 16-25.09.23	490 000.00	498 575.00	0.01
USD NCR CORP 5.87500% 14-15.12.21	2 831 000.00	2 841 616.25	0.07
USD NEPTUNE ENERGY BONDCO PLC-144A 6.62500% 18-15.05.25	2 550 000.00	2 463 937.50	0.06
USD NOBLE HOLDING INTERNATIONAL LTD 7.75000% 16-15.01.24	1 050 000.00	882 000.00	0.02
USD NOKIA CORP 5.37500% 09-15.05.19	1 726 000.00	1 732 472.50	0.04
USD NOKIA OYJ 3.37500% 17-12.06.22	550 000.00	541 062.50	0.01
USD NRG ENERGY INC 5.75000% 18-15.01.28	1 235 000.00	1 251 055.00	0.03
USD NRG ENERGY INC 7.25000% 17-15.05.26	3 035 000.00	3 280 228.00	0.08
USD OASIS PETROLEUM INC 6.87500% 12-15.01.23	812 000.00	804 895.00	0.02
USD OCI NV-144A 6.62500% 18-15.04.23	1 125 000.00	1 155 937.50	0.03
USD OXFORD FINANCE LLC/ ISSUER II INC-144A 6.37500% 17-15.12.22	1 000 000.00	1 012 500.00	0.02
USD PISCES MIDCO INC-144A 8.00000% 18-15.04.26	1 475 000.00	1 395 718.75	0.03
USD PRECISION DRILLING CORP 6.50000% 12-15.12.21	65 000.00	42 425.93	0.00
USD PULTEGROUP INC 5.00000% 16-15.01.27	2 980 000.00	2 867 318.75	0.07
USD QEP RESOURCES INC 5.37500% 12-01.10.22	600 000.00	590 130.00	0.01
USD QEP RESOURCES INC 5.62500% 17-01.03.26	4 441 000.00	4 263 360.00	0.10
USD RANGE RESOURCES CORP 4.87500% 16-15.05.25	1 550 000.00	1 398 875.00	0.03

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD RANGE RESOURCES CORP 5.87500% 17-01.07.22	250 000.00	250 625.00	0.01
USD RANGE RESOURCES CORP 5.75000% 17-01.06.21	2 771 000.00	2 784 855.00	0.07
USD REVLON CONSUMER PRODUCTS CORP 6.25000% 16-01.08.24	1 730 000.00	947 175.00	0.02
USD REYNOLDS GROUP INC/LLC/LUX 5.75000% 12-15.10.20	5 295 000.00	5 150 924.75	0.12
USD RHP HOTEL PROPERTIES/RHP FINANCE 5.00000% 15-15.04.23	637 000.00	639 388.75	0.02
USD ROWAN COS INC 4.87500% 12-01.06.22	3 970 000.00	3 515 633.50	0.08
USD ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC-SUB 6.12500% 12-15.12.22	500 000.00	525 542.20	0.01
USD SALLY HOLDINGS LLC/SALLY CAPITAL INC 5.62500% 15-01.12.25	2 090 000.00	2 036 705.00	0.05
USD SCHAEFFLER FINANCE BV-144A 4.75000% 15-15.05.23	1 550 000.00	1 534 500.00	0.04
USD SCHAEFFLER FINANCE BV-REG-S 4.75000% 15-15.05.23	990 000.00	980 100.00	0.02
USD SEMGRP/ROSE ROCK FIN CORP 5.62500% 15-15.11.23	2 588 000.00	2 406 840.00	0.06
USD SIGMA HOLDCO BV-144A 7.87500% 18-15.05.26	1 758 000.00	1 561 543.50	0.04
USD SM ENERGY CO 6.62500% 18-15.01.27	410 000.00	399 741.80	0.01
USD SM ENERGY CO 6.75000% 16-15.09.26	3 952 000.00	3 893 312.80	0.09
USD SPCM SA-144A 4.87500% 17-15.09.25	3 311 000.00	3 112 340.00	0.07
USD SPECTRUM BRANDS INC 5.75000% 16-15.07.25	3 370 000.00	3 320 461.00	0.08
USD SPRINGLEAF FINANCE CORP 5.62500% 17-15.03.23	1 825 000.00	1 797 625.00	0.04
USD SPRINGLEAF FINANCE CORP 7.12500% 18-15.03.26	625 000.00	595 312.50	0.01
USD SPRINT CORP 7.62500% 18-01.03.26	6 510 000.00	6 762 262.50	0.16
USD SPRINT NEXTEL CORP 6.00000% 12-15.11.22	170 000.00	171 912.50	0.00
USD SPRINT NEXTEL CORP 7.00000% 12-15.08.20	2 494 000.00	2 587 525.00	0.06
USD STARFRUIT US HOLDCO LLC / FINCO BV-144A 8.00000% 18-01.10.26	2 141 000.00	2 135 647.50	0.05
USD STEEL DYNAMICS INC 5.12500% 15-01.10.21	3 775 000.00	3 803 312.50	0.09
USD STUDIO CITY CO LTD-144A 7.25000% 16-30.11.21	420 000.00	432 217.80	0.01
USD SUMMIT MATERIALS LLC/FIN 6.12500% 15-15.07.23	8 961 000.00	9 025 519.20	0.22
USD SUMMIT MIDSTREAM HLDG LLC/FIN CORP 5.75000% 17-15.04.25	850 000.00	796 875.00	0.02
USD SYMANTEC CORP-REG-S 5.00000% 17-15.04.25	350 000.00	348 343.05	0.01
USD T-MOBILE USA INC 4.00000% 17-15.04.22	1 500 000.00	1 481 250.00	0.04
USD T-MOBILE USA INC 4.50000% 18-01.02.26	1 150 000.00	1 121 250.00	0.03
USD T-MOBILE USA INC 4.75000% 18-01.02.28	445 000.00	426 643.75	0.01
USD T-MOBILE USA INC 5.12500% 17-15.04.25	450 000.00	454 500.00	0.01
USD T-MOBILE USA INC 6.00000% 14-01.03.23	5 072 000.00	5 198 800.00	0.12
USD T-MOBILE USA INC 6.00000% 16-15.04.24	4 562 000.00	4 676 050.00	0.11
USD T-MOBILE USA INC 6.37500% 14-01.03.25	2 218 000.00	2 301 175.00	0.05
USD TALEN ENERGY SUPPLY LLC 6.50000% 16-01.06.25	550 000.00	429 000.00	0.01
USD TALEN ENERGY SUPPLY LLC-144A 9.50000% 17-15.07.22	425 000.00	433 500.00	0.01
USD TECK RESOURCES LTD 5.40000% 12-01.02.43	1 960 000.00	1 862 000.00	0.04
USD TECK RESOURCES LTD 6.00000% 10-15.08.40	2 083 000.00	2 088 207.50	0.05
USD TELECOM ITALIA CAPITAL 6.37500% 04-15.11.33	1 110 000.00	1 007 880.00	0.02
USD TELECOM ITALIA CAPITAL 7.20000% 06-18.07.36	4 000 000.00	3 861 200.00	0.09
USD TELECOM ITALIA CAPITAL 7.72100% 08-06.04.38	5 350 000.00	5 324 855.00	0.13
USD TELEFLEX INC 4.62500% 17-15.11.27	1 900 000.00	1 852 500.00	0.04
USD TELEFLEX INC 4.87500% 16-01.06.26	4 610 000.00	4 631 667.00	0.11
USD TENET HEALTHCARE CORP 6.87500% 02-15.11.31	1 160 000.00	1 026 600.00	0.02
USD TENET HEALTHCARE CORP 6.75000% 15-15.06.23	2 080 000.00	2 046 200.00	0.05
USD TENET HEALTHCARE CORP 4.62500% 17-15.07.24	1 250 000.00	1 224 350.00	0.03
USD TENET HEALTHCARE CORP III 5.12500% 17-01.05.25	5 164 000.00	5 045 641.12	0.12
USD TENET HEALTHCARE CORP 7.00000% 17-01.08.25	1 965 000.00	1 901 137.50	0.05
USD TESLA INC-144A 5.30000% 17-15.08.25	1 109 000.00	984 237.50	0.02
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 2.20000% 16-21.07.21	550 000.00	519 878.83	0.01
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 2.80000% 16-21.07.23	550 000.00	494 931.40	0.01
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 3.15000% 16-01.10.26	500 000.00	415 150.82	0.01
USD TRANSDIGM INC-SUB 5.50000% 13-15.10.20	5 066 000.00	5 069 166.24	0.12
USD TRANSDIGM INC-SUB 6.50000% 15-15.05.25	7 885 000.00	7 648 450.00	0.18
USD TRANSOCEAN LTD 6.80000% 07-15.03.38	1 200 000.00	903 000.00	0.02
USD TRANSOCEAN LTD 7.50000% 01-15.04.31	200 000.00	163 500.00	0.00
USD TRANSOCEAN PHOENIX 2 LTD-144A 7.75000% 16-15.10.24	100 000.00	83 100.00	0.00
USD TRIBUNE MEDIA CO 5.87500% 16-15.07.22	3 510 000.00	3 571 425.00	0.09
USD TRIUMPH GROUP INC 7.75000% 18-15.08.25	4 270 000.00	3 640 175.00	0.09

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD UNITED RENTALS NORTH AMERICA INC 6.50000% 18-15.12.26	1 350 000.00	1 400 625.00	0.03
USD UNITED STATES STEEL CORP 6.87500% 17-15.08.25	3 014 000.00	2 855 765.00	0.07
USD UNITYMEDIA KABELBW GMBH-144A 6.12500% 14-15.01.25	6 880 000.00	7 103 600.00	0.17
USD VERISIGN INC 4.75000% 17-15.07.27	5 700 000.00	5 677 200.00	0.14
USD VIRGIN MEDIA FINANCE PLC-144A 6.00000% 14-15.10.24	2 500 000.00	2 532 000.00	0.06
USD VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC-144A 5.50000% 16-15.08.26	400 000.00	393 000.00	0.01
USD VISTRA ENERGY CORP 7.37500% 15-01.11.22	1 250 000.00	1 300 000.00	0.03
USD WEATHERFORD INTERNATIONAL LTD 6.50000% 06-01.08.36	350 000.00	199 500.00	0.00
USD WEATHERFORD INTERNATIONAL LTD 7.75000% 16-15.06.21	525 000.00	447 562.50	0.01
USD WEATHERFORD INTERNATIONAL LTD 8.25000% 16-15.06.23	185 000.00	117 937.50	0.00
USD WEATHERFORD INTERNATIONAL LTD 9.87500% 17-15.02.24	425 000.00	271 379.50	0.01
USD WELLCARE HEALTH PLANS INC 5.25000% 17-01.04.25	1 660 000.00	1 684 900.00	0.04
USD WESTERN DIGITAL CORP 4.75000% 18-15.02.26	2 771 000.00	2 577 030.00	0.06
USD WHITING PETROLEUM CORP 5.75000% 13-15.03.21	1 455 000.00	1 455 000.00	0.03
USD WHITING PETROLEUM CORP 6.25000% 15-01.04.23	1 556 000.00	1 536 550.00	0.04
USD WILDHORSE RESOURCE DEVELOPMENT CORP 6.87500% 17-01.02.25	2 090 000.00	2 115 707.00	0.05
USD WILLIAM LYON HOMES INC 7.00000% 15-15.08.22	235 000.00	236 175.00	0.01
USD WILLIAMS COMPANIES INC 4.55000% 14-24.06.24	730 000.00	753 704.13	0.02
USD WIND TRE SPA-144A 5.00000% 17-20.01.26	2 688 000.00	2 210 880.00	0.05
USD WPX ENERGY INC 5.75000% 18-01.06.26	3 315 000.00	3 298 425.00	0.08
USD XEROX CORP 4.07000% 17-17.03.22	2 528 000.00	2 426 880.00	0.06
USD XEROX CORP 6.75000% 09-15.12.39	510 000.00	463 947.00	0.01
USD ZAYO GROUP LLC/ CAPITAL INC 6.37500% 15-15.05.25	2 102 000.00	2 052 077.50	0.05
USD ZAYO GROUP LLC/ CAPITAL INC 6.00000% 15-01.04.23	4 028 000.00	4 048 140.00	0.10
USD ZIGGO BOND CO BV-144A 6.00000% 16-15.01.27	5 845 000.00	5 384 706.25	0.13
USD ZIGGO BV-144A 5.50000% 16-15.01.27	9 768 000.00	9 230 760.00	0.22
米ドル合計		495 070 718.12	11.81
ノート、固定利付債合計		852 705 918.05	20.34
ノート、変動利付債			
ユーロ			
EUR ALGECO SCOTSMAN FIN PLC-REG-S 3M EURIBOR+625BP 18-15.02.23	500 000.00	577 310.78	0.02
EUR BNP PARIBAS CARDIF SA-SUB 4.032%/3M EURIBOR+393BP 14-PRP	3 300 000.00	3 910 652.83	0.09
EUR FIRE BC SPA-REG-S 3M EURIBOR+475BP 18-30.09.24	1 300 000.00	1 455 884.56	0.04
EUR GALAPAGOS SA/LUXEMBOURG-REG-S 3M EURIBOR+475BP 14-15.06.21	1 066 000.00	864 789.47	0.02
EUR GUALA CLOSURES SPA-REG-S 3M EURIBOR+350BP 18-15.04.24	650 000.00	747 371.47	0.02
EUR INTESA SANPAOLO SPA-SUB 8.375%/3M EURIBOR+687.1BP 09-PRP	450 000.00	537 089.22	0.01
EUR NEXI CAPITAL SPA-REG-S 3M EURIBOR+362.5BP 18-01.05.23	500 000.00	570 856.38	0.01
EUR NGG FINANCE-REG-S-SUB 4.250%/VAR 13-18.06.76	1 000 000.00	1 187 610.75	0.03
EUR WIND TRE SPA-REG-S 3M EURIBOR+275BP 17-20.01.24	2 125 000.00	2 178 892.81	0.05
ユーロ合計		12 030 458.27	0.29
米ドル			
USD ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 3M LIBOR+74BP 18-12.01.24	800 000.00	779 947.36	0.02
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-144A-SUB 7.500%/VAR 13-PRP	1 250 000.00	1 325 877.50	0.03
USD DEUTSCHE BANK AG-SUB 4.296%/VAR 13-24.05.28	1 500 000.00	1 331 903.49	0.03
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY-SUB 4.875%/VAR 17-01.12.32	850 000.00	716 550.00	0.02
USD ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC-SUB 8.625%/VAR 16-PRP	880 000.00	936 936.00	0.02
USD ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC-SUB 7.500%/VAR 15-PRP	1 300 000.00	1 329 250.00	0.03
USD SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN-REG-S-SUB 5.625%/VAR 17-PRP	1 800 000.00	1 748 314.80	0.04
USD SOCIETE GENERALE SA-REG-S-SUB 7.375%/VAR 18-PRP	2 500 000.00	2 453 125.00	0.06
USD SOCIETE GENERALE SA-REG-S-SUB 7.375%/VAR 16-PRP	1 250 000.00	1 291 250.00	0.03
USD STANDARD CHARTERED PLC-144A 3M LIBOR+115BP 18-20.01.23	900 000.00	887 717.46	0.02
USD UBS GROUP FUNDING SWITZERLAND AG-144A-SUB 7.000%/VAR 19-PRP	1 000 000.00	1 006 250.00	0.03
米ドル合計		13 807 121.61	0.33
ノート、変動利付債合計		25 837 579.88	0.62

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
中期債券、固定利付債			
ユーロ			
EUR ALDESA FINANCIAL SERVICES SA REG-S 7.25000% 14-01.04.21	1 270 000.00	837 925.36	0.02
EUR ALTICE FINANCING SA-REG-S 5.25000% 15-15.02.23	3 000 000.00	3 493 764.94	0.08
EUR BANCO BPM SPA-REG-S-SUB 6.00000% 10-05.11.20	600 000.00	717 323.78	0.02
EUR BANCO BPM SPA-REG-S-SUB 6.37500% 11-31.05.21	2 850 000.00	3 450 526.96	0.08
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 5.62500% 16-06.05.26	1 100 000.00	1 317 506.90	0.03
EUR BANK OF IRELAND-REG-S-SUB 10.00000% 12-19.12.22	1 500 000.00	2 182 091.90	0.05
EUR BOMBARDIER INC-REG S 6.12500% 10-15.05.21	1 500 000.00	1 764 204.37	0.04
EUR CASINO GUICHARD PERRACHON SA STEP-UP 11-26.05.21	500 000.00	606 748.62	0.02
EUR CASINO GUICHARD PERRACHON SA-REG-S STEP-UP 14-07.03.24	2 300 000.00	2 544 529.62	0.06
EUR CASINO GUICHARD PERRACHON SA-REG-S STEP-UP 14-07.02.25	100 000.00	104 697.37	0.00
EUR CASINO GUICHARD PERRACHON SA-REG-S 1.86500% 17-13.06.22	7 000 000.00	7 469 899.50	0.18
EUR CELLNEX TELECOM SA-REG-S 2.87500% 17-18.04.25	1 400 000.00	1 618 034.85	0.04
EUR CELLNEX TELECOM SAU-REG-S 2.37500% 16-16.01.24	1 000 000.00	1 143 856.18	0.03
EUR COMMERZBANK AG-REG-S-SUB 4.00000% 16-23.03.26	3 000 000.00	3 622 230.69	0.09
EUR CONSTELLIUM NV-REG-S 4.62500% 14-15.05.21	1 895 000.00	2 196 161.92	0.05
EUR COTT CORP-REG-S 5.50000% 16-01.07.24	3 200 000.00	3 855 431.99	0.09
EUR DEUTSCHE BANK AG-REG-S 0.37500% 18-18.01.21	1 000 000.00	1 124 964.78	0.03
EUR DEUTSCHE BANK AG-REG-S 1.75000% 18-17.01.28	3 000 000.00	3 261 387.83	0.08
EUR DEUTSCHE BANK AG-SUB 5.00000% 10-24.06.20	1 250 000.00	1 495 279.68	0.04
EUR DEUTSCHE BANK AG-SUB 4.50000% 16-19.05.26	8 900 000.00	10 562 633.00	0.25
EUR ELIS SA-REG-S 1.87500% 18-15.02.23	1 800 000.00	2 071 854.07	0.05
EUR ELIS SA-REG-S 2.87500% 18-15.02.26	1 500 000.00	1 716 872.06	0.04
EUR FIAT CHRYSLER FINANCE EUROPE-REG-S 6.75000% 13-14.10.19	16 110 000.00	19 317 263.38	0.46
EUR FIAT CHRYSLER FINANCE EUROPE-REG-S 4.75000% 14-22.03.21	600 000.00	740 848.80	0.02
EUR FIAT CHRYSLER FINANCE EUROPE-REG-S 4.75000% 14-15.07.22	1 000 000.00	1 259 831.25	0.03
EUR GESTAMP AUTOMOCION SA-REG-S 3.25000% 18-30.04.26	3 230 000.00	3 280 043.20	0.08
EUR GLOBALWORTH REAL ESTATE INVEST-REG-S 3.00000% 18-29.03.25	3 150 000.00	3 486 605.72	0.08
EUR GREIF LUXEMBOURG FINANCE SCA-REG-S 7.37500% 11-15.07.21	489 000.00	632 082.58	0.02
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB 6.62500% 13-13.09.23	1 000 000.00	1 316 021.88	0.03
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB 3.92800% 14-15.09.26	2 300 000.00	2 683 725.83	0.06
EUR IPD 3 BV-REG-S 4.50000% 17-15.07.22	5 700 000.00	6 542 100.12	0.16
EUR LEONARDO SPA-REG-S 1.50000% 17-07.06.24	1 250 000.00	1 373 385.78	0.03
EUR MAX TWO LTD 5.70000% 04-02.04.24	350 000.00	136 730.68	0.00
EUR MOBILUX FINANCE SAS-REG-S 5.50000% 16-15.11.24	3 700 000.00	3 948 336.89	0.09
EUR NOKIA OYJ-REG-S 1.00000% 17-15.03.21	400 000.00	463 446.79	0.01
EUR NOKIA OYJ-REG-S 2.00000% 17-15.03.24	5 290 000.00	6 213 432.70	0.15
EUR NYRSTAR NETHERLANDS HOLDINGS BV-REG-S 6.87500% 17-15.03.24	690 000.00	355 293.55	0.01
EUR ORANO SA 4.87500% 09-23.09.24	7 450 000.00	8 878 218.24	0.21
EUR ORANO SA-REG-S 3.12500% 14-20.03.23	800 000.00	919 887.72	0.02
EUR ORANO SA-REG-S 4.37500% 09-06.11.19	1 000 000.00	1 181 015.20	0.03
EUR PHOENIX PIB DUTCH FINANCE BV-REG-S 3.12500% 13-27.05.20	500 000.00	588 492.68	0.01
EUR RAIFFEISEN BANK INTL AG-REG-S-SUB 6.00000% 13-16.10.23	2 000 000.00	2 664 276.09	0.06
EUR ROADSTER FINANCE DESIGNATED ACTIVITY CO 2.37500% 17-08.12.27	400 000.00	431 681.38	0.01
EUR SAIPEM FINANCE INTERNATIONAL BV-REG-S 3.00000% 16-08.03.21	900 000.00	1 062 151.55	0.03
EUR SAIPEM FINANCE INTERNATIONAL BV-REG-S 2.75000% 17-05.04.22	904 000.00	1 060 633.93	0.03
EUR SAMSONITE FINCO SARL-REG-S 3.50000% 18-15.05.26	810 000.00	881 103.90	0.02
EUR SCHAEFFLER FINANCE BV-REG-S 3.50000% 14-15.05.22	5 100 000.00	5 907 588.96	0.14
EUR SEALED AIR CORP-REG-S 4.50000% 15-15.09.23	2 500 000.00	3 150 840.32	0.08
EUR STORA ENSO OYJ-REG-S 2.50000% 18-21.03.28	1 800 000.00	2 043 723.19	0.05
EUR TAKKO LUXEMBOURG 2 S.C.A-REG-S 5.37500% 17-15.11.23	1 000 000.00	835 917.33	0.02
EUR TDC A/S 3.75000% 12-02.03.22	800 000.00	1 012 137.18	0.02
EUR TELECOM ITALIA FINANCE SA 7.75000% 03-24.01.33	1 000 000.00	1 380 189.58	0.03
EUR TELECOM ITALIA SPA-REG-S 2.50000% 17-19.07.23	2 000 000.00	2 213 275.00	0.05
EUR TELECOM ITALIA SPA-REG-S 2.87500% 18-28.01.26	5 320 000.00	5 600 122.29	0.13
EUR TELECOM ITALIA SPA-REG-S 4.00000% 19-11.04.24	4 655 000.00	5 355 288.70	0.13

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR TELEFON AB L M ERICSSON-REG-S 1.87500% 17-01.03.24	1 750 000.00	2 004 623.83	0.05
EUR TEOLLISUUDEN VOIMA OY-REG-S 2.00000% 18-08.05.24	1 400 000.00	1 613 300.38	0.04
EUR TESCO CORPORATE TREASURY SERVICES-REG-S 2.50000% 14-01.07.24	1 500 000.00	1 781 900.12	0.04
EUR TESCO CORPORATE TREASURY SERVICES-REG-S 1.37500% 18-24.10.23	1 500 000.00	1 698 509.33	0.04
EUR UNICREDIT SPA-SUB 6.12500% 11-19.04.21	1 950 000.00	2 433 248.51	0.06
EUR VIRGIN MEDIA FINANCE PLC-REG-S 4.50000% 15-15.01.25	2 800 000.00	3 293 181.50	0.08
EUR VOLVO CAR AB-REG-S 2.00000% 17-24.01.25	937 000.00	1 013 252.91	0.02
EUR WEPA HYGIENEPRODUKTE GMBH-REG-S 3.75000% 16-15.05.24	1 394 000.00	1 592 926.70	0.04
EUR ZIGGO BV-REG-S 3.62500% 13-27.03.20	1 350 000.00	1 583 167.74	0.04
ユーロ合計		171 087 729.78	4.08
英ポンド			
GBP ANGLIAN WATER/OSPREY FINANCING-REG-S 5.00000% 15-30.04.23	906 000.00	1 154 606.47	0.03
GBP PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 6.25000% 11-14.12.26	1 500 000.00	2 113 556.73	0.05
GBP TELECOM ITALIA SPA 5.87500% 06-19.05.23	4 000 000.00	5 447 362.64	0.13
GBP TELECOM ITALIA SPA 6.37500% 04-24.06.19	1 350 000.00	1 799 707.26	0.04
GBP THAMES WATER KEMBLE FINANCE PLC-REG-S 5.87500% 15-15.07.22	1 854 000.00	2 482 364.50	0.06
英ポンド合計		12 997 597.60	0.31
米ドル			
USD ALTICE LUXEMBOURG SA-144A 7.75000% 14-15.05.22	12 601 000.00	12 222 970.00	0.29
USD NAVIENT CORP 5.62500% 03-01.08.33	185 000.00	141 062.50	0.00
USD NAVIENT CORP 6.12500% 14-25.03.24	700 000.00	669 812.50	0.02
USD NAVIENT CORP 7.25000% 12-25.01.22	975 000.00	1 011 562.50	0.02
USD NAVIENT CORP 8.00000% 10-25.03.20	1 000 000.00	1 041 250.00	0.03
USD SPRINT CAPITAL CORPORATION 8.75000% 02-15.03.32	3 959 000.00	4 345 002.50	0.10
米ドル合計		19 431 660.00	0.46
中期債券、固定利付債合計		203 516 987.38	4.85
中期債券、変動利付債			
ユーロ			
EUR ALLIANZ SE-REG-S-SUB 4.750%/3M EURIBOR+360BP 13-PRP	4 500 000.00	5 792 921.00	0.14
EUR ALLIED IRISH BANKS PLC-REG-S-SUB 4.125%/VAR 15-26.11.25	4 150 000.00	4 896 089.29	0.12
EUR AQUARIUS + INVESTMENTS PLC-SUB 4.250%/VAR 13-02.10.43	500 000.00	638 010.89	0.02
EUR ASS GENERALI-REG-S-SUB 7.750%/3M EURIBOR+711.3BP 12-12.12.42	400 000.00	542 743.85	0.01
EUR AXA SA-REG-S-SUB 3.250%/VAR 18-28.05.49	2 250 000.00	2 579 433.75	0.06
EUR AXA SA-REG-S-SUB 3.941%/VAR 14-PRP	2 750 000.00	3 360 594.19	0.08
EUR BANCA MONT DEI PAS DI SIENA-REG-S-SUB 5.375%/VAR 18-18.01.28	650 000.00	324 441.49	0.01
EUR BANCO COMERCIAL PORTUGUES-REG-S-SUB 4.500%/VAR 17-07.12.27	2 300 000.00	2 507 178.25	0.06
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 5.375%/VAR 18-12.12.28	1 300 000.00	1 517 544.85	0.04
EUR BANK OF IRELAND-REG-S-SUB 4.25%/VAR 14-11.06.24	3 800 000.00	4 388 739.22	0.10
EUR BANKIA SA-REG-S-SUB 4.000%/VAR 14-22.05.24	3 200 000.00	3 688 730.47	0.09
EUR BPCE SA-REG-S-SUB 2.750%/VAR 15-30.11.27	1 000 000.00	1 196 898.21	0.03
EUR CAIXABANK SA-REG-S-SUB 2.750%/VAR 17-14.07.28	1 200 000.00	1 385 047.42	0.03
EUR CAIXABANK-REG-S-SUB 2.250%/VAR 18-17.04.30	1 000 000.00	1 079 647.18	0.03
EUR DANSKE BANK AS-REG-S-SUB 5.875%/VAR 15-PRP	400 000.00	461 848.63	0.01
EUR DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG-REG-S-SUB 2.875%/VAR 17-28.06.27	1 600 000.00	1 746 921.94	0.04
EUR ELM BV SWISS LIFE INS & PEN GRP-REG-S-SUB 4.500%/VAR 16-PRP	900 000.00	1 095 921.00	0.03
EUR ERSTE GROUP BANK AG-REG-S-SUB 8.875%/VAR 16-PRP	1 600 000.00	2 102 128.40	0.05
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB 7.000%/VAR 16-PRP	5 751 000.00	6 738 843.84	0.16
EUR NAVIERA ARMAS SA-REG-S 3M EURIBOR+425BP 17-15.11.24	1 520 000.00	1 617 954.07	0.04
EUR NN GROUP NV-REG-S-SUB 3M EURIBOR+290BP 14-PRP	1 000 000.00	1 190 510.47	0.03
EUR NN GROUP NV-REG-S-SUB 4.625%/VAR 17-13.01.48	2 720 000.00	3 307 029.49	0.08
EUR ORANGE SA REG-S-SUB 5.000%/VAR 14-PRP	6 200 000.00	7 748 163.93	0.18
EUR RAIFFEISEN BANK INT-REG-S-SUB 4.500%/EUSA5+330BP 14-21.02.25	500 000.00	593 280.99	0.01

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR ROYAL BK OF SCOTLAND GP PLC-REG-S-SUB 3.625%/VAR 14-25.03.24	500 000.00	574 400.85	0.01
EUR RWE AG-REG-S-SUB 2.750%/VAR 15-21.04.75	4 733 000.00	5 482 984.71	0.13
EUR TALANX FINANZ LUX-SUB 8.3673%/VAR 12-15.06.42	1 000 000.00	1 401 652.98	0.03
EUR TOTAL SA-REG-S-SUB 2.625%/VAR 15-PRP	2 750 000.00	3 186 890.91	0.08
EUR TOTAL SA-REG-S-SUB 3.875%/VAR 16-PRP	1 500 000.00	1 846 056.58	0.04
EUR TOTAL SA-REG-S-SUB 3.369%/VAR 16-PRP	3 000 000.00	3 582 357.26	0.09
EUR UNICREDIT SPA-REG-S-SUB 5.750%/VAR 13-28.10.25	4 050 000.00	4 802 137.12	0.11
EUR UNICREDIT SPA-REG-S-SUB 4.375%/VAR 16-03.01.27	800 000.00	923 935.92	0.02
EUR UNIONE DI BANCHE ITALIANE-REG-S-SUB 4.250%/VAR 16-05.05.26	3 350 000.00	3 747 858.56	0.09
EUR UNIPOLSAI SPA-SUB 5.750%/VAR 14-PRP	1 500 000.00	1 578 967.66	0.04
ユーロ合計		87 627 865.37	2.09
米ドル			
USD BANK OF IRELAND GROUP PLC-REG-S-SUB 4.125%/VAR 17-19.09.27	720 000.00	664 407.36	0.02
USD ERSTE GROUP BANK AG-REG-S-SUB 5.500%/VAR 14-26.05.25	1 600 000.00	1 619 958.40	0.04
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 6.750%/3M LIBOR+378BP 14-PRP	1 600 000.00	1 724 496.00	0.04
USD ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC-SUB 8.000%/VAR 15-PRP	1 000 000.00	1 046 000.00	0.02
米ドル合計		5 054 861.76	0.12
中期債券、変動利付債合計		92 682 727.13	2.21
債券、固定利付債			
スイスフラン			
CHF MATTERHORN TELECOM SA-REG-S 3.62500% 15-01.05.22	3 680 000.00	3 662 195.35	0.09
CHF TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE 0.50000% 16-28.07.22	625 000.00	595 013.10	0.01
CHF TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE 1.00000% 16-28.07.25	450 000.00	408 224.97	0.01
スイスフラン合計		4 665 433.42	0.11
ユーロ			
EUR ADLER REAL ESTATE AG-REG-S 1.87500% 18-27.04.23	1 500 000.00	1 674 351.20	0.04
EUR ADLER REAL ESTATE AG-REG-S 3.00000% 18-27.04.26	400 000.00	446 031.93	0.01
EUR ADLER REAL ESTATE AG-REG-S 1.50000% 17-06.12.21	2 935 000.00	3 342 772.12	0.08
EUR ALMAVIVA-THE ITALIAN INNOVATION-REG-S 7.25000% 17-15.10.22	640 000.00	635 234.67	0.01
EUR ALTICE FRANCE-REG-S 5.62500% 14-15.05.24	8 106 000.00	9 580 266.59	0.23
EUR ALTICE LUXEMBOURG SA-REG-S 7.25000% 14-15.05.22	4 100 000.00	4 629 225.23	0.11
EUR ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-REG-S 2.75000% 17-15.03.24	1 176 000.00	1 352 774.70	0.03
EUR ARENA LUXEMBOURG FINANCE SARL-REG-S 2.87500% 17-01.11.24	4 250 000.00	4 907 862.89	0.12
EUR AURIS LUXEMBOURG II SARL-REG-S 8.00000% 14-15.01.23	3 300 000.00	3 868 981.09	0.09
EUR AUTODIS SA-REG-S 4.37500% 16-01.05.22	350 000.00	390 547.22	0.01
EUR AXALTA COATING SYSTEMS LLC-REG-S 4.25000% 16-15.08.24	4 600 000.00	5 405 476.31	0.13
EUR AXALTA COATING SYSTEMS DUTCH HLDG-REG-S 3.75000% 16-15.01.25	6 314 000.00	7 241 376.80	0.17
EUR BARRY CALLEBAUT SERVICES NV-REG-S 2.37500% 16-24.05.24	250 000.00	299 052.44	0.01
EUR BELDEN INC-REG-S-SUB 4.12500% 16-15.10.26	4 550 000.00	5 317 484.10	0.13
EUR BELDEN INC-REG-S-SUB 3.37500% 17-15.07.27	2 250 000.00	2 479 524.71	0.06
EUR BELDEN INC-REG-S-SUB 3.87500% 18-15.03.28	4 468 000.00	4 908 404.64	0.12
EUR BWAY HOLDING CO-REG-S 4.75000% 18-15.04.24	4 510 000.00	5 147 509.90	0.12
EUR CATALENT PHARMA SOLUTIONS INC-REG-S 4.75000% 16-15.12.24	2 675 000.00	3 188 126.33	0.08
EUR CBR FASHION FINANCE BV-REG-S 5.12500% 17-01.10.22	1 125 000.00	1 099 181.87	0.03
EUR CEMEX FINANCE LLC-REG-S 4.62500% 16-15.06.24	590 000.00	704 075.32	0.02
EUR CHEMOURS CO/THE 4.00000% 18-15.05.26	5 165 000.00	5 808 521.79	0.14
EUR CMA CGM SA-REG-S 5.25000% 17-15.01.25	3 000 000.00	2 929 267.72	0.07
EUR COLFAX CORP-REG-S 3.25000% 17-15.05.25	1 550 000.00	1 713 274.80	0.04
EUR CONSTANTIN INVESTISSEMENT 3 SASU-REG-S 5.37500% 18-15.04.25	300 000.00	320 568.84	0.01
EUR CONTOURGLOBAL POWER HOLDINGS SA-REG-S 3.37500% 18-01.08.23	500 000.00	570 558.03	0.01
EUR CORRAL PETROLEUM HOLDINGS-REG-S (PIK) 11.75000% 16-15.05.21	1 900 000.00	2 327 965.14	0.06
EUR CROWN EUROPEAN HOLDINGS SA-REG-S 4.00000% 14-15.07.22	2 000 000.00	2 494 533.35	0.06

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR CROWN EUROPEAN HOLDINGS SA-REG-S 3.37500% 15-15.05.25	5 269 000.00	6 294 280.20	0.15
EUR CROWN EUROPEAN HOLDINGS SA-REG-S 2.62500% 16-30.09.24	8 340 000.00	9 718 063.86	0.23
EUR CRYSTAL ALMOND SARL-REG-S 10.00000% 16-01.11.21	1 296 000.00	1 582 788.58	0.04
EUR CTC BONDCO GMBH-REG-S 5.25000% 17-15.12.25	600 000.00	666 094.72	0.02
EUR DEA FINANCE SA-REG-S 7.50000% 16-15.10.22	1 800 000.00	2 168 680.50	0.05
EUR EAGLE INTERMEDIATE GLO HOLDING BV-REG-S 5.37500% 18-01.05.23	1 100 000.00	1 224 707.81	0.03
EUR EC FINANCE PLC-REG-S 2.37500% 17-15.11.22	5 065 000.00	5 760 980.70	0.14
EUR EIRCOM FINANCE DAC-REG-S 4.50000% 16-31.05.22	1 000 000.00	1 170 880.47	0.03
EUR ELIS SA-REG-S 3.00000% 15-30.04.22	6 520 000.00	7 565 539.46	0.18
EUR ENERGIZER GAMMA ACQUISITION BV-REG-S 4.62500% 18-15.07.26	5 700 000.00	6 412 206.48	0.15
EUR EQUINIX INC 2.87500% 17-01.10.25	14 670 000.00	16 724 349.72	0.40
EUR ETHIAS SA-REG-S SUB 5.00000% 15-14.01.26	1 100 000.00	1 371 402.77	0.03
EUR FAURECIA SA-REG-S 2.62500% 18-15.06.25	2 230 000.00	2 445 304.53	0.06
EUR FAURECIA-REG-S 3.62500% 16-15.06.23	9 500 000.00	11 167 843.99	0.27
EUR GALAPAGOS SA/LUXEMBOURG-REG-S 5.37500% 14-15.06.21	1 922 000.00	1 552 340.12	0.04
EUR GARFUNKELUX HOLDCO 3 SA-REG-S 7.50000% 15-01.08.22	600 000.00	604 373.39	0.01
EUR GESTAMP FUNDING LUXEMBOURG SA-REG-S 3.50000% 16-15.05.23	550 000.00	612 164.57	0.01
EUR GLOBALWORTH REAL ESTATE INVEST-REG-S 2.87500% 17-20.06.22	480 000.00	557 631.56	0.01
EUR GOODYEAR DUNLOP TIRES EUROPE BV-REG-S 3.75000% 15-15.12.23	2 857 000.00	3 298 917.72	0.08
EUR GRIFOLS SA-REG-S 3.20000% 17-01.05.25	7 849 000.00	8 983 819.22	0.21
EUR GROUPE FNAC SA-REG-S 3.25000% 16-30.09.23	4 700 000.00	5 487 230.98	0.13
EUR HANESBRANDS FINANCE LUXEMBOURG SC-REG-S 3.50000% 16-15.06.24	1 750 000.00	2 073 057.76	0.05
EUR HERTZ HOLDINGS NETHER BV-REG-S 5.50000% 18-30.03.23	2 525 000.00	2 859 704.15	0.07
EUR HORIZON PARENT HOLDINGS-REG-S (PIK) 8.25000% 17-15.02.22	1 440 000.00	1 683 309.15	0.04
EUR HP PELZER HOLDING GMBH-REG-S 4.12500% 17-01.04.24	490 000.00	521 284.92	0.01
EUR IHO VERWALTUNGS GMBH-REG-S (PIK) 3.25000% 16-15.09.23	2 700 000.00	3 043 278.37	0.07
EUR IHO VERWALTUNGS GMBH-REG-S (PIK) 3.75000% 16-15.09.26	7 050 000.00	7 622 433.46	0.18
EUR INEOS FINANCE PLC-REG-S 4.00000% 15-01.05.23	1 955 000.00	2 275 747.22	0.05
EUR INEOS FINANCE PLC-REG-S 2.12500% 17-15.11.25	500 000.00	540 770.23	0.01
EUR INTER MEDIA COMMUNICATION SRL-REG-S 4.87500% 17-31.12.22	2 460 000.00	2 803 089.79	0.07
EUR INTRALOT CAPITAL LUXEMBOURG SA-REG-S 5.25000% 17-15.09.24	1 400 000.00	1 104 780.47	0.03
EUR INTRUM JUSTITIA AB-REG-S 2.75000% 17-15.07.22	7 900 000.00	8 815 542.83	0.21
EUR INTRUM JUSTITIA AB-REG-S 3.12500% 17-15.07.24	1 800 000.00	1 959 190.01	0.05
EUR KAEFER ISOLIERTECHNIK-REG-S 5.50000% 18-10.01.24	5 225 000.00	5 915 555.17	0.14
EUR KIRK BEAUTY ONE GMBH-REG-S 8.75000% 15-15.07.23	5 035 000.00	3 098 136.52	0.07
EUR KIRK BEAUTY ZERO GMBH-REG-S 6.25000% 15-15.07.22	1 200 000.00	1 097 944.42	0.03
EUR KME AG-REG-S 6.75000% 18-01.02.23	2 100 000.00	2 209 042.06	0.05
EUR KRATON POLYMERS LLC/CAPITAL CORP-REG-S 5.25000% 18-15.05.26	1 140 000.00	1 200 175.32	0.03
EUR LA FINANCIERE ATALIAN SA-REG-S 4.00000% 17-15.05.24	790 000.00	701 211.86	0.02
EUR LECTA SA-REG-S 6.50000% 16-01.08.23	500 000.00	550 431.77	0.01
EUR LHC3 PLC-REG-S (PIK) 4.12500% 17-15.08.24	2 300 000.00	2 625 569.84	0.06
EUR LKQ EUROPEAN HOLDINGS BV-REG-S 3.62500% 18-01.04.26	11 210 000.00	12 642 958.66	0.30
EUR LKQ EUROPEAN HOLDINGS BV-REG-S 4.12500% 18-01.04.28	3 000 000.00	3 340 972.79	0.08
EUR LKQ ITALIA BONDCO SPA-REG-S 3.87500% 16-01.04.24	4 801 000.00	5 699 791.10	0.14
EUR LOUVRE BIDCO SAS-REG-S 4.25000% 17-30.09.24	1 540 000.00	1 669 530.57	0.04
EUR LOXAM SAS-REG-S 3.50000% 16-03.05.23	2 750 000.00	3 206 133.08	0.08
EUR LOXAM SAS-REG-S 3.50000% 17-15.04.22	1 170 000.00	1 368 134.40	0.03
EUR LOXAM SAS-REG-S 4.25000% 17-15.04.24	560 000.00	660 091.08	0.02
EUR LOXAM SAS-REG-S 6.00000% 17-15.04.25	1 600 000.00	1 888 137.23	0.04
EUR LSF10 WOLVERINE INVESTMENTS SCA-REG-S 5.00000% 18-15.03.24	740 000.00	832 555.30	0.02
EUR LSF9 BALTA ISSUER SA-REG-S 7.75000% 15-15.09.22	1 330 000.00	1 172 204.43	0.03
EUR MASARIA INVESTMENTS SAU-REG-S 5.00000% 17-15.09.24	500 000.00	550 776.00	0.01
EUR MATTERHORN TELECOM SA-REG-S 3.87500% 15-01.05.22	6 737 000.00	7 672 392.87	0.18
EUR MAXEDA DIY HOLDING BV-REG-S 6.12500% 17-15.07.22	3 265 000.00	3 530 907.45	0.08
EUR MEDIOBANCA SPA-SUB 5.75000% 13-18.04.23	400 000.00	509 605.49	0.01
EUR MEDIOBANCA-BANCA DI CREDITO FIN SPA-SUB 5.00000% 10-15.11.20	1 250 000.00	1 516 041.77	0.04
EUR MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-REG-S 2.75000% 15-15.03.22	4 700 000.00	5 565 213.98	0.13
EUR METSA BOARD CORP-REG-S 2.75000% 17-29.09.27	850 000.00	994 175.92	0.02

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR MOBY SPA-REG-S 7.75000% 16-15.02.23	2 000 000.00	826 164.00	0.02
EUR MPT OPERATING PARTNERSHIP LP/FIN CORP 4.00000% 15-19.08.22	750 000.00	928 508.51	0.02
EUR MPT OPERATING PARTNERSHIP LP/FIN CORP 3.32500% 17-24.03.25	6 520 000.00	7 610 206.24	0.18
EUR NEMAK SAB DE CV-REG-S 3.25000% 17-15.03.24	747 000.00	847 502.27	0.02
EUR NEXANS SA-REG-S 2.75000% 17-05.04.24	700 000.00	773 777.17	0.02
EUR NEXANS SA-REG-S 3.25000% 16-26.05.21	2 000 000.00	2 389 788.60	0.06
EUR NEXANS SA-REG-S 3.75000% 18-08.08.23	2 100 000.00	2 454 970.43	0.06
EUR NEXI CAPITAL SPA-REG-S 4.12500% 18-01.11.23	7 125 000.00	8 290 856.95	0.20
EUR NH HOTEL GROUP SA-REG-S 3.75000% 16-01.10.23	2 800 000.00	2 986 528.34	0.07
EUR NOVAFIVES SAS-REG-S 5.00000% 18-15.06.25	260 000.00	253 586.45	0.01
EUR NYRSTAR NETHERLANDS HOLDINGS BV-REG-S 8.50000% 14-15.09.19	2 200 000.00	1 211 707.20	0.03
EUR OBRASCON HUARTE LAIN SA-REG-S 4.75000% 14-15.03.22	500 000.00	301 773.61	0.01
EUR OCI NV-REG-S 5.00000% 18-15.04.23	1 233 000.00	1 483 607.85	0.03
EUR OI EUROPEAN GROUP BV-REG-S 3.12500% 16-15.11.24	9 496 000.00	11 151 264.89	0.27
EUR OUTOKUMPU-REG-S 4.12500% 18-18.06.24	1 395 000.00	1 576 778.40	0.04
EUR PAPREC HOLDING-REG-S 4.00000% 18-31.03.25	3 670 000.00	3 579 470.28	0.08
EUR PHOENIX PIB DUTCH FINANCE BV-REG-S 3.62500% 14-30.07.21	1 000 000.00	1 214 208.64	0.03
EUR PLATIN 1426 GMBH-REG-S 5.37500% 17-15.06.23	4 870 000.00	5 198 089.29	0.12
EUR PLATIN 1426 GMBH-REG-S 6.87500% 18-15.06.23	670 000.00	740 922.81	0.02
EUR POLYGON AB-REG-S 4.00000% 18-23.02.23	1 900 000.00	2 191 055.77	0.05
EUR PRESTIGEBIDCO GMBH-REG-S 6.25000% 16-15.12.23	1 800 000.00	2 160 745.19	0.05
EUR PRO-GEST SPA-REG-S 3.25000% 17-15.12.24	870 000.00	904 942.18	0.02
EUR PVH CORP-REG-S 3.62500% 16-15.07.24	3 000 000.00	3 703 349.67	0.09
EUR QUINTILES IMS INC-REG-S 3.50000% 16-15.10.24	11 073 000.00	13 032 831.34	0.31
EUR QUINTILES IMS INC-REG-S 3.25000% 17-15.03.25	3 900 000.00	4 528 900.64	0.11
EUR RADISSON HOTEL-REG-S 6.87500% 18-15.07.23	3 040 000.00	3 778 958.59	0.09
EUR RESIDOMO SRO-REG-S 3.37500% 17-15.10.24	9 775 000.00	11 189 628.90	0.27
EUR REXEL SA-REG-S 2.12500% 17-15.06.25	511 000.00	563 661.35	0.01
EUR REXEL SA-REG-S 3.50000% 16-15.06.23	9 500 000.00	11 173 294.37	0.27
EUR ROSSINI SARL-REG-S 6.75000% 18-30.10.25	1 540 000.00	1 806 832.14	0.04
EUR SAFARI HOLDING VERWALTUNGS GMBH-REG-S 5.37500% 17-30.11.22	3 140 000.00	3 289 172.32	0.08
EUR SAPPI PAPIER HOLDING AG-REG-S 3.37500% 15-01.04.22	698 000.00	811 023.70	0.02
EUR SAPPI PAPIER HOLDING AG-REG-S 4.00000% 16-01.04.23	3 900 000.00	4 570 597.43	0.11
EUR SCHMOLZ + BICKENBACH LUXEMBOURG-REG-S 5.62500% 17-15.07.22	2 710 000.00	2 907 466.18	0.07
EUR SMCP GROUP 5.87500% 16-01.05.23	1 500 000.00	864 806.10	0.02
EUR SMURFIT KAPPA ACQUISITIONS-REG-S 2.87500% 18-15.01.26	2 000 000.00	2 340 798.00	0.06
EUR SMURFIT KAPPA ACQUISITIONS ULC-REG-S 2.87500% 19-15.01.26	3 175 000.00	3 670 477.40	0.09
EUR SMURFIT KAPPA AQUISITION-REG-S 3.25000% 14-01.06.21	3 500 000.00	4 240 573.59	0.10
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 4.75000% 15-30.07.25	350 000.00	416 450.91	0.01
EUR SPECTRUM BRANDS INC-REG-S 4.00000% 16-01.10.26	6 165 000.00	6 975 488.02	0.17
EUR SPIE SA-REG-S 3.12500% 17-22.03.24	6 000 000.00	6 918 435.04	0.16
EUR STARFRUIT US HOLDCO LLC / FINCO BV-144A 6.50000% 18-01.10.26	4 700 000.00	5 195 630.65	0.12
EUR SUMMIT GERMANY LTD-144A 2.00000% 18-31.01.25	1 560 000.00	1 673 262.93	0.04
EUR SUNSHINE MID BV-REG-S 6.50000% 18-15.05.26	1 575 000.00	1 765 848.10	0.04
EUR SUPERIOR INDUSTRIES INTERNATIONAL-REG-S 6.00000% 17-15.06.25	1 000 000.00	935 791.38	0.02
EUR SYNLAB BONDCO PLC-REG-S 6.25000% 15-01.07.22	4 750 000.00	5 633 520.52	0.13
EUR SYNLAB UNSECURED BONDCO PLC-REG-S 8.25000% 15-01.07.23	1 000 000.00	1 215 512.14	0.03
EUR TA MANUFACTURING LTD-REG-S 3.62500% 15-15.04.23	1 000 000.00	1 161 747.11	0.03
EUR TELENET FINANCE VI LUXEMBOURG SCA-REG-S 4.87500% 15-15.07.27	7 600 000.00	8 425 416.81	0.20
EUR TENNECO INC-REG-S 4.87500% 17-15.04.22	2 000 000.00	2 352 272.50	0.06
EUR TEREOS FINANCE GROUPE I SA-REG-S 4.12500% 16-16.06.23	1 000 000.00	998 052.01	0.02
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV-REG-S 1.25000% 15-31.03.23	8 417 000.00	9 114 626.11	0.22
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV-REG-S 1.87500% 15-31.03.27	3 900 000.00	3 871 056.82	0.09
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV-REG-S 0.37500% 16-25.07.20	2 000 000.00	2 270 342.99	0.05
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV-REG-S 1.12500% 16-15.10.24	11 266 000.00	11 440 546.95	0.27
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV-REG-S 1.62500% 16-15.10.28	1 050 000.00	967 472.47	0.02
EUR THOMAS COOK FINANCE 2 PLC-REG-S 3.87500% 17-15.07.23	1 200 000.00	946 646.25	0.02
EUR TITAN GLOBAL FINANCE PLC-REG-S 2.37500% 17-16.11.24	260 000.00	291 943.64	0.01

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR TRANSCOM HOLDING AB 6.50000% 18-22.03.23	2 300 000.00	2 372 582.37	0.06
EUR TUI AG-REG-S 2.12500% 16-26.10.21	2 000 000.00	2 347 843.34	0.06
EUR UGI INTERNATIONAL LLC-REG-S 3.25000% 18-01.11.25	3 870 000.00	4 556 798.42	0.11
EUR UNICREDIT SPA-REG-S-SUB 6.95000% 12-31.10.22	3 600 000.00	4 691 760.58	0.11
EUR UNITYMEDIA KABELBW GMBH-REG-S 3.75000% 15-15.01.27	4 250 000.00	5 067 827.67	0.12
EUR UNITYMEDIA NRW/HESSEN-REG-S 4.00000% 14-15.01.25	10 303 000.00	12 287 971.14	0.29
EUR UNITYMEDIA NRW/HESSEN-REG-S 3.50000% 15-15.01.27	2 744 000.00	3 270 611.16	0.08
EUR UNITYMEDIA NRW/HESSEN-REG-S 4.62500% 15-15.02.26	6 500 000.00	7 207 971.09	0.17
EUR UPC HOLDING BV-REG-S 3.87500% 17-15.06.29	750 000.00	813 151.92	0.02
EUR UPCB FINANCE IV LTD-REG-S 4.00000% 15-15.01.27	5 000 000.00	5 318 141.60	0.13
EUR UPCB FINANCE VII LTD-REG-S 3.62500% 17-15.06.29	3 750 000.00	4 141 921.57	0.10
EUR VALLOUREC SA-REG-S 2.25000% 14-30.09.24	300 000.00	185 249.43	0.00
EUR VALLOUREC SA-REG-S 6.62500% 17-15.10.22	370 000.00	269 134.85	0.01
EUR VALLOUREC SA-REG-S 6.37500% 18-15.10.23	570 000.00	407 307.46	0.01
EUR VERISURE HOLDING AB-REG-S 3.50000% 18-15.05.23	3 100 000.00	3 583 773.21	0.09
EUR VERISURE MIDHOLDING AB-REG-S 5.75000% 17-01.12.23	13 000 000.00	14 879 557.88	0.35
EUR WIENERBERGER AG-REG-S 2.00000% 18-02.05.24	500 000.00	582 187.44	0.01
EUR WITTUR INTERNATIONAL HOLDING GMBH-REG-S 8.50000% 15-15.02.23	1 900 000.00	2 153 674.84	0.05
EUR WMG ACQUISITION CORP-REG-S 4.12500% 16-01.11.24	4 520 000.00	4 854 352.96	0.12
EUR WORLDPAY FINANCE PLC-REG-S 3.75000% 15-15.11.22	2 053 000.00	2 527 729.15	0.06
EUR ZF NORTH AMERICA CAPITAL INC 2.75000% 15-27.04.23	2 000 000.00	2 381 729.84	0.06
EUR ZIGGO BOND CO BV-REG-S 7.12500% 14-15.05.24	1 300 000.00	1 566 269.25	0.04
EUR ZIGGO BOND CO BV-REG-S 4.62500% 15-15.01.25	1 750 000.00	2 027 587.76	0.05
EUR ZIGGO BV-REG-S 3.75000% 15-15.01.25	7 957 000.00	9 297 617.31	0.22
EUR ZIGGO BV-REG-S 4.25000% 16-15.01.27	6 865 000.00	7 964 413.84	0.19
ユーロ合計		592 548 484.74	14.13
英ポンド			
GBP AA BOND CO LTD-REG-S 5.50000% 15-31.07.22	3 446 000.00	3 762 423.78	0.09
GBP AMC ENTERTAINMENT HOLDING INC-SUB 6.37500% 17-15.11.24	1 000 000.00	1 240 979.74	0.03
GBP AMIGO LUXEMBOURG SA-REG-S 7.62500% 17-15.01.24	2 800 000.00	3 783 200.10	0.09
GBP ARQIVA BROADCAST FINANCE PLC-REG-S 6.75000% 18-30.09.23	2 980 000.00	4 076 403.59	0.10
GBP ASTON MARTIN CAPITAL HOLDINGS LTD-REG-S 5.75000% 17-15.04.22	1 000 000.00	1 296 375.97	0.03
GBP CPUK FINANCE LTD-REG-S 4.25000% 17-28.08.22	325 000.00	417 588.73	0.01
GBP DRAX FINCO PLC-REG-S 4.25000% 17-01.05.22	625 000.00	822 932.37	0.02
GBP ENTERTAINMENT ONE LTD-REG-S 6.87500% 15-15.12.22	1 340 000.00	1 818 228.14	0.04
GBP HEATHROW FINANCE PLC-REG-S 4.75000% 18-01.03.24	350 000.00	465 878.89	0.01
GBP JEWEL UK BONDCO PLC-REG-S 8.50000% 18-15.04.23	1 800 000.00	2 257 261.69	0.05
GBP LADBROKES GROUP FINANCE PLC-REG-S 5.12500% 16-08.09.23	1 175 000.00	1 562 241.70	0.04
GBP MATALAN FINANCE PLC-REG-S 6.75000% 18-31.01.23	1 000 000.00	1 207 911.96	0.03
GBP MOTO FINANCE PLC-REG-S 4.50000% 17-01.10.22	1 880 000.00	2 387 725.92	0.06
GBP NMG FINCO PLC-REG-S 5.00000% 17-01.08.22	1 000 000.00	1 221 763.65	0.03
GBP PENSION INSURANCE CORP PLC-REG-S-SUB 8.00000% 16-23.11.26	875 000.00	1 335 006.80	0.03
GBP RAC BOND CO PLC-REG-S 5.00000% 17-06.11.22	2 450 000.00	2 870 282.72	0.07
GBP SAGA PLC-REG-S 3.37500% 17-12.05.24	1 010 000.00	1 188 979.04	0.03
GBP TVL FINANCE PLC-REG-S 8.50000% 16-15.05.23	2 307 000.00	2 500 424.43	0.06
GBP VIRGIN MEDIA REC FINANCE NT I DAC-REG-S 5.50000% 16-15.09.24	2 080 000.00	2 697 887.50	0.06
GBP VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC-REG-S 4.87500% 15-15.01.27	1 142 000.00	1 441 913.78	0.04
GBP VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC-REG-S 5.00000% 17-15.04.27	2 950 000.00	3 763 604.03	0.09
英ポンド合計		42 119 014.53	1.01
米ドル			
USD ALCATEL-LUCENT USA INC 6.45000% 99-15.03.29	1 230 000.00	1 190 025.00	0.03
USD ALLEGHENY LUDLUM CORP 6.95000% 95-15.12.25	130 000.00	130 000.00	0.00
USD ALLY FINANCIAL INC 4.62500% 15-19.05.22	3 528 000.00	3 596 796.00	0.09
USD ALTICE FINANCING SA-144A 7.50000% 16-15.05.26	3 300 000.00	3 126 750.00	0.07
USD ALTICE FRANCE-144A 6.25000% 14-15.05.24	2 600 000.00	2 548 780.00	0.06
USD BALL CORP 4.87500% 18-15.03.26	4 350 000.00	4 418 730.00	0.11

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD DELL INC 7.10000% 98-15.04.28	2 000 000.00	2 122 600.00	0.05
USD DENBURY RESOURCES INC-144A 9.00000% 16-15.05.21	1 545 000.00	1 529 550.00	0.04
USD DITECH HOLDING CORP (PIK) 9.00000% 18-31.12.24	582 765.00	52 448.85	0.00
USD HCA INC 5.37500% 15-01.02.25	5 300 000.00	5 470 607.00	0.13
USD ISTAR INC 6.00000% 17-01.04.22	885 000.00	882 787.50	0.02
USD SEAGATE HDD CAYMAN-144A 4.75000% 14-01.01.25	270 000.00	255 448.19	0.01
USD SPRINT CAPITAL CORPORATION 6.87500% 98-15.11.28	6 375 000.00	6 327 187.50	0.15
USD SPRINT CAPITAL CORPORATION 6.90000% 99-01.05.19	5 990 000.00	6 028 935.00	0.14
USD T-MOBILE USA INC 6.50000% 15-15.01.26	1 975 000.00	2 088 562.50	0.05
USD TELECOM ITALIA CAPITAL 6.00000% 05-30.09.34	800 000.00	696 240.00	0.02
USD YUM BRANDS INC 6.87500% 07-15.11.37	1 475 000.00	1 463 937.50	0.03
米ドル合計		41 929 385.04	1.00
債券、固定利付債合計		681 262 317.73	16.25
債券、変動利付債			
ユーロ			
EUR AAREAL BANK AG-REG-S-SUB 7.625%/VAR 14-PRP	1 200 000.00	1 414 976.59	0.03
EUR ABN AMRO BANK NV-REG-S-SUB 5.750%/VAR 15-PRP	3 500 000.00	4 175 111.57	0.10
EUR ABN AMRO BANK NV-REG-S-SUB 4.750%/VAR 17-PRP	1 600 000.00	1 718 689.17	0.04
EUR ACCOR SA-REG-S-SUB 4.125%/VAR 14-PRP	7 500 000.00	8 852 639.86	0.21
EUR ACCOR SA-REG-S-SUB 4.375%/VAR 19-PRP	5 200 000.00	5 996 120.23	0.14
EUR AKELIUS RESIDENTIAL PROPERT-REG-S-SUB 3.875%/VAR 18-05.10.78	1 430 000.00	1 628 383.01	0.04
EUR ARKEMA SA-REG-S-SUB 4.750%/VAR 14-PRP	4 800 000.00	5 823 002.15	0.14
EUR ASR NEDERLAND NV-REG-S-SUB 4.625%/VAR 17-PRP	790 000.00	811 057.96	0.02
EUR AUTODIS SA-REG-S 6M EURIBOR+437.5BP 16-01.05.22	3 875 000.00	4 359 397.78	0.10
EUR BANCO BPM SPA-REG-S-SUB 4.375%/VAR 17-21.09.27	1 000 000.00	1 075 734.37	0.03
EUR BANCO COMERCIAL PORTUGUES SA-REG-S-SUB 9.250%/VAR 19-PRP	1 200 000.00	1 376 940.00	0.03
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 6.500%/VAR 17-PRP	2 200 000.00	2 444 457.71	0.06
EUR BANCO SANTANDER SA-REG-S-SUB 6.250%/VAR 14-PRP	2 500 000.00	2 810 185.38	0.07
EUR BANCO SANTANDER SA-REG-S-SUB 6.250%/VAR 14-PRP	400 000.00	462 944.67	0.01
EUR BANKIA SA-REG-S-SUB 3.375%/VAR 17-15.03.27	500 000.00	577 659.60	0.01
EUR BANKINTER SA-REG-S-SUB 8.625%/VAR 16-PRP	1 200 000.00	1 530 086.03	0.04
EUR BANKINTER SA-REG-S-SUB 2.500%/VAR 17-06.04.27	4 000 000.00	4 588 147.66	0.11
EUR BAYER AG-REG-S-SUB 3.750%/VAR 14-01.07.74	3 000 000.00	3 457 978.27	0.08
EUR BELFIUS BANK SA/NV-REG-S-SUB 3.625%/VAR 18-PRP	400 000.00	353 851.55	0.01
EUR BERTELSMANN SE & CO KGAA-REG-S-SUB 3.000%/VAR 15-23.04.75	1 200 000.00	1 366 612.95	0.03
EUR BHP BILLITON FINANCE LTD-REG-S-SUB 5.625%/VAR 15-22.10.79	1 000 000.00	1 338 959.40	0.03
EUR BNP PARIBAS SA-REG-S-SUB 6.125%/VAR 15-PRP	1 750 000.00	2 150 728.64	0.05
EUR CAIXABANK SA-REG-S-SUB 6.750%/VAR 17-PRP	1 200 000.00	1 437 181.12	0.03
EUR CREDIT AGRICOLE ASSURANCES SA-REG-S-SUB 4.250%/VAR 15-PRP	2 300 000.00	2 711 478.97	0.06
EUR CREDIT AGRICOLE SA REG-S-SUB 6.500%/VAR 14-PRP	2 500 000.00	3 067 581.35	0.07
EUR DANSKE BANK AS-REG-S-SUB 5.750%/VAR 14-PRP	1 875 000.00	2 132 750.97	0.05
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 4.000%/VAR 18-PRP	2 800 000.00	3 196 795.71	0.08
EUR ELM BV-REG-S-SUB 2.600%/VAR 15-PRP	2 500 000.00	2 929 401.99	0.07
EUR ENGIE SA-REG-S-SUB 3.87500%/VAR 14-PRP	4 000 000.00	4 800 930.80	0.11
EUR FERROVIAL NETHERLANDS BV-REG-S-SUB 2.124%/VAR 17-PRP	2 050 000.00	2 014 815.49	0.05
EUR GAS NATURAL FENOSA FINANCE BV-REG-S-SUB 4.125%/VAR 14-PRP	4 700 000.00	5 601 484.69	0.13
EUR GAS NATURAL FENOSA FINANCE-REG-S-SUB 3.375%/VAR 15-PRP	500 000.00	562 903.40	0.01
EUR GROUPE BPCE 12.50000%/3M LIBOR+1313BP 09-PRP	4 000 000.00	4 945 481.97	0.12
EUR HEMA BONDCO I BV-REG-S 3M EURIBOR+625BP 17-15.07.22	3 700 000.00	3 608 730.25	0.09
EUR HSBC HOLDINGS PLC-144A-REG-S-SUB 5.25000%/VAR 14-PRP	1 300 000.00	1 551 904.33	0.04
EUR IBERCAJA BANCO SA 5.000%/VAR REG-S-SUB 15-28.07.25	1 500 000.00	1 732 534.75	0.04
EUR INTERNATIONAL DESIGN GRP-REG-S 3M EURIBOR+600BP 18-15.11.25	1 200 000.00	1 318 420.05	0.03
EUR KBC GROEP NV-REG-S-SUB 5.625%/VAR 14-PRP	999 000.00	1 153 643.47	0.03
EUR KBC GROEP NV-REG-S-SUB 4.250%/VAR 18-PRP	3 600 000.00	3 685 401.94	0.09
EUR LA POSTE SA-REG-S-SUB 3.125%/VAR 18-PRP	5 600 000.00	5 968 851.29	0.14

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR LANXESS AG-REG-S-SUB 4.500%/VAR 16-06.12.76	500 000.00	604 081.14	0.01
EUR LIBERBANK SA-REG-S-SUB 6.875%/VAR 17-14.03.27	600 000.00	726 941.70	0.02
EUR LIMACORPORATE SPA-REG-S 3M EURIBOR+375BP 17-15.08.23	400 000.00	458 980.00	0.01
EUR LLOYDS BANKING GROUP PLC-REG-S-SUB 6.375%/VAR 14-PRP	601 000.00	708 568.14	0.02
EUR LOUVRE BIDCO SAS-REG-S 3M EURIBOR+537.5BP 18-30.09.24	470 000.00	533 908.48	0.01
EUR MASARIA INVESTMENTS SAU-REG-S 3M EURIBOR+525BP 17-15.09.24	1 000 000.00	1 098 683.37	0.03
EUR MERCK KGAA-REG-S-SUB 2.625%/VAR 14-12.12.74	1 000 000.00	1 177 297.47	0.03
EUR NAVIERA ARMAS SA-REG-S 3M EURIBOR+650BP 16-31.07.23	1 700 000.00	1 888 828.92	0.05
EUR NN GROUP NV-REG-S-SUB 4.625/3M EURIBOR+395BP 14-08.04.44	3 400 000.00	4 217 742.68	0.10
EUR NOVAFIVES SAS-REG-S 3M EURIBOR+450BP 18-15.06.25	650 000.00	629 080.86	0.01
EUR OMV AG-REG-S-SUB 6.250%/VAR 15-PRP	800 000.00	1 078 603.00	0.03
EUR ORANGE-SUB-REG-S 5.25000%/VAR 14-PRP	1 200 000.00	1 528 089.46	0.04
EUR ORIGIN ENERGY FINANCE LTD-REG-S-SUB 4.000%/VAR 14-16.09.74	1 500 000.00	1 750 968.53	0.04
EUR ORSTED A/S-SUB VAR 13-PRP	4 400 000.00	5 780 450.71	0.14
EUR PERSTORP HOLDING AB-REG-S 3M EURIBOR+425BP 17-15.09.22	250 000.00	288 841.85	0.01
EUR PICARD GROUPE SA-REG-S 3M EURIBOR+300BP 17-30.11.23	2 675 000.00	2 948 186.32	0.07
EUR RABOBANK NEDERLAND NV REG-S 5.500%/VAR 15-PRP	1 000 000.00	1 197 650.94	0.03
EUR RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S-SUB 6.625%/VAR 16-PRP	1 800 000.00	2 282 278.05	0.05
EUR RAIFFEISEN BANK INTL AG-REG-S-SUB 6.125%/VAR 17-PRP	600 000.00	694 523.03	0.02
EUR REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV-SUB-REG-S 3.875%/VAR 15-PRP	3 644 000.00	4 352 883.58	0.10
EUR REPSOL INTERNATIONAL FINANC-REG-S-SUB 4.500%/VAR 15-25.03.75	5 800 000.00	7 044 420.00	0.17
EUR SES SA-REG-S-SUB 5.625%/VAR 16-PRP	2 000 000.00	2 402 797.02	0.06
EUR SOCIETE GENERALE-SUB 9.375%/3M EURIBOR+890.1BP 09-PRP	6 800 000.00	8 192 793.00	0.20
EUR SOLVAY FIN SA-REG-S-SUB 4.199%/VAR 13-PRP	3 500 000.00	4 056 235.75	0.10
EUR SOLVAY FIN SA-REG-S-SUB 5.425%/VAR 13-PRP	6 900 000.00	8 659 661.71	0.21
EUR SOLVAY FINANCE SA-REG-S-SUB 5.118%/VAR 15-PRP	2 500 000.00	3 076 600.31	0.07
EUR SOLVAY FINANCE SA-REG-S-SUB 5.869%/VAR 15-PRP	3 800 000.00	4 846 484.57	0.12
EUR SOLVAY SA-REG-S-SUB 4.250%/VAR 18-PRP	600 000.00	708 263.52	0.02
EUR SWISS LIFE AG VIA DEMETER INV BV-SUB 4.375%/VAR 15-PRP	1 192 000.00	1 453 296.31	0.03
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 7.625%/VAR 13-PRP	6 000 000.00	7 924 413.62	0.19
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 5.000%/VAR 14-PRP	500 000.00	596 674.00	0.01
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 5.875%/VAR 14-PRP	1 100 000.00	1 380 525.78	0.03
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 3.750%/VAR 16-PRP	1 500 000.00	1 760 500.41	0.04
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 3.000%/VAR 18-PRP	11 700 000.00	12 803 499.31	0.31
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 3.875%/VAR 18-PRP	2 000 000.00	2 139 379.22	0.05
EUR TENNET HOLDING BV-REG-S-SUB 2.993%/VAR 17-PRP	4 500 000.00	5 146 795.18	0.12
EUR UBS GROUP FUNDING SWITZERLAND AG-REG-S-SUB 5.750%/VAR 15-PRP	1 000 000.00	1 241 336.65	0.03
EUR UNIBAIL-RODAMCO SE-REG-S-SUB 2.125%/VAR 18-PRP	600 000.00	664 263.39	0.02
EUR UNIBAIL-RODAMCO SE-REG-S-SUB 2.875%/VAR 18-PRP	700 000.00	769 078.36	0.02
EUR VOLKSWAGEN INTL FIN NV-REG-S-SUB 3.875%/VAR 17-PRP	1 500 000.00	1 604 682.43	0.04
EUR VOLKSWAGEN INTL FINANCE NV-REG-S-SUB 3.375%/VAR 18-PRP	1 100 000.00	1 214 117.99	0.03
EUR VOLKSWAGEN INTL FINANCE NV-REG-S-SUB 4.625%/VAR 18-PRP	4 600 000.00	5 127 881.54	0.12
EUR VOLVO TREASURY AB-REG-S-SUB 4.200%/VAR 14-10.06.75	2 250 000.00	2 677 287.71	0.06
EUR VONOVIA FINANCE BV-REG-S-SUB 4.625%/VAR 14-08.04.74	2 000 000.00	2 311 010.19	0.06
EUR VONOVIA FINANCE BV-REG-S-SUB 4.000%/VAR 14-PRP	3 300 000.00	3 957 057.05	0.09
ユーロ合計		236 439 600.34	5.64
英ポンド			
GBP AVIVA PLC-REG-S-SUB 4.375%/FLR 16-12.09.49	1 025 000.00	1 308 781.46	0.03
GBP BARCLAYS BANK PLC-SUB 14.000%/3M LIBOR+1340BP 08-PRP	1 300 000.00	1 782 154.82	0.04
GBP BARCLAYS PLC-REG-S-SUB 5.875%/VAR 17-PRP	850 000.00	1 047 166.87	0.02
GBP LLOYDS BANKING GROUP PLC-REG-S-SUB 7.000%/VAR 14-PRP	1 300 000.00	1 718 635.42	0.04
GBP QUILTER PLC-REG-S-SUB 4.478%/VAR 18-28.02.28	1 775 000.00	2 337 900.77	0.06
GBP STONEGATE PUB CO FIN PLC-REG-S 3M LIBOR+437.5BP 17-15.03.22	2 850 000.00	3 653 432.17	0.09
GBP TVL FINANCE PLC-REG-S 3M LIBOR+487.5BP 17-15.05.23	1 175 000.00	1 522 407.12	0.04
英ポンド合計		13 370 478.63	0.32

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
米ドル			
USD BARCLAYS PLC-SUB 7.750%/VAR 18-PRP	1 100 000.00	1 096 788.00	0.03
USD CITIGROUP INC-SUB 6.250%/VAR 16-PRP	1 200 000.00	1 242 000.00	0.03
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S-SUB 7.125%/VAR 17-PRP	900 000.00	924 750.00	0.02
USD DNB BANK ASA-REG-S-SUB 6.500%/VAR 16-PRP	800 000.00	806 000.00	0.02
USD PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP 6.125%/VAR 17-PRP	1 445 000.00	1 295 081.25	0.03
USD SCOR SE-REG-S-SUB 5.250%/VAR 18-PRP	600 000.00	502 466.40	0.01
USD SVENSKA HANDELSBANKEN AB-REG-S-SUB 5.250%/VAR 15-PRP	1 800 000.00	1 777 500.00	0.04
USD SWEDBANK-REG-S-SUB 6.000%/VAR 16-PRP	800 000.00	798 000.00	0.02
USD WESTPAC BANKING CORP-SUB 5.000%/VAR 17-PRP	300 000.00	260 280.00	0.01
米ドル合計		8 702 865.65	0.21
債券、変動利付債合計		258 512 944.62	6.17
転換社債、固定利付債			
ユーロ			
EUR TELECOM ITALIA SPA-REG-S 1.12500% 15-26.03.22	3 900 000.00	4 173 525.79	0.10
ユーロ合計		4 173 525.79	0.10
転換社債、固定利付債合計		4 173 525.79	0.10
転換社債、変動利付債			
ユーロ			
EUR BANCO BILBALO VIZCAYA ARGENT-REG-S-SUB 5.875%/VAR 18-PRP	1 600 000.00	1 784 863.06	0.04
EUR BANKIA SA-REG-S-SUB 6.375%/VAR 18-PRP	1 000 000.00	1 132 946.23	0.03
ユーロ合計		2 917 809.29	0.07
米ドル			
USD DANSKE BANK AS-REG-S-SUB 7.000%/VAR 18-PRP	1 450 000.00	1 317 223.50	0.03
米ドル合計		1 317 223.50	0.03
転換社債、変動利付債合計		4 235 032.79	0.10
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
合計		2 127 081 589.17	50.74
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
財務省証券 (T-bill)、ゼロ・クーポン			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 10.01.19-11.07.19	2 000 000.00	1 978 633.34	0.05
米ドル合計		1 978 633.34	0.05
財務省証券 (T-bill)、ゼロ・クーポン合計		1 978 633.34	0.05
ノート、固定利付債			
ユーロ			
EUR ARD FINANCE SA (PIK) 6.62500% 17-15.09.23	8 050 000.00	8 844 401.17	0.21
ユーロ合計		8 844 401.17	0.21
英ポンド			
GBP WAGAMAMA FINANCE PLC-REG-S 4.12500% 17-01.07.22	4 260 000.00	5 491 740.66	0.13
英ポンド合計		5 491 740.66	0.13

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
米ドル			
USD 1011778 BC ULC/NEW RED FINANCE INC-144A 4.62500% 15-15.01.22	7 589 000.00	7 607 972.50	0.18
USD 1011778 BC ULC/NEW RED FINANCE INC-144A 4.25000% 17-15.05.24	2 409 000.00	2 330 707.50	0.06
USD 1011778 BC ULC/NEW RED FINANCE INC-144A 5.00000% 17-15.10.25	10 585 000.00	10 214 525.00	0.24
USD ACADIA HEALTHCARE CO INC 5.62500% 15-15.02.23	2 300 000.00	2 259 750.00	0.05
USD ACCO BRANDS CORP-144A 5.25000% 16-15.12.24	4 356 000.00	4 257 990.00	0.10
USD ACI WORLDWIDE INC-144A 5.75000% 18-15.08.26	3 855 000.00	3 976 432.50	0.09
USD ACTUANT CORP 5.62500% 12-15.06.22	500 000.00	503 750.00	0.01
USD ADT CORP 4.12500% 13-15.06.23	700 000.00	673 750.00	0.02
USD ADVANCED DISPOSAL SERVICES INC-144A 5.62500% 16-15.11.24	4 035 000.00	4 045 087.50	0.10
USD ALBERTSONS COS LLC / SAFEWAY INC 5.75000% 17-15.03.25	850 000.00	795 812.50	0.02
USD ALCOA NEDERLAND HOLDING BV-144A 6.75000% 16-30.09.24	3 905 000.00	4 067 682.30	0.10
USD ALCOA NEDERLAND HOLDING BV-144A 7.00000% 16-30.09.26	1 450 000.00	1 529 750.00	0.04
USD ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC 5.95000% 11-15.01.21	2 047 000.00	2 074 675.44	0.05
USD ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC STEP-UP 13-15.08.23	1 275 000.00	1 359 468.75	0.03
USD ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP-144A 5.37500% 14-01.08.22	6 115 000.00	6 115 000.00	0.15
USD ALLIANCE RESOURCE OP PART/FIN CORP-144A 7.50000% 17-01.05.25	630 000.00	654 412.50	0.02
USD ALLIANT HLDG INTER LLC/CO ISSUER-144A 8.25000% 15-01.08.23	2 075 000.00	2 106 125.00	0.05
USD ALLISON TRANSMISSION INC-144A 4.75000% 17-01.10.27	5 460 000.00	5 077 800.00	0.12
USD ALLY FINANCIAL INC 8.00000% 08-01.11.31	2 100 000.00	2 520 000.00	0.06
USD ALPHA 2 BV-144A (PIK) 8.75000% 18-01.06.23	750 000.00	725 625.00	0.02
USD ALPHA 3 BV / ALPHA US BIDCO INC-144A 6.25000% 17-01.02.25	495 000.00	467 973.00	0.01
USD ALTICE FRANCE-144A 8.12500% 18-01.02.27	3 199 000.00	3 142 697.60	0.08
USD AMERICAN BUILDER & CONTRACT SUPPLY-144A 5.75000% 15-15.12.23	865 000.00	888 787.50	0.02
USD AMSTED INDUSTRIES INC-144A 5.00000% 14-15.03.22	500 000.00	495 000.00	0.01
USD AMSTED INDUSTRIES INC-144A 5.37500% 14-15.09.24	1 750 000.00	1 680 000.00	0.04
USD AMWINS-144A 7.75000% 18-01.07.26	1 600 000.00	1 596 000.00	0.04
USD ANTERO RESOURCES CORP 5.37500% 14-01.11.21	550 000.00	552 777.50	0.01
USD ANTERO RESOURCES FIN CORP 5.12500% 14-01.12.22	750 000.00	749 062.50	0.02
USD ARAMARK SERVICES INC-144A 5.00000% 17-01.04.25	575 000.00	577 875.00	0.01
USD ARAMARK SERVICES INC-144A 5.00000% 18-01.02.28	400 000.00	390 500.00	0.01
USD ARD FINANCE SA (PIK) 7.12500% 17-15.09.23	685 200.00	661 218.00	0.02
USD ASCENT RESOURCES UTICA HOLDINGS-144A 10.00000% 17-01.04.22	4 456 000.00	4 762 350.00	0.11
USD ASHLAND INC 4.75000% 13-15.08.22	2 066 000.00	2 078 912.50	0.05
USD ASHLAND INC 6.87500% 13-15.05.43	1 540 000.00	1 540 000.00	0.04
USD ATS AUTOMATION TOOLING SYSTEMS INC-144A 6.50000% 15-15.06.23	1 450 000.00	1 479 000.00	0.04
USD AVANTOR INC-144A 6.00000% 17-01.10.24	1 250 000.00	1 278 125.00	0.03
USD AVIS BUDGET CAR RENT LLC/FIN INC 5.50000% 13-01.04.23	150 000.00	149 250.00	0.00
USD AVIS BUDGET CAR RENT LLC/FIN INC-144A 6.37500% 16-01.04.24	2 450 000.00	2 431 625.00	0.06
USD AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD-144A 5.50000% 18-15.01.23	225 000.00	229 286.25	0.01
USD B&G FOODS HOLDINGS CORP 4.62500% 13-01.06.21	1 485 000.00	1 492 870.50	0.04
USD BBA US HOLDINGS INC-144A 5.37500% 18-01.05.26	600 000.00	600 000.00	0.01
USD BEAZER HOMES USA INC 6.75000% 17-15.03.25	550 000.00	492 250.00	0.01
USD BEAZER HOMES USA INC 8.75000% 17-15.03.22	2 450 000.00	2 561 475.00	0.06
USD BEAZER HOMES USA INC 5.87500% 18-15.10.27	75 000.00	63 750.00	0.00
USD BERRY PLASTICS CORP 5.50000% 14-15.05.22	3 421 000.00	3 443 373.34	0.08
USD BERRY PLASTICS CORP 5.12500% 15-15.07.23	3 768 000.00	3 778 663.44	0.09
USD BERRY PLASTICS CORP-144A 4.50000% 18-15.02.26	3 063 000.00	2 886 877.50	0.07
USD BEVERAGES & MORE INC-144A 11.50000% 17-15.06.22	1 075 000.00	806 250.00	0.02
USD BIG RIVER STEEL LLC/BRS FIN CORP-144A 7.25000% 17-01.09.25	525 000.00	551 250.00	0.01
USD BLUE RACER MIDSTREAM / FINANC CORP-144A 6.12500% 14-15.11.22	5 087 000.00	5 137 870.00	0.12
USD BLUE RACER MIDSTREAM / FINANC CORP-144A 6.62500% 18-15.07.26	2 765 000.00	2 720 068.75	0.06
USD BMC EAST LLC-144A 5.50000% 16-01.10.24	1 275 000.00	1 216 031.25	0.03
USD BOMBARDIER INC-144A 6.12500% 13-15.01.23	2 150 000.00	2 077 330.00	0.05
USD BOMBARDIER INC-144A 6.00000% 14-15.10.22	1 600 000.00	1 542 000.00	0.04
USD BOMBARDIER INC-144A 7.50000% 15-15.03.25	4 800 000.00	4 626 000.00	0.11
USD BOMBARDIER INC-144A 7.50000% 17-01.12.24	4 240 000.00	4 112 800.00	0.10
USD BOOZ ALLEN HAMILTON INC-144A 5.12500% 17-01.05.25	1 255 000.00	1 229 900.00	0.03

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD BOYD GAMING CORP 6.00000% 18-15.08.26	2 099 000.00	2 099 000.00	0.05
USD BROOKFIELD RESIDENT PROPERTIES INC-144A 6.37500% 15-15.05.25	1 050 000.00	987 000.00	0.02
USD BRUIN E&P PARTNERS LLC-144A 8.87500% 18-01.08.23	950 000.00	904 286.00	0.02
USD BUILDERS FIRSTSOURCE INC-144A 5.62500% 16-01.09.24	610 000.00	581 787.50	0.01
USD BWAY HOLDING CO-144A 5.50000% 17-15.04.24	4 449 000.00	4 346 139.12	0.10
USD BWAY HOLDING CO-144A 7.25000% 17-15.04.25	8 250 000.00	7 610 625.00	0.18
USD BWX TECHNOLOGIES INC-144A 5.37500% 18-15.07.26	2 323 000.00	2 346 230.00	0.06
USD CALIFORNIA RESOURCES CORP-144A 8.00000% 15-15.12.22	5 590 000.00	4 510 459.20	0.11
USD CALPINE CORP 5.75000% 14-15.01.25	1 050 000.00	989 625.00	0.02
USD CALPINE CORP-144A 5.87500% 13-15.01.24	775 000.00	775 000.00	0.02
USD CALPINE CORP-144A 5.25000% 16-01.06.26	1 440 000.00	1 368 000.00	0.03
USD CALUMET SPECIALTY PROD PART LP/FIN 7.62500% 14-15.01.22	3 920 000.00	3 609 666.54	0.09
USD CAMELOT FINANCE SA-144A 7.87500% 16-15.10.24	1 562 000.00	1 608 860.00	0.04
USD CANBRIAM ENERGY INC-144A 9.75000% 14-15.11.19	1 495 000.00	1 222 162.50	0.03
USD CARMIKE CINEMAS INC-144A 6.00000% 15-15.06.23	1 700 000.00	1 727 625.00	0.04
USD CARROLS RESTAURANT GROUP INC 8.00000% 15-01.05.22	2 735 000.00	2 796 537.50	0.07
USD CATALENT PHARMA SOLUTIONS INC-144A 4.87500% 17-15.01.26	2 681 000.00	2 600 570.00	0.06
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP 5.25000% 12-30.09.22	5 512 000.00	5 572 218.60	0.13
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP 5.75000% 13-15.01.24	2 895 000.00	2 952 900.00	0.07
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.12500% 15-01.05.23	3 062 000.00	3 102 969.56	0.07
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.87500% 15-01.05.27	9 245 000.00	9 270 886.00	0.22
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.75000% 15-15.02.26	9 860 000.00	10 007 900.00	0.24
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.87500% 16-01.04.24	1 510 000.00	1 548 112.40	0.04
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.50000% 16-01.05.26	5 025 000.00	5 012 437.50	0.12
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.12500% 17-01.05.27	2 200 000.00	2 125 684.00	0.05
USD CDW LLC/CDW FINANCE CORP 5.50000% 14-01.12.24	3 827 000.00	3 959 031.50	0.09
USD CENGAGE LEARNING INC-144A 9.50000% 16-15.06.24	3 425 000.00	2 321 533.50	0.06
USD CENTENE CORP 6.12500% 16-15.02.24	5 096 000.00	5 338 060.00	0.13
USD CENTENE CORP-144A 5.37500% 18-01.06.26	2 430 000.00	2 508 975.00	0.06
USD CENTENNIAL RESOURCE PRODUCTION LLC-144A 5.37500% 17-15.01.26	1 250 000.00	1 206 250.00	0.03
USD CENTRAL GARDEN & PET CO 6.12500% 15-15.11.23	1 914 000.00	1 957 065.00	0.05
USD CENTURYLINK INC 7.60000% 09-15.09.39	2 385 000.00	1 955 700.00	0.05
USD CHANGE HC HLDS LLC/CHNG HC FIN INC-144A 5.75000% 17-01.03.25	6 394 000.00	6 122 255.00	0.15
USD CHARLES RIVER LABORATORIES INC-144A 5.50000% 18-01.04.26	3 786 000.00	3 861 720.00	0.09
USD CHENIERE CORPUS CHRISTI HLDGS LLC 5.87500% 17-31.03.25	1 840 000.00	1 938 366.40	0.05
USD CHENIERE CORPUS CHRISTI HLDGS LLC 7.00000% 17-30.06.24	2 890 000.00	3 168 162.50	0.08
USD CHENIERE CORPUS CHRISTI HLDGS LLC 5.12500% 17-30.06.27	2 650 000.00	2 676 500.00	0.06
USD CHENIERE ENERGY PARTNERS LP 5.25000% 18-01.10.25	2 615 000.00	2 628 048.85	0.06
USD CHESAPEAKE 7.00000% 18-01.10.24	3 345 000.00	3 265 556.25	0.08
USD CHOBANI LLC/FINANCE CORP-144A 7.50000% 17-15.04.25	1 840 000.00	1 573 200.00	0.04
USD CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC 5.12500% 14-01.08.21	2 175 000.00	2 090 718.75	0.05
USD CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC 6.87500% 14-01.02.22	3 600 000.00	2 046 420.00	0.05
USD CHURCHILL DOWNS INC-144A 4.75000% 17-15.01.28	3 110 000.00	2 981 712.50	0.07
USD CINCINNATI BELL INC-144A 7.00000% 16-15.07.24	5 576 000.00	4 795 360.00	0.11
USD CIT GROUP INC 5.00000% 12-15.08.22	330 000.00	338 250.00	0.01
USD CLEAR CHANNEL WORLDWIDE HOLDINGS-SUB 7.62500% 12-15.03.20	1 900 000.00	1 897 625.00	0.05
USD CLEAR CHANNEL WORLDWIDE HLDGS INC 6.50000% 13-15.11.22	2 500 000.00	2 556 250.00	0.06
USD CLEARWATER PAPER CORP 4.50000% 13-01.02.23	170 000.00	157 675.00	0.00
USD CLEAVER-BROOKS INC-144A 7.87500% 17-01.03.23	1 925 000.00	1 905 750.00	0.05
USD CLEVELAND-CLIFFS INC 5.75000% 18-01.03.25	7 855 000.00	7 599 712.49	0.18
USD CLOUD CRANE LLC-144A 10.12500% 16-01.08.24	1 282 000.00	1 365 330.00	0.03
USD COGENT COMMUNICATIONS GROUP INC-144A 5.37500% 15-01.03.22	500 000.00	508 000.00	0.01
USD COMMSCOPE INC-144A 5.50000% 14-15.06.24	1 555 000.00	1 453 925.00	0.03
USD COMMSCOPE TECHNOLOGIES LLC-144A 6.00000% 15-15.06.25	5 276 000.00	4 972 630.00	0.12
USD COMMSCOPE TECHNOLOGIES LLC-144A 5.00000% 17-15.03.27	1 970 000.00	1 679 228.00	0.04
USD COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC 8.25000% 15-15.10.23	2 490 000.00	2 303 250.00	0.06
USD CONSOL ENERGY INC 5.87500% 14-15.04.22	3 100 000.00	3 084 500.00	0.07
USD CONSOLIDATED COMMUNICATIONS INC 6.50000% 15-01.10.22	2 470 000.00	2 260 050.00	0.05

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD CONSTELLIUM NV-144A 6.62500% 17-01.03.25	1 050 000.00	1 044 750.00	0.03
USD CONSTELLIUM NV-144A 5.87500% 17-15.02.26	2 360 000.00	2 259 700.00	0.05
USD CONTINENTAL RESOURCES INC 4.90000% 14-01.06.44	2 220 000.00	2 113 963.41	0.05
USD CORE & MAIN LP-144A 6.12500% 17-15.08.25	3 850 000.00	3 667 125.00	0.09
USD COREVIC INC 4.75000% 17-15.10.27	900 000.00	766 125.00	0.02
USD COTT HOLDINGS INC-144A 5.50000% 17-01.04.25	1 670 000.00	1 653 300.00	0.04
USD COVANTA HOLDING CORP 5.875000% 14-01.03.24	3 650 000.00	3 640 875.00	0.09
USD COVEY PARK ENERGY LLC-144A 7.50000% 17-15.05.25	500 000.00	462 500.00	0.01
USD CRC ESCROW ISSUER LLC / FINCO INC-144A 5.25000% 17-15.10.25	2 272 000.00	2 127 160.00	0.05
USD CROWN AMERICAS CAPITAL CORP VI 4.75000% 19-01.02.26	1 955 000.00	1 915 900.00	0.05
USD CROWN AMERICAS LLC/CAPITAL CORP V 4.25000% 17-30.09.26	790 000.00	750 500.00	0.02
USD CROWNROCK LP / CROWNROCK FIN INC-144A 5.62500% 17-15.10.25	10 361 000.00	9 946 560.00	0.24
USD CSC HOLDINGS INC-144A 5.37500% 18-01.02.28	600 000.00	576 750.00	0.01
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 5.25000% 14-01.06.24	2 000 000.00	1 920 000.00	0.05
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 5.50000% 16-15.04.27	2 150 000.00	2 101 582.00	0.05
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 5.50000% 18-15.05.26	4 837 000.00	4 788 630.00	0.11
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 5.12500% 18-15.12.21	4 119 000.00	4 105 471.56	0.10
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 7.75000% 18-15.07.25	500 000.00	523 750.00	0.01
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 7.50000% 18-01.04.28	503 000.00	516 832.50	0.01
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 10.87500% 15-15.10.25	1 243 000.00	1 432 793.67	0.03
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 6.62500% 15-15.10.25	1 800 000.00	1 883 250.00	0.05
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 10.12500% 15-15.01.23	3 115 000.00	3 363 577.00	0.08
USD CURO GROUP HOLDINGS CORP-144A 8.25000% 18-01.09.25	1 888 000.00	1 602 440.00	0.04
USD CVR REFINING LLC/COFFEYVILLE FIN 6.50000% 13-01.11.22	1 187 000.00	1 189 967.50	0.03
USD CYRUSONE LP / CYRUSONE FIN CORP 5.00000% 18-15.03.24	950 000.00	957 125.00	0.02
USD DAE FUNDING LLC-144A 4.50000% 17-01.08.22	1 520 000.00	1 497 200.00	0.04
USD DAE FUNDING LLC-144A 5.00000% 17-01.08.24	5 815 000.00	5 735 043.75	0.14
USD DAE FUNDING LLC-144A 4.00000% 17-01.08.20	1 675 000.00	1 654 062.50	0.04
USD DANA FINANCING LUXEMBOURG SARL-144A 5.75000% 17-15.04.25	700 000.00	684 250.00	0.02
USD DBP HOLDING CORP-144A 7.75000% 12-15.10.20	1 605 000.00	632 971.88	0.02
USD DCP MIDSTREAM OPERATING LP-144A 5.35000% 10-15.03.20	400 000.00	406 000.00	0.01
USD DECK CHASSIS ACQUISITION INC-144A 10.00000% 16-15.06.23	1 180 000.00	1 138 700.00	0.03
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP-144A 4.42000% 16-15.06.21	210 000.00	213 606.65	0.01
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP-144A 6.02000% 16-15.06.26	805 000.00	841 999.65	0.02
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP-144A 5.87500% 16-15.06.21	8 204 000.00	8 337 817.90	0.20
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP-144A 7.12500% 16-15.06.24	10 241 000.00	10 804 798.80	0.26
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP-REG-S 5.87500% 16-15.06.21	1 650 000.00	1 676 913.64	0.04
USD DELPHI JERSEY HOLDINGS PLC-144A 5.00000% 17-01.10.25	3 550 000.00	3 044 125.00	0.07
USD DENBURY RESOURCES INC-SUB 5.50000% 14-01.05.22	2 100 000.00	1 533 000.00	0.04
USD DIAMONDBACK ENERGY INC-144A 4.75000% 16-01.11.24	450 000.00	448 875.00	0.01
USD DIAMONDBACK ENERGY INC 4.75000% 17-01.11.24	3 084 000.00	3 076 290.00	0.07
USD DIAMONDBACK ENERGY INC 5.37500% 17-31.05.25	1 016 000.00	1 040 688.80	0.02
USD DIGICEL LTD-144A 6.00000% 13-15.04.21	7 194 000.00	6 654 450.00	0.16
USD DIGICEL LTD-144A 6.75000% 15-01.03.23	2 800 000.00	2 281 160.00	0.05
USD DISH DBS CORP 5.00000% 13-15.03.23	3 210 000.00	2 792 700.00	0.07
USD DISH DBS CORP 5.87500% 12-15.07.22	6 222 000.00	5 910 900.00	0.14
USD DISH DBS CORP 5.87500% 14-15.11.24	750 000.00	621 562.50	0.01
USD DISH DBS CORP 7.75000% 16-01.07.26	3 475 000.00	2 988 500.00	0.07
USD DISH DBS CORP 7.87500% 09-01.09.19	4 075 000.00	4 146 312.50	0.10
USD DKT FINANCE APS-144A 9.37500% 18-17.06.23	2 435 000.00	2 562 837.50	0.06
USD DOLE FOOD CO INC-144A 7.25000% 17-15.06.25	2 315 000.00	2 106 650.00	0.05
USD DPL INC 7.25000% 12-15.10.21	1 550 000.00	1 646 875.00	0.04
USD EAGLE HOLDING CO II LLC-144A (PIK) 7.62500% 17-15.05.22	5 214 000.00	5 214 000.00	0.12
USD EIG INVESTORS CORP 10.87500% 17-01.02.24	3 570 000.00	3 748 500.00	0.09
USD ELDORADO GOLD CORP-144A 6.12500% 12-15.12.20	5 115 000.00	4 872 037.50	0.12
USD ELDORADO RESORTS INC 7.00000% 16-01.08.23	4 572 000.00	4 777 740.00	0.11
USD ELDORADO RESORTS INC 6.00000% 17-01.04.25	2 725 000.00	2 740 668.75	0.07
USD ENDEAVOR ENERGY RESOURCES LP/FIN-144A 5.50000% 17-30.01.26	2 634 000.00	2 745 945.00	0.07

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD ENDEAVOR ENERGY RESOURCES LP/FIN-144A 5.75000% 17-30.01.28	1 286 000.00	1 366 375.00	0.03
USD ENDO FINANCE LLC / ENDO FINCO INC-REG-S 7.25000% 14-15.01.22	1 400 000.00	1 319 500.00	0.03
USD ENDO FINANCE LLC& FINCO INC-144A STEP UP 14-15.01.22	3 509 000.00	3 307 232.50	0.08
USD ENDO FINANCE LLC& FINCO INC-144A 5.37500% 14-15.01.23	4 070 000.00	3 322 137.50	0.08
USD ENDO FINANCE LLC-144A 5.75000% 13-15.01.22	640 000.00	580 800.00	0.01
USD ENDO FINANCE LLC-144A 5.87500% 17-15.10.24	2 050 000.00	2 009 000.00	0.05
USD ENDO FINANCE LLC-144A 6.00000% 15-15.07.23	3 880 000.00	3 170 425.60	0.08
USD ENERGIZER HOLDINGS INC-144A 6.37500% 18-15.07.26	3 765 000.00	3 661 462.50	0.09
USD ENERGIZER SPINCO INC-144A 5.50000% 15-15.06.25	650 000.00	619 125.00	0.01
USD ENERGY TRANSFER EQUITY LP 7.50000% 10-15.10.20	1 400 000.00	1 485 750.00	0.04
USD ENERSYS-144A 5.00000% 15-30.04.23	350 000.00	347 375.00	0.01
USD ENOVA INTERNATIONAL INC-144A 8.50000% 17-01.09.24	4 086 000.00	3 708 045.00	0.09
USD ENSCO PLC 7.75000% 18-01.02.26	700 000.00	562 187.50	0.01
USD ENTEGRIS INC-144A 4.62500% 17-10.02.26	1 832 000.00	1 777 040.00	0.04
USD ENTERPRISE MERGER SUB INC-144A 8.75000% 18-15.10.26	5 621 000.00	5 125 649.38	0.12
USD EP ENERGY LLC/ EVEREST ACQUIS FIN-144A 8.00000% 16-29.11.24	365 000.00	292 000.00	0.01
USD EP ENERGY LLC/ EVEREST ACQUIS FIN-144A 7.75000% 18-15.05.26	775 000.00	713 968.75	0.02
USD EP ENERGY LLC/ EVEREST ACQUIS FINANCE 9.37500% 12-01.05.20	500 000.00	397 500.00	0.01
USD EQUINIX INC 5.87500% 15-15.01.26	1 600 000.00	1 652 480.00	0.04
USD EQUINIX INC-144A 5.75000% 14-01.01.25	2 604 000.00	2 688 630.00	0.06
USD ESH HOSPITALITY INC-144A 5.25000% 15-01.05.25	2 100 000.00	2 076 060.00	0.05
USD EVERI PAYMENTS INC-144A 7.50000% 17-15.12.25	2 567 000.00	2 534 142.40	0.06
USD EW SCRIPPS CO-144A 5.12500% 17-15.05.25	1 950 000.00	1 862 250.00	0.04
USD EXELA INTERMEDIATE LLC/FIN INC-144A 10.00000% 17-15.07.23	5 057 000.00	5 057 000.00	0.12
USD EXTRACTION OIL & GAS INC-144A 7.37500% 17-15.05.24	275 000.00	254 375.00	0.01
USD EXTRACTION OIL & GAS INC-144A 5.62500% 18-01.02.26	995 000.00	815 900.00	0.02
USD FAGE DAIRY INDUSTRY SA/USA DAIRY-144A 5.62500% 16-15.08.26	1 750 000.00	1 509 375.00	0.04
USD FAIR ISSAC CORP-144A 5.25000% 18-15.05.26	1 930 000.00	1 939 650.00	0.05
USD FERRELLGAS L.P/FIN CORP 6.75000% 14-15.01.22	1 300 000.00	1 138 312.50	0.03
USD FIDELITY&GUARANTY LIFE HOLDING INC-144A 5.50000% 18-01.05.25	3 200 000.00	3 080 000.00	0.07
USD FINANCIAL & RISK US HOLDINGS INC-144A 8.25000% 18-15.11.26	4 694 000.00	4 400 625.00	0.11
USD FIRST CASH FINANCIAL SERVICES INC-144A 5.37500% 17-01.06.24	900 000.00	900 000.00	0.02
USD FIRST DATA CORP-144A 5.37500% 15-15.08.23	4 348 000.00	4 432 242.50	0.11
USD FIRST DATA CORP-144A 5.00000% 15-15.01.24	1 950 000.00	1 992 656.25	0.05
USD FIRST QUALITY FINANCE CORP-144A 4.62500% 13-15.05.21	1 636 000.00	1 627 820.00	0.04
USD FIRST QUANTUM MINERALS LTD-144A 7.00000% 14-15.02.21	335 000.00	334 162.50	0.01
USD FIRST QUANTUM MINERALS LTD-144A 7.50000% 17-01.04.25	491 000.00	445 582.50	0.01
USD FIRST QUANTUM MINERALS LTD-144A 6.87500% 18-01.03.26	375 000.00	334 687.50	0.01
USD FIVE POINT OPERATING/CAPITAL CORP-144A 7.87500% 17-15.11.25	519 000.00	498 240.00	0.01
USD FLEX ACQUISITION CO INC-144A 6.87500% 17-15.01.25	750 000.00	701 250.00	0.02
USD FLEX ACQUISITION CO INC-144A 7.87500% 18-15.07.26	3 264 000.00	3 100 800.00	0.07
USD FMG RESOURCES AUGUST 2006 PTY LTD-144A 4.75000% 17-15.05.22	4 695 000.00	4 645 796.40	0.11
USD FMG RESOURCES AUGUST 2006 PTY LTD-144A 5.12500% 17-15.05.24	1 000 000.00	976 400.00	0.02
USD FMG RESOURCES AUGUST 2006 PTY LTD-144A 5.12500% 18-15.03.23	3 340 000.00	3 302 425.00	0.08
USD FREEDOM MORTGAGE CORP-144A 8.25000% 18-15.04.25	3 274 000.00	2 995 710.00	0.07
USD FREEPORT-MCMORAN INC 3.87500% 13-15.03.23	600 000.00	573 750.00	0.01
USD FREEPORT-MCMORAN INC 5.45000% 13-15.03.43	478 000.00	411 080.00	0.01
USD FRONTIER COMMUNICATIONS CORP 7.62500% 13-15.04.24	600 000.00	325 500.00	0.01
USD FRONTIER COMMUNICATIONS CORP 11.00000% 16-15.09.25	1 400 000.00	902 125.00	0.02
USD FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATIO-144A 8.50000% 18-01.04.26	1 775 000.00	1 610 368.75	0.04
USD GARTNER INC-144A 5.12500% 17-01.04.25	1 536 000.00	1 528 320.00	0.04
USD GATEWAY CASINO & ENTERTAINMENT LTD-144A 8.25000% 17-01.03.24	2 000 000.00	2 065 000.00	0.05
USD GENESIS ENERGY LP 5.62500% 14-15.06.24	3 252 000.00	2 991 840.00	0.07
USD GENESIS ENERGY LP 6.00000% 15-15.05.23	10 065 000.00	9 662 400.00	0.23
USD GEO GROUP INC/THE 5.87500% 14-15.10.24	250 000.00	226 250.00	0.01
USD GEO GROUP INC/THE 6.00000% 16-15.04.26	1 600 000.00	1 430 000.00	0.03
USD GFL ENVIRONMENTAL INC-144A 5.37500% 18-01.03.23	1 225 000.00	1 145 375.00	0.03
USD GLP CAPITAL LP / GLP FINANC II INC 4.87500% 14-01.11.20	3 200 000.00	3 245 760.00	0.08

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD GOEASY LTD-144A 7.87500% 17-01.11.22	1 250 000.00	1 309 375.00	0.03
USD GOLDEN NUGGET INC-144A-SUB 8.75000% 17-01.10.25	1 755 000.00	1 798 875.00	0.04
USD GOLDEN NUGGET INC-144A 6.75000% 17-15.10.24	3 140 000.00	3 140 000.00	0.07
USD GRAHAM HOLDINGS CO-144A 5.75000% 18-01.06.26	2 147 000.00	2 222 145.00	0.05
USD GRAY TELEVISION INC-144A 5.87500% 16-15.07.26	150 000.00	147 375.00	0.00
USD GRAY TELEVISION INC-144A 5.12500% 16-15.10.24	425 000.00	413 046.87	0.01
USD GREAT LAKES DREDGE & DOCK CORP 8.00000% 17-15.05.22	4 890 000.00	5 036 700.00	0.12
USD GREAT WESTERN PETROLEUM/FIN INC-144A 9.00000% 16-30.09.21	925 000.00	825 562.50	0.02
USD GREYSTAR REAL ESTATE PARTNERS LLC-144A 5.75000% 17-01.12.25	6 068 000.00	6 022 490.00	0.14
USD GRIFFON CORP 5.25000% 14-01.03.22	500 000.00	490 000.00	0.01
USD GTT COMMUNICATIONS INC-144A 7.87500% 17-31.12.24	4 462 000.00	3 926 560.00	0.09
USD GULFPORT ENERGY CORP 6.62500% 15-01.05.23	2 915 000.00	2 887 671.88	0.07
USD GULFPORT ENERGY CORP 6.37500% 17-15.05.25	600 000.00	568 500.00	0.01
USD H&E EQUIPMENT SERVICES INC 5.62500% 18-01.09.25	1 550 000.00	1 515 125.00	0.04
USD HALCON RESOURCES CORP 6.75000% 18-15.02.25	1 950 000.00	1 501 500.00	0.04
USD HCA INC 5.00000% 14-15.03.24	795 000.00	827 197.50	0.02
USD HCA INC 5.50000% 17-15.06.47	4 460 000.00	4 646 428.00	0.11
USD HCA INC 5.87500% 12-01.05.23	1 790 000.00	1 892 925.00	0.05
USD HERTZ CORP/THE 7.37500% 11-15.01.21	1 425 000.00	1 410 750.00	0.03
USD HERTZ CORP/THE-144A 7.62500% 17-01.06.22	1 300 000.00	1 293 890.00	0.03
USD HILCORP ENERGY I LP/FINANCE CO-144A 5.75000% 15-01.10.25	16 000.00	15 560.00	0.00
USD HILL-ROM HOLDINGS INC-144A 5.75000% 15-01.09.23	2 222 000.00	2 283 105.00	0.05
USD HILL-ROM HOLDINGS INC-144A 5.00000% 17-15.02.25	500 000.00	495 000.00	0.01
USD HILLMAN GROUP INC-144A 6.37500% 14-15.07.22	115 000.00	93 725.00	0.00
USD HILTON DOMESTIC OPERATING CO INC 4.25000% 17-01.09.24	600 000.00	587 880.00	0.01
USD HILTON DOMESTIC OPERATING CO INC-144A 5.12500% 18-01.05.26	400 000.00	403 000.00	0.01
USD HLF FIN SARL LLC / HERBALF INT INC-144A 7.25000% 18-15.08.26	1 400 000.00	1 419 250.00	0.03
USD HOLLY ENERGY PARTNERS LP FIN CORP-144A 6.00000% 16-01.08.24	2 212 000.00	2 228 590.00	0.05
USD HOLOGIC INC-144A 4.37500% 17-15.10.25	3 365 000.00	3 304 833.80	0.08
USD HORIZON PHARMA INC 6.62500% 15-01.05.23	2 000 000.00	1 990 000.00	0.05
USD HORIZON PHARMA INC/USA INC-144A 8.75000% 16-01.11.24	3 600 000.00	3 805 200.00	0.09
USD HOWARD HUGHES CORP-144A 5.37500% 17-15.03.25	5 924 000.00	5 892 306.60	0.14
USD HUB INTERNATIONAL LTD-144A 7.00000% 18-01.05.26	4 473 000.00	4 338 810.00	0.10
USD HUDBAY MINERALS INC-144A 7.25000% 16-15.01.23	2 800 000.00	2 884 000.00	0.07
USD HUGHES SATELLITE SYSTEMS CORP 5.25000% 17-01.08.26	580 000.00	555 350.00	0.01
USD HUGHES SATELLITE SYSTEMS CORP 6.62500% 17-01.08.26	1 905 000.00	1 833 562.50	0.04
USD HULK FINANCE CORP-144A 7.00000% 18-01.06.26	6 198 000.00	5 734 389.60	0.14
USD HUNT COS INC-144A 6.25000% 18-15.02.26	2 050 000.00	1 845 000.00	0.04
USD ICAHN ENTERPRISES LP/FINANCE CORP 6.00000% 14-01.08.20	1 332 000.00	1 343 655.00	0.03
USD ICAHN ENTERPRISES LP/FINANCE CORP 5.87500% 14-01.02.22	2 100 000.00	2 115 981.00	0.05
USD ICAHN ENTERPRISES LP/FINANCE CORP 6.37500% 18-15.12.25	1 885 000.00	1 925 056.25	0.05
USD INDIGO NATURAL RESOURCES LLC-144A 6.87500% 18-15.02.26	3 575 000.00	3 128 125.00	0.07
USD INFOR SOFTWARE PARENT-144A (PIK) 7.12500% 14-01.05.21	570 000.00	574 275.00	0.01
USD INFOR US INC 6.50000% 16-15.05.22	3 800 000.00	3 866 500.00	0.09
USD INFORMATICA CORP-144A 7.12500% 15-15.07.23	2 465 000.00	2 471 162.50	0.06
USD INGEVITY CORP-144A 4.50000% 18-01.02.26	1 915 000.00	1 752 225.00	0.04
USD INTELSAT JACKSON HOLDINGS SA 5.50000% 14-01.08.23	1 210 000.00	1 101 100.00	0.03
USD INTELSAT JACKSON HOLDINGS SA-144A 9.75000% 17-15.07.25	6 890 000.00	7 174 212.50	0.17
USD INTELSAT JACKSON HOLDINGS SA-144A 8.50000% 18-15.10.24	9 147 000.00	9 241 214.10	0.22
USD INTERVAL ACQUISITION CORP 5.62500% 16-15.04.23	1 300 000.00	1 303 250.00	0.03
USD IRIDIUM COMMUNICATIONS INC-144A 10.25000% 18-15.04.23	2 660 000.00	2 872 800.00	0.07
USD IRON MOUNTAIN INC-144A 4.87500% 17-15.09.27	2 310 000.00	2 129 531.25	0.05
USD IRON MOUNTAIN INC-144A 5.25000% 17-15.03.28	560 000.00	520 800.00	0.01
USD ITRON INC-144A 5.00000% 17-15.01.26	3 378 000.00	3 220 754.10	0.08
USD J2 CLD SER LLC/GLB CO-OBLIGOR INC-144A 6.00000% 17-15.07.25	5 145 000.00	5 157 862.50	0.12
USD JAGGED PEAK ENERGY LLC-144A 5.87500% 18-01.05.26	1 130 000.00	1 090 450.00	0.03
USD JAGUAR HOLDINGS/PHARMA PROD DEV-144A 6.37500% 15-01.08.23	11 588 000.00	11 530 060.00	0.28
USD JBS USA LLC/JBS USA FINANCE INC-144A 5.75000% 15-15.06.25	2 444 000.00	2 437 890.00	0.06

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD JEFFERIE LOANCORE LLC/JLC FIN CORP-144A 6.87500% 13-01.06.20	1 650 000.00	1 654 125.00	0.04
USD JEFFERIES FINANCE LLC-144A 7.37500% 13-01.04.20	1 000 000.00	1 002 500.00	0.02
USD JEFFERIES FINANCE LLC-144A 6.87500% 14-15.04.22	2 250 000.00	2 221 875.00	0.05
USD JEFFERIES FINANCE LLC-144A 7.50000% 14-15.04.21	865 000.00	872 568.75	0.02
USD JELD-WEN INC-144A 4.62500% 17-15.12.25	500 000.00	453 750.00	0.01
USD JELD-WEN INC-144A 4.87500% 17-15.12.27	425 000.00	376 125.00	0.01
USD KAISER ALUMINUM CORP 5.87500% 16-15.05.24	1 050 000.00	1 065 750.00	0.03
USD KAR AUCTION SERVICES INC-144A 4.12500% 17-01.06.25	6 715 000.00	6 470 439.70	0.15
USD KENNEDY-WILSON INC 5.87500% 14-01.04.24	3 160 000.00	3 089 848.00	0.07
USD KFC HLDG/PIZZA HUT HLDG/TACO BELL-144A 5.25000% 16-01.06.26	3 158 000.00	3 197 475.00	0.08
USD KGA ESCROW LLC-144A 7.50000% 18-15.08.23	2 938 000.00	2 964 588.90	0.07
USD KISRS MIDCO 3 PLC-144A 8.62500% 17-15.07.23	1 150 000.00	994 750.00	0.02
USD KOPPERS INC-144A 6.00000% 17-15.02.25	3 310 000.00	2 945 900.00	0.07
USD KRONOS ACQUISITION HOLDINGS INC-144A 9.00000% 15-15.08.23	3 450 000.00	2 923 875.00	0.07
USD LAMB WESTON HOLDINGS INC-144A 4.62500% 16-01.11.24	5 330 000.00	5 303 350.00	0.13
USD LAMB WESTON HOLDINGS INC-144A 4.87500% 16-01.11.26	5 273 000.00	5 228 179.50	0.12
USD LAUREATE EDUCATION INC-144A 8.25000% 17-01.05.25	3 783 000.00	4 104 555.00	0.10
USD LBC TANK TERMINALS HDNG NETH BV-144A 6.87500% 13-15.05.23	3 100 000.00	2 890 750.00	0.07
USD LENNAR CORP 5.87500% 18-15.11.24	400 000.00	409 500.00	0.01
USD LENNAR CORP STEP-UP/DOWN 13-15.11.22	1 700 000.00	1 706 375.00	0.04
USD LEVEL 3 FINANCING INC 5.62500% 15-01.02.23	1 425 000.00	1 432 125.00	0.03
USD LEVEL 3 FINANCING INC 5.37500% 14-15.08.22	7 681 000.00	7 740 911.80	0.18
USD LEVEL 3 FINANCING INC 5.25000% 17-15.03.26	1 625 000.00	1 576 737.50	0.04
USD LEVEL 3 PARENT LLC 5.75000% 15-01.12.22	135 000.00	135 000.00	0.00
USD LIVE NATION ENTERTAINMENT INC-144A 4.87500% 16-01.11.24	4 568 000.00	4 499 480.00	0.11
USD LTF MERGER SUB INC-144A-SUB 8.50000% 15-15.06.23	4 380 000.00	4 462 125.00	0.11
USD MALLINCKRODT INT FINANCE S A-144A 5.50000% 15-15.04.25	660 000.00	511 500.00	0.01
USD MASONITE INTERNATIONAL CORP-144A 5.75000% 18-15.09.26	1 800 000.00	1 750 500.00	0.04
USD MASONITE INTL CORP-144A 5.62500% 15-15.03.23	1 656 000.00	1 673 056.80	0.04
USD MATADOR RESOURCES CO 5.87500% 18-15.09.26	2 505 000.00	2 495 606.25	0.06
USD MATCH GROUP INC 6.37500% 16-01.06.24	3 615 000.00	3 777 675.00	0.09
USD MATTHEWS INTERNATIONAL CORP-144A 5.25000% 17-01.12.25	2 594 000.00	2 444 845.00	0.06
USD MCGRAW-HILL GLOBAL EDUCATION-144A 7.87500% 16-15.05.24	8 506 000.00	6 336 970.00	0.15
USD MDC PARTNERS INC-144A 6.50000% 16-01.05.24	5 295 000.00	4 820 038.50	0.12
USD MEDNAX INC-144A 5.25000% 15-01.12.23	885 000.00	887 212.50	0.02
USD MEG ENERGY CORP-144A 7.00000% 13-31.03.24	2 725 000.00	2 404 812.50	0.06
USD MEG ENERGY CORP-144A 6.50000% 17-15.01.25	2 500 000.00	245 625.00	0.01
USD MERCER INTERNATIONAL INC 5.50000% 18-15.01.26	1 345 000.00	1 247 487.50	0.03
USD MERCER INTERNATIONAL INC-144A 7.37500% 18-15.01.25	650 000.00	661 375.00	0.02
USD MEREDITH CORP-144A 6.87500% 18-01.02.26	6 162 000.00	6 346 860.00	0.15
USD MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-144A 5.75000% 18-15.06.26	2 190 000.00	2 233 800.00	0.05
USD MGM GROWTH POP LP/CO-ISSUER INC 4.50000% 17-01.09.26	385 000.00	364 787.50	0.01
USD MGM GROWTH POP LP/CO-ISSUER INC 5.62500% 17-01.05.24	5 175 000.00	5 317 312.50	0.13
USD MGM GROWTH POP LP/CO-ISSUER INC 4.50000% 18-15.01.28	3 200 000.00	2 960 000.00	0.07
USD MGM RESORTS INTL 6.75000% 13-01.10.20	50 000.00	52 190.50	0.00
USD MIDAS INTERMEDIATE HOLDCO II LLC-144A 7.87500% 14-01.10.22	2 250 000.00	2 081 250.00	0.05
USD MIDCONT COM & MIDCONT FIN CORP-144A 6.87500% 15-15.08.23	900 000.00	927 000.00	0.02
USD MOHEGAN TRIBAL GAMING AUTHORITY-144A 7.87500% 16-15.10.24	1 900 000.00	1 833 500.00	0.04
USD MOSS CREEK RESOURCES HOLDINGS INC-144A 7.50000% 18-15.01.26	3 280 000.00	2 935 600.00	0.07
USD MPH ACQUISITION HOLDINGS LLC-144A 7.12500% 16-01.06.24	7 510 000.00	7 457 430.00	0.18
USD MSCI INC-144A 5.37500% 18-15.05.27	1 076 000.00	1 092 140.00	0.03
USD MUELLER WATER PRODUCTS INC-144A 5.50000% 18-15.06.26	2 610 000.00	2 623 050.00	0.06
USD MULTI-COLOR CORP-144A 6.12500% 14-01.12.22	5 601 000.00	5 643 007.49	0.13
USD MULTI-COLOR CORP-144A 4.87500% 17-01.11.25	4 419 000.00	4 198 050.00	0.10
USD NABORS INDUSTRIES INC 5.75000% 18-01.02.25	956 000.00	831 720.00	0.02
USD NATHAN 'S FAMOUS INC-144A 6.62500% 17-01.11.25	1 050 000.00	1 018 500.00	0.02
USD NATIONAL CINEMEDIA LLC 6.00000% 12-15.04.22	3 228 000.00	3 252 210.00	0.08
USD NATIONAL FINANCIAL PARTNERS -144A 6.87500% 17-15.07.25	800 000.00	760 000.00	0.02

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD NAVIENT CORP 5.50000% 13-25.01.23	1 475 000.00	1 423 375.00	0.03
USD NAVIENT CORP 6.62500% 16-26.07.21	875 000.00	899 062.50	0.02
USD NAVISTAR INTERNATIONAL CORP-144A 6.62500% 17-01.11.25	4 060 000.00	4 060 000.00	0.10
USD NCL CORP LTD-144A 4.75000% 16-15.12.21	1 444 000.00	1 453 025.00	0.03
USD NCR CORP 4.62500% 13-15.02.21	3 214 000.00	3 173 825.00	0.08
USD NCR CORP 5.00000% 13-15.07.22	4 274 000.00	4 200 487.20	0.10
USD NCR CORP 6.37500% 14-15.12.23	2 645 000.00	2 651 612.50	0.06
USD NETFLIX INC 5.50000% 15-15.02.22	1 000 000.00	1 038 050.00	0.02
USD NETFLIX INC 5.75000% 14-01.03.24	600 000.00	624 750.00	0.01
USD NETFLIX INC-144A 5.87500% 18-15.11.28	3 860 000.00	3 913 075.00	0.09
USD NEW COTA I LLC/CAPITAL CORP-144A(PIK)10.62500% 13-01.05.19	316 487.00	174 067.85	0.00
USD NEW ENTERPRISE STONE&LIME CO INC-144A 6.25000% 18-15.03.26	3 021 000.00	2 885 055.00	0.07
USD NEW GOLD INC-144A 6.37500% 17-15.05.25	310 000.00	261 368.75	0.01
USD NEW GOLD INC-144A 6.25000% 12-15.11.22	3 032 000.00	2 797 020.00	0.07
USD NEWFIELD EXPLORATION CO 5.62500% 12-01.07.24	1 250 000.00	1 309 375.00	0.03
USD NEXSTAR BROADCASTING INC-144A 5.62500% 16-01.08.24	1 200 000.00	1 161 000.00	0.03
USD NEXTERA ENERGY PARTNERS LP-144A 4.50000% 17-15.09.27	2 475 000.00	2 250 703.13	0.05
USD NGPL PIPECO LLC-144A 4.37500% 17-15.08.22	85 000.00	85 708.90	0.00
USD NIELSEN CO LUXEMBOURG SARL/THE-144A 5.50000% 13-01.10.21	2 695 000.00	2 716 021.00	0.06
USD NIELSEN CO LUXEMBOURG SARL/THE-144A 5.00000% 17-01.02.25	725 000.00	719 562.50	0.02
USD NIELSEN FINANCE LLC/CO-144A 5.00000% 14-15.04.22	2 972 000.00	2 967 542.00	0.07
USD NOBLE HOLDING INTERNATIONAL LTD-144A 7.87500% 18-01.02.26	1 135 000.00	1 049 875.00	0.03
USD NOVA CHEMICALS CORP-144A 5.25000% 13-01.08.23	2 400 000.00	2 333 496.00	0.06
USD NOVA CHEMICALS CORP-144A 4.87500% 17-01.06.24	1 975 000.00	1 876 250.00	0.04
USD NOVELIS CORP-144A 5.87500% 16-30.09.26	5 247 000.00	5 063 355.00	0.12
USD NRG ENERGY INC 6.62500% 17-15.01.27	6 005 000.00	6 321 583.60	0.15
USD NRG YIELD OPERATING LLC 5.37500% 15-15.08.24	990 000.00	918 225.00	0.02
USD NUFARM AUSTRALIA LTD/AMERICAS-144A 5.75000% 18-30.04.26	6 392 000.00	5 912 600.00	0.14
USD NUSTAR LOGISTICS LP 6.75000% 13-01.02.21	350 000.00	359 625.00	0.01
USD NVA HOLDINGS INC-144A 6.87500% 18-01.04.26	4 520 000.00	4 315 244.00	0.10
USD OASIS PETROLEUM INC 6.87500% 14-15.03.22	2 200 000.00	2 194 500.00	0.05
USD OI EUROPEAN GROUP BV-144A 4.00000% 17-15.03.23	873 000.00	844 627.50	0.02
USD OPE KAG FINANCE SUB INC-144A 7.87500% 15-31.07.23	8 214 000.00	7 875 172.50	0.19
USD OPEN TEXT CORP-144A 5.87500% 16-01.06.26	1 350 000.00	1 393 875.00	0.03
USD OWENS-BROCKWAY GLASS CONTAINER INC-144A 6.37500% 15-15.08.25	1 500 000.00	1 567 500.00	0.04
USD OWENS-BROCKWAY GLASS CONTAINER INC-144A 5.00000% 14-15.01.22	1 594 000.00	1 609 940.00	0.04
USD PARK AEROSPACE HOLDINGS LTD-144A 5.25000% 17-15.08.22	3 495 000.00	3 548 473.50	0.08
USD PARK AEROSPACE HOLDINGS LTD-144A 5.50000% 17-15.02.24	3 689 000.00	3 744 335.00	0.09
USD PARK AEROSPACE HOLDINGS LTD-144A 4.50000% 17-15.03.23	1 790 000.00	1 756 437.50	0.04
USD PARK AEROSPACE HOLDINGS LTD-144A 3.62500% 17-15.03.21	2 400 000.00	2 370 000.00	0.06
USD PARKLAND FUEL CORP-144A 6.00000% 18-01.04.26	4 220 000.00	4 030 100.00	0.10
USD PARSLEY ENERGY LLC/FINANCE CORP-144A 6.25000% 16-01.06.24	6 278 000.00	6 434 121.30	0.15
USD PARSLEY ENERGY LLC/FINANCE CORP-144A 5.25000% 17-15.08.25	1 240 000.00	1 227 600.00	0.03
USD PARSLEY ENERGY LLC/FINANCE CORP-144A 5.62500% 17-15.10.27	5 509 000.00	5 460 796.25	0.13
USD PARTY CITY HOLDINGS INC-144A 6.12500% 15-15.08.23	290 000.00	293 625.00	0.01
USD PATTERN ENERGY GROUP INC-144A 5.87500% 17-01.02.24	845 000.00	825 987.50	0.02
USD PBF HOLDING CO LLC/FIN CORP 7.00000% 17-15.11.23	4 992 000.00	5 002 982.40	0.12
USD PBF HOLDING CO LLC/FIN CORP 7.25000% 17-15.06.25	3 349 000.00	3 332 255.00	0.08
USD PBF LOGISTICS LP/FINANCE CORP 6.87500% 15-15.05.23	10 946 000.00	11 151 237.50	0.27
USD PDC ENERGY INC 5.75000% 18-15.05.26	850 000.00	796 875.00	0.02
USD PEABODY ENERGY CORP-144A 6.37500% 17-31.03.25	4 335 000.00	4 183 275.00	0.10
USD PENSKE AUTOMOTIVE GROUP INC-SUB 5.75000% 13-01.10.22	1 394 000.00	1 414 910.00	0.03
USD PERFORMANCE FOOD GROUP INC-144A 5.50000% 16-01.06.24	2 810 000.00	2 767 850.00	0.07
USD PETSMART INC-144A 5.87500% 17-01.06.25	850 000.00	667 505.00	0.02
USD PILGRIMS PRIDE CORP-144A 5.75000% 15-15.03.25	780 000.00	764 400.00	0.02
USD PILGRIMS PRIDE CORP-144A 5.87500% 17-30.09.27	4 581 000.00	4 420 665.00	0.11
USD POLARIS INTERMEDIATE CORP-144A (PIK) 8.50000% 17-01.12.22	8 007 000.00	7 746 772.50	0.18
USD POLYONE CORP 5.25000% 13-15.03.23	1 050 000.00	1 055 250.00	0.03

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD POST HOLDINGS INC-144A 8.00000% 15-15.07.25	1 300 000.00	1 378 000.00	0.03
USD POST HOLDINGS INC-144A 5.00000% 16-15.08.26	1 765 000.00	1 668 278.00	0.04
USD POST HOLDINGS INC-144A 5.50000% 17-01.03.25	5 500 000.00	5 445 000.00	0.13
USD POST HOLDINGS INC-144A 5.75000% 17-01.03.27	9 847 000.00	9 648 189.06	0.23
USD POST HOLDINGS INC-144A 5.62500% 17-15.01.28	5 450 000.00	5 225 133.00	0.12
USD PQ CORP-144A 6.75000% 16-15.11.22	3 178 000.00	3 322 599.00	0.08
USD PRESTIGE BRANDS INC-144A 5.37500% 13-15.12.21	2 346 000.00	2 346 000.00	0.06
USD PRESTIGE BRANDS INC-144A 6.37500% 16-01.03.24	7 166 000.00	7 130 170.00	0.17
USD PRIME SEC SER BORROWER LLC/FIN INC-144A 9.25000% 16-15.05.23	6 486 000.00	6 858 945.00	0.16
USD QORVO INC-144A 5.50000% 18-15.07.26	1 000 000.00	992 500.00	0.02
USD QUALITYTECH LP/QTS FIN CORP-144A 4.75000% 17-15.11.25	700 000.00	654 500.00	0.02
USD QUEBECOR MEDIA INC 5.75000% 13-15.01.23	8 053 000.00	8 294 590.00	0.20
USD QUICKEN LOANS INC -144A 5.75000% 15-01.05.25	1 050 000.00	1 013 250.00	0.02
USD QUICKEN LOANS INC-144A 5.25000% 17-15.01.28	3 425 000.00	3 091 062.50	0.07
USD QUINTILES IMS INC-144A 5.00000% 16-15.10.26	2 000 000.00	2 002 500.00	0.05
USD QUINTILES IMS INC-144A 4.87500% 15-15.05.23	5 318 000.00	5 397 770.00	0.13
USD RACKSPACE HOSTING INC-144A 8.62500% 16-15.11.24	6 183 000.00	5 193 719.99	0.12
USD RANGE RESOURCES CORP 5.00000% 17-15.08.22	1 300 000.00	1 262 625.00	0.03
USD RAYONIER AM PRODUCTS INC-144A 5.50000% 14-01.06.24	5 135 000.00	4 642 296.75	0.11
USD RBS GLOBAL INC/REXNORD LLC-144A 4.87500% 17-15.12.25	800 000.00	772 000.00	0.02
USD REALOGY GROUP/CO ISSUER-144A 5.25000% 14-01.12.21	150 000.00	149 943.00	0.00
USD RELIANCE INTERMEDIATE HOLDINGS-144A 6.50000% 15-01.04.23	4 303 000.00	4 432 090.00	0.11
USD RESOLUTE ENERGY CORP 8.50000% 13-01.05.20	3 098 000.00	3 105 745.00	0.07
USD REVLOON CUSTOMER PRODUCTS CORP STEP-UP/DOWN 13-15.02.21	4 440 000.00	3 600 099.85	0.09
USD REYNOLDS GROUP INC/LLC/LUX-144A 7.00000% 16-15.07.24	3 057 000.00	3 125 782.50	0.07
USD RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC-144A 5.37500% 16-15.01.25	2 085 000.00	2 095 425.00	0.05
USD RITE AID CORP-144A 6.12500% 15-01.04.23	4 949 000.00	4 175 718.75	0.10
USD RIVERBED TECHNOLOGY INC-144A 8.87500% 15-01.03.23	2 545 000.00	1 857 850.00	0.04
USD ROWAN COS INC 4.75000% 14-15.01.24	1 450 000.00	1 160 000.00	0.03
USD ROWAN COS INC 5.40000% 12-01.12.42	350 000.00	220 500.00	0.01
USD ROWAN COS INC 5.85000% 14-15.01.44	600 000.00	396 000.00	0.01
USD ROWAN COS INC 7.37500% 16-15.06.25	2 170 000.00	1 866 200.00	0.04
USD SABRE GLBL INC-144A 5.37500% 15-15.04.23	2 950 000.00	2 986 875.00	0.07
USD SABRE GLBL INC-144A 5.25000% 15-15.11.23	810 000.00	822 150.00	0.02
USD SBA COMMUNICATIONS CORP 4.87500% 17-01.09.24	11 516 000.00	11 530 395.00	0.28
USD SBA COMMUNICATIONS CORP 4.00000% 18-01.10.22	390 000.00	385 125.00	0.01
USD SCIENTIFIC GAMES INTERNATIONAL 10.00000% 14-01.12.22	6 961 000.00	7 317 751.25	0.17
USD SEMGRP/ROSE ROCK FIN CORP 5.62500% 14-15.07.22	3 240 000.00	3 078 000.00	0.07
USD SEMINOLE HARD ROCK ENT INC-144A 5.87500% 13-15.05.21	1 450 000.00	1 471 300.50	0.04
USD SENSATA TECHNOLOGIES BV-144A 4.87500% 13-15.10.23	3 000 000.00	3 007 500.00	0.07
USD SENSATA TECHNOLOGIES BV-144A 5.62500% 14-01.11.24	1 438 000.00	1 491 925.00	0.04
USD SENSATA TECHNOLOGIES BV-144A 5.00000% 15-01.10.25	4 702 000.00	4 725 510.00	0.11
USD SENSATA TECHNOLOGIES UK FINANCING-144A 6.25000% 15-15.02.26	2 500 000.00	2 593 750.00	0.06
USD SERVICEMASTER CO LLC/THE 7.45000% 97-15.08.27	2 900 000.00	2 985 202.00	0.07
USD SERVICEMASTER CO LLC/THE-144A 5.12500% 16-15.11.24	1 250 000.00	1 221 875.00	0.03
USD SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD-144A 5.37500% 17-30.09.25	650 000.00	627 120.00	0.02
USD SHELF DRILLING HOLDINGS LTD-144A 8.25000% 18-15.02.25	1 645 000.00	1 484 612.50	0.04
USD SILGAN HOLDINGS INC 4.75000% 18-15.03.25	1 600 000.00	1 536 000.00	0.04
USD SILVERSEA CRUISE FINANCE LTD-144A 7.25000% 17-01.02.25	1 761 000.00	1 886 471.25	0.04
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 4.62500% 13-15.05.23	2 050 000.00	2 047 437.50	0.05
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 6.00000% 14-15.07.24	5 073 000.00	5 269 578.75	0.13
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 5.37500% 15-15.04.25	3 935 000.00	3 984 187.50	0.10
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 5.37500% 16-15.07.26	4 660 000.00	4 619 225.00	0.11
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 3.87500% 17-01.08.22	700 000.00	689 500.00	0.02
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 5.00000% 17-01.08.27	5 142 000.00	4 968 457.50	0.12
USD SIX FLAGS ENTERTAINMENT CORP-144A 4.87500% 16-31.07.24	5 090 000.00	5 039 100.00	0.12
USD SIX FLAGS ENTERTAINMENT CORP-144A 5.50000% 17-15.04.27	2 245 000.00	2 228 162.50	0.05
USD SM ENERGY CO 5.00000% 14-15.01.24	1 625 000.00	1 535 608.75	0.04

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD SM ENERGY CO 5.62500% 15-01.06.25	1 000 000.00	955 000.00	0.02
USD SOLERA LLC/SOLERA FINANCE INC-144A 10.50000% 16-01.03.24	9 565 000.00	10 377 833.70	0.25
USD SOPHIA LP / SOPHIA FINANCE INC-144A 9.00000% 15-30.09.23	7 945 000.00	8 143 625.00	0.19
USD SOUTHERN STAR CENTRAL CORP-144A 5.12500% 14-15.07.22	3 828 000.00	3 741 870.00	0.09
USD SOUTHWESTERN ENERGY CO 7.75000% 17-01.10.27	2 495 000.00	2 569 850.00	0.06
USD SPECTRUM BRANDS INC 6.62500% 14-15.11.22	1 945 000.00	1 993 625.00	0.05
USD SPRINT CORP 7.12500% 14-15.06.24	2 131 000.00	2 180 279.37	0.05
USD SPRINT CORP 7.25000% 14-15.09.21	9 635 000.00	10 116 750.00	0.24
USD SPRINT CORP 7.62500% 15-15.02.25	2 800 000.00	2 926 840.00	0.07
USD SPRINT CORP 7.87500% 14-15.09.23	10 140 000.00	10 773 750.00	0.26
USD SPRINT NEXTEL CORP 11.50000% 12-15.11.21	4 400 000.00	5 098 500.00	0.12
USD SPRINT NEXTEL CORP-144A 7.00000% 12-01.03.20	2 350 000.00	2 417 562.50	0.06
USD SRC ENERGY INC 6.25000% 18-01.12.25	450 000.00	399 375.00	0.01
USD STANDARD INDUSTRIES INC/NJ-144A 5.50000% 16-15.02.23	7 114 000.00	7 238 495.00	0.17
USD STANDARD INDUSTRIES INC/NJ-144A 5.00000% 17-15.02.27	1 600 000.00	1 496 000.00	0.04
USD STANDARD INDUSTRIES INC/NJ-144A 4.75000% 17-15.01.28	1 625 000.00	1 471 112.50	0.04
USD STAPLES INC-144A 8.50000% 17-15.09.25	8 776 000.00	8 424 960.00	0.20
USD STARWOOD PROPERTY TRUST INC 4.75000% 18-15.03.25	8 976 000.00	8 616 960.00	0.21
USD STERIGENICS-NORDION HOLDINGS LLC-144A 6.50000% 15-15.05.23	3 247 000.00	3 271 352.50	0.08
USD STERIGENICS-NORDION TOPCO LLC-144A(PIK)8.12500% 16-01.11.21	8 551 000.00	8 529 622.50	0.20
USD SUBURBAN PROPANE PARTNERS LP/SUBURBAN 5.50000% 14-01.06.24	615 000.00	604 237.50	0.01
USD SUBURBAN PROPANE PARTNERS LP/SUBURBAN 5.75000% 15-01.03.25	2 950 000.00	2 832 000.00	0.07
USD SUBURBAN PROPANE PARTNERS LP/ENERGY 5.87500% 17-01.03.27	3 377 000.00	3 191 265.00	0.08
USD SUMMIT MATERIALS LLC/FIN 8.50000% 16-15.04.22	475 000.00	496 968.75	0.01
USD SUMMIT MIDSTREAM HLDG LLC/FIN CORP 5.50000% 14-15.08.22	3 930 000.00	3 792 450.00	0.09
USD SUNCOKE ENERGY PARTNERS LP/FIN CO-144A 7.50000% 17-15.06.25	2 640 000.00	2 560 800.00	0.06
USD SUNOCO LP/FINANCE CORP 4.87500% 18-15.01.23	380 000.00	374 300.00	0.01
USD SUNOCO LP/FINANCE CORP 5.50000% 18-15.02.26	915 000.00	903 553.35	0.02
USD SUPERIOR PLUS/SUPE GEN PARTNER INC-144A 7.00000% 18-15.07.26	1 250 000.00	1 232 812.50	0.03
USD SURGERY CENTER HOLDINGS INC-144A 6.75000% 17-01.07.25	3 715 000.00	3 436 375.00	0.08
USD SURGERY CENTER HOLDINGS INC-144A 8.87500% 16-15.04.21	2 486 000.00	2 535 720.00	0.06
USD SYMANTEC CORP-144A 5.00000% 17-15.04.25	1 826 000.00	1 817 355.49	0.04
USD TALEN ENERGY SUPPLY LLC-144A 10.50000% 17-15.01.26	500 000.00	462 500.00	0.01
USD TALLGRASS ENRGY PART LP/FIN CORP-144A 5.50000% 17-15.01.28	1 260 000.00	1 228 059.00	0.03
USD TARGA RESOURCES PARTNERS 6.75000% 15-15.03.24	5 287 000.00	5 498 480.00	0.13
USD TARGA RESOURCES PARTNERS 5.00000% 17-15.01.28	700 000.00	657 562.50	0.02
USD TARGA RESOURCES PARTNERS-144A 5.87500% 18-15.04.26	425 000.00	428 718.75	0.01
USD TARGA RESOURCES PARTNERS-144A 6.87500% 19-15.01.29	973 000.00	1 012 484.34	0.02
USD TAYLOR MORRISON COMMUNITIES INC 6.62500% 17-15.05.22	750 000.00	763 125.00	0.02
USD TEAM HEALTH HOLDINGS INC-144A 6.37500% 17-01.02.25	7 669 000.00	6 250 235.00	0.15
USD TECK RESOURCES LTD-144A 8.50000% 16-01.06.24	705 000.00	759 630.45	0.02
USD TENET HEALTHCARE CORP 8.12500% 13-01.04.22	4 700 000.00	4 917 375.00	0.12
USD TENET HEALTHCARE ESCROW CORP 6.00000% 14-01.10.20	3 665 000.00	3 785 212.00	0.09
USD TENNANT CO 5.62500% 18-01.05.25	1 200 000.00	1 185 000.00	0.03
USD TERRAFORM GLOBAL OPERATING LLC-144A 6.12500% 18-01.03.26	3 325 000.00	3 175 375.00	0.08
USD TERRAFORM POWER OPERATING LLC-144A 6.12500% 15-15.06.25	220 000.00	231 000.00	0.01
USD TERRAFORM POWER OPERATING LLC-144A 4.25000% 17-31.01.23	1 916 000.00	1 872 890.00	0.04
USD TERRAFORM POWER OPERATING LLC-144A 5.00000% 17-31.01.28	1 065 000.00	989 118.75	0.02
USD TERVITA ESCROW CORP-144A 7.62500% 16-01.12.21	1 320 000.00	1 296 900.00	0.03
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE CO BV 3.65000% 11-10.11.21	250 000.00	241 473.70	0.01
USD TIBCO SOFTWARE-144A 11.37500% 14-01.12.21	900 000.00	947 250.00	0.02
USD TITAN ACQUISITION/CO-BORROWER LLC-144A 7.75000% 18-15.04.26	2 181 000.00	1 908 375.00	0.05
USD TITAN INTERNATIONAL INC 6.50000% 18-30.11.23	1 400 000.00	1 284 500.00	0.03
USD TMS INTERNATIONAL CORP-144A 7.25000% 17-15.08.25	1 845 000.00	1 734 300.00	0.04
USD TRANSDIGM INC-SUB 6.00000% 14-15.07.22	4 624 000.00	4 658 680.00	0.11
USD TRANSDIGM INC-SUB 6.50000% 14-15.07.24	1 750 000.00	1 725 937.50	0.04
USD TRANSDIGM INC-SUB 6.37500% 17-15.06.26	2 225 000.00	2 141 562.50	0.05
USD TRANSDIGM UK HOLDINGS PLC-144A-SUB 6.87500% 18-15.05.26	1 720 000.00	1 668 400.00	0.04

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD TRANSM TLP FINANCE CORP 6.12500% 18-15.02.26	2 022 000.00	1 845 075.00	0.04
USD TRANSOCEAN GUARDIAN LTD-144A 5.87500% 18-15.01.24	465 000.00	441 622.12	0.01
USD TRANSOCEAN INC-144A 9.00000% 16-15.07.23	2 350 000.00	2 452 060.50	0.06
USD TRANSOCEAN INC-144A 7.50000% 17-15.01.26	1 979 000.00	1 882 523.75	0.04
USD TRANSOCEAN PONTUS LTD-144A 6.12500% 18-01.08.25	320 000.00	321 385.60	0.01
USD TRANSOCEAN-144A 7.25000% 18-01.11.25	813 000.00	768 285.00	0.02
USD TRI POINTE HOLDINGS INC 5.87500% 15-15.06.24	363 000.00	349 841.25	0.01
USD TRIMAS CORP-144A 4.87500% 17-15.10.25	1 875 000.00	1 818 750.00	0.04
USD TRINIDAD DRILLING LTD-144A 6.62500% 17-15.02.25	2 922 000.00	2 951 220.00	0.07
USD TRONOX FINANCE PLC-144A 5.75000% 17-01.10.25	1 060 000.00	916 900.00	0.02
USD TRONOX INC-144A 6.50000% 18-15.04.26	277 000.00	242 375.00	0.01
USD ULTRA RESOURCES INC-144A 6.87500% 17-15.04.22	180 000.00	72 000.00	0.00
USD ULTRA RESOURCES INC-144A 7.12500% 17-15.04.25	375 000.00	108 750.00	0.00
USD UNISYS CORP-144A 10.75000% 17-15.04.22	4 526 000.00	4 928 180.36	0.12
USD UNIVAR USA INC-144A 6.75000% 15-15.07.23	8 194 000.00	8 419 335.00	0.20
USD UNIVISION COMMUNICATIONS INC-144A 5.12500% 13-15.05.23	975 000.00	911 625.00	0.02
USD UPC HOLDING BV-144A 5.50000% 17-15.01.28	1 260 000.00	1 159 200.00	0.03
USD UPCB FINANCE IV LTD-144A 5.37500% 15-15.01.25	2 050 000.00	1 973 125.00	0.05
USD US FOODS INC-144A 5.87500% 16-15.06.24	5 180 000.00	5 269 562.20	0.13
USD USA COMPRESSION PARTNERS LLC 6.87500% 19-01.04.26	1 400 000.00	1 400 000.00	0.03
USD USG CORP-144A 4.87500% 17-01.06.27	1 500 000.00	1 524 900.00	0.04
USD USIS MERGER SUB INC-144A 6.87500% 17-01.05.25	950 000.00	912 000.00	0.02
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 5.87500% 15-15.05.23	13 225 000.00	12 943 968.75	0.31
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 6.12500% 15-15.04.25	6 251 000.00	5 907 195.00	0.14
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 5.62500% 13-01.12.21	988 000.00	989 235.00	0.02
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 5.50000% 15-01.03.23	2 237 000.00	2 169 890.00	0.05
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 6.50000% 17-15.03.22	975 000.00	1 007 906.25	0.02
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 7.00000% 17-15.03.24	3 970 000.00	4 170 882.00	0.10
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 5.50000% 17-01.11.25	5 578 000.00	5 543 137.50	0.13
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 9.00000% 17-15.12.25	4 010 000.00	4 275 662.50	0.10
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 9.25000% 18-01.04.26	6 506 000.00	6 993 950.00	0.17
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 8.50000% 18-31.01.27	2 734 000.00	2 857 030.00	0.07
USD VALVOLINE INC 4.37500% 17-15.08.25	2 600 000.00	2 476 500.00	0.06
USD VANTIV LLC/ISSUER CORP-144A 4.37500% 17-15.11.25	400 000.00	383 992.00	0.01
USD VECTOR GROUP LTD-144A 6.12500% 17-01.02.25	4 200 000.00	3 680 250.00	0.09
USD VENATOR FINANCE SARL/VEN MAT CORP-144A 5.75000% 17-15.07.25	405 000.00	335 137.50	0.01
USD VERISIGN INC 5.25000% 15-01.04.25	3 838 000.00	3 956 210.40	0.09
USD VERITAS US INC / BERMUDA LTD -144A 10.50000% 16-01.02.24	853 000.00	620 813.40	0.01
USD VERMILION ENERGY INC-144A 5.62500% 17-15.03.25	520 000.00	495 300.00	0.01
USD VERSCEND ESCROW CORP-144A 9.75000% 18-15.08.26	2 746 000.00	2 764 672.80	0.07
USD VERSUM MATERIALS INC-144A 5.50000% 16-30.09.24	4 080 000.00	4 141 200.00	0.10
USD VIASAT INC-144A 5.62500% 17-15.09.25	4 585 000.00	4 309 900.00	0.10
USD VICI PROPERTIES/FC INC 8.00000% 17-15.10.23	1 572 895.00	1 698 726.60	0.04
USD VIKING CRUISES LTD-144A 5.87500% 17-15.09.27	4 332 000.00	4 234 530.00	0.10
USD VISTRA ENERGY CORP 7.62500% 15-01.11.24	495 000.00	525 937.50	0.01
USD VISTRA ENERGY CORP-144A 8.12500% 17-30.01.26	1 580 000.00	1 706 400.00	0.04
USD VIZIENT INC-144A 10.37500% 16-01.03.24	3 000 000.00	3 251 250.00	0.08
USD W/S PACKAGING HOLDINGS INC-144A 9.00000% 18-15.04.23	2 174 000.00	2 184 870.00	0.05
USD WAND MERGER CORP-144A 8.12500% 18-15.07.23	2 500 000.00	2 530 500.00	0.06
USD WARRIOR MET COAL INC-144A 8.00000% 17-01.11.24	1 900 000.00	1 917 100.00	0.05
USD WASTE PRO USA INC-144A 5.50000% 18-15.02.26	5 185 000.00	5 029 450.00	0.12
USD WATCO COS LLC/FINANCE CORP-144A 6.37500% 13-01.04.23	10 469 000.00	10 496 219.40	0.25
USD WEST CORP-144A 8.50000% 17-15.10.25	1 018 000.00	848 757.50	0.02
USD WEST STREET MERGER SUB INC-144A 6.37500% 17-01.09.25	3 292 000.00	2 979 260.00	0.07
USD WEX INC-144A 4.75000% 13-01.02.23	1 225 000.00	1 209 687.50	0.03
USD WHITING PETROLEUM CORP 6.62500% 18-15.01.26	3 506 000.00	3 435 880.00	0.08
USD WILLIAM LYON HOMES INC 6.00000% 18-01.09.23	3 878 000.00	3 538 675.00	0.08
USD WILLIAMS COMPANIES INC 3.70000% 12-15.01.23	1 425 000.00	1 422 655.11	0.03

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD WILLIAMS SCOTSMAN INTERNATIONAL IN-144A 7.87500% 17-15.12.22	975 000.00	984 750.00	0.02
USD WMG ACQUISITION CORP-144A 5.00000% 16-01.08.23	1 000 000.00	992 500.00	0.02
USD WOLVERINE WORLD WIDE INC-144A 5.00000% 16-01.09.26	250 000.00	237 000.00	0.01
USD WPX ENERGY INC 5.25000% 14-15.09.24	3 175 000.00	3 127 375.00	0.07
USD WPX ENERGY INC 6.00000% 11-15.01.22	364 000.00	369 460.00	0.01
USD WPX ENERGY INC 8.25000% 15-01.08.23	2 727 000.00	3 033 787.50	0.07
USD WR GRACE & CO-CONN-144A 5.12500% 14-01.10.21	1 050 000.00	1 078 875.00	0.03
USD WR GRACE & CO-CONN-144A 5.62500% 14-01.10.24	5 570 000.00	5 792 800.00	0.14
USD WR GRACE & CO-CONN-REG-S 5.12500% 14-01.10.21	1 365 000.00	1 402 537.50	0.03
USD WYNDHAM HOTELS & RESORTS INC-144A 5.37500% 18-15.04.26	3 100 000.00	3 100 000.00	0.07
USD WYNN LAS VEGAS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.25000% 17-15.05.27	965 000.00	902 275.00	0.02
USD XEROX CORP 3.62500% 17-15.03.23	1 750 000.00	1 666 875.00	0.04
USD XPO LOGISTICS INC-144A 6.50000% 15-15.06.22	1 874 000.00	1 913 822.50	0.05
USD YUM BRANDS INC 3.87500% 13-01.11.23	1 625 000.00	1 580 312.50	0.04
USD ZAYO GROUP LLC/ CAPITAL INC-144A 5.75000% 17-15.01.27	4 154 000.00	4 013 553.26	0.10
USD ZIGGO BOND CO BV-144A 5.87500% 15-15.01.25	1 150 000.00	1 078 125.00	0.03
米ドル合計		1 565 831 239.59	37.35
ノート、固定利付債合計		1 580 167 381.42	37.69
ノート、変動利付債			
米ドル			
USD ASSURANT INC-SUB 7.000%/VAR 18-27.03.48	450 000.00	434 250.00	0.01
USD ENERGY TRANSFER PARTNERS-SUB 6.250%/VAR 17-PRP	280 000.00	251 874.00	0.01
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 3M LIBOR+82BP 17-10.08.22	500 000.00	492 155.19	0.01
USD REYNOLDS GROUP INC/LLC/LUX-144A 3M LIBOR+350BP 16-15.07.21	800 000.00	802 000.00	0.02
米ドル合計		1 980 279.19	0.05
ノート、変動利付債合計		1 980 279.19	0.05
中期債券、固定利付債			
米ドル			
USD INTESA SANPAOLO SPA-144A-SUB 5.01700% 14-26.06.24	5 000 000.00	4 588 094.00	0.11
USD NAVIENT CORP 6.75000% 18-15.06.26	1 290 000.00	1 215 799.20	0.03
米ドル合計		5 803 893.20	0.14
中期債券、固定利付債合計		5 803 893.20	0.14
債券、固定利付債			
ユーロ			
EUR CMA CGM SA-REG-S 6.50000% 17-15.07.22	1 690 000.00	1 845 624.56	0.04
EUR NORICAN GROUP APS-REG-S 4.50000% 17-15.05.23	2 500 000.00	2 496 019.30	0.06
ユーロ合計		4 341 643.86	0.10
米ドル			
USD ALLISON TRANSMISSION INC-144A 5.00000% 16-01.10.24	1 785 000.00	1 755 993.75	0.04
USD BUILDING MATERIALS CORP OF AMERICA-144A 6.00000% 15-15.10.25	5 413 000.00	5 440 065.00	0.13
USD CARRIAGE SERVICES INC-144A 6.62500% 18-01.06.26	2 098 000.00	2 103 245.00	0.05
USD CENTURYLINK INC 6.87500% 98-15.01.28	3 970 000.00	3 611 906.00	0.09
USD EP ENERGY LLC/ EVEREST ACQ FIN-144A 9.37500% 18-01.05.24	625 000.00	332 812.50	0.01
USD EQUINIX INC 5.37500% 13-01.04.23	1 500 000.00	1 516 875.00	0.04
USD FIRST DATA CORP-144A 5.75000% 15-15.01.24	5 085 000.00	5 228 015.62	0.12
USD INTELSAT JACKSON HOLDINGS SA-144A 8.00000% 16-15.02.24	955 000.00	994 393.75	0.02
USD ISTAR INC 5.25000% 17-15.09.22	8 870 000.00	8 732 515.00	0.21

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD NETFLIX INC 4.37500% 16-15.11.26	5 092 000.00	4 821 487.50	0.11
USD NUANCE COMMUNICATIONS INC 5.62500% 16-15.12.26	3 220 000.00	3 155 600.00	0.08
USD PETSMART INC-144A 7.12500% 15-15.03.23	950 000.00	596 125.00	0.01
USD REYNOLDS GROUP INC/LLC/LUX-144A 5.12500% 16-15.07.23	3 585 000.00	3 577 113.00	0.09
USD SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD-144A 6.75000% 15-01.05.23	3 140 000.00	3 203 742.00	0.08
USD TULLOW OIL PLC-REG-S 7.00000% 18-01.03.25	1 750 000.00	1 688 750.00	0.04
USD UNIT CORP-SUB 6.62500% 11-15.05.21	5 300 000.00	5 008 500.00	0.12
USD VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC-144A 5.25000% 15-15.01.26	350 000.00	344 750.00	0.01
USD XPO LOGISTICS INC-144A 6.12500% 16-01.09.23	1 300 000.00	1 320 306.00	0.03
米ドル合計		53 432 195.12	1.28
債券、固定利付債合計		57 773 838.98	1.38
債券、変動利付債			
ユーロ			
EUR 3AB OPTIQUE DEVELOPPEMENT 3M EURIBOR+412.5BP 17-01.10.23	150 000.00	164 441.06	0.01
ユーロ合計		164 441.06	0.01
米ドル			
USD CITIGROUP INC-SUB 6.300%/VAR 14-PRP	1 800 000.00	1 822 500.00	0.04
米ドル合計		1 822 500.00	0.04
債券、変動利付債合計		1 986 941.06	0.05
転換社債、固定利付債			
米ドル			
USD NEXTERA ENERGY PARTNERS LP-144A 1.50000% 17-15.09.20	750 000.00	713 325.00	0.01
米ドル合計		713 325.00	0.01
転換社債、固定利付債合計		713 325.00	0.01
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品 合計		1 650 404 292.19	39.37
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されていない譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
優先株式			
アメリカ合衆国			
USD DITECH HOLDING COR 0% PREF 31/12/49	146.00	14.60	0.00
アメリカ合衆国合計		14.60	0.00
優先株式合計		14.60	0.00
記名株式			
アメリカ合衆国			
USD ATD NEW HLDGS INC NPV	9 499.00	157 835.38	0.00
アメリカ合衆国合計		157 835.38	0.00
記名株式合計		157 835.38	0.00

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
ノート、固定利付債			
ユーロ			
EUR CONSTELLUM NV-REG-S 4.25000% 17-15.02.26	1 420 000.00	1 576 424.18	0.04
EUR CROWN EUROPEAN HOLDINGS SA-REG-S 2.87500% 18-01.02.26	2 955 000.00	3 386 137.29	0.08
ユーロ合計		4 962 561.47	0.12
米ドル			
USD ALCOA NEDERLAND HOLDING BV-144A 6.12500% 18-15.05.28	1 255 000.00	1 270 687.50	0.03
USD AMERI MIDSTRM PARTNERS LP/FIN CORP-144A 8.50000% 16-15.12.21	10 488 000.00	9 753 840.00	0.23
USD ANTERO MIDSTREAM PARTNERS/FIN CORP 5.37500% 17-15.09.24	3 395 000.00	3 327 100.00	0.08
USD ASCEND LEARNING LLC-144A 6.87500% 17-01.08.25	2 274 000.00	2 274 000.00	0.06
USD BEACON ROOFING SUPPLY INC 6.37500% 16-01.10.23	930 000.00	957 881.40	0.02
USD BERRY PETROLEUM CORP-144A 7.00000% 18-15.02.26	6 602 000.00	6 403 940.00	0.15
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.00000% 17-01.02.28	6 506 000.00	6 180 700.00	0.15
USD CCO LLC/CAPITAL 4.20000% 17-15.03.28	425 000.00	410 657.94	0.01
USD CDK GLOBAL INC 4.87500% 18-01.06.27	6 020 000.00	5 839 400.00	0.14
USD CENTRAL GARDEN & PET CO 5.12500% 17-01.02.28	1 820 000.00	1 697 150.00	0.04
USD CHESAPEAKE ENERGY CORP 8.00000% 18-15.06.27	550 000.00	526 625.00	0.01
USD CNX MIDSTREAM FINANCE CORP-144A 6.50000% 18-15.03.26	4 595 000.00	4 520 331.25	0.11
USD COVANTA HOLDING CORP 6.00000% 18-01.01.27	1 040 000.00	995 800.00	0.02
USD CUMBERLAND FARMS INC-144A 6.75000% 17-01.05.25	1 684 000.00	1 709 260.00	0.04
USD ELEMENT SOLUTIONS INC-144A 6.50000% 15-01.02.22	365 000.00	370 018.75	0.01
USD ENERGIZER HOLDINGS INC-144A 7.75000% 19-15.01.27	4 202 000.00	4 329 530.70	0.10
USD EXTERRAN ENE SOL LP / EES FIN CORP 8.12500% 18-01.05.25	4 100 000.00	4 007 750.00	0.10
USD FLEXI-VAN LEASING INC-144A 10.00000% 18-15.02.23	600 000.00	499 500.00	0.01
USD GLP CAPITAL LP / GLP FINANC II INC 5.75000% 18-01.06.28	1 705 000.00	1 777 189.70	0.04
USD GRINDING MEDIA INC/ CANADA INC-144A 7.37500% 16-15.12.23	2 850 000.00	2 878 500.00	0.07
USD GULFPORT ENERGY CORP 6.37500% 18-15.01.26	4 376 000.00	4 069 680.00	0.10
USD HCA INC 5.87500% 19-01.02.29	3 755 000.00	3 933 362.50	0.09
USD HUBBAY MINERALS INC-144A 7.62500% 16-15.01.25	750 000.00	770 625.00	0.02
USD HUGHES SATELLITE SYSTEMS CORP 7.62500% 12-15.06.21	2 000 000.00	2 120 000.00	0.05
USD IHS MARKIT LTD-144A 5.00000% 16-01.11.22	905 000.00	924 638.50	0.02
USD INVENTIV GROUP HOLDINGS INC-144A 7.50000% 16-01.10.24	6 763 000.00	7 126 511.25	0.17
USD JACK OHIO FIN/ JO FINANCE 1 CORP-144A 10.25000% 16-15.11.22	76 000.00	81 890.00	0.00
USD JBS USA LLC/JBS USA FINANCE INC-144A 6.75000% 18-15.02.28	6 022 000.00	6 082 220.00	0.15
USD JEFFERIES FINANCE LLC-144A 7.25000% 17-15.08.24	950 000.00	903 687.50	0.02
USD KEHE DIST LLC / KEHE FIN CORP-144A 7.62500% 13-15.08.21	825 000.00	779 625.00	0.02
USD KFC HLDG/PIZZA HUT HLDG/TACO BELL-144A 4.75000% 17-01.06.27	3 100 000.00	3 003 125.00	0.07
USD KINETIC CONCEPTS INC/KCI USA INC-144A 12.50000% 16-01.11.21	3 240 000.00	3 507 300.00	0.08
USD KRATOS DEFENSE & SECURITY SOL INC-144A 6.50000% 17-30.11.25	580 000.00	597 400.00	0.02
USD LITHIA MOTORS INC-144A 5.25000% 17-01.08.25	1 105 000.00	1 066 325.00	0.03
USD MGM RESORTS INTL 5.75000% 18-15.06.25	2 510 000.00	2 522 550.00	0.06
USD NABORS INDUSTRIES INC 5.50000% 17-15.01.23	3 016 000.00	2 714 400.00	0.07
USD NAVIENT CORP 6.50000% 17-15.06.22	290 000.00	296 249.50	0.01
USD NETFLIX INC 4.87500% 18-15.04.28	3 538 000.00	3 365 522.50	0.08
USD NEXTERA ENERGY OPERATING PARTNERS-144A 4.25000% 17-15.09.24	250 000.00	238 200.00	0.01
USD NOVELIS CORP-144A 6.25000% 16-15.08.24	5 951 000.00	5 988 193.75	0.14
USD OLIN CORP 5.00000% 18-01.02.30	765 000.00	705 712.50	0.02
USD PARK-OHIO INDUSTRIES INC 6.62500% 17-15.04.27	2 650 000.00	2 577 125.00	0.06
USD PARSLEY ENERGY LLC/FINANCE CORP-144A 5.37500% 16-15.01.25	510 000.00	506 175.00	0.01
USD PARTY CITY HOLDINGS INC-144A 6.62500% 18-01.08.26	2 518 000.00	2 448 755.00	0.06
USD PQ CORP-144A 5.75000% 17-15.12.25	5 192 000.00	4 958 360.00	0.12
USD PRECISION DRILLING CORP 7.75000% 17-15.12.23	5 702 000.00	5 445 410.00	0.13
USD PRECISION DRILLING CORP-144A 7.12500% 17-15.01.26	190 000.00	173 850.00	0.00
USD SERVICE CORP INTERNATIONAL/US 4.62500% 17-15.12.27	7 760 000.00	7 566 000.00	0.18
USD STARS GROUP HOLDINGS BV-144A 7.00000% 18-15.07.26	6 210 000.00	6 305 013.00	0.15
USD TALLGRASS ENRGY PART LP/FIN CORP-144A 5.50000% 16-15.09.24	2 000 000.00	2 005 000.00	0.05

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD TARGA RESOURCES PARTNERS 5.12500% 16-01.02.25	1 795 000.00	1 763 587.50	0.04
USD TARGA RESOURCES PARTNERS-144A 6.50000% 19-15.07.27	2 236 000.00	2 305 852.64	0.06
USD TELENET FINANCE LUXEMBOURG-144A 5.50000% 17-01.03.28	1 000 000.00	945 000.00	0.02
USD TENET HEALTHCARE CORP-144A 7.50000% 16-01.01.22	6 486 000.00	6 738 954.00	0.16
USD VALVOLINE INC 5.50000% 17-15.07.24	2 600 000.00	2 639 000.00	0.06
USD VERITAS US INC / BERMUDA LTD-144A 7.50000% 16-01.02.23	2 065 000.00	1 817 200.00	0.04
USD VOC ESCROW LTD-144A 5.00000% 18-15.02.28	3 525 000.00	3 436 522.50	0.08
USD WABASH NATIONAL CORP-144A 5.50000% 17-01.10.25	1 050 000.00	955 500.00	0.02
USD WILLIAM LYON HOMES INC 5.87500% 17-31.01.25	200 000.00	176 000.00	0.00
USD YAMANA GOLD INC 4.62500% 18-15.12.27	750 000.00	701 130.00	0.02
米ドル合計		163 991 514.88	3.91
ノート、固定利付債合計		168 954 076.35	4.03
中期債券、固定利付債			
米ドル			
USD RYDER SYSTEM INC 2.50000% 17-01.09.22	1 650 000.00	1 595 602.55	0.04
米ドル合計		1 595 602.55	0.04
中期債券、固定利付債合計		1 595 602.55	0.04
債券、固定利付債			
米ドル			
USD DELEK LOGISTICS PARTNERS LP 6.75000% 18-15.05.25	4 208 000.00	4 165 920.00	0.10
USD ISTAR INC 4.62500% 17-15.09.20	1 370 000.00	1 359 725.00	0.03
USD JB POINDEXTER & CO INC-144A 7.12500% 18-15.04.26	975 000.00	945 750.00	0.03
USD PDC ENERGY INC 6.12500% 17-15.09.24	900 000.00	878 238.00	0.02
USD WINDSTREAM SERVICES/FINANCE CORP-144A 8.62500% 17-31.10.25	4 461 000.00	4 204 492.50	0.10
米ドル合計		11 554 125.50	0.28
債券、固定利付債合計		11 554 125.50	0.28
転換社債、固定利付債			
米ドル			
USD NABORS INDUSTRIES INC 0.75000% 17-15.01.24	650 000.00	438 620.00	0.01
米ドル合計		438 620.00	0.01
転換社債、固定利付債合計		438 620.00	0.01
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されて いない譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		182 700 274.38	4.36
最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD ACRISURE LLC / FINANCE INC-144A 8.12500% 19-15.02.24	3 093 000.00	3 147 127.50	0.08
USD ALBERTSONS COS LLC / SAFEWAY INC-144A 7.50000% 19-15.03.26	420 000.00	421 050.00	0.01
USD ANIXTER INC-144A 6.00000% 18-01.12.25	850 000.00	871 250.00	0.02
USD ASCENT RESOURCES UTICA HOLDINGS-144A 7.00000% 18-01.11.26	5 604 000.00	5 407 860.00	0.13
USD AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD-144A 5.12500% 18-01.10.23	525 000.00	532 980.00	0.01
USD BASIC ENERGY SERVICES INC-144A 10.75000% 18-15.10.23	575 000.00	493 062.50	0.01
USD CHENIERE ENERGY PARTNERS LP-144A 5.62500% 18-01.10.26	2 035 000.00	2 039 802.60	0.05

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD CLEARWAY ENERGY OPERATING LLC-144A 5.75000% 18-15.10.25	900 000.00	831 375.00	0.02
USD COMPASS GROUP DIVERSIFIED HOLDINGS-144A 8.00000% 18-01.05.26	920 000.00	932 075.00	0.02
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 6.50000% 19-01.02.29	500 000.00	506 562.50	0.01
USD DAE FUNDING LLC-144A 5.25000% 18-15.11.21	2 236 000.00	2 256 347.60	0.05
USD DIGICEL GROUP ONE LTD-144A 8.25000% 18-30.12.22	1 595 000.00	1 315 875.00	0.03
USD DIGICEL LTD-144A 8.25000% 18-30.09.22	1 505 000.00	820 225.00	0.02
USD ELDORADO RESORTS INC-144A 6.00000% 18-15.09.26	1 738 000.00	1 733 655.00	0.04
USD ENPRO INDUSTRIES INC-144A 5.75000% 18-15.10.26	3 678 000.00	3 659 610.00	0.09
USD FINANCIAL & RISK US HOLDINGS INC-144A 6.25000% 18-15.05.26	850 000.00	835 125.00	0.02
USD GRAY ESCROW INC-144A 7.00000% 18-15.05.27	2 946 000.00	3 050 288.40	0.07
USD HD SUPPLY INC-144A 5.37500% 18-15.10.26	1 200 000.00	1 206 000.00	0.03
USD HILCORP ENERGY I LP/FINANCE CO-144A 6.25000% 18-01.11.28	5 613 000.00	5 472 675.00	0.13
USD INTERTAPE POLYMER GROUP INC-144A 7.00000% 18-15.10.26	1 350 000.00	1 350 000.00	0.03
USD LGI HOMES INC-144A 6.87500% 18-15.07.26	1 580 000.00	1 520 750.00	0.04
USD LSB INDUSTRIES INC-144A 9.62500% 18-01.05.23	2 040 000.00	2 075 700.00	0.05
USD MEDNAX INC-144A 6.25000% 18-15.01.27	2 304 000.00	2 321 280.00	0.06
USD MGM GROWTH POP LP/CO-ISSUER INC-144A 5.75000% 19-01.02.27	4 087 000.00	4 122 148.20	0.10
USD NEWMARK GROUP INC-144A 6.12500% 18-15.11.23	1 800 000.00	1 796 120.86	0.04
USD NINE ENERGY SERVICE INC-144A 8.75000% 18-01.11.23	975 000.00	977 437.50	0.02
USD REGIONALCARE HOSPITAL PTRS HLDNGS-144A 9.75000% 18-01.12.26	1 500 000.00	1 496 700.00	0.04
USD RESIDEO FUNDING INC-144A 6.12500% 18-01.11.26	2 634 000.00	2 713 020.00	0.07
USD TENET HEALTHCARE CORP-144A 6.25000% 19-01.02.27	4 050 000.00	4 075 312.50	0.10
USD TRANSDIGM INC-144A 6.25000% 19-15.03.26	6 388 000.00	6 483 820.00	0.15
USD TRANSOCEAN POSEIDON LTD-144A 6.87500% 19-01.02.27	248 000.00	251 844.00	0.01
USD VISTRA OPERATIONS CO LLC-144A 5.62500% 19-15.02.27	1 001 000.00	1 006 005.00	0.02
USD WELLCARE HEALTH PLANS INC-144A 5.37500% 18-15.08.26	5 843 000.00	5 945 252.50	0.14
USD WILLIAMS SCOTSMAN INTNL INC-144A 6.87500% 18-15.08.23	1 350 000.00	1 321 717.50	0.03
米ドル合計		72 990 054.16	1.74
ノート、固定利付債合計		72 990 054.16	1.74
最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		72 990 054.16	1.74
投資有価証券合計		4 033 176 209.90	96.21
派生商品			
公認の証券取引所に上場されている派生商品			
債券先物に係るオプション、先物型			
EUR EURO-BOBL FUTURE PUT 131.00000 MAR 19 22.02.19	190.00	-41 422.94	0.00
債券先物に係るオプション、先物型合計		-41 422.94	0.00
債券に係る金融先物			
EUR EURO-BUND FUTURE 07.03.19	58.00	88 091.21	0.00
EUR EURO-BOBL FUTURE 07.03.19	41.00	35 421.78	0.00
EUR EURO-SCHATZ FUTURE 07.03.19	162.00	0.00	0.00
EUR EURO-BUXL FUTURE 07.03.19	4.00	42 317.96	0.00
EUR EURO-OAT FUTURE 07.03.19	-185.00	-393 430.42	-0.01
USD US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 20.03.19	-35.00	-167 402.13	0.00
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 20.03.19	-43.00	5 516.43	0.00
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 29.03.19	-520.00	-391 697.88	-0.01
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 29.03.19	127.00	57 132.24	0.00
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 20.03.19	-140.00	-390 589.74	-0.01
USD US LONG BOND FUTURE 20.03.19	-18.00	-191 435.10	0.00
債券に係る金融先物合計		-1 306 075.65	-0.03

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
通貨に係る金融先物			
USD EURO FX CURRENCY FUTURE 18.03.19	-2 925.00	-1 985 456.25	-0.05
USD GBP CURRENCY FUTURE 18.03.19	-370.00	-1 240 312.50	-0.03
通貨に係る金融先物合計		-3 225 768.75	-0.08
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		-4 573 267.34	-0.11
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されていない派生商品			
指数に係るスワップおよびフォワード・スワップ			
EUR SG/IBOXX EUR LIQUID HY EQS REC PERF 18-20.03.19	8 000 000.00	141 472.57	0.00
EUR SG/IBOXX EUR LIQUID HY INDEX SWAP PAY 3ML 18-20.03.19			
指数に係るスワップおよびフォワード・スワップ合計		141 472.57	0.00
クレジット・デフォルト・スワップ*			
EUR SOCIETE GENERALE/PEUGEOT SA CREDIT DEFAULT SWAP RECEIVER 5.00000% 18-20.12.23	600 000.00	-119 721.40	0.00
EUR BNP PARIBAS/TELECOM ITALIA CREDIT DEFAULT SWAP PAYER 1.00000% 17-20.06.24	-550 000.00	-73 056.14	0.00
EUR BARCLAYS/TELECOM ITALIA CREDIT DEFAULT SWAP PAYER 1.00000% 18- 20.06.23	-150 000.00	-13 964.08	0.00
EUR SOCIETE GENERALE/TELECOM CREDIT DEFAULT SWAP PAYER 1.00000% 18- 20.06.24	-500 000.00	-66 414.68	0.00
USD ICE/CDX.NA.HY.31 DEC23 CDI PAYER 5.00000% 18-20.12.23	-19 600 000.00	1 302 894.76	0.02
EUR BNP PARIBAS/TELECOM CREDIT DEFAULT SWAP PAYER 1.00000% 18- 20.12.23	-1 800 000.00	-206 540.14	0.00
クレジット・デフォルト・スワップ合計		823 198.32	0.02
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されて いない派生商品合計		964 670.89	0.02
派生商品合計		-3 608 596.45	-0.09

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2019年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
先渡為替契約			
先渡為替契約(購入/売却)			
USD 246 297 440.48	EUR 214 127 000.00	8.2.2019 476 087.72	0.01
EUR 4 361 000.00	USD 5 011 512.93	8.2.2019 -5 012.49	0.00
USD 1 205 761.87	EUR 1 053 000.00	8.2.2019 -3 099.62	0.00
EUR 830 619.18	USD 945 987.20	8.2.2019 7 577.42	0.00
EUR 874 000.00	USD 1 000 087.61	8.2.2019 3 278.91	0.00
USD 2 665 725.10	EUR 2 334 288.77	8.2.2019 -14 077.18	0.00
USD 1 464 673.62	EUR 1 281 000.00	8.2.2019 -5 935.66	0.00
USD 1 490 184.91	EUR 1 297 157.50	8.2.2019 1 026.55	0.00
EUR 2 307 000.00	USD 2 641 482.70	8.2.2019 6 991.62	0.00
USD 923 806.34	EUR 808 046.42	8.2.2019 -3 844.37	0.00
USD 765 378.56	EUR 669 368.96	8.2.2019 -3 068.12	0.00
USD 85 661 851.28	EUR 75 075 000.00	20.2.2019 -613 771.01	-0.01
USD 33 633 135.90	GBP 26 580 000.00	20.2.2019 -1 363 638.90	-0.03
USD 2 817 452.59	CHF 2 779 000.00	20.2.2019 11 595.19	0.00
EUR 786 023.72	USD 903 252.08	8.2.2019 -883.79	0.00
USD 3 322 982.11	EUR 2 879 000.00	8.2.2019 17 842.29	0.00
EUR 2 355 000.00	USD 2 707 404.56	8.2.2019 -3 825.44	0.00
SGD 8 217 688.95	USD 6 075 000.00	22.2.2019 38 819.01	0.00
GBP 58 257 017.12	USD 75 045 000.00	22.2.2019 1 667 403.24	0.04
EUR 1 188 437 410.04	USD 1 366 438 000.00	22.2.2019 -464 892.99	-0.01
CHF 1 228 825 581.95	USD 1 254 955 000.00	22.2.2019 -14 018 470.32	-0.33
USD 119 166 363.50	EUR 103 300 000.00	20.3.2019 163 538.02	0.00
USD 27 690 481.80	GBP 21 460 000.00	20.3.2019 -606 713.11	-0.01
USD 3 174 401.30	CHF 3 095 000.00	20.3.2019 40 855.09	0.00
USD 320 680 702.80	EUR 279 000 000.00	21.3.2019 -759 359.74	-0.02
CHF 27 510 560.00	USD 28 000 000.00	22.2.2019 -218 303.92	-0.02
EUR 21 804 220.77	USD 25 000 000.00	22.2.2019 61 462.17	0.00
GBP 1 395 909.37	USD 1 800 000.00	22.2.2019 38 122.99	0.00
SGD 108 187.44	USD 80 000.00	22.2.2019 489.59	0.00
USD 3 435 541.50	EUR 3 000 000.00	21.3.2019 -20 803.26	0.00
USD 1 932 387.52	EUR 1 692 000.00	8.2.2019 -10 056.59	0.00
USD 4 337 563.20	EUR 3 800 000.00	20.3.2019 -40 081.88	0.00
USD 582 272.10	GBP 450 000.00	20.3.2019 -11 098.72	0.00
USD 100 979.40	CHF 100 000.00	20.3.2019 -266.03	0.00
USD 668 564.82	EUR 587 000.00	8.2.2019 -5 320.93	0.00
USD 1 712 323.20	EUR 1 500 000.00	21.3.2019 -15 849.18	0.00
USD 933 623.48	EUR 818 000.00	8.2.2019 -5 454.11	0.00
EUR 499 449.93	USD 570 750.40	8.2.2019 2 626.42	0.00
USD 1 311 002.11	GBP 998 800.00	28.2.2019 -4 612.84	0.00
USD 154 701 900.00	EUR 135 000 000.00	28.2.2019 -543 558.08	-0.01
USD 114 594 000.00	EUR 100 000 000.00	28.2.2019 -402 635.62	-0.01
EUR 1 496 681.07	USD 1 718 915.76	8.2.2019 -701.03	0.00
USD 1 035 747.16	EUR 902 554.49	8.2.2019 -400.39	0.00
EUR 1 117 543.00	USD 1 284 078.70	28.2.2019 1 058.15	0.00
先渡為替契約(購入/売却)合計		-16 606 960.94	-0.40
現金預金、要求払預金および預託金勘定ならびにその他の流動資産		139 519 766.40**	3.33
当座借越およびその他の短期負債		-7 544 020.50	-0.18
その他の資産および負債		47 262 776.15	1.13
純資産総額		4 192 199 174.56	100.00

* 額面が正：サブ・ファンドは「プロテクションの受取側」、額面が負：サブ・ファンドは「プロテクションの支払側」

** 2019年1月31日現在、パークレイズに対する180,000.00米ドル、ビー・エヌ・ピー・パリバに対する360,000.00米ドル、メリルリンチに対する50,000.00米ドルおよびUBSヨーロッパSEに対する1,586,787.44米ドルの現金が、取引相手方に対する担保となっている。

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

[次へ](#)

5 販売及び買戻しの実績

2019年2月末日までの1年間における販売および買戻しの実績ならびに2019年2月末日現在の発行済口数は以下のとおりである。

(エマージング・マーケット・デッド)

(クラスF - a c c 投資証券)

販売口数	買戻し口数	発行済口数
5,866,453.9150	8,255,450.0160	12,780,670.5270
(0)	(0)	(0)

(注) ()内の数字は本邦内における販売、買戻しおよび発行済口数である。以下、同じ。

(US マルチ・クレジット)

(クラスF - a c c 投資証券)

販売口数	買戻し口数	発行済口数
3,208,287.9360	4,031,048.5770	14,243,760.9240
(0)	(0)	(0)

(ハイ・イールド)

(クラスF - a c c 投資証券)

販売口数	買戻し口数	発行済口数
4,355,977.2700	2,390,252.4210	11,323,477.2860
(0)	(0)	(0)