

【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】 令和3年4月30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

【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：13億6,640万米ドル(約1,420億円)を上限とする。

クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券

1,032億4,000万円を上限とする。

U S マルチ・クレジット

クラスF - a c c 投資証券：16億3,020万米ドル(約1,694億円)を上限とする。

クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券

1,076億2,000万円を上限とする。

ハイ・イールド

クラスF - a c c 投資証券：13億2,180万米ドル(約1,373億円)を上限とする。

クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券

1,040億8,000万円を上限とする。

(注1) 上限見込額は、便宜上、各サブ・ファンドの投資証券の2020年10月末日現在の1口当たりの純資産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・デッドのクラスF - a c c 投資証券については136.64米ドル(約14,196円)、エマージング・マーケット・デッドのクラスF - a c c 円ヘッジ投資証券については10,324円、U S マルチ・クレジットのクラスF - a c c 投資証券については163.02米ドル(約16,936円)、U S マルチ・クレジットのクラスF - a c c 円ヘッジ投資証券については10,762円、ハイ・イールドのクラスF - a c c 投資証券については132.18米ドル(約13,732円)、ハイ・イールドのクラスF - a c c 円ヘッジ投資証券については10,408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、2020年11月30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=103.89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、令和3年1月29日付をもって提出した有価証券届出書(2021年3月8日付および2021年4月9日付の有価証券届出書の訂正届により訂正済)(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、また、2021年5月2日付で払込取扱場所が変更されるため、これに関する記載を訂正するため、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】

(1) 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) 事業の内容及び営業の概況		(4) 事業の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)

	2019年1月末日 に終了する 中間会計年度末	2019年7月末日 に終了する 会計年度末	2020年1月末日 に終了する 中間会計年度末	2020年7月末日 に終了する 会計年度末	2021年1月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	- 1,772,841.39	262,426,023.02	205,152,492.83	351,514,548.83	419,923,653.21
(b) 経常利益金額 または経常損失金額	- 1,772,841.39	262,426,023.02	205,152,492.83	351,514,548.83	419,923,653.21
(c) 当期純利益金額 または当期純損失金額	- 1,772,841.39	262,426,023.02	205,152,492.83	351,514,548.83	419,923,653.21
(d) 出資総額 ⁽²⁾	4,815,514,601.02	6,089,637,256.08	6,485,463,790.78	6,297,057,630.99	7,088,189,524.66
(e) 発行済投資口総数 (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)	12,457,206.6330口 -	14,193,122.2020口 77,455口	15,882,703.0560口 127,510口	16,214,122.0160口 140,170口	17,817,775.2900口 127,429.1180口
(f) 純資産額	4,815,514,601.02	6,089,637,256.08	6,485,463,790.78	6,297,057,630.99	7,088,189,524.66
(g) 資産総額	5,643,466,678.05	6,156,363,434.31	6,664,804,223.36	6,355,513,053.74	7,262,997,802.48
(h) 1口当たり純資産価格 (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)	124.82 -	134.28 10,399円	138.80 10,611円	137.43 10,398円	144.28 10,883円
(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) (クラスF - a c c 円ヘッジ 投資証券)	3.00 -	11.18 4.21	4.60 2.34	4.19 3.34	6.71 5.95
(j) 分配総額	9,576,575.17	9,576,575.17	12,736,384.92	12,856,778.29	15,638,449.34
(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	85.33%	98.92%	97.31%	99.08%	97.59%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾ (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)	- 1.25% -	9.84% 3.99%	11.20% 6.11%	2.35% - 0.01%	3.95% 2.56%

(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) が含まれる。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、2019年5月29日から1口当たり純資産価格の算出を開始した。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。

(U S 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)

	2019年1月末日 に終了する 中間会計年度末	2019年7月末日 に終了する 会計年度末	2020年1月末日 に終了する 中間会計年度末	2020年7月末日 に終了する 会計年度末	2021年1月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ^(1)	39,382,289.75	212,113,520.97	202,052,254.46	651,975,966.37	155,668,842.68
(b) 経常利益金額 または経常損失金額	39,382,289.75	212,113,520.97	202,052,254.46	651,975,966.37	155,668,842.68
(c) 当期純利益金額 または当期純損失金額	39,382,289.75	212,113,520.97	202,052,254.46	651,975,966.37	155,668,842.68
(d) 出資総額 ^(2)	4,554,018,506.46	5,219,858,520.58	5,671,072,733.01	6,198,677,594.06	5,586,016,054.14
(e) 発行済投資口総数 (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)	14,133,543.7510口 -	14,765,747.6220口 278,717口	15,327,746.8270口 327,767口	14,063,084.4420口 329,750口	13,261,111.2100口 309,435口
(f) 純資産額	4,554,018,506.46	5,219,858,520.58	5,671,072,733.01	6,198,677,594.06	5,586,016,054.14
(g) 資産総額	4,564,362,055.62	5,246,548,649.35	5,731,345,460.24	6,214,829,242.92	5,674,469,422.74
(h) 1口当たり純資産価格 (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)	142.56 -	150.44 10,183円	156.50 10,461円	163.20 10,788円	165.92 10,934円
(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) (クラスF - a c c 円ヘッジ 投資証券)	3.35 -	10.91 2.35	5.97 2.56	12.79 8.01	2.73 2.46
(j) 分配総額	6,219,391.52	6,219,391.52	7,699,227.71	7,802,905.72	9,503,304.77
(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	99.77%	99.49%	98.95%	99.74%	98.44%
(m) 自己資本利益率 ^(3) (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)	1.64% -	8.08% 1.83%	9.78% 4.61%	8.48% 5.94%	6.02% 4.52%

(ハイ・イールド)

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	2019年1月末日 に終了する 中間会計年度末	2019年7月末日 に終了する 会計年度末	2020年1月末日 に終了する 中間会計年度末	2020年7月末日 に終了する 会計年度末	2021年1月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	- 61,547,460.22	108,749,340.73	145,821,659.70	239,578,445.72	300,321,786.73
(b) 経常利益金額 または経常損失金額	- 61,547,460.22	108,749,340.73	145,821,659.70	239,578,445.72	300,321,786.73
(c) 当期純利益金額 または当期純損失金額	- 61,547,460.22	108,749,340.73	145,821,659.70	239,578,445.72	300,321,786.73
(d) 出資総額 ⁽²⁾	4,192,199,174.56	4,507,826,074.78	4,460,382,133.69	4,411,256,071.12	3,978,703,842.70
(e) 発行済投資口総数 (クラスF - a c c 投資証券)	11,349,743.1350口	11,444,078.7390口	11,932,941.4770口	12,116,942.6060口	10,543,921.530口
(e) 発行済投資口総数 (クラスF - a c c 円ヘッジ 投資証券)	-	77,644口	101,356口	107,946口	97,986口
(f) 純資産額	4,192,199,174.56	4,507,826,074.78	4,460,382,133.69	4,411,256,071.12	3,978,703,842.70
(g) 資産総額	4,233,420,506.64	4,598,888,147.24	4,536,686,484.21	4,468,225,679.24	4,079,272,705.52
(h) 1口当たり純資産価格 (クラスF - a c c 投資証券)	119.17	126.70	131.17	131.06	139.45
(h) 1口当たり純資産価格 (クラスF - a c c 円ヘッジ 投資証券)	-	10,229円	10,460円	10,333円	10,962円
(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)	0.75	8.22	4.34	3.76	8.74
(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 円ヘッジ 投資証券)	-	2.75	2.07	3.39	7.49
(j) 分配総額	6,428,148.63	6,428,148.63	8,555,219.29	8,604,497.14	8,742,699.34
(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	98.69%	98.02%	98.32%	98.73%	97.53%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾ (クラスF - a c c 投資証券)	0.96%	7.27%	10.07%	3.44%	6.31%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾ (クラスF - a c c 円ヘッジ 投資証券)	-	2.29%	4.60%	1.02%	4.80%

(2) 外国投資法人の出資総額

2021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。

なお、発行可能投資口総口数には制限がない。

(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		
2021年2月末日現在	5,703,752,128.45	606,024	クラスF - a c c 投資証券	14,683,277.5490
			クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券	124,459.1180

(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		
2021年2月末日現在	5,524,639,355.69	586,993	クラスF - a c c 投資証券	13,361,163.9220
			クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券	302,151

(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		
2021年2月末日現在	3,978,119,911.09	422,675	クラスF - a c c 投資証券	10,608,712.1580
			クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券	95,736

(注) 米ドルの円貨換算は、特に記載がない限り、2021年2月26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=106.25円)によります。

(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

(2021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

(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ズ・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)に遅滞なく預託される。

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。)未滿に落ち込んだ場合、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、「有価証券報告書 第二部 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)

(2021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	374,965,578.57	6.39
	オランダ	274,018,342.25	4.67
	ケイマン諸島	259,980,904.82	4.43
	トルコ	225,591,883.17	3.84
	コロンビア	194,588,269.73	3.32
	インドネシア	168,604,437.37	2.87
	ブラジル	163,358,293.10	2.78
	中国	141,096,692.63	2.40
	ドミニカ共和国	138,442,714.99	2.36
	エジプト	138,226,189.07	2.36
	アラブ首長国連邦	133,680,861.14	2.28
	ウクライナ	125,628,197.38	2.14
	ルクセンブルグ	115,928,881.71	1.98
	香港	110,702,685.57	1.89
	サウジアラビア	109,482,388.41	1.87
	英領ヴァージン諸島	103,837,318.65	1.77
	ペルー	101,782,660.59	1.73
	アルゼンチン	101,720,368.84	1.73
	チリ	99,395,329.61	1.69
	パラグアイ	94,820,707.49	1.62
	ロシア連邦	86,687,713.89	1.48
	パナマ	84,412,758.69	1.44
	インド	80,973,216.28	1.38
	カタール	79,320,532.38	1.35
	ナイジェリア	75,092,259.10	1.28
	ルーマニア	73,895,789.29	1.26
	オマーン	70,908,844.68	1.21
	マレーシア	69,877,396.88	1.19
	南アフリカ	66,484,700.23	1.13
	カザフスタン	65,173,226.05	1.11
	米国	63,380,380.63	1.08
	バーレーン	61,000,859.17	1.04
アゼルバイジャン	59,367,360.30	1.01	
コートジボワール	56,014,972.19	0.95	
シンガポール	55,915,840.62	0.95	

エクアドル	52,622,996.21	0.90
アイルランド	51,355,849.76	0.88
アンゴラ	50,327,693.11	0.86
モーリシャス	49,706,559.00	0.85
ガーナ	49,524,381.55	0.84
イスラエル	49,490,592.65	0.84
グアテマラ	46,973,466.69	0.80
フィリピン	46,081,364.59	0.79
クロアチア	43,524,989.46	0.74
スリランカ	42,133,840.31	0.72
エクアドル	38,423,517.50	0.65
イギリス	37,498,192.70	0.64
セルビア	31,965,604.34	0.54
モロッコ	30,656,738.06	0.52
マン島	30,581,126.72	0.52
カナダ	30,565,792.14	0.52
モンゴル	29,770,585.75	0.51
ハンガリー	26,224,400.09	0.45
コスタリカ	24,846,756.25	0.42
スペイン	24,286,855.43	0.41
韓国	24,169,180.80	0.41
セネガル	23,736,773.20	0.40
パキスタン	22,193,625.31	0.38
ヨルダン	21,990,141.88	0.37
マカオ	21,872,960.26	0.37
ウルグアイ	21,272,559.88	0.36
ケニヤ	20,258,100.00	0.35
ジャマイカ	18,871,727.26	0.32
ガボン	18,619,406.65	0.32
タイ	17,045,781.43	0.29
オーストリア	16,675,397.68	0.28
トリニダード・アンド・トバゴ	15,944,415.00	0.27
バミューダ	15,240,327.42	0.26
ベラルーシ	14,705,783.35	0.25
アルメニア	14,566,633.05	0.25
レバノン	12,349,865.63	0.21
ベネズエラ	12,049,069.04	0.21
ホンデュラス	11,291,373.44	0.19
イラク	11,149,616.46	0.19
トーゴ	10,610,005.70	0.18
ジャージー	10,434,437.49	0.18
マケドニア(旧ユーゴスラビア)	10,234,276.07	0.17

エチオピア	9,324,649.99	0.16
ノルウェー	9,291,875.00	0.16
ザンビア	8,851,182.18	0.15
ウズベキスタン	8,781,160.00	0.15
ベニン	8,552,020.90	0.15
チュニジア	8,192,710.37	0.14
セントルシア	6,864,189.06	0.12
グルジア	5,023,767.19	0.09
バハマ	4,160,990.62	0.07
ベトナム	3,958,762.50	0.07
マーシャル諸島	3,941,406.25	0.07
ポーランド	3,856,725.00	0.07
クウェート	3,655,116.63	0.06
ブルンディ	2,819,173.76	0.05
多国籍	2,528,718.75	0.04
ブルガリア	2,415,699.07	0.04
国際機関	2,045,058.08	0.03
パプアニューギニア	1,887,212.50	0.03
カンボジア	1,261,125.00	0.02
ベリーズ	1,089,312.35	0.02
タジキスタン	965,250.00	0.02
カメルーン	949,025.00	0.02
ボリビア	178,875.00	0.00
小計	5,476,795,319.98	93.33
ポートフォリオ合計	5,476,795,319.98	93.33
現金・その他資産(負債控除後)	391,718,654.20	6.67
資産総額	5,868,513,974.18	100.00
負債総額	164,761,845.73	2.81
合計 (純資産総額)	5,703,752,128.45 (約606,024百万円)	97.19

(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。

(US マルチ・クレジット)

(2021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	4,306,736,182.54	76.81
	イギリス	255,796,582.64	4.56
	カナダ	117,251,750.25	2.09
	日本	107,473,143.88	1.92
	オランダ	77,723,746.18	1.39
	フランス	64,910,631.65	1.16
	オーストラリア	47,430,669.51	0.85
	アイルランド	46,911,448.56	0.84
	中国	35,441,279.55	0.63
	スイス	29,446,462.99	0.53
	ルクセンブルグ	29,365,508.92	0.52
	ケイマン諸島	28,217,788.14	0.50
	メキシコ	25,785,930.00	0.46
	スペイン	20,965,166.59	0.37
	バミューダ	20,846,839.15	0.37
	ガーンジー	12,661,004.95	0.23
	イタリア	11,893,160.78	0.21
	ニュージーランド	11,765,408.56	0.21
	チリ	9,491,704.48	0.17
	ノルウェー	9,102,648.93	0.16
	デンマーク	7,383,865.39	0.13
	ペルー	6,626,150.55	0.12
	英領ヴァージン諸島	6,235,636.50	0.11
	アラブ首長国連邦	5,889,628.12	0.11
	韓国	5,337,067.44	0.10
	カタール	4,735,686.25	0.08
	パナマ	4,465,569.60	0.08
	ブラジル	4,443,552.50	0.08
	フィンランド	4,151,053.42	0.07
	キュラソー	3,591,417.50	0.06
	サウジアラビア	3,521,208.20	0.06
	オーストリア	3,453,625.00	0.06
	スウェーデン	2,876,899.33	0.05
マカオ	2,410,435.85	0.04	
インド	2,304,867.19	0.04	
ジャージー	2,216,505.84	0.04	
マレーシア	1,084,777.99	0.02	

	コロンビア	827,726.87	0.01
	カザフスタン	734,293.26	0.01
	小計	5,341,507,025.05	95.26
モーゲージ 担保証券/ 資産担保証券/ その他割引債	ケイマン諸島	28,329,936.44	0.51
	米国	25,188,773.07	0.45
	小計	53,518,709.51	0.95
短期金融商品	米国	36,813,918.75	0.66
株式	米国	148,541.08	0.00
ポートフォリオ合計		5,431,988,194.39	96.88
現金・その他資産(負債控除後)		175,185,836.32	3.12
資産総額		5,607,174,030.71	100.00
負債総額		82,534,675.02	1.47
合計 (純資産総額)		5,524,639,355.69 (約586,993百万円)	98.53

(ハイ・イールド)

(2021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	2,182,924,168.73	54.02
	オランダ	300,160,348.47	7.43
	フランス	274,113,883.55	6.78
	ドイツ	203,374,912.61	5.03
	イギリス	163,336,125.57	4.04
	ルクセンブルグ	133,966,842.77	3.32
	イタリア	126,269,705.95	3.12
	カナダ	108,396,172.14	2.68
	スウェーデン	65,325,281.14	1.62
	スペイン	63,013,469.37	1.56
	アイルランド	40,994,914.05	1.01
	ケイマン諸島	22,177,487.20	0.55
	日本	21,236,704.48	0.53
	オーストラリア	18,303,449.52	0.45
	デンマーク	17,280,407.36	0.43
	フィンランド	14,901,658.96	0.37
	メキシコ	12,658,701.92	0.31
	オーストリア	12,650,409.14	0.31
	ベルギー	11,709,478.87	0.29
	ジャージー	9,743,423.20	0.24
	スイス	9,537,980.33	0.24
	パナマ	5,341,738.84	0.13
	ノルウェー	5,257,731.23	0.13
	バミューダ	4,946,846.57	0.12
	ルーマニア	4,293,438.18	0.11
	リベリア	3,947,027.96	0.10
	チェコ共和国	3,927,856.80	0.10
	アラブ首長国連邦	3,828,761.24	0.09
	マン島	3,814,495.66	0.09
	ハンガリー	3,643,979.33	0.09
	多国籍	3,258,935.73	0.08
	ポルトガル	3,012,651.60	0.07
	英領ヴァージン諸島	2,003,225.17	0.05
シンガポール	1,276,974.52	0.03	
ジャマイカ	799,438.39	0.02	
ガーンジー	595,308.21	0.01	

	マルタ	594,483.30	0.01
	マカオ	345,391.20	0.01
	香港	344,250.00	0.01
	小計	3,863,308,059.26	95.60
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	2,409,308.88	0.06
株式	米国	3,496,264.65	0.09
	ポートフォリオ合計	3,869,213,632.79	95.75
	現金・その他資産(負債控除後)	171,898,213.11	4.25
	資産総額	4,041,111,845.90	100.00
	負債総額	62,991,934.81	1.56
	合計 (純資産総額)	3,978,119,911.09 (約422,675百万円)	98.44

(2) 運用実績

純資産等の推移

2021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		
					(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)
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円	円
2020年3月末日	5,118,375	543,827	4,910,049	521,693	116.38	12,365	8,834
4月末日	5,508,071	585,233	5,410,897	574,908	120.57	12,811	9,136
5月末日	5,895,759	626,424	5,766,914	612,735	128.06	13,606	9,702
6月末日	6,044,024	642,178	5,958,589	633,100	132.70	14,099	10,046
7月末日	6,355,513	675,273	6,297,058	669,062	137.43	14,602	10,398
8月末日	7,410,268	787,341	7,115,231	755,993	139.20	14,790	10,529
9月末日	6,942,225	737,611	6,851,385	727,960	136.69	14,523	10,333
10月末日	6,851,491	727,971	6,757,800	718,016	136.64	14,518	10,324
11月末日	7,216,627	766,767	7,041,983	748,211	142.51	15,142	10,763
12月末日	7,226,654	767,832	7,195,629	764,536	145.54	15,464	10,981
2021年1月末日	7,262,998	771,694	7,088,190	753,120	144.28	15,330	10,883
2月末日	5,868,514	623,530	5,703,752	606,024	142.13	15,101	10,717

(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		
					(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)
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円	円
2020年3月末日	5,366,924	570,236	5,213,278	553,911	147.69	15,692	9,801
4月末日	5,905,230	627,431	5,833,355	619,794	154.33	16,398	10,223
5月末日	6,060,048	643,880	5,970,371	634,352	157.41	16,725	10,422
6月末日	6,036,684	641,398	6,010,544	638,620	160.39	17,041	10,610
7月末日	6,214,829	660,326	6,198,678	658,610	163.20	17,340	10,788
8月末日	6,119,531	650,200	6,071,342	645,080	163.34	17,355	10,793
9月末日	5,711,761	606,875	5,666,887	602,107	162.97	17,316	10,763
10月末日	5,612,862	596,367	5,582,682	593,160	163.02	17,321	10,762
11月末日	5,667,423	602,164	5,628,203	597,997	165.38	17,572	10,912
12月末日	5,690,691	604,636	5,673,682	602,829	166.41	17,681	10,970
2021年1月末日	5,674,469	602,912	5,586,016	593,514	165.92	17,629	10,934
2月末日	5,607,174	595,762	5,524,639	586,993	164.58	17,487	10,844

(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		
					(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)
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円	円
2020年3月末日	4,029,945	428,182	3,780,874	401,718	115.27	12,247	9,123
4月末日	4,037,312	428,964	3,968,367	421,639	120.91	12,847	9,548
5月末日	4,433,777	471,089	4,139,881	439,862	125.30	13,313	9,891
6月末日	4,224,079	448,808	4,181,474	444,282	126.61	13,452	9,990
7月末日	4,468,226	474,749	4,411,256	468,696	131.06	13,925	10,333
8月末日	4,163,383	442,359	4,027,820	427,956	132.62	14,091	10,454
9月末日	3,938,532	418,469	3,897,300	414,088	131.63	13,986	10,370
10月末日	3,892,771	413,607	3,860,970	410,228	132.18	14,044	10,408
11月末日	4,037,129	428,945	3,979,975	422,872	137.17	14,574	10,798

12月末日	4,053,661	430,701	4,034,149	428,628	139.01	14,770	10,933
2021年1月末日	4,079,273	433,423	3,978,704	422,737	139.45	14,817	10,962
2月末日	4,041,112	429,368	3,978,120	422,675	139.94	14,869	10,998

各サブ・ファンドのクラス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

(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)

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

該当事項なし。

自己資本利益率(収益率)の推移

2021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)	(クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券)
3.45	2.12

(US マルチ・クレジット)

収益率(%) (注)	
(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)
4.27	2.95

(ハイ・イールド)

収益率(%) (注)	
(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)
8.45	6.96

(注) 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$

a = 2021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 = 2020年2月末日の1口当たり純資産価格(分配落の額)。

(3) 投資リスク

当中間計算期間において、2021年1月29日提出の有価証券報告書「第一部 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

2021年2月末日現在の株主資本総額は、13,000,000ユーロ(約17億円)

(注)ユーロの円貨換算は、便宜上、2021年2月26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=129.15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

2021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12億円)

(注)スイスフランの円貨換算は、便宜上、2021年2月26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=117.34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

(2021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

(2021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

(2021年2月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有株式
アンドレ・ヴァレンテ (André Valente)	チェアマン	UBSファンド・マネジメント (スイス) エイ・ジー、バーゼル、 チーフ・エグゼクティブ・ オフィサー	該当なし
フランチェスカ・ジリ・ プリム (Francesca Gigli Prym)	ディレクター/ ボード・メンバー	UBSファンド・マネジメント (ルクセンブルグ) エス・エイ、 ルクセンブルグ、チーフ・ エグゼクティブ・オフィサー	該当なし
クリスティアン・マウラー (Christian Maurer)	ディレクター/ ボード・メンバー	UBSアセット・マネジメント・ スイス・エイ・ジー、チューリッ ヒ、 プロダクト・マネジメント・ヘッド	該当なし
ギルバート・シントゲン (Gilbert Schintgen)	インディペンデ ント・ディレク ター/ ボード・メンバー	ルクセンブルグ大公国、 デュドランジュ、 インディペンデント・ディレクター	該当なし

ユービーエス・スイス・エイ・ジー

(2021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 (2019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
ロジャー・フォン・メント レン (Roger von Mentlen)	ディレクター/ ボード・メンバー	2020年4月24日就任	非公開
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12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
クリスチャン・エッケハー 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
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

(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。

2021年2月末日現在、管理会社は以下のとおり、405本の投資信託/投資法人のサブ・ファンドの管理・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	364	538,555,619.52オーストラリア・ドル
			2,963,614,051.54カナダ・ドル
			14,931,265,949.26スイス・フラン
			10,382,233,353.13中国元
			715,933,910.44デンマーク・クローネ
			47,557,199,598.13ユーロ
			1,731,564,037.29英ポンド
			264,009,867.91香港ドル
			313,811,310,250.35日本円
			77,127,511.29シンガポール・ドル
			148,191,017,506.34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	41	479,726,878.25オーストラリア・ドル
			189,487,569.60スイス・フラン
			2,726,602,548.85ユーロ
			2,088,035,688.77英ポンド
			26,957,908,946.30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。

2021年1月末日現在、ユービーエス・スイス・エイ・ジーは以下の107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	7	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	40億スイスフラン
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	52億スイスフラン
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	299億スイスフラン
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	45	187億スイスフラン
アイルランド (ポートフォリオ・マネージャー)	ヘッジ・ファンド	2	4.8億スイスフラン

(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
 - クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券
 - U S 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
- 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、2021年2月26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=106.25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

	2021年1月31日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	6,677,985,542.99	709,535,964
投資有価証券、未実現評価(損)益	152,832,090.45	16,238,410
投資有価証券合計(注1)	6,830,817,633.44	725,774,374
現金預金、要求払預金および預託金勘定	259,531,608.96 *	27,575,233
その他の流動資産(委託証拠金)	17,037,248.46	1,810,208
投資有価証券売却未収金(注1)	59,237,873.23	6,294,024
発行未収金	6,933,103.36	736,642
有価証券に係る未収利息	85,364,728.72	9,070,002
スワップに係る未実現利益(注1)	4,075,606.31	433,033
資産合計	7,262,997,802.48	771,693,517
負 債		
金融先物に係る未実現損失(注1)	(4,055,259.01)	(430,871)
先渡為替契約に係る未実現損失(注1)	(53,323,557.22)	(5,665,628)
当座借越	(3,084,106.91)	(327,686)
当座借越に係る未払利息	(7,697.51)	(818)
投資有価証券購入未払金(注1)	(94,747,686.75)	(10,066,942)
買戻未払金	(15,092,679.20)	(1,603,597)
報酬引当金(注2)	(4,262,730.31)	(452,915)
年次税引当金(注3)	(57,099.32)	(6,067)
その他の手数料および報酬に係る引当金(注2)	(177,461.59)	(18,855)
引当金合計	(4,497,291.22)	(477,837)
負債合計	(174,808,277.82)	(18,573,380)
期末現在純資産	7,088,189,524.66	753,120,137

* 2021年1月31日現在、UBSヨーロッパSEに対する2,745,298.17米ドル、シティバンクに対する630,000.00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

2021年1月31日現在

	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	5,207,383,612.48	553,284,509
投資有価証券、未実現評価(損)益	331,402,347.25	35,211,499
投資有価証券合計(注1)	5,538,785,959.73	588,496,008
現金預金、要求払預金および預託金勘定	83,383,165.92	8,859,461
その他の流動資産(委託証拠金)	2,056,310.87	218,483
投資有価証券売却未収金(注1)	2,920,875.72	310,343
発行未収金	3,549,263.99	377,109
有価証券に係る未収利息	42,440,635.56	4,509,318
金融先物に係る未実現利益(注1)	1,333,210.95	141,654
資産合計	5,674,469,422.74	602,912,376
負 債		
先渡為替契約に係る未実現損失(注1)	(37,970,929.11)	(4,034,411)
当座借越	(58,074.37)	(6,170)
投資有価証券購入未払金(注1)	(42,247,504.19)	(4,488,797)
当座借越に係る未払利息	(3,776.70)	(401)
買戻未払金	(5,353,494.99)	(568,809)
報酬引当金(注2)	(2,604,610.77)	(276,740)
年次税引当金(注3)	(44,998.48)	(4,781)
その他の手数料および報酬に係る引当金(注2)	(169,979.99)	(18,060)
引当金合計	(2,819,589.24)	(299,581)
負債合計	(88,453,368.60)	(9,398,170)
期末現在純資産	5,586,016,054.14	593,514,206

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

2021年1月31日現在

	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	3,649,509,831.78	387,760,420
投資有価証券、未実現評価(損)益	237,720,944.40	25,257,850
投資有価証券合計(注1)	3,887,230,776.18	413,018,270
現金預金、要求払預金および預託金勘定	104,984,502.00 *	11,154,603
その他の流動資産(委託証拠金)	983,668.17	104,515
投資有価証券売却未収金(注1)	9,953,387.74	1,057,547
発行未収金	21,210,521.00	2,253,618
有価証券に係る未収利息	54,905,852.17	5,833,747
未収配当金	3,998.26	425
資産合計	4,079,272,705.52	433,422,725
負 債		
金融先物に係る未実現損失(注1)	(131,859.84)	(14,010)
先渡為替契約に係る未実現損失(注1)	(30,694,999.37)	(3,261,344)
スワップに係る未実現損失(注1)	(243,937.70)	(25,918)
当座借越	(4,946,682.93)	(525,585)
当座借越に係る未払利息	(296.98)	(32)
投資有価証券購入未払金(注1)	(39,415,389.12)	(4,187,885)
買戻未払金	(22,615,786.89)	(2,402,927)
報酬引当金(注2)	(2,251,421.55)	(239,214)
年次税引当金(注3)	(32,050.68)	(3,405)
その他の手数料および報酬に係る引当金(注2)	(236,437.76)	(25,122)
引当金合計	(2,519,909.99)	(267,740)
負債合計	(100,568,862.82)	(10,685,442)
期末現在純資産	3,978,703,842.70	422,737,283

* 2021年1月31日現在、パークレイズに対する270,000.00米ドル、ソシエテ・ジェネラルに対する6,660,000.00米ドルおよびビー・エヌ・ピー・パリバ・ロンドンに対する180,004.70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2020年8月1日 至2021年1月31日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	2,145.59	228
有価証券に係る利息	147,446,406.78	15,666,181
スワップに係る受取利息(注1)	1,584,844.67	168,390
その他の収益(注4)	7,360,246.63	782,026
収益合計	<u>156,393,643.67</u>	<u>16,616,825</u>
費 用		
スワップに係る支払利息(注1)	(920,784.97)	(97,833)
定率報酬(注2)	(25,982,755.97)	(2,760,668)
年次税(注3)	(351,256.08)	(37,321)
当座借越に係る利息	(119,654.27)	(12,713)
その他の手数料および報酬(注2)	(226,040.20)	(24,017)
費用合計	<u>(27,600,491.49)</u>	<u>(2,932,552)</u>
投資純(損)益	<u>128,793,152.18</u>	<u>13,684,272</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	57,341,602.63	6,092,545
オプションに係る実現(損)益	79,400.00	8,436
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	5,399,517.13	573,699
金融先物に係る実現(損)益	(3,939,342.11)	(418,555)
先渡為替契約に係る実現(損)益	249,941,790.21	26,556,315
スワップに係る実現(損)益	(6,193,017.01)	(658,008)
外国為替に係る実現(損)益	2,391,431.53	254,090
実現(損)益合計	<u>305,021,382.38</u>	<u>32,408,522</u>
当期実現純(損)益	<u>433,814,534.56</u>	<u>46,092,794</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	158,197,540.28	16,808,489
オプションに係る未実現評価(損)益	99,488.20	10,571
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	5,479,360.28	582,182
金融先物に係る未実現評価(損)益	(6,897,653.47)	(732,876)
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	(171,283,767.14)	(18,198,900)
スワップに係る未実現評価(損)益	514,150.50	54,628
未実現評価(損)益の変動合計	<u>(13,890,881.35)</u>	<u>(1,475,906)</u>
運用の結果による純資産の純増(減)	<u>419,923,653.21</u>	<u>44,616,888</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2020年8月1日 至2021年1月31日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
有価証券に係る利息	86,855,932.51	9,228,443
その他の収益(注4)	371,814.65	39,505
収益合計	87,227,747.16	9,267,948
費 用		
定率報酬(注2)	(14,743,415.87)	(1,566,488)
年次税(注3)	(273,127.26)	(29,020)
当座借越に係る利息	(35,819.17)	(3,806)
その他の手数料および報酬(注2)	(111,331.99)	(11,829)
費用合計	(15,163,694.29)	(1,611,143)
投資純(損)益	72,064,052.87	7,656,806
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	75,564,509.83	8,028,729
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	113,898.30	12,102
金融先物に係る実現(損)益	668,284.74	71,005
先渡為替契約に係る実現(損)益	232,273,874.60	24,679,099
外国為替に係る実現(損)益	(986,824.45)	(104,850)
実現(損)益合計	307,633,743.02	32,686,085
当期実現純(損)益	379,697,795.89	40,342,891
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	(58,024,380.82)	(6,165,090)
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	(27,160.12)	(2,886)
金融先物に係る未実現評価(損)益	2,072,825.36	220,238
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	(168,050,237.63)	(17,855,338)
未実現評価(損)益の変動合計	(224,028,953.21)	(23,803,076)
運用の結果による純資産の純増(減)	155,668,842.68	16,539,815

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2020年8月1日 至2021年1月31日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	6,957.81	739
有価証券に係る利息	100,092,196.81	10,634,796
スワップに係る受取利息(注1)	14,344.79	1,524
分配金	46,623.76	4,954
その他の収益(注4)	854,739.56	90,816
収益合計	101,014,862.73	10,732,829
費 用		
スワップに係る支払利息(注1)	(11,761.21)	(1,250)
定率報酬(注2)	(13,049,401.72)	(1,386,499)
年次税(注3)	(190,941.99)	(20,288)
当座借越に係る利息	(114,298.14)	(12,144)
その他の手数料および報酬(注2)	(115,553.34)	(12,278)
費用合計	(13,481,956.40)	(1,432,458)
投資純(損)益	87,532,906.33	9,300,371
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	66,686,031.02	7,085,391
金融先物に係る実現(損)益	(1,010,381.21)	(107,353)
先渡為替契約に係る実現(損)益	89,549,885.28	9,514,675
スワップに係る実現(損)益	(485,208.85)	(51,553)
外国為替に係る実現(損)益	2,307,802.96	245,204
実現(損)益合計	157,048,129.20	16,686,364
当期実現純(損)益	244,581,035.53	25,986,735
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	132,952,441.13	14,126,197
金融先物に係る未実現評価(損)益	(242,135.10)	(25,727)
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	(77,358,947.51)	(8,219,388)
スワップに係る未実現評価(損)益	389,392.68	41,373
未実現評価(損)益の変動合計	55,740,751.20	5,922,455
運用の結果による純資産の純増(減)	300,321,786.73	31,909,190

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2020年8月1日 至2021年1月31日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	6,297,057,630.99	669,062,373
発行額	1,204,633,949.62	127,992,357
買戻額	(817,787,259.82)	(86,889,896)
純発行(買戻)合計	386,846,689.80	41,102,461
支払分配金	(15,638,449.34)	(1,661,585)
投資純(損)益	128,793,152.18	13,684,272
実現(損)益合計	305,021,382.38	32,408,522
未実現評価(損)益の変動合計	(13,890,881.35)	(1,475,906)
運用の結果による純資産の純増(減)	419,923,653.21	44,616,888
期末現在純資産	7,088,189,524.66	753,120,137

発行済投資証券数の変動表

	自2020年8月1日 至2021年1月31日	
	(口)	
クラスF - a c c		
期首現在発行済投資証券数	16,214,122.0160	
期中発行投資証券数	3,253,593.0200	
期中買戻投資証券数	(1,649,939.7460)	
期末現在発行済投資証券数	<u>17,817,775.2900</u>	
クラスF - a c c円ヘッジ		
期首現在発行済投資証券数	140,170.0000	
期中発行投資証券数	1,380.0000	
期中買戻投資証券数	(14,120.8820)	
期末現在発行済投資証券数	<u>127,429.1180</u>	

最重要数値

日付	ISIN	2021年1月31日	2020年7月31日	2019年7月31日
純資産額(米ドル)		7,088,189,524.66	6,297,057,630.99	6,089,637,256.08
クラスF - a c c	LU0985399996			
発行済投資証券数(口)		12,817,775.2900	16,214,122.0160	14,193,122.2020
1口当たり純資産価格(米ドル)		144.28	137.43	134.28
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) ¹		144.28	137.43	134.28
クラスF - a c c円ヘッジ	LU1749433899			
発行済投資証券数(口)		127,429.1180	140,170.0000	77,455.0000
1口当たり純資産価格(日本円)		10,883	10,398	10,399
1口当たり発行・買戻価格(日本円) ¹		10,883	10,398	10,399

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 - エマージング・マーケット・デッド

組入証券の構造

地域別分類	純資産割合%	地域別分類	純資産割合%
メキシコ	7.02	バミューダ	0.19
ケイマン諸島	5.08	レバノン	0.18
トルコ	4.90	ウズベキスタン	0.17
オランダ	4.64	トーゴ	0.16
コロンビア	3.67	ベネズエラ	0.16
インドネシア	3.20	ベナン共和国	0.15
ドミニカ共和国	3.06	ヨルダン	0.15
アラブ首長国連邦	2.74	ノルウェー	0.13
ブラジル	2.72	セントルシア	0.12
中国	2.42	ホンジュラス	0.10
サウジアラビア	2.26	エチオピア	0.09
香港	2.06	ジョージア	0.09
エジプト	1.92	マケドニア	0.09
ウクライナ	1.85	タジキスタン	0.08
アルゼンチン	1.84	ポーランド	0.07
ペルー	1.73	クウェート	0.06
ルクセンブルグ	1.72	ベトナム	0.06
パナマ	1.68	ガボン	0.06
パラグアイ	1.64	マーシャル諸島	0.06
チリ	1.61	ブルンジ	0.04
英国領バージン諸島	1.53	アルバニア	0.04
オマーン	1.49	国際機関	0.04
ルーマニア	1.47	多国籍企業	0.04
インド	1.46	パプアニューギニア	0.03
ナイジェリア	1.43	カンボジア	0.02
ロシア連邦 (CIS)	1.33	ベリーズ	0.02
カザフスタン	1.32	合計	96.37
マレーシア	1.21		
カタール	1.11	業種別分類	純資産割合%
アメリカ合衆国	1.09	国債および中央政府債	39.74
南アフリカ	1.04	金融および持株会社	15.81
アゼルバイジャン	1.03	石油	9.21
モーリシャス	0.99	銀行および金融機関	8.48
フィリピン	0.97	エネルギー・水道	4.08
アンゴラ	0.97	交通・運輸	2.26
エクアドル	0.94	通信	2.03
シンガポール	0.92	不動産	1.76
バーレーン	0.91	鉱業・石炭・鋼鉄	1.30
アイルランド	0.80	モーゲージおよび貸付機関	1.21
グアテマラ	0.79	化学	1.16
コートジボワール	0.78	食品・清涼飲料	1.00
スリランカ	0.78	宿泊・仕出し・レジャー	0.88
ガーナ	0.75	建築業・資材	0.80
ウルグアイ	0.70	貴金属および宝石	0.70
エルサルバドル	0.68	インターネット、ソフトウェア・ITサービス	0.64
モロッコ	0.62	非鉄金属	0.53
カナダ	0.52	医薬品・化粧品・医療品	0.52
イギリス	0.52	各種サービス	0.50
マン島	0.47	国際機関	0.50
イスラエル	0.45	非分類会社	0.43
スペイン	0.44	電気装置・部品	0.31
ケニア	0.44	州、連邦州	0.30
セルビア	0.42	機械工学・産業機器	0.27
モンゴル	0.41	投資信託	0.25
オーストリア	0.39	林業・紙・パルプ製品	0.23
コスタリカ	0.38	農業・漁業	0.20
マカオ	0.38	保険	0.19
ベラルーシ	0.38	グラフィックデザイン・出版・メディア	0.19
クロアチア	0.37	たばこ・アルコール	0.18
韓国	0.37	市および地方自治体	0.15
ジャマイカ	0.35	航空宇宙産業	0.14
ジャージー	0.34	各種貿易会社	0.13
タイ	0.30	小売り・百貨店	0.07
パキスタン	0.30	その他消費財	0.06
トリニダード・トバゴ共和国	0.29	自動車	0.05
チュニジア	0.29	電子工学・半導体	0.05
ハンガリー	0.25	ヘルスケア、社会事業	0.03
パハマ	0.22	繊維・衣服・革製品	0.01
セネガル	0.22	コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置	0.01
イラク	0.21	公的、非営利機関	0.01
アルメニア	0.20	合計	96.37
ザンビア	0.19		

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット
純資産変動計算書

自2020年8月1日 至2021年1月31日

	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	6,198,677,594.06	658,609,494
発行額	371,422,646.31	39,463,656
買戻額	(1,130,249,724.14)	(120,089,033)
純発行(買戻)合計	(758,827,077.83)	(80,625,377)
支払分配金	(9,503,304.77)	(1,009,726)
投資純(損)益	72,064,052.87	7,656,806
実現(損)益合計	307,633,743.02	32,686,085
未実現評価(損)益の変動合計	(224,028,953.21)	(23,803,076)
運用の結果による純資産の純増(減)	155,668,842.68	16,539,815
期末現在純資産	5,586,016,054.14	593,514,206

発行済投資証券数の変動表

自2020年8月1日 至2021年1月31日

	(口)
クラスF - a c c	
期首現在発行済投資証券数	14,063,084.4420
期中発行投資証券数	1,006,020.5520
期中買戻投資証券数	(1,807,993.7840)
期末現在発行済投資証券数	13,261,111.2100
クラスF - a c c円ヘッジ	
期首現在発行済投資証券数	329,750.0000
期中発行投資証券数	7,725.0000
期中買戻投資証券数	(28,040.0000)
期末現在発行済投資証券数	309,435.0000

最重要数値

日付	ISIN	2021年1月31日	2020年7月31日	2019年7月31日
純資産額(米ドル)		5,586,016,054.14	6,198,677,594.06	5,219,858,520.58
クラスF - a c c	LU0313364738			
発行済投資証券数(口)		13,261,111.2100	14,063,084.4420	14,765,747.6220
1口当たり純資産価格(米ドル)		165.92	163.20	150.44
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) ¹		165.92	163.20	150.44
クラスF - a c c円ヘッジ	LU1749433972			
発行済投資証券数(口)		309,435.0000	329,750.0000	278,717.0000
1口当たり純資産価格(日本円)		10,934	10,788	10,183
1口当たり発行・買戻価格(日本円) ¹		10,934	10,788	10,183

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	80.05	銀行および金融機関	22.60
イギリス	4.65	金融および持株会社	20.18
日本	2.16	エネルギー・水道	6.04
カナダ	1.94	医薬品・化粧品・医療品	5.13
オランダ	1.40	不動産	3.80
フランス	1.17	石油	3.46
ケイマン諸島	1.02	国債および中央政府債	3.46
アイルランド	0.85	通信	3.43
オーストラリア	0.73	保険	3.08
中国	0.61	小売り・百貨店	2.42
ルクセンブルグ	0.53	ヘルスケア、社会事業	2.33
スイス	0.53	交通・運輸	2.00
メキシコ	0.43	コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置	1.92
スペイン	0.41	インターネット、ソフトウェア・ITサービス	1.88
バミューダ	0.38	グラフィックデザイン・出版・メディア	1.70
ガーンジー	0.23	宿泊・仕出し・レジャー	1.32
イタリア	0.21	自動車	1.28
ニュージーランド	0.21	食品・清涼飲料	1.17
チリ	0.17	電気装置・部品	1.04
ノルウェー	0.16	モーゲージおよび貸付機関	0.95
デンマーク	0.13	たばこ・アルコール	0.93
ペルー	0.12	電子工学・半導体	0.93
英国領バージン諸島	0.11	各種サービス	0.78
アラブ首長国連邦	0.11	公的、非営利機関	0.76
韓国	0.10	バイオテクノロジー	0.72
カタール	0.09	航空宇宙産業	0.59
ブラジル	0.08	化学	0.55
パナマ	0.08	建築業・資材	0.46
フィンランド	0.08	その他消費財	0.42
キュラソー	0.07	環境サービスおよびリサイクル	0.40
サウジアラビア	0.06	鉱業・石炭・鋼鉄	0.39
オーストリア	0.06	各種貿易会社	0.38
スウェーデン	0.05	投資信託	0.34
マカオ	0.04	林業、紙・パルプ製品	0.32
インド	0.04	機械工学・産業機器	0.31
ジャージー	0.04	包装業	0.31
マレーシア	0.02	農業・漁業	0.30
コロンビア	0.02	繊維・衣服・革製品	0.30
カザフスタン	0.01	貴金属および宝石	0.24
合計	99.15	非分類会社	0.24
		市および地方自治体	0.13
		州、連邦州	0.11
		各種資本財	0.05
		合計	99.15

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2020年8月1日 至2021年1月31日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	4,411,256,071.12	468,695,958
発行額	213,569,087.92	22,691,716
買戻額	(937,700,403.73)	(99,630,668)
純発行(買戻)合計	(724,131,315.81)	(76,938,952)
支払分配金	(8,742,699.34)	(928,912)
投資純(損)益	87,532,906.33	9,300,371
実現(損)益合計	157,048,129.20	16,686,364
未実現評価(損)益の変動合計	55,740,751.20	5,922,455
運用の結果による純資産の純増(減)	300,321,786.73	31,909,190
期末現在純資産	3,978,703,842.70	422,737,283

発行済投資証券数の変動表

	自2020年8月1日 至2021年1月31日	
	(口)	
クラスF - a c c		
期首現在発行済投資証券数	12,116,942.6060	
期中発行投資証券数	664,008.8980	
期中買戻投資証券数	(2,237,029.9740)	
期末現在発行済投資証券数	10,543,921.5300	
クラスF - a c c円ヘッジ		
期首現在発行済投資証券数	107,946.0000	
期中発行投資証券数	1,130.0000	
期中買戻投資証券数	(11,090.0000)	
期末現在発行済投資証券数	97,986.0000	

最重要数値

日付	ISIN	2021年1月31日	2020年7月31日	2019年7月31日
純資産額(米ドル)		3,978,703,842.70	4,411,256,071.12	4,507,826,074.78
クラスF - a c c	LU1344275315			
発行済投資証券数(口)		10,543,921.5300	12,116,942.6060	11,444,078.7390
1口当たり純資産価格(米ドル)		139.45	131.06	126.70
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) ¹		139.45	131.06	126.70
クラスF - a c c円ヘッジ	LU1749434194			
発行済投資証券数(口)		97,986.0000	107,946.0000	77,644.0000
1口当たり純資産価格(日本円)		10,962	10,333	10,229
1口当たり発行・買戻価格(日本円) ¹		10,962	10,333	10,229

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	55.25	金融および持株会社	32.61
オランダ	7.46	通信	7.90
フランス	6.84	石油	5.56
ドイツ	5.09	銀行および金融機関	4.54
イギリス	4.13	インターネット、ソフトウェア・ITサービス	3.69
ルクセンブルグ	3.42	ヘルスケア、社会事業	3.37
イタリア	3.24	宿泊・仕出し・レジャー	3.08
カナダ	2.92	自動車	2.80
スウェーデン	1.57	各種サービス	2.54
スペイン	1.36	エネルギー・水道	2.47
アイルランド	1.06	食品・清涼飲料	2.38
ケイマン諸島	0.59	交通・運輸	2.37
オーストラリア	0.55	不動産	2.34
日本	0.52	建築業・資材	2.13
デンマーク	0.48	医薬品・化粧品・医療品	2.05
メキシコ	0.39	化学	2.01
フィンランド	0.37	鉱業・石炭・鋼鉄	1.65
オーストリア	0.32	包装業	1.65
ベルギー	0.29	小売り・百貨店	1.45
ジャージー	0.24	機械工学・産業機器	1.26
スイス	0.24	電気装置・部品	1.14
ノルウェー	0.14	その他消費財	1.14
パナマ	0.13	電子工学・半導体	0.99
バミューダ	0.12	グラフィックデザイン・出版・メディア	0.97
ルーマニア	0.11	航空宇宙産業	0.87
リベリア	0.11	コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置	0.86
アラブ首長国連邦	0.10	林業、紙・パルプ製品	0.59
チェコ共和国	0.10	保険	0.67
マン島	0.10	繊維・衣服・革製品	0.46
ハンガリー	0.09	環境サービスおよびリサイクル	0.38
多国籍企業	0.08	バイオテクノロジー	0.34
スロベニア	0.08	非鉄金属	0.30
ポルトガル	0.08	農業・漁業	0.28
英国領バージン諸島	0.05	貴金属および宝石	0.24
シンガポール	0.03	たばこ・アルコール	0.16
ジャマイカ	0.01	モーゲージおよび貸付機関	0.15
ガーンジー	0.01	非分類会社	0.12
マカオ	0.01	各種貿易会社	0.10
マルタ共和国	0.01	各種資本財	0.07
香港	0.01	ゴム・タイヤ	0.02
合計	97.70	合計	97.70

マルチ・マネージャー・アクセス

財務書類に対する注記

2021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。

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、U B S 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。

報酬および手数料ならびに投資先の投資対象の売買スプレッドにより、サブ・ファンドの資産および投資対象の売買に係る実際の費用が入手可能な最新の価格または該当する場合は投資証券1口当たり純資産価格を計算するために用いられる純資産価額とは異なることがある。当該費用は、サブ・ファンドの価値にマイナスの影響を及ぼすものであり「希薄化」と称される。希薄化による影響を軽減するために、取締役会はその裁量により、投資証券1口当たり純資産価格に対して希薄化調整を行うことができる(「スウィング・プライシング」)。

投資証券は通常、単一の価格である投資証券1口当たり純資産価格に基づいて発行され、買い戻される。しかしながら、希薄化による影響を軽減するために、投資証券1口当たり純資産価格は、以下に記載するとおり評価日に調整される。これは、サブ・ファンドが関連する評価日において正味申込ポジションにあるかまたは正味買戻ポジションにあるかに関係なく行われる。ある評価日において、いずれかのサブ・ファンドまたはサブ・ファンドのクラスにおいて取引が行われない場合、未調整の投資証券1口当たり純資産価格が適用される。かかる希薄化調整が行われる状況に関しては取締役会が裁量権を有している。一般的なルールとして、希薄化調整を実行するための要件は関連するサブ・ファンドにおける投資証券の申込みまたは買戻しの規模に基づいている。取締役会は、その意見により、既存の受益者(申込みの場合)または残存する受益者(買戻しの場合)が損害を被る可能性があるかと判断する場合

に希薄化調整を行うことができる。特に、希薄化調整は以下の場合に行われることがあるが、これらに限定されない。

- (a) サブ・ファンドが継続的に下落している場合(すなわち買戻しによる純流出)。
- (b) サブ・ファンドがその規模に比べて大量の正味申込みを受けている場合。
- (c) サブ・ファンドの特定の評価日におけるポジションが正味申込みまたは正味買戻しになっている場合。または、
- (d) 投資主の利益のために希薄化調整が必要であると取締役会が判断するその他のあらゆる場合。

評価額の調整においては、報酬および手数料ならびに売買価格のスプレッドに十分に見合う適切な数値であると取締役会が判断する金額が、サブ・ファンドが正味申込ポジションにある場合は投資証券1口当たり純資産価格に加算され、正味買戻ポジションにある場合は投資証券1口当たり純資産価格から控除される。特に、関連するサブ・ファンドの投資証券1口当たり純資産価格は、()見積み財務費用、()サブ・ファンドが負担する可能性がある取引費用および()サブ・ファンドが投資する資産の想定売買スプレッドを反映する金額分だけ(上方または下方に)調整される。一部の株式市場および法域ではバイサイドおよびセルサイドが異なる手数料体系を有することがあるため、最終的な調整額が純流入と純流出とで異なることがある。ただし、調整は基本的に、当該時に適用される投資証券1口当たり純資産価格の最大2%を上限とする。例外的な状況(例えば、市場のボラティリティの上昇および/または流動性の低下、例外的な市況、市場の混乱等)においては、これが実勢市場の状況を示すものであり、投資主の最大の利益であることを取締役会が正当化できるのであれば、取締役会は各サブ・ファンドおよび/または各評価日に関連する該当ある1口当たり純資産価格の2%を超える希薄化調整を一時的に適用することを決定することができる。このような希薄化調整は取締役会が定める手順に従い算出されるものとする。投資者は一時的な手続きが導入される度に、かつ一時的な手続きが終了した直後に、通常の手続きを通じて通知を受けるものとする。

サブ・ファンドの各投資証券クラスの純資産価額は個別に計算されるが、希薄化調整はパーセンテージで見ると各クラスの純資産価額に対して同一の影響を及ぼすことになる。希薄化調整はサブ・ファンドの水準において元本に対して適用されるもので、各個人投資家の取引における特定の状況に関連するものではない。

すべてのサブ・ファンドについて、スウィング・プライシング方法が適用されている。

会計期間末時点で純資産額へのスウィング・プライシング調整があった場合は、サブ・ファンドの最重要数値の純資産額の情報から見る事ができる。受益証券1口当たり発行および買戻価格が、調整後の純資産額を表している。

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)益のカテゴリーに基づき、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) 結合財務書類

結合財務書類は、ユーロで表示される。本投資法人の2021年1月31日現在の結合純資産計算書、結合運用計算書および結合純資産変動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、2021年1月31日現在の結合財務書類の換算に用いられた。

$$\begin{array}{l} \text{為替レート} \\ \hline 1 \text{ユーロ} = 1.214900 \text{米ドル} \end{array}$$

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」のポジションには、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」のポジションには、外貨取引による未払金が含まれる。

外国為替取引からの未収金および未払金は相殺される。

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・スワップに係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)
	Fクラス
- エマージング・マーケット・デッド	0.76%
- ハイ・イールド	0.67%
- US マルチ・クレジット	0.48%

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 - ソフト・コミッション・アレンジメント

2020年8月1日から2021年1月31日までの会計期間中、いかなる「ソフト・コミッション・アレンジメント」もマルチ・マネージャー・アクセス に代わって締結されておらず、「ソフト・コミッション・アレンジメント」の金額もなかった。

注7 - 金融先物およびスワップ契約

2021年1月31日現在、サブ・ファンドごとの金融先物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)	債券に係る金融先物 (売却)
- エマージング・マーケット・デッド	557,236,780.97 米ドル	404,597,658.08 米ドル
- ハイ・イールド	99,586,172.48 米ドル	128,670,767.18 米ドル
- US マルチ・クレジット	315,843,156.01 米ドル	182,460,554.34 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)	通貨に係る金融先物 (売却)
-----------------	-------------------	-------------------

該当なし。

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) 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)	クレジット・デフォルト・ スワップ (売却)
- エマージング・マーケット・デッド	153,626,299.03 米ドル	74,945,163.40 米ドル
- ハイ・イールド	- 米ドル	2,612,035.00 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)	指数に係るスワップおよび フォワード・スワップ (売却)
- ハイ・イールド	13,127,218.83 米ドル	- 米ドル

注8 - 総費用比率 (TER)

この比率は、スイス資産運用協会 (AMAS) / 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	0.75%
- エマージング・マーケット・デッド F - a c c 円ヘッジ	0.78%
- ハイ・イールド F - a c c	0.64%
- ハイ・イールド F - a c c 円ヘッジ	0.67%
- US マルチ・クレジット F - a c c	0.51%
- US マルチ・クレジット F - a c c 円ヘッジ	0.53%

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、利息費用、証券貸付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9 - 制御不能な事象

2020年3月、世界保健機関は新型コロナウイルス感染症(COVID-19)の発生をパンデミックと宣言した。ワクチンの継続的な開発を含め、このパンデミックの管理については2020年末に向けて進展が見られたものの、このパンデミックが世界的にも地域的にもどの程度の期間、どの程度の深刻さで経済に影響を与えるかは依然として不透明である。このことは、ファンドの資産価格のボラティリティーおよび本報告書で取り上げられる資産の評価に関連し、継続的な不確実性を引き起こしている。

取締役会と投資運用会社は、各国政府によるパンデミックの管理、ひいてはポートフォリオとファンド自体への経済的影響について、引き続き注視する。ファンドの財務諸表を作成する際に取締役会が行った継続企業の前提が不適切であるという証拠はない。

注10 - 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

2021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			
ノート、固定利付債			
EUR			
EUR ALBANIA, REPUBLIC OF-REG-S 3.5000% 20-16.06.27	2 010 000.00	2 615 937.86	0.04
EUR ARGENTINA, REPUBLIC OF 0.1250% 20-09.07.30	1 008 800.00	443 051.19	0.01
EUR ARGENTINA, REPUBLIC OF 0.5000% 20-09.07.29	34 392.00	16 010.67	0.00
EUR BANQUE OUEST AFRICAINE DE DEV-REG-S 2.7500% 21-22.01.33	3 144 000.00	3 917 046.56	0.06
EUR BENIN GOVT INTERNATIONAL BD-REG-S 4.8750% 21-19.01.32	5 320 000.00	6 404 064.46	0.09
EUR CENTRAL BANK OF TUNISIA-REG-S 6.7500% 18-31.10.23	1 120 000.00	1 282 023.23	0.02
EUR CENTRAL BANK OF TUNISIA-REG-S 6.3750% 19-15.07.26	4 041 000.00	4 478 303.27	0.06
EUR CREDIT BK MOSCOW/CBOM FINANCE-REG-S 3.1000% 21-21.01.26	800 000.00	964 326.88	0.01
EUR CROATIA, REPUBLIC OF-REG-S 1.1250% 19-19.06.29	1 160 000.00	1 473 142.19	0.02
EUR GOVERNMENT OF BENIN-REG-S 6.8750% 21-19.01.52	3 286 000.00	4 191 769.47	0.06
EUR HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 1.7500% 20-05.06.35	709 000.00	947 500.51	0.01
EUR HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 1.5000% 20-17.11.50	847 000.00	1 027 734.03	0.01
EUR INDONESIA GOVERNMENT INTERNATIONAL 1.1000% 21-12.03.33	2 204 000.00	2 685 672.52	0.04
EUR INDONESIA, REPUBLIC OF 1.4000% 19-30.10.31	1 490 000.00	1 882 609.04	0.03
EUR INDONESIA, REPUBLIC OF 0.9000% 20-14.02.27	3 899 000.00	4 788 704.88	0.07
EUR IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 5.8750% 19-17.10.31	7 225 000.00	9 611 529.48	0.14
EUR IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 4.8750% 20-30.01.32	9 137 000.00	11 378 054.84	0.16
EUR MACEDONIA GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.6250% 16-26.07.23	3 180 000.00	4 298 012.48	0.06
EUR MACEDONIA GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 3.6750% 20-03.06.26	1 310 000.00	1 774 543.69	0.02
EUR MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.4500% 21-25.10.33	3 830 000.00	4 507 658.65	0.06
EUR MEXICO, UNITED STATES OF 1.3500% 20-18.09.27	2 980 000.00	3 738 743.89	0.05
EUR MOROCCO GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 2.0000% 20-30.09.30	3 420 000.00	4 252 339.83	0.06
EUR MOROCCO GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 1.3750% 20-30.03.26	2 240 000.00	2 762 196.64	0.04
EUR MOROCCO, KINGDOM OF-REG-S 1.5000% 19-27.11.31	3 480 000.00	4 165 755.42	0.06
EUR NE PROPERTY BV-REG-S 3.3750% 20-14.07.27	2 800 000.00	3 724 883.40	0.05
EUR PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 1.8750% 19-05.11.31	2 813 000.00	3 404 698.03	0.05
EUR PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 0.7000% 20-03.02.29	1 610 000.00	1 965 157.69	0.03
EUR ROMANIA-REG-S 2.6250% 20-02.12.40	12 629 000.00	15 956 690.98	0.22
EUR SERBIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 1.5000% 19-26.06.29	14 795 000.00	18 356 402.47	0.26
EUR SERBIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 3.1250% 20-15.05.27	4 224 000.00	5 728 302.10	0.08
EUR UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 4.3750% 20-27.01.30	270 000.00	311 621.85	0.00
EUR UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 6.7500% 19-20.06.26	6 230 000.00	8 278 404.53	0.12
ユーロ合計		141 332 892.73	1.99
USD			
USD 1MDB ENERGY LTD-REG-S 5.9900% 12-11.05.22	36 400 000.00	38 038 000.00	0.54
USD ABENGOA TRANSMISSION SUR SA-REG-S 6.8750% 14-30.04.43	3 165 000.00	4 089 921.50	0.06
USD ABJA INVESTMENT CO PTE LTD-REG-S 5.4500% 18-24.01.28	800 000.00	834 664.00	0.01
USD ABU DHABI CRUDE OIL PIPELINE LLC-REG-S 3.6500% 17-02.11.29	6 379 000.00	7 309 935.32	0.10
USD ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO PJSC-REG-S 4.8750% 18-23.04.30	2 266 000.00	2 801 795.70	0.04
USD ABU DHABI, GOVERNMENT OF-REG-S 4.1250% 17-11.10.47	3 550 000.00	4 367 609.38	0.06
USD ABU DHABI, GOVERNMENT OF-REG-S 2.5000% 17-11.10.22	1 998 000.00	2 063 309.63	0.03
USD ADANI ELECTRICITY MUMBAI LTD-REG-S 3.9490% 20-12.02.30	2 727 000.00	2 859 089.06	0.04
USD ADANI INTERNATIONAL CONTAINER TER-REG-S 3.0000% 20-16.02.31	2 340 000.00	2 318 378.40	0.03
USD ADANI PORTS & SPECIAL ECO ZONE-REG-S 4.2000% 20-04.08.27	7 405 000.00	8 029 796.87	0.11
USD ADANI PORTS & SPECIAL ECO ZONE-REG-S 3.1000% 21-02.02.31	1 008 000.00	1 000 236.69	0.01
USD ADANI PORTS AND SPECIAL ECO ZONE-REG-S 4.3750% 19-03.07.29	8 232 000.00	9 021 757.51	0.13
USD ADANI TRANSMISSION LTD-REG-S 4.0000% 16-03.08.26	1 880 000.00	2 035 695.58	0.03
USD ADANI TRANSMISSION LTD-REG-S 4.2500% 19-21.05.36	1 820 000.00	1 873 752.56	0.03
USD AEROPUERTO INTERNACIONAL DE TOCU-REG-S 5.3750% 16-11.05.36	2 450 000.00	2 828 218.75	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 - エマージング・マーケット・デッド

2021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 AEROPUERTO INTERNACIONAL DE TOCU-REG-S 6.00000% 18-18.11.48	5 722 000.00	6 815 402.07	0.10
USD AEROPUERTOS DOMINICANOS-REG-S 6.75000% 17-30.03.29	6 760 000.00	6 979 700.00	0.10
USD AES EL SALVADOR TRUST II-REG-S 6.75000% 13-28.03.23	4 504 000.00	4 298 505.00	0.06
USD AES PANAMA GENERATION HOLDING SRL-REG-S 4.37500% 20-31.05.30	23 535 000.00	25 211 868.75	0.36
USD AFRICA FINANCE CORP-REG-S 3.75000% 19-30.10.29	1 403 000.00	1 488 470.76	0.02
USD AI CANDELARIA SPAIN SLU-REG-S 7.50000% 18-15.12.28	22 380 000.00	25 747 966.20	0.36
USD AIA GROUP LTD-REG-S 3.60000% 19-09.04.29	1 250 000.00	1 398 165.95	0.02
USD AIA GROUP LTD-REG-S 3.37500% 20-07.04.30	250 000.00	279 119.18	0.00
USD AIA GROUP LTD-REG-S-SUB 3.20000% 20-16.09.40	248 000.00	258 673.96	0.00
USD AJECORP BV-REG-S 6.50000% 12-14.05.22	1 855 000.00	1 852 699.80	0.03
USD AKBANK TAS-REG-S 6.80000% 20-06.02.26	3 358 000.00	3 577 109.50	0.05
USD ALFA SAB DE CV-REG-S 5.25000% 14-25.03.24	400 000.00	433 750.00	0.01
USD ALIBABA GROUP HOLDING LTD 4.00000% 17-06.12.37	1 929 000.00	2 180 372.81	0.03
USD ALIBABA GROUP HOLDING LTD 4.20000% 17-06.12.47	400 000.00	469 000.00	0.01
USD AMERICA MOVIL SAB DE CV 3.62500% 19-22.04.29	2 743 000.00	3 070 445.63	0.04
USD ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT-144A 3.37500% 12-01.11.22	1 000 000.00	1 018 437.50	0.01
USD ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT-REG-S 3.37500% 12-01.11.22	10 125 000.00	10 318 007.81	0.15
USD ANGLOGOLD ASHANTI HOLDINGS PLC 3.75000% 20-01.10.30	1 417 000.00	1 516 190.00	0.02
USD ANGOLAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 9.37500% 18-08.05.48	13 199 000.00	13 038 137.19	0.18
USD ANTOFAGASTA PLC-REG-S 2.37500% 20-14.10.30	1 457 000.00	1 478 855.00	0.02
USD ARCOR SAIC-REG-S 6.00000% 16-06.07.23	4 901 000.00	4 558 322.08	0.06
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF STEP-UP 20-09.07.30	31 195 219.00	11 893 177.23	0.17
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF STEP-UP 20-09.07.35	73 577 215.00	25 177 203.26	0.36
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF STEP-UP 20-09.01.38	36 788 465.00	14 370 494.14	0.20
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF 1.00000% 20-09.07.29	5 758 167.00	2 377 043.31	0.03
USD ARMENIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 3.60000% 21-02.02.31	6 093 000.00	5 894 611.92	0.08
USD ARMENIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 3.95000% 19-26.09.29	5 483 000.00	5 544 683.75	0.08
USD AUNA SA-REG-S 6.50000% 20-20.11.25	2 650 000.00	2 777 531.25	0.04
USD AXTEL SAB DE CV-REG-S 6.37500% 17-14.11.24	10 007 000.00	10 438 551.87	0.15
USD B2W DIGITAL LUX SARL-REG-S 4.37500% 20-20.12.30	4 042 000.00	4 183 470.00	0.06
USD BAHAMAS GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 6.00000% 17-21.11.28	6 092 000.00	5 846 416.25	0.08
USD BAHAMAS, COMMONWEALTH OF THE-REG 5.75000% 14-16.01.24	5 283 000.00	5 245 028.44	0.07
USD BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 7.00000% 15-26.01.26	2 500 000.00	2 888 281.25	0.04
USD BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.75000% 17-20.09.29	4 067 000.00	4 577 916.88	0.06
USD BAIDU INC 3.07500% 20-07.04.25	1 390 000.00	1 480 469.13	0.02
USD BAIDU INC 3.62500% 17-06.07.27	1 620 000.00	1 784 531.25	0.03
USD BANCO BTG PACTUAL SA/CAYMAN-REG-S 4.50000% 19-10.01.25	911 000.00	953 634.80	0.01
USD BANCO BTG PACTUAL SA/CAY IS-REG-S 2.75000% 21-11.01.26	1 918 000.00	1 865 350.90	0.03
USD BANCO CONTINENTAL SAECA-REG-S 2.75000% 20-10.12.25	7 854 000.00	7 677 285.00	0.11
USD BANCO DE BOGOTA SA-REG-S-SUB 5.37500% 13-19.02.23	850 000.00	903 125.00	0.01
USD BANCO DE BOGOTA SA-REG-S-SUB 6.25000% 16-12.05.26	21 765 000.00	24 540 037.50	0.35
USD BANCO DE BOGOTA SA-REG-S 4.37500% 17-03.08.27	637 000.00	686 208.25	0.01
USD BANCO DE CREDITO E INVERSIONES-REG-S 3.50000% 17-12.10.27	2 620 000.00	2 899 193.75	0.04
USD BANCO DEL ESTADO DE CHILE-REG-S 3.87500% 12-08.02.22	580 000.00	599 756.25	0.01
USD BANCO DEL ESTADO DE CHILE-REG-S 2.70400% 20-09.01.25	524 000.00	553 147.50	0.01
USD BANCO DO BRASIL SA-REG-S-SUB 5.87500% 11-26.01.22	685 000.00	716 432.94	0.01
USD BANCO GENERAL SA-REG-S 4.12500% 17-07.08.27	3 145 000.00	3 517 485.93	0.05
USD BANCO INBURSA SA-REG-S 4.37500% 17-11.04.27	1 905 000.00	2 062 162.50	0.03
USD BANCO INTL PERU-REG-S 3.25000% 19-04.10.26	2 819 000.00	2 988 140.00	0.04
USD BANCO NACIONAL DE COM EXTER SNC-REG-S 4.37500% 15-14.10.25	850 000.00	941 109.38	0.01
USD BANCO NACIONAL DE PANAMA-144A 2.50000% 20-11.08.30	1 120 000.00	1 117 200.00	0.02
USD BANCO NACIONAL DE PANAMA-REG-S 2.50000% 20-11.08.30	4 042 000.00	4 031 895.00	0.06
USD BANCO SANTANDER CHILE-REG-S 2.70000% 20-10.01.25	1 123 000.00	1 184 371.95	0.02
USD BANCO SANTANDER SA-REG-S 5.37500% 20-17.04.25	9 368 000.00	10 714 650.00	0.15
USD BANCOCOLMBIA SA 3.00000% 20-29.01.25	710 000.00	731 300.00	0.01
USD BANISTMO SA-REG-S 3.65000% 17-19.09.22	1 363 000.00	1 406 871.56	0.02
USD BANQUE OUEST AFRICAINE DE DEV-REG-S 5.00000% 17-27.07.27	4 141 000.00	4 669 805.70	0.07
USD BANQUE OUEST AFRICAINE DE DEV-REG-S 4.70000% 19-22.10.31	2 469 000.00	2 696 444.28	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

2021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 BBVA BANCOMER SA/TEXAS-REG-S-SUB 6.50000% 11-10.03.21	1 650 000.00	1 654 125.00	0.02
USD BBVA BANCOMER SA/TEXAS-REG-S-SUB 6.75000% 12-30.09.22	750 000.00	809 062.50	0.01
USD BECLE SA DE CV-REG-S 3.75000% 15-13.05.25	5 607 000.00	6 097 612.50	0.09
USD BELARUS INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.87500% 17-28.02.23	7 320 000.00	7 580 775.00	0.11
USD BELARUS INTERNATIONAL BOND-REG-S 7.62500% 17-29.06.27	893 000.00	975 602.50	0.01
USD BELARUS, REPUBLIC OF-REG-S 5.87500% 20-24.02.26	885 000.00	905 797.50	0.01
USD BELARUS, REPUBLIC OF-REG-S 6.37800% 20-24.02.31	13 703 000.00	13 894 841.99	0.20
USD BERMUDA, GOVERNMENT OF-REG-S 3.71700% 16-25.01.27	2 307 000.00	2 563 653.75	0.04
USD BERMUDA, GOVERNMENT OF-REG-S 2.37500% 20-20.08.30	1 653 000.00	1 702 073.44	0.02
USD BHARTI AIRTEL LTD-REG-S 4.37500% 15-10.06.25	2 024 000.00	2 199 835.00	0.03
USD BOLIVIA, REPUBLIC OF-REG-S 4.50000% 17-20.03.28	200 000.00	181 375.00	0.00
USD BRASKEM AMERICA FINANCE CO-REG-S 7.12500% 11-22.07.41	600 000.00	676 500.00	0.01
USD BRASKEM IDESA SAPI-REG-S 7.45000% 19-15.11.29	2 268 000.00	2 189 470.50	0.03
USD BRASKEM NETHERLANDS FINANCE BV-REG-S 4.50000% 19-31.01.30	1 000 000.00	1 013 650.00	0.01
USD BRASKEM NETHERLANDS FINANCE BV-REG-S 5.87500% 19-31.01.50	745 000.00	754 126.25	0.01
USD BRAZIL LOAN TRUST 1-REG-S 5.47700% 13-24.07.23	2 920 000.00	1 151 461.53	0.02
USD BRAZIL, FEDERAL REPUBLIC OF 3.87500% 20-12.06.30	8 274 000.00	8 504 120.63	0.12
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 5.62500% 09-07.01.41	1 630 000.00	1 809 300.00	0.03
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 4.25000% 13-07.01.25	5 000 000.00	5 464 062.50	0.08
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 4.62500% 17-13.01.28	6 661 000.00	7 333 344.69	0.10
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 4.75000% 19-14.01.50	12 853 000.00	12 824 884.06	0.18
USD BRF SA-REG-S 4.87500% 19-24.01.30	8 194 000.00	8 670 726.92	0.12
USD BRF SA-REG-S 5.75000% 20-21.09.50	5 455 000.00	5 731 159.37	0.08
USD BRIGHT SCHOLAR EDU HOLD LTD-REG-S 7.45000% 19-31.07.22	350 000.00	363 125.00	0.01
USD BUKIT MAKMUR MANDIRI UTAMA-REG-S 7.75000% 21-10.02.26	440 000.00	432 300.00	0.01
USD CABLE ONDA SA-REG-S 4.50000% 19-30.01.30	10 430 000.00	11 264 400.00	0.16
USD CAR INC-REG-S 8.87500% 19-10.05.22	370 000.00	364 103.12	0.01
USD CBQ FINANCE LTD-REG-S 2.00000% 20-15.09.25	1 420 000.00	1 432 425.00	0.02
USD CEMEX SAB DE CV-REG-S 7.75000% 16-16.04.26	2 928 000.00	3 058 845.00	0.04
USD CEMEX SAB DE CV-REG-S 5.45000% 19-19.11.29	1 420 000.00	1 542 120.00	0.02
USD CEMEX SAB DE CV-REG-S 7.37500% 20-05.06.27	2 100 000.00	2 369 850.00	0.03
USD CEMEX SAV DE CV-REG-S 5.20000% 20-17.09.30	5 083 000.00	5 527 762.50	0.08
USD CEMEX SAV DE CV-REG-S 3.87500% 21-11.07.31	4 690 000.00	4 690 000.00	0.07
USD CEMIG GERACAO E TRANSMISSAO SA-REG-S 9.25000% 17-05.12.24	7 519 000.00	8 674 106.37	0.12
USD CENCOSUD SA-144A 6.62500% 15-12.02.45	400 000.00	524 000.00	0.01
USD CENCOSUD SA-REG-S 6.62500% 15-12.02.45	1 406 000.00	1 841 860.00	0.03
USD CENTRAL AMERICAN BOTTLING CORP-REG-S 5.75000% 17-31.01.27	10 410 000.00	11 002 068.74	0.16
USD CENTRAL CHINA REAL ESTATE-REG-S 7.65000% 20-27.08.23	1 165 000.00	1 170 825.00	0.02
USD CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD-REG-S 7.50000% 21-14.07.25	1 000 000.00	962 190.00	0.01
USD CERRO DEL AGUILA SA-REG-S 4.12500% 17-16.08.27	2 854 000.00	3 091 238.75	0.04
USD CHAMPION PATH HOLDINGS-REG-S 4.50000% 21-27.01.26	1 913 000.00	1 960 686.50	0.03
USD CHAMPION PATH HOLDINGS-REG-S 4.85000% 21-27.01.28	4 201 000.00	4 285 020.00	0.06
USD CHILE, REPUBLIC OF 3.24000% 18-06.02.28	553 000.00	621 260.94	0.01
USD CHILE, REPUBLIC OF 3.50000% 19-25.01.50	8 146 000.00	8 960 600.00	0.13
USD CHINA EVERGRANDE GROUP-REG-S 9.50000% 19-11.04.22	26 363 000.00	25 160 188.13	0.35
USD CHINA EVERGRANDE GROUP-REG-S 10.00000% 19-11.04.23	2 360 000.00	2 169 725.00	0.03
USD CHINA EVERGRANDE GROUP-REG-S 11.50000% 20-22.01.23	4 145 000.00	3 949 407.81	0.06
USD CHINA HONGQIAO GROUP LTD-REG-S 7.12500% 19-22.07.22	900 000.00	876 937.50	0.01
USD CIA GENERAL DE COMBUSTIBLES SA-REG-S 9.50000% 20-08.03.25	2 454 000.00	1 790 653.12	0.03
USD CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD-REG-S 6.00000% 20-16.07.25	3 475 000.00	3 700 875.00	0.05
USD CIKARANG LISTRINDO TBK PT-REG-S 4.95000% 16-14.09.26	2 080 000.00	2 153 450.00	0.03
USD CIMPOR FINANCIAL OPERATIONS BV-REG-S 5.75000% 14-17.07.24	1 550 000.00	1 331 062.50	0.02
USD COCA-COLA FEMSA SA 5.25000% 13-26.11.43	282 000.00	382 815.00	0.01
USD COCA-COLA ICECEK AS-REG-S 4.21500% 17-19.09.24	9 890 000.00	10 393 771.88	0.15
USD COLOMBIA TELECOMUNICACIONES SA-REG-S 4.95000% 20-17.07.30	4 852 000.00	5 221 965.00	0.07
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 3.87500% 17-25.04.27	13 658 000.00	14 993 923.14	0.21
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 4.50000% 18-15.03.29	8 164 000.00	9 294 203.76	0.13
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 5.20000% 19-15.05.49	2 629 000.00	3 140 833.44	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

2021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 COLOMBIA, REPUBLIC OF 3.0000% 20-30.01.30	5 086 000.00	5 235 401.25	0.07
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 3.1250% 20-15.04.31	34 266 000.00	35 326 104.38	0.50
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 4.1250% 20-15.05.51	18 915 000.00	19 777 996.88	0.28
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 3.8750% 21-15.02.61	9 340 000.00	9 199 900.00	0.13
USD COMETA ENERGIA SA DE CV-REG-S 6.3750% 18-24.04.35	4 884 000.00	5 344 898.92	0.08
USD COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD-REG-S 4.7500% 16-23.02.27	1 420 000.00	1 604 156.25	0.02
USD COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD-REG-S 4.8750% 13-15.01.24	3 886 000.00	4 263 670.62	0.06
USD CONSORCIO TRANSMANTARO-REG-S 4.3750% 13-07.05.23	890 000.00	942 565.62	0.01
USD CONSORCIO TRANSMANTARO-REG-S 4.7000% 19-16.04.34	5 575 000.00	6 533 481.87	0.09
USD CONTROLADORA MABE SA DE CV-REG-S 5.6000% 18-23.10.28	2 670 000.00	3 167 287.50	0.04
USD CORP FINANCIERA DE DESARROLLO SA-REG-S 4.7500% 12-08.02.22	874 000.00	906 775.00	0.01
USD CORP FINANCIERA DE DESARROLLO SA-REG-S 4.7500% 15-15.07.25	1 545 000.00	1 744 884.37	0.02
USD CORP FINANCIERA DE DESARROLLO SA-REG-S 2.4000% 20-28.09.27	2 830 000.00	2 867 143.75	0.04
USD CORP LINDLEY SA-REG-S 6.7500% 11-23.11.21	691 000.00	355 433.13	0.01
USD CORP LINDLEY SA-REG-S 4.6250% 13-12.04.23	1 945 000.00	2 011 612.19	0.03
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 4.2500% 12-17.07.42	592 000.00	675 990.00	0.01
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 4.5000% 15-16.09.25	1 290 000.00	1 477 050.00	0.02
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 4.5000% 17-01.08.47	808 000.00	961 015.00	0.01
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 4.3750% 19-05.02.49	2 979 000.00	3 523 598.44	0.05
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 3.0000% 19-30.09.29	1 715 000.00	1 852 200.00	0.03
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 3.1500% 20-14.01.30	5 661 000.00	6 166 951.87	0.09
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 3.7500% 20-15.01.31	864 000.00	979 560.00	0.01
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 3.1500% 20-15.01.51	511 000.00	500 620.32	0.01
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 4.2500% 12-26.01.23	2 000 000.00	1 969 375.00	0.03
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 4.3750% 13-30.04.25	1 700 000.00	1 653 781.25	0.02
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 5.6250% 13-30.04.43	2 717 000.00	2 413 884.69	0.03
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 7.0000% 14-04.04.44	3 219 000.00	3 151 602.19	0.04
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 7.1580% 15-12.03.45	12 621 000.00	12 447 461.25	0.18
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 6.1250% 19-19.02.31	3 259 000.00	3 260 018.43	0.05
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 8.0000% 18-27.01.24	1 040 000.00	1 114 425.00	0.02
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 7.1250% 18-27.01.22	570 000.00	590 662.50	0.01
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 7.1250% 19-25.04.22	2 071 000.00	2 143 485.00	0.03
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 7.2500% 19-08.04.26	1 715 000.00	1 935 270.31	0.03
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 3.3000% 21-12.01.31	5 939 000.00	5 931 576.25	0.08
USD CREDICORP LTD-REG-S 2.7500% 20-17.06.25	3 986 000.00	4 136 720.62	0.06
USD CREDIT BK MOSCOW/CBOM FIN-REG-S LPN 7.1210% 19-25.06.24	590 000.00	653 793.75	0.01
USD CREDIT BK MOSCOW/CBOM FIN-REG-S 4.7000% 20-29.01.25	3 268 000.00	3 349 700.00	0.05
USD CSN ISLANDS XI CORP-REG-S 6.7500% 20-28.01.28	4 828 000.00	5 190 220.70	0.07
USD CSN RESOURCES SA-REG-S 7.6250% 18-13.02.23	955 000.00	989 320.32	0.01
USD CSN RESOURCES SA-REG-S 7.6250% 19-17.04.26	2 678 000.00	2 871 298.04	0.04
USD DAE FUNDING LLC-REG-S 2.6250% 21-20.03.25	3 730 000.00	3 818 587.50	0.05
USD DAE FUNDING LLC-REG-S 3.3750% 21-20.03.28	4 000 000.00	4 115 000.00	0.06
USD DEBT AND ASSET TRADING CORP-REG-S 1.0000% 13-10.10.25	4 910 000.00	4 271 700.00	0.06
USD DEV BK OF THE REPUBLIC OF BELARUS-REG-S 6.7500% 19-02.05.24	2 610 000.00	2 654 043.75	0.04
USD DEVELOPMENT BANK OF KAZAKHSTAN-REG-S 4.1250% 12-10.12.22	1 735 000.00	1 817 412.50	0.03
USD DOMINICAN REPUBLIC INT BOND-REG-S 4.8750% 20-23.09.32	47 456 000.00	50 422 000.00	0.71
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 5.5000% 15-27.01.25	4 035 000.00	4 493 981.25	0.06
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.8500% 15-27.01.45	10 737 000.00	12 599 198.44	0.18
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.8750% 16-29.01.26	11 172 000.00	13 196 925.00	0.19
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 5.9500% 17-25.01.27	2 300 000.00	2 662 250.00	0.04
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.5000% 18-15.02.48	10 910 000.00	12 324 890.62	0.17
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.0000% 18-19.07.28	6 436 000.00	7 473 805.00	0.11
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.4000% 19-05.06.49	3 746 000.00	4 174 448.75	0.06
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 4.5000% 20-30.01.30	29 289 000.00	30 515 476.87	0.43
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 5.8750% 20-30.01.60	53 852 000.00	56 123 881.24	0.79
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 5.3000% 21-21.01.41	12 925 000.00	13 304 671.87	0.19
USD DTEK FINANCE PLC (PIK) *DEFAULTED* 10.7500% 16-31.12.24	3 000 000.00	2 010 000.00	0.03
USD EASY TACTIC LTD-REG-S 8.6250% 20-05.03.24	520 000.00	482 625.00	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 - エマージング・マーケット・デッド

2021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	ECOPETROL SA 5.87500% 13-18.09.23	3 738 000.00	4 147 535.28	0.06
USD	ECOPETROL SA 6.87500% 20-29.04.30	6 924 000.00	8 613 456.00	0.12
USD	ECUADOR GOVT INTERNATIONAL BD-REG-S STEP-UP/DOWN 20-31.07.35	70 080 458.00	32 193 210.39	0.45
USD	ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S STEP-UP 0.50000% 20-31.07.30	22 781 883.00	12 209 665.43	0.17
USD	ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S STEP-UP 20-31.07.40	40 675 432.00	17 808 212.57	0.25
USD	ECUADOR, REPUBLIC OF-144A STEP-UP 20-31.07.40	2 600 000.00	1 138 312.50	0.02
USD	EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.90300% 18-21.02.48	10 507 000.00	10 933 846.88	0.15
USD	EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 6.58800% 18-21.02.28	463 000.00	501 052.81	0.01
USD	EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 4.55000% 19-20.11.23	910 000.00	944 125.00	0.01
USD	EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 5.75000% 20-29.05.24	5 480 000.00	5 892 712.50	0.08
USD	EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.62500% 20-29.05.32	16 800 000.00	18 590 250.00	0.26
USD	EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 8.87500% 20-29.05.50	9 185 000.00	10 381 920.31	0.15
USD	EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 20-06.10.25	5 540 000.00	5 900 100.00	0.08
USD	EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 7.75000% 02-24.01.23	6 574 000.00	6 623 305.00	0.09
USD	EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 7.62500% 11-01.02.41	4 880 000.00	4 684 800.00	0.07
USD	EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 5.87500% 12-30.01.25	4 171 000.00	4 066 725.00	0.06
USD	EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 6.37500% 14-18.01.27	6 865 000.00	6 744 862.50	0.10
USD	EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 8.62500% 17-28.02.29	7 626 000.00	7 969 170.00	0.11
USD	EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 7.12460% 19-20.01.50	8 090 000.00	7 483 250.00	0.11
USD	EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 9.50000% 20-15.07.52	7 343 000.00	7 695 464.00	0.11
USD	EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 8.25000% 02-10.04.32	947 000.00	965 940.00	0.01
USD	EMBRAER NETHERLANDS FINANCE BV 5.40000% 17-01.02.27	2 304 000.00	2 408 832.00	0.03
USD	EMBRAER NETHERLANDS FINANCE BV-REG-S 6.95000% 20-17.01.28	1 675 000.00	1 876 418.75	0.03
USD	EMBRAER OVERSEAS LTD-REG-S 5.69600% 13-16.09.23	231 000.00	245 654.06	0.00
USD	EMPRESA DE L FERROCARRILE DEL EST-REG-S 3.06800% 20-18.08.50	1 194 000.00	1 110 793.12	0.02
USD	EMPRESA DE TRANSMISION ELECTRICA-REG-S 5.12500% 19-02.05.49	3 750 000.00	4 605 750.00	0.06
USD	EMPRESA DE TRANSPORTE DE PASA MET-REG-S 5.00000% 17-25.01.47	200 000.00	250 650.00	0.00
USD	EMPRESA DE TRANSPORTE DE PASA MET-REG-S 3.65000% 20-07.05.30	3 473 000.00	3 879 992.19	0.05
USD	EMPRESA DE TRANSPORTE DE PASA MET-REG-S 4.70000% 20-07.05.50	3 724 000.00	4 589 830.00	0.06
USD	EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO-REG-S 3.75000% 16-05.08.26	3 757 000.00	4 088 085.62	0.06
USD	EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO-REG-S 4.50000% 17-14.09.47	1 558 000.00	1 708 931.25	0.02
USD	EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO-REG-S 5.25000% 18-06.11.29	7 653 000.00	8 999 928.00	0.13
USD	EMPRESAS PUBLICAS DE MEDELLIN ESP-REG-S 4.25000% 19-18.07.29	18 377 000.00	19 445 163.12	0.27
USD	EMPRESAS PUBLICAS DE MEDELLIN ESP-REG-S 4.37500% 20-15.02.31	4 630 000.00	4 903 678.84	0.07
USD	ENEL CHILE SA 4.87500% 18-12.06.28	2 872 000.00	3 364 727.51	0.05
USD	ENERGUATE TRUST-REG-S 5.87500% 17-03.05.27	4 310 000.00	4 561 865.63	0.06
USD	ENERSIS AMERICAS SA 4.00000% 16-25.10.26	2 770 000.00	3 085 087.50	0.04
USD	ENN ENERGY HOLDINGS LTD-REG-S 2.62500% 20-17.09.30	12 415 000.00	12 446 037.50	0.18
USD	ESKOM HOLDINGS SOC LTD-REG-S 6.75000% 13-06.08.23	4 770 000.00	4 984 650.00	0.07
USD	ESKOM HOLDINGS SOC LTD-REG-S 7.12500% 15-11.02.25	10 610 000.00	11 279 756.25	0.16
USD	ETERNA CAPITAL PTE LTD (PIK) 8.00000% 17-11.12.22	679 554.00	325 723.82	0.00
USD	EUROTORG LLC VIA BONITRON DAC-REG-S 9.00000% 20-22.10.25	900 000.00	972 000.00	0.01
USD	EVRAZ PLC-REG-S 5.37500% 17-20.03.23	500 000.00	532 812.50	0.01
USD	EXPORT CREDIT BANK OF TURKEY-REG-S 5.37500% 16-24.10.23	8 764 000.00	8 887 243.75	0.13
USD	EXPORT CREDIT BANK OF TURKEY-REG-S 6.12500% 18-03.05.24	3 330 000.00	3 416 371.87	0.05
USD	FANTASIA HOLDINGS GROUP CO LTD-REG-S 10.87500% 20-09.01.23	1 070 000.00	1 087 387.50	0.02
USD	FANTASIA HOLDINGS GROUP CO LTD-REG-S 11.87500% 20-01.06.23	685 000.00	710 473.44	0.01
USD	FANTASIA HOLDINGS GROUP CO LTD-REG-S 9.25000% 20-28.07.23	560 000.00	548 975.00	0.01
USD	FBN VIA FINANCE CO BV-REG-S 8.62500% 20-27.10.25	4 480 000.00	4 949 000.00	0.07
USD	FENIX POWER PERU SA-REG-S 4.31700% 17-20.09.27	2 930 000.00	2 769 657.91	0.04
USD	FIRST QUANTUM MINERALS LTD-144A 7.25000% 17-01.04.23	2 340 000.00	2 386 928.70	0.03
USD	FIRST QUANTUM MINERALS LTD-REG-S 7.25000% 17-01.04.23	1 130 000.00	1 152 662.15	0.02
USD	FIRST QUANTUM MINERALS LTD-REG-S 7.50000% 17-01.04.25	770 000.00	797 450.50	0.01
USD	FIRST QUANTUM MINERALS LTD-REG-S 6.87500% 18-01.03.26	630 000.00	656 775.00	0.01
USD	FORTUNE STAR BVI LTD-REG-S 6.75000% 19-02.07.23	360 000.00	379 125.00	0.01
USD	FORTUNE STAR BVI LTD-REG-S 6.85000% 20-02.07.24	2 340 000.00	2 480 259.60	0.03
USD	FRANSHION BRILLIANT LTD-REG-S 4.25000% 19-23.07.29	2 210 000.00	2 205 165.62	0.03
USD	FS LUXEMBOURG SARL-REG-S 10.00000% 20-15.12.25	2 260 000.00	2 408 369.00	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 - エマージング・マーケット・デッド

2021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 FUTURE RETAIL LTD-REG-S 5.60000% 20-22.01.25	350 000.00	298 021.50	0.00
USD FWD GROUP LTD-REG-S-SUB 5.75000% 19-09.07.24	800 000.00	836 400.00	0.01
USD GABON, REPUBLIC OF-REG-S 6.62500% 20-06.02.31	2 912 000.00	2 869 230.01	0.04
USD GEOPARK LTD-REG-S 5.50000% 20-17.01.27	1 260 000.00	1 264 315.50	0.02
USD GEOPARK LTD-REG-S 6.50000% 17-21.09.24	3 120 000.00	3 231 150.00	0.05
USD GERDAU TRADE INC-REG-S 4.87500% 17-24.10.27	2 210 000.00	2 525 615.62	0.04
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 7.62500% 18-16.05.29	17 238 000.00	18 148 381.87	0.26
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 8.62700% 18-16.06.49	1 400 000.00	1 400 000.00	0.02
USD GLOBAL LIMAN ISLETMELERI-REG-S 8.12500% 14-14.11.21	5 950 000.00	4 983 125.00	0.07
USD GLOBAL PRIME CAPITAL PTE LTD-REG-S 5.95000% 20-23.01.25	360 000.00	370 800.00	0.01
USD GNL QUINTERO SA-REG-S 4.63400% 14-31.07.29	10 045 000.00	11 139 905.00	0.16
USD GOLD FIELDS OROGEN HOLDINGS BVI-REG-S 5.12500% 19-15.05.24	1 000 000.00	1 094 050.00	0.02
USD GOLD FIELDS OROGEN HOLDINGS-REG-S 6.12500% 19-15.05.29	2 910 000.00	3 519 281.25	0.05
USD GREENKO DUTCH BV-REG-S 5.25000% 17-24.07.24	2 944 000.00	3 047 040.00	0.04
USD GREENKO DUTCH BV-REG-S 4.87500% 17-24.07.22	2 120 000.00	2 132 587.50	0.03
USD GREENKO MAURITIUS LTD-REG-S 6.25000% 19-21.02.23	4 539 000.00	4 675 170.00	0.07
USD GROWTHPOINT PROPERTIES INT PTY-REG-S 5.87200% 18-02.05.23	840 000.00	888 037.50	0.01
USD GRUMA SA DE CV-REG-S 4.87500% 14-01.12.24	6 727 000.00	7 538 444.37	0.11
USD GRUPO AVAL LTD-REG-S 4.75000% 12-26.09.22	3 610 000.00	3 775 834.38	0.05
USD GRUPO AVAL LTD-REG-S 4.37500% 20-04.02.30	8 944 000.00	9 205 612.00	0.13
USD GRUPO BIMBO SA DE CV-REG-S 4.00000% 19-06.09.49	490 000.00	531 650.00	0.01
USD GRUPO BIMBO SAB DE CV-REG-S 4.70000% 17-10.11.47	200 000.00	240 437.50	0.00
USD GRUPO CEMENTO DE CHIHUA SAB DE CV-REG-S 5.25000% 17-23.06.24	2 660 000.00	2 748 943.75	0.04
USD GRUPO ENERGIA BOGOTA SA ESP-REG-S 4.87500% 20-15.05.30	1 610 000.00	1 863 575.00	0.03
USD GTL TRADE FINANCE INC-REG-S 7.25000% 14-16.04.44	2 942 000.00	4 134 429.38	0.06
USD GTLK EUROPE CAPITAL DAC-REG-S 4.94900% 19-18.02.26	3 539 000.00	3 722 585.62	0.05
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 4.87500% 13-13.02.28	350 000.00	390 140.62	0.01
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 4.50000% 16-03.05.26	7 771 000.00	8 475 246.88	0.12
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 4.37500% 17-05.06.27	788 000.00	857 196.25	0.01
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 4.90000% 19-01.06.30	12 610 000.00	14 213 834.37	0.20
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 6.12500% 19-01.06.50	5 742 000.00	7 080 603.75	0.10
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 5.37500% 20-24.04.32	2 196 000.00	2 589 907.50	0.04
USD GUSAP III-REG-S 4.25000% 19-21.01.30	5 692 000.00	6 213 529.50	0.09
USD HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING-REG-S 2.15000% 21-14.01.26	2 000 000.00	2 011 840.00	0.03
USD HAITONG INTERNATIONAL SECURITIES-REG-S 3.37500% 19-19.07.24	1 100 000.00	1 154 312.50	0.02
USD HAITONG INTERNATIONAL SECURITIES-REG-S 3.12500% 19-18.05.25	800 000.00	833 750.00	0.01
USD HEJUN SHUNZE INVESTMENT CO LTD-REG-S 10.40000% 20-09.03.23	2 384 000.00	2 294 600.00	0.03
USD HIKMA FINANCE USA LLC-REG-S 3.25000% 20-09.07.25	1 105 000.00	1 152 680.75	0.02
USD HKT CAPITAL NO 4 LTD-REG-S 3.00000% 16-14.07.26	2 800 000.00	2 995 125.00	0.04
USD HONDURAS, REPUBLIC OF-REG-S 6.25000% 17-19.01.27	975 000.00	1 116 070.31	0.02
USD HONDURAS, REPUBLIC OF-REG-S 5.62500% 20-24.06.30	2 717 000.00	3 050 681.56	0.04
USD HONDURAS, REPUBLIC OF-REG-S 7.50000% 13-15.03.24	2 340 000.00	2 592 281.25	0.04
USD HTA GROUP LTD/MAURITIUS-REG-S 7.00000% 20-18.12.25	12 572 000.00	13 439 468.00	0.19
USD HUARONG FINANCE 2017 CO-REG-S 3.75000% 17-27.04.22	7 420 000.00	7 605 500.00	0.11
USD HUARONG FINANCE 2017 CO-REG-S 4.75000% 17-27.04.27	4 310 000.00	4 887 809.38	0.07
USD HUNGARY, REPUBLIC OF 7.62500% 11-29.03.41	900 000.00	1 567 125.00	0.02
USD HUNGARY, REPUBLIC OF 5.75000% 13-22.11.23	2 108 000.00	2 408 390.00	0.03
USD HUNGARY, REPUBLIC OF 5.37500% 14-25.03.24	1 364 000.00	1 556 665.00	0.02
USD HUNT OIL CO OF PERU LLC SUCUAL DL-REG-S 6.37500% 18-01.06.28	6 650 000.00	7 175 682.50	0.10
USD HYUNDAI CAPITAL AMERICA-REG-S 2.75000% 16-27.09.26	1 000 000.00	1 062 759.98	0.01
USD HYUNDAI CAPITAL AMERICA-REG-S 3.50000% 19-02.11.26	2 614 000.00	2 882 437.19	0.04
USD ICL GROUP LTD-144A-REG-S 6.37500% 18-31.05.38	1 465 000.00	1 930 137.50	0.03
USD IHS NETHERLANDS HOLDCO BV-REG-S 7.12500% 19-18.03.25	3 387 000.00	3 538 356.56	0.05
USD IHS NETHERLANDS HOLDCO BV-REG-S 8.00000% 19-18.09.27	14 498 000.00	15 625 944.40	0.22
USD INDIKA ENERGY CAPITAL IV PTE LTD-REG-S 8.25000% 20-22.10.25	990 000.00	1 059 300.00	0.01
USD INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM TBK PT-REG-S 5.71000% 18-15.11.23	952 000.00	1 056 422.50	0.01
USD INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM TBK PT-REG-S 6.53000% 18-15.11.28	2 189 000.00	2 728 725.31	0.04
USD INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM TBK PT-REG-S 6.75700% 18-15.11.48	5 869 000.00	7 824 110.62	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 - エマージング・マーケット・デッド

2021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 INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM TBK PT-REG-S 4.75000% 20-15.05.25	2 483 000.00	2 736 464.64	0.04
USD INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM TBK PT-REG-S 5.45000% 20-15.05.30	1 758 000.00	2 073 890.62	0.03
USD INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM TBK PT-REG-S 5.80000% 20-15.05.50	1 059 000.00	1 285 030.32	0.02
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 3.50000% 17-11.01.28	4 300 000.00	4 775 687.50	0.07
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 3.50000% 20-14.02.50	4 003 000.00	4 295 719.38	0.06
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 4.45000% 20-15.04.70	1 580 000.00	1 931 056.25	0.03
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 3.05000% 21-12.03.51	2 290 000.00	2 301 450.00	0.03
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 3.35000% 21-12.03.71	2 071 000.00	2 099 476.25	0.03
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 7.75000% 08-17.01.38	2 273 000.00	3 568 610.00	0.05
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 12-17.01.42	11 674 000.00	15 084 996.88	0.21
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 4.35000% 16-08.01.27	600 000.00	694 312.50	0.01
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 16-08.01.47	1 171 000.00	1 544 988.12	0.02
USD INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV-REG-S 4.15000% 19-12.09.29	1 693 000.00	1 895 630.93	0.03
USD INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV-REG-S 4.75000% 20-06.08.50	4 744 000.00	5 331 070.00	0.08
USD INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA-REG-S 3.75000% 17-14.01.28	920 000.00	986 412.50	0.01
USD INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA-REG-S 4.75000% 20-15.01.51	895 000.00	953 175.00	0.01
USD INKIA ENERGY LTD-REG-S 5.87500% 17-09.11.27	4 788 000.00	5 111 190.00	0.07
USD INRETAIL PHARMA SA-REG-S 5.37500% 18-02.05.23	5 040 000.00	5 222 700.00	0.07
USD INSTITUTO COSTARRICENSE DE ELEC-REG-S 6.95000% 11-10.11.21	1 700 000.00	1 723 906.25	0.02
USD INSTITUTO COSTARRICENSE DE ELEC-REG-S 6.37500% 13-15.05.43	540 000.00	455 962.50	0.01
USD INTERCORP PERU LTD-REG-S 3.87500% 19-15.08.29	1 330 000.00	1 397 331.25	0.02
USD INTERNATIONAL AIRPORT FINANCE SA-REG-S 12.00000% 19-15.03.33	5 555 000.00	5 375 867.11	0.08
USD INVERSIONES CMPC SA-REG-S 4.37500% 17-04.04.27	2 441 000.00	2 743 378.88	0.04
USD IRSA PROPIEDADES COMERCIALES SA-REG-S 8.75000% 16-23.03.23	932 000.00	786 957.50	0.01
USD ISRAEL ELECTRIC CORP LTD-144A-REG-S 5.00000% 14-12.11.24	1 842 000.00	2 080 428.48	0.03
USD ISRAEL ELECTRIC CORP LTD-REG-S 6.87500% 13-21.06.23	4 592 000.00	5 187 525.00	0.07
USD ITAU UNIBANCO HOLDING SA-REG-S-SUB 4.62500% 20-PRP	1 995 000.00	1 902 731.25	0.03
USD IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S STEP-UP 10-31.12.32	4 077 000.00	2 916 440.65	0.04
USD JAMAICA, GOVERNMENT OF 6.75000% 15-28.04.28	2 850 000.00	3 405 750.00	0.05
USD JAMAICA, GOVERNMENT OF 7.87500% 15-28.07.45	10 376 000.00	14 581 522.51	0.21
USD JBS INVESTMENTS II GMBH-REG-S 7.00000% 18-15.01.26	2 110 000.00	2 256 645.00	0.03
USD JBS INVESTMENTS II GMBH-REG-S 5.75000% 19-15.01.28	1 885 000.00	1 998 250.80	0.03
USD JD.COM INC 4.12500% 20-14.01.50	550 000.00	594 515.63	0.01
USD JORDAN, KINGDOM OF-REG-S 5.75000% 16-31.01.27	3 034 000.00	3 355 414.38	0.05
USD JORDAN, KINGDOM OF-REG-S 5.85000% 20-07.07.30	3 880 000.00	4 258 300.00	0.06
USD JORDAN, KINGDOM OF-REG-S 4.95000% 20-07.07.25	2 700 000.00	2 874 656.25	0.04
USD JSC GEORGIAN RAILWAY-REG-S 7.75000% 12-11.07.22	1 700 000.00	1 801 468.75	0.03
USD JSL EUROPE SA-REG-S 5.20000% 21-26.01.31	4 712 000.00	4 735 560.00	0.07
USD JSM GLOBAL SARL-REG-S 4.75000% 20-20.10.30	7 028 000.00	7 394 773.75	0.10
USD KAISA GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 11.95000% 19-22.10.22	5 278 000.00	5 535 302.50	0.08
USD KAISA GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 11.50000% 19-30.01.23	1 345 000.00	1 392 075.00	0.02
USD KAISA GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 10.87500% 19-23.07.23	11 649 000.00	11 965 707.19	0.17
USD KAISA GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 11.95000% 19-12.11.23	430 000.00	448 812.50	0.01
USD KAISA GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 10.50000% 20-15.01.25	1 208 000.00	1 182 707.50	0.02
USD KAISA GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 11.25000% 20-16.04.25	1 960 000.00	1 957 550.00	0.03
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO-REG-S 4.75000% 17-19.04.27	10 510 000.00	12 165 325.00	0.17
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO-REG-S 5.75000% 17-19.04.47	10 322 000.00	13 228 288.13	0.19
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO-REG-S 6.37500% 18-24.10.48	8 904 000.00	12 318 127.50	0.17
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO-REG-S 5.37500% 18-24.04.30	10 564 000.00	12 973 912.50	0.18
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO JSC-REG-S 3.50000% 20-14.04.33	8 281 000.00	8 910 355.99	0.13
USD KENBOURNE INVEST SA-REG-S 6.87500% 19-26.11.24	5 548 000.00	5 946 762.50	0.08
USD KENYA, REPUBLIC OF-REG-S 6.87500% 14-24.06.24	3 219 000.00	3 545 929.68	0.05
USD KENYA, REPUBLIC OF-REG-S 7.25000% 18-28.02.28	640 000.00	713 000.00	0.01
USD KENYA, REPUBLIC OF-REG-S 8.25000% 18-28.02.48	7 500 000.00	8 465 625.00	0.12
USD KENYA, REPUBLIC OF-REG-S 8.00000% 19-22.05.32	12 875 000.00	14 786 132.81	0.21
USD KENYA, REPUBLIC OF-REG-S 7.00000% 19-22.05.27	3 190 000.00	3 521 959.38	0.05
USD KLABIN AUSTRIA GMBH-REG-S 5.75000% 19-03.04.29	415 000.00	477 250.00	0.01
USD KLABIN AUSTRIA GMBH-REG-S 7.00000% 19-03.04.49	5 768 000.00	7 202 790.00	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

2021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	KLABIN AUSTRIA GMBH-REG-S 3.20000% 21-12.01.31	1 426 000.00	1 421 151.60	0.02
USD	KOC HOLDING AS-REG-S 5.25000% 16-15.03.23	3 763 000.00	3 878 241.88	0.05
USD	KOSMOS ENERGY LTD-144A 7.12500% 19-04.04.26	910 000.00	900 900.00	0.01
USD	KOSMOS ENERGY LTD-REG-S 7.12500% 19-04.04.26	6 592 000.00	6 526 080.00	0.09
USD	KUWAIT PROJECTS CO SPC LTD-REG-S 4.22900% 19-29.10.26	800 000.00	835 250.00	0.01
USD	LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.65000% 15-26.02.30	8 773 000.00	1 008 895.00	0.01
USD	LEVIATHAN BOND LTD-144A-REG-S 5.75000% 20-30.06.23	3 600 000.00	3 828 375.00	0.05
USD	LIQUID TELECOMMUNICATIONS FIN-REG-S 8.50000% 17-13.07.22	9 232 000.00	9 399 330.01	0.13
USD	LLPL CAPITAL PTE LTD-REG-S 6.87500% 19-04.02.39	7 500 000.00	8 490 614.07	0.12
USD	LUKOIL INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 4.75000% 16-02.11.26	4 060 000.00	4 594 143.75	0.06
USD	LUKOIL SECURITIES BV-REG-S 3.87500% 20-06.05.30	2 498 000.00	2 653 344.37	0.04
USD	MEDCO BELL PTE LTD-REG-S 6.37500% 20-30.01.27	599 000.00	605 738.75	0.01
USD	MEDCO OAK TREE PTE LTD-REG-S 7.37500% 19-14.05.26	3 585 000.00	3 815 784.36	0.05
USD	MEDCO PLATINUM ROAD PTE LTD-REG-S 6.75000% 18-30.01.25	3 233 000.00	3 355 247.82	0.05
USD	MEGAWORLD CORP-REG-S 4.12500% 20-30.07.27	3 260 000.00	3 447 450.00	0.05
USD	MEITUAN DIANPING-REG-S 2.12500% 20-28.10.25	200 000.00	203 936.00	0.00
USD	MEITUAN DIANPING-REG-S 3.05000% 20-28.10.30	5 725 000.00	5 946 843.75	0.08
USD	MELCO RESORTS FINANCE LTD-REG-S 5.62500% 19-17.07.27	2 823 000.00	2 951 305.35	0.04
USD	MELCO RESORTS FINANCE LTD-REG-S 5.37500% 19-04.12.29	2 141 000.00	2 232 442.11	0.03
USD	MELCO RESORTS FINANCE LTD-REG-S 5.75000% 20-21.07.28	3 644 000.00	3 847 153.00	0.05
USD	MELCO RESORTS FINANCE LTD-REG-S 5.37500% 21-04.12.29	4 460 000.00	4 663 777.40	0.07
USD	MERCADOLIBRE INC 2.37500% 21-14.01.26	382 000.00	384 865.00	0.01
USD	MERCADOLIBRE INC 3.12500% 21-14.01.31	1 299 000.00	1 307 950.11	0.02
USD	MERSIN ULUSLARARASI LIMAN-REG-S 5.37500% 19-15.11.24	11 812 000.00	12 535 485.00	0.18
USD	METINVEST BV-REG-S 7.65000% 20-01.10.27	600 000.00	645 348.00	0.01
USD	METINVEST BV-REG-S 8.50000% 18-23.04.26	8 905 000.00	9 904 029.69	0.14
USD	MEXICAN, UNITED STATES OF 4.60000% 15-23.01.46	1 950 000.00	2 147 437.50	0.03
USD	MEXICHEM SAB DE CV-REG-S 5.87500% 14-17.09.44	4 195 000.00	5 096 925.00	0.07
USD	MEXICHEM SAB DE CV-REG-S 4.00000% 17-04.10.27	1 000 000.00	1 097 187.50	0.02
USD	MEXICHEM SAB DE CV-REG-S 5.50000% 17-15.01.48	850 000.00	1 000 609.37	0.01
USD	MEXICO CITY AIRPORT TRUST-REG-S 4.25000% 16-31.10.26	5 321 000.00	5 515 083.48	0.08
USD	MEXICO GEN DE ENERGIA S DE RL-REG-S 5.50000% 12-06.12.32	4 465 000.00	4 429 303.24	0.06
USD	MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.65900% 20-24.05.31	8 531 000.00	8 485 679.07	0.12
USD	MEXICO, UNITED STATES OF 6.05000% 08-11.01.40	526 000.00	671 965.00	0.01
USD	MEXICO, UNITED STATES OF 5.75000% 10-12.10.110	8 922 000.00	11 054 915.62	0.16
USD	MEXICO, UNITED STATES OF 3.60000% 14-30.01.25	550 000.00	610 500.00	0.01
USD	MEXICO, UNITED STATES OF 4.35000% 16-15.01.47	1 470 000.00	1 573 359.38	0.02
USD	MEXICO, UNITED STATES OF 4.60000% 17-10.02.48	1 990 000.00	2 192 731.25	0.03
USD	MEXICO, UNITED STATES OF 3.75000% 18-11.01.28	1 500 000.00	1 664 531.25	0.02
USD	MEXICO, UNITED STATES OF 4.50000% 19-22.04.29	2 100 000.00	2 422 218.75	0.03
USD	MEXICO, UNITED STATES OF 4.50000% 19-31.01.50	6 600 000.00	7 233 187.50	0.10
USD	MEXICO, UNITED STATES OF 4.75000% 20-27.04.32	3 859 000.00	4 501 764.69	0.06
USD	MEXICO, UNITED STATES OF 5.00000% 20-27.04.51	9 854 000.00	11 498 386.25	0.16
USD	MEXICO, UNITED STATES OF 3.77100% 20-24.05.61	31 444 000.00	30 255 023.75	0.43
USD	MGM CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 5.25000% 20-18.06.25	700 000.00	724 766.00	0.01
USD	MHP LUX SA-REG-S 6.25000% 19-19.09.29	1 130 000.00	1 161 075.00	0.02
USD	MHP LUX SA-REG-S 6.95000% 18-03.04.26	4 130 000.00	4 492 665.62	0.06
USD	MHP SA-REG-S 7.75000% 17-10.05.24	6 948 000.00	7 571 148.75	0.11
USD	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-REG-S 5.12500% 17-15.01.28	2 571 000.00	2 698 778.70	0.04
USD	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-REG-S 6.25000% 19-25.03.29	4 543 000.00	5 043 297.88	0.07
USD	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-REG-S 4.50000% 20-27.04.31	6 867 000.00	7 279 020.00	0.10
USD	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-REG-S 6.62500% 18-15.10.26	3 040 000.00	3 258 500.00	0.05
USD	MINERVA LUXEMBOURG SA-REG-S 6.50000% 16-20.09.26	2 514 000.00	2 641 132.98	0.04
USD	MMC NORILSK NICKL VIA MMC FIN DAC-REG-S 3.37500% 19-28.10.24	2 970 000.00	3 102 721.88	0.04
USD	MONG DUONG FINANCE HOLDINGS BV-REG-S 5.12500% 19-07.05.29	2 260 000.00	2 284 012.50	0.03
USD	MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 5.62500% 17-01.05.23	6 986 000.00	7 324 384.39	0.10
USD	MONGOLIAN MIN CORP/ENRGY RES LLC-REG-S 9.25000% 19-15.04.24	1 260 000.00	1 151 028.90	0.02
USD	MOROCCO GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 4.00000% 20-15.12.50	8 975 000.00	9 140 476.56	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 - エマージング・マーケット・デッド

2021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 MOROCCO, KINGDOM OF-REG-S 2.37500% 20-15.12.27	2 980 000.00	2 990 243.75	0.04
USD MOROCCO, KINGDOM OF-REG-S 3.00000% 20-15.12.32	5 209 000.00	5 239 928.45	0.07
USD MTN MAURITIUS INVESTMENTS LTD-REG-S 4.75500% 14-11.11.24	8 750 000.00	9 285 937.50	0.13
USD MTN MAURITIUS INVESTMENTS LTD-REG-S 6.50000% 16-13.10.26	8 862 000.00	10 251 118.50	0.14
USD MTN MAURITIUS INVESTMENTS LTD-REG-S 5.37300% 16-13.02.22	5 060 000.00	5 199 150.00	0.07
USD NAGACORP LTD-REG-S 7.95000% 20-06.07.24	1 200 000.00	1 251 375.00	0.02
USD NATIONAL BANK OF UZBEKISTAN-REG-S 4.85000% 20-21.10.25	200 000.00	205 187.50	0.00
USD NATIONAL CENTRAL COOLING CO-REG-S 2.50000% 20-21.10.27	9 845 000.00	9 968 062.50	0.14
USD NBM US HOLDINGS INC-REG-S 7.00000% 19-14.05.26	4 457 000.00	4 784 589.50	0.07
USD NEXA RESOURCES SA-REG-S 6.50000% 20-18.01.28	3 214 000.00	3 736 275.00	0.05
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.87500% 17-16.02.32	3 781 000.00	4 128 379.38	0.06
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.14300% 18-23.02.30	13 740 000.00	14 688 918.75	0.21
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.69600% 18-23.02.38	3 579 000.00	3 753 476.25	0.05
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.62500% 18-21.11.25	1 500 000.00	1 717 031.25	0.02
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 8.74700% 18-21.01.31	8 378 000.00	9 705 389.37	0.14
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 9.24800% 18-21.01.49	9 630 000.00	11 176 818.75	0.16
USD OCP SA-REG-S 4.50000% 15-22.10.25	550 000.00	594 319.00	0.01
USD OCP SA-REG-S 6.87500% 14-25.04.44	7 421 000.00	9 658 895.31	0.14
USD OIL AND GAS HOLDING CO BSCC/THE-REG-S 7.62500% 18-07.11.24	3 390 000.00	3 789 384.37	0.05
USD OIL AND GAS HOLDING CO BSCC/THE-REG-S 8.37500% 18-07.11.28	4 791 000.00	5 605 470.00	0.08
USD OLEODUCTO CENTRAL SA-REG-S 4.00000% 20-14.07.27	600 000.00	646 950.00	0.01
USD OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 7.00000% 21-25.01.51	9 186 000.00	9 300 825.00	0.13
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 4.75000% 16-15.06.26	7 513 000.00	7 672 651.25	0.11
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.37500% 17-08.03.27	8 868 000.00	9 128 497.50	0.13
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.50000% 17-08.03.47	2 947 000.00	2 853 985.32	0.04
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.62500% 18-17.01.28	1 370 000.00	1 419 662.50	0.02
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.75000% 18-17.01.48	15 634 000.00	15 433 689.38	0.22
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.25000% 21-25.01.31	19 848 000.00	21 063 690.00	0.30
USD ORAZUL ENERGY EGENOR SCA-REG-S 5.62500% 17-28.04.27	4 348 000.00	4 554 530.00	0.06
USD ORYX FUNDING LTD-REG-S 5.80000% 21-03.02.31	2 108 000.00	2 154 771.26	0.03
USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 8.25000% 14-15.04.24	6 394 000.00	7 053 381.25	0.10
USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 8.25000% 15-30.09.25	507 000.00	564 829.69	0.01
USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 6.87500% 17-05.12.27	7 895 000.00	8 393 371.88	0.12
USD PAMPA ENERGIA SA-REG-S 7.50000% 17-24.01.27	4 945 000.00	4 054 900.00	0.06
USD PAMPA ENERGIA SA-REG-S 7.37500% 16-21.07.23	9 174 000.00	8 156 259.37	0.12
USD PANAMA, REPUBLIC OF 4.50000% 17-15.05.47	470 000.00	576 484.38	0.01
USD PANAMA, REPUBLIC OF 3.87000% 19-23.07.60	4 330 000.00	4 794 121.88	0.07
USD PANAMA, REPUBLIC OF 4.50000% 20-01.04.56	4 990 000.00	6 100 275.00	0.09
USD PANAMA, REPUBLIC OF 2.25200% 20-29.09.32	12 118 000.00	12 220 245.62	0.17
USD PAPUA NEW GUINEA GOVT INTL BOND-REG-S 8.37500% 18-04.10.28	1 819 000.00	1 878 117.50	0.03
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 6.10000% 14-11.08.44	8 774 000.00	11 535 068.13	0.16
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 4.70000% 17-27.03.27	5 417 000.00	6 260 020.62	0.09
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 5.60000% 18-13.03.48	7 190 000.00	9 041 425.00	0.13
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 5.40000% 19-30.03.50	11 585 000.00	14 416 084.38	0.20
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 4.95000% 20-28.04.31	17 188 000.00	20 491 318.74	0.29
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 2.73900% 21-29.01.33	16 726 000.00	17 038 567.13	0.24
USD PATRIMONIO EN FIDEICOMISO-REG-S 5.75000% 18-03.04.28	1 410 000.00	1 510 903.12	0.02
USD PERTAMINA PT-144A 4.30000% 13-20.05.23	1 390 000.00	1 489 037.50	0.02
USD PERTAMINA PT-REG-S 6.00000% 12-03.05.42	390 000.00	495 791.40	0.01
USD PERU LNG SRL-REG-S 5.37500% 18-22.03.30	4 640 000.00	4 158 600.00	0.06
USD PERU, REPUBLIC OF 3.23000% 20-28.07.21	8 262 000.00	7 892 791.88	0.11
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 5.50000% 11-22.11.21	1 082 000.00	1 121 222.50	0.02
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 4.87500% 19-17.07.49	2 920 000.00	3 284 087.50	0.05
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 4.32500% 15-28.05.25	333 000.00	375 665.63	0.01
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 4.55000% 16-29.03.26	13 000 000.00	14 950 000.00	0.21
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 4.40000% 18-01.03.28	16 840 000.00	19 529 137.50	0.28
USD PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.78000% 20-01.12.60	4 211 000.00	4 060 983.12	0.06
USD PET DIAM US TREA PLC-REG-S *DEFAULTED* 7.25000% 17-01.05.22	2 378 000.00	950 456.88	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

2021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	PETROAMAZONAS EP-REG-S 4.62500% 17-06.12.21	1 700 000.00	790 594.03	0.01
USD	PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 6.87500% 09-20.01.40	3 716 000.00	4 458 038.76	0.06
USD	PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 5.62500% 13-20.05.43	510 000.00	546 496.87	0.01
USD	PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 6.90000% 19-19.03.49	5 913 000.00	7 085 252.25	0.10
USD	PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV1 5.09300% 20-15.01.30	10 184 000.00	11 123 474.00	0.16
USD	PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 6.75000% 20-03.06.50	2 011 000.00	2 340 804.00	0.03
USD	PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 5.60000% 20-03.01.31	2 121 000.00	2 356 431.00	0.03
USD	PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 12.75000% 11-17.02.22	560 000.00	19 600.00	0.00
USD	PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 8.50000% 16-27.10.20	34 620 000.00	3 721 650.00	0.05
USD	PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 5.37500% 07-12.04.27	23 369 600.00	817 936.00	0.01
USD	PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 5.50000% 07-12.04.37	370 000.00	12 950.00	0.00
USD	PETROLEOS DEL PERU SA-REG-S 4.75000% 17-19.06.32	11 838 000.00	13 406 535.00	0.19
USD	PETROLEOS DEL PERU SA-REG-S 5.62500% 17-19.06.47	2 459 000.00	2 931 589.06	0.04
USD	PETROLEOS MEXICANOS 3.50000% 13-30.01.23	6 115 000.00	6 183 793.75	0.09
USD	PETROLEOS MEXICANOS 6.37500% 14-23.01.45	2 945 000.00	2 535 645.00	0.04
USD	PETROLEOS MEXICANOS 6.50000% 18-13.03.27	3 680 000.00	3 808 800.00	0.05
USD	PETROLEOS MEXICANOS 5.35000% 18-12.02.28	23 312 000.00	22 268 788.00	0.31
USD	PETROLEOS MEXICANOS 6.35000% 18-12.02.48	19 694 000.00	16 469 107.49	0.23
USD	PETROLEOS MEXICANOS 6.50000% 18-23.01.29	1 811 000.00	1 798 549.38	0.03
USD	PETROLEOS MEXICANOS 6.49000% 20-23.01.27	50 000.00	51 500.00	0.00
USD	PETROLEOS MEXICANOS 6.84000% 20-23.01.30	4 128 000.00	4 133 160.00	0.06
USD	PETROLEOS MEXICANOS 7.69000% 20-23.01.50	43 570 000.00	41 119 187.50	0.58
USD	PETROLEOS MEXICANOS 5.95000% 20-28.01.31	24 127 000.00	22 860 332.50	0.32
USD	PETROLEOS MEXICANOS 6.95000% 20-28.01.60	24 109 000.00	20 972 419.10	0.30
USD	PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 6.87500% 20-16.10.25	1 225 000.00	1 332 493.75	0.02
USD	PETROPAYLOVSK 2016 LTD-REG-S 8.12500% 17-14.11.22	854 000.00	892 430.00	0.01
USD	PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 9.50000% 05-02.02.30	1 193 000.00	1 958 384.06	0.03
USD	PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 2.95000% 20-05.05.45	10 491 000.00	10 825 400.63	0.15
USD	PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 2.65000% 20-10.12.45	621 000.00	614 013.75	0.01
USD	PHOSAGRO BOND FUNDING LTD-REG-S 3.05000% 20-23.01.25	9 690 000.00	10 035 206.25	0.14
USD	PJSC KOKS VIA IMH CAP-REG-S 5.90000% 20-23.09.25	730 000.00	778 362.50	0.01
USD	PLDT INC-REG-S 2.50000% 20-23.01.31	624 000.00	648 960.00	0.01
USD	POLAND, REPUBLIC OF 3.00000% 12-17.03.23	4 620 000.00	4 868 325.00	0.07
USD	PROMIGAS SA ESP/GASES DEL PACIFIC-REG-S 3.75000% 19-16.10.29	2 430 000.00	2 563 042.50	0.04
USD	PROSUS NV-144A 3.68000% 20-21.01.30	200 000.00	215 000.00	0.00
USD	PROSUS NV-REG S 3.83200% 20-08.02.51	4 332 000.00	4 215 577.50	0.06
USD	PROSUS NV-REG-S 3.68000% 20-21.01.30	20 129 000.00	21 638 675.00	0.31
USD	PROSUS NV-REG-S 4.02700% 20-03.08.50	3 061 000.00	3 088 028.63	0.04
USD	PROSUS NV-REG-S 4.85000% 17-06.07.27	1 617 000.00	1 848 433.13	0.03
USD	PROVINCE OF CORDOBA-REG-S 7.12500% 16-10.06.21	966 000.00	697 935.00	0.01
USD	PUMA INTL FINANCING-REG-S 5.00000% 18-24.01.26	1 890 000.00	1 826 212.50	0.03
USD	QATAR, STATE OF-144A 5.10300% 18-23.04.48	200 000.00	275 375.00	0.00
USD	QATAR, STATE OF-REG-S 4.50000% 18-23.04.28	5 500 000.00	6 600 000.00	0.09
USD	QATAR, STATE OF-REG-S 5.10300% 18-23.04.48	9 634 000.00	13 264 813.75	0.19
USD	QATAR, STATE OF-REG-S 4.81700% 19-14.03.49	22 515 000.00	30 156 028.12	0.43
USD	QATAR, STATE OF-REG-S 3.75000% 20-16.04.30	3 362 000.00	3 902 021.25	0.05
USD	QATAR, STATE OF-REG-S 4.40000% 20-16.04.50	10 392 000.00	13 249 800.00	0.19
USD	QNB FINANSBANK AS-REG-S 6.87500% 19-07.09.24	2 210 000.00	2 418 568.75	0.03
USD	RAIZEN FUELS FINANCE SA-REG-S 5.30000% 17-20.01.27	1 157 000.00	1 307 410.00	0.02
USD	REC LTD-REG-S 3.50000% 19-12.12.24	1 100 000.00	1 160 843.75	0.02
USD	REDE D'OR FINANCE SARL-REG-S 4.95000% 18-17.01.28	834 000.00	881 433.75	0.01
USD	REDE D'OR FINANCE SARL-REG-S 4.50000% 20-22.01.30	12 219 000.00	12 426 967.38	0.18
USD	REDSUN PROPERTIES GROUP LTD-REG-S 9.70000% 20-16.04.23	1 013 000.00	1 068 398.44	0.02
USD	RELIANCE INDUSTRIES LTD-REG-S 4.87500% 15-10.02.45	250 000.00	309 531.25	0.00
USD	RELIANCE INDUSTRIES LTD-REG-S 3.66700% 17-30.11.27	4 977 000.00	5 592 903.75	0.08
USD	REPUBLIC OF AZERBAIJAN-REG-S 4.75000% 14-18.03.24	310 000.00	338 190.63	0.00
USD	REPUBLIC OF TAJIKISTAN INTER BOND-REG-S 7.12500% 17-14.09.27	6 947 000.00	5 931 001.25	0.08
USD	REPUBLIC OF TURKEY 7.25000% 18-23.12.23	1 282 000.00	1 402 588.13	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

2021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 RIO ENERGY SA/UGEN SA/UENSA SA-REG-S 6.87500% 18-01.02.25	2 448 000.00	1 596 555.00	0.02
USD RKPF OVERSEAS 2020 A LTD-REG-S 5.20000% 21-12.01.26	4 296 000.00	4 290 630.00	0.06
USD ROMANIA-REG-S 3.00000% 20-14.02.31	8 412 000.00	8 927 235.00	0.13
USD ROMANIA-REG-S 4.00000% 20-14.02.51	12 378 000.00	13 178 701.89	0.19
USD RONESANS GAYRIMENKUL YATIRIM AS-REG-S 7.25000% 18-26.04.23	1 587 000.00	1 471 446.56	0.02
USD RSHB CAPITAL SA-REG-S LPN 8.50000% 13-16.10.23	1 838 000.00	2 076 365.62	0.03
USD RUMO LUXEMBOURG SARL-REG-S 5.87500% 18-18.01.25	1 195 000.00	1 261 471.88	0.02
USD RUMO LUXEMBOURG SARL-REG-S 5.25000% 20-10.01.28	1 600 000.00	1 711 664.00	0.02
USD RUSSIA, FEDERATION OF-REG-S 5.62500% 12-04.04.42	19 800 000.00	26 773 312.50	0.38
USD SACI FALABELLA-REG-S 4.37500% 14-27.01.25	322 000.00	351 785.00	0.00
USD SAKA ENERGI INDONESIA PT-REG-S 4.45000% 17-05.05.24	3 300 000.00	3 046 312.50	0.04
USD SAMARCO MINERACAO SA-REG-S 5.37500% 14-26.09.24	1 280 000.00	959 600.00	0.01
USD SAMBA FUNDING LTD-REG-S 2.75000% 19-02.10.24	5 949 000.00	6 198 858.00	0.09
USD SANDS CHINA LTD 5.40000% 19-08.08.28	12 349 000.00	14 142 198.29	0.20
USD SANDS CHINA LTD-REG-S 4.37500% 20-18.06.30	300 000.00	328 125.00	0.00
USD SANDS CHINA LTD-REG-S 3.80000% 20-08.01.26	330 000.00	348 968.40	0.00
USD SASOL FINANCING INTERNATIONAL PLC 4.50000% 12-14.11.22	6 616 000.00	6 697 310.64	0.09
USD SASOL FINANCING USA LLC 5.87500% 18-27.03.24	15 496 000.00	16 275 642.50	0.23
USD SASOL FINANCING USA LLC 6.50000% 18-27.09.28	6 441 000.00	7 077 048.75	0.10
USD SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 2.25000% 20-24.11.30	5 040 000.00	5 040 000.00	0.07
USD SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 3.25000% 20-24.11.50	4 389 000.00	4 290 247.50	0.06
USD SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 3.50000% 20-24.11.70	13 180 000.00	12 751 650.00	0.18
USD SCENERY JOURNEY LTD-REG-S 12.00000% 20-24.10.23	900 000.00	842 625.00	0.01
USD SENEGAL, REPUBLIC OF-REG-S 8.75000% 11-13.05.21	632 000.00	642 072.50	0.01
USD SENEGAL, REPUBLIC OF-REG-S 6.75000% 18-13.03.48	3 251 000.00	3 462 315.00	0.05
USD SERBIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 7.25000% 11-28.09.21	1 385 000.00	1 439 967.18	0.02
USD SERBIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 2.12500% 20-01.12.30	4 684 000.00	4 530 306.25	0.06
USD SEVERSTAL OAO VIA STEEL CAP-REG-S LPN 5.90000% 12-17.10.22	845 000.00	905 470.32	0.01
USD SEVERSTAL OAO VIA STEEL CAP-REG-S LPN 3.15000% 19-16.09.24	910 000.00	945 546.87	0.01
USD SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD-REG-S 5.60000% 19-15.07.26	2 259 000.00	2 484 900.00	0.04
USD SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD-REG-S 3.45000% 21-11.01.31	6 644 000.00	6 718 745.00	0.09
USD SHINHAN CARD CO LTD-REG-S 1.37500% 20-19.10.25	3 743 000.00	3 784 354.16	0.05
USD SIGMA ALIMENTOS-REG-S 4.12500% 16-02.05.26	939 000.00	1 024 390.31	0.01
USD SIGMA FINANCE NETHERLANDS BV-REG-S 4.87500% 18-27.03.28	1 736 000.00	2 002 367.50	0.03
USD SINOPEC GROUP OVERSEAS DEV12 LTD-REG-S 4.87500% 12-17.05.42	604 000.00	752 168.75	0.01
USD SINOPEC GRP OVERSEAS DEV LTD-REG-S 2.15000% 20-13.05.25	2 453 000.00	2 524 308.71	0.04
USD SINOPEC GRP OVERSEAS DEV LTD-REG-S 2.70000% 20-13.05.30	5 853 000.00	6 034 077.19	0.08
USD SINOPEC GRP OVERSEAS DEV LTD-REG-S 3.35000% 20-13.05.50	951 000.00	968 236.87	0.01
USD SINOPEC GUP OVERSEAS DEVPT-REG-S 2.30000% 21-08.01.31	3 358 000.00	3 340 055.52	0.05
USD SK BATTERY AMERICA INC-REG-S 2.12500% 21-26.01.26	667 000.00	666 103.96	0.01
USD SK HYNIX INC-REG-S 2.37500% 21-19.01.31	1 353 000.00	1 363 118.28	0.02
USD SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHIL-REG-S 4.37500% 14-28.01.25	4 650 000.00	5 107 734.38	0.07
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.87500% 07-30.05.22	527 000.00	559 772.82	0.01
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 4.87500% 16-14.04.26	1 750 000.00	1 883 437.50	0.03
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 4.85000% 17-27.09.27	200 000.00	213 187.50	0.00
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.65000% 17-27.09.47	1 664 000.00	1 589 120.00	0.02
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.75000% 19-30.09.49	12 094 000.00	11 602 681.24	0.16
USD SOUTHERN COPPER CORP 6.75000% 10-16.04.40	2 194 000.00	3 238 322.06	0.05
USD SOUTHERN COPPER CORP 3.87500% 15-23.04.25	272 000.00	300 791.20	0.00
USD SOUTHERN COPPER CORP 5.87500% 15-23.04.45	2 270 000.00	3 255 350.25	0.05
USD SOVCOMBANK VIA SOVCOM CAPITAL DAC-REG-S 3.40000% 21-26.01.25	900 000.00	900 281.25	0.01
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 5.87500% 12-25.07.22	1 669 000.00	1 159 465.48	0.02
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 6.12500% 15-03.06.25	4 600 000.00	2 849 125.00	0.04
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 6.82500% 16-18.07.26	4 514 000.00	2 753 570.24	0.04
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 5.75000% 16-18.01.22	1 000 000.00	782 113.30	0.01
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 6.20000% 17-11.05.27	9 840 000.00	5 905 574.40	0.08
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 5.75000% 18-18.04.23	1 260 000.00	816 097.84	0.01
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 6.75000% 18-18.04.28	25 090 000.00	14 931 227.09	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

2021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 6.85000% 19-14.03.24	8 082 000.00	5 114 505.40	0.07
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 7.85000% 19-14.03.29	19 907 000.00	11 980 231.67	0.17
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 6.35000% 19-28.06.24	8 912 000.00	5 617 560.67	0.08
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 7.55000% 19-28.03.30	3 601 000.00	2 167 105.92	0.03
USD SRI REJEKI ISMAN TBK PT-REG-S 7.25000% 19-16.01.25	735 000.00	665 175.00	0.01
USD SSB #1 PLC-REG-S LPN STEP-UP 15-20.03.25	1 300 000.00	625 767.18	0.01
USD STUDIO CITY FINANCE LTD-REG-S 6.00000% 20-15.07.25	9 107 000.00	9 539 582.50	0.13
USD STUDIO CITY FINANCE LTD-REG-S 6.50000% 20-15.01.28	6 570 000.00	7 021 687.50	0.10
USD STUDIO CITY FINANCE LTD-REG-S 5.00000% 21-15.01.29	2 696 000.00	2 712 850.00	0.04
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 8.35000% 18-19.04.23	3 730 000.00	3 904 843.75	0.05
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 7.00000% 20-09.07.25	886 000.00	901 505.00	0.01
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 6.65000% 20-03.08.24	330 000.00	335 568.75	0.00
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 6.50000% 21-26.01.26	2 833 000.00	2 801 128.75	0.04
USD SUNNY EXPRESS ENTERPRISES CORP-REG-S 3.12500% 20-23.04.30	2 500 000.00	2 623 600.00	0.04
USD SURA ASSET MANAGEMENT SA-REG-S 4.37500% 17-11.04.27	1 748 000.00	1 963 768.76	0.03
USD SUZANO AUSTRIA GMBH 6.00000% 19-15.01.29	6 874 000.00	8 223 022.50	0.12
USD SUZANO AUSTRIA GMBH 5.00000% 19-15.01.30	1 435 000.00	1 616 900.60	0.02
USD SUZANO AUSTRIA GMBH 3.75000% 20-15.01.31	2 151 000.00	2 275 112.70	0.03
USD SUZANO AUSTRIA GMBH-REG-S 7.00000% 17-16.03.47	5 369 000.00	7 106 193.64	0.10
USD TAQA ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO-REG-S 3.62500% 12-12.01.23	912 000.00	963 015.00	0.01
USD TC ZIRAAT BANKASI AS-REG-S 5.37500% 21-02.03.26	4 820 000.00	4 820 000.00	0.07
USD TECPETROL SA-REG-S 4.87500% 17-12.12.22	4 979 000.00	4 748 721.25	0.07
USD TELECOM ARGENTINA SA-REG-S 8.00000% 19-18.07.26	1 095 000.00	952 650.00	0.01
USD TELECOM ARGENTINA SA-REG-S 8.50000% 20-06.08.25	692 000.00	612 420.00	0.01
USD TELEFONICA CELULAR DEL PARAGUAY-REG-S 5.87500% 19-15.04.27	20 146 000.00	21 379 942.50	0.30
USD TERMOCANDELARIA POWER LTD-REG-S 7.87500% 19-30.01.29	13 015 000.00	14 186 350.00	0.20
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 2.20000% 16-21.07.21	32 000.00	31 911.59	0.00
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 2.80000% 16-21.07.23	1 310 000.00	1 294 935.00	0.02
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 3.15000% 16-01.10.26	6 677 000.00	6 359 842.50	0.09
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 4.10000% 16-01.10.46	4 090 000.00	3 575 702.95	0.05
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 6.75000% 18-01.03.28	4 150 000.00	4 629 843.75	0.07
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 6.00000% 18-15.04.24	2 720 000.00	2 860 216.00	0.04
USD THIRD PAKISTAN INTERNATIONAL SUK-REG-S 5.62500% 17-05.12.22	4 688 000.00	4 819 850.00	0.07
USD TMK CAPITAL SA-REG-S 4.30000% 20-12.02.27	1 650 000.00	1 645 875.00	0.02
USD TOTAL PLAY TELECOMUNICACIONES SA-REG-S 7.50000% 20-12.11.25	4 250 000.00	4 186 356.25	0.06
USD TOWER BERSAMA INFRA TBK PT-REG-S 4.25000% 20-21.01.25	1 540 000.00	1 626 143.75	0.02
USD TOWER BERSAMA INFRA TBK PT-REG-S 2.75000% 21-20.01.26	750 000.00	763 125.00	0.01
USD TRANSNET SOC LTD-REG-S 4.00000% 12-26.07.22	2 000 000.00	2 040 000.00	0.03
USD TRANSPORTADORA DE GAS INTER-REG-S 5.55000% 18-01.11.28	9 293 000.00	10 805 900.40	0.15
USD TRANSPORTADORA DE GAS DEL SUR SA-REG-S 6.75000% 18-02.05.25	580 000.00	507 500.00	0.01
USD TRINIDAD & TOBAGO, REPUBLIC OF-REG-S 4.50000% 16-04.08.26	2 620 000.00	2 845 975.00	0.04
USD TRINIDAD & TOBAGO, REPUBLIC OF-REG-S 4.50000% 20-26.06.30	8 600 000.00	9 183 187.51	0.13
USD TRINIDAD GENERATION UNLTD-REG-S 5.25000% 16-04.11.27	3 475 000.00	3 665 256.25	0.05
USD TRINIDAD PETROLEUM HOLDINGS LTD-REG-S 9.75000% 19-15.06.26	4 450 000.00	5 082 734.37	0.07
USD TRUST F/1401-REG-S 4.86900% 19-15.01.30	1 655 000.00	1 848 014.38	0.03
USD TRUST F/1401-REG-S 5.25000% 14-15.12.24	2 794 000.00	3 089 395.65	0.04
USD TRUST F/1401-REG-S 5.25000% 15-30.01.26	600 000.00	673 350.00	0.01
USD TULLOW OIL PLC-REG-S-SUB 6.25000% 14-15.04.22	2 952 000.00	2 398 500.00	0.03
USD TUPRAS TURKIYE PETROL-REG-S 4.50000% 17-18.10.24	3 414 000.00	3 394 796.25	0.05
USD TURK SISE VE CAM FABRIKA-REG-S 6.95000% 19-14.03.26	1 980 000.00	2 192 231.25	0.03
USD TURK TELEKOMUNIKASYON AS-REG-S 6.87500% 19-28.02.25	726 000.00	798 600.00	0.01
USD TURKCELL ILETISIM HIZMETLERI AS-REG-S 5.80000% 18-11.04.28	7 027 000.00	7 474 971.25	0.11
USD TURKEY, REPUBLIC OF 7.37500% 05-05.02.25	524 000.00	584 096.25	0.01
USD TURKEY, REPUBLIC OF 6.87500% 06-17.03.36	290 000.00	309 484.37	0.00
USD TURKEY, REPUBLIC OF 6.00000% 11-14.01.41	5 930 000.00	5 666 856.25	0.08
USD TURKEY, REPUBLIC OF 3.25000% 13-23.03.23	480 000.00	479 100.00	0.01
USD TURKEY, REPUBLIC OF 4.87500% 13-16.04.43	19 988 000.00	16 889 860.00	0.24
USD TURKEY, REPUBLIC OF 4.87500% 16-09.10.26	3 000 000.00	3 033 750.00	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

2021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 TURKEY, REPUBLIC OF 6.00000% 17-25.03.27	2 566 000.00	2 721 563.75	0.04
USD TURKEY, REPUBLIC OF 5.75000% 17-11.05.47	12 103 000.00	11 085 591.56	0.16
USD TURKEY, REPUBLIC OF 5.12500% 18-17.02.28	568 000.00	573 680.00	0.01
USD TURKEY, REPUBLIC OF 6.35000% 19-10.08.24	6 752 000.00	7 228 860.00	0.10
USD TURKEY, REPUBLIC OF 5.60000% 19-14.11.24	11 725 000.00	12 318 578.13	0.17
USD TURKEY, REPUBLIC OF 4.25000% 20-13.03.25	1 693 000.00	1 696 174.37	0.02
USD TURKEY, REPUBLIC OF 5.25000% 20-13.03.30	8 900 000.00	8 819 343.75	0.12
USD TURKEY, REPUBLIC OF 5.95000% 20-15.01.31	32 568 000.00	33 382 200.00	0.47
USD TURKEY, REPUBLIC OF 4.75000% 21-26.01.26	1 888 000.00	1 913 960.00	0.03
USD TURKIYE GARANTI BANKASI AS-REG-S 5.25000% 12-13.09.22	1 633 000.00	1 663 108.44	0.02
USD TURKIYE GARANTI BANKASI AS-REG-S 5.87500% 17-16.03.23	2 190 000.00	2 270 071.87	0.03
USD TURKIYE IS BANKASI-REG-S 6.12500% 17-25.04.24	3 968 000.00	4 048 600.00	0.06
USD TURKIYE SINAI KALKINMA BANKASI AS-REG-S 6.00000% 20-23.01.25	667 000.00	675 962.81	0.01
USD TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO-REG-S 5.25000% 20-05.02.25	5 020 000.00	4 965 093.75	0.07
USD TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO-REG-S 6.50000% 20-08.01.26	6 845 000.00	7 084 575.00	0.10
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.21	521 000.00	536 467.19	0.01
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.22	3 580 000.00	3 792 562.50	0.05
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.23	15 249 000.00	16 611 879.37	0.23
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.24	10 645 000.00	11 722 806.25	0.17
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.25	15 401 000.00	17 167 302.20	0.24
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.26	11 947 000.00	13 403 040.62	0.19
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.27	5 700 000.00	6 371 531.26	0.09
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.37500% 17-25.09.32	14 300 000.00	15 323 343.74	0.22
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 8.99400% 18-01.02.24	5 573 000.00	6 269 625.00	0.09
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 9.75000% 18-01.11.28	1 655 000.00	2 005 135.93	0.03
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.25300% 20-15.03.33	5 609 000.00	5 964 820.94	0.08
USD ULKER BISKUVI SANAYI-REG-S 6.95000% 20-30.10.25	6 331 000.00	6 873 091.87	0.10
USD ULTRAPAR INTERNATIONAL SA-REG-S 5.25000% 19-06.06.29	589 000.00	641 089.69	0.01
USD UNIGEL LUXEMBOURG SA-REG-S 8.75000% 21-01.10.26	2 294 000.00	2 432 901.70	0.03
USD UPL CORP LTD-REG-S 4.50000% 18-08.03.28	1 520 000.00	1 606 925.00	0.02
USD URUGUAY, REPUBLIC OF 4.12500% 12-20.11.45	3 194 075.00	3 881 799.28	0.05
USD VALE OVERSEAS LTD 3.75000% 20-08.07.30	1 876 000.00	2 050 749.40	0.03
USD VALE OVERSEAS LTD 6.87500% 06-21.11.36	2 869 000.00	4 105 682.45	0.06
USD VALE OVERSEAS LTD 6.25000% 16-10.08.26	775 000.00	950 101.56	0.01
USD VEB FINANCE PLC-REG-S LPN 5.94200% 13-21.11.23	2 800 000.00	3 095 750.00	0.04
USD VEDANTA RESOURCES PLC-REG-S 7.12500% 13-31.05.23	1 346 000.00	1 131 901.88	0.02
USD VEDANTA RESOURCES PLC-REG-S 6.37500% 17-30.07.22	900 000.00	815 062.50	0.01
USD VEDANTA RESOURCES PLC-REG-S 6.12500% 17-09.08.24	2 420 000.00	1 833 150.00	0.03
USD VENEZUELA, REP. OF REG-S *DEFAULTED* 8.25000% 09-13.10.24	16 419 700.00	1 518 822.25	0.02
USD VENEZUELA, REP. OF-REG-S *DEFAULTED* 7.75000% 09-13.10.19	4 923 700.00	455 442.25	0.01
USD VEON HOLDINGS BV-REG-S 4.00000% 19-09.04.25	7 219 000.00	7 664 301.13	0.11
USD VFU FUNDING PLC VIA VF UKRAINE-REG-S 6.20000% 20-11.02.25	2 465 000.00	2 562 059.38	0.04
USD VIVO ENERGY INVEST BV-REG-S 5.12500% 20-24.09.27	890 000.00	942 009.38	0.01
USD VM HOLDING SA-REG-S 5.37500% 17-04.05.27	4 355 000.00	4 768 725.00	0.07
USD VOTORANTIM CIMENTOS INTL SA-REG-S 7.25000% 11-05.04.41	4 432 000.00	6 026 135.01	0.08
USD VTR COMUNICACION SPA-REG-S 5.12500% 20-15.01.28	2 249 000.00	2 396 590.63	0.03
USD VTR FINANCE NV-REG-S 6.37500% 20-15.07.28	3 644 000.00	3 953 831.11	0.06
USD WYNN MACAU LTD-REG-S 4.87500% 17-01.10.24	1 000 000.00	1 005 010.00	0.01
USD WYNN MACAU LTD-REG-S 5.50000% 20-15.01.26	4 866 000.00	5 008 427.82	0.07
USD WYNN MACAU LTD-REG-S 5.62500% 20-26.08.28	12 849 000.00	13 246 933.53	0.19
USD WYNN MACAU LTD-REG-S 5.62500% 20-26.08.28	1 866 000.00	1 925 562.72	0.03
USD YAPI VE KREDI BANKASI AS-REG-S-SUB 5.50000% 12-06.12.22	650 000.00	652 437.50	0.01
USD YINGDE GASES INVESTMENT LTD-REG-S 6.25000% 18-19.01.23	3 118 000.00	3 202 770.63	0.05
USD YPF SA-144A 8.50000% 20-23.03.25	1 295 000.00	1 061 900.00	0.00
USD YPF SA-REG-S 6.95000% 17-21.07.27	5 642 000.00	3 418 699.37	0.05
USD YPF SA-REG-S 7.00000% 17-15.12.47	1 954 000.00	1 102 788.75	0.02
USD YPF SA-REG-S 8.50000% 15-28.07.25	4 790 000.00	3 227 262.50	0.05
USD YPF SA-REG-S 8.50000% 16-23.03.21	1 175 000.00	1 069 367.50	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

2021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 YPF SA-REG-S 8.50000% 19-27.06.29	2 480 000.00	1 517 450.00	0.02
USD YPF SA-REG-S 8.50000% 20-23.03.25	1 777 000.00	1 457 140.00	0.02
USD YPF SA-REG-S 8.75000% 14-04.04.24	10 169 000.00	7 512 348.75	0.11
USD YUZHOU PROPERTIES CO LTD-REG-S 6.00000% 16-25.10.23	368 000.00	374 325.00	0.01
USD YUZHOU PROPERTIES CO LTD-REG-S 8.37500% 19-30.10.24	2 425 000.00	2 606 875.00	0.04
USD YUZHOU PROPERTIES CO LTD-REG-S 7.37500% 20-13.01.26	1 000 000.00	1 050 000.00	0.01
USD YUZHOU PROPERTIES CO LTD-REG-S 7.70000% 20-20.02.25	1 430 000.00	1 514 906.25	0.02
USD ZAMBIA, REPUBLIC OF-REG-S 8.50000% 14-14.04.24	3 030 000.00	1 613 475.00	0.02
USD ZAMBIA, REPUBLIC OF-REG-S 8.97000% 15-30.07.27	8 912 000.00	4 637 024.99	0.07
USD ZHONGAN ONLINE P&C INSUR CO LTD-REG-S 3.12500% 20-16.07.25	1 170 000.00	1 171 828.13	0.02
米ドル合計		3 637 660 625.46	51.33
ノート、固定利付債合計		3 778 993 518.19	53.32
ノート、ゼロ・クーポン			
EUR			
EUR PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 0.00000% 20-03.02.23	6 590 000.00	7 983 673.59	0.11
ユーロ合計		7 983 673.59	0.11
USD			
USD BIOCEANICO SOVEREIGN CERTIFICATE-REG-S 0.00000% 19-05.06.34	9 700 000.00	7 369 153.54	0.10
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 20-31.07.30	5 472 270.00	2 359 916.44	0.04
米ドル合計		9 729 069.98	0.14
ノート、ゼロ・クーポン合計		17 712 743.57	0.25
ノート、変動利付債			
USD			
USD AES GENER SA-REG-S-SUB 7.125%/VAR 19-26.03.79	3 257 000.00	3 578 628.75	0.05
USD AKBANK TAS-REG-S-SUB 6.797%/VAR 18-27.04.28	2 412 000.00	2 379 588.75	0.03
USD ALFA BD ISS OJSC ALFA BK-REG-S-SUB 5.950%/VAR 19-15.04.30	7 710 000.00	8 155 734.38	0.12
USD BANCO DE CREDITO DEL PERU-REG-S-SUB 3.125%/VAR 20-01.07.30	8 287 000.00	8 494 340.74	0.12
USD BANCO DO BRASIL CAYMAN-REG-S-SUB 6.250%/VAR 13-PRP	13 585 000.00	13 517 075.00	0.19
USD BANCO DO BRASIL CAYMAN-REG-S-SUB 9.000%/VAR 14-PRP	16 874 000.00	18 840 664.70	0.27
USD BANCO DO ESTADO DO RIO G-REG-S-SUB 5.37500%/VAR 21-28.01.31	4 990 000.00	4 967 545.00	0.07
USD BANCO MER DEL NORTE SA/GRAND CY-REG-S-SUB 7.625%/VAR 17-PRP	3 370 000.00	3 698 575.00	0.05
USD BANCO MERCANTIL DEL NORTE-REG-S-SUB 5.750%/VAR 16-04.10.31	3 410 000.00	3 623 125.00	0.05
USD BANCO MERCANTIL DEL NORTE SA-REG-S-SUB 8.375%/VAR 20-PRP	5 387 000.00	6 275 855.00	0.09
USD BANCO NACIONAL DE COM EXT-REG-S-SUB 3.800%/VAR 16-11.08.26	1 960 000.00	1 960 000.00	0.03
USD BANCO SANTANDER SA-REG-S-SUB 5.950%/VAR 18-01.10.28	2 660 000.00	2 889 957.00	0.04
USD BANCOLOMBIA SA-SUB 4.875%/VAR 17-18.10.27	756 000.00	768 285.00	0.01
USD BANK LEUMI ISRAEL BM-144A-REG-S-SUB 3.275%/VAR 20-29.01.31	9 599 000.00	10 034 890.59	0.14
USD BBVA BANCOMER SA/TEXAS-REG-S-SUB 5.125%/VAR 18-18.01.33	14 644 000.00	15 524 104.40	0.22
USD BBVA BANCOMER SA/TEXAS-REG-S-SUB 5.875%/VAR 19-13.09.34	2 278 000.00	2 556 343.12	0.04
USD BLOSSOM JOY LTD-REG-S-SUB 3.100%/VAR 20-PRP	568 000.00	571 550.00	0.01
USD BRASKEM NETHERLANDS FINANCE-REG-S-SUB 8.500%/VAR 20-23.01.81	6 375 000.00	7 047 084.38	0.10
USD BURGAN BANK SAK-REG-S-SUB 2.750%/VAR 20-15.12.31	1 684 000.00	1 652 846.00	0.02
USD CHINA DEV BANK FIN LEASING-REG-S-SUB 2.875%/VAR 20-28.09.30	750 000.00	767 797.50	0.01
USD CHINA HUADIAN OVERSEAS DEVP MANG-REG-S 4.000%/VAR 19-PRP	222 000.00	230 116.88	0.00
USD CK HUTCHISON CAPITAL SEC 17 LTD-REG-S-SUB 4.000%/VAR 17-PRP	6 789 000.00	6 895 078.12	0.10
USD CORP FINANCIERA DE DESARROL-REG-S-SUB 5.250%/VAR 14-15.07.29	880 000.00	953 975.00	0.01
USD CREDIT BK MOSCOW/CBOM FIN-REG-S-SUB 7.500%/VAR 17-05.10.27	11 470 000.00	11 326 625.00	0.16
USD DP WORLD SALAAM-REG-S-SUB 6.000%/VAR 20-PRP	8 390 000.00	9 176 562.50	0.13
USD GAZPROM PJSC VIA GAZ FIN PLC-REG-S-SUB 4.598%/VAR 20-PRP	2 923 000.00	3 003 382.50	0.04
USD GRUPO BIMBO SA DE CV-REG-S-SUB 5.950%/VAR 18-PRP	3 050 000.00	3 253 968.75	0.05
USD HANWHA LIFE INSURANCE CO-REG-S-SUB 4.700%/VAR 18-23.04.48	2 783 000.00	2 894 320.00	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

2021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 ITAU UNIBANCO HOLDING SA-144A-SUB 3.875%/VAR 21-15.04.31	1 490 000.00	1 489 031.50	0.02
USD ITAU UNIBANCO HOLDING SA-REG-S-SUB 3.875%/VAR 21-15.04.31	1 090 000.00	1 089 291.50	0.02
USD ITAU UNIBANCO HOLDING SA-REG-S-SUB 4.500%/VAR 19-21.11.29	6 179 000.00	6 338 109.25	0.09
USD MINMETALS BOUNTIOUS FIN BVI LTD-REG-S 3.375%/VAR 20-PRP	3 778 000.00	3 839 392.50	0.05
USD MONGOLIAN MINING CORP (PIK) VAR 17-PRP	1 235 901.00	432 627.15	0.01
USD NANYANG COMMERCIAL BANK LTD-REG-S-SUB 3.800%/VAR 19-20.11.29	800 000.00	839 884.96	0.01
USD NBK TIER 2 LTD-REG-S-SUB 2.500%/VAR 20-24.11.30	7 840 000.00	7 908 600.00	0.11
USD OVERSEA-CHINESE BKNG-REG-S-SUB 1.832%/VAR 20-10.09.30	1 226 000.00	1 240 383.68	0.02
USD PETROLEOS MEXICANOS 3M LIBOR+365BP 18-11.03.22	1 137 000.00	1 149 507.00	0.02
USD TURKIYE GARANTI BANK AS-REG-S-SUB 6.125%/VAR 17-24.05.27	1 013 000.00	1 005 402.50	0.01
USD YAPI VE KREDI BANKASI AS-REG-S-SUB 7.875%/VAR 21-22.01.31	10 590 000.00	10 854 750.00	0.15
米ドル合計		191 224 999.10	2.70
ノート、変動利付債合計		191 224 999.10	2.70
中期債券、固定利付債			
EUR			
EUR EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 5.62500% 18-16.04.30	11 216 000.00	14 064 915.52	0.20
EUR EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 4.75000% 18-16.04.26	2 650 000.00	3 354 300.93	0.05
EUR EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 4.75000% 19-11.04.25	5 852 000.00	7 427 304.82	0.10
EUR EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 6.37500% 19-11.04.31	6 147 000.00	7 974 413.38	0.11
EUR INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 3.75000% 16-14.06.28	816 000.00	1 197 065.27	0.02
EUR KAZAKHSTAN, REPUBLIC OF-REG-S 2.37500% 18-09.11.28	2 546 000.00	3 498 142.82	0.05
EUR KAZAKHSTAN, REPUBLIC OF-REG-S 1.55000% 18-09.11.23	5 130 000.00	6 450 572.30	0.09
EUR KAZAKHSTAN, REPUBLIC OF-REG-S 0.60000% 19-30.09.26	3 530 000.00	4 287 256.81	0.06
EUR NE PROPERTY BV-REG-S 2.62500% 19-22.05.23	1 980 000.00	2 494 956.60	0.04
EUR NE PROPERTY BV-REG-S 1.87500% 19-09.10.26	3 060 000.00	3 743 152.46	0.05
EUR NE PROPERTY COOPERATIEF UA-REG-S 1.75000% 17-23.11.24	2 040 000.00	2 537 257.91	0.04
EUR PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 5.12500% 16-15.03.23	3 520 000.00	4 424 787.29	0.06
EUR PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 0.87500% 19-17.05.27	5 080 000.00	6 287 411.22	0.09
EUR PPF ARENA 1 BV-REG-S 2.12500% 19-31.01.25	1 057 000.00	1 307 559.34	0.02
EUR PPF TELECOM GROUP BV-REG-S 3.25000% 20-29.09.27	2 055 000.00	2 687 486.06	0.04
EUR PROSUS NV-REG-S 2.03100% 20-03.08.32	2 404 000.00	3 044 745.93	0.04
EUR ROMANIA-REG-S 2.00000% 20-28.01.32	5 628 000.00	7 115 228.90	0.10
EUR ROMANIA-REG-S 2.12400% 19-16.07.31	220 000.00	283 147.64	0.00
EUR ROMANIA-REG-S 2.37500% 17-19.04.27	1 180 000.00	1 562 604.38	0.02
EUR ROMANIA-REG-S 2.50000% 18-08.02.30	3 040 000.00	4 040 696.66	0.06
EUR ROMANIA-REG-S 2.87500% 18-11.03.29	3 530 000.00	4 835 393.12	0.07
EUR ROMANIA-REG-S 3.37500% 20-28.01.50	11 016 000.00	15 039 526.53	0.21
EUR ROMANIA-REG-S 4.12500% 18-11.03.39	3 090 000.00	4 671 434.77	0.07
EUR ROMANIA-REG-S 4.62500% 19-03.04.49	10 620 000.00	17 301 094.75	0.24
ユーロ合計		129 630 455.41	1.83
USD			
USD ABQ FINANCE LTD-REG-S 3.12500% 19-24.09.24	3 815 000.00	4 004 557.81	0.06
USD ABU DHABI, EMIRATE OF-REG-S 3.87500% 20-16.04.50	7 209 000.00	8 560 687.50	0.12
USD ABU DHABI, EMIRATE OF-REG-S 2.70000% 20-02.09.70	803 000.00	736 501.56	0.01
USD ACCESS BANK PLC-REG-S 10.50000% 16-19.10.21	9 307 000.00	9 749 082.50	0.14
USD AFRICA FINANCE CORP-REG-S 4.37500% 19-17.04.26	8 921 000.00	9 791 689.60	0.14
USD AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK-REG-S 4.12500% 17-20.06.24	2 424 000.00	2 609 145.12	0.04
USD AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK-REG-S 5.25000% 18-11.10.23	2 580 000.00	2 832 220.80	0.04
USD AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK/THE-REG-S 3.99400% 19-21.09.29	1 062 000.00	1 150 740.72	0.02
USD ALDAR SUKUK NO 2 LTD-REG-S 3.87500% 19-22.10.29	5 555 000.00	6 017 453.75	0.08
USD AMIPEACE LTD-REG-S 2.25000% 20-22.10.30	3 380 000.00	3 359 290.40	0.05
USD ANGOLAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 8.00000% 19-26.11.29	12 955 000.00	12 789 014.07	0.18
USD ANGOLAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 9.12500% 19-26.11.49	21 960 000.00	21 328 650.00	0.30
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF 6.62500% 17-06.07.28	0.00	100 762.31	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 - エマージング・マーケット・デッド

2021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 AXIATA SPV2 BHD-REG-S 2.16300% 20-19.08.30	491 000.00	492 380.93	0.01
USD AXIATA SPV5 LABUAN LTD-REG-S 3.06400% 20-19.08.50	1 230 000.00	1 210 396.87	0.02
USD AZURE POWER SOLAR ENERGY PVT LTD-REG-S 5.65000% 19-24.12.24	1 870 000.00	1 986 875.00	0.03
USD BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.25000% 21-25.01.33	1 780 000.00	1 771 100.00	0.03
USD BAHRAIN, KINGDOM OF-REG-S 4.25000% 21-25.01.28	2 030 000.00	2 032 537.50	0.03
USD BANCO BRADESCO SA GRAND CY BR-REG-S 3.20000% 20-27.01.25	1 708 000.00	1 774 697.40	0.03
USD BANCO DO BRASIL SA/CAYMAN-REG-S 4.75000% 19-20.03.24	2 960 000.00	3 172 972.00	0.04
USD BANCO DO BRASIL SA/CAYMAN-REG-S 4.62500% 17-15.01.25	517 000.00	556 421.25	0.01
USD BANCO VOTORANTIM SA-REG-S 4.50000% 19-24.09.24	1 480 000.00	1 564 637.50	0.02
USD BANK MANDIRI PERSERO TBK PT-REG-S 3.75000% 19-11.04.24	3 699 000.00	3 916 316.25	0.06
USD BANK MANDIRI PERSERO TBK PT-REG-S 4.75000% 20-13.05.25	1 956 000.00	2 167 492.50	0.03
USD BANK OF CHINA LTD-REG-S-SUB 5.00000% 14-13.11.24	3 977 000.00	4 471 639.38	0.06
USD BANK OF THE PHILIPPINE ISLANDS-REG-S 4.25000% 18-04.09.23	762 000.00	825 579.37	0.01
USD BDO UNIBANK INC-REG-S 2.95000% 17-06.03.23	150 000.00	155 765.62	0.00
USD BDO UNIBANK INC-REG-S 2.12500% 20-13.01.26	960 000.00	987 600.00	0.01
USD BHARAT PETROLEUM CORP LTD-REG-S 4.37500% 19-24.01.22	3 059 000.00	3 131 467.71	0.04
USD BOC AVIATION LTD-REG-S 3.50000% 17-18.09.27	391 000.00	423 379.69	0.01
USD BOC AVIATION LTD-REG-S 3.00000% 19-11.09.29	3 250 000.00	3 348 885.48	0.05
USD CBQ FINANCE LTD-REG-S 5.00000% 18-24.05.23	1 700 000.00	1 839 187.50	0.03
USD CCBL CAYMAN 1 CORP LTD-REG-S 3.50000% 19-16.05.24	900 000.00	957 656.25	0.01
USD CHARMING LIGHT INVESTMENTS LTD-REG-S 4.37500% 17-21.12.27	500 000.00	568 593.75	0.01
USD CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT-REG-S 2.50000% 21-20.01.28	660 000.00	666 101.83	0.01
USD CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD-REG-S 3.00000% 21-20.01.31	2 770 000.00	2 824 478.79	0.04
USD CHINA CINDA FINANCE 2017 I LTD-REG-S 4.75000% 18-08.02.28	810 000.00	929 981.25	0.01
USD CHINA CINDA FINANCE 2017 I LTD-REG-S 4.75000% 19-21.02.29	250 000.00	288 984.37	0.00
USD CHINA RESOURCES LAND LTD-REG-S 4.12500% 19-26.02.29	429 000.00	471 095.62	0.01
USD CICC HONG KONG FIN 2016 MTN LTD-REG-S 2.00000% 21-26.01.26	875 000.00	878 163.57	0.01
USD CMB INTERNATIONAL LEASING MGT LTD-REG-S 1.87500% 20-12.08.25	960 000.00	955 315.20	0.01
USD CMB INTERNATIONAL LEASING MGT LTD-REG-S 2.75000% 20-12.08.30	459 000.00	451 828.12	0.01
USD DP WORLD CRESCENT LTD-REG-S 4.84800% 18-26.09.28	4 210 000.00	4 877 495.50	0.07
USD DP WORLD CRESCENT LTD-REG-S 3.87500% 19-18.07.29	4 908 000.00	5 354 321.24	0.08
USD DP WORLD CRESCENT LTD-REG-S 3.75000% 19-30.01.30	2 152 000.00	2 334 247.49	0.03
USD DP WORLD PLC-144A 6.85000% 07-02.07.37	330 000.00	446 737.50	0.01
USD DP WORLD PLC-REG-S 4.70000% 19-30.09.49	200 000.00	222 250.00	0.00
USD DP WORLD PLC-REG-S 5.62500% 18-25.09.48	5 754 000.00	7 158 335.63	0.10
USD DP WORLD PLC-REG-S 6.85000% 07-02.07.37	1 550 000.00	2 098 312.50	0.03
USD DUBAI DOF SUKUK LTD-REG-S 2.76300% 20-09.09.30	1 700 000.00	1 740 494.00	0.02
USD DUBAI, GOVERNMENT OF-REG-S 3.90000% 20-09.09.50	2 250 000.00	2 169 140.63	0.03
USD EASTERN AND SOUTHERN AFRICAN TRAD-REG-S 4.87500% 19-23.05.24	2 672 000.00	2 851 772.16	0.04
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 8.50000% 17-31.01.47	12 190 000.00	13 355 668.74	0.19
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.50000% 17-31.01.27	6 800 000.00	7 839 125.00	0.11
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.60030% 19-01.03.29	3 367 000.00	3 783 666.25	0.05
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 8.70020% 19-01.03.49	2 178 000.00	2 415 538.13	0.03
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.05290% 19-15.01.32	9 140 000.00	9 745 525.00	0.14
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 8.15000% 19-20.11.59	8 738 000.00	9 256 818.74	0.13
USD EMAAR SUKUK LTD-REG-S 3.87500% 19-17.09.29	998 000.00	1 012 346.25	0.01
USD EMIRATES DEVELOPMENT BANK PJSC-REG-S 3.51600% 19-06.03.24	1 700 000.00	1 818 468.75	0.03
USD EMIRATES NBD BANK PJSC-REG-S 2.62500% 20-18.02.25	565 000.00	595 192.19	0.01
USD EQUATE PETROCHEMICAL BV-REG-S 4.25000% 16-03.11.26	5 440 000.00	6 006 100.00	0.08
USD ESKOM HOLDINGS SOC LTD-REG-S 8.45000% 18-10.08.28	522 000.00	586 923.75	0.01
USD ESKOM HOLDINGS SOC LTD-REG-S 6.35000% 18-10.08.28	4 774 000.00	5 275 270.00	0.07
USD EXPORT CREDIT BANK OF TURKEY-REG-S 5.37500% 16-08.02.21	1 220 000.00	1 221 708.00	0.02
USD EXPORT-IMPORT BANK OF INDIA-REG-S 2.25000% 21-13.01.31	838 000.00	807 384.09	0.01
USD EXPORT-IMPORT BANK OF INDIA-REG-S 4.00000% 13-14.01.23	1 001 000.00	1 053 917.37	0.01
USD FAR EAST HORIZON LTD-REG-S 3.37500% 20-18.02.25	790 000.00	786 050.00	0.01
USD FINANCE DEPRTMENT GOVT OF SHARJAH-REG-S 4.00000% 20-28.07.50	14 904 000.00	14 978 520.00	0.21
USD FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 3.00000% 17-30.03.22	505 000.00	518 729.68	0.01
USD GLP CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 4.97400% 19-26.02.24	6 185 000.00	6 643 076.56	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 - エマージング・マーケット・デッド

2021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 GOODMAN HK FINANCE-REG-S 3.00000% 20-22.07.30	825 000.00	848 380.50	0.01
USD GREENLAND GLOBAL INVESTMENT LTD-REG-S 6.75000% 19-25.06.22	800 000.00	761 000.00	0.01
USD GREENLAND GLOBAL INVESTMENT LTD-REG-S 6.25000% 20-16.12.22	2 951 000.00	2 788 695.00	0.04
USD GULF INTERNATIONAL BANK BSC-REG-S 2.37500% 20-23.09.25	1 621 000.00	1 640 755.94	0.02
USD HLP FINANCE LTD-REG-S 4.75000% 12-25.06.22	500 000.00	521 445.00	0.01
USD HONGKONG ELECTRIC FINANCE LTD-REG-S 2.25000% 20-09.06.30	1 330 000.00	1 353 231.24	0.02
USD HONGKONG ELECTRIC FINANCE LTD-REG-S 1.87500% 20-27.08.30	1 006 000.00	994 808.43	0.01
USD HPCL MITTAL ENERGY LTD-REG-S 5.45000% 19-22.10.26	644 000.00	673 785.00	0.01
USD HUARONG FINANCE 2017 CO-REG-S 4.25000% 17-07.11.27	770 000.00	855 903.12	0.01
USD HUARONG FINANCE II CO LTD-REG-S 5.50000% 15-16.01.25	1 170 000.00	1 317 686.88	0.02
USD HUARONG FINANCE II CO LTD-REG-S 4.87500% 16-22.11.26	950 000.00	1 078 848.50	0.02
USD HUARONG FINANCE-REG-S 4.50000% 19-29.05.29	1 001 000.00	1 099 848.75	0.02
USD HUARONG FINANCE-REG-S 3.87500% 19-13.11.29	3 650 000.00	3 855 312.50	0.05
USD HUARONG FINANCE-REG-S 3.62500% 20-30.09.30	1 330 000.00	1 383 226.60	0.02
USD HUAXIN CEMENT INTL FINANCE CO LTD-REG-S 2.25000% 20-19.11.25	5 650 000.00	5 565 388.43	0.08
USD HUTAMA KARYA PERSERO PT-REG-S 3.75000% 20-11.05.30	3 664 000.00	4 034 980.00	0.06
USD HYSAN MTN LTD-REG-S 2.87500% 20-02.06.27	891 000.00	951 069.61	0.01
USD ICD SUKUK CO LTD-REG-S 5.00000% 17-01.02.27	4 935 000.00	5 439 295.31	0.08
USD INDIAN RAILWAY FINANCE CORP LTD-REG-S 3.24900% 20-13.02.30	2 100 000.00	2 201 062.50	0.03
USD INDIAN RAILWAY FINANCE CORP LTD-REG-S 3.95000% 20-13.02.50	1 160 000.00	1 146 225.00	0.02
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 6.75000% 14-15.01.44	2 570 000.00	3 936 115.63	0.06
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.12500% 15-15.01.45	5 643 000.00	7 224 803.44	0.10
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 5.95000% 15-08.01.46	775 000.00	1 104 617.18	0.02
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 4.75000% 17-18.07.47	733 000.00	908 003.75	0.01
USD ISRAEL ELECTRIC CORP LTD-144A-REG-S 4.25000% 18-14.08.28	860 000.00	977 183.60	0.01
USD KAZAKHSTAN, REPUBLIC OF-REG-S 6.50000% 15-21.07.45	1 160 000.00	1 826 637.50	0.03
USD KINGDOM OF SAUDI ARABIA-REG-S 2.25000% 21-02.02.33	11 894 000.00	11 763 909.38	0.17
USD KSA SUKUK LTD-REG-S 4.30300% 18-19.01.29	6 090 000.00	7 102 462.50	0.10
USD KSA SUKUK LTD-REG-S 2.96900% 19-29.10.29	10 820 000.00	11 604 450.00	0.16
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 8.25000% 06-12.04.21	5 737 000.00	659 755.00	0.01
USD LEBANON, REPUBLIC OF *DEFAULT* 6.37500% 10-09.03.20	24 931 000.00	2 984 240.70	0.04
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.10000% 10-04.10.22	7 280 000.00	837 200.00	0.01
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.60000% 11-27.11.26	7 709 000.00	886 535.00	0.01
USD LEBANON, REPUBLIC OF *DEFAULTED* 6.15000% 13-19.06.20	10 027 000.00	1 175 227.57	0.02
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 5.80000% 14-14.04.20	3 658 000.00	428 740.64	0.01
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 7.00000% 17-20.03.28	270 000.00	28 350.00	0.00
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 7.15000% 17-20.11.31	180 000.00	18 000.00	0.00
USD LENOVO GROUP LTD-REG-S 5.87500% 20-24.04.25	750 000.00	856 875.00	0.01
USD MANAPPURAM FINANCE LTD-REG-S 5.90000% 20-13.01.23	10 153 000.00	10 495 663.75	0.15
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 4.50000% 18-07.11.28	1 297 000.00	1 542 214.06	0.02
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 2.87500% 19-07.11.29	6 010 000.00	6 428 821.88	0.09
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 3.70000% 19-07.11.49	7 574 000.00	8 299 210.50	0.12
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 3.95000% 20-21.05.50	4 342 000.00	4 977 017.50	0.07
USD MEGLOBAL CANADA INC-REG-S 5.87500% 20-18.05.30	1 165 000.00	1 445 328.12	0.02
USD MEGLOBAL CANADA INC-REG-S 5.00000% 20-18.05.25	17 782 000.00	19 815 816.26	0.28
USD METROPOLITAN BANK & TRUST CO-REG-S 2.12500% 20-15.01.26	3 055 000.00	3 131 375.00	0.04
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.75000% 12-08.03.44	2 744 000.00	3 092 145.00	0.04
USD MEXICO, UNITED STATES OF 5.55000% 14-21.01.45	863 000.00	1 074 435.00	0.02
USD MEXICO, UNITED STATES OF 3.75000% 21-19.04.71	4 649 000.00	4 356 984.69	0.06
USD MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 8.75000% 17-09.03.24	10 244 000.00	11 854 228.75	0.17
USD MTR CORP LTD-REG-S 1.62500% 20-19.08.30	1 200 000.00	1 176 126.58	0.02
USD MUTHOOT FINANCE LTD-REG-S 6.12500% 19-31.10.22	1 500 000.00	1 572 187.50	0.02
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 6.50000% 17-28.11.27	15 661 000.00	16 855 151.25	0.24
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.62500% 17-28.11.47	9 688 000.00	10 066 437.50	0.14
USD NTPC LTD-REG-S 3.75000% 19-03.04.24	2 564 000.00	2 705 821.25	0.04
USD NWD MTN LTD-REG-S 4.50000% 20-19.05.30	206 000.00	217 381.50	0.00
USD OVERSEA-CHINESE BANKING CORP-REG-S-SUB 4.25000% 14-19.06.24	2 900 000.00	3 184 562.50	0.05
USD PANAMA, REPUBLIC OF 9.37500% 99-01.04.29	12 596 000.00	19 271 880.00	0.27

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

2021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	PERTAMINA PERSERO PT-REG-S 4.70000% 19-30.07.49	1 300 000.00	1 468 593.75	0.02
USD	PERTAMINA PERSERO PT-REG-S 4.17500% 20-21.01.50	6 103 000.00	6 524 488.43	0.09
USD	PERTAMINA PERSERO PT-REG-S 3.10000% 20-27.08.30	2 000 000.00	2 125 220.00	0.03
USD	PERTAMINA PT-144A 6.45000% 14-30.05.44	1 710 000.00	2 298 881.24	0.03
USD	PERTAMINA PT-REG-S 6.45000% 14-30.05.44	1 843 000.00	2 477 683.13	0.04
USD	PERTAMINA PT-REG-S 6.50000% 18-07.11.48	2 006 000.00	2 790 847.50	0.04
USD	PERU PERS PT PERSUSAHAAN LIST NEG-REG-S 4.00000% 20-30.06.50	8 188 000.00	8 344 083.76	0.12
USD	PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 4.12500% 17-15.05.27	2 500 000.00	2 750 781.25	0.04
USD	PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 5.25000% 17-15.05.47	4 183 000.00	4 869 273.44	0.07
USD	PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 5.45000% 18-21.05.28	1 253 000.00	1 496 943.44	0.02
USD	PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 6.15000% 18-21.05.48	3 810 000.00	4 970 859.38	0.07
USD	PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 4.37500% 19-05.02.50	823 000.00	876 495.00	0.01
USD	PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 4.45000% 19-20.02.29	13 380 000.00	15 671 325.00	0.22
USD	PETROLEOS MEXICANOS 4.50000% 16-23.01.26	2 066 000.00	2 039 529.38	0.03
USD	PETROLEOS MEXICANOS 5.62500% 16-23.01.46	1 750 000.00	1 417 150.00	0.02
USD	PETROLEOS MEXICANOS 6.87500% 17-04.08.26	14 572 000.00	15 610 255.00	0.22
USD	PETROLEOS MEXICANOS 6.75000% 17-21.09.47	7 616 000.00	6 641 152.00	0.09
USD	PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 4.50000% 15-18.03.45	4 500 000.00	5 826 093.75	0.08
USD	PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 3.50000% 20-21.04.30	3 807 000.00	4 280 210.10	0.06
USD	PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 4.55000% 20-21.04.50	8 084 000.00	10 395 518.74	0.15
USD	PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 4.80000% 20-21.04.60	2 929 000.00	4 063 987.50	0.06
USD	PHILIPPINE NATIONAL BANK-REG-S 3.28000% 19-27.09.24	4 027 000.00	4 253 518.75	0.06
USD	PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 10.62500% 00-16.03.25	628 000.00	884 695.00	0.01
USD	POWER FINANCE CORP LTD-REG-S 6.15000% 18-06.12.28	800 000.00	958 000.00	0.01
USD	POWER FINANCE CORP LTD-REG-S 3.95000% 20-23.04.30	892 000.00	937 157.50	0.01
USD	PSA TREASURY PTE LTD-REG-S 2.12500% 19-05.09.29	1 445 000.00	1 500 040.05	0.02
USD	PTT TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 3.70000% 20-16.07.70	3 650 000.00	3 855 312.50	0.05
USD	PTTEP TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 3.90300% 19-06.12.59	2 924 000.00	3 263 915.00	0.05
USD	PTTEP TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 2.99300% 20-15.01.30	4 090 000.00	4 308 559.38	0.06
USD	PTTEP TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 2.58700% 20-10.06.27	1 750 000.00	1 849 531.25	0.03
USD	QNB FINANCE LTD-REG-S 2.12500% 16-07.09.21	2 147 000.00	2 161 089.69	0.03
USD	QNB FINANCE LTD-REG-S 3.50000% 19-28.03.24	1 480 000.00	1 585 450.00	0.02
USD	QNB FINANCE LTD-REG-S 2.75000% 20-12.02.27	2 605 000.00	2 759 671.87	0.04
USD	QNB FINANCE LTD-REG-S 2.62500% 20-12.05.25	1 631 000.00	1 712 550.00	0.02
USD	QNB FINANSBANK AS-REG-S 4.87500% 17-19.05.22	1 909 000.00	1 941 810.94	0.03
USD	REPUBLIC OF UZBEKISTAN BOND-REG-S 5.37500% 19-20.02.29	3 775 000.00	4 326 150.00	0.06
USD	REPUBLIC OF UZBEKISTAN BOND-REG-S 4.75000% 19-20.02.24	5 202 000.00	5 599 953.00	0.08
USD	REPUBLIC OF UZBEKISTAN BOND-REG-S 3.70000% 20-25.11.30	1 525 000.00	1 576 850.00	0.02
USD	RHB BANK BHD-REG-S 3.76600% 19-19.02.24	2 762 000.00	2 966 560.63	0.04
USD	RIZAL COMMERCIAL BANKING CORP-REG-S 4.12500% 18-16.03.23	2 935 000.00	3 101 619.95	0.04
USD	RIZAL COMMERCIAL BANKING CORP-REG-S 3.00000% 19-11.09.24	2 830 000.00	2 943 200.00	0.04
USD	ROMANIA-REG-S 6.12500% 14-22.01.44	882 000.00	1 215 230.62	0.02
USD	SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 3.50000% 19-16.04.29	6 300 000.00	6 920 550.00	0.10
USD	SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 4.25000% 19-16.04.39	17 326 000.00	19 740 811.25	0.28
USD	SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 4.37500% 19-16.04.49	1 000 000.00	1 172 187.50	0.02
USD	SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 4.50000% 16-26.10.46	3 180 000.00	3 736 500.00	0.05
USD	SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 4.62500% 17-04.10.47	4 556 000.00	5 450 115.00	0.08
USD	SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 5.00000% 18-17.04.49	2 283 000.00	2 890 848.75	0.04
USD	SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 2.75000% 20-03.02.32	16 569 000.00	17 211 048.75	0.24
USD	SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 3.75000% 20-21.01.55	12 368 000.00	13 055 970.00	0.18
USD	SAUDI GOVERNMENT INTER-REG-S 4.50000% 20-22.04.60	9 426 000.00	11 331 819.38	0.16
USD	SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 3.45000% 21-02.02.61	24 717 000.00	24 693 827.82	0.35
USD	SHARJAH SUKUK PROGRAM LTD-REG-S 4.22600% 18-14.03.28	2 570 000.00	2 854 306.25	0.04
USD	SHARJAH SUKUK PROGRAM LTD-REG-S 3.85400% 19-03.04.26	2 830 000.00	3 064 359.38	0.04
USD	SHINHAN BANK CO LTD-REG-S-SUB 4.00000% 19-23.04.29	1 306 000.00	1 483 534.37	0.02
USD	SHINHAN BANK-REG-S-SUB 4.50000% 18-26.03.28	2 210 000.00	2 542 190.63	0.04
USD	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD-REG-S 4.40000% 21-13.03.24	3 840 000.00	3 811 200.00	0.05
USD	SIAM COMMERCIAL BK CAYMAN ISLAND-REG-S 3.90000% 19-11.02.24	2 449 000.00	2 646 450.63	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

2021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 OIL OF THE AZERBAIJAN REP-REG-S 4.75000% 13-13.03.23	9 140 000.00	9 705 537.50	0.14
USD SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD-REG-S 3.75000% 19-25.02.29	3 729 000.00	4 155 504.37	0.06
USD TBC BANK JSC-REG-S 5.75000% 19-19.06.24	4 245 000.00	4 445 310.93	0.06
USD TC ZIRAAT BANKASI AS-REG-S 4.75000% 16-29.04.21	3 314 000.00	3 322 285.00	0.05
USD TC ZIRAAT BANKASI AS-REG-S 5.12500% 17-03.05.22	850 000.00	851 859.37	0.01
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.59500% 18-19.01.28	2 050 000.00	2 241 203.50	0.03
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.97500% 19-11.04.29	890 000.00	1 002 918.75	0.01
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 2.39000% 20-03.06.30	8 679 000.00	8 757 653.44	0.12
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.24000% 20-03.06.50	736 000.00	734 620.00	0.01
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.29000% 20-03.06.60	238 000.00	236 140.63	0.00
USD THAIOIL TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 4.62500% 18-20.11.28	3 388 000.00	3 917 375.00	0.06
USD THAIOIL TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 5.37500% 18-20.11.48	1 157 000.00	1 419 132.81	0.02
USD THAIOIL TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 3.75000% 20-18.06.50	2 700 000.00	2 658 285.00	0.04
USD TRAFIGURA FUNDING SA-REG-S 5.87500% 20-23.09.25	200 000.00	208 483.20	0.00
USD TURKIYE SINAI KALKINMA BANKASI AS-REG-S 5.87500% 21-14.01.26	4 834 000.00	4 870 255.00	0.07
USD UNION BANK OF THE PHILIPPINES-REG-S 2.12500% 20-22.10.25	1 732 000.00	1 770 970.00	0.03
USD VEON HOLDINGS BV-REG-S 3.37500% 20-25.11.27	3 559 000.00	3 646 266.68	0.05
USD YAPI VE KREDI BANKASI AS-REG-S 5.85000% 17-21.06.24	280 000.00	287 087.50	0.00
USD YAPI VE KREDI BANKASI AS-REG-S 6.10000% 18-16.03.23	3 810 000.00	3 893 343.75	0.06
USD YAPI VE KREDI BANKASI AS-REG-S 8.25000% 19-15.10.24	10 625 000.00	11 687 500.00	0.17
USD YES BANK IFSC BANKING UNIT BR-REG-S 3.75000% 18-06.02.23	11 654 000.00	11 420 919.99	0.16
USD ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD-REG-S 8.65000% 19-21.01.23	1 072 000.00	1 109 185.00	0.02
米ドル合計		834 786 100.83	11.78
中期債券、固定利付債合計		964 416 556.24	13.61
中期債券、変動利付債			
EUR			
EUR OTP BANK NYRT-REG-S-SUB 2.875%/VAR 19-15.07.29	8 180 000.00	10 037 260.83	0.14
ユーロ合計		10 037 260.83	0.14
USD			
USD BANGKOK BANK PCL/HONG KONG-REG-S-SUB 3.733%/VAR 19-25.09.34	6 738 000.00	7 047 526.88	0.10
USD BANGKOK BANK PCL/HONG KONG-REG-S-SUB 5.000%/VAR 20-PRP	8 240 000.00	8 693 200.00	0.12
USD BANK OF EAST ASIA LTD-REG-S-SUB 5.825%/VAR 20-PRP	1 303 000.00	1 382 873.90	0.02
USD DBS GROUP HOLDINGS LTD-REG-S-SUB 4.520%/VAR 18-11.12.28	1 505 000.00	1 641 157.35	0.02
USD DBS GROUP HOLDINGS LTD-REG-S-SUB 3.300%/VAR 20-PRP	3 450 000.00	3 531 937.50	0.05
USD DIANJIAN HAIYU LTD-REG-S 4.300%/VAR 19-PRP	617 000.00	635 895.63	0.01
USD FAR EAST HORIZON LTD-REG-S 4.350%/VAR 17-PRP	1 900 000.00	1 871 500.00	0.03
USD HUARONG FINANCE 2017 CO-REG-S 4.000%/VAR 17-PRP	3 003 000.00	3 059 306.25	0.04
USD KASIKORNBANK PCL/HONG KONG-REG-S-SUB 3.343%/VAR 19-02.10.31	10 260 000.00	10 750 556.25	0.15
USD KOOKMIN BANK-REG-S-SUB 4.350%/VAR 19-PRP	709 000.00	747 773.44	0.01
USD LEADER GOAL INTERNATIONAL LTD-REG-S 4.250%/VAR 18-PRP	500 000.00	509 375.00	0.01
USD PARKWAY PANTAI LTD-REG-S 4.250%/VAR 17-PRP	4 311 000.00	4 311 000.00	0.06
USD QIB SUKUK LTD-REG-S 3M LIBOR+135BP 20-07.02.25	3 310 000.00	3 312 068.75	0.05
USD QNB FINANCE LTD-REG-S 3M LIBOR+135BP 18-31.05.21	2 375 000.00	2 377 226.56	0.03
USD SAN MIGUEL CORP-REG-S 5.500%/VAR 20-PRP	1 570 000.00	1 591 587.50	0.02
USD SHINHAN FIN GROUP CO LTD-REG-S-SUB 3.340%/VAR 19-05.02.30	2 035 000.00	2 164 998.86	0.03
USD UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S-SUB 3.750%/VAR 19-15.04.29	2 300 000.00	2 467 808.00	0.04
USD UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S-SUB 2.880%/VAR 16-08.03.27	1 282 000.00	1 305 011.90	0.02
USD UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S-SUB 3.875%/VAR 17-PRP	1 245 000.00	1 284 765.30	0.02
USD WING LUNG BANK LTD-REG-S-SUB 3.750%/H15T5Y+175BP 17-22.11.27	1 647 000.00	1 689 822.00	0.02
米ドル合計		60 375 391.07	0.85
中期債券、変動利付債合計		70 412 651.90	0.99

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

2021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			
EUR			
EUR	ALTICE FINANCING SA-REG-S 3.00000% 20-15.01.28	2 050 000.00	0.03
EUR	CENTRAL BANK OF TUNISIA-REG-S 5.62500% 17-17.02.24	6 676 000.00	0.11
EUR	CROATIA, REPUBLIC OF-REG-S 2.75000% 17-27.01.30	3 417 000.00	0.07
EUR	CROATIA, REPUBLIC OF-REG-S 1.50000% 20-17.06.31	13 107 000.00	0.24
EUR	IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 18-22.03.30	2 050 000.00	0.04
EUR	IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 6.62500% 18-22.03.48	7 661 000.00	0.14
EUR	IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 6.87500% 19-17.10.40	11 056 000.00	0.21
EUR	NAK NAFTOGAZ UKRAINE VIA KONDOR-REG-S 7.12500% 19-19.07.24	1 343 000.00	0.02
EUR	ROMANIAN GOVERNMENT INTERN BDS-REG-S 3.62400% 20-26.05.30	7 149 000.00	0.15
EUR	RUSSIA, FEDERATION OF-REG-S 2.87500% 18-04.12.25	11 000 000.00	0.21
EUR	SENEGAL, REPUBLIC OF-REG-S 4.75000% 18-13.03.28	5 380 000.00	0.10
EUR	TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV-REG-S 1.25000% 15-31.03.23	1 270 000.00	0.02
EUR	TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV-REG-S 1.12500% 16-15.10.24	1 110 000.00	0.02
ユーロ合計		96 292 306.58	1.36
USD			
USD	21VIANET GROUP INC-REG-S 7.87500% 19-15.10.21	2 090 000.00	0.03
USD	ABJA INVESTMENT CO PTE LTD-REG-S 5.95000% 14-31.07.24	4 542 000.00	0.07
USD	ABU DHABI CRUDE OIL PIPELINE LLC-REG-S 4.60000% 17-02.11.47	9 212 000.00	0.16
USD	ABU DHABI GOVERNMENT OF-REG-S 3.12500% 19-30.09.49	4 333 000.00	0.06
USD	ACWA POWER MGMT & INVEST ONE LTD-REG-S 5.95000% 17-15.12.39	4 714 000.00	0.08
USD	ADANI GREEN ENERGY UP LTD-REG-S 6.25000% 19-10.12.24	1 820 000.00	0.03
USD	ADCB FINANCE CAYMAN LTD-REG-S 4.00000% 18-29.03.23	4 301 000.00	0.06
USD	AHB SUKUK CO LTD-REG-S 4.37500% 18-19.09.23	2 800 000.00	0.04
USD	AKBANK TAS-REG-S 5.12500% 15-31.03.25	1 800 000.00	0.03
USD	AKCB FINANCE LTD-REG-S 4.75000% 18-09.10.23	3 359 000.00	0.05
USD	ALAM SUTERA REALTY TBK PT (PAY IN KIND) STEP UP 20-02.05.24	325 000.00	0.00
USD	ALAM SUTERA REALTY TBK PT (PAY IN KIND) STEP UP 20-02.11.25	615 000.00	0.01
USD	ALDAR SUKUK LTD-REG-S 4.75000% 18-29.09.25	1 310 000.00	0.02
USD	ALTICE FINANCING SA-144A 7.50000% 16-15.05.26	8 090 000.00	0.12
USD	ALTICE FINANCING SA-REG-S 7.50000% 16-15.05.26	6 224 000.00	0.09
USD	ANGOLAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 9.50000% 15-12.11.25	714 000.00	0.01
USD	ANGOLAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 8.25000% 18-09.05.28	20 862 000.00	0.29
USD	ARGENTINA, REPUBLIC OF STEP-UP 20-09.07.41	75 446 379.00	0.38
USD	ARMENIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 7.15000% 15-26.03.25	2 200 000.00	0.04
USD	BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.00000% 14-19.09.44	3 077 000.00	0.04
USD	BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 7.00000% 16-12.10.28	5 670 000.00	0.09
USD	BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 7.50000% 17-20.09.47	1 064 000.00	0.02
USD	BAHRAIN, KINGDOM OF-REG-S 5.62500% 19-30.09.31	2 150 000.00	0.03
USD	BAHRAIN, KINGDOM OF-REG-S 7.37500% 20-14.05.30	10 930 000.00	0.18
USD	BAHRAIN, KINGDOM OF-REG-S 5.45000% 20-16.09.32	10 516 000.00	0.15
USD	BANK OF BAHRAIN & KUWAIT-REG-S 5.50000% 19-09.07.24	3 713 000.00	0.05
USD	BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO-REG-S-SUB 4.20000% 20-23.01.25	1 682 000.00	0.02
USD	BELARUS INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.20000% 18-28.02.30	684 000.00	0.01
USD	BELIZE, GOVERNMENT OF-REG-S STEP-DOWN 13-20.02.34	2 573 000.00	0.02
USD	BHARTI AIRTEL INTL NETHERLANDS BV-REG-S 5.35000% 14-20.05.24	18 230 000.00	0.28
USD	BIZ FINANCE PLC FOR UKREXIMBANK-REG-S 9.62500% 15-27.04.22	5 081 000.00	0.02
USD	BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 8.25000% 04-20.01.34	5 167 000.00	0.10
USD	BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 7.12500% 06-20.01.37	800 000.00	0.01
USD	BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 5.00000% 14-27.01.45	4 138 000.00	0.06
USD	BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 6.00000% 16-07.04.26	585 000.00	0.01
USD	BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 5.62500% 16-21.02.47	660 000.00	0.01
USD	BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 4.50000% 19-30.05.29	20 120 000.00	0.31
USD	CBB INTERNATIONAL SUKUK PROGRAMME-REG-S 3.95000% 20-16.09.27	2 170 000.00	0.03
USD	CDBL FUNDING 1-REG-S 4.25000% 14-02.12.24	766 000.00	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

2021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 BANK OF TUNISIA-REG-S 5.75000% 15-30.01.25	8 230 000.00	7 491 871.87	0.11
USD	CENTRAL CHINA REAL ESTATE-REG-S 7.75000% 20-24.05.24	1 525 000.00	1 511 656.25	0.02
USD	CFLD CAYMAN INVESTMENT LTD-REG-S 6.90000% 20-13.01.23	420 000.00	156 318.75	0.00
USD	CHINA CONSTRUCTION BANK CORP-REG-S-SUB 4.25000% 19-27.02.29	1 623 000.00	1 747 260.94	0.02
USD	CHINA EVERGRANDE GROUP-REG-S 8.25000% 17-23.03.22	1 607 000.00	1 534 685.00	0.02
USD	CHINA EVERGRANDE GROUP-REG-S 6.25000% 17-28.06.21	870 000.00	852 871.88	0.01
USD	CHINA EVERGRANDE GROUP-REG-S 7.50000% 17-28.06.23	3 156 000.00	2 732 898.75	0.04
USD	CHINA EVERGRANDE GROUP-REG-S 8.75000% 17-28.06.25	1 180 000.00	960 962.50	0.01
USD	CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN-REG-S 5.95000% 14-08.05.24	200 000.00	226 875.00	0.00
USD	CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN-REG-S 6.45000% 14-11.06.34	550 000.00	739 406.25	0.01
USD	CHINA SCE GROUP HOLDINGS LTD-REG-S- 6.00000% 21-04.02.26	1 070 000.00	1 056 625.00	0.01
USD	CHINA SCE PROPERTY HOLDINGS LTD-REG-S 7.37500% 19-09.04.24	725 000.00	761 929.69	0.01
USD	CHINALCO CAPITAL HOLDINGS LTD-REG-S 4.00000% 16-25.08.21	3 029 000.00	3 056 450.31	0.04
USD	CHINALCO CAPITAL HOLDINGS LTD-REG-S 4.25000% 17-21.04.22	4 262 000.00	4 319 061.79	0.06
USD	CK HUTCHISON INTERNATIONAL LTD-REG-S 3.62500% 19-11.04.29	1 710 000.00	1 931 647.98	0.03
USD	COLOMBIA, REPUBLIC OF 10.37500% 03-28.01.33	660 000.00	1 056 412.50	0.01
USD	COLOMBIA, REPUBLIC OF 8.12500% 04-21.05.24	2 000 000.00	2 420 625.00	0.03
USD	COLOMBIA, REPUBLIC OF 7.37500% 06-18.09.37	2 903 000.00	4 068 735.93	0.06
USD	COLOMBIA, REPUBLIC OF 6.12500% 09-18.01.41	1 476 000.00	1 890 202.50	0.03
USD	COLOMBIA, REPUBLIC OF 4.00000% 13-26.02.24	3 160 000.00	3 395 025.00	0.05
USD	COLOMBIA, REPUBLIC OF 5.62500% 14-26.02.44	2 766 000.00	3 416 874.38	0.05
USD	COLOMBIA, REPUBLIC OF 5.00000% 15-15.06.45	4 953 000.00	5 733 097.50	0.08
USD	COLOMBIA, REPUBLIC OF 2.62500% 13-15.03.23	8 320 000.00	8 559 200.00	0.12
USD	COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD-REG-S 5.75000% 12-14.02.42	1 360 000.00	1 574 200.00	0.02
USD	COMPETITION TEAM TECHNOLOGIES LTD-REG-S 3.75000% 19-12.03.24	4 355 000.00	4 700 678.12	0.07
USD	CONTEMPORARY RUIDING DEVELOPMENT-REG-S 2.62500% 20-17.09.30	2 070 000.00	2 096 521.88	0.03
USD	CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 5.62500% 13-18.10.43	1 367 000.00	1 847 158.75	0.03
USD	CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 4.87500% 14-04.11.44	1 640 000.00	2 045 900.00	0.03
USD	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 6.15000% 19-17.09.25	776 000.00	863 300.00	0.01
USD	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 4.80000% 20-06.08.30	1 023 000.00	1 101 643.13	0.02
USD	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 2.70000% 21-12.07.26	1 372 000.00	1 383 113.20	0.02
USD	CROATIA, REPUBLIC OF-REG-S 6.00000% 13-26.01.24	2 277 000.00	2 619 261.56	0.04
USD	DAR AL-ARKAN SUKUK CO LTD-REG-S 6.87500% 20-26.02.27	1 936 000.00	1 932 975.00	0.03
USD	DELHI INTERNATIONAL AIRPORT LTD-REG-S 6.12500% 16-31.10.26	450 000.00	457 734.38	0.01
USD	DELTA MERLIN DUNIA TE-REG-S *DEFAULTED* 8.62500% 19-12.03.24	2 110 000.00	108 137.50	0.00
USD	DEVELOPMENT BANK OF MONGOLIA LLC-REG-S 7.25000% 18-23.10.23	4 468 000.00	4 847 780.00	0.07
USD	DIB SUKUK LTD-REG-S 2.95000% 19-20.02.25	3 555 000.00	3 716 085.94	0.05
USD	DIB SUKUK LTD-REG-S 2.95000% 20-16.01.26	5 995 000.00	6 257 281.25	0.09
USD	DNO ASA-144A-REG-S 8.75000% 18-31.05.23	4 800 000.00	4 728 000.00	0.07
USD	DNO ASA-144A-REG-S 8.37500% 19-29.05.24	4 550 000.00	4 459 000.00	0.06
USD	DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 5.87500% 13-18.04.24	1 410 000.00	1 533 815.63	0.02
USD	DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 7.45000% 14-30.04.44	1 040 000.00	1 302 600.00	0.02
USD	EA PARTNERS I BV-REG-S *DEFAULTED* 6.87500% 15-28.09.20	4 113 000.00	1 663 996.82	0.02
USD	EA PARTNERS II BV-REG-S *DEFAULTED* 6.75000% 16-01.06.21	1 710 000.00	700 565.63	0.01
USD	EASY TACTIC LTD-REG-S 5.87500% 17-13.02.23	250 000.00	227 920.00	0.00
USD	EASY TACTIC LTD-REG-S 8.62500% 19-27.02.24	1 540 000.00	1 420 650.00	0.02
USD	EL FONDO MIVIVIENDA-REG-S 3.50000% 13-31.01.23	1 950 000.00	2 048 109.37	0.03
USD	EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 7.65000% 05-15.06.35	1 878 000.00	1 831 050.00	0.03
USD	EL SUKUK CO LTD-REG-S 1.82700% 20-23.09.25	1 582 000.00	1 583 483.12	0.02
USD	ELDORADO INTL. FINANCE GMBH-REG-S 8.62500% 16-16.06.21	7 485 000.00	7 513 068.75	0.11
USD	ELECT GLOBAL INVESTMENTS LTD-REG-S 4.85000% 20-PRP	658 000.00	669 201.79	0.01
USD	EMG SUKUK LTD-REG-S 4.56400% 14-18.06.24	1 312 000.00	1 388 260.00	0.02
USD	ETHIOPIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.62500% 14-11.12.24	7 100 000.00	6 651 812.50	0.09
USD	EXPORT CREDIT BANK OF TURKEY-REG-S 8.25000% 19-24.01.24	2 365 000.00	2 563 068.75	0.04
USD	EXPORT-IMPORT BANK OF INDIA-REG-S 3.37500% 16-05.08.26	380 000.00	411 706.25	0.01
USD	FAB SUKUK CO LTD-REG-S 1.41100% 21-14.01.26	857 000.00	860 256.60	0.01
USD	FORMOSA GROUP CAYMAN LTD-REG-S 3.37500% 15-22.04.25	1 708 000.00	1 821 155.00	0.03
USD	FORTUNE STAR BVI LTD-REG-S 5.25000% 17-23.03.22	210 000.00	212 953.13	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 - エマージング・マーケット・デッド

2021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 FOXCONN FAR EAST LTD-REG-S 2.50000% 20-28.10.30	1 855 000.00	1 891 964.21	0.03
USD FPC RESOURCES LTD-REG-S 4.37500% 20-11.09.27	320 000.00	336 300.00	0.00
USD GABON, REPUBLIC OF-REG-S 6.37500% 13-12.12.24	1 280 014.00	1 333 614.59	0.02
USD GALAXY PIPELINE ASSETS BIDCO LTD-REG-S 2.62500% 20-31.03.36	32 065 000.00	32 260 275.85	0.46
USD GALAXY PIPELINE ASSETS BIDCO LTD-REG-S 3.25000% 20-30.09.40	22 896 000.00	23 411 160.00	0.33
USD GAZ CAPITAL SA/GAZPROM-REG-S LPN 5.15000% 19-11.02.26	2 500 000.00	2 832 812.50	0.04
USD GAZPROM PJSC VIA GAZ FINANCE PLC-REG-S 3.25000% 20-25.02.30	1 500 000.00	1 515 000.00	0.02
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 10.75000% 15-14.10.30	7 961 000.00	10 535 885.94	0.15
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 7.87500% 19-26.03.27	3 900 000.00	4 259 531.25	0.06
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 8.12500% 19-26.03.32	4 580 000.00	4 786 100.00	0.07
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 8.95000% 19-26.03.51	1 735 000.00	1 770 784.37	0.02
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 7.87500% 20-11.02.35	4 150 000.00	4 182 421.87	0.06
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 8.75000% 20-11.03.61	8 384 000.00	8 402 340.00	0.12
USD GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD-REG-S 3.87500% 15-04.06.25	7 349 000.00	7 778 457.18	0.11
USD GMR HYDERABAD INTNATL AIRPORT LTD-REG-S 4.75000% 21-02.02.26	380 000.00	378 693.75	0.01
USD GOHL CAPITAL LTD-REG-S 4.25000% 17-24.01.27	23 251 000.00	24 914 899.70	0.35
USD GREENKO INVESTMENT CO-REG-S 4.87500% 16-16.08.23	2 726 000.00	2 777 964.38	0.04
USD GREENKO SOLAR MAURITIUS LTD-REG-S 5.55000% 19-29.01.25	2 736 000.00	2 809 872.00	0.04
USD GREENKO SOLAR MAURITIUS LTD-REG-S 5.95000% 19-29.07.26	1 480 000.00	1 591 925.00	0.02
USD GTLK EUROPE LTD-REG-S 5.95000% 16-19.07.21	371 000.00	377 724.38	0.01
USD HALYK SAVINGS BANK OF KAZAKHSTAN-REG-S 5.50000% 12-21.12.22	2 250 977.00	747 737.67	0.01
USD HK RED STAR MAC UNIV HOME FURN-REG-S 3.37500% 17-21.09.22	2 390 000.00	2 091 250.00	0.03
USD HKT CAPITAL NO 5 LTD-REG-S 3.25000% 19-30.09.29	4 650 000.00	4 993 955.85	0.07
USD HONGKONG INTERNATIONAL QINGDAO-REG-S 4.25000% 17-04.12.22	3 694 000.00	3 750 665.96	0.05
USD HUBI SCI TECH INV GRP HNG KNG LTD-REG-S 4.37500% 18-05.03.21	1 518 000.00	1 519 423.13	0.02
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 8.50000% 05-12.10.35	3 403 000.00	5 572 412.50	0.08
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 6.62500% 07-17.02.37	693 000.00	986 225.63	0.01
USD IRAQ INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.80000% 06-15.01.28	12 705 000.00	10 477 654.68	0.15
USD IRAQ INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.75200% 17-09.03.23	4 835 000.00	4 733 767.18	0.07
USD ISRAEL, STATE OF 3.87500% 20-03.07.50	2 909 000.00	3 444 437.81	0.05
USD ISRAEL, STATE OF 4.50000% 20-03.04.20	3 530 000.00	4 553 700.00	0.06
USD IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 6.12500% 17-15.06.33	3 201 000.00	3 520 099.69	0.05
USD JAMAICA, GOVERNMENT OF 9.25000% 05-17.10.25	496 000.00	604 035.00	0.01
USD JSW STEEL LTD-REG-S 5.95000% 19-18.04.24	1 914 000.00	2 031 232.50	0.03
USD KAISA GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 8.50000% 17-30.06.22	2 515 000.00	2 535 371.50	0.04
USD KAISA GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 9.37500% 17-30.06.24	10 916 000.00	10 363 377.51	0.15
USD KAZAKHSTAN TEMIR ZHOLY FINANCE BV-REG-S 6.95000% 12-10.07.42	2 637 000.00	3 858 260.63	0.05
USD KING POWER CAPITAL LTD-REG-S 5.62500% 14-03.11.24	2 300 000.00	2 622 000.00	0.04
USD KOOKMIN BANK-REG-S-SUB 2.50000% 20-04.11.30	1 491 000.00	1 527 335.67	0.02
USD KOREA HOUSING FINANCE CORP-REG-S 3.00000% 17-31.10.22	430 000.00	448 499.33	0.01
USD KUNMING RAIL TRANSIT GROUP CO LTD-REG-S 3.50000% 19-12.12.22	1 358 000.00	1 366 436.30	0.02
USD KUWAIT PROJECTS CO SPC LTD-REG-S 5.00000% 16-15.03.23	300 000.00	313 125.00	0.00
USD KWG GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 5.87500% 17-10.11.24	910 000.00	927 346.87	0.01
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.75000% 12-29.11.27	825 000.00	94 875.00	0.00
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.00000% 12-27.01.23	564 000.00	64 860.00	0.00
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.20000% 15-26.02.25	4 600 000.00	529 000.00	0.01
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 7.05000% 15-02.11.35	765 000.00	86 062.50	0.00
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.65000% 15-03.11.28	5 549 000.00	638 135.00	0.01
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.65000% 16-22.04.24	3 558 000.00	409 170.00	0.01
USD LEBANON, REPUBLIC OF *DEFAULTED* 6.85000% 16-25.05.29	5 109 000.00	547 844.20	0.01
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.85000% 17-23.03.27	8 186 000.00	951 622.50	0.01
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 7.25000% 17-23.03.37	1 023 000.00	117 645.00	0.00
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 7.00000% 17-23.03.32	1 438 000.00	161 775.00	0.00
USD LEBANON, REPUBLIC OF *DEFAULTED* 8.25000% 18-17.05.34	12 419 000.00	1 241 900.00	0.02
USD LEBANON, REPUBLIC OF *DEFAULTED* 8.20000% 18-17.05.33	180 000.00	18 000.00	0.00
USD LIMA METRO LINE 2 FINANCE LTD-REG-S 4.35000% 19-05.04.36	17 134 000.00	18 847 400.00	0.27
USD MAF GLOBAL SECURITIES LTD-REG-S 4.75000% 14-07.05.24	830 000.00	904 440.62	0.01

USD MAF SUKUK LTD-REG-S 4.63800% 19-14.05.29

685 000.00

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 - エマージング・マーケット・デッド

2021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 MAR SUKUK LTD-REG-S 2.21000% 20-02.09.25	2 062 000.00	2 102 595.63	0.03
USD MARB BONDCO PLC-REG S-3.95000% 21-29.01.31	2 848 000.00	2 833 048.00	0.04
USD MARBLE II PTE LTD-REG-S 5.30000% 17-20.06.22	886 000.00	890 153.12	0.01
USD MASHREQBANK PSC-REG-S 4.25000% 19-26.02.24	2 081 000.00	2 232 522.82	0.03
USD MELCO RESORTS FINANCE LTD-REG-S 5.25000% 19-26.04.26	1 406 000.00	1 455 716.16	0.02
USD METINVEST BV-REG-S 7.75000% 18-23.04.23	3 991 000.00	4 236 695.95	0.06
USD METINVEST BV-REG-S 7.75000% 19-17.10.29	1 545 000.00	1 659 909.38	0.02
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-144A 5.50000% 16-31.10.46	1 500 000.00	1 501 406.25	0.02
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-144A 3.87500% 17-30.04.28	3 880 000.00	3 939 412.50	0.06
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-144A 5.50000% 17-31.07.47	3 060 000.00	3 064 207.50	0.04
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-REG-S 5.50000% 16-31.10.46	261 000.00	261 244.68	0.00
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-REG-S 3.87500% 17-30.04.28	4 041 000.00	4 102 877.81	0.06
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-REG-S 5.50000% 17-31.07.47	19 815 000.00	19 842 245.62	0.28
USD MINEJESA CAPITAL BV-REG-S 4.62500% 17-10.08.30	17 724 000.00	18 986 835.00	0.27
USD MINEJESA CAPITAL BV-REG-S 5.62500% 17-10.08.37	1 659 000.00	1 809 865.31	0.03
USD MINERA Y METALURGICA DEL BOLEO-REG-S 3.25000% 19-17.04.24	357 000.00	382 101.56	0.01
USD MINMETALS BOUNTEOUS FIN BVI LTD-REG-S 4.20000% 16-27.07.26	3 500 000.00	3 899 218.75	0.05
USD MODERN LAND CHINA CO LTD-REG-S 11.95000% 20-04.03.24	550 000.00	553 265.62	0.01
USD MODERNLA OVE PTE LTD-REG-S *DEFAULTED* 6.95000% 17-13.04.24	330 000.00	92 812.50	0.00
USD MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 5.12500% 20-07.04.26	2 933 000.00	3 130 977.50	0.04
USD MOROCCO, KINGDOM OF THE-REG-S 5.50000% 12-11.12.42	3 399 000.00	4 196 702.80	0.06
USD MOROCCO, KINGDOM OF-REG-S 4.25000% 12-11.12.22	1 102 000.00	1 160 888.12	0.02
USD MUMTALAKAT SUKUK HOLDING CO-REG-S 4.10000% 20-21.01.27	2 040 000.00	2 105 662.50	0.03
USD NAKILAT INC-REG-S 6.06700% 06-31.12.33	3 125 000.00	3 964 843.75	0.06
USD NEW METRO GLOBAL LTD-REG-S 6.50000% 18-23.04.21	1 110 000.00	1 115 894.10	0.02
USD NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH GRP-REG-S 2.12500% 20-02.07.25	1 950 000.00	1 938 421.88	0.03
USD NOVOLIPETSK STEEL VIA STEEL FUND-REG-S 4.70000% 19-30.05.26	1 330 000.00	1 495 418.75	0.02
USD NUOXI CAPITAL LTD-REG-S 4.70000% 18-24.01.21	220 000.00	27 825.60	0.00
USD NUOXI CAPITAL LTD-REG-S *DEFAULTED* 5.35000% 18-24.01.23	1 510 000.00	203 378.13	0.00
USD NWD FINANCE BVI LTD-REG-S 5.75000% 16-PRP	1 435 000.00	1 442 146.59	0.02
USD NWD MTN LTD-REG-S 4.12500% 19-18.07.29	5 074 000.00	5 227 713.79	0.07
USD OI SA (PIK) 10.00000% 18-27.07.25	2 560 000.00	2 659 840.00	0.04
USD OIL INDIA INTERNATIONAL PTE LTD-REG-S 4.00000% 17-21.04.27	3 974 000.00	4 284 468.75	0.06
USD OIL INDIA LTD-REG-S 5.12500% 19-04.02.29	4 128 000.00	4 709 790.00	0.07
USD OILFLOW SPV 1 DAC-REG-S 12.00000% 17-13.01.22	7 651 000.00	5 431 239.05	0.08
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.75000% 20-28.10.27	15 430 000.00	17 069 437.50	0.24
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 7.37500% 20-28.10.32	19 148 000.00	21 804 784.99	0.31
USD OSCHADBANK VIA SSB #1 PLC-REG-S LPN STEP UP/DOWN 15-10.03.23	5 778 000.00	1 512 210.94	0.02
USD OZTEL HOLDINGS SPC-REG-S 6.62500% 18-24.04.28	7 070 000.00	7 730 603.12	0.11
USD PANAMA, REPUBLIC OF 8.87500% 97-30.09.27	665 000.00	950 118.75	0.01
USD PANAMA, REPUBLIC OF 7.12500% 05-29.01.26	271 000.00	344 847.50	0.00
USD PANAMA, REPUBLIC OF 6.70000% 06-26.01.36	1 619 000.00	2 322 253.13	0.03
USD PANAMA, REPUBLIC OF 4.30000% 13-29.04.53	1 132 000.00	1 352 386.25	0.02
USD PANAMA, REPUBLIC OF 4.00000% 14-22.09.24	476 000.00	524 343.75	0.01
USD PANAMA, REPUBLIC OF 3.75000% 15-16.03.25	510 000.00	561 956.25	0.01
USD PANAMA, REPUBLIC OF 4.50000% 18-16.04.50	4 238 000.00	5 191 550.00	0.07
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 5.00000% 16-15.04.26	6 962 000.00	8 062 866.25	0.11
USD PELABUHAN INDONESIA II PT-REG-S 4.25000% 15-05.05.25	2 400 000.00	2 619 000.00	0.04
USD PERU, REPUBLIC OF 2.78300% 20-23.01.31	4 695 000.00	5 054 460.93	0.07
USD PERU, REPUBLIC OF 7.35000% 05-21.07.25	1 430 000.00	1 816 546.87	0.03
USD PERU, REPUBLIC OF 8.75000% 03-21.11.33	4 861 000.00	8 174 075.31	0.12
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 3.87500% 19-17.07.29	2 960 000.00	3 227 325.00	0.05
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 3.80000% 20-23.06.50	10 842 000.00	11 689 031.26	0.16
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 9.75000% 12-17.05.35	1 493 000.00	52 255.00	0.00
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 6.00000% 14-16.05.24	33 023 021.00	1 155 805.74	0.02
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 7.75000% 06-14.01.31	3 285 000.00	5 036 315.62	0.07
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 6.37500% 09-23.10.34	982 000.00	1 432 492.50	0.02
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 3.95000% 15-20.01.40	1 134 000.00	1 326 780.00	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 - エマージング・マーケット・デッド

2021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 POWER FINANCE CORP LTD-REG-S 4.50000% 19-18.06.29	3 755 000.00	4 085 909.37	0.06
USD PROSUS NV-REG-S 5.50000% 15-21.07.25	2 663 000.00	3 047 470.63	0.04
USD PTTEP CANADA INTERNATIONAL FIN-REG-S 6.35000% 12-12.06.42	1 020 000.00	1 457 039.40	0.02
USD QATAR, STATE OF-REG-S 4.62500% 16-02.06.46	1 250 000.00	1 607 421.87	0.02
USD QATAR, STATE OF-REG-S 3.25000% 16-02.06.26	1 715 000.00	1 899 362.50	0.03
USD QIB SUKUK LTD-REG-S 3.25100% 17-23.05.22	5 320 000.00	5 436 375.00	0.08
USD QIB SUKUK LTD-REG-S 1.950000% 20-27.10.25	3 350 000.00	3 377 218.75	0.05
USD QIIB SENIOR SUKUK LTD-REG-S 4.26400% 19-05.03.24	692 000.00	748 008.75	0.01
USD REDSUN PROPERTIES GROUP LTD-REG-S 7.30000% 21-13.01.25	1 600 000.00	1 610 000.00	0.02
USD REPUBLIC OF AZERBAIJAN-REG-S 3.50000% 17-01.09.32	12 340 000.00	12 906 868.75	0.18
USD RKP OVERSEAS 2019 A LTD-REG-S 6.00000% 20-04.09.25	990 000.00	1 022 175.00	0.01
USD RONGXINGDA DEVELOPMENT BVI LTD-REG-S 8.00000% 19-24.04.22	3 932 000.00	3 725 570.00	0.05
USD RUSSIA, FEDERATION OF-REG-S 4.75000% 16-27.05.26	9 800 000.00	11 288 375.00	0.16
USD RUSSIA, FEDERATION OF-REG-S 12.75000% 98-24.06.28	7 500 000.00	12 703 125.00	0.18
USD RUSSIA, FEDERATION OF-REG-S STEP-UP 00-31.03.30	70.00	20.65	0.00
USD RUSSIA, FEDERATION OF-REG-S 4.87500% 13-16.09.23	800 000.00	880 750.00	0.01
USD RUSSIA, FEDERATION OF-REG-S 5.87500% 13-16.09.43	8 800 000.00	12 364 000.00	0.17
USD SABIC CAPTIAL BV-REG-S 2.15000% 20-14.09.30	865 000.00	857 431.25	0.01
USD SAMARCO MINERACAO SA-REG-S 4.12500% 12-01.11.22	25 180 000.00	18 428 612.50	0.26
USD SAMBA FUNDING LTD-REG-S 2.90000% 20-29.01.27	2 713 000.00	2 857 128.13	0.04
USD SANDS CHINA LTD 5.12500% 19-08.08.25	4 809 000.00	5 374 057.50	0.08
USD SAUDI ELECTRICITY GLOBAL SUKIK CO REG-S 5.50000% 14-08.04.44	5 847 000.00	7 632 162.19	0.11
USD SAUDI ELECTRICITY GLOBAL SUKUK CO-REG-S 4.22200% 18-27.01.24	824 000.00	896 357.50	0.01
USD SAUDI ELECTRICITY GLOBAL SUKUK CO-REG-S 4.72300% 18-27.09.28	2 290 000.00	2 734 403.12	0.04
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 5.25000% 19-16.01.50	5 872 000.00	7 710 670.00	0.11
USD SENEGAL, REPUBLIC OF-REG-S 6.25000% 14-30.07.24	2 100 000.00	2 321 812.50	0.03
USD SENEGAL, REPUBLIC OF-REG-S 6.25000% 17-23.05.33	1 900 000.00	2 079 312.50	0.03
USD SFC CAPITAL LTD-REG-S 5.37500% 16-16.06.23	1 700 000.00	1 804 656.25	0.03
USD SHANDONG IRON AND STEEL XINHENG-REG-S 6.50000% 20-05.11.23	2 547 000.00	2 655 553.14	0.04
USD SHANGHAI PORT GROUP BVI DEVELOP-REG-S 2.85000% 19-11.09.29	300 000.00	311 625.00	0.00
USD SHANGHAI PORT GRP BVI DEP 2 CO LTD-REG-S 20-13.07.30	871 000.00	873 721.87	0.01
USD SHARJAH SUKUK PROGRAM LTD-REG-S 3.23400% 19-23.10.29	3 270 000.00	3 396 712.50	0.05
USD SHARJAH SUKUK PROGRAM LTD 2.94200% 20-10.06.27	1 649 000.00	1 706 199.68	0.02
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.87500% 13-16.09.25	2 350 000.00	2 652 562.50	0.04
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 4.30000% 16-12.10.28	11 331 000.00	11 522 210.63	0.16
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.00000% 16-12.10.46	14 716 000.00	13 336 375.00	0.19
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.87500% 18-22.06.30	775 000.00	852 015.63	0.01
USD SOUTHERN GAS CORRIDOR CJSC-REG-S 6.87500% 16-24.03.26	24 703 000.00	29 720 796.88	0.42
USD SOVCOMBANK CAP DAC-REG-S-SUB 8.00000% 19-07.04.30	3 590 000.00	3 879 443.75	0.05
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 6.85000% 15-03.11.25	1 800 000.00	1 119 375.00	0.02
USD SSMS PLANTATION HOLDINGS PTE LTD-REG-S 7.75000% 18-23.01.23	500 000.00	397 656.25	0.01
USD STAR ENERGY GEOTHERMAL DARAJAT II-REG-S 4.85000% 20-14.10.38	1 975 000.00	2 202 742.19	0.03
USD STATE OIL OF THE AZERBAIJAN REP-REG-S 6.95000% 15-18.03.30	16 167 000.00	20 612 925.00	0.29
USD STILLWATER MINING CO-REG-S 6.12500% 17-27.06.22	2 681 000.00	2 714 512.50	0.04
USD STILLWATER MINING CO-REG-S 7.12500% 17-27.06.25	11 615 000.00	12 213 898.43	0.17
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 7.87500% 19-15.02.22	550 000.00	561 000.00	0.01
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 7.95000% 19-11.10.23	1 570 000.00	1 646 537.50	0.02
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 7.50000% 19-01.02.24	1 410 000.00	1 460 231.25	0.02
USD SURA ASSET MANAGEMENT SA-REG-S 4.87500% 14-17.04.24	405 000.00	442 563.75	0.01
USD TABREED SUKUK SPC LTD-REG-S 5.50000% 18-31.10.25	2 732 000.00	3 175 096.25	0.04
USD TAQA ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO-REG-S 6.50000% 06-27.10.36	990 000.00	1 445 090.63	0.02
USD THETA CAPITAL PTE LTD-REG-S 8.12500% 20-22.01.25	1 130 000.00	1 128 940.63	0.02
USD THIRD PAKISTAN INTERNATIONAL SUK-REG-S 5.50000% 16-13.10.21	406 000.00	411 075.00	0.01
USD TIANQI FINCO CO LTD-REG-S 3.75000% 17-28.11.22	400 000.00	347 375.00	0.00
USD TINGYI CAYMAN ISLANDS HOLD CORP-REG-S 1.62500% 20-24.09.25	955 000.00	947 006.65	0.01
USD TNB GLOBAL VENTURES CAPITAL-REG-S 4.85100% 18-01.11.28	4 783 000.00	5 658 886.87	0.08
USD TULLOW OIL PLC-REG-S 7.00000% 18-01.03.25	1 000 000.00	655 850.00	0.01
USD TURKEY, REPUBLIC OF 5.75000% 14-22.03.24	8 920 000.00	9 385 512.49	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 - エマージング・マーケット・デッド

2021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 TURKEY, REPUBLIC OF 6.62500% 14-17.02.45	500 000.00	506 562.50	0.01
USD TURKEY, REPUBLIC OF 4.25000% 15-14.04.26	3 040 000.00	3 012 450.00	0.04
USD TURKEY, REPUBLIC OF 6.12500% 18-24.10.28	1 627 000.00	1 730 721.25	0.02
USD TURKEY, REPUBLIC OF 6.37500% 20-14.10.25	16 345 000.00	17 657 707.81	0.25
USD TURKEY, REPUBLIC OF 5.87500% 21-26.06.31	32 263 000.00	32 827 602.50	0.46
USD TURKIYE IS BANKASI AS-REG-S-SUB 6.00000% 12-24.10.22	1 079 000.00	1 087 766.87	0.02
USD TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO-REG-S 8.12500% 19-28.03.24	5 050 000.00	5 398 765.63	0.08
USD UNITED BANK FOR AFRICA PLC-REG-S 7.75000% 17-08.06.22	8 088 000.00	8 338 222.50	0.12
USD UPL CORP LTD-REG-S 4.62500% 20-16.06.30	10 918 000.00	11 692 495.62	0.16
USD URUGUAY, REPUBLIC OF 7.62500% 06-21.03.36	907 715.00	1 466 243.39	0.02
USD URUGUAY, REPUBLIC OF 5.10000% 14-18.06.50	2 865 915.00	3 849 282.09	0.05
USD URUGUAY, REPUBLIC OF 4.97500% 18-20.04.55	11 511 043.00	15 338 464.80	0.22
USD URUGUAY, REPUBLIC OF 4.37500% 19-23.01.31	8 127 856.00	9 794 066.48	0.14
USD VALE OVERSEAS LTD 6.87500% 09-10.11.39	2 325 000.00	3 376 335.94	0.05
USD VALE OVERSEAS LTD 8.25000% 04-17.01.34	1 250 000.00	1 878 515.63	0.03
USD VEDANTA RESOURCES FINANCE II PLC-REG-S 9.25000% 19-23.04.26	200 000.00	164 375.00	0.00
USD VEDANTA RESOURCES FINANCE II PLC-REG-S 8.00000% 19-23.04.23	830 000.00	717 690.62	0.01
USD VEDANTA RESOURCES FINANCE II PLC-REG-S 13.87500% 20-21.01.24	1 790 000.00	1 919 327.50	0.03
USD VENEZUELA, REP. OF REG-S *DEFAULTED* 11.75000% 11-21.10.26	4 098 600.00	379 120.50	0.01
USD VENEZUELA, REP. OF-REG-S *DEFAULTED* 9.00000% 08-07.05.23	378 000.00	34 965.00	0.00
USD VENEZUELA, REP. OF-REG-S *DEFAULTED* 9.25000% 08-07.05.28	2 977 000.00	275 372.50	0.00
USD VENEZUELA, REP. OF-REG-S *DEFAULTED* 12.75000% 10-23.08.22	2 305 600.00	213 268.00	0.00
USD VENEZUELA, REP. OF-REG-S *DEFAULTED* 11.95000% 11-05.08.31	6 682 000.00	618 085.00	0.01
USD VENEZUELA, REPUBLIC OF *DEFAULTED* 9.25000% 97-15.09.27	1 002 000.00	92 685.00	0.00
USD WANDA GROUP OVERSEAS LTD-REG-S 8.87500% 20-21.03.23	720 000.00	669 600.00	0.01
USD WOORI BANK-REG-S-SUB 4.75000% 14-30.04.24	1 950 000.00	2 169 375.00	0.03
USD XINGSHENG BVI CO LTD-REG-S 3.37500% 19-25.07.22	1 745 000.00	1 787 351.15	0.03
USD YUNDA HOLDING INVESTMENT LTD-REG-S 2.25000% 20-19.08.25	2 224 000.00	2 220 775.20	0.03
USD YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD-REG-S 6.35000% 21-13.01.27	770 000.00	763 262.50	0.01
USD YUZHOU PROPERTIES CO LTD-REG-S 8.30000% 19-27.05.25	1 750 000.00	1 865 390.62	0.03
USD ZAMBIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.37500% 12-20.09.22	14 223 000.00	7 240 395.94	0.10
USD ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD-REG-S 6.70000% 21-04.08.26	2 700 000.00	2 655 909.00	0.04
USD ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 3.00000% 21-13.01.26	1 283 000.00	1 304 336.80	0.02
米ドル合計		1 228 513 414.10	17.33
債券、固定利付債合計		1 324 805 720.68	18.69
固定利付ゼロ・クーポン債			
USD			
USD ECUADOR SOCIAL BOND SARL-REG-S 0.00000% 20-30.01.35	7 910 000.00	5 081 475.91	0.07
米ドル合計		5 081 475.91	0.07
固定利付ゼロ・クーポン債合計		5 081 475.91	0.07
債券、変動利付債			
USD			
USD AGILE GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 7.875%/VAR 19-PRP	470 000.00	489 828.12	0.01
USD AIRPORT AUTHORITY-REG-S 2.100%/VAR 20-PRP	5 586 000.00	5 634 877.50	0.08
USD AL AHLI BANK OF KUWAIT KSCP 7.250%/VAR 18-PRP	1 697 000.00	1 806 774.69	0.03
USD BANCOLOMBIA SA-SUB 4.625%/VAR 19-18.12.29	6 276 000.00	6 472 062.24	0.09
USD BANK OF CHINA HONG KONG LTD-REG-S-SUB 5.900%/VAR 18-PRP	2 210 000.00	2 403 375.00	0.03
USD BANK OF EAST ASIA LTD/THE-REG-S-SUB 4.000%/VAR 16-03.11.26	3 623 000.00	3 665 461.20	0.05
USD BURGAN BANK SAK-REG-S-SUB 5.749%/VAR 19-PRP	900 000.00	928 968.75	0.01
USD CASHLD FLR REG-S-SUB 4.000%/VAR 21-PRP	15 742 000.00	15 702 645.00	0.22
USD CCB LIFE INSURANCE CO LTD-REG-S-SUB 4.500%/VAR 17-21.04.77	2 640 000.00	2 653 332.00	0.04
USD CELESTIAL MILES LTD-REG-S 5.750%/VAR 19-PRP	1 900 000.00	1 996 717.60	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

2021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 CONSTRUCTION BK CORP-REG-S-SUB 2.450%/VAR 20-24.06.30	3 773 000.00	3 867 325.00	0.05
USD CHINA MINMETALS CORP-REG-S 3.750%/VAR 17-PRP	11 616 000.00	11 790 240.00	0.17
USD CHINA MINMETALS CORP-REG-S 4.450%/VAR 18-PRP	870 000.00	875 124.30	0.01
USD CHINALCO CAPITAL HOLDINGS LTD-REG-S 4.100%/VAR 19-PRP	558 000.00	574 740.00	0.01
USD CLP POWER HK FINANCE LTD-REG-S-SUB 3.550%/VAR 19-PRP	400 000.00	412 299.44	0.01
USD DIANJI HAIYU LTD-REG-S 3.450%/VAR 20-PRP	1 192 000.00	1 197 960.00	0.02
USD DIANJI INTERNATIONAL FINANCE LTD-REG-S 4.600%/VAR 18-PRP	2 744 000.00	2 832 322.50	0.04
USD DIB TIER 1 SUKUK 3 LTD-REG-S-SUB 6.250%/VAR 19-PRP	1 559 000.00	1 681 771.25	0.02
USD ELECT GLOBAL INVESTMENTS LTD-REG-S-SUB 4.100%/VAR 20-PRP	3 310 000.00	3 328 205.00	0.05
USD EMIRATES NBD PJSC-REG-S-SUB 6.125%/VAR 19-PRP	1 708 000.00	1 822 756.25	0.03
USD FIRST ABU DHABI BANK-REG-S-SUB 4.500%/VAR 20-PRP	2 004 000.00	2 124 240.00	0.03
USD FIRSTRAND BANK LTD-REG-S-SUB 6.250%/VAR 18-23.04.28	950 000.00	991 859.38	0.01
USD HEUNGKUK LIFE INSURANCE CO-REG-S-SUB 4.475%/VAR 17-09.11.47	3 300 000.00	3 327 843.75	0.05
USD HONG KONG AIRPORT AUTHORITY 2.400%/VAR 20-PRP	4 760 000.00	4 786 322.80	0.07
USD HUARONG FINANCE 2017 CO-REG-S 4.500%/VAR 17-PRP	1 780 000.00	1 810 593.75	0.03
USD JOLLIBEE WORLDWIDE PTE LTD-REG-S 3.900%/VAR 20-PRP	1 030 000.00	992 662.50	0.01
USD KAISA GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 10.875%/VAR 20-PRP	2 080 000.00	2 022 800.00	0.03
USD KING TALENT MANAGEMENT LTD-REG-S-SUB 5.600%/VAR 17-PRP	360 000.00	309 825.00	0.00
USD KYOBO LIFE INSURANCE CO LTD-REG-S-SUB 3.950%/VAR 17-24.07.47	1 438 000.00	1 474 399.38	0.02
USD MAF GLOBAL SECURITIES LTD-REG-S-SUB 6.375%/VAR 18-PRP	3 400 000.00	3 575 312.50	0.05
USD MCC HOLDING HONG KONG CORP LTD-REG-S-SUB 3.250%/VAR 20-PRP	574 000.00	573 461.88	0.01
USD NBK TIER 1 FINANCING LTD-REG-S-SUB 5.750%/VAR 15-PRP	3 614 000.00	3 634 328.75	0.05
USD NBK TIER 1 FINANCING 2 LTD-REG-S-SUB 4.500%/VAR 19-PRP	17 547 000.00	18 064 636.50	0.25
USD NETWORK I2I LTD-REG-S-SUB 5.650%/VAR 19-PRP	5 558 000.00	5 877 585.00	0.08
USD NOOR TIER 1 SUKUK LTD-REG-S-SUB 6.250%/VAR 16-PRP	1 516 000.00	1 521 211.25	0.02
USD NWD FINANCE BVI LTD-REG-S 5.250%/VAR 20-PRP	870 000.00	917 141.29	0.01
USD RIZAL COMMERCIAL BANKING CORP-REG-S-SUB 6.500%/VAR 20-PRP	1 390 000.00	1 408 243.75	0.02
USD ROYAL CAPITAL BV-REG-S 5.000%/VAR 20-PRP	3 299 000.00	3 392 815.32	0.05
USD SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD-REG-S-SUB 5.875%/VAR 18-PRP	2 148 000.00	2 333 936.25	0.03
USD SMC GLOBAL POWER HOLDINGS CORP-REG-S 6.500%/VAR 19-PRP	2 460 000.00	2 482 293.75	0.04
USD SMC GLOBAL POWER HOLDINGS CORP-REG-S 7.000%/VAR 20-PRP	3 880 000.00	4 021 620.00	0.06
USD STANDARD BANK GROUP LTD-REG-S-SUB 5.950%/VAR 19-31.05.29	2 998 000.00	3 152 584.38	0.04
USD SUNNY EXPRESS ENTERPRISES CORP-REG-S 3.350%/VAR 19-PRP	840 000.00	851 550.00	0.01
USD TRAFIGURA GROUP PTE LTD-REG-S-SUB 6.875%/VAR 17-PRP	1 620 000.00	1 607 850.00	0.02
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S VAR 15-31.05.40	11 687 000.00	13 166 135.94	0.19
USD UPL CORP LTD-REG-S-SUB 5.250%/VAR 20-PRP	9 232 000.00	9 061 785.00	0.13
USD URUGUAY, REPUBLIC OF (PIK) 7.87500% 03-15.01.33	9 756 423.00	15 515 761.45	0.22
USD YUZHOU PROPERTIES CO LTD-REG-S 5.375%/VAR 17-PRP	200 000.00	196 937.50	0.00
USD ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD-REG-S 10.250%/VAR 19-PRP	1 510 000.00	1 550 109.38	0.02
米ドル合計		180 882 632.29	2.55
債券、変動利付債合計		180 882 632.29	2.55
転換社債型新株予約権付社債、固定利付			
USD			
USD GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD-REG-S 2.00000% 16-28.06.22	1 250 000.00	1 375 825.00	0.02
USD INNOVATE CAPITAL PTE LTD-REG-S (PIK) 6.00000% 17-11.12.24	950 000.00	382 850.86	0.00
米ドル合計		1 758 675.86	0.02
転換社債型新株予約権付社債、固定利付合計		1 758 675.86	0.02
転換社債型新株予約権付社債、変動利付			
USD			
USD BANCO MER DEL NORTE SA/GRAN-REG-S-SUB 7.500%/VAR 19-PRP	7 934 000.00	8 671 623.98	0.12
USD BANCO MERCANTIL DEL NOR-REG-S-SUB 6.750%/VAR 19-PRP	10 990 000.00	11 623 683.40	0.17

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

2021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 EMIRATES NBD PJSC-REG-S-SUB COCO 6.125%/VAR 20-PRP	7 980 000.00	8 653 512.00	0.12
USD YAPI VE KREDI BANKASI AS-REG-S-SUB 13.875%/VAR 19-PRP	8 590 000.00	9 906 417.50	0.14
米ドル合計		38 855 236.88	0.55
転換社債型新株予約権付社債、変動利付合計		38 855 236.88	0.55
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		6 574 144 210.62	92.75
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			
USD			
USD ALFA SAB DE CV-REG-S 6.87500% 14-25.03.44	4 945 000.00	6 411 192.50	0.09
USD ALPEK SA DE CV-REG-S 4.25000% 19-18.09.29	5 396 000.00	5 795 641.25	0.08
USD AMAGGI LUXEMBOURG INTERNATIONAL-REG-S 5.25000% 21-28.01.28	1 122 000.00	1 134 342.00	0.02
USD BANGKOK BANK PUBLIC CO LTD HK-REG-S-SUB 9.02500% 97-15.03.29	1 390 000.00	1 925 150.00	0.03
USD BRAZIL MINAS SPE-REG-S 5.33300% 13-15.02.28	13 266 000.00	11 567 952.00	0.16
USD C&W SENIOR FIN DESIGNATD ACT V CO-REG-S 6.87500% 17-15.09.27	6 010 000.00	6 398 396.24	0.09
USD C&W SENIOR FIN DESIGNATD ACT V CO-REG-S 7.50000% 18-15.10.26	1 146 000.00	1 212 204.42	0.02
USD CELULOSA ARAUCO Y CONSTITUCION SA-REG-S 4.20000% 19-29.01.30	1 406 000.00	1 581 750.00	0.02
USD CENCOSUD SA-REG-S 5.15000% 15-12.02.25	741 000.00	826 511.40	0.01
USD DOLPHIN ENERGY LTD-REG-S 5.50000% 12-15.12.21	1 805 000.00	1 882 840.63	0.03
USD ECOPETROL SA 5.37500% 15-26.06.26	3 632 000.00	4 121 412.00	0.06
USD ECOPETROL SA 5.87500% 14-28.05.45	15 703 000.00	17 860 592.20	0.25
USD ECOPETROL SA 7.37500% 13-18.09.43	3 390 000.00	4 390 050.00	0.06
USD FRESNILLO PLC-REG-S 4.25000% 20-02.10.50	5 868 000.00	6 221 987.10	0.09
USD INDIA GREEN ENERGY HOLDINGS-REG-S 5.37500% 20-29.04.24	250 000.00	261 875.00	0.00
USD INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CN/NY 3.53800% 17-08.11.27	1 676 000.00	1 893 880.00	0.03
USD INVERSIONES CMPC SA-REG-S 4.75000% 14-15.09.24	1 880 000.00	2 071 760.00	0.03
USD INVERSIONES CMPC SA-REG-S 3.85000% 20-13.01.30	278 000.00	307 885.00	0.00
USD KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV-144A 3.80000% 14-08.04.24	140 000.00	150 850.00	0.00
USD KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV-144A 3.25000% 15-12.03.25	307 000.00	328 298.13	0.01
USD LCPR SENIOR SECURED FINANCING DAC-144A 6.75000% 19-15.10.27	3 029 000.00	3 256 871.67	0.05
USD LCPR SENIOR SECURED FINANCING DAC-REG-S 6.75000% 19-15.10.27	1 250 000.00	1 344 037.50	0.02
USD LUKOIL INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 4.56300% 13-24.04.23	4 972 000.00	5 293 626.25	0.08
USD MINERA MEXICO SA DE CV-144A 4.50000% 19-26.01.50	810 000.00	916 312.50	0.01
USD MINERA MEXICO SA DE CV-REG-S 4.50000% 19-26.01.50	5 688 000.00	6 434 550.00	0.09
USD MV24 CAPITAL BV-REG-S 6.74800% 19-01.06.34	24 908 000.00	25 618 663.83	0.36
USD NEMAK SAB DE CV-REG-S 4.75000% 18-23.01.25	400 000.00	412 000.00	0.01
USD PERU, REPUBLIC OF 5.62500% 10-18.11.50	2 446 000.00	3 733 971.88	0.05
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 7.25000% 14-17.03.44	752 000.00	919 996.80	0.01
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 6.85000% 15-05.06.115	20 267 000.00	23 641 455.50	0.33
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 6.00000% 13-15.11.26	22 988 469.00	804 596.42	0.01
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 6.00000% 14-28.10.22	31 450 000.00	880 600.00	0.01
USD SACI FALABELLA-REG-S 3.75000% 17-30.10.27	1 018 000.00	1 098 931.00	0.02
USD SAMARCO MINERACAO SA-REG-S *DEFAULT* 5.75000% 13-24.10.23	2 950 000.00	2 213 606.25	0.03
USD SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHIL-REG-S 4.25000% 19-07.05.29	825 000.00	944 882.81	0.01
USD ST MARYS CEMENT INC CANADA-REG-S 5.75000% 16-28.01.27	2 125 000.00	2 483 381.25	0.04
USD TRUST F/1401-REG-S 6.39000% 19-15.01.50	3 742 000.00	4 378 140.00	0.06
USD TRUST F/1401-REG-S 6.95000% 14-30.01.44	1 488 000.00	1 815 360.00	0.03
USD TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO-144A 5.25000% 20-05.02.25	970 000.00	959 390.63	0.01
米ドル合計		163 494 944.16	2.31
ノート、固定利付債合計		163 494 944.16	2.31

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

2021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、ゼロ・クーポン			
USD			
USD RUTAS 2 AND 7 FINANCE LTD-REG-S 0.00000% 19-30.09.36	9 143 000.00	6 880 107.50	0.10
米ドル合計		6 880 107.50	0.10
ノート、ゼロ・クーポン合計			0.10
ノート、変動利付債			
USD			
USD BANCO INDUSTRIAL SA/GUATE-REG-S-SUB 4.875%/VAR 21-29.01.31	6 647 000.00	6 796 557.50	0.09
米ドル合計		6 796 557.50	0.09
ノート、変動利付債合計			0.09
債券、固定利付債			
USD			
USD 1MDB GLOBAL INV-REG-S 4.40000% 13-09.03.23	13 000 000.00	13 024 375.00	0.18
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 9.00000% 11-17.11.21	2 611 961.00	91 418.64	0.00
USD TENGIZCHEVROIL FINANCE CO INTL-REG-S 4.00000% 16-15.08.26	4 843 000.00	5 307 625.31	0.08
米ドル合計		18 423 418.95	0.26
債券、固定利付債合計			0.26
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			2.76
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			
USD			
USD COLBUN SA-REG-S 3.15000% 20-06.03.30	960 000.00	1 027 800.00	0.01
USD DIGICEL GROUP 0.5 LTD (PIK) 10.00000% 20-01.04.24	5 698 988.00	5 371 296.19	0.08
USD DIGICEL GROUP 0.5 LTD-REG-S 8.00000% 20-01.04.25	1 422 684.00	867 837.24	0.01
USD DIGICEL INTERNATIONAL FINANCE LTD-REG-S 8.75000% 20-25.05.24	5 738 974.00	5 988 260.67	0.08
USD DIGICEL INTL FINANCE LTD-REG-S (PIK) 13.00000% 20-31.12.25	605 453.00	606 966.63	0.01
USD DIGICEL INTL FINANCE LTD-REG-S-SUB 8.00000% 20-31.12.26	505 606.00	429 607.10	0.01
USD FEL ENERGY VI SARL-REG-S 5.75000% 20-01.12.40	4 616 000.00	4 808 718.00	0.07
USD FIRST QUANTUM MINERALS LTD-REG-S 6.87500% 20-15.10.27	6 286 000.00	6 761 378.76	0.10
USD KENBOURNE INVEST SA-REG-S 4.70000% 21-22.01.28	1 712 000.00	1 731 260.00	0.02
USD PRUMO PARTICIPACOES E INVESTIMENT-REG-S 7.50000% 19-31.12.31	5 410 000.00	5 332 021.44	0.08
USD SABLE INTERNATIONAL FINANCE LTD-REG-S 5.75000% 19-07.09.27	2 000 000.00	2 119 220.00	0.03
USD SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHIL-REG-S 4.25000% 20-22.01.50	1 386 000.00	1 586 103.75	0.02
USD TENGIZCHEVROIL FINANCE CO INTL-REG-S 3.25000% 20-15.08.30	7 143 000.00	7 425 719.94	0.10
USD TENGIZCHEVROIL FINANCE CO INTL-REG-S 2.62500% 20-15.08.25	7 730 000.00	7 969 630.00	0.11
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NETHERLANDS 7.12500% 20-31.01.25	5 077 000.00	5 610 084.99	0.08
米ドル合計		57 635 904.71	0.81
ノート、固定利付債合計			0.81

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

2021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			
USD			
USD ARABIAN CENTRES SUKUK LTD-REG-S 5.37500% 19-26.11.24	1 165 000.00	1 190 120.31	0.02
米ドル合計		1 190 120.31	0.02
債券、固定利付債合計		1 190 120.31	0.02
転換社債型新株予約権付社債、固定利付			
USD			
USD DIGICEL GROUP 0.5 LTD-REG-S-SUB (PIK) 7.00000% 20-PRP	1 327 539.00	451 363.26	0.01
USD IQIYI INC 2.00000% 20-01.04.25	410 000.00	391 119.50	0.00
米ドル合計		842 482.76	0.01
転換社債型新株予約権付社債、固定利付合計		842 482.76	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		59 668 507.78	0.84
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			
USD			
USD DIGICEL INTL FINANCE LTD-144A (PIK) 13.00000% 20-31.12.25	1 406 371.00	1 409 886.93	0.02
米ドル合計		1 409 886.93	0.02
ノート、固定利付債合計		1 409 886.93	0.02
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		1 409 886.93	0.02
投資有価証券合計		6 830 817 633.44	96.37
金融派生商品			
公認の証券取引所に上場されている金融派生商品			
債券に係る金融先物			
EUR EURO-BUND FUTURE 08.03.21	-804.00	-104 442.59	0.00
EUR EURO-BOBL FUTURE 08.03.21	-498.00	-46 554.97	0.00
EUR EURO-SCHATZ FUTURE 08.03.21	-83.00	2 016.73	0.00
EUR EURO-BUXL FUTURE 08.03.21	-149.00	335 348.75	0.00
USD US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 22.03.21	-43.00	-418 929.70	-0.01
USD US LONG BOND FUTURE 22.03.21	647.00	-3 614 331.56	-0.05
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.21	552.00	92 383.76	0.00
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.21	673.00	81 744.35	0.00
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 22.03.21	-475.00	661 165.86	0.01
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 22.03.21	1 642.00	-1 043 659.64	-0.01
債券に係る金融先物合計		-4 055 259.01	-0.06
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		-4 055 259.01	-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

2021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金融派生商品				
クレジット・デフォルト・スワップ*				
USD	CITIGROUP/CDX.EM.33 CDI PAYER 1.00000% 20-20.06.25	12 388 000.00	105 801.78	0.00
USD	CITIGROUP/CDX.EM.33 CDI PAYER 1.00000% 20-20.06.25	12 829 750.00	109 574.61	0.00
USD	CITIGROUP/CDX.EM.33 CDI PAYER 1.00000% 20-20.06.25	25 241 500.00	215 579.24	0.00
USD	CITIGROUP/CDX.EM.33 CDI PAYER 1.00000% 20-20.06.25	14 440 000.00	123 327.23	0.00
USD	JPM/SOUTHAFRICA REPUBLIC CREDIT DEFAULT SWAP PAYER 1.00000% 20-20.12.25	12 010 000.00	696 012.85	0.01
USD	JP MORGAN/RUSSIA CREDIT DEFAULT SWAP PAYER 1.00000% 20-20.12.25	33 770 000.00	-81 460.11	0.00
USD	BARCLAYS/SOUTHAFRICA REPUBLIC CREDIT DEFAULT SWAP PAYER 1.00000% 20-20.12.25	8 830 000.00	511 723.02	0.01
USD	BARCLAYS/SOUTHAFRICA REPUBLIC CREDIT DEFAULT SWAP PAYER 1.00000% 20-20.12.25	30 200 000.00	1 750 173.85	0.03
USD	JP MORGAN/RUSSIA CREDIT DEFAULT SWAP PAYER 1.00000% 20-20.12.25	1 580 000.00	-3 811.28	0.00
USD	CITIGROUP/RUSSIA CREDIT DEFAULT SWAP PAYER 1.00000% 20-20.06.25	494 000.00	-1 191.63	0.00
USD	GOLDMAN SACHS/RUSSIA CREDIT DEFAULT SWAP PAYER 1.00000% 20-20.12.25	582 000.00	-1 403.90	0.00
USD	MORGAN STANLEY/RUSSIA CREDIT DEFAULT SWAP PAYER 1.00000% 20-20.12.25	1 375 000.00	-3 316.78	0.00
USD	JP MORGAN/RUSSIA CREDIT DEFAULT SWAP PAYER 1.00000% 20-20.12.25	3 469 000.00	-8 367.93	0.00
USD	CITIGROUP/PERU CREDIT DEFAULT SWAP REC 1.00000% 20-20.12.25	-34 946 000.00	667 265.33	0.01
USD	CITI GROUP/QATAR CREDIT DEFAULT SWAP REC 1.00000% 20-20.12.25	-19 500 000.00	539 484.73	0.01
USD	JPMORGAN/QATAR CREDIT DEFAULT SWAP REC 1.00000% 20-20.12.25	-6 100 000.00	168 761.89	0.00
USD	JPMORGAN/QATAR CREDIT DEFAULT SWAP REC 1.00000% 20-20.12.25	-9 000 000.00	248 992.95	0.00
USD	CITIGROUP/ARGENT CREDIT DEFAULT SWAP REC 5.00000% 20-20.12.25	-3 850 000.00	-961 539.54	-0.01
クレジット・デフォルト・スワップ合計			4 075 606.31	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金融派生商品合計			4 075 606.31	0.06
金融派生商品合計			20 347.30	0.00

* 額面が正：サブ・ファンドは「受取側」、額面が負：サブ・ファンドは「支払側」

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

2021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				
購入通貨	購入額	売却通貨	売却額	満期日
USD	50 473 301.23	EUR	42 556 000.00	10.2.2021
USD	127 269 446.90	EUR	106 095 271.00	3.3.2021
USD	1 548 773.87	EUR	1 290 000.00	3.3.2021
JPY	1 372 147 064.00	USD	13 340 000.00	5.2.2021
SGD	19 654 751.05	USD	14 922 000.00	5.2.2021
CHF	1 077 828 423.71	USD	1 226 867 000.00	5.2.2021
EUR	2 345 877 439.64	USD	2 884 946 000.00	5.2.2021
GBP	90 498 288.57	USD	123 366 000.00	5.2.2021
CHF	20 220 565.00	USD	23 000 000.00	5.2.2021
EUR	39 079 705.50	USD	48 000 000.00	5.2.2021
USD	12 000 000.00	EUR	9 896 833.76	5.2.2021
USD	4 965 483.68	EUR	4 093 208.64	26.2.2021
USD	195 785 208.77	EUR	161 164 628.99	9.4.2021
EUR	6 396 597.31	USD	7 759 686.61	9.4.2021
USD	24 156 708.70	EUR	19 919 280.22	26.2.2021
USD	943 381.98	EUR	774 779.18	16.2.2021
USD	134 723.59	EUR	111 275.96	26.2.2021
USD	4 570 852.07	EUR	3 761 373.00	3.3.2021
EUR	821 776.25	USD	998 914.23	9.4.2021
先渡為替契約合計				
			-1 238 750.40	-0.02
			-1 707 192.52	-0.02
			-19 438.01	0.00
			-233 361.85	0.00
			-111 921.74	0.00
			-15 106 755.51	-0.21
			-34 658 009.07	-0.49
			908 663.04	0.01
			-266 811.44	0.00
			-517 376.49	-0.01
			-24 850.89	0.00
			-9 985.67	0.00
			-305 372.20	-0.01
			23 115.92	0.00
			-56 024.37	0.00
			1 831.29	0.00
			-537.08	0.00
			-1 729.20	0.00
			948.97	0.00
			-53 323 557.22	-0.75
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産			276 568 857.42 **	3.90
当座借越およびその他の短期負債			-3 084 106.91	-0.04
その他の資産および負債			37 190 350.63	0.52
純資産総額			7 088 189 524.66	100.00

** 2021年1月31日現在、U B S ヨーロッパ S E に対する2,745,298.17米ドル、シティバンクに対する630,000.00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

2021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			
アセット・バック証券、変動利付			
USD			
USD MIDOCEAN CREDIT CLO III -144A 3M LIBOR+112BP 18-21.04.31	3 000 000.00	2 964 499.35	0.05
USD OCP CLO LTD-144A 3M LIBOR+126BP 17-15.07.30	2 000 000.00	2 001 094.00	0.04
USD ZAIS CLO 6 LTD-144A 3M LIBOR+137BP 17-15.07.29	3 000 000.00	2 900 960.26	0.05
米ドル合計		7 866 553.61	0.14
アセット・バック証券、変動利付合計		7 866 553.61	0.14
ノート、固定利付債			
EUR			
EUR FIDELITY NATIONAL INFO SERVICES 0.75000% 19-21.05.23	400 000.00	495 284.60	0.01
EUR MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 1.62500% 19-07.03.31	100 000.00	137 394.01	0.00
ユーロ合計		632 678.61	0.01
USD			
USD 3M CO 2.65000% 20-15.04.25	1 210 000.00	1 308 315.39	0.02
USD ABBOTT LABORATORIES 3.40000% 16-30.11.23	716 000.00	773 034.44	0.01
USD ABBOTT LABORATORIES 1.15000% 20-30.01.28	7 100 000.00	7 109 354.75	0.13
USD ABBVIE INC 2.30000% 16-14.05.21	2 100 000.00	2 109 656.75	0.04
USD ABBVIE INC 2.30000% 20-21.11.22	4 415 000.00	4 562 324.45	0.08
USD ABBVIE INC 2.60000% 20-21.11.24	5 825 000.00	6 223 142.43	0.11
USD ABBVIE INC 2.95000% 20-21.11.26	16 040 000.00	17 646 538.32	0.32
USD ABBVIE INC 3.20000% 16-14.05.26	4 882 000.00	5 376 403.01	0.10
USD ABBVIE INC 3.20000% 20-21.11.29	5 170 000.00	5 719 968.52	0.10
USD ABBVIE INC 3.60000% 15-14.05.25	7 260 000.00	8 047 314.26	0.14
USD ABBVIE INC 3.75000% 18-14.11.23	2 030 000.00	2 207 064.43	0.04
USD ABBVIE INC 3.80000% 20-15.03.25	1 100 000.00	1 221 864.49	0.02
USD ABBVIE INC 4.05000% 20-21.11.39	1 730 000.00	2 028 197.25	0.04
USD ABBVIE INC 4.50000% 15-14.05.35	1 500 000.00	1 848 421.16	0.03
USD ABN AMRO BANK NV-144A-SUB 4.75000% 15-28.07.25	1 954 000.00	2 241 851.56	0.04
USD ADANI PORTS&SPECIAL ECO ZONE LTD-REG-S 4.00000% 17-30.07.27	1 075 000.00	1 161 335.93	0.02
USD ADANI TRANSMISSION LTD-REG-S 4.00000% 16-03.08.26	1 075 000.00	1 164 028.06	0.02
USD ADVANCE AUTO PARTS INC 1.75000% 20-01.10.27	356 000.00	363 334.96	0.01
USD AERCAP IRE CAP LTD/GLB AVIA TRUST 3.95000% 16-01.02.22	1 000 000.00	1 028 960.30	0.02
USD AERCAP IRE CAP LTD/GLB AVIA TRUST 4.45000% 18-01.10.25	575 000.00	632 716.91	0.01
USD AERCAP IRE CAP LTD/GLB AVIA TRUST 4.87500% 19-16.01.24	1 000 000.00	1 098 746.83	0.02
USD AERCAP IRE CAP LTD/GLB AVIA TRUST 3.15000% 20-15.02.24	1 569 000.00	1 644 666.42	0.03
USD AERCAP IRE CAP LTD/GLB AVIA TRUST 1.75000% 21-30.01.26	4 600 000.00	4 532 250.14	0.08
USD AERCAP IRELAND CAP/ GLBL AVIATION TRUST 6.50000% 20-15.07.25	640 000.00	758 389.11	0.01
USD AES PANAMA GENERATION HOLDINGS SRL-144A 4.37500% 20-31.05.30	673 000.00	720 951.25	0.01
USD AETNA INC 3.50000% 14-15.11.24	1 000 000.00	1 098 262.08	0.02
USD AIR LEASE CORP 3.00000% 16-15.09.23	750 000.00	788 724.31	0.01
USD AIR LEASE CORP 3.25000% 18-01.03.25	2 720 000.00	2 910 850.79	0.05
USD AIR LEASE CORP 3.50000% 18-15.01.22	500 000.00	513 786.17	0.01
USD AIR LEASE CORP 3.62500% 17-01.12.27	2 689 000.00	2 937 956.21	0.05
USD AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC 1.85000% 20-15.05.27	2 385 000.00	2 504 773.81	0.04
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC 3.45000% 17-30.04.25	1 015 000.00	1 123 132.86	0.02
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC 4.00000% 18-15.01.24	1 720 000.00	1 890 864.61	0.03
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC 3.80000% 19-15.04.26	550 000.00	627 844.01	0.01
USD ALIBABA GROUP HOLDING LTD 2.80000% 17-06.06.23	5 071 000.00	5 288 647.32	0.09
USD ALIBABA GROUP HOLDING LTD 3.40000% 17-06.12.27	4 825 000.00	5 340 068.75	0.10
USD ALLEGHANY CORP 3.62500% 20-15.05.30	4 323 000.00	4 877 771.59	0.09
USD ALLY FINANCIAL INC 1.45000% 20-02.10.23	4 850 000.00	4 929 429.80	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 - US マルチ・クレジット

2021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 ALLY FINANCIAL INC 3.87500% 19-21.05.24	4 860 000.00	5 303 277.05	0.10
USD ALPHABET INC 0.45000% 20-15.08.25	1 010 000.00	1 006 212.07	0.02
USD ALPHABET INC 1.10000% 20-15.08.30	8 200 000.00	7 942 698.51	0.14
USD ALTRIA GROUP INC 2.35000% 20-06.05.25	2 850 000.00	3 007 941.44	0.05
USD ALTRIA GROUP INC 4.80000% 19-14.02.29	3 784 000.00	4 496 080.46	0.08
USD AMAZON.COM INC 0.80000% 20-03.06.25	2 050 000.00	2 070 567.69	0.04
USD AMAZON.COM INC 2.40000% 18-22.02.23	2 220 000.00	2 312 204.88	0.04
USD AMAZON.COM INC 3.15000% 18-22.08.27	1 810 000.00	2 047 644.20	0.04
USD AMAZON.COM INC 3.80000% 14-05.12.24	3 275 000.00	3 664 605.72	0.07
USD AMCOR FINANCE USA INC 3.62500% 20-28.04.26	2 550 000.00	2 877 783.40	0.05
USD AMEREN CORP 2.50000% 19-15.09.24	4 815 000.00	5 130 697.93	0.09
USD AMEREN CORP 3.50000% 20-15.01.31	4 105 000.00	4 652 935.40	0.08
USD AMERICA MOVIL SAB DE CV 2.87500% 20-07.05.30	1 703 000.00	1 826 041.75	0.03
USD AMERICAN ASSETS TRUST LP 3.37500% 21-01.02.31	1 340 000.00	1 382 279.09	0.02
USD AMERICAN CAMPUS COMMUN OPER PARTN 4.12500% 14-01.07.24	585 000.00	643 282.98	0.01
USD AMERICAN EXPRESS CO 3.12500% 19-20.05.26	11 485 000.00	12 758 088.14	0.23
USD AMERICAN EXPRESS CO 2.50000% 19-30.07.24	1 750 000.00	1 861 776.96	0.03
USD AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC 4.12500% 13-15.02.24	4 035 000.00	4 458 726.20	0.08
USD AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC-SUB 3.75000% 15-10.07.25	1 100 000.00	1 224 172.04	0.02
USD AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC 3.90000% 16-01.04.26	1 460 000.00	1 653 409.95	0.03
USD AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC 4.20000% 18-01.04.28	2 980 000.00	3 490 564.74	0.06
USD AMERICAN TOWER CORP 5.00000% 13-15.02.24	4 958 000.00	5 585 935.16	0.10
USD AMERICAN TOWER CORP 3.37500% 16-15.10.26	3 740 000.00	4 164 426.09	0.07
USD AMERICAN TOWER CORP 3.00000% 17-15.06.23	1 000 000.00	1 058 059.82	0.02
USD AMERICAN TOWER CORP 3.80000% 19-15.08.29	3 208 000.00	3 648 188.29	0.07
USD AMERICAN WATER CAPITAL CORP 2.95000% 17-01.09.27	2 505 000.00	2 785 040.64	0.05
USD AMERISOURCEBERGEN CORP 3.45000% 17-15.12.27	1 195 000.00	1 354 207.56	0.02
USD AMGEN INC 2.20000% 20-21.02.27	3 375 000.00	3 575 599.00	0.06
USD AMGEN INC 2.65000% 17-11.05.22	4 975 000.00	5 116 913.87	0.09
USD AMGEN INC 2.70000% 15-01.05.22	2 259 000.00	2 320 977.68	0.04
USD AMGEN INC 3.15000% 20-21.02.40	3 820 000.00	4 045 263.72	0.07
USD ANALOG DEVICES INC 2.95000% 20-01.04.25	435 000.00	471 995.69	0.01
USD ANALOG DEVICES INC 3.90000% 15-15.12.25	2 668 000.00	3 032 162.12	0.05
USD ANALOG DEVICES INC 3.12500% 16-05.12.23	2 585 000.00	2 773 667.13	0.05
USD ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC-144A 4.87500% 15-14.05.25	1 800 000.00	2 072 812.50	0.04
USD ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC-144A 5.37500% 20-01.04.25	1 390 000.00	1 618 046.87	0.03
USD ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC-REG-S 4.50000% 18-15.03.28	2 800 000.00	3 273 368.00	0.06
USD ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 4.15000% 19-23.01.25	4 250 000.00	4 805 674.14	0.09
USD ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 4.00000% 18-13.04.28	3 840 000.00	4 450 033.53	0.08
USD ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 4.75000% 19-23.01.29	7 955 000.00	9 659 229.88	0.17
USD ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE 3.50000% 20-01.06.30	2 750 000.00	3 137 664.48	0.06
USD ANTERO RESOURCES CORP 5.00000% 17-01.03.25	1 076 000.00	1 019 510.00	0.02
USD ANTHEM INC 2.37500% 19-15.01.25	2 840 000.00	3 013 796.92	0.05
USD ANTHEM INC 2.87500% 19-15.09.29	2 000 000.00	2 183 180.74	0.04
USD ANTHEM INC 3.70000% 11-15.08.21	1 500 000.00	1 514 826.47	0.03
USD ANTHEM INC 4.10100% 18-01.03.28	2 250 000.00	2 630 141.12	0.05
USD AON CORP 2.80000% 20-15.05.30	2 050 000.00	2 207 187.77	0.04
USD AON CORP 3.75000% 19-02.05.29	1 620 000.00	1 867 888.38	0.03
USD APPALACHIAN POWER CO 4.60000% 11-30.03.21	660 000.00	662 111.94	0.01
USD APPALACHIAN POWER CO 3.40000% 15-01.06.25	5 300 000.00	5 804 180.42	0.10
USD APPALACHIAN POWER CO 3.30000% 17-01.06.27	2 490 000.00	2 770 286.87	0.05
USD APPLE INC 1.12500% 20-11.05.25	4 165 000.00	4 260 791.75	0.08
USD APPLE INC 1.65000% 20-11.05.30	3 705 000.00	3 745 581.60	0.07
USD APPLE INC 2.05000% 19-11.09.26	2 400 000.00	2 549 021.93	0.05
USD APPLE INC 2.50000% 17-09.02.22	4 500 000.00	4 596 642.27	0.08
USD APPLE INC 2.75000% 17-13.01.25	3 700 000.00	3 999 157.14	0.07
USD APPLE INC 2.85000% 17-11.05.24	3 675 000.00	3 952 529.42	0.07
USD APPLE INC 3.00000% 17-20.06.27	1 085 000.00	1 218 232.05	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

2021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 APPLE INC 3.0000% 17-13.11.27	5 230 000.00	5 881 463.13	0.11
USD APPLE INC 3.2500% 16-23.02.26	3 525 000.00	3 933 410.02	0.07
USD ASTRAZENECA PLC 0.7000% 20-08.04.26	6 335 000.00	6 246 490.16	0.11
USD ASTRAZENECA PLC 1.3750% 20-06.08.30	5 700 000.00	5 505 181.53	0.10
USD ASTRAZENECA PLC 3.5000% 18-17.08.23	3 870 000.00	4 159 088.69	0.07
USD AT&T INC 1.6500% 20-01.02.28	3 875 000.00	3 899 306.32	0.07
USD AT&T INC 2.3000% 20-01.06.27	4 985 000.00	5 264 049.84	0.09
USD AT&T INC 3.0000% 15-30.06.22	4 500 000.00	4 650 173.82	0.08
USD AT&T INC 3.5000% 20-01.06.41	1 935 000.00	1 995 186.90	0.04
USD AT&T INC 4.3000% 18-15.02.30	1 625 000.00	1 906 450.00	0.03
USD AT&T INC 4.3500% 19-01.03.29	15 890 000.00	18 657 277.82	0.33
USD AT&T INC 4.5000% 15-15.05.35	1 615 000.00	1 916 370.74	0.03
USD ATMOS ENERGY CORP 3.0000% 17-15.06.27	1 500 000.00	1 667 275.98	0.03
USD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK-REG-S-SUB-4.4000% 16-19.05.26	6 800 000.00	7 776 140.00	0.14
USD AUTODESK INC 3.5000% 17-15.06.27	3 482 000.00	3 939 605.28	0.07
USD AUTODESK INC 4.3750% 15-15.06.25	3 400 000.00	3 851 230.15	0.07
USD AUTONATION INC 4.7500% 20-01.06.30	424 000.00	510 303.13	0.01
USD AUTOZONE INC 3.1250% 19-18.04.24	2 675 000.00	2 881 805.08	0.05
USD AVALON BAY COMMUNITIES INC 3.3000% 19-01.06.29	1 325 000.00	1 484 287.22	0.03
USD AVANGRID INC 3.1500% 17-01.12.24	2 190 000.00	2 386 205.23	0.04
USD BAE SYSTEMS PLC-144A 3.4000% 20-15.04.30	255 000.00	284 472.99	0.01
USD BAIDU INC 2.8750% 17-06.07.22	929 000.00	953 813.59	0.02
USD BAIDU INC 3.0750% 20-07.04.25	406 000.00	432 424.79	0.01
USD BALL CORP 2.8750% 20-15.08.30	2 040 000.00	2 030 412.00	0.04
USD BALL CORP 4.0000% 13-15.11.23	250 000.00	267 187.50	0.00
USD BALTIMORE GAS & ELECTRIC CO 2.4000% 16-15.08.26	2 755 000.00	2 960 976.92	0.05
USD BANCO SANTANDER SA 2.7060% 19-27.06.24	1 800 000.00	1 919 798.19	0.03
USD BANCO SANTANDER SA 2.7460% 20-28.05.25	3 200 000.00	3 421 703.65	0.06
USD BANCO SANTANDER SA 3.1250% 17-23.02.23	400 000.00	421 052.57	0.01
USD BANCO SANTANDER SA 3.8480% 18-12.04.23	1 200 000.00	1 286 851.65	0.02
USD BANCO SANTANDER SA 4.2500% 17-11.04.27	800 000.00	922 917.98	0.02
USD BANCO SANTANDER SA-SUB 5.1790% 15-19.11.25	6 600 000.00	7 694 091.51	0.14
USD BANCO SANTANDER SA-SUB 2.7490% 20-03.12.30	1 400 000.00	1 409 876.64	0.03
USD BANK OF AMERICA CORP 4.0000% 14-01.04.24	4 221 000.00	4 664 198.25	0.08
USD BANK OF AMERICA CORP 4.1000% 13-24.07.23	3 000 000.00	3 275 297.91	0.06
USD BANK OF IRELAND GROUP PLC-144A 4.5000% 18-25.11.23	2 447 000.00	2 679 700.28	0.05
USD BARCLAYS PLC 3.6500% 15-16.03.25	3 185 000.00	3 492 281.41	0.06
USD BARCLAYS PLC 4.3370% 17-10.01.28	900 000.00	1 030 695.97	0.02
USD BARCLAYS PLC 4.3750% 16-12.01.26	5 040 000.00	5 748 220.80	0.10
USD BARCLAYS PLC-SUB 4.8360% 17-09.05.28	1 280 000.00	1 460 545.42	0.03
USD BAT CAPITAL CORP 2.2590% 20-25.03.28	1 855 000.00	1 895 471.31	0.03
USD BAT CAPITAL CORP 3.2220% 18-15.08.24	3 360 000.00	3 626 325.56	0.07
USD BAT CAPITAL CORP 3.2150% 19-06.09.26	1 382 000.00	1 507 551.41	0.03
USD BAT CAPITAL CORP 3.4620% 19-06.09.29	1 250 000.00	1 363 943.93	0.02
USD BAT CAPITAL CORP 3.5570% 18-15.08.27	6 895 000.00	7 662 614.08	0.14
USD BAT CAPITAL CORP 4.9060% 20-02.04.30	2 025 000.00	2 396 113.57	0.04
USD BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC 1.6680% 20-25.03.26	1 095 000.00	1 111 986.05	0.02
USD BAXALTA INC 4.0000% 16-23.06.25	893 000.00	1 003 849.65	0.02
USD BAYER US FINANCE II LLC-144A 3.8750% 18-15.12.23	1 710 000.00	1 863 216.99	0.03
USD BAYER US FINANCE II LLC-144A 4.2500% 18-15.12.25	1 000 000.00	1 141 955.01	0.02
USD BAYER US FINANCE II LLC-144A 4.3750% 18-15.12.28	1 780 000.00	2 087 477.37	0.04
USD BAYER US FINANCE II LLC-144A 2.2000% 18-15.07.22	1 250 000.00	1 276 540.10	0.02
USD BBVA BANCOMER SA/TEXAS-144A-SUB 6.5000% 11-10.03.21	955 000.00	957 387.50	0.02
USD BECTON DICKINSON AND CO 3.7340% 14-15.12.24	3 767 000.00	4 165 239.78	0.07
USD BECTON DICKINSON AND CO 2.8940% 17-06.06.22	2 209 000.00	2 277 912.58	0.04
USD BECTON DICKINSON AND CO 3.3630% 17-06.06.24	4 691 000.00	5 094 395.23	0.09
USD BEMIS CO INC 2.6300% 20-19.06.30	4 590 000.00	4 873 196.11	0.09
USD BERKSHIRE HATHAWAY FINANCE CORP 1.8500% 20-12.03.30	3 410 000.00	3 524 988.06	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

2021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 BIOGEN INC 2.25000% 20-01.05.30	1 970 000.00	2 026 747.52	0.04
USD BLACK HILLS CORP 3.95000% 16-15.01.26	575 000.00	651 157.23	0.01
USD BMW US CAPITAL LLC-REG-S 3.80000% 20-06.04.23	2 750 000.00	2 946 268.49	0.05
USD BNP PARIBAS-REG-S 3.37500% 18-09.01.25	1 185 000.00	1 290 951.62	0.02
USD BNP PARIBAS-REG-S 4.40000% 18-14.08.28	2 700 000.00	3 182 656.40	0.06
USD BNZ INTERNATIONAL FUND LTD/LONDON-144A 3.37500% 18-01.03.23	2 495 000.00	2 646 521.35	0.05
USD BOARDWALK PIPELINES LP 5.95000% 16-01.06.26	2 260 000.00	2 701 409.64	0.05
USD BOARDWALK PIPELINES LP 4.80000% 19-03.05.29	1 574 000.00	1 798 765.99	0.03
USD BOEING CO 1.95000% 20-01.02.24	3 175 000.00	3 261 058.25	0.06
USD BOEING CO 3.60000% 19-01.05.34	2 775 000.00	2 890 796.23	0.05
USD BOEING CO 5.04000% 20-01.05.27	6 500 000.00	7 571 703.75	0.14
USD BOEING CO 5.15000% 20-01.05.30	1 730 000.00	2 054 286.70	0.04
USD BOOKING HOLDINGS INC 4.10000% 20-13.04.25	1 834 000.00	2 069 219.39	0.04
USD BOOKING HOLDINGS INC 4.62500% 20-13.04.30	3 370 000.00	4 092 194.81	0.07
USD BOSTON PROPERTIES LP 2.75000% 16-01.10.26	1 974 000.00	2 138 077.97	0.04
USD BOSTON PROPERTIES LP 3.20000% 17-15.01.25	2 015 000.00	2 187 244.27	0.04
USD BOSTON PROPERTIES LP 3.25000% 20-30.01.31	1 840 000.00	1 986 939.55	0.04
USD BP CAPITAL MARKETS AMERICA INC 3.41000% 19-11.02.26	5 450 000.00	6 066 169.69	0.11
USD BP CAPITAL MARKETS AMERICA INC 3.63300% 20-06.04.30	1 590 000.00	1 809 104.02	0.03
USD BP CAPITAL MARKETS PLC 3.21600% 18-28.11.23	3 765 000.00	4 035 578.80	0.07
USD BP CAPITAL MARKETS PLC 2.52000% 18-19.09.22	2 250 000.00	2 326 094.24	0.04
USD BPCE SA-144A-SUB 5.15000% 14-21.07.24	2 425 000.00	2 751 779.95	0.05
USD BRISTOL MYERS SQUIBB CO 3.40000% 20-26.07.29	5 905 000.00	6 753 761.85	0.12
USD BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 2.90000% 20-26.07.24	9 110 000.00	9 866 219.55	0.18
USD BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 3.20000% 20-15.06.26	3 465 000.00	3 874 338.09	0.07
USD BRITISH AIRW CL AA PASS THR TRUST-144A 3.80000% 18-20.09.31	1 500 000.00	1 344 021.87	0.02
USD BRITISH TELECOMMUNICATIONS PLC-144A 3.25000% 19-08.11.29	5 730 000.00	6 289 533.46	0.11
USD BRIXMOR OPERATING PARTNERSHIP LP 3.25000% 16-15.09.23	2 800 000.00	2 960 150.37	0.05
USD BRIXMOR OPERATING PARTNERSHIP LP 4.05000% 20-01.07.30	3 810 000.00	4 312 096.35	0.08
USD BROADCOM CORP/CAYMAN FIN LTD 3.87500% 18-15.01.27	4 202 000.00	4 693 823.85	0.08
USD BROADCOM CORP/CAYMAN FIN LTD 3.50000% 18-15.01.28	618 000.00	674 489.92	0.01
USD BROADCOM INC 4.15000% 20-15.11.30	4 550 000.00	5 153 739.50	0.09
USD BROADCOM INC 5.00000% 20-15.04.30	5 504 000.00	6 552 069.74	0.12
USD BUCKEYE PARTNERS LP 4.12500% 17-01.12.27	2 055 000.00	2 102 367.75	0.04
USD BUNGE LTD FINANCE CORP 3.00000% 17-25.09.22	1 300 000.00	1 347 791.66	0.02
USD BURLINGTON NORTHERN SANTA FE LLC 3.65000% 15-01.09.25	2 300 000.00	2 591 785.33	0.05
USD CAMDEN PROPERTY TRUST 3.50000% 14-15.09.24	1 250 000.00	1 360 553.44	0.02
USD CAMDEN PROPERTY TRUST 2.80000% 20-15.05.30	2 150 000.00	2 336 961.08	0.04
USD CAMPBELL SOUP CO 2.37500% 20-24.04.30	1 575 000.00	1 635 386.69	0.03
USD CAMPBELL SOUP CO 3.95000% 18-15.03.25	1 500 000.00	1 684 755.66	0.03
USD CANADIAN IMPERIAL BK OF COM 3.10000% 19-02.04.24	5 500 000.00	5 937 178.83	0.11
USD CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO 2.75000% 16-01.03.26	1 675 000.00	1 825 525.60	0.03
USD CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD 3.80000% 14-15.04.24	1 000 000.00	1 081 288.55	0.02
USD CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD 2.95000% 17-15.01.23	2 430 000.00	2 533 003.06	0.05
USD CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD 3.85000% 17-01.06.27	310 000.00	348 885.46	0.01
USD CANADIAN PACIFIC RAILWAY CO 4.50000% 11-15.01.22	1 800 000.00	1 868 682.28	0.03
USD CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 3.7500 14-24.04.24	2 200 000.00	2 408 236.67	0.04
USD CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 3.75000% 17-09.03.27	2 920 000.00	3 328 751.76	0.06
USD CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 3.30000% 17-30.10.24	600 000.00	654 440.40	0.01
USD CARDINAL HEALTH INC 3.20000% 13-15.03.23	2 400 000.00	2 530 659.88	0.05
USD CBS CORP 2.90000% 16-15.01.27	1 000 000.00	1 089 583.40	0.02
USD CBS CORP 3.70000% 14-15.08.24	3 000 000.00	3 282 657.00	0.06
USD CCO LLC/CAPITAL 2.30000% 20-01.02.32	2 400 000.00	2 336 094.58	0.04
USD CCO LLC/CAPITAL 4.20000% 17-15.03.28	2 004 000.00	2 276 153.02	0.04
USD CCO LLC/CAPITAL 4.46400% 16-23.07.22	2 890 000.00	3 036 212.21	0.05
USD CCO LLC/CAPITAL 4.90800% 16-23.07.25	3 621 000.00	4 174 327.72	0.07
USD CCO LLC/CAPITAL 6.38400% 16-23.10.35	3 000 000.00	4 037 725.98	0.07
USD CENOVUS ENERGY INC 4.25000% 17-15.04.27	1 500 000.00	1 650 082.27	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

2021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 CENTENE CORP 3.0000% 20-15.10.30	4 712 000.00	4 928 516.40	0.09
USD CENTERPOINT ENERGY INC 4.2500% 18-01.11.28	1 066 000.00	1 254 335.25	0.02
USD CENTURYLINK INC-REG-S 4.0000% 20-15.02.27	345 000.00	356 737.52	0.01
USD CERRO DEL AGUILA SA-144A 4.1250% 17-16.08.27	1 018 000.00	1 102 621.25	0.02
USD CHEVRON USA INC 3.2500% 21-15.10.29	435 000.00	490 608.80	0.01
USD CHUBB INA HOLDINGS INC 2.8750% 15-03.11.22	4 815 000.00	5 007 051.14	0.09
USD CHURCH & DWIGHT CO INC 3.1500% 17-01.08.27	2 610 000.00	2 898 003.03	0.05
USD CIGNA CORP 2.4000% 20-15.03.30	4 845 000.00	5 051 043.41	0.09
USD CIGNA CORP 3.7500% 19-15.07.23	2 526 000.00	2 724 999.54	0.05
USD CIGNA CORP 4.1250% 19-15.11.25	7 527 000.00	8 633 343.74	0.15
USD CIGNA CORP 4.3750% 19-15.10.28	5 247 000.00	6 238 061.13	0.11
USD CIT GROUP INC 4.1250% 18-09.03.21	979 000.00	979 489.50	0.02
USD CIT GROUP INC 5.2500% 18-07.03.25	674 000.00	772 815.14	0.01
USD CIT GROUP INC-SUB 6.1250% 18-09.03.28	500 000.00	621 250.00	0.01
USD CITIGROUP INC 3.2000% 16-21.10.26	3 160 000.00	3 484 588.85	0.06
USD CITIGROUP INC 3.4000% 16-01.05.26	1 800 000.00	2 002 375.69	0.04
USD CITIGROUP INC 3.7000% 16-12.01.26	2 481 000.00	2 784 980.71	0.05
USD CITIGROUP INC-SUB 3.8750% 15-26.03.25	3 288 000.00	3 643 333.83	0.07
USD CITIGROUP INC-SUB 4.4000% 15-10.06.25	8 772 000.00	9 950 290.31	0.18
USD CITIGROUP INC-SUB 4.4500% 15-29.09.27	21 008 000.00	24 540 976.49	0.44
USD CITIZENS BANK NA/PROVIDENCE RI 2.2500% 20-28.04.25	3 200 000.00	3 384 882.94	0.06
USD CK HUTCHISON INTNL 17 II LTD-REG-S 2.7500% 17-29.03.23	1 950 000.00	2 035 312.50	0.04
USD CMS ENERGY CORP 2.9500% 16-15.02.27	1 650 000.00	1 794 670.30	0.03
USD CMS ENERGY CORP 3.0000% 16-15.05.26	1 700 000.00	1 865 526.54	0.03
USD CNA FINANCIAL CORP 3.9500% 14-15.05.24	3 560 000.00	3 920 895.39	0.07
USD CNA FINANCIAL CORP 3.4500% 17-15.08.27	1 500 000.00	1 698 645.08	0.03
USD CNH INDUSTRIAL CAPITAL LLC 3.8750% 16-15.10.21	8 655 000.00	8 855 115.63	0.16
USD CNH INDUSTRIAL CAPITAL LLC 4.3750% 17-05.04.22	822 000.00	856 805.17	0.02
USD CNH INDUSTRIAL CAPITAL LLC 1.9500% 20-02.07.23	3 230 000.00	3 325 865.81	0.06
USD COCA-COLA CO/THE 1.4500% 20-01.06.27	1 465 000.00	1 499 929.73	0.03
USD COCA-COLA FEMSA SA 2.7500% 20-22.01.30	2 125 000.00	2 265 250.00	0.04
USD COLORADO INTERSTATE GAS/ ISSUING-REG-S 4.1500% 16-15.08.26	5 030 000.00	5 653 419.41	0.10
USD COMCAST CORP 1.9500% 20-15.01.31	750 000.00	758 999.41	0.01
USD COMCAST CORP 2.6500% 19-01.02.30	6 945 000.00	7 468 592.30	0.13
USD COMCAST CORP 3.3000% 20-01.04.27	1 750 000.00	1 970 953.88	0.04
USD COMCAST CORP 3.5500% 18-01.05.28	2 926 000.00	3 337 776.18	0.06
USD COMCAST CORP 3.6000% 14-01.03.24	1 500 000.00	1 645 856.30	0.03
USD COMCAST CORP 3.7000% 18-15.04.24	2 385 000.00	2 622 192.66	0.05
USD COMCAST CORP 3.9500% 18-15.10.25	8 321 000.00	9 486 340.73	0.17
USD COMCAST CORP 4.1500% 18-15.10.28	2 800 000.00	3 320 128.14	0.06
USD COMCAST CORP 4.2500% 18-15.10.30	3 775 000.00	4 554 877.48	0.08
USD COMCAST CORP 4.4000% 15-15.08.35	2 930 000.00	3 630 674.43	0.07
USD CONAGRA BRANDS INC 4.3000% 18-01.05.24	2 110 000.00	2 348 979.53	0.04
USD CONAGRA BRANDS INC 4.8500% 18-01.11.28	2 720 000.00	3 328 541.77	0.06
USD CONAGRA INC 4.6000% 18-01.11.25	6 395 000.00	7 438 260.28	0.13
USD CONCHO RESOURCES INC 3.7500% 17-01.10.27	480 000.00	547 116.19	0.01
USD CONCHO RESOURCES INC 4.3000% 18-15.08.28	6 085 000.00	7 107 140.36	0.13
USD CONSTELLATION BRANDS INC 4.2500% 13-01.05.23	1 250 000.00	1 352 296.14	0.02
USD CONSTELLATION BRANDS INC 2.8750% 20-01.05.30	1 890 000.00	2 034 133.41	0.04
USD CONTINENTAL RESOURCES INC 3.8000% 14-01.06.24	2 095 000.00	2 147 375.00	0.04
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-144A 3.0000% 19-30.09.29	2 941 000.00	3 176 280.00	0.06
USD CORPORATE OFFICE PROPERTIES LP 2.2500% 20-15.03.26	3 330 000.00	3 458 872.40	0.06
USD CRANE CO 4.4500% 13-15.12.23	1 760 000.00	1 927 411.35	0.03
USD CREDIT SUISSE AG/NEW YORK NY 2.1000% 19-12.11.21	2 400 000.00	2 435 436.05	0.04
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-144A 4.2820% 17-09.01.28	530 000.00	610 088.41	0.01
USD CREDIT SUISSE GROUP AG 3.7500% 16-26.03.25	3 975 000.00	4 399 353.66	0.08
USD CREDIT SUISSE-REG-S-SUB 6.5000% 13-08.08.23	2 400 000.00	2 703 964.80	0.05
USD CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 3.7000% 16-15.05.26	2 250 000.00	2 524 519.85	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 - US マルチ・クレジット

2021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 CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 3.15000% 18-15.07.23	2 317 000.00	2 460 912.13	0.04
USD CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 3.30000% 20-01.07.30	2 030 000.00	2 226 538.98	0.04
USD CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 1.35000% 20-15.07.25	6 570 000.00	6 681 750.65	0.12
USD CSX CORP 2.60000% 16-01.11.26	2 000 000.00	2 177 313.06	0.04
USD CSX CORP 3.25000% 17-01.06.27	3 145 000.00	3 523 585.51	0.06
USD CUBESMART LP 4.37500% 19-15.02.29	1 315 000.00	1 535 310.73	0.03
USD CVS HEALTH CORP 1.30000% 20-21.08.27	14 850 000.00	14 887 189.45	0.27
USD CVS HEALTH CORP 2.62500% 19-15.08.24	1 700 000.00	1 815 961.21	0.03
USD CVS HEALTH CORP 2.87500% 16-01.06.26	1 420 000.00	1 547 266.22	0.03
USD CVS HEALTH CORP 3.70000% 18-09.03.23	1 912 000.00	2 039 176.03	0.04
USD CVS HEALTH CORP 3.87500% 15-20.07.25	4 569 000.00	5 135 935.91	0.09
USD CVS HEALTH CORP 4.30000% 18-25.03.28	6 572 000.00	7 720 325.56	0.14
USD CVS HEALTH CORP 4.78000% 18-25.03.38	490 000.00	606 141.46	0.01
USD CVS HEALTH CORP 5.00000% 16-01.12.24	1 830 000.00	2 102 487.62	0.04
USD CVS HEALTH CORP 5.05000% 18-25.03.48	2 830 000.00	3 705 140.14	0.07
USD DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA-REG-S 1.75000% 20-10.03.23	3 860 000.00	3 962 247.69	0.07
USD DANSKE BANK AS-144A 3.87500% 18-12.09.23	1 780 000.00	1 916 114.39	0.03
USD DANSKE BANK AS-144A 5.37500% 19-12.01.24	2 355 000.00	2 651 759.60	0.05
USD DDR CORP 3.62500% 15-01.02.25	1 550 000.00	1 628 177.56	0.03
USD DDR CORP 4.70000% 17-01.06.27	4 333 000.00	4 837 162.14	0.09
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP-REG-S 5.85000% 20-15.07.25	775 000.00	920 482.50	0.02
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP-REG-S 5.45000% 16-15.06.23	11 325 000.00	12 440 690.08	0.22
USD DELTA AIR LINES INC 7.37500% 20-15.01.26	1 580 000.00	1 815 146.33	0.03
USD DENTSPLY INTERNATIONAL INC 3.25000% 20-01.06.30	2 750 000.00	3 022 433.48	0.05
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 3.95000% 18-27.02.23	435 000.00	461 869.17	0.01
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 4.25000% 18-04.02.21	2 115 000.00	2 115 423.36	0.04
USD DH EUROPE FINANCE II SARL 2.20000% 19-15.11.24	5 265 000.00	5 579 930.34	0.10
USD DH EUROPE FINANCE II SARL 2.60000% 19-15.11.29	5 650 000.00	6 059 680.43	0.11
USD DIAGEO CAPITAL PLC 2.12500% 20-29.04.32	2 000 000.00	2 057 419.92	0.04
USD DIAMONDBACK ENERGY INC 3.25000% 19-01.12.26	6 690 000.00	7 163 509.16	0.13
USD DIGITAL REALTY TRUST LP 2.75000% 17-01.02.23	1 500 000.00	1 571 121.29	0.03
USD DISCOVER BANK 4.20000% 13-08.08.23	750 000.00	818 172.66	0.01
USD DISCOVER BANK 4.65000% 18-13.09.28	3 250 000.00	3 855 308.44	0.07
USD DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC 2.95000% 17-20.03.23	709 000.00	744 633.03	0.01
USD DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC 4.12500% 19-15.05.29	1 665 000.00	1 928 526.15	0.03
USD DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC 3.62500% 20-15.05.30	3 350 000.00	3 775 154.10	0.07
USD DOLLAR GENERAL CORP 3.25000% 13-15.04.23	1 600 000.00	1 688 674.05	0.03
USD DOLLAR GENERAL CORP 3.50000% 20-03.04.30	2 300 000.00	2 610 822.16	0.05
USD DOLLAR TREE INC 3.70000% 18-15.05.23	12 343 000.00	13 195 107.52	0.24
USD DOLLAR TREE INC 4.00000% 18-15.05.25	2 590 000.00	2 917 149.50	0.05
USD DOLLAR TREE INC 4.20000% 18-15.05.28	3 000 000.00	3 521 658.90	0.06
USD DOMINION ENERGY INC 2.85000% 16-15.08.26	5 550 000.00	6 072 975.67	0.11
USD DOMINION ENERGY INC-SUB 2.00000% 19-15.08.24	2 700 000.00	2 934 371.85	0.05
USD DOMINION GAS HOLDINGS LLC 2.50000% 19-15.11.24	4 800 000.00	5 114 960.68	0.09
USD DOMINION GAS HOLDINGS LLC 3.00000% 19-15.11.29	3 000 000.00	3 261 185.37	0.06
USD DOW CHEMICAL CO 3.62500% 19-15.05.26	670 000.00	755 700.27	0.01
USD DOW CHEMICAL CO 4.55000% 19-30.11.25	1 385 000.00	1 610 494.76	0.03
USD DR HORTON INC 2.50000% 19-15.10.24	3 660 000.00	3 891 304.28	0.07
USD DTE ENERGY CO 2.85000% 16-01.10.26	1 900 000.00	2 083 181.41	0.04
USD DTE ENERGY CO 2.95000% 19-01.03.30	580 000.00	624 258.52	0.01
USD DTE ENERGY CO 3.40000% 19-15.06.29	1 105 000.00	1 240 003.82	0.02
USD DUKE ENERGY CORP 2.45000% 20-01.06.30	2 975 000.00	3 099 198.90	0.06
USD DUKE ENERGY CORP 2.65000% 16-01.09.26	1 000 000.00	1 080 803.52	0.02
USD DUKE ENERGY CORP 3.15000% 17-15.08.27	1 415 000.00	1 573 432.06	0.03
USD DUKE ENERGY CORP 3.40000% 19-15.06.29	2 680 000.00	3 007 869.46	0.05
USD DUKE REALTY LP 1.75000% 21-01.02.31	3 450 000.00	3 436 277.62	0.06
USD DUPONT DE NEMOURS INC 4.20500% 18-15.11.23	5 000 000.00	5 499 381.45	0.10
USD DUPONT DE NEMOURS INC 4.49300% 18-15.11.25	3 328 000.00	3 865 542.49	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

2021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 EBAY INC 2.70000% 20-11.03.30	1 220 000.00	1 293 552.70	0.02
USD EBAY INC 3.60000% 17-05.06.27	4 755 000.00	5 390 340.09	0.10
USD ECOLAB INC 4.80000% 20-24.03.30	2 625 000.00	3 299 577.33	0.06
USD EDISON INTERNATIONAL 2.40000% 17-15.09.22	1 325 000.00	1 356 997.74	0.02
USD EDISON INTERNATIONAL 4.12500% 18-15.03.28	944 000.00	1 039 108.85	0.02
USD EDISON INTERNATIONAL 4.95000% 20-15.04.25	1 700 000.00	1 932 204.22	0.03
USD EL PASO ELECTRIC CO 3.30000% 12-15.12.22	2 595 000.00	2 651 041.72	0.05
USD ELANCO ANIMAL HEALTH INC 4.90000% 19-28.08.28	1 700 000.00	2 030 650.00	0.04
USD EMERA US FINANCE LP 2.70000% 17-15.06.21	1 440 000.00	1 449 921.40	0.03
USD EMPRESA DE TRANSPORTE DE PASA MET-144A 3.65000% 20-07.05.30	200 000.00	223 437.50	0.00
USD EMPRESA NACIONAL DE ELECTRICIDAD SA/CHI 4.25000% 14-15.04.24	348 000.00	375 731.25	0.01
USD EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO-REG-S 3.75000% 16-05.08.26	213 000.00	231 770.62	0.00
USD EMPRESAS PUBLICAS DE MEDELLIN ESP-144A 4.25000% 19-18.07.29	811 000.00	858 139.38	0.02
USD ENABLE MIDSTREAM PARTNERS LP 4.40000% 17-15.03.27	2 168 000.00	2 262 692.24	0.04
USD ENABLE MIDSTREAM PARTNERS LP 4.95000% 18-15.05.28	290 000.00	305 850.23	0.01
USD ENBRIDGE ENERGY PARTNERS LP 5.87500% 15-15.10.25	1 650 000.00	1 994 219.88	0.04
USD ENBRIDGE INC 3.12500% 19-15.11.29	3 025 000.00	3 270 462.03	0.06
USD ENEL CHILE SA 4.87500% 18-12.06.28	676 000.00	791 976.25	0.01
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 3.62500% 17-25.05.27	1 850 000.00	2 084 837.24	0.04
USD ENERGY TRANSFER LP/REGENCY FIN CORP 5.00000% 14-01.10.22	5 045 000.00	5 334 370.91	0.10
USD ENERGY TRANSFER OPERATING LP 5.25000% 19-15.04.29	700 000.00	807 570.89	0.01
USD ENERGY TRANSFER OPERATING LP 2.90000% 20-15.05.25	3 400 000.00	3 586 156.87	0.06
USD ENERGY TRANSFER OPERATING LP 3.75000% 20-15.05.30	6 515 000.00	6 842 958.58	0.12
USD ENERGY TRANSFER PARTNERS LP 4.75000% 15-15.01.26	2 485 000.00	2 801 331.31	0.05
USD ENERGY TRANSFER PARTNERS LP 4.95000% 18-15.06.28	1 500 000.00	1 712 154.05	0.03
USD ENERSIS AMERICAS SA 4.00000% 16-25.10.26	686 000.00	764 032.50	0.01
USD ENI SPA-144A 4.00000% 18-12.09.23	1 485 000.00	1 611 693.01	0.03
USD ENTERGY CORP 0.90000% 20-15.09.25	4 310 000.00	4 301 880.35	0.08
USD ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC 2.85000% 16-15.04.21	1 500 000.00	1 504 594.43	0.03
USD ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC 3.12500% 19-31.07.29	2 000 000.00	2 189 681.52	0.04
USD ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LP 2.80000% 20-31.01.30	3 550 000.00	3 803 444.90	0.07
USD EOG RESOURCES INC 4.15000% 16-15.01.26	800 000.00	919 926.76	0.02
USD EOG RESOURCES INC 4.37500% 20-15.04.30	894 000.00	1 062 991.20	0.02
USD EPR PROPERTIES 5.25000% 13-15.07.23	692 000.00	720 182.26	0.01
USD EQT CORP 3.00000% 17-01.10.22	1 290 000.00	1 310 130.45	0.02
USD EQT CORP 3.90000% 17-01.10.27	2 162 000.00	2 245 777.50	0.04
USD EQT CORP 5.00000% 20-15.01.29	25 000.00	27 187.50	0.00
USD EQT MIDSTREAM PARTNERS LP 4.75000% 18-15.07.23	906 000.00	937 710.00	0.02
USD EQUIFAX INC 2.60000% 19-01.12.24	5 395 000.00	5 754 282.83	0.10
USD EQUIFAX INC 3.10000% 20-15.05.30	2 000 000.00	2 186 907.06	0.04
USD EQUINIX INC 1.00000% 20-15.09.25	6 425 000.00	6 428 959.98	0.12
USD EQUINIX INC 2.62500% 19-18.11.24	2 815 000.00	2 997 923.06	0.05
USD EQUINIX INC 5.37500% 17-15.05.27	2 975 000.00	3 229 386.89	0.06
USD ERAC USA FINANCE LLC-REG-S 2.70000% 16-01.11.23	3 500 000.00	3 689 196.39	0.07
USD ERP OPERATING LP 3.25000% 17-01.08.27	1 460 000.00	1 633 102.08	0.03
USD ESSENTIAL UTILITIES INC 2.70400% 20-15.04.30	1 710 000.00	1 830 314.78	0.03
USD ESTEE LAUDER COS INC 2.00000% 19-01.12.24	930 000.00	980 164.07	0.02
USD EVERGY INC 4.85000% 11-01.06.21	2 000 000.00	2 007 199.12	0.04
USD EVERGY INC- 2.90000% 19-15.09.29	3 355 000.00	3 623 194.27	0.06
USD EVERSOURCE ENERGY 2.90000% 17-01.10.24	4 410 000.00	4 766 381.80	0.09
USD EXELON CORP 3.40000% 16-15.04.26	2 790 000.00	3 118 411.43	0.06
USD EXELON CORP 3.95000% 16-15.06.25	6 807 000.00	7 653 278.99	0.14
USD EXELON CORP-SUB STEP-UP 17-01.06.22	1 280 000.00	1 328 373.07	0.02
USD EXELON GENERATION CO LLC 3.25000% 20-01.06.25	2 590 000.00	2 814 613.86	0.05
USD EXXON MOBIL CORP 2.61000% 20-15.10.30	2 084 000.00	2 223 877.85	0.04
USD FEDEX CORP 3.25000% 16-01.04.26	2 000 000.00	2 211 287.06	0.04
USD FEDEX CORP 3.80000% 20-15.05.25	2 900 000.00	3 254 220.59	0.06
USD FIDELITY NATIONAL INFO SERVICES 3.87500% 14-05.06.24	183 000.00	201 022.52	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

2021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 FIDELITY NATIONAL INFO SERVICES 3.75000% 19-21.05.29	760 000.00	874 979.10	0.02
USD FIRSTENERGY CORP 1.60000% 20-15.01.26	3 680 000.00	3 580 079.17	0.06
USD FIRSTENERGY CORP 2.25000% 20-01.09.30	1 830 000.00	1 742 017.79	0.03
USD FISERV INC 2.25000% 20-01.06.27	2 250 000.00	2 378 493.14	0.04
USD FISERV INC 3.50000% 19-01.07.29	6 195 000.00	6 982 093.77	0.13
USD FMC CORP 3.45000% 19-01.10.29	1 300 000.00	1 453 224.28	0.03
USD FNB CORP/PA 2.20000% 20-24.02.23	1 530 000.00	1 557 662.52	0.03
USD FORD MOTOR CO 5.29100% 16-08.12.46	465 000.00	489 844.95	0.01
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.08700% 20-09.01.23	3 125 000.00	3 159 531.25	0.06
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 5.75000% 11-01.02.21	2 035 000.00	2 035 000.00	0.04
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.25000% 12-20.09.22	3 735 000.00	3 856 424.85	0.07
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.37500% 13-06.08.23	5 700 000.00	5 936 322.00	0.11
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.09600% 16-04.05.23	6 200 000.00	6 265 875.00	0.11
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.81000% 17-09.01.24	2 605 000.00	2 692 918.75	0.05
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.33900% 17-28.03.22	3 495 000.00	3 540 539.85	0.06
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.97900% 17-03.08.22	3 850 000.00	3 893 312.50	0.07
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.81300% 18-12.10.21	1 400 000.00	1 418 592.00	0.03
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.35000% 19-01.11.22	1 500 000.00	1 523 925.00	0.03
USD FORTIS INC 3.05500% 17-04.10.26	3 880 000.00	4 252 106.89	0.08
USD FRESENIUS MED CARE US FIN II INC-144A 5.87500% 12-31.01.22	2 150 000.00	2 261 640.67	0.04
USD FRESENIUS MEDICAL CARE US FINANCE-144A 5.75000% 11-15.02.21	750 000.00	751 358.09	0.01
USD FRESENIUS US FINANCE II INC-144A 4.25000% 14-01.02.21	1 600 000.00	1 600 000.00	0.03
USD FS KKR CAPITAL CORP 4.75000% 15-15.05.22	6 000 000.00	6 226 001.94	0.11
USD GATX CORP 4.35000% 18-15.02.24	5 425 000.00	5 972 365.68	0.11
USD GE CAPITAL INTL FUNDING CO 3.37300% 16-15.11.25	2 392 000.00	2 643 562.52	0.05
USD GE CAPITAL INTL FUNDING CO 4.41800% 16-15.11.35	2 780 000.00	3 254 481.64	0.06
USD GENERAL DYNAMICS CORP 3.37500% 18-15.05.23	1 093 000.00	1 169 380.84	0.02
USD GENERAL DYNAMICS CORP 3.00000% 18-11.05.21	1 675 000.00	1 687 472.85	0.03
USD GENERAL ELECTRIC CO 3.37500% 14-11.03.24	3 500 000.00	3 796 421.97	0.07
USD GENERAL ELECTRIC CO 3.45000% 20-01.05.27	345 000.00	386 599.07	0.01
USD GENERAL MOTORS CO 4.20000% 17-01.10.27	2 200 000.00	2 506 757.13	0.04
USD GENERAL MOTORS CO 6.80000% 20-01.10.27	2 863 000.00	3 680 022.67	0.07
USD GENERAL MOTORS CO 6.12500% 20-01.10.25	1 485 000.00	1 788 775.10	0.03
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 4.37500% 14-25.09.21	995 000.00	1 020 255.26	0.02
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 4.00000% 15-15.01.25	1 870 000.00	2 056 952.58	0.04
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 4.20000% 16-01.03.21	7 425 000.00	7 425 000.00	0.13
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 3.20000% 16-06.07.21	1 490 000.00	1 503 499.40	0.03
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 3.15000% 17-30.06.22	1 155 000.00	1 193 551.18	0.02
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 3.50000% 17-07.11.24	6 175 000.00	6 693 962.01	0.12
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO 3.85000% 18-05.01.28	665 000.00	736 464.57	0.01
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 4.15000% 18-19.06.23	7 707 000.00	8 283 444.05	0.15
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 5.10000% 19-17.01.24	2 130 000.00	2 379 659.41	0.04
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 2.90000% 20-26.02.25	818 000.00	871 495.78	0.02
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 2.75000% 20-20.06.25	3 410 000.00	3 624 010.71	0.06
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO LTD 3.60000% 20-21.06.30	2 365 000.00	2 610 456.47	0.05
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 1.70000% 20-18.08.23	5 020 000.00	5 134 546.36	0.09
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 2.70000% 20-20.08.27	8 200 000.00	8 667 760.96	0.16
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 1.25000% 21-08.01.26	2 775 000.00	2 766 962.63	0.05
USD GENPACT LUXEMBOURG SARL 3.37500% 19-01.12.24	1 905 000.00	2 080 079.19	0.04
USD GILEAD SCIENCES INC 3.65000% 15-01.03.26	4 314 000.00	4 862 916.90	0.09
USD GILEAD SCIENCES INC 2.95000% 16-01.03.27	1 245 000.00	1 371 925.36	0.02
USD GILEAD SCIENCES INC 1.20000% 20-01.10.27	4 880 000.00	4 877 685.32	0.09
USD GILEAD SCIENCES INC 1.65000% 20-01.10.30	8 200 000.00	8 115 869.23	0.15
USD GLAXOSMITHKLINE CAPITAL INC 3.37500% 18-15.05.23	2 675 000.00	2 859 136.70	0.05
USD GLENCORE FUNDING LLC-144A 1.62500% 20-01.09.25	8 960 000.00	9 173 149.26	0.16
USD GLOBAL PAYMENTS INC 3.20000% 19-15.08.29	2 130 000.00	2 328 955.71	0.04
USD GLOBAL PAYMENTS INC 3.80000% 16-01.04.21	2 515 000.00	2 521 975.71	0.05
USD GLOBAL PAYMENTS INC 4.00000% 18-01.06.23	2 085 000.00	2 244 737.98	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

2021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	GLP CAPITAL LP / GLP FINANC II INC 5.25000% 18-01.06.25	1 585 000.00	1 796 343.90	0.03
USD	GLP CAPITAL LP / GLP FINANC II INC 5.75000% 18-01.06.28	2 555 000.00	3 037 422.32	0.05
USD	GOLDMAN SACHS GROUP INC-SUB 4.25000% 15-21.10.25	9 200 000.00	10 453 414.16	0.19
USD	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 3.20000% 18-23.02.23	9 875 000.00	10 406 609.57	0.19
USD	GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.62500% 19-20.02.24	5 200 000.00	5 650 457.59	0.10
USD	GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.60000% 20-07.02.30	11 200 000.00	11 840 588.59	0.21
USD	GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.80000% 20-15.03.30	7 535 000.00	8 691 165.65	0.16
USD	GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.50000% 20-01.04.25	4 489 000.00	4 955 259.31	0.09
USD	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 3.50000% 16-16.11.26	1 725 000.00	1 919 561.42	0.03
USD	GRAPHIC PACKAGING INTERNATIONAL INC 4.12500% 16-15.08.24	416 000.00	440 960.00	0.01
USD	GULF POWER CO 3.30000% 17-30.05.27	2 105 000.00	2 367 290.98	0.04
USD	HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP 2.80000% 19-19.08.29	3 000 000.00	3 222 168.39	0.06
USD	HCA INC 3.50000% 20-01.09.30	1 295 000.00	1 345 000.24	0.02
USD	HCA INC 4.12500% 19-15.06.29	2 745 000.00	3 146 502.80	0.06
USD	HCA INC 4.75000% 12-01.05.23	2 500 000.00	2 722 320.05	0.05
USD	HCA INC 5.25000% 14-15.04.25	1 700 000.00	1 982 729.84	0.04
USD	HCA INC 5.25000% 16-15.06.26	1 200 000.00	1 417 956.82	0.03
USD	HCA INC 5.37500% 18-01.09.26	1 469 000.00	1 673 433.38	0.03
USD	HCA INC 5.87500% 19-01.02.29	2 100 000.00	2 501 299.50	0.04
USD	HCP INC 3.40000% 15-01.02.25	3 430 000.00	3 764 509.21	0.07
USD	HCP INC 3.87500% 14-15.08.24	2 690 000.00	2 974 616.66	0.05
USD	HEALTHCARE REALTY TRUST 3.87500% 15-01.05.25	2 500 000.00	2 768 591.15	0.05
USD	HEALTHCARE REALTY TRUST 3.62500% 17-15.01.28	1 836 000.00	2 053 172.78	0.04
USD	HEALTHCARE TRUST OF AMERICA HOLDINGS LP 3.75000% 17-01.07.27	2 070 000.00	2 378 366.35	0.04
USD	HEALTHCARE TRUST OF AMERICA HOLDINGS LP 2.00000% 20-15.03.31	1 275 000.00	1 268 324.37	0.02
USD	HEALTHPEAK PROPERTIES INC 3.00000% 19-15.01.30	1 865 000.00	2 028 570.32	0.04
USD	HEALTHPEAK PROPERTIES INC 2.87500% 20-15.01.31	910 000.00	978 575.80	0.02
USD	HESS CORP 4.30000% 16-01.04.27	150 000.00	166 321.76	0.00
USD	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO STEP-UP/DOWN 16-15.10.22	4 440 000.00	4 702 304.14	0.08
USD	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO STEP-UP/DOWN 16-15.10.25	490 000.00	570 357.25	0.01
USD	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO 4.45000% 20-02.10.23	3 105 000.00	3 407 178.39	0.06
USD	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO 1.45000% 20-01.04.24	5 720 000.00	5 857 138.65	0.10
USD	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO 1.75000% 20-01.04.26	1 985 000.00	2 042 487.03	0.04
USD	HEWLETT-PACKARD CO 3.00000% 20-17.06.27	3 135 000.00	3 437 131.83	0.06
USD	HIGHWOODS REALTY LP 3.20000% 14-15.06.21	652 000.00	655 458.33	0.01
USD	HIGHWOODS REALTY LP 3.87500% 17-01.03.27	5 035 000.00	5 590 227.72	0.10
USD	HILLENBRAND INC 4.50000% 19-15.09.26	1 370 000.00	1 554 950.00	0.03
USD	HOME DEPOT INC 2.70000% 20-15.04.30	6 905 000.00	7 537 949.38	0.14
USD	HOME DEPOT INC/THE 0.90000% 21-15.03.28	2 750 000.00	2 734 959.21	0.05
USD	HOST HOTELS & RESORTS LP 3.87500% 17-01.04.24	4 121 000.00	4 363 292.59	0.08
USD	HOST HOTELS & RESORTS LP 3.50000% 20-15.09.30	6 020 000.00	6 223 983.19	0.11
USD	HSBC HOLDINGS PLC 4.95000% 20-31.03.30	655 000.00	806 427.78	0.01
USD	HSBC HOLDINGS PLC-SUB 4.25000% 14-14.03.24	4 434 000.00	4 878 548.58	0.09
USD	HUDSON PACIFIC PROPERTIES LP 3.95000% 17-01.11.27	1 805 000.00	1 987 539.32	0.04
USD	HUDSON PACIFIC PROPERTIES LP 4.65000% 19-01.04.29	850 000.00	983 232.59	0.02
USD	HUMANA INC 2.90000% 17-15.12.22	2 310 000.00	2 411 731.17	0.04
USD	HUMANA INC 3.12500% 19-15.08.29	1 750 000.00	1 918 247.26	0.03
USD	HUNTINGTON BANCSHARES INC/OH 4.00000% 18-15.05.25	4 400 000.00	4 972 638.97	0.09
USD	HUNTINGTON BANCSHARES INC/OH 2.62500% 19-06.08.24	2 500 000.00	2 665 889.42	0.05
USD	HUSKY ENERGY INC 3.95000% 12-15.04.22	3 215 000.00	3 303 604.63	0.06
USD	IHS MARKIT LTD 3.62500% 19-01.05.24	703 000.00	764 725.44	0.01
USD	IHS MARKIT LTD 4.12500% 18-01.08.23	4 158 000.00	4 507 812.54	0.08
USD	IMPERIAL BRANDS FINANCE PLC-144A 3.50000% 19-26.07.26	926 000.00	1 016 132.58	0.02
USD	IMPERIAL BRANDS FINANCE PLC-144A 4.25000% 15-21.07.25	2 045 000.00	2 289 281.59	0.04
USD	INDIANA MICHIGAN POWER CO 3.20000% 13-15.03.23	862 000.00	905 340.56	0.02
USD	ING GROEP NV 3.55000% 19-09.04.24	1 950 000.00	2 129 241.09	0.04
USD	ING GROEP NV 3.95000% 17-29.03.27	1 710 000.00	1 959 103.00	0.04
USD	ING GROEP NV 4.10000% 18-02.10.23	2 575 000.00	2 818 812.27	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 - US マルチ・クレジット

2021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 INGERSOLL-RAND LUXEMBOURG FINANCE SA 3.50000% 19-21.03.26	2 725 000.00	3 050 883.24	0.05
USD INTEL CORP 2.45000% 19-15.11.29	3 150 000.00	3 371 881.72	0.06
USD INTEL CORP 2.87500% 17-11.05.24	1 600 000.00	1 718 914.78	0.03
USD INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC 2.10000% 20-15.06.30	1 885 000.00	1 918 270.25	0.03
USD INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC 0.70000% 20-15.06.23	2 620 000.00	2 639 270.36	0.05
USD INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC 1.85000% 20-15.09.32	1 250 000.00	1 227 064.88	0.02
USD INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 3.00000% 19-15.05.24	1 660 000.00	1 792 487.17	0.03
USD INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 3.30000% 19-15.05.26	1 650 000.00	1 848 366.78	0.03
USD INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC 4.45000% 18-26.09.28	2 955 000.00	3 479 192.92	0.06
USD INTERPUBLIC GROUP OF COS INC 4.65000% 18-01.10.28	562 000.00	671 813.29	0.01
USD INTERPUBLIC GROUP OF COS INC 4.75000% 20-30.03.30	4 403 000.00	5 392 757.50	0.10
USD ITC HOLDINGS CORP 3.65000% 14-15.06.24	1 833 000.00	1 997 624.75	0.04
USD ITC HOLDINGS CORP 3.25000% 16-30.06.26	1 350 000.00	1 495 243.09	0.03
USD ITC HOLDINGS CORP 4.05000% 13-01.07.23	675 000.00	725 830.88	0.01
USD JABIL INC 3.60000% 20-15.01.30	2 615 000.00	2 875 097.89	0.05
USD JD.COM INC 3.37500% 20-14.01.30	5 220 000.00	5 651 380.80	0.10
USD JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC STEP-UP 16-02.07.24	1 182 000.00	1 289 209.75	0.02
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.30000% 16-01.04.26	4 150 000.00	4 616 777.43	0.08
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.20000% 16-15.06.26	7 930 000.00	8 801 410.18	0.16
USD JPMORGAN CHASE & CO 2.95000% 16-01.10.26	1 800 000.00	1 984 854.82	0.04
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 3.87500% 14-10.09.24	18 223 000.00	20 280 980.97	0.36
USD JUNIPER NETWORKS INC 2.00000% 20-10.12.30	4 900 000.00	4 757 952.58	0.09
USD KAISER FOUNDATION HOSPITALS 3.15000% 17-01.05.27	3 890 000.00	4 397 571.09	0.08
USD KEURIG DR PEPPER INC 3.20000% 20-01.05.30	1 075 000.00	1 192 747.83	0.02
USD KILROY REALTY LP 3.45000% 17-15.12.24	1 756 000.00	1 908 066.80	0.03
USD KILROY REALTY LP 4.37500% 15-01.10.25	1 500 000.00	1 680 109.36	0.03
USD KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV-144A 2.43100% 20-01.07.31	786 000.00	808 597.50	0.01
USD KIMCO REALTY CORP 3.40000% 15-01.11.22	2 000 000.00	2 093 230.34	0.04
USD KINDER MORGAN ENERGY PARTNERS LP 3.45000% 12-15.02.23	1 840 000.00	1 928 946.11	0.03
USD KINDER MORGAN ENERGY PARTNERS LP 4.25000% 14-01.09.24	3 000 000.00	3 334 575.84	0.06
USD KINDER MORGAN INC 3.15000% 17-15.01.23	3 600 000.00	3 777 458.22	0.07
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 6.87500% 12-26.01.39	555 000.00	762 867.15	0.01
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 3.00000% 16-01.06.26	3 100 000.00	3 278 464.64	0.06
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 3.95000% 16-15.07.25	1 675 000.00	1 830 465.56	0.03
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 5.00000% 16-15.07.35	2 452 000.00	2 904 434.97	0.05
USD LABORATORY CORP AMERICA HOLDINGS 3.60000% 15-01.02.25	529 000.00	583 196.05	0.01
USD LABORATORY CORP AMERICA HOLDINGS 2.95000% 19-01.12.29	1 780 000.00	1 942 463.76	0.03
USD LAS VEGAS SANDS CORP 3.50000% 19-18.08.26	3 780 000.00	4 019 731.53	0.07
USD LAS VEGAS SANDS CORP 3.90000% 19-08.08.29	1 775 000.00	1 863 158.19	0.03
USD LAS VEGAS SANDS CORP 3.20000% 19-08.08.24	4 954 000.00	5 205 923.63	0.09
USD LEAR CORP 3.50000% 20-30.05.30	405 000.00	442 830.05	0.01
USD LEAR CORP 3.80000% 17-15.09.27	5 507 000.00	6 152 538.91	0.11
USD LEGGETT & PLATT INC 4.40000% 19-15.03.29	2 451 000.00	2 850 560.01	0.05
USD LENNAR CORP 4.75000% 18-29.11.27	2 625 000.00	3 102 330.00	0.06
USD LEVEL 3 FINANCING INC 5.37500% 16-15.01.24	150 000.00	150 135.00	0.00
USD LEXINGTON REALTY TRUST 2.70000% 20-15.09.30	2 400 000.00	2 468 367.50	0.04
USD LG&E AND KU ENERGY LLC 4.37500% 12-01.10.21	2 000 000.00	2 032 234.16	0.04
USD LIFE STORAGE LP 3.87500% 17-15.12.27	535 000.00	610 436.36	0.01
USD LIFE STORAGE LP 4.00000% 19-15.06.29	625 000.00	719 353.96	0.01
USD LINCOLN NATIONAL CORP 4.20000% 12-15.03.22	2 700 000.00	2 819 217.80	0.05
USD LINCOLN NATIONAL CORP 3.80000% 18-01.03.28	8 898 000.00	10 234 071.72	0.18
USD LINCOLN NATIONAL CORP 3.05000% 19-15.01.30	1 115 000.00	1 221 099.21	0.02
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC-SUB 4.58200% 16-10.12.25	4 280 000.00	4 880 924.24	0.09
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.37500% 18-22.03.28	400 000.00	468 847.51	0.01
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC-SUB 4.50000% 14-04.11.24	1 520 000.00	1 699 637.26	0.03
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 3.75000% 17-11.01.27	4 800 000.00	5 426 121.99	0.10
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 3.90000% 19-12.03.24	5 955 000.00	6 541 924.80	0.12
USD LOWE ' S COS INC 1.30000% 20-15.04.28	7 550 000.00	7 498 400.36	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 - US マルチ・クレジット

2021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	LOWE ' S COS INC 3.65000% 19-05.04.29	1 260 000.00	1 442 638.66	0.03
USD	LYB INTERNATIONAL FINANCE III LLC 2.87500% 20-01.05.25	3 595 000.00	3 871 067.42	0.07
USD	LYB INTERNATIONAL FINANCE III LLC 4.20000% 20-01.05.50	905 000.00	1 022 697.31	0.02
USD	MARATHON OIL CORP 4.40000% 17-15.07.27	2 275 000.00	2 564 182.00	0.05
USD	MARATHON OIL CORP 6.80000% 02-15.03.32	1 080 000.00	1 366 310.94	0.02
USD	MARATHON PETROLEUM CORP 4.75000% 19-15.12.23	2 430 000.00	2 687 187.99	0.05
USD	MARATHON PETROLEUM CORP 4.50000% 20-01.05.23	2 000 000.00	2 163 828.48	0.04
USD	MARKEL CORP 3.35000% 19-17.09.29	1 420 000.00	1 581 360.77	0.03
USD	MARKEL CORP 3.50000% 17-01.11.27	2 000 000.00	2 234 542.62	0.04
USD	MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD 3.60000% 19-15.04.24	2 455 000.00	2 618 353.71	0.05
USD	MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD 3.12500% 14-15.10.21	1 900 000.00	1 925 283.24	0.03
USD	MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD 3.12500% 16-15.06.26	1 400 000.00	1 478 819.26	0.03
USD	MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD 4.65000% 18-01.12.28	2 040 000.00	2 338 695.39	0.04
USD	MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD 5.75000% 20-01.05.25	2 525 000.00	2 930 902.74	0.05
USD	MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD 3.50000% 20-15.10.32	1 240 000.00	1 316 024.36	0.02
USD	MARS INC-REG-S 2.70000% 19-01.04.25	2 650 000.00	2 857 648.65	0.05
USD	MARSH & MCLENNAN COS INC 3.30000% 16-14.03.23	2 550 000.00	2 693 875.08	0.05
USD	MARSH & MCLENNAN COS INC 3.87500% 19-15.03.24	1 930 000.00	2 125 478.00	0.04
USD	MARSH & MCLENNAN COS INC 4.37500% 19-15.03.29	2 785 000.00	3 343 156.17	0.06
USD	MARSH & MCLENNAN COS INC 2.25000% 20-15.11.30	2 860 000.00	2 968 173.72	0.05
USD	MARTIN MARIETTA MATERIALS INC 3.50000% 17-15.12.27	1 205 000.00	1 379 899.53	0.02
USD	MARTIN MARIETTA MATERIALS INC 2.50000% 20-15.03.30	645 000.00	684 333.59	0.01
USD	MASTERCARD INC 2.95000% 19-01.06.29	2 775 000.00	3 080 554.86	0.06
USD	MCCORMICK & CO 2.50000% 20-15.04.30	845 000.00	894 973.69	0.02
USD	MCCORMICK & CO 3.15000% 17-15.08.24	2 605 000.00	2 823 942.20	0.05
USD	MCDONALD ' S CORP 2.62500% 11-15.01.22	4 600 000.00	4 702 391.31	0.08
USD	MCKESSON CORP 3.95000% 18-16.02.28	1 020 000.00	1 178 078.44	0.02
USD	MERCADOLIBRE INC 3.12500% 21-14.01.31	1 800 000.00	1 812 402.00	0.03
USD	MERCK & CO INC 0.75000% 20-24.02.26	3 600 000.00	3 601 165.90	0.06
USD	MERCK & CO INC 1.45000% 20-24.06.30	4 050 000.00	4 001 919.53	0.07
USD	METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 3.45000% 16-18.12.26	2 200 000.00	2 505 457.65	0.04
USD	MEXICHEM SAB DE CV-144A 4.00000% 17-04.10.27	2 200 000.00	2 413 812.50	0.04
USD	MEXICO, UNITED STATES OF 3.90000% 20-27.04.25	756 000.00	846 247.50	0.02
USD	MICRON TECHNOLOGY INC 4.97500% 19-06.02.26	4 025 000.00	4 715 299.81	0.08
USD	MICRON TECHNOLOGY INC 4.66300% 19-15.02.30	1 135 000.00	1 368 833.88	0.02
USD	MICROSOFT CORP 3.30000% 17-06.02.27	6 007 000.00	6 824 373.03	0.12
USD	MICROSOFT CORP 4.20000% 15-03.11.35	1 250 000.00	1 597 821.58	0.03
USD	MID-AMERICA APARTMENTS LP 4.30000% 13-15.10.23	1 000 000.00	1 089 510.01	0.02
USD	MID-AMERICA APARTMENTS LP 3.75000% 14-15.06.24	1 300 000.00	1 415 135.75	0.03
USD	MINERVA LUXEMBOURG SA-144A 6.50000% 16-20.09.26	280 000.00	294 159.60	0.01
USD	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 3.45500% 18-02.03.23	5 320 000.00	5 644 998.80	0.10
USD	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 3.76100% 18-26.07.23	1 070 000.00	1 155 557.20	0.02
USD	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 3.40700% 19-07.03.24	7 850 000.00	8 501 550.00	0.15
USD	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 3.74100% 19-07.03.29	2 550 000.00	2 932 296.00	0.05
USD	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GRP INC 2.19300% 20-25.02.25	6 025 000.00	6 317 212.50	0.11
USD	MOLINA HEALTHCARE INC 5.37500% 16-15.11.22	1 685 000.00	1 783 993.75	0.03
USD	MOLSON COORS BREWING CO 3.00000% 16-15.07.26	1 695 000.00	1 857 128.48	0.03
USD	MONDELEZ INTERNATIONAL INC 2.75000% 20-13.04.30	1 075 000.00	1 161 900.37	0.02
USD	MONDELEZ INTERNATIONAL INC 1.50000% 20-04.05.25	1 605 000.00	1 657 595.30	0.03
USD	MONDELEZ INTERNATIONAL INC 1.50000% 20-04.02.31	325 000.00	314 789.38	0.01
USD	MOODY ' S CORP 3.75000% 20-24.03.25	2 125 000.00	2 379 370.45	0.04
USD	MORGAN STANLEY 3.62500% 17-20.01.27	3 890 000.00	4 419 563.56	0.08
USD	MORGAN STANLEY-SUB 5.00000% 13-24.11.25	9 605 000.00	11 344 802.35	0.20
USD	MOSAIC CO 3.25000% 17-15.11.22	4 525 000.00	4 721 157.93	0.08
USD	MOTOROLA SOLUTIONS INC 4.00000% 14-01.09.24	3 000 000.00	3 339 416.94	0.06
USD	MPLX LP 3.37500% 18-15.03.23	1 850 000.00	1 953 441.58	0.04
USD	MPLX LP 4.12500% 17-01.03.27	3 410 000.00	3 890 295.80	0.07
USD	MPLX LP 4.87500% 16-01.12.24	7 905 000.00	8 982 083.20	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

2021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 MYLAN INC 4.55000% 19-15.04.28	1 829 000.00	2 168 200.30	0.04
USD NATIONAL FUEL GAS CO 5.50000% 20-15.01.26	2 500 000.00	2 909 259.23	0.05
USD NATIONAL OILWELL VARCO INC 3.60000% 19-01.12.29	3 390 000.00	3 526 308.34	0.06
USD NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-144A-SUB 4.00000% 16-14.09.26	1 299 000.00	1 451 399.11	0.03
USD NATWEST GROUP PLC 3.87500% 16-12.09.23	3 025 000.00	3 266 618.91	0.06
USD NATWEST GROUP PLC-SUB 6.00000% 13-19.12.23	1 610 000.00	1 828 994.01	0.03
USD NATWEST GROUP PLC-SUB 5.12500% 14-28.05.24	2 115 000.00	2 376 973.69	0.04
USD NATWEST MARKETS PLC-144A 3.62500% 19-29.09.22	1 940 000.00	2 040 867.77	0.04
USD NEVADA POWER CO 3.70000% 19-01.05.29	2 550 000.00	2 963 488.62	0.05
USD NEWELL BRANDS INC 3.85000% 16-01.04.23	4 115 000.00	4 336 098.95	0.08
USD NEWFIELD EXPLORATION CO 5.37500% 15-01.01.26	3 836 000.00	4 190 957.40	0.08
USD NEWMONT CORP 2.25000% 20-01.10.30	7 005 000.00	7 198 962.07	0.13
USD NEWMONT GOLDCORP CORP 2.80000% 19-01.10.29	4 250 000.00	4 563 558.11	0.08
USD NEXTERA ENERGY CAPITAL HOLDINGS INC 3.55000% 17-01.05.27	1 375 000.00	1 565 975.80	0.03
USD NIKE INC 2.85000% 20-27.03.30	4 970 000.00	5 521 557.58	0.10
USD NISOURCE INC 3.49000% 17-15.05.27	4 220 000.00	4 756 098.21	0.09
USD NISOURCE INC 3.60000% 20-01.05.30	5 300 000.00	6 028 898.50	0.11
USD NISSAN MOTOR CO LTD-144A 3.04300% 20-15.09.23	1 290 000.00	1 352 642.40	0.02
USD NISSAN MOTOR CO LTD-144A 3.52200% 20-17.09.25	4 200 000.00	4 497 956.11	0.08
USD NISSAN MOTOR CO LTD-144A 4.34500% 20-17.09.27	12 953 000.00	14 236 512.77	0.25
USD NOMURA HOLDINGS INC 2.64800% 20-16.01.25	1 545 000.00	1 641 392.55	0.03
USD NOMURA HOLDINGS INC 1.85100% 20-16.07.25	9 630 000.00	9 945 478.80	0.18
USD NORDEA BANK ABP-REG-S 3.75000% 18-30.08.23	2 774 000.00	3 000 320.01	0.05
USD NORFOLK SOUTHERN CORP 3.80000% 18-01.08.28	2 645 000.00	3 071 938.97	0.06
USD NORFOLK SOUTHERN CORP 3.65000% 18-01.08.25	1 730 000.00	1 933 192.43	0.03
USD NORTHROP GRUMMAN CORP 4.40000% 20-01.05.30	2 700 000.00	3 283 948.79	0.06
USD NUTRITION & BIOSCIENCES INC-144A 2.30000% 20-01.11.30	5 195 000.00	5 306 122.51	0.10
USD O' REILLY AUTOMOTIVE INC 3.55000% 16-15.03.26	825 000.00	926 035.82	0.02
USD O' REILLY AUTOMOTIVE INC 3.60000% 17-01.09.27	2 250 000.00	2 561 705.37	0.05
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 3.50000% 19-15.08.29	2 293 000.00	2 127 605.91	0.04
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 2.90000% 19-15.08.24	3 720 000.00	3 599 100.00	0.06
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 5.50000% 20-01.12.25	1 800 000.00	1 890 000.00	0.03
USD OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST 4.25000% 15-15.05.25	3 150 000.00	3 357 897.73	0.06
USD OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC 4.50000% 15-15.01.25	1 550 000.00	1 697 095.42	0.03
USD OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC 5.25000% 16-15.01.26	2 606 000.00	2 984 351.49	0.05
USD OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC 3.37500% 20-01.02.31	1 223 000.00	1 274 091.87	0.02
USD ONCOR ELECTRIC DELIVERY CO 4.10000% 19-15.11.48	1 200 000.00	1 520 279.00	0.03
USD ONEOK INC 2.20000% 20-15.09.25	1 845 000.00	1 920 809.70	0.03
USD ONEOK INC 2.75000% 19-01.09.24	2 790 000.00	2 939 296.05	0.05
USD ONEOK INC 3.10000% 20-15.03.30	3 275 000.00	3 400 043.07	0.06
USD ONEOK INC 4.00000% 17-13.07.27	536 000.00	595 246.58	0.01
USD ONEOK INC 4.35000% 19-15.03.29	2 426 000.00	2 726 802.06	0.05
USD ONEOK INC 4.55000% 18-15.07.28	2 595 000.00	2 959 035.03	0.05
USD ONEOK PARTNERS LP 4.90000% 15-15.03.25	1 510 000.00	1 711 351.99	0.03
USD ONTARIO TEACHERS' FINANCE TRUST-144A 1.37500% 20-15.04.25	9 300 000.00	9 598 919.39	0.17
USD ORACLE CORP 2.40000% 16-15.09.23	7 755 000.00	8 141 187.99	0.15
USD ORACLE CORP 2.50000% 20-01.04.25	2 705 000.00	2 894 442.89	0.05
USD ORACLE CORP 2.80000% 20-01.04.27	2 950 000.00	3 224 114.24	0.06
USD ORACLE CORP 2.95000% 17-15.11.24	3 410 000.00	3 697 474.77	0.07
USD OVINTIV INC 3.90000% 11-15.11.21	2 834 000.00	2 865 068.75	0.05
USD OWENS CORNING 3.40000% 16-15.08.26	1 600 000.00	1 772 872.69	0.03
USD OWENS CORNING 3.95000% 19-15.08.29	2 000 000.00	2 308 530.42	0.04
USD OWL ROCK CAPITAL CORP 3.75000% 20-22.07.25	5 900 000.00	6 141 961.60	0.11
USD PANASONIC CORP-144A 2.67900% 19-19.07.24	4 730 000.00	5 042 794.90	0.09
USD PARK AEROSPACE HOLDINGS LTD-144A 5.50000% 17-15.02.24	2 415 000.00	2 650 535.36	0.05
USD PAYPAL HOLDINGS INC 2.40000% 19-01.10.24	2 375 000.00	2 524 089.06	0.05
USD PAYPAL HOLDINGS INC 2.85000% 19-01.10.29	1 845 000.00	2 011 125.34	0.04
USD PAYPAL HOLDINGS INC 1.65000% 20-01.06.25	2 665 000.00	2 761 269.69	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 - US マルチ・クレジット

2021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 PEIDMONT OPERATING PARTNERSHIP LP 3.40000% 13-01.06.23	1 500 000.00	1 565 249.76	0.03
USD PENTAIR FINANCE SARL 4.50000% 19-01.07.29	4 315 000.00	5 057 688.13	0.09
USD PEPSICO INC 2.00000% 17-15.04.21	2 620 000.00	2 625 962.91	0.05
USD PEPSICO INC 2.25000% 17-02.05.22	1 950 000.00	1 996 284.49	0.04
USD PERRIGO FINANCE UNLIMITED CO 3.15000% 20-15.06.30	3 200 000.00	3 373 814.21	0.06
USD PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD-144A 5.50000% 15-15.07.22	7 900 000.00	8 331 002.67	0.15
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV1 5.09300% 20-15.01.30	158 000.00	172 575.50	0.00
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 5.60000% 20-03.01.31	1 290 000.00	1 433 190.00	0.03
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.50000% 18-23.01.29	3 990 000.00	3 962 568.75	0.07
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.49000% 20-23.01.27	770 000.00	793 100.00	0.01
USD PETROLEOS MEXICANOS 5.95000% 20-28.01.31	2 300 000.00	2 179 250.00	0.04
USD PFIZER INC 2.62500% 20-01.04.30	2 400 000.00	2 619 737.02	0.05
USD PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 2.87500% 19-01.05.24	2 725 000.00	2 923 904.38	0.05
USD PHILLIPS 66 3.85000% 20-09.04.25	395 000.00	440 592.48	0.01
USD PHILLIPS 66 4.30000% 12-01.04.22	920 000.00	960 672.26	0.02
USD PHILLIPS 66 PARTNERS LP 3.75000% 17-01.03.28	2 840 000.00	3 082 040.91	0.06
USD PIEDMONT NATURAL GAS CO INC 3.50000% 19-01.06.29	1 320 000.00	1 494 235.59	0.03
USD PINNACLE WEST CAPITAL CORP 1.30000% 20-15.06.25	3 320 000.00	3 375 699.57	0.06
USD PIONEER NATURAL RESOURCES CO 2.15000% 21-15.01.31	1 443 000.00	1 427 669.80	0.03
USD PIONEER NATURAL RESOURCES CO 1.12500% 21-15.01.26	8 905 000.00	8 920 127.46	0.16
USD PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP 3.65000% 12-01.06.22	2 400 000.00	2 471 523.72	0.04
USD PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP 3.85000% 13-15.10.23	4 919 000.00	5 253 126.03	0.09
USD PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP 3.55000% 19-15.12.29	5 016 000.00	5 225 520.52	0.09
USD PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP 3.80000% 20-15.09.30	1 250 000.00	1 322 073.40	0.02
USD PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE 3.45000% 19-23.04.29	4 400 000.00	5 031 247.14	0.09
USD PNC FINANCIAL SERVICES GROUP 2.20000% 19-01.11.24	5 710 000.00	6 066 926.73	0.11
USD PPL CAPITAL FUNDING INC 4.12500% 20-15.04.30	1 820 000.00	2 148 154.92	0.04
USD PRINCIPAL FINANCIAL GROUP 3.40000% 15-15.05.25	2 747 000.00	3 032 350.72	0.05
USD PRINCIPAL FINANCIAL GROUP 3.10000% 16-15.11.26	3 750 000.00	4 158 128.55	0.07
USD PROLOGIS LP 2.12500% 20-15.04.27	1 100 000.00	1 170 160.89	0.02
USD PROLOGIS LP 2.25000% 20-15.04.30	2 065 000.00	2 168 389.86	0.04
USD PROSUS NV-144A 3.68000% 20-21.01.30	552 000.00	593 400.00	0.01
USD PROTECTIVE LIVE CORP-REG-S 4.30000% 18-30.09.28	5 700 000.00	6 523 924.39	0.12
USD PSEG POWER LLC 3.85000% 18-01.06.23	4 730 000.00	5 083 253.00	0.09
USD PUBLIC SERVICE CO OF NEW MEXICO 3.85000% 15-01.08.25	3 000 000.00	3 295 667.40	0.06
USD PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC 2.65000% 17-15.11.22	2 500 000.00	2 593 828.17	0.05
USD PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC 0.80000% 20-15.08.25	3 425 000.00	3 424 041.35	0.06
USD PUBLIC STORAGE 0.87500% 21-15.02.26	4 175 000.00	4 170 498.22	0.07
USD PULTEGROUP INC 5.00000% 16-15.01.27	445 000.00	528 833.55	0.01
USD PVH CORP 4.62500% 20-10.07.25	1 515 000.00	1 703 068.36	0.03
USD QATAR, STATE OF-144A 3.87500% 18-23.04.23	1 819 000.00	1 950 877.50	0.04
USD QATAR, STATE OF-144A 4.00000% 19-14.03.29	882 000.00	1 034 145.00	0.02
USD QATAR, STATE OF-144A 4.81700% 19-14.03.49	1 450 000.00	1 942 093.75	0.03
USD QUEST DIAGNOSTICS INC 2.95000% 19-30.06.30	715 000.00	786 673.11	0.01
USD QWEST CORP 6.75000% 11-01.12.21	1 090 000.00	1 142 211.00	0.02
USD RABOBANK NEDERLAND NV-SUB 4.37500% 15-04.08.25	5 870 000.00	6 711 952.83	0.12
USD RABOBANK NEDERLAND NV-SUB 3.75000% 16-21.07.26	1 504 000.00	1 695 164.57	0.03
USD RABOBANK NEDERLAND-SUB 4.62500% 13-01.12.23	5 000 000.00	5 562 100.00	0.10
USD RALPH LAUREN CORP 2.95000% 20-15.06.30	3 232 000.00	3 466 580.30	0.06
USD RAYMOND JAMES FINANCIAL INC 5.62500% 12-01.04.24	2 000 000.00	2 304 073.58	0.04
USD RAYMOND JAMES FINANCIAL INC 4.65000% 20-01.04.30	2 680 000.00	3 264 251.09	0.06
USD REALTY INCOME CORP 1.80000% 20-15.03.33	280 000.00	274 658.61	0.01
USD REALTY INCOME CORP 3.87500% 18-15.04.25	2 040 000.00	2 300 140.98	0.04
USD REALTY INCOME CORP 3.25000% 20-15.01.31	6 480 000.00	7 215 945.33	0.13
USD REALTY INCOME CORP 4.12500% 14-15.10.26	1 000 000.00	1 168 039.41	0.02
USD RECKITT BENCKISER TREAS SERV-REG-S 2.75000% 17-26.06.24	5 650 000.00	6 036 332.76	0.11
USD REGENCY CENTERS LP 3.75000% 14-15.06.24	1 110 000.00	1 197 023.48	0.02
USD REGENCY CENTERS LP 3.60000% 17-01.02.27	2 030 000.00	2 252 111.11	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

2021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 REGENCY CENTERS LP 4.12500% 18-15.03.28	1 600 000.00	1 821 458.76	0.03
USD RELX CAPITAL INC 3.00000% 20-22.05.30	3 200 000.00	3 483 488.00	0.06
USD RELX CAPITAL INC 4.00000% 19-18.03.29	2 940 000.00	3 436 957.99	0.06
USD REPUBLIC SERVICES INC 2.90000% 16-01.07.26	2 445 000.00	2 668 050.26	0.05
USD REPUBLIC SERVICES INC 2.50000% 19-15.08.24	2 500 000.00	2 660 565.65	0.05
USD REXFORD INDUSTRIAL REALTY LP 2.12500% 20-01.12.30	1 354 000.00	1 339 652.37	0.02
USD REYNOLDS AMERICAN INC 5.70000% 15-15.08.35	2 700 000.00	3 378 506.92	0.06
USD RIO TINTO FINANCE USA LTD 3.75000% 15-15.06.25	2 585 000.00	2 894 734.70	0.05
USD ROCK-TENN CO 4.90000% 13-01.03.22	1 275 000.00	1 335 165.39	0.02
USD ROGERS COMMUNICATIONS INC 3.62500% 15-15.12.25	1 520 000.00	1 709 940.03	0.03
USD ROGERS COMMUNICATIONS INC 2.90000% 16-15.11.26	2 000 000.00	2 203 669.02	0.04
USD ROSS STORES INC 4.70000% 20-15.04.27	1 720 000.00	2 018 847.28	0.04
USD ROSS STORES INC 4.80000% 20-15.04.30	1 725 000.00	2 076 917.91	0.04
USD ROYALTY PHARMA PLC-REG-S 1.75000% 20-02.09.27	4 825 000.00	4 924 788.33	0.09
USD SABINE PASS LIQUEFACTION LLC 5.75000% 14-15.05.24	3 350 000.00	3 833 808.91	0.07
USD SABINE PASS LIQUEFACTION LLC 5.62500% 16-01.03.25	1 045 000.00	1 218 992.50	0.02
USD SALESFORCE.COM INC 3.25000% 18-11.04.23	2 382 000.00	2 528 061.79	0.05
USD SANDS CHINA LTD 4.60000% 19-08.08.23	800 000.00	847 264.00	0.02
USD SANTANDER HOLDINGS USA INC 4.40000% 18-13.07.27	5 600 000.00	6 422 835.38	0.12
USD SANTANDER UK GROUP HOLD PLC 3.57100% 17-10.01.23	4 615 000.00	4 747 600.63	0.09
USD SANTANDER UK PLC 3.40000% 18-01.06.21	2 820 000.00	2 849 540.15	0.05
USD SASOL FINANCING USA LLC 5.87500% 18-27.03.24	1 070 000.00	1 123 834.38	0.02
USD SAUDI ARABIAN OIL CO-144A 1.62500% 20-24.11.25	424 000.00	431 950.00	0.01
USD SAUDI ARABIAN OIL CO-144A 2.25000% 20-24.11.30	520 000.00	520 000.00	0.01
USD SEMPRA ENERGY 3.40000% 18-01.02.28	5 487 000.00	6 158 780.81	0.11
USD SENIOR HOUSING PROPERTIES TRUST 6.75000% 11-15.12.21	1 450 000.00	1 479 000.00	0.03
USD SERVICE PROPERTIES TRUST 5.25000% 16-15.02.26	5 000 000.00	4 925 000.00	0.09
USD SERVICENOW INC 1.40000% 20-01.09.30	2 850 000.00	2 723 839.71	0.05
USD SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 3.50000% 18-13.11.23	2 600 000.00	2 810 477.05	0.05
USD SHERWIN-WILLIAMS CO 3.45000% 17-01.06.27	2 825 000.00	3 195 970.98	0.06
USD SHERWIN-WILLIAMS CO 2.95000% 19-15.08.29	2 225 000.00	2 428 721.02	0.04
USD SHERWIN-WILLIAMS CO 2.30000% 20-15.05.30	2 340 000.00	2 426 984.82	0.04
USD SHIRE ACQUISITIONS INVT IRELAND DAC 2.87500% 16-23.09.23	6 955 000.00	7 353 307.49	0.13
USD SHIRE ACQUISITIONS INVT IRELAND DAC 3.20000% 16-23.09.26	750 000.00	833 050.91	0.01
USD SK HYNIX INC-144A 2.37500% 21-19.01.31	658 000.00	662 920.78	0.01
USD SK TELECOM CO LTD-144A 3.75000% 18-16.04.23	2 505 000.00	2 673 786.90	0.05
USD SL GREEN OPERATING PARTNERSHIP LP 3.25000% 17-15.10.22	2 685 000.00	2 783 085.38	0.05
USD SMBC AVIATION CAPITAL FINANCE DAC-REG-S 2.65000% 16-15.07.21	9 915 000.00	9 976 009.08	0.18
USD SMITH&NEWPHEW PLC 2.03200% 20-14.10.30	2 550 000.00	2 562 272.54	0.05
USD SOCIETE GENERALE SA-144A-SUB 4.25000% 15-14.04.25	2 165 000.00	2 391 566.62	0.04
USD SOCIETE GENERALE SA-144A-SUB 4.75000% 15-24.11.25	2 930 000.00	3 328 405.08	0.06
USD SONOCO PRODUCTS CO 3.12500% 20-01.05.30	4 415 000.00	4 818 488.05	0.09
USD SOUTHERN CO 3.70000% 20-30.04.30	925 000.00	1 051 768.67	0.02
USD SOUTHERN CO GAS CAPITAL CORP 3.25000% 16-15.06.26	1 665 000.00	1 851 506.19	0.03
USD SOUTHWEST AIRLINES CO 2.62500% 20-10.02.30	1 515 000.00	1 534 947.64	0.03
USD SOUTHWEST AIRLINES CO 5.25000% 20-04.05.25	4 081 000.00	4 683 671.67	0.08
USD SOUTHWEST AIRLINES CO 5.12500% 20-15.06.27	1 330 000.00	1 574 990.13	0.03
USD SOUTHWEST GAS CORP 3.70000% 18-01.04.28	1 250 000.00	1 423 149.31	0.03
USD SOUTHWESTERN ELECTRIC POWER 3.55000% 12-15.02.22	1 000 000.00	1 024 509.17	0.02
USD SPECTRA ENERGY PARTNERS LP 3.50000% 15-15.03.25	900 000.00	985 988.20	0.02
USD SPIRE INC 3.54300% 17-27.02.24	1 500 000.00	1 574 574.99	0.03
USD SPIRIT AEROSYSTEMS INC 3.85000% 16-15.06.26	1 000 000.00	1 042 200.00	0.02
USD SPIRIT REALTY LP 3.20000% 19-15.01.27	1 546 000.00	1 649 958.10	0.03
USD SPIRIT REALTY LP 3.40000% 19-15.01.30	1 300 000.00	1 408 469.78	0.03
USD SPIRIT REALTY LP 4.00000% 19-15.07.29	3 829 000.00	4 278 047.59	0.08
USD SPIRIT REALTY LP 4.45000% 17-15.09.26	2 710 000.00	3 068 723.57	0.05
USD STARBUCKS CORP 2.00000% 20-12.03.27	4 615 000.00	4 856 934.73	0.09
USD STARBUCKS CORP 2.55000% 20-15.11.30	2 235 000.00	2 370 476.89	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

2021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 STARBUCKS CORP 3.8000% 18-15.08.25	1 900 000.00	2 143 359.54	0.04
USD STEEL DYNAMICS INC 2.4000% 20-15.06.25	845 000.00	897 153.20	0.02
USD STEEL DYNAMICS INC 3.4500% 19-15.04.30	2 960 000.00	3 298 301.51	0.06
USD STEEL DYNAMICS INC 3.2500% 20-15.01.31	2 125 000.00	2 337 269.06	0.04
USD STIFEL FINANCIAL CORP 4.0000% 20-15.05.30	1 390 000.00	1 581 603.71	0.03
USD STORE CAPITAL CORP 4.6250% 19-15.03.29	892 000.00	1 029 380.26	0.02
USD STRYKER CORP 1.1500% 20-15.06.25	4 685 000.00	4 749 177.42	0.09
USD STRYKER CORP 2.6250% 16-15.03.21	1 000 000.00	1 001 511.69	0.02
USD STRYKER CORP 3.5000% 16-15.03.26	1 000 000.00	1 125 792.58	0.02
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 2.7840% 17-12.07.22	2 150 000.00	2 222 734.50	0.04
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 3.1020% 18-17.01.23	2 510 000.00	2 640 043.10	0.05
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 3.7480% 18-19.07.23	2 740 000.00	2 960 762.05	0.05
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 2.6960% 19-16.07.24	2 925 000.00	3 120 887.25	0.06
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 2.4480% 19-27.09.24	7 535 000.00	7 991 847.05	0.14
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 2.3480% 20-15.01.25	2 915 000.00	3 072 031.05	0.06
USD SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 0.5080% 21-12.01.24	350 000.00	349 933.50	0.01
USD SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 1.7100% 21-12.01.31	2 000 000.00	1 963 420.00	0.04
USD SUNOCO LOGISTICS PARTNERS OPERATIONS LP 3.9000% 16-15.07.26	750 000.00	821 038.69	0.01
USD SUNOCO LOGISTICS PARTNERS OPERATIONS LP 4.0000% 17-01.10.27	1 000 000.00	1 102 075.95	0.02
USD SUZANO AUSTRIA GMBH 3.7500% 20-15.01.31	2 280 000.00	2 411 556.00	0.04
USD SYNCHRONY BANK 3.0000% 17-15.06.22	5 000 000.00	5 154 708.80	0.09
USD SYNCHRONY FINANCIAL 4.2500% 14-15.08.24	544 000.00	597 861.71	0.01
USD SYNCHRONY FINANCIAL 4.5000% 15-23.07.25	4 550 000.00	5 132 406.19	0.09
USD SYNCHRONY FINANCIAL 3.9500% 17-01.12.27	586 000.00	654 664.84	0.01
USD SYNCHRONY FINANCIAL 4.3750% 19-19.03.24	389 000.00	426 971.46	0.01
USD SYSCO CORP 5.6500% 20-01.04.25	690 000.00	819 356.20	0.01
USD SYSCO CORP 5.9500% 20-01.04.30	1 883 000.00	2 432 661.45	0.04
USD T-MOBILE USA INC 2.6250% 21-15.02.29	5 585 000.00	5 605 273.55	0.10
USD T-MOBILE USA INC 4.7500% 18-01.02.28	56 000.00	59 813.60	0.00
USD T-MOBILE USA INC 6.0000% 14-01.03.23	134 000.00	134 167.50	0.00
USD T-MOBILE USA INC 6.0000% 16-15.04.24	389 000.00	393 271.22	0.01
USD T-MOBILE USA INC-144A 2.5500% 20-15.02.31	2 664 000.00	2 728 681.92	0.05
USD T-MOBILE USA INC-REG-S 3.8750% 20-15.04.30	4 675 000.00	5 278 869.75	0.09
USD TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 4.4000% 19-26.11.23	2 853 000.00	3 148 485.21	0.06
USD TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 2.0500% 20-31.03.30	11 124 000.00	11 225 005.92	0.20
USD TAQA ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO-144A 4.3750% 18-23.04.25	2 229 000.00	2 518 073.44	0.05
USD TARGA RESOURCES PARTNERS 6.8750% 19-15.01.29	251 000.00	277 041.25	0.01
USD TARGET CORP 2.2500% 20-15.04.25	2 430 000.00	2 589 213.67	0.05
USD TD AMERITRADE HOLDING COPR 3.7500% 18-01.04.24	5 000 000.00	5 485 935.35	0.10
USD TELEFONICA EMISIONES SAU 5.4620% 11-16.02.21	1 700 000.00	1 703 365.71	0.03
USD TELEFONICA EMISIONES SA 4.1030% 17-08.03.27	2 440 000.00	2 819 781.29	0.05
USD TENET HEALTHCARE CORP 4.6250% 17-15.07.24	179 000.00	182 186.20	0.00
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE CO BV 3.6500% 11-10.11.21	3 578 000.00	3 611 543.75	0.06
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 2.2000% 16-21.07.21	3 051 000.00	3 042 570.08	0.05
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 3.1500% 16-01.10.26	6 750 000.00	6 429 375.00	0.12
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 6.0000% 18-15.04.24	4 300 000.00	4 521 665.00	0.08
USD TEXAS INSTRUMENTS INC 1.7500% 20-04.05.30	6 550 000.00	6 629 576.01	0.12
USD TIME WARNER CABLE LLC 5.5000% 11-01.09.41	200 000.00	250 358.34	0.00
USD TOLL BROTHERS FINANCE CORP 4.8750% 15-15.11.25	965 000.00	1 088 037.50	0.02
USD TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.7500% 14-10.04.24	1 200 000.00	1 324 356.60	0.02
USD TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.4550% 19-19.02.29	1 040 000.00	1 178 565.07	0.02
USD TOTAL CAPITAL SA 3.8830% 18-11.10.28	4 405 000.00	5 167 292.65	0.09
USD TOYOTA INDUSTRIES CORP-144A 3.1100% 19-12.03.22	4 500 000.00	4 621 050.00	0.08
USD TRANSCANADA PIPELINES LTD 4.1000% 20-15.04.30	6 855 000.00	7 958 396.83	0.14
USD TRANSOCEAN PHOENIX 2 LTD-144A 7.7500% 16-15.10.24	249 000.00	143 424.00	0.00
USD TRANSOCEAN PROTEUS LTD-144A 6.2500% 16-01.12.24	150 000.00	82 800.00	0.00
USD TRIMBLE INC 4.1500% 18-15.06.23	1 460 000.00	1 566 438.62	0.03
USD TRINITY ACQUISITION PLC 4.4000% 16-15.03.26	700 000.00	809 809.00	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

2021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 TRIVIUM PACKAGING FINANCE BV-144A 5.50000% 19-15.08.26	710 000.00	748 570.75	0.01
USD TRUIST BANK 4.05000% 18-03.11.25	5 250 000.00	6 027 808.19	0.11
USD TSMC GLOBAL LTD-144A 0.75000% 20-28.09.25	6 350 000.00	6 305 613.50	0.11
USD TUCSON ELECTRIC POWER CO 5.15000% 11-15.11.21	220 000.00	225 665.92	0.00
USD TYCO ELECTRONICS GROUP SA 3.45000% 14-01.08.24	690 000.00	745 499.70	0.01
USD TYSON FOODS INC 3.95000% 14-15.08.24	2 000 000.00	2 218 646.88	0.04
USD TYSON FOODS INC 4.00000% 19-01.03.26	3 500 000.00	3 995 118.92	0.07
USD UBS GROUP AG-144A 4.12500% 16-15.04.26	1 000 000.00	1 147 628.23	0.02
USD UBS GROUP AG-REG-S 3.49100% 17-23.05.23	1 850 000.00	1 922 342.38	0.03
USD UBS GROUP AG-REG-S 4.12500% 15-24.09.25	2 100 000.00	2 386 146.48	0.04
USD UNION ELECTRIC CO 2.95000% 17-15.06.27	1 555 000.00	1 720 964.60	0.03
USD UNION PACIFIC CORP 3.15000% 19-01.03.24	2 800 000.00	3 011 208.14	0.05
USD UNITED AIRLINES 2014-2 CLAS A PAS THR 3.75000% 14-03.09.26	4 500 000.00	3 321 027.99	0.06
USD UNITED PARCEL SERVICE INC 2.20000% 19-01.09.24	6 230 000.00	6 592 296.80	0.12
USD UNITED RENTALS NORTH AMERICA INC 4.00000% 20-15.07.30	1 825 000.00	1 924 827.50	0.03
USD UNITED TECHNOLOGIES CORP 4.12500% 18-16.11.28	4 725 000.00	5 559 134.53	0.10
USD UNITED TECHNOLOGIES CORP 3.65000% 18-16.08.23	148 000.00	159 126.99	0.00
USD UNITED TECHNOLOGIES CORP 3.95000% 18-16.08.25	3 562 000.00	4 055 254.07	0.07
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 3.37500% 17-15.04.27	2 315 000.00	2 615 329.02	0.05
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 3.85000% 18-15.06.28	5 611 000.00	6 567 142.24	0.12
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 2.37500% 19-15.08.24	1 640 000.00	1 746 215.32	0.03
USD UNUM GROUP 4.00000% 19-15.06.29	1 000 000.00	1 112 538.29	0.02
USD UNUM GROUP 4.50000% 20-15.03.25	1 000 000.00	1 137 016.96	0.02
USD US BANCORP 2.40000% 19-30.07.24	2 915 000.00	3 101 193.11	0.06
USD VALE OVERSEAS LTD 3.75000% 20-08.07.30	1 930 000.00	2 109 779.50	0.04
USD VALE OVERSEAS LTD 6.25000% 16-10.08.26	436 000.00	534 508.75	0.01
USD VALERO ENERGY CORP 2.85000% 20-15.04.25	3 625 000.00	3 848 976.67	0.07
USD VALERO ENERGY CORP 4.00000% 19-01.04.29	2 010 000.00	2 223 627.39	0.04
USD VENTAS REALITY LP 3.75000% 14-01.05.24	535 000.00	582 450.89	0.01
USD VENTAS REALTY LP 3.12500% 16-15.06.23	2 805 000.00	2 957 122.47	0.05
USD VENTAS REALTY LP 3.85000% 17-01.04.27	2 106 000.00	2 368 354.68	0.04
USD VEON HOLDINGS BV-144A 3.37500% 20-25.11.27	2 815 000.00	2 886 782.50	0.05
USD VEREIT OPERATING PARTNERSHIP LP 4.87500% 16-01.06.26	256 000.00	301 294.74	0.01
USD VEREIT OPERATING PARTNERSHIP LP 4.62500% 18-01.11.25	1 761 000.00	2 033 306.37	0.04
USD VEREIT OPERATING PARTNERSHIP LP 3.10000% 19-15.12.29	2 825 000.00	3 009 644.23	0.05
USD VEREIT OPERATING PARTNERSHIP LP 2.85000% 20-15.12.32	2 399 000.00	2 467 212.18	0.04
USD VEREIT OPERATING PARTNERSHIP LP 2.20000% 20-15.06.28	1 475 000.00	1 508 912.05	0.03
USD VERISK ANALYTICS INC 4.12500% 19-15.03.29	4 734 000.00	5 584 394.45	0.10
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 4.27200% 15-15.01.36	1 500 000.00	1 825 637.28	0.03
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 4.50000% 17-10.08.33	5 305 000.00	6 541 360.33	0.12
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.37600% 18-15.02.25	3 008 000.00	3 310 018.51	0.06
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.87500% 19-08.02.29	1 275 000.00	1 475 457.51	0.03
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 4.01600% 19-03.12.29	4 828 000.00	5 661 361.08	0.10
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.15000% 20-22.03.30	870 000.00	957 825.69	0.02
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.00000% 20-22.03.27	976 000.00	1 074 601.83	0.02
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.50000% 20-18.09.30	3 310 000.00	3 209 091.61	0.06
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 0.85000% 20-20.11.25	2 100 000.00	2 099 971.02	0.04
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.65000% 20-20.11.40	930 000.00	906 381.61	0.02
USD VF CORP 2.95000% 20-23.04.30	4 120 000.00	4 514 075.12	0.08
USD VIACOMCBS INC 3.87500% 14-01.04.24	1 000 000.00	1 090 982.72	0.02
USD VIACOMCBS INC 4.20000% 20-19.05.32	1 940 000.00	2 298 379.17	0.04
USD VIACOMCBS INC 4.95000% 20-15.01.31	525 000.00	648 675.08	0.01
USD VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC-144A 5.50000% 19-15.05.29	500 000.00	536 555.00	0.01
USD VIRGINIA ELECTRIC & POWER CO 3.80000% 18-01.04.28	565 000.00	654 518.27	0.01
USD VISA INC 2.70000% 20-15.04.40	270 000.00	283 398.99	0.01
USD VMWARE INC 2.95000% 17-21.08.22	663 000.00	686 868.48	0.01
USD VODAFONE GROUP PLC 4.37500% 18-30.05.28	6 241 000.00	7 431 319.53	0.13
USD VORNADO REALTY LP 3.50000% 17-15.01.25	4 600 000.00	4 901 463.58	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 - US マルチ・クレジット

2021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 VOYA FINANCIAL INC 3.12500% 17-15.07.24	2 000 000.00	2 162 402.76	0.04
USD WABTEC CORP/DE 3.20000% 20-15.06.25	274 000.00	294 206.52	0.01
USD WABTEC CORP/DE 3.45000% 17-15.11.26	2 875 000.00	3 143 084.21	0.06
USD WALMART INC 2.65000% 17-15.12.24	5 950 000.00	6 423 715.85	0.12
USD WALMART INC 2.85000% 19-08.07.24	2 675 000.00	2 890 811.11	0.05
USD WALMART INC 3.05000% 19-08.07.26	4 720 000.00	5 279 721.62	0.09
USD WALMART INC 3.25000% 19-08.07.29	2 715 000.00	3 108 235.66	0.06
USD WALT DISNEY CO 1.75000% 19-30.08.24	2 800 000.00	2 914 323.30	0.05
USD WALT DISNEY CO 1.75000% 20-13.01.26	3 310 000.00	3 453 551.00	0.06
USD WALT DISNEY CO 2.20000% 20-13.01.28	1 845 000.00	1 949 313.74	0.03
USD WALT DISNEY CO 2.65000% 20-13.01.31	4 795 000.00	5 176 146.93	0.09
USD WALT DISNEY CO 2.75000% 19-01.09.49	240 000.00	236 655.98	0.00
USD WALT DISNEY CO 3.35000% 20-24.03.25	1 358 000.00	1 498 428.99	0.03
USD WALT DISNEY CO 3.70000% 19-15.09.24	1 600 000.00	1 765 391.90	0.03
USD WALT DISNEY CO 3.70000% 19-15.10.25	2 100 000.00	2 362 905.74	0.04
USD WASTE CONNECTIONS INC 2.60000% 20-01.02.30	3 250 000.00	3 455 072.33	0.06
USD WASTE MANAGEMENT INC 3.15000% 17-15.11.27	1 200 000.00	1 349 164.64	0.02
USD WASTE MANAGEMENT INC 1.15000% 20-15.03.28	5 975 000.00	5 909 227.50	0.11
USD WEA FINANCE LLC-144A 3.15000% 17-05.04.22	3 800 000.00	3 882 834.26	0.07
USD WEIBO CORP 3.50000% 19-05.07.24	3 269 000.00	3 428 363.75	0.06
USD WELLS FARGO & CO 3.00000% 16-23.10.26	2 834 000.00	3 116 456.59	0.06
USD WELLS FARGO & CO 3.06900% 17-24.01.23	3 450 000.00	3 543 666.19	0.06
USD WELLS FARGO & CO-SUB 4.12500% 13-15.08.23	6 520 000.00	7 094 060.84	0.13
USD WELLTOWER INC 2.75000% 20-15.01.31	825 000.00	869 929.50	0.02
USD WELLTOWER INC 3.10000% 19-15.01.30	2 450 000.00	2 648 047.17	0.05
USD WELLTOWER INC 3.62500% 19-15.03.24	1 000 000.00	1 088 656.48	0.02
USD WESTERN GAS PARTNERS LP 4.65000% 16-01.07.26	2 465 000.00	2 588 250.00	0.05
USD WESTERN GAS PARTNERS LP 4.50000% 18-01.03.28	1 005 000.00	1 040 175.00	0.02
USD WESTERN MIDSTREAM OPERATING LP 4.05000% 20-01.02.30	3 210 000.00	3 531 000.00	0.06
USD WESTERN UNION CO 2.85000% 19-10.01.25	2 825 000.00	3 027 081.38	0.05
USD WILLIAMS COMPANIES INC 4.55000% 14-24.06.24	8 150 000.00	9 084 494.65	0.16
USD WILLIAMS COS INC/THE 3.75000% 17-15.06.27	6 025 000.00	6 854 149.18	0.12
USD WILLIAMS COS INC/THE 4.00000% 11-15.11.21	640 000.00	652 079.78	0.01
USD WILLIAMS COS INC/THE LP 3.35000% 12-15.08.22	1 000 000.00	1 036 275.79	0.02
USD WILLIAMS COS INC/THE 4.50000% 13-15.11.23	2 300 000.00	2 525 324.68	0.05
USD WILLIAMS COS INC/THE 4.30000% 14-04.03.24	2 620 000.00	2 876 450.48	0.05
USD WILLIAMS COS INC/THE 3.90000% 14-15.01.25	1 000 000.00	1 103 847.16	0.02
USD WILLIS NORTH AMERICA INC 3.60000% 17-15.05.24	975 000.00	1 064 210.85	0.02
USD WILLIS TOWERS WATSON PLC 5.75000% 11-15.03.21	600 000.00	603 762.00	0.01
USD WOODSIDE FINANCE LTD-REG-S 3.70000% 17-15.03.28	2 175 000.00	2 325 292.50	0.04
USD WP CAREY INC 2.40000% 20-01.02.31	950 000.00	971 945.64	0.02
USD WP CAREY INC 3.85000% 19-15.07.29	3 208 000.00	3 619 402.64	0.06
USD WPX ENERGY INC 5.25000% 19-15.10.27	4 395 000.00	4 632 593.70	0.08
USD WR BERKLEY CORP 4.62500% 12-15.03.22	2 220 000.00	2 320 829.31	0.04
USD WYNN MACAU LTD-REG-S 5.50000% 20-15.01.26	1 045 000.00	1 075 587.15	0.02
USD WYNN MACAU LTD-REG-S 5.62500% 20-26.08.28	880 000.00	908 089.60	0.02
USD XCEL ENERGY INC 2.60000% 19-01.12.29	3 270 000.00	3 496 532.68	0.06
USD YARA INTERNATIONAL ASA-REG-S 3.14800% 20-04.06.30	725 000.00	771 445.31	0.01
USD ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC 3.15000% 15-01.04.22	3 780 000.00	3 881 161.16	0.07
米ドル合計		2 916 967 282.41	52.22
ノート、固定利付債合計		2 917 599 961.02	52.23
ノート、変動利付債			
USD			
USD AT&T INC 3M LIBOR+118 BP 18-12.06.24	14 695 000.00	15 082 319.49	0.27
USD BANCO SANTANDER SA 3M LIBOR+112BP 18-12.04.23	400 000.00	406 388.00	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

2021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 BANK OF AMERICA CORP 3.366%/VAR 18-23.01.26	6 650 000.00	7 299 228.66	0.13
USD BANK OF AMERICA CORP 3.419%/VAR 18-20.12.28	9 553 000.00	10 705 731.28	0.19
USD BANK OF AMERICA CORP 3.550%/3M LIBOR+78BP 18-05.03.24	2 720 000.00	2 893 086.98	0.05
USD BANK OF AMERICA CORP 2.592%/VAR 20-29.04.31	5 590 000.00	5 864 932.97	0.11
USD BANK OF NEW YORK MELLON CORP-SUB 4.700%/VAR 20-PRP	775 000.00	848 632.75	0.02
USD BARCLAYS PLC 2.852%/VAR 20-07.05.26	4 150 000.00	4 423 028.50	0.08
USD BARCLAYS PLC 3.932%/VAR 19-07.05.25	4 455 000.00	4 869 310.45	0.09
USD BARCLAYS PLC 4.610%/VAR 18-15.02.23	1 850 000.00	1 926 672.15	0.03
USD BBVA BANCOMER SA/TEXAS-144A-SUB 5.875%/VAR 19-13.09.34	1 590 000.00	1 784 278.12	0.03
USD BK OF AMERICA CORP 3.004%/VAR 18-20.12.23	11 861 000.00	12 426 447.91	0.22
USD BNP PARIBAS-REG-S 3.052%/VAR 20-13.01.31	3 300 000.00	3 545 014.24	0.06
USD CHARLES SCHWAB CORP-SUB 5.375%/VAR 20-PRP	2 314 000.00	2 564 745.04	0.05
USD CITIGROUP INC 0.776%/VAR 20-30.10.24	6 180 000.00	6 199 808.38	0.11
USD CITIGROUP INC 1.122%/VAR 21-28.01.27	2 550 000.00	2 549 268.40	0.05
USD CITIGROUP INC 1.678%/VAR 20-15.05.24	8 385 000.00	8 599 355.06	0.15
USD CITIGROUP INC 2.572%/VAR 20-03.06.31	2 935 000.00	3 057 820.59	0.05
USD CITIGROUP INC 2.666%/VAR 20-29.01.31	5 725 000.00	6 022 323.24	0.11
USD CITIGROUP INC 2.876%/VAR 17-24.07.23	2 000 000.00	2 070 851.40	0.04
USD CITIGROUP INC 2.976%/VAR 19-05.11.30	4 430 000.00	4 784 976.92	0.09
USD CITIGROUP INC 3.106%/VAR 20-08.04.26	1 080 000.00	1 172 274.13	0.02
USD CITIGROUP INC 3.142%/3M LIBOR+72.2BP 18-24.01.23	7 240 000.00	7 431 213.40	0.13
USD CITIGROUP INC 3.352%/VAR 19-24.04.25	2 750 000.00	2 975 830.00	0.05
USD CITIGROUP INC 3.520%/VAR 17-27.10.28	5 010 000.00	5 622 814.88	0.10
USD CITIGROUP INC-SUB 4.000%/VAR 20-VAR	3 277 000.00	3 322 058.75	0.06
USD COMERICA INC-SUB 5.625%/VAR 20-PRP	1 750 000.00	1 925 000.00	0.03
USD CREDIT AGRICOLE SA-REG-S 1.247%/VAR 21-26.01.27	1 700 000.00	1 698 852.11	0.03
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-144A 2.997%/VAR 17-14.12.23	515 000.00	537 662.34	0.01
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-144A 3.869%/VAR 18-12.01.29	1 300 000.00	1 457 371.98	0.03
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-144A-SUB 6.375%/VAR 19-PRP	1 403 000.00	1 562 591.25	0.03
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-144A 4.194%/VAR 20-01.04.31	4 071 000.00	4 716 346.69	0.08
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-144A 2.193%/VAR 20-05.06.26	1 449 000.00	1 506 370.96	0.03
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S 2.593%/VAR 19-11.09.25	2 375 000.00	2 506 074.95	0.05
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S-SUB 6.250%/VAR 14-PRP	1 600 000.00	1 749 984.00	0.03
USD DANSKE BANK A/S-144A 5.000%/VAR 20-12.01.23	800 000.00	831 309.75	0.02
USD DANSKE BANK AS-144A 3.244%/3M LIBOR+159.1BP 19-20.12.25	650 000.00	698 391.95	0.01
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 3.961%/VAR 19-26.11.25	1 700 000.00	1 861 687.93	0.03
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 2.222%/VAR 20-18.09.24	2 580 000.00	2 653 054.53	0.05
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY-SUB 3.729%/VAR 21-14.01.32	1 200 000.00	1 193 468.05	0.02
USD DISCOVER BANK-SUB 4.682%/VAR 18-09.08.28	2 158 000.00	2 305 175.60	0.04
USD DISCOVER FINANCIAL SERVICES-SUB 6.125%/VAR 20-PRP	2 573 000.00	2 897 506.76	0.05
USD ENTERPRISE PRODUCTS-SUB 5.375%/VAR 18-15.02.78	1 975 000.00	1 960 561.92	0.04
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3M LIBOR+127BP 17-28.03.22	1 500 000.00	1 490 625.00	0.03
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3M LIBOR+108BP 17-03.08.22	1 750 000.00	1 717 187.50	0.03
USD GENERAL MILLS INC 3M LIBOR+101BP 18-17.10.23	1 005 000.00	1 021 914.97	0.02
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3M LIBOR+111BP 17-26.04.22	2 300 000.00	2 305 613.40	0.04
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.905%/VAR 17-24.07.23	12 510 000.00	12 953 571.44	0.23
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.272%/VAR 17-29.09.25	5 035 000.00	5 481 860.58	0.10
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.814%/VAR 18-23.04.29	2 230 000.00	2 553 527.01	0.05
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 1.093%/VAR 20-09.12.26	4 400 000.00	4 412 956.77	0.08
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.876%/3M LIBOR+82.1BP 17-31.10.22	3 000 000.00	3 054 539.73	0.05
USD HSBC HOLDINGS PLC 1.589%/VAR 20-24.05.27	6 875 000.00	6 961 434.70	0.12
USD HSBC HOLDINGS PLC 2.633%/VAR 19-07.11.25	2 815 000.00	2 982 352.48	0.05
USD HSBC HOLDINGS PLC 2.099%/VAR 20-04.06.26	7 270 000.00	7 548 329.55	0.14
USD HSBC HOLDINGS PLC 2.013%/VAR 20-22.09.28	9 870 000.00	10 065 535.26	0.18
USD HSBC HOLDINGS PLC 3.803%/VAR 19-11.03.25	2 400 000.00	2 614 919.42	0.05
USD HSBC HOLDINGS PLC 3.973%/VAR 19-22.05.30	5 325 000.00	6 055 033.07	0.11
USD HSBC HOLDINGS PLC 4.041%/VAR 17-13.03.28	4 639 000.00	5 275 390.32	0.09
USD HSBC HOLDINGS PLC 4.583%/VAR 18-19.06.29	3 848 000.00	4 509 365.08	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 - US マルチ・クレジット

2021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 HSBC HOLDINGS PLC 4.292%/VAR 18-12.09.26	2 120 000.00	2 400 870.73	0.04
USD HSBC HOLDINGS PLC-SUB 6.875%/VAR 16-PRP	1 745 000.00	1 769 238.05	0.03
USD JP MORGAN CHASE & CO-SUB 7.900%/3M LIBOR+347BP 08-PRP	39 000.00	38 725.25	0.00
USD JP MORGAN CHASE & CO 4.005%/VAR 18-23.04.29	4 750 000.00	5 491 765.80	0.10
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.782%/VAR 17-01.02.28	6 635 000.00	7 594 196.47	0.14
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.220%/VAR 17-01.03.25	17 153 000.00	18 482 457.85	0.33
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.509%/3M LIBOR+94.5BP 18-23.01.29	7 270 000.00	8 141 139.83	0.15
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.559%/VAR 18-23.04.24	8 581 000.00	9 159 317.53	0.16
USD JPMORGAN CHASE & CO 4.452%/3M LIBOR+133BP 18-05.12.29	9 065 000.00	10 828 019.86	0.19
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.960%/3M LIBOR+124.5BP 19-29.01.27	1 000 000.00	1 137 912.12	0.02
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.207%/VAR 19-01.04.23	4 000 000.00	4 130 125.56	0.07
USD JPMORGAN CHASE & CO 2.739%/VAR 19-15.10.30	3 870 000.00	4 153 944.80	0.07
USD JPMORGAN CHASE & CO 2.301%/VAR 19-15.10.25	5 175 000.00	5 471 215.76	0.10
USD JPMORGAN CHASE & CO 2.083%/VAR 20-22.04.26	4 210 000.00	4 403 674.99	0.08
USD JPMORGAN CHASE & CO 2.522%/VAR 20-22.04.31	15 325 000.00	16 078 204.75	0.29
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 2.956%/VAR 20-13.05.31	1 065 000.00	1 138 684.16	0.02
USD KINDER MORGAN INC 3M LIBOR+128BP 17-15.01.23	2 725 000.00	2 767 362.47	0.05
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 2.438%/VAR 20-05.02.26	10 175 000.00	10 700 143.96	0.19
USD LLOYDS BANKING GROUP 2.858%/VAR 19-17.03.23	1 250 000.00	1 282 176.96	0.02
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 3.870%/VAR 20-09.07.25	6 810 000.00	7 483 057.64	0.13
USD MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 3.922%/VAR 18-11.09.24	9 385 000.00	10 157 854.74	0.18
USD MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 2.555%/VAR 19-13.09.25	2 840 000.00	2 993 700.80	0.05
USD MORGAN STANLEY 0.985%/VAR 20-10.12.26	4 400 000.00	4 389 587.75	0.08
USD MORGAN STANLEY 1.928%/VAR 21-28.04.32	2 000 000.00	1 994 752.38	0.04
USD MORGAN STANLEY 3.591%/VAR 17-22.07.28	5 180 000.00	5 859 308.41	0.11
USD MORGAN STANLEY 3.737%/VAR 18-24.04.24	5 750 000.00	6 153 267.17	0.11
USD MORGAN STANLEY 3M LIBOR+93BP 17-22.07.22	3 000 000.00	3 011 447.55	0.05
USD MORGAN STANLEY-SUB STEP DOWN 14-PRP	125 000.00	124 843.75	0.00
USD NATIONWIDE BUIL SOC-144A 3.766%/3M LIBOR+106.4BP 18-08.03.24	5 400 000.00	5 738 087.36	0.10
USD NATWEST GROUP PLC 2.359%/VAR 20-22.05.24	1 090 000.00	1 127 212.55	0.02
USD NATWEST GROUP PLC 3.498%/VAR 17-15.05.23	1 900 000.00	1 970 522.06	0.04
USD NATWEST GROUP PLC 3M LIBOR+147BP 17-15.05.23	1 070 000.00	1 084 551.06	0.02
USD NATWEST GROUP PLC 4.519%/VAR 18-25.06.24	510 000.00	553 811.64	0.01
USD NATWEST GROUP PLC 4.269%/VAR 19-22.03.25	3 470 000.00	3 822 316.45	0.07
USD NATWEST GROUP PLC 5.076%/VAR 18-27.01.30	1 220 000.00	1 469 660.95	0.03
USD NATWEST GROUP PLC-SUB 8.625%/VAR 16-PRP	2 900 000.00	3 001 500.00	0.05
USD NIPPON LIFE INSURANCE CO-144A-SUB 2.750%/VAR 21-21.01.51	3 050 000.00	3 040 545.00	0.05
USD PNC FINANCIAL SERVICES GRP-SUB 6.750%/3M LIBOR+367.8BP 11-PRP	205 000.00	208 331.25	0.00
USD PRINCIPAL FINANCIAL GROUP-SUB 4.700%/VAR 15-15.05.55	2 686 000.00	2 630 601.25	0.05
USD PRUDENTIAL FINANCIAL-SUB 5.200%/3M LIBOR+304BP 13-15.03.44	1 849 000.00	1 979 487.74	0.04
USD SANTANDER UK GRP HOLD PLC 4.796%/3M LIBOR+157BP 18-15.11.24	350 000.00	387 933.23	0.01
USD SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN-REG-S-SUB 5.625%/VAR 17-PRP	400 000.00	411 248.00	0.01
USD SL GREEN OPERATING PARTNERSHIP 3M LIBOR+98BP 18-16.08.21	620 000.00	618 493.31	0.01
USD STANDARD CHARTERED PLC-144A-SUB 6.409%/3M LIBOR+151BP 06-PRP	200 000.00	186 000.00	0.00
USD STANDARD CHARTERED PLC-144A 3.785%/VAR 19-21.05.25	2 086 000.00	2 269 241.29	0.04
USD STANDARD CHARTERED PLC-144A 1.456%/VAR 21-14.01.27	973 000.00	972 381.99	0.02
USD SWISS RE FINANCE LUXEMBOURG-144A-SUB 5.000%/VAR 19-02.04.49	3 024 000.00	3 500 280.00	0.06
USD TRUIST FINANCIAL CORP-SUB 4.950%/VAR 20-PRP	4 005 000.00	4 375 462.50	0.08
USD TRUIST FINANCIAL CORP-SUB 5.100%/VAR 20-PRP	2 031 000.00	2 290 561.80	0.04
USD UBS GROUP AG-144A 2.859%/VAR 17-15.08.23	1 960 000.00	2 031 442.47	0.04
USD WABTEC CORP STEP-UP/RATING LINKED 18-15.09.28	1 850 000.00	2 192 528.91	0.04
USD WABTEC CORP/DE STEP-UP/RATING LINKED 18-15.03.24	7 281 000.00	8 008 647.85	0.14
USD WELLS FARGO & CO 2.188%/VAR 20-30.04.26	14 794 000.00	15 482 953.03	0.28
USD WELLS FARGO & CO-SUB 3.900%/VAR 21-PRP	4 400 000.00	4 400 000.00	0.08
USD WESTPAC BANKING CORP-SUB 2.668%/VAR 20-15.11.35	3 800 000.00	3 834 352.00	0.07
米ドル合計		476 439 129.52	8.53
ノート、変動利付債合計		476 439 129.52	8.53

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

2021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			
USD			
USD ABU DHABI, EMIRATE OF-144A 2.5000% 20-16.04.25	1 001 000.00	1 066 065.00	0.02
USD AIR LEASE CORP 0.7000% 21-15.02.24	1 900 000.00	1 884 928.84	0.03
USD AIR LEASE CORP 2.3000% 20-01.02.25	2 950 000.00	3 044 824.62	0.05
USD AIR LEASE CORP 2.8750% 20-15.01.26	5 702 000.00	6 009 974.60	0.11
USD AMERICAN HONDA FINANCE CORP 2.3500% 20-08.01.27	1 860 000.00	2 001 061.88	0.04
USD AMERICAN HONDA FINANCE CORP 1.2000% 20-08.07.25	2 550 000.00	2 596 376.98	0.05
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 4.2000% 14-26.08.24	2 515 000.00	2 809 447.57	0.05
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 4.4500% 16-03.03.26	10 545 000.00	12 168 575.47	0.22
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 4.1830% 16-25.11.27	4 650 000.00	5 328 960.35	0.10
USD BANK OF NEW YORK MELLON CORP 2.8000% 16-04.05.26	2 000 000.00	2 185 564.00	0.04
USD BB&T CORP 2.5000% 19-01.08.24	2 950 000.00	3 144 004.62	0.06
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 3.3750% 18-12.05.21	689 000.00	694 456.62	0.01
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.2190% 15-09.01.22	1 645 000.00	1 658 365.62	0.03
USD GENERAL ELECTRIC CO 6.7500% 02-15.03.32	265 000.00	367 101.36	0.01
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 4.0000% 14-03.03.24	3 600 000.00	3 962 520.54	0.07
USD JOHN DEERE CAPITAL CORP 2.8000% 19-18.07.29	2 900 000.00	3 198 053.59	0.06
USD JOHN DEERE CAPITAL CORP 2.4500% 20-09.01.30	3 300 000.00	3 570 859.87	0.06
USD KEYCORP 2.2500% 20-06.04.27	3 110 000.00	3 314 797.82	0.06
USD MCDONALD ' S CORP 1.4500% 20-01.09.25	2 400 000.00	2 478 790.05	0.04
USD MCDONALD ' S CORP 3.3500% 18-01.04.23	2 400 000.00	2 547 096.00	0.05
USD MORGAN STANLEY 3.1250% 18-23.01.23	4 000 000.00	4 216 972.80	0.07
USD MORGAN STANLEY 3.1250% 16-27.07.26	2 200 000.00	2 435 498.30	0.04
USD MORGAN STANLEY 3.8750% 16-27.01.26	10 725 000.00	12 198 066.74	0.22
USD MORGAN STANLEY 4.0000% 15-23.07.25	1 635 000.00	1 854 099.38	0.03
USD MORGAN STANLEY-SUB 3.9500% 15-23.04.27	4 375 000.00	5 011 453.12	0.09
USD MORGAN STANLEY-SUB 4.3500% 14-08.09.26	2 435 000.00	2 834 363.18	0.05
USD MORGAN STANLEY-SUB 4.1000% 13-22.05.23	6 470 000.00	6 984 743.62	0.13
USD PETRONAS CAPITAL LTD-144A 3.5000% 20-21.04.30	992 000.00	1 115 305.60	0.02
USD PNC BANK NATIONAL ASSOCIATION 2.1500% 16-29.04.21	3 000 000.00	3 009 710.01	0.05
USD PUBLIC SERVICE ELECTRIC & GAS CO 3.0000% 17-15.05.27	455 000.00	502 908.53	0.01
USD PUBLIC SERVICE ELECTRIC & GAS CO 3.7000% 18-01.05.28	835 000.00	963 003.14	0.02
USD PUBLIC SERVICE ELECTRIC & GAS CO 3.6500% 18-01.09.28	1 530 000.00	1 760 085.00	0.03
USD PUBLIC SERVICE ELECTRIC & GAS CO 3.2000% 19-15.05.29	820 000.00	923 350.99	0.02
USD ROYAL BANK OF CANADA 2.5500% 19-16.07.24	2 985 000.00	3 189 721.33	0.06
USD ROYAL BANK OF CANADA 1.1500% 20-10.06.25	2 330 000.00	2 365 732.85	0.04
USD RYDER SYSTEM INC 2.5000% 17-01.09.22	1 235 000.00	1 272 743.91	0.02
USD RYDER SYSTEM INC 3.6500% 19-18.03.24	6 165 000.00	6 723 537.96	0.12
USD RYDER SYSTEM INC 4.6250% 20-01.06.25	545 000.00	628 296.64	0.01
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-144A 3.2500% 16-26.10.26	1 204 000.00	1 321 390.00	0.02
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-144A 3.2500% 20-22.10.30	1 192 000.00	1 296 300.00	0.02
USD SHINHAN FIN GROUP CO LTD-144A 1.3500% 20-10.01.26	2 040 000.00	2 065 071.60	0.04
USD SOCIETE GENERALE SA-144A 3.8750% 19-28.03.24	1 665 000.00	1 815 476.49	0.03
USD TENCENT HOLDINGS LTD-144A 3.2800% 19-11.04.24	5 800 000.00	6 172 940.00	0.11
USD TENCENT HOLDINGS LTD-144A 3.9750% 19-11.04.29	7 260 000.00	8 181 112.49	0.15
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.5750% 19-11.04.26	480 000.00	525 958.37	0.01
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.9750% 19-11.04.29	1 845 000.00	2 079 084.37	0.04
USD TORONTO-DOMINION BANK 3.2500% 19-11.03.24	7 950 000.00	8 628 031.01	0.15
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 3.4000% 18-14.04.25	3 460 000.00	3 840 422.53	0.07
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 1.8000% 20-13.02.25	3 750 000.00	3 913 859.66	0.07
USD WELLS FARGO & CO 3.7500% 19-24.01.24	4 795 000.00	5 216 427.03	0.09
米ドル合計		167 077 492.05	2.99
中期債券、固定利付債合計		167 077 492.05	2.99

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

2021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、変動利付債			
USD			
USD BANCO DE CREDITO DEL PERU-144A-SUB 3.125%/VAR 20-01.07.30	2 900 000.00	2 972 558.00	0.05
USD BANK OF AMERICA CORP 3.124%/VAR 17-20.01.23	541 000.00	555 079.55	0.01
USD BANK OF AMERICA CORP 3.824%/VAR 17-20.01.28	4 230 000.00	4 821 592.79	0.09
USD BANK OF AMERICA CORP 2.881%/VAR 17-24.04.23	1 795 000.00	1 849 153.78	0.03
USD BANK OF AMERICA CORP 3.593%/VAR 17-21.07.28	12 480 000.00	14 094 151.72	0.25
USD BANK OF AMERICA CORP 3M LIBOR+79BP 18-05.03.24	3 000 000.00	3 029 910.00	0.05
USD BANK OF AMERICA CORP 3.970%/3M LIBOR+107BP 18-05.03.29	1 000 000.00	1 151 154.67	0.02
USD BANK OF AMERICA CORP 3.974%/VAR 19-07.02.30	3 300 000.00	3 816 804.18	0.07
USD BANK OF AMERICA CORP 3.458%/3M LIBOR+97BP 19-15.03.25	7 270 000.00	7 890 537.54	0.14
USD BANK OF AMERICA CORP 3.559%/VAR 19-23.04.27	8 410 000.00	9 432 047.71	0.17
USD BANK OF AMERICA CORP 3.194%/VAR 19-23.07.30	2 190 000.00	2 412 249.13	0.04
USD BANK OF AMERICA CORP 2.456%/VAR 19-22.10.25	5 900 000.00	6 250 784.32	0.11
USD BANK OF AMERICA CORP 2.884%/VAR 19-22.10.30	5 350 000.00	5 748 439.65	0.10
USD BANK OF AMERICA CORP 2.496%/3M LIBOR+99BP 20-13.02.31	9 505 000.00	9 910 677.97	0.18
USD BANK OF AMERICA CORP 1.319%/VAR 20-19.06.23	8 005 000.00	8 102 402.28	0.15
USD BANK OF NEW YORK MELLON CORP 2.661%/VAR 17-16.05.23	1 360 000.00	1 400 899.47	0.03
USD GENERAL ELECTRIC CO 3M LIBOR+38BP 06-05.05.26	1 095 000.00	1 066 575.05	0.02
USD GENERAL ELECTRIC CO 3M LIBOR+48BP 06-15.08.36	10 141 000.00	8 072 067.56	0.14
USD MORGAN STANLEY 0.864%/VAR 20-21.10.25	2 075 000.00	2 083 804.91	0.04
USD MORGAN STANLEY 2.188%/VAR 20-28.04.26	9 467 000.00	9 943 964.41	0.18
USD MORGAN STANLEY 2.699%/VAR 20-22.01.31	6 850 000.00	7 281 472.66	0.13
USD MORGAN STANLEY 2.720%/VAR 19-22.07.25	5 965 000.00	6 365 762.94	0.11
USD MORGAN STANLEY 3.622%/VAR 20-01.04.31	3 213 000.00	3 658 391.01	0.07
USD MORGAN STANLEY 4.431%/VAR 19-23.01.30	935 000.00	1 118 463.43	0.02
USD NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-144A 3.622%/VAR 19-26.04.23	3 105 000.00	3 218 574.84	0.06
USD WELLS FARGO & CO 1.654%/VAR 20-02.06.24	7 070 000.00	7 245 631.60	0.13
USD WELLS FARGO & CO 2.393%/VAR 20-02.06.28	13 376 000.00	14 115 773.46	0.25
USD WELLS FARGO & CO 2.406%/VAR 19-30.10.25	3 050 000.00	3 222 585.16	0.06
USD WELLS FARGO & CO 2.572%/VAR 20-11.02.31	6 550 000.00	6 857 493.43	0.12
USD WELLS FARGO & CO 2.879%/VAR 19-30.10.30	12 985 000.00	13 951 267.61	0.25
USD WELLS FARGO & CO 3.196%/3M LIBOR+117BP 19-17.06.27	14 495 000.00	15 931 646.42	0.29
USD WELLS FARGO & CO 3.584%/VAR 17-22.05.28	9 850 000.00	11 081 970.33	0.20
米ドル合計		198 653 887.58	3.56
中期債券、変動利付債合計		198 653 887.58	3.56
債券、固定利付債			
EUR			
EUR MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 2.25000% 19-07.03.39	200 000.00	297 670.79	0.01
EUR THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 0.50000% 19-01.03.28	1 100 000.00	1 361 139.94	0.02
ユーロ合計		1 658 810.73	0.03
USD			
USD ABU DHABI ,GOVERNMENT OF-144A 2.50000% 19-30.09.29	2 250 000.00	2 393 437.50	0.04
USD ACE CAPITAL TRUST II-SUB 9.70000% 00-01.04.30	779 000.00	1 202 605.46	0.02
USD ARES CAPITAL CORP 3.50000% 17-10.02.23	4 165 000.00	4 375 749.71	0.08
USD BAIDU INC 3.87500% 18-29.09.23	3 000 000.00	3 212 812.50	0.06
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 8.05000% 97-15.06.27	281 000.00	372 982.50	0.01
USD BRANCH BANKING & TRUST CO-SUB 3.80000% 14-30.10.26	6 200 000.00	7 126 694.96	0.13
USD BURLINGTON NORTHERN SANTA FE CORP 3.00000% 15-01.04.25	2 000 000.00	2 181 015.56	0.04
USD BURLINGTON NORTHERN SANTA FE CORP 7.00000% 95-15.12.25	2 000 000.00	2 589 285.40	0.05
USD CITIGROUP INC-SUB 4.30000% 14-20.11.26	2 965 000.00	3 413 099.86	0.06
USD CK HUTCHISON INTERNATIONAL LTD-REG-S 3.25000% 19-11.04.24	2 745 000.00	2 942 694.90	0.05
USD COMCAST CORP 3.15000% 17-15.02.28	2 285 000.00	2 556 055.31	0.05
USD COMCAST CORP 3.37500% 14-15.02.25	5 940 000.00	6 523 778.51	0.12

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

2021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 COMMONSPIRIT HEALTH 2.76000% 19-01.10.24	5 195 000.00	5 575 283.36	0.10
USD COMMONWEALTH EDISON CO 3.70000% 18-15.08.28	520 000.00	606 983.88	0.01
USD CONSOLIDATED EDISON CO OF NEW YORK INC 4.00000% 18-01.12.28	2 580 000.00	3 033 807.32	0.05
USD CVS CAREMARK CORP 6.25000% 07-01.06.27	1 100 000.00	1 397 638.47	0.02
USD DANONE-REG-S 2.58900% 16-02.11.23	4 740 000.00	4 978 666.01	0.09
USD DISCOVER BANK 3.45000% 16-27.07.26	3 080 000.00	3 431 278.22	0.06
USD DISCOVER BANK 4.25000% 14-13.03.26	500 000.00	575 142.27	0.01
USD DTE ENERGY CO 3.80000% 17-15.03.27	4 300 000.00	4 944 216.03	0.09
USD DUKE ENERGY FLORIDA LLC 3.80000% 18-15.07.28	1 575 000.00	1 825 232.47	0.03
USD ENERGY TRANSFER OPERATING LP 4.25000% 19-15.03.23	1 750 000.00	1 854 594.70	0.03
USD ENERGY TRANSFER OPERATING LP 5.50000% 19-01.06.27	3 110 000.00	3 674 117.55	0.07
USD ENERGY TRANSFER PARTNERS LP 4.20000% 17-15.04.27	790 000.00	874 837.31	0.02
USD ENTERGY ARKANSAS LLC 3.05000% 13-01.06.23	1 035 000.00	1 091 160.35	0.02
USD ENTERGY LOUISIANA LLC 3.25000% 16-01.04.28	2 875 000.00	3 216 809.58	0.06
USD ENTERGY LOUISIANA LLC 4.00000% 18-15.03.33	465 000.00	567 457.55	0.01
USD ENTERGY TEXAS INC 4.00000% 19-30.03.29	3 895 000.00	4 526 052.36	0.08
USD EQUIFAX INC 3.95000% 18-15.06.23	900 000.00	970 793.62	0.02
USD EVERSOURCE ENERGY 2.75000% 17-15.03.22	1 270 000.00	1 302 286.36	0.02
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 3.45000% 17-14.01.22	2 145 000.00	2 199 085.89	0.04
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 4.35000% 17-17.01.27	2 035 000.00	2 330 814.42	0.04
USD HEATHROW FUNDING LTD-144A 4.87500% 11-15.07.21	2 183 000.00	2 223 586.03	0.04
USD INTERSTATE POWER & LIGHT CO 3.25000% 14-01.12.24	2 225 000.00	2 425 323.42	0.04
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 5.30000% 15-PRP	411 000.00	411 809.67	0.01
USD KROGER CO 3.70000% 17-01.08.27	925 000.00	1 067 402.11	0.02
USD MARB BONDCO PLC-144A-3.95000% 21-29.01.31	7 625 000.00	7 584 968.75	0.14
USD MIZUHO FINANCE GROUP CAYMAN 3-144A-SUB 4.60000% 14-27.03.24	7 657 000.00	8 448 935.49	0.15
USD NEXTERA ENERGY 2.75000% 20-01.05.25	770 000.00	829 412.15	0.01
USD PACIFIC GAS & ELECTRIC CO 1.75000% 20-16.06.22	8 365 000.00	8 392 437.20	0.15
USD PERU, REPUBLIC OF 2.39200% 20-23.01.26	288 000.00	305 100.00	0.01
USD PERU, REPUBLIC OF 2.78300% 20-23.01.31	1 050 000.00	1 130 390.62	0.02
USD PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP 4.50000% 16-15.12.26	2 249 000.00	2 524 506.48	0.04
USD REYNOLDS AMERICAN INC 4.45000% 15-12.06.25	2 275 000.00	2 575 061.39	0.05
USD SABIC CAPITAL II BV-REG-S 4.00000% 18-10.10.23	1 650 000.00	1 787 671.88	0.03
USD SOUTHERN CALIFORNIA EDISON 3.40000% 18-01.06.23	1 069 000.00	1 135 599.66	0.02
USD SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 3.70000% 18-01.08.25	1 048 000.00	1 165 034.05	0.02
USD SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 2.25000% 20-01.06.30	2 300 000.00	2 357 632.87	0.04
USD SOUTHWESTERN PUBLIC SERVICE CO 3.30000% 14-15.06.24	2 500 000.00	2 688 560.00	0.05
USD TOLEDO HOSPITAL 5.32500% 18-15.11.28	4 490 000.00	5 324 758.18	0.09
USD TOLEDO HOSPITAL 5.75000% 18-15.11.38	2 265 000.00	2 743 327.91	0.05
USD TOLEDO HOSPITAL 6.01500% 18-15.11.48	2 900 000.00	3 772 889.01	0.07
USD VIACOMCBS INC 5.85000% 13-01.09.43	1 000 000.00	1 359 117.11	0.02
USD VODAFONE GROUP PLC 3.75000% 18-16.01.24	3 635 000.00	3 967 331.69	0.07
USD WESTAR ENERGY INC 2.55000% 16-01.07.26	2 500 000.00	2 698 482.58	0.05
USD WILLIAMS COS INC/THE 3.60000% 15-15.03.22	3 276 000.00	3 373 787.75	0.06
米ドル合計		158 160 595.89	2.83
債券、固定利付債合計		159 819 406.62	2.86
債券、変動利付債			
USD AMERICAN EXPRESS CO-SUB 4.900%/VAR 15-PRP	1 312 000.00	1 298 880.00	0.02
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 6.25000%/VAR 14-PRP	2 005 000.00	2 219 098.07	0.04
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 6.500%/VAR 14-PRP	572 000.00	651 050.40	0.01
USD BANK OF NEW YORK MELLON CORP-SUB 4.950%/VAR 15-PRP	889 000.00	883 443.75	0.02
USD BARCLAYS BANK PLC-144A-SUB 6.860%/6M LIBOR+173BP 02-PRP	188 000.00	265 315.00	0.01
USD BP CAPITAL MARKETS PLC-SUB 4.375%/VAR 20-PRP	5 450 000.00	5 804 468.00	0.10
USD CAPITAL ONE FINANCIAL CORP-SUB 5.550%/VAR 15-PRP	35 000.00	34 488.03	0.00
USD CITIGROUP INC-SUB 4.700%/VAR 20-PRP	963 000.00	984 667.50	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 - US マルチ・クレジット

2021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 CITIGROUP INC-SUB 5.950%/3M LIBOR+406.8BP 12-PRP	1 482 000.00	1 560 526.36	0.03
USD CLOVERIE PLC VIA SWISS RE-REG-S-SUB 4.500%/VAR 14-11.09.44	1 200 000.00	1 285 296.00	0.02
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S-SUB 7.500%/VAR 18-PRP	891 000.00	969 835.68	0.02
USD DEMETER INVESTMENTS BV-REG-S-SUB 5.125%/VAR 18-01.06.48	3 030 000.00	3 514 800.00	0.06
USD DEUTSCHE TELEKOM INTL FIN 8.250%/RATING LINKED 00-15.06.30	4 450 000.00	6 939 619.07	0.12
USD DNB BANK ASA-REG-S-SUB 6.500%/VAR 16-PRP	3 859 000.00	4 023 007.50	0.07
USD ENERGY TRANSFER OPERATING LP-SUB 6.750%/VAR 20-PRP	1 205 000.00	1 113 263.35	0.02
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC-SUB 5.375%/3M LIBOR+392.2BP 15-PRP	810 000.00	806 193.00	0.02
USD ING GROEP NV-REG-S-SUB 6.875%/VAR 16-PRP	1 715 000.00	1 785 743.75	0.03
USD JP MORGAN CHASE & CO 2.005%/VAR 20-13.03.26	6 320 000.00	6 591 670.95	0.12
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 5.000%/VAR 14-PRP	381 000.00	377 545.30	0.01
USD LLOYDS BANKING GROUP-144A-SUB 6.657%/3M LIBOR+127BP 09-PRP	672 000.00	865 200.00	0.02
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC-SUB 7.500%/VAR 14-PRP	1 200 000.00	1 334 400.00	0.02
USD METLIFE INC-SUB 5.250%/3M LIBOR+357.5BP 15-PRP	777 000.00	777 000.00	0.01
USD MORGAN STANLEY-SUB 5.500%/3M LIBOR+3.81BP 15-PRP	660 000.00	660 330.00	0.01
USD NATWEST GROUP PLC-SUB 7.640%/VAR 07-PRP	3 100 000.00	3 045 750.00	0.06
USD QBE INSURANCE GROUP LTD-REG-S-SUB 6.750%/VAR 14-02.12.44	2 810 000.00	3 131 632.60	0.06
USD STANDARD CHARTERED PLC-144A-SUB 7.500%/VAR 16-PRP	1 690 000.00	1 773 486.00	0.03
USD SVENSKA HANDELSBANKEN AB-REG-S-SUB 5.250%/VAR 15-PRP	2 465 000.00	2 470 043.39	0.04
USD US BANCORP-SUB 5.125%/VAR 15-PRP	442 000.00	441 558.00	0.01
米ドル合計		55 608 311.70	1.00
債券、変動利付債合計		55 608 311.70	1.00
財務省証券 (T-note)、固定利付債			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 20-15.02.30	2 450 000.00	2 555 847.64	0.04
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.37500% 31.03.20-31.03.22	79 520 000.00	79 780 925.00	1.43
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.62500% 20-15.08.30	16 407 000.00	15 760 974.37	0.28
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.25000% 20-30.09.25	12 281 000.00	12 202 804.54	0.22
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.87500% 20-15.11.30	7 800 000.00	7 653 750.00	0.14
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.12500% 20-30.11.22	4 380 000.00	4 381 368.75	0.08
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.37500% 20-31.12.25	4 480 000.00	4 470 200.00	0.08
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.12500% 20-31.12.22	2 670 000.00	2 670 521.48	0.05
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.12500% 21-31.01.23	325 000.00	325 076.17	0.00
米ドル合計		129 801 467.95	2.32
財務省証券 (T-note)、固定利付債合計		129 801 467.95	2.32
地方債、固定利付			
USD OREGON, STATE OF 5.76200% 03-01.06.23	3 000 000.00	1 734 489.29	0.03
米ドル合計		1 734 489.29	0.03
地方債、固定利付合計		1 734 489.29	0.03
転換社債型新株予約権付社債、変動利付			
USD BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA-SUB COCO 6.500%/VAR 19-PRP	800 000.00	845 336.00	0.02
USD BANK OF MONTREAL-SUB 4.338%/VAR 18-05.10.28	8 910 000.00	9 732 036.60	0.17
米ドル合計		10 577 372.60	0.19
転換社債型新株予約権付社債、変動利付合計		10 577 372.60	0.19
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		4 125 178 071.94	73.85

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

2021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 (%)
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			
USD			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 13.08.20-11.02.21	11 710 000.00	11 709 861.70	0.21
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 20.08.20-18.02.21	3 900 000.00	3 899 930.93	0.07
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 03.09.20-04.03.21	500 000.00	499 978.47	0.01
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 17.09.20-18.03.21	1 400 000.00	1 399 897.18	0.02
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 01.10.20-01.04.21	25 815 000.00	25 812 620.12	0.46
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 08.09.20-09.02.21	2 100 000.00	2 099 979.00	0.04
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 06.10.20-09.03.21	2 500 000.00	2 499 868.75	0.04
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 27.02.20-25.02.21	300 000.00	299 991.00	0.01
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 22.09.20-23.02.21	5 395 000.00	5 394 859.89	0.10
米ドル合計		53 616 987.04	0.96
財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン合計		53 616 987.04	0.96
アセット・バック証券、変動利付			
USD			
USD AGL CORE CLO 4 LTD-144A 3M LIBOR+221BP 20-20.04.28	4 500 000.00	4 511 092.05	0.08
USD CIFC FUNDING LTD-144A 3M LIBOR+105BP 18-24.04.30	1 500 000.00	1 501 060.20	0.03
USD OCEAN TRAILS CLO VI-144A 3M LIBOR+115BP 19-15.07.28	8 000 000.00	5 728 084.03	0.10
USD OCEAN TRAILS CLO-144A 3M LIBOR+140BP 19-17.04.30	3 250 000.00	3 249 994.80	0.06
USD ROMARK CLO II-144A 3M LIBOR+117.5BP 18-25.07.31	5 500 000.00	5 499 955.45	0.10
米ドル合計		20 490 186.53	0.37
アセット・バック証券、変動利付合計		20 490 186.53	0.37
モーゲージ・バック証券、固定利付			
USD			
USD CD 2017-CD4 MORTGAGE TRUST-SUB 3.24820% 17-01.05.50	5 000 000.00	5 557 993.50	0.10
USD MORGAN STANLEY BANK OF AMERICA ML 2.84000% 16-01.11.49	2 500 000.00	2 687 529.50	0.05
USD MORGAN STANLEY BK OF AMERICA MERRI TRT 3.29500% 17-01.05.50	5 000 000.00	5 447 249.50	0.10
USD MORGAN STANLEY CAPITAL I TRUST 3.15300% 17-01.06.50	2 800 000.00	2 974 561.52	0.05
米ドル合計		16 667 334.02	0.30
モーゲージ・バック証券、固定利付合計		16 667 334.02	0.30
モーゲージ・バック証券、変動利付			
USD			
USD AMERICAN HOME MORTGAGE INVESTMENT 6M LIBOR+200BP 05-01.06.45	29 470 000.00	1 142 116.19	0.02
USD BANC OF AMERICA FUND TRUST 1M LIBOR+30BP 05-20.05.35	16 952 000.00	493 092.32	0.01
USD WAMU MORTGAGE PASS-TH TRUST 1M LIBOR+27BP 05-25.12.45	12 000 000.00	950 442.18	0.01
米ドル合計		2 585 650.69	0.04
モーゲージ・バック証券、変動利付合計		2 585 650.69	0.04
ノート、固定利付債			
USD			
USD 7-ELEVEN INC-144A 0.95000% 21-10.02.26	6 535 000.00	6 537 632.16	0.12
USD 7-ELEVEN INC-144A 1.30000% 21-10.02.28	4 700 000.00	4 679 574.13	0.08
USD ABBVIE INC 4.55000% 20-15.03.35	2 000 000.00	2 470 415.96	0.04
USD ADVANCE AUTO PARTS INC 3.90000% 20-15.04.30	4 661 000.00	5 323 103.35	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 - US マルチ・クレジット

2021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	ADVOCATE HEALTH & HOSPITALS CORP 2.21100% 20-15.06.30	2 000 000.00	2 055 718.98	0.04
USD	AEP TRANSMISSION CO LLC 3.10000% 17-01.12.26	150 000.00	167 409.95	0.00
USD	AIRCASTLE LTD 5.50000% 15-15.02.22	6 795 000.00	7 115 343.00	0.13
USD	AIRCASTLE LTD-144A 5.25000% 20-11.08.25	1 960 000.00	2 176 011.60	0.04
USD	AKER BP ASA-144A 3.00000% 20-15.01.25	2 165 000.00	2 219 997.22	0.04
USD	ALBERTSONS COS LLC / SAFEWAY INC-144A 3.50000% 20-15.03.29	4 655 000.00	4 596 812.50	0.08
USD	ALCON FINANCE CORP-144A 2.75000% 19-23.09.26	975 000.00	1 065 792.65	0.02
USD	ALCON FINANCE CORP-144A 3.00000% 19-23.09.29	2 500 000.00	2 713 644.13	0.05
USD	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC 4.90000% 20-15.12.30	1 575 000.00	1 974 214.04	0.04
USD	ALLIANT ENERGY FINANCE LLC-144A 3.75000% 18-15.06.23	3 900 000.00	4 177 147.96	0.07
USD	AMERICAN CAMPUS COMMUN OPER PARTN 3.75000% 13-15.04.23	2 000 000.00	2 121 415.44	0.04
USD	AMERICAN TOWER CORP 3.12500% 16-15.01.27	2 599 000.00	2 840 428.88	0.05
USD	ANTERO RESOURCES FIN CORP 5.12500% 14-01.12.22	21 000.00	21 004.20	0.00
USD	ARC PROPERTIES OPERATING PSHIP LP/CLARK 4.60000% 14-06.02.24	1 975 000.00	2 181 215.01	0.04
USD	ARCH CAPITAL FINANCE LLC 4.01100% 16-15.12.26	1 300 000.00	1 503 275.71	0.03
USD	ARES CAPITAL CORP 3.62500% 16-19.01.22	5 595 000.00	5 740 943.01	0.10
USD	ASB BANK LTD-144A 3.12500% 19-23.05.24	5 985 000.00	6 490 811.21	0.12
USD	AT&T INC-144A 3.50000% 20-15.09.53	2 275 000.00	2 191 972.38	0.04
USD	ATHENE GLOBAL FUNDING-144A 2.95000% 19-12.11.26	7 500 000.00	8 090 852.62	0.14
USD	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK-144A-SUB 4.50000% 14-19.03.24	1 593 000.00	1 758 621.98	0.03
USD	AVIATION CAPITAL GROUP-144A 2.87500% 17-20.01.22	4 350 000.00	4 429 150.82	0.08
USD	AVIATION CAPITAL GROUP-144A 3.87500% 18-01.05.23	2 515 000.00	2 646 253.12	0.05
USD	AVIATION CAPITAL GROUP-144A 1.95000% 21-30.01.26	1 339 000.00	1 328 028.98	0.02
USD	BACARDI LTD-144A 4.45000% 18-15.05.25	1 700 000.00	1 930 231.00	0.03
USD	BACARDI LTD-144A 4.70000% 18-15.05.28	2 390 000.00	2 835 133.91	0.05
USD	BANK OF NEW ZEALAND-144A 3.50000% 19-20.02.24	4 900 000.00	5 338 853.12	0.10
USD	BAYER US FINANCE II LLC-144A 3.37500% 18-15.07.24	50 000.00	54 238.49	0.00
USD	BAYER US FINANCE II LLC-144A 4.20000% 18-15.07.34	650 000.00	740 108.23	0.01
USD	BERKSHIRE HATHAWAY ENERGY CO-144A 3.70000% 20-15.07.30	2 135 000.00	2 480 163.87	0.04
USD	BERRY GLOBAL INC-REG-S 4.87500% 19-15.07.26	1 250 000.00	1 338 125.00	0.02
USD	BNP PARIBAS SA-144A 3.37500% 18-09.01.25	1 720 000.00	1 873 786.32	0.03
USD	BNP PARIBAS-144A 4.40000% 18-14.08.28	695 000.00	819 239.34	0.01
USD	BOSTON PROPERTIES LP 3.80000% 13-01.02.24	904 000.00	981 079.51	0.02
USD	BPCE SA-144A 2.37500% 20-14.01.25	1 250 000.00	1 315 847.61	0.02
USD	BPCE SA-144A 4.00000% 18-12.09.23	490 000.00	532 167.40	0.01
USD	BPCE SA-144A-SUB 5.70000% 13-22.10.23	1 996 000.00	2 253 224.52	0.04
USD	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 3.25000% 20-20.02.23	5 850 000.00	6 178 893.08	0.11
USD	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 3.90000% 20-20.02.28	4 395 000.00	5 154 949.29	0.09
USD	BRIXMOR OPERATING PARTNERSHIP LP 3.85000% 15-01.02.25	2 000 000.00	2 189 039.34	0.04
USD	BROADCOM INC 3.15000% 20-15.11.25	1 650 000.00	1 788 969.53	0.03
USD	BROADCOM INC 3.45900% 20-15.09.26	9 688 000.00	10 665 018.71	0.19
USD	BROADCOM INC 3.62500% 20-15.10.24	850 000.00	930 981.39	0.02
USD	BROADCOM INC 4.11000% 20-15.09.28	5 206 000.00	5 876 722.93	0.11
USD	CABLE ONE INC-144A 4.00000% 20-15.11.30	791 000.00	811 550.18	0.01
USD	CAESARS ENTERTAINMENT INC-144A 6.25000% 20-01.07.25	298 000.00	314 066.67	0.01
USD	CARLYLE HOLDINGS FINANCE LLC-REG-S 3.87500% 13-01.02.23	777 000.00	825 447.10	0.01
USD	CARRIER GLOBAL CORP 2.24200% 20-15.02.25	3 605 000.00	3 790 046.45	0.07
USD	CARRIER GLOBAL CORP 2.72200% 20-15.02.30	3 150 000.00	3 336 059.22	0.06
USD	CATALENT PHARMA SOLUTIONS INC-144A 4.87500% 17-15.01.26	304 000.00	310 460.00	0.01
USD	CBS CORP 3.70000% 18-01.06.28	2 329 000.00	2 640 423.37	0.05
USD	CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 4.00000% 17-01.03.23	788 000.00	796 140.04	0.01
USD	CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.37500% 19-01.06.29	314 000.00	340 630.34	0.01
USD	CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 4.50000% 20-15.08.30	2 798 000.00	2 946 629.76	0.05
USD	CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-REG-S 4.50000% 20-15.08.30	1 585 000.00	1 669 195.20	0.03
USD	CCO LLC/CAPITAL 3.75000% 17-15.02.28	2 265 000.00	2 511 089.58	0.05
USD	CCO LLC/CAPITAL 5.37500% 17-01.05.47	700 000.00	850 760.54	0.02
USD	CELULOSA ARAUCO Y CONSTITUCION SA 4.50000% 14-01.08.24	650 000.00	712 156.25	0.01
USD	CELULOSA ARAUCO Y CONSTITUCION SA-144A 4.20000% 19-29.01.30	511 000.00	574 875.00	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

2021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 CEMEX SAB DE CV-144A 3.87500% 21-11.07.31	1 585 000.00	1 585 000.00	0.03
USD CENTENE CORP 3.37500% 20-15.02.30	520 000.00	544 700.00	0.01
USD CENTENE CORP 4.25000% 20-15.12.27	784 000.00	829 381.84	0.01
USD CF INDUSTRIES INC-144A 4.50000% 16-01.12.26	670 000.00	796 500.16	0.01
USD CHENIERE CORPUS CHRISTI HLDGS LLC 5.87500% 17-31.03.25	3 685 000.00	4 269 337.90	0.08
USD CHENIERE ENERGY INC-144A 4.62500% 20-15.10.28	850 000.00	889 312.50	0.02
USD CHENIERE ENERGY PARTNERS LP 5.25000% 18-01.10.25	550 000.00	564 437.50	0.01
USD CHENIERE ENERGY PARTNERS LP 4.50000% 20-01.10.29	1 890 000.00	2 031 750.00	0.04
USD CHEVRON USA INC 3.90000% 21-15.11.24	2 755 000.00	3 075 682.30	0.06
USD CHURCHILL DOWNS INC-144A 5.50000% 19-01.04.27	897 000.00	938 486.25	0.02
USD CIGNA CORP 3.00000% 20-15.07.23	2 106 000.00	2 230 102.37	0.04
USD CIGNA CORP 3.05000% 20-15.10.27	2 625 000.00	2 918 007.30	0.05
USD CIGNA CORP 3.25000% 20-15.04.25	4 550 000.00	4 971 696.00	0.09
USD CIGNA CORP 3.40000% 20-01.03.27	710 000.00	798 866.16	0.01
USD CIGNA CORP 3.50000% 20-15.06.24	1 243 000.00	1 354 232.65	0.02
USD CIGNA CORP 4.50000% 20-25.02.26	2 470 000.00	2 873 753.02	0.05
USD CITIGROUP INC-SUB 4.60000% 16-09.03.26	4 265 000.00	4 947 673.73	0.09
USD CLEAN HARBORS INC-144A 5.12500% 19-15.07.29	528 000.00	572 880.00	0.01
USD CLECO CORPORATE HOLDINGS LLC 3.74300% 17-01.05.26	2 400 000.00	2 670 934.76	0.05
USD CLEVELAND ELECTRIC ILLUMINATING CO-144A 3.50000% 17-01.04.28	530 000.00	561 627.00	0.01
USD COMCAST CORP 3.37500% 15-15.08.25	4 115 000.00	4 568 249.67	0.08
USD CONTINENTAL AIRLINES 4.00000% 12-29.10.24	2 170 000.00	1 454 297.46	0.03
USD COOPERATIEVE RADOBANK UA-144A 1.00400% 20-24.09.26	4 000 000.00	4 015 437.56	0.07
USD CORP FINANCIERA DE DESARROLLO SA-144A 2.40000% 20-28.09.27	1 194 000.00	1 209 671.25	0.02
USD COSTCO WHOLESALE CORP 1.60000% 20-20.04.30	5 250 000.00	5 280 362.22	0.09
USD COX COMMUNICATION INC-144A 3.35000% 16-15.09.26	1 250 000.00	1 390 709.60	0.02
USD COX COMMUNICATIONS INC-144A 3.15000% 17-15.08.24	743 000.00	803 186.56	0.01
USD COX COMMUNICATIONS INC-144A 3.50000% 17-15.08.27	4 750 000.00	5 348 274.28	0.10
USD CSC HOLDINGS INC-144A 5.37500% 18-01.02.28	300 000.00	318 207.00	0.01
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 5.50000% 18-15.05.26	300 000.00	311 163.00	0.01
USD CYRUSONE LP / CYRUSONE FIN CORP 2.90000% 19-15.11.24	2 145 000.00	2 285 905.05	0.04
USD CYRUSONE LP/CYRUSONE FINANCE 2.15000% 20-01.11.30	1 210 000.00	1 166 185.90	0.02
USD DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC-144A 3.70000% 18-04.05.23	3 215 000.00	3 439 416.77	0.06
USD DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC-144A 3.65000% 19-22.02.24	5 879 000.00	6 398 440.46	0.11
USD DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA-144A 2.55000% 19-15.08.22	2 900 000.00	2 993 087.25	0.05
USD DAVITA INC-REG-S 3.75000% 20-15.02.31	1 525 000.00	1 512 609.38	0.03
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP-144A 5.85000% 20-15.07.25	2 500 000.00	2 969 298.40	0.05
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP-144A 6.02000% 16-15.06.26	4 163 000.00	5 025 543.00	0.09
USD DELTA AIR LINES INC / SKYMILES LTD-144A 4.50000% 20-20.10.25	1 182 578.00	1 263 753.58	0.02
USD DEUTSCHE TELEKOM INTL FINANCE BV-144A 2.48500% 16-19.09.23	730 000.00	765 575.31	0.01
USD DEVON ENERGY CORP 5.85000% 15-15.12.25	1 950 000.00	2 287 932.02	0.04
USD DIAMONDBACK ENERGY INC 5.37500% 17-31.05.25	1 565 000.00	1 622 322.30	0.03
USD DISCOVER BANK 2.70000% 20-06.02.30	6 750 000.00	7 144 366.93	0.13
USD DISCOVER BANK 3.35000% 18-06.02.23	505 000.00	532 491.49	0.01
USD DOMINION ENERGY INC 3.90000% 15-01.10.25	1 500 000.00	1 692 912.71	0.03
USD DOMINION ENERGY INC 4.25000% 18-01.06.28	2 900 000.00	3 451 702.56	0.06
USD DOMINION ENERGY INC-SUB STEP-UP 16-01.04.21	5 350 000.00	5 383 793.92	0.10
USD DOMINION ENERGY INC-144A 2.45000% 19-15.01.23	1 000 000.00	1 038 697.77	0.02
USD DTE ENERGY CO 3.50000% 14-01.06.24	2 100 000.00	2 281 975.58	0.04
USD DUKE ENERGY CORP 3.05000% 12-15.08.22	2 685 000.00	2 776 015.97	0.05
USD EDP FINANCE BV-144A 1.71000% 20-24.01.28	3 350 000.00	3 330 234.96	0.06
USD ELANCO ANIMAL HEALTH INC 4.27200% 19-28.08.23	7 050 000.00	7 614 000.00	0.14
USD EMORY UNIVERSITY 2.14300% 20-01.09.30	975 000.00	1 016 253.96	0.02
USD ENBRIDGE ENERGY PARTNERS LP 4.20000% 11-15.09.21	1 280 000.00	1 298 223.98	0.02
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-144A 3.62500% 17-25.05.27	2 810 000.00	3 166 698.73	0.06
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-144A 3.50000% 17-06.04.28	460 000.00	518 186.22	0.01
USD ENI SPA-144A 4.25000% 19-09.05.29	867 000.00	1 012 454.04	0.02
USD EOG RESOURCES INC 4.10000% 10-01.02.21	1 010 000.00	1 010 000.00	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 - US マルチ・クレジット

2021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	ERP OPERATING LTD PARTNERSHIP 4.62500% 11-15.12.21	2 000 000.00	2 053 006.04	0.04
USD	EXPERIAN FINANCE PLC-144A 2.75000% 19-08.03.30	1 625 000.00	1 739 093.16	0.03
USD	FARMERS EXCHANGE CAPITAL-144A-SUB 7.05000% 98-15.07.28	1 915 000.00	2 389 258.16	0.04
USD	FIRST MIDWEST BANCORP INC/IL-SUB 5.87500% 16-29.09.26	6 695 000.00	7 650 316.38	0.14
USD	FMG RESOURCES AUGUST 2006 PTY LTD-144A 5.12500% 17-15.05.24	1 305 000.00	1 404 532.35	0.03
USD	FOX CORP 3.05000% 20-07.04.25	216 000.00	235 531.79	0.00
USD	GEORGIA-PACIFIC LLC-144A 3.73400% 13-15.07.23	2 508 000.00	2 688 347.30	0.05
USD	GFL ENVIRONMENTAL INC-144A 5.12500% 19-15.12.26	436 000.00	459 980.00	0.01
USD	GLENCORE FUNDING LLC-144A 4.12500% 19-12.03.24	2 455 000.00	2 693 140.59	0.05
USD	GLOBAL PAYMENTS INC 3.75000% 13-01.06.23	688 000.00	733 706.79	0.01
USD	GLP CAPITAL LP / GLP FINANC II INC 5.37500% 16-15.04.26	5 120 000.00	5 864 448.00	0.11
USD	GLP CAPITAL LP / GLP FINANC II INC 3.35000% 19-01.09.24	135 000.00	143 943.75	0.00
USD	GLP CAPTIAL/GLP FINANCING II INC 4.00000% 20-15.01.31	2 600 000.00	2 829 580.00	0.05
USD	GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.75000% 15-22.05.25	4 965 000.00	5 528 302.49	0.10
USD	HARLEY-DAVIDSON FIN.SERV INC-144A 4.05000% 19-04.02.22	1 425 000.00	1 474 244.98	0.03
USD	HARLEY-DAVIDSON FIN.SERV INC-144A 3.35000% 20-08.06.25	5 050 000.00	5 452 298.96	0.10
USD	HCA INC 5.00000% 14-15.03.24	3 000 000.00	3 378 932.40	0.06
USD	HCP INC 4.25000% 13-15.11.23	1 314 000.00	1 437 397.44	0.03
USD	HELMERICH & PAYNE INC 4.65000% 19-15.03.25	2 000 000.00	2 234 834.20	0.04
USD	HESS CORP 7.87500% 99-01.10.29	1 000 000.00	1 325 454.92	0.02
USD	HESS MIDSTREAM PARTNERS LP-144A 5.62500% 19-15.02.26	435 000.00	451 493.02	0.01
USD	HIGH STREET FUNDING TRUST-144A 4.11100% 18-15.02.28	2 485 000.00	2 850 317.62	0.05
USD	HUMANA INC 4.50000% 20-01.04.25	2 640 000.00	3 024 485.03	0.05
USD	HUSKY ENERGY INC 4.00000% 14-15.04.24	840 000.00	901 369.84	0.02
USD	HUSKY ENERGY INC 4.40000% 19-15.04.29	4 354 000.00	4 881 352.82	0.09
USD	HYUNDAI CAPITAL AMERICA-144A 5.87500% 20-07.04.25	1 640 000.00	1 942 734.25	0.03
USD	IHS MARKIT LTD-144A 4.75000% 17-15.02.25	957 000.00	1 087 802.76	0.02
USD	IHS MARKIT LTD-144A 4.00000% 17-01.03.26	1 206 000.00	1 361 477.52	0.02
USD	INFOR INC-144A 1.45000% 20-15.07.23	675 000.00	687 150.51	0.01
USD	INFOR INC-144A 1.75000% 20-15.07.25	5 943 000.00	6 135 235.50	0.11
USD	INTESA SANPAOLO SPA-144A 3.12500% 17-14.07.22	1 586 000.00	1 636 890.16	0.03
USD	INTESA SANPAOLO SPA-144A 3.37500% 18-12.01.23	2 165 000.00	2 261 313.53	0.04
USD	INTESA SANPAOLO SPA-144A 3.25000% 19-23.09.24	2 000 000.00	2 134 736.52	0.04
USD	INVERSIONES CMPC SA-144A 4.37500% 17-04.04.27	1 434 000.00	1 611 636.75	0.03
USD	INVERSIONES CMPC SA-REG-S 3.85000% 20-13.01.30	1 100 000.00	1 218 250.00	0.02
USD	IPALCO ENTERPRISES INC 3.70000% 18-01.09.24	955 000.00	1 040 918.78	0.02
USD	IPALCO ENTERPRISES INC-REG-S 4.25000% 20-01.05.30	2 900 000.00	3 309 920.10	0.06
USD	IRON MOUNTAIN INC-144A 4.87500% 19-15.09.29	977 000.00	1 014 492.37	0.02
USD	JACKSON NATIONAL LIFE GLOBAL FUND-144A 2.65000% 19-21.06.24	6 130 000.00	6 553 929.72	0.12
USD	JEFFERIES GROUP INC 5.12500% 13-20.01.23	2 250 000.00	2 446 601.00	0.04
USD	JERSEY CENTRAL POWER & LIGHT CO-144A 4.70000% 13-01.04.24	1 573 000.00	1 722 192.30	0.03
USD	JERSEY CENTRAL POWER & LIGHT CO-144A 4.30000% 15-15.01.26	1 896 000.00	2 119 275.67	0.04
USD	JPMORGAN CHASE & CO-SUB 3.37500% 13-01.05.23	2 810 000.00	2 992 998.61	0.05
USD	JPMORGAN CHASE & CO-SUB 3.62500% 16-01.12.27	1 705 000.00	1 925 510.96	0.03
USD	KEYSPAN GAS EAST CORP-144A 2.74200% 16-15.08.26	1 250 000.00	1 358 878.01	0.02
USD	KINDER MORGAN ENERGY PARTNERS LP 4.30000% 14-01.05.24	3 645 000.00	4 019 956.81	0.07
USD	KINDER MORGAN ENERGY PARTNERS LP 5.80000% 05-15.03.35	1 973 000.00	2 522 702.01	0.05
USD	KINDER MORGAN INC-144A 5.62500% 13-15.11.23	565 000.00	633 628.06	0.01
USD	LAMB WESTON HOLDINGS INC-144A 4.62500% 16-01.11.24	75 000.00	78 135.00	0.00
USD	LENNAR CORP STEP-UP/DOWN 13-15.11.22	700 000.00	741 209.00	0.01
USD	LEUCADIA NATIONAL CORP 5.50000% 13-18.10.23	1 750 000.00	1 916 351.96	0.03
USD	LEVEL 3 FINANCING INC-144A 4.62500% 19-15.09.27	171 000.00	177 653.61	0.00
USD	LEVEL 3 FINANCING INC-144A 3.40000% 19-01.03.27	4 100 000.00	4 492 247.00	0.08
USD	LEVEL 3 FINANCING INC-144A 3.87500% 19-15.11.29	1 600 000.00	1 760 000.00	0.03
USD	LEVEL 3 FINANCING INC-REG-S 4.25000% 20-01.07.28	1 495 000.00	1 531 941.45	0.03
USD	LIBERTY MUTUAL GROUP INC-144A 4.56900% 19-01.02.29	5 000 000.00	6 034 140.30	0.11
USD	LINCOLN NATIONAL CORP 4.00000% 13-01.09.23	2 075 000.00	2 258 288.72	0.04
USD	LIVE NATION ENTERTAINMENT INC-144A 4.75000% 19-15.10.27	270 000.00	270 675.00	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

2021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 LPL HOLDINGS INC-144A 5.75000% 17-15.09.25	796 000.00	822 506.80	0.01
USD LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV 5.75000% 12-15.04.24	500 000.00	572 886.47	0.01
USD MARATHON PETROLEUM CORP 5.12500% 19-15.12.26	1 580 000.00	1 880 485.57	0.03
USD MARATHON PETROLEUM CORP 3.80000% 19-01.04.28	3 052 000.00	3 393 124.69	0.06
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-144A 2.00000% 16-15.04.21	3 000 000.00	3 010 836.90	0.05
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-144A 2.95000% 18-11.01.25	540 000.00	587 213.69	0.01
USD MCDONALD ' S CORP 3.70000% 15-30.01.26	3 330 000.00	3 763 389.77	0.07
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-144A 3.87500% 12-11.04.22	670 000.00	698 751.72	0.01
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I-144A 3.00000% 13-10.01.23	1 500 000.00	1 576 887.99	0.03
USD MGM CHINA HOLDINGS LTD-144A 5.37500% 19-15.05.24	456 000.00	468 403.20	0.01
USD MICHAEL KORS USA INC-144A 4.00000% 17-01.11.24	1 225 000.00	1 295 486.50	0.02
USD MICROCHIP TECHNOLOGY INC 3.92200% 18-01.06.21	3 100 000.00	3 135 816.56	0.06
USD MIDWEST CONNECTOR CAPITAL CO LLC-144A 3.90000% 19-01.04.24	7 420 000.00	7 587 064.35	0.14
USD MIDWEST CONNECTOR CAPITAL CO LLC-144A 3.62500% 19-01.04.22	2 455 000.00	2 492 766.34	0.04
USD MOLINA HEALTHCARE INC-144A 3.87500% 20-15.11.30	883 000.00	943 706.25	0.02
USD MOLINA HEALTHCARE INC-REG-S 4.37500% 20-15.06.28	1 105 000.00	1 151 376.85	0.02
USD MORGAN STANLEY 3.70000% 14-23.10.24	5 020 000.00	5 565 077.52	0.10
USD MORGAN STANLEY 3.75000% 13-25.02.23	3 765 000.00	4 019 960.00	0.07
USD MORGAN STANLEY 3.87500% 14-29.04.24	2 000 000.00	2 207 583.54	0.04
USD MPLX LP 3.50000% 20-01.12.22	2 470 000.00	2 595 295.30	0.05
USD MPLX LP 4.25000% 20-01.12.27	525 000.00	603 396.81	0.01
USD MYLAN INC-144A 3.12500% 12-15.01.23	3 090 000.00	3 235 080.44	0.06
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD/NY 3.70000% 18-04.11.21	2 670 000.00	2 738 966.10	0.05
USD NAVIENT CORP 6.62500% 16-26.07.21	790 000.00	807 775.00	0.01
USD NETAPP INC 1.87500% 20-22.06.25	3 825 000.00	3 977 254.36	0.07
USD NEWFIELD EXPLORATION CO 5.62500% 12-01.07.24	3 370 000.00	3 667 407.82	0.07
USD NORDEA BANK ABP-144A 3.75000% 18-30.08.23	1 065 000.00	1 151 889.26	0.02
USD NRG ENERGY INC-144A 3.75000% 19-15.06.24	4 500 000.00	4 907 100.24	0.09
USD NUTRIEN LTD 3.37500% 18-15.03.25	1 900 000.00	2 079 474.48	0.04
USD NUTRITION & BIOSCIENCES INC-144A 1.23000% 20-01.10.25	3 995 000.00	4 021 571.06	0.07
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 6.95000% 19-01.07.24	665 000.00	721 525.00	0.01
USD OHIO NATIONAL FINANCIAL SRVCES INC-144A 5.55000% 20-24.01.30	2 500 000.00	2 650 686.13	0.05
USD OHIO NATIONAL LIFE INSURANC C0144A-SUB 6.87500% 12-15.06.42	2 500 000.00	2 924 081.10	0.05
USD OI EUROPEAN GROUP BV-144A 4.00000% 17-15.03.23	99 000.00	101 475.00	0.00
USD ONEOK INC 6.35000% 20-15.01.31	970 000.00	1 239 325.22	0.02
USD ONEOK PARTNERS LP 3.37500% 12-01.10.22	1 145 000.00	1 187 721.20	0.02
USD ONTARIO TEACHERS CADILLAC FAIRVIEW-144A 3.12500% 17-20.03.22	3 000 000.00	3 086 051.97	0.06
USD OTIS WORLDWIDE CORP 2.56500% 20-15.02.30	1 730 000.00	1 828 626.45	0.03
USD PANTHER BF AGGR 2/PANTHER FIN CO-144A 6.25000% 19-15.05.26	359 000.00	382 037.03	0.01
USD PARK AEROSPACE HOLDINGS LTD-144A 5.25000% 17-15.08.22	405 000.00	424 751.91	0.01
USD PARK AEROSPACE HOLDINGS LTD-144A 4.50000% 17-15.03.23	470 000.00	494 065.16	0.01
USD PENNSYLVANIA ELECTRIC CO-144A 3.25000% 17-15.03.28	305 000.00	322 686.72	0.01
USD PENSKE TRUCK LEASING/PTL FIN CORP-144A 3.90000% 18-01.02.24	2 500 000.00	2 720 503.75	0.05
USD PENSKE TRUCK LEASING/PTL FIN CORP-144A 4.45000% 19-29.01.26	2 680 000.00	3 092 369.72	0.06
USD PENSKE TRUCK LEASING/PTL FIN CORP-144A 3.45000% 19-01.07.24	2 865 000.00	3 116 429.53	0.06
USD PHILLIPS 66 PARTNERS LP 3.55000% 16-01.10.26	2 445 000.00	2 667 191.92	0.05
USD PRINCIPAL FINANCIAL GROUP INC 2.12500% 20-15.06.30	435 000.00	443 511.01	0.01
USD PRINCIPAL LIFE GLOBAL FUNDING II-144A 0.87500% 21-12.01.26	2 520 000.00	2 510 863.34	0.04
USD PROVIDENCE HEALTH & SERV OBLIG 4.37900% 13-01.10.23	2 500 000.00	2 740 257.75	0.05
USD REGENERON PHARMACEUTICALS INC 1.75000% 20-15.09.30	4 185 000.00	4 076 290.61	0.07
USD RELIANCE STAND LIFE-144A 2.62500% 19-22.07.22	4 780 000.00	4 925 752.53	0.09
USD ROCKIES EXPRESS PIPELINE LLC-144A 4.95000% 19-15.07.29	975 000.00	1 049 343.75	0.02
USD ROCKIES EXPRESS PIPELINE LLC-144A 3.60000% 20-15.05.25	1 020 000.00	1 048 254.00	0.02
USD ROCKIES EXPRESS PIPELINE LLC-144A 4.80000% 20-15.05.30	900 000.00	945 000.00	0.02
USD RUBY PIPELINE LLC-144A 6.00000% 12-01.04.22	2 140 000.00	1 268 479.66	0.02
USD SANTANDER HOLDINGS USA INC 3.24400% 20-05.10.26	3 750 000.00	4 071 456.75	0.07
USD SANTANDER UK PLC-144A-SUB 5.00000% 13-07.11.23	1 000 000.00	1 100 514.00	0.02
USD SEALED AIR CORP-144A 4.00000% 19-01.12.27	1 197 000.00	1 271 812.50	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 - US マルチ・クレジット

2021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 SES SA-144A 3.6000% 13-04.04.23	2 000 000.00	2 118 671.62	0.04
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 3.8750% 17-01.08.22	325 000.00	328 315.00	0.01
USD SMITHFIELD FOODS INC-144A 3.3500% 17-01.02.22	1 765 000.00	1 788 352.90	0.03
USD SMITHFIELD FOODS INC-144A 5.2000% 19-01.04.29	1 545 000.00	1 833 400.64	0.03
USD SPRINT SPECTRUM CO III LLC-144A STEP-DOWN 16-20.09.21	2 450 000.00	463 440.46	0.01
USD SPRINT SPECTRUM CO III LLC-144A 4.7380% 18-20.03.25	3 915 000.00	4 249 341.00	0.08
USD SPRINT SPECTRUM CO III LLC-144A 5.1520% 18-20.03.28	3 305 000.00	3 844 508.20	0.07
USD SS&C TECHNOLOGIES INC-144A 5.5000% 19-30.09.27	244 000.00	258 398.44	0.00
USD STATE STREET CORP 2.9010% 20-30.03.26	3 220 000.00	3 489 745.65	0.06
USD SUNOCO LOGISTICS PARTNERS OPERATIONS LP 4.2500% 14-01.04.24	1 260 000.00	1 367 253.42	0.02
USD TC PIPELINES LP 3.9000% 17-25.05.27	800 000.00	905 834.48	0.02
USD TC PIPELINES LP 4.6500% 11-15.06.21	620 000.00	623 024.36	0.01
USD TENET HEALTHCARE CORP-144A 4.8750% 19-01.01.26	1 186 000.00	1 237 152.18	0.02
USD TENGIZCHEVROIL FINANCE CO INTL-144A 3.2500% 20-15.08.30	723 000.00	751 616.34	0.01
USD TEXAS EASTERN TRANSMISSION LP-144A 2.8000% 12-15.10.22	1 375 000.00	1 420 463.40	0.03
USD THOMSON REUTERS CORP 4.3000% 13-23.11.23	2 516 000.00	2 755 715.67	0.05
USD TRANSCONTINENTAL GAS PIPE LINE 4.6000% 18-15.03.48	1 955 000.00	2 315 829.72	0.04
USD TRANSOCEAN PONTUS LTD-144A 6.1250% 18-01.08.25	255 000.00	183 982.50	0.00
USD TRANSOCEAN POSEIDON LTD-144A 6.8750% 19-01.02.27	479 000.00	431 100.00	0.01
USD TRIMBLE INC 4.7500% 14-01.12.24	1 300 000.00	1 474 349.25	0.03
USD TUCSON ELECTRIC POWER CO 3.0500% 15-15.03.25	1 425 000.00	1 551 477.85	0.03
USD UNITED AIRLINES AA PASS THROUGH TRUST 3.5000% 18-01.03.30	1 350 000.00	1 262 688.82	0.02
USD UPJOHN INC-144A 2.3000% 20-22.06.27	3 500 000.00	3 697 440.81	0.07
USD UPJOHN INC-144A 2.7000% 20-22.06.30	4 785 000.00	5 028 410.31	0.09
USD UPJOHN INC-REG-S 1.6500% 20-22.06.25	1 680 000.00	1 730 663.59	0.03
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 7.0000% 17-15.03.24	525 000.00	536 655.00	0.01
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 9.2500% 18-01.04.26	85 000.00	94 341.50	0.00
USD VENTAS REALTY LP 4.1250% 15-15.01.26	1 960 000.00	2 240 647.03	0.04
USD VEREIT OPERATING PATNERSHIP LP 3.4000% 20-15.01.28	3 485 000.00	3 833 941.83	0.07
USD VERISK ANALYTICS INC 4.1250% 12-12.09.22	1 500 000.00	1 584 815.98	0.03
USD VICI PROPERTIES LP / VICI NOTE CO-REG-S 3.5000% 20-15.02.25	375 000.00	381 093.75	0.01
USD VISTRA OPERATIONS CO LLC-144A 3.5500% 19-15.07.24	7 070 000.00	7 657 954.92	0.14
USD VISTRA OPERATIONS CO LLC-144A 3.7000% 19-30.01.27	580 000.00	640 868.56	0.01
USD VM HOLDING SA-144A 5.3750% 17-04.05.27	730 000.00	799 350.00	0.01
USD VOLKSWAGEN GRP OF AMERICA FINANCE-144A 4.2500% 18-13.11.23	7 175 000.00	7 875 801.06	0.14
USD VOLKSWAGEN GRP OF AMERICA FINANCE-144A 4.6250% 18-13.11.25	1 445 000.00	1 676 697.48	0.03
USD WALGREEN CO 3.1000% 12-15.09.22	2 295 000.00	2 390 774.07	0.04
USD WEA FIN LLC/ WESTF UK&EUR FIN PLC-144A 3.7500% 14-17.09.24	605 000.00	645 199.41	0.01
USD WEA FINANCE LLC-144A 4.1250% 18-20.09.28	2 620 000.00	2 826 393.14	0.05
USD WELLTOWER INC 3.7500% 12-15.03.23	500 000.00	528 925.65	0.01
USD WELLTOWER INC 4.2500% 16-01.04.26	1 230 000.00	1 424 439.61	0.03
USD WILLIS NORTH AMERICA INC 2.9500% 19-15.09.29	4 925 000.00	5 314 070.81	0.10
USD WRKCO INC 3.7500% 19-15.03.25	2 240 000.00	2 490 453.28	0.04
USD WRKCO INC 4.6500% 19-15.03.26	730 000.00	852 012.67	0.02
USD XYLEM INC/NY 4.8750% 12-01.10.21	500 000.00	514 703.33	0.01
USD YAMANA GOLD INC 4.6250% 18-15.12.27	970 000.00	1 083 225.49	0.02
USD ZF NORTH AMERICA CAPITAL INC-144A 4.7500% 15-29.04.25	2 065 000.00	2 239 781.60	0.04
米ドル合計		660 382 255.60	11.82
ノート、固定利付債合計		660 382 255.60	11.82
ノート、ゼロ・クーポン			
USD			
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 0.0000% 19-10.10.36	3 100 000.00	1 495 750.00	0.03
米ドル合計		1 495 750.00	0.03
ノート、ゼロ・クーポン合計		1 495 750.00	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 - US マルチ・クレジット

2021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			
USD			
USD AVIATION CAPITAL GROUP LLC-144A 3M LIBOR+95BP 18-01.06.21	1 000 000.00	999 117.54	0.02
USD BNP PARIBAS-144A 3.052%/VAR 20-13.01.31	4 135 000.00	4 442 010.27	0.08
USD CAPITAL ONE BANK 2.280%/VAR 20-28.01.26	2 995 000.00	3 130 154.41	0.06
USD CITIZENS BANK NA/PROVIDENCE RI 3M LIBOR+95BP 18-29.03.23	7 370 000.00	7 469 263.50	0.13
USD CREDIT AGRICOLE SA-144A 1.247%/VAR 21-26.01.27	3 055 000.00	3 052 937.17	0.06
USD DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA-144A 3M LIBOR+90BP 19-15.02.22	3 500 000.00	3 526 180.00	0.06
USD DUPONT DE NEMOURS INC 3M LIBOR+111BP 18-15.11.23	2 380 000.00	2 425 310.29	0.04
USD ENERGY TRANSFER PARTNERS-SUB 6.250%/VAR 17-PRP	720 000.00	583 200.00	0.01
USD FARMERS EXCHANGE CAPITAL II-144A-SUB 6.151%/VAR 13-01.11.53	1 000 000.00	1 327 392.34	0.02
USD HARTFORD FINANCIAL-144A-SUB 3M LIBOR+212.5BP 17-12.02.47	2 070 000.00	1 904 144.77	0.04
USD JPMORGAN CHASE & CO 1.953%/VAR 21-04.02.32	3 950 000.00	3 942 998.70	0.07
USD MACQUARIE GROUP LTD-144A 3.189%/VAR 17-28.11.23	7 935 000.00	8 292 692.35	0.15
USD NATIONWIDE MUT INS-144A-SUB 5.81%/3M LIBOR+229BP 08-15.12.24	3 000 000.00	2 998 883.91	0.05
USD PRUDENTIAL FINANCIAL INC-SUB 5.875%/VAR 12-15.09.42	2 070 000.00	2 191 612.50	0.04
USD PRUDENTIAL FINANCIAL INC-SUB 5.625%/VAR 12-15.06.43	6 349 000.00	6 831 809.76	0.12
USD TEACHER INS&AN-144A-SUB 4.375%/3M LIBOR+266.1BP 14-15.09.54	400 000.00	425 160.68	0.01
USD VOYA FINANCIAL INC-SUB 5.650%/VAR 13-15.05.53	2 620 000.00	2 777 200.00	0.05
米ドル合計		56 320 068.19	1.01
ノート、変動利付債合計		56 320 068.19	1.01
中期債券、固定利付債			
USD			
USD AIB GROUP PLC-144A 4.75000% 18-12.10.23	1 755 000.00	1 925 915.24	0.03
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 4.00000% 15-22.01.25	2 862 000.00	3 190 876.40	0.06
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 3.95000% 15-21.04.25	3 775 000.00	4 219 529.92	0.07
USD BPCE SA-144A-SUB 4.62500% 14-11.07.24	4 620 000.00	5 158 883.97	0.09
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 3.85000% 14-08.07.24	16 760 000.00	18 406 851.69	0.33
USD PNC BANK NATIONAL ASSOCIATION-SUB 2.95000% 13-30.01.23	3 500 000.00	3 667 889.47	0.07
USD SOCIETE GENERALE SA-144A 2.62500% 20-22.01.25	3 760 000.00	3 966 909.98	0.07
USD WELLS FARGO & CO-SUB 4.30000% 15-22.07.27	2 659 000.00	3 103 636.30	0.06
米ドル合計		43 640 492.97	0.78
中期債券、固定利付債合計		43 640 492.97	0.78
債券、固定利付債			
USD			
USD ALTRIA GROUP INC 4.00000% 13-31.01.24	1 250 000.00	1 374 689.11	0.02
USD AMERICA WEST AIRLINES PASS THROUGH TRST 7.10000% 02-02.04.21	4 500 000.00	284 101.57	0.01
USD AMERICAN AIRLINES 2019-1 CLASS AA 3.15000% 19-15.02.32	4 500 000.00	4 306 043.07	0.08
USD AMERICAN AIRLINES 3.20000% 16-15.06.28	2 000 000.00	1 601 523.22	0.03
USD BANNER HEALTH 2.33800% 20-01.01.30	1 130 000.00	1 187 125.11	0.02
USD BARNABAS HEALTH INC 4.00000% 12-01.07.28	2 000 000.00	2 205 771.68	0.04
USD BMW US CAPITAL LLC-144A 3.10000% 18-12.04.21	2 000 000.00	2 011 182.50	0.04
USD CAPITAL ONE BANK USA NA-SUB 3.37500% 13-15.02.23	8 300 000.00	8 764 465.59	0.16
USD COMMONWEALTH BK OF AUSTRALIA-144A-SUB 4.50000% 15-09.12.25	4 880 000.00	5 584 379.20	0.10
USD CONTINENTAL AIRLINES PASS THRU TRUST 5.98300% 07-19.04.22	3 000 000.00	1 595 304.64	0.03
USD CONTINENTAL AIRLINES PASS THROUGH TRUST 6.90300% 07-19.04.22	16 415 000.00	1 122 658.28	0.02
USD CONTINENTAL RESOURCES INC 4.50000% 13-15.04.23	591 000.00	606 566.94	0.01
USD COX ENTERPRISES INC-144A 7.37500% 97-15.07.27	280 000.00	373 310.75	0.01
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP-144A 4.90000% 19-01.10.26	2 455 000.00	2 866 797.99	0.05
USD DELTA AIR LINES INC PASS THROUGH TRUSTS 6.71800% 02-02.01.23	8 775 000.00	1 140 634.69	0.02
USD DELTA AIR LINES INC 6.82100% 07-10.08.22	1 700 000.00	642 006.24	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

2021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 DEUTSCHE TELEKOM INTL FINANCE BV-144A 4.37500% 18-21.06.28	1 200 000.00	1 426 278.03	0.03
USD ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC 3.75000% 14-15.02.25	1 230 000.00	1 367 208.60	0.02
USD FARMERS INSURANCE EXCHANGE-144A-SUB 8.62500% 94-01.05.24	700 000.00	842 053.39	0.01
USD FIVE CORNERS FUNDING TRUST-144A 4.41900% 13-15.11.23	6 220 000.00	6 890 999.73	0.12
USD INTERSTATE POWER & LIGHT CO 3.60000% 19-01.04.29	4 280 000.00	4 984 912.49	0.09
USD METROPOLITAN EDISON CO-144A 4.00000% 14-15.04.25	2 400 000.00	2 607 667.23	0.05
USD MONONGAHELA POWER CO-144A 4.10000% 13-15.04.24	2 290 000.00	2 471 133.87	0.04
USD NBD BANK NA MICHIGAN-SUB 8.25000% 94-01.11.24	1 300 000.00	1 649 593.66	0.03
USD NGPL PIPECO LLC-144A 4.87500% 17-15.08.27	1 000 000.00	1 156 536.51	0.02
USD PACIFIC GAS & ELECTRIC CO 3.45000% 20-01.07.25	2 550 000.00	2 756 334.30	0.05
USD PACIFIC LIFE CORP-144A 6.60000% 03-15.09.33	4 500 000.00	6 349 895.15	0.11
USD PEOPLES UNITED BANK-SUB 4.00000% 14-15.07.24	1 450 000.00	1 562 635.89	0.03
USD PUGET ENERGY INC 6.00000% 11-01.09.21	2 500 000.00	2 578 132.35	0.05
USD ROCHESTER GAS & ELECTRIC CORP-144A 3.10000% 17-01.06.27	3 500 000.00	3 878 581.84	0.07
USD SMBC AVIATION CAPITAL FINANCE DAC-144A 3.00000% 17-15.07.22	1 750 000.00	1 797 416.60	0.03
USD SUTTER HEALTH 3.69500% 18-15.08.28	9 125 000.00	10 407 668.87	0.19
USD SYDNEY AIRPORT FINANCE CO PTY LTD-144A 3.62500% 16-28.04.26	520 000.00	571 686.29	0.01
USD UNITED AIRLINES PASS THRU TRUST 4.30000% 13-15.08.25	4 000 000.00	2 951 844.40	0.05
USD US AIRWAYS 2012-1 CLASS A PAS THRO TRST 5.90000% 12-01.10.24	1 220 000.00	642 117.09	0.01
USD WILLIAMS COMPANIES INC 7.50000% 01-15.01.31	150 000.00	203 656.92	0.00
米ドル合計		92 762 913.79	1.66
債券、固定利付債合計		92 762 913.79	1.66
債券、変動利付債			
USD			
USD CITIZENS FINANCIAL GROUP INC-SUB 5.500%/VAR 15-PRP	301 000.00	300 623.75	-0.00
USD METLIFE CAPITAL TRUST IV-144A-SUB 7.875%/VAR 07-15.12.37	1 200 000.00	1 702 920.00	0.03
USD PACIFIC GAS AND ELECTRIC CO 3M LIBOR+137.5BP 20-15.11.21	3 180 000.00	3 187 657.44	0.06
米ドル合計		5 191 201.19	0.09
債券、変動利付債合計		5 191 201.19	0.09
地方債、固定利付			
USD			
USD COUNTY OF MIAMI-DADE FL AVIATION REV 3.50400% 17-01.10.31	865 000.00	946 214.85	0.02
USD DENVER CO CITY & COUNTY ARPT REV 2.23700% 20-15.11.30	1 845 000.00	1 866 014.55	0.03
USD GREATER ORLANDO AVIATION AUTH 5.00000% 19-01.10.44	385 000.00	485 588.95	0.01
USD HOUSTON TEXAS WATER & SEWER SYSTEM 3.82800% 14-15.05.28	800 000.00	914 904.00	0.02
USD LOS ANGELES DEPARTMENT OF AIRPORTS-SUB 5.00000% 19-15.05.36	750 000.00	956 070.00	0.02
USD LOS ANGELES DEPARTMENT OF POWER 5.51600% 10-01.07.27	1 520 000.00	1 923 484.00	0.03
USD LOS ANGELES UNIFIED SCHOOL DISTRICT 6.75800% 10-01.07.34	1 285 000.00	1 921 319.15	0.03
USD MASSACHUSETTS, STATE OF-SUB-S 2.96600% 19-15.10.32	850 000.00	906 542.00	0.02
USD NEW YORK CITY 2.80000% 19-01.08.30	1 325 000.00	1 433 173.00	0.02
USD NEW YORK CITY TRANS FINANCE AUTH REV 5.26700% 10-01.05.27	1 400 000.00	1 728 860.00	0.03
USD NEW YORK CITY TRANS FIN AUTH REV-SUB 3.95000% 18-01.08.32	1 000 000.00	1 145 730.00	0.02
USD NEW YORK N Y, CITY OF 1.92300% 21-01.08.31	340 000.00	344 035.80	0.01
USD NEW YORK STATE DORMITORY AUTHORITY 5.50000% 10-15.03.30	1 765 000.00	2 153 670.65	0.04
USD NEW YORK STATE DORMITORY AUTHORITY 5.00000% 19-15.03.47	765 000.00	954 773.55	0.02
USD NEW YORK STATE URBAN DEV CORP 3.37000% 17-15.03.30	1 295 000.00	1 443 912.05	0.03
USD NORTH TEXAS TOLLWAY AUTH REV 1.87700% 20-01.01.30	1 840 000.00	1 843 072.80	0.03
USD RUTGERS STATE UNIVERSITY 4.14600% 18-01.05.48	5 655 000.00	6 195 957.30	0.11
USD SAN FRANCISCO CITY&CNTY AIRPORTS 5.00000% 19-01.05.49	75 000.00	92 844.00	0.00
USD SANTA CLARA VALLEY TRANSPORTATION AUTH 5.87600% 10-01.04.32	2 205 000.00	2 816 027.55	0.05
USD UNIVERSITY OF CALIFORNIA 4.60100% 13-15.05.31	1 385 000.00	1 670 877.85	0.03
USD UNIVERSITY OF CALIFORNIA REVS 0.88300% 20-15.05.25	3 000 000.00	3 058 350.00	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 - US マルチ・クレジット

2021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 UNIVERSITY OF CALIFORNIA REVS 1.31600% 20-15.05.27	3 650 000.00	3 715 663.50	0.07
USD WASHINGTON, STATE OF 5.04000% 10-01.08.31	925 000.00	1 174 787.00	0.02
米ドル合計		39 691 872.55	0.71
地方債、固定利付合計		39 691 872.55	0.71
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		992 844 712.57	17.77
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			
USD			
USD NAVIENT STUDENT LOAN TRUST-144A VAR 16-25.06.65	1 000 000.00	1 034 980.90	0.02
米ドル合計		1 034 980.90	0.02
アセット・バック証券、変動利付合計		1 034 980.90	0.02
モーゲージ・バック証券、固定利付			
USD			
USD JP MORGAN CHASE COM MTG SEC TRUST-SUB 3.80460% 14-01.07.47	4 750 000.00	5 203 530.95	0.09
米ドル合計		5 203 530.95	0.09
モーゲージ・バック証券、固定利付合計		5 203 530.95	0.09
ノート、固定利付債			
USD			
USD 1011778 BC ULC/NEW RED FINANCE INC-144A 3.50000% 20-15.02.29	1 772 000.00	1 768 677.50	0.03
USD ABBVIE INC 3.85000% 20-15.06.24	2 939 000.00	3 230 117.85	0.06
USD ABBVIE INC 5.00000% 20-15.12.21	2 882 000.00	2 965 645.78	0.05
USD AIR CANADA CLASS AA PASS THR TRT-144A 3.30000% 17-15.01.30	1 750 000.00	1 514 892.09	0.03
USD ALIMENTATION COUCHE TARD INC-144A 3.55000% 17-26.07.27	3 530 000.00	3 955 334.77	0.07
USD AT&T INC-144A 2.55000% 20-01.12.33	9 570 000.00	9 541 660.54	0.17
USD BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUT-144A 3.75000% 18-20.07.23	2 470 000.00	2 666 362.65	0.05
USD BAYER US FINANCE II LLC-144A 5.50000% 18-30.07.35	1 000 000.00	1 248 789.27	0.02
USD BAYLOR SCOTT & WHITE HOLDINGS 1.94700% 16-15.11.21	2 000 000.00	2 014 222.36	0.04
USD BBVA USA 2.50000% 19-27.08.24	6 470 000.00	6 879 320.66	0.12
USD BERKSHIRE HATHAWAY ENERGY CO-144A 1.65000% 20-15.05.31	3 250 000.00	3 211 204.65	0.06
USD BERRY GLOBAL INC-144A 1.57000% 20-15.01.26	5 880 000.00	5 913 075.00	0.11
USD BMW US CAPITAL LLC-144A 3.90000% 20-09.04.25	2 960 000.00	3 314 121.82	0.06
USD BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 2.75000% 20-15.02.23	5 150 000.00	5 391 317.92	0.10
USD CAMERON LNG LLC-REG-S 2.90200% 19-15.07.31	2 050 000.00	2 230 312.85	0.04
USD CARGILL INC-144A 2.12500% 20-23.04.30	2 095 000.00	2 169 312.31	0.04
USD CARNIVAL CORP-144A 11.50000% 20-01.04.23	3 290 000.00	3 738 262.50	0.07
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.00000% 17-01.02.28	850 000.00	892 925.00	0.02
USD CENTENE CORP 4.75000% 20-15.01.25	2 750 000.00	2 821 362.50	0.05
USD CENTENE CORP-144A 5.37500% 20-15.08.26	74 000.00	77 607.50	0.00
USD CENTERPOINT ENERGY INC 2.50000% 19-01.09.24	3 284 000.00	3 490 176.03	0.06
USD CLECO CORPORATE HOLDINGS LLC 3.37500% 20-15.09.29	320 000.00	334 258.60	0.01
USD COMERICA BANK 2.50000% 19-23.07.24	5 700 000.00	6 072 442.10	0.11
USD COMPASS BANK 2.87500% 17-29.06.22	1 830 000.00	1 889 687.71	0.03
USD COSTCO WHOLESALE CORP 1.37500% 20-20.06.27	6 850 000.00	7 019 127.95	0.13
USD CYRUSONE LP / CYRUSONE FIN CORP 3.45000% 19-15.11.29	4 610 000.00	4 958 331.60	0.09
USD DANSKE BANK A/S-144A 1.62100% 20-11.09.26	1 295 000.00	1 302 439.84	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

2021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 DELTA AIR LN 2020-1 CLS AA PAS THRU TRT 2.00000% 20-10.06.28	4 600 000.00	4 472 320.81	0.08
USD DTE ENERGY CO STEP-UP 19-01.10.24	2 800 000.00	2 984 144.80	0.05
USD ENSTAR GROUP LTD 4.50000% 17-10.03.22	6 870 000.00	7 119 986.93	0.13
USD FIFTH THIRD BANCORP 2.55000% 20-05.05.27	2 855 000.00	3 092 751.41	0.05
USD FOX CORP 4.70900% 20-25.01.29	3 577 000.00	4 290 623.81	0.08
USD GEORGIA-PACIFIC LLC-144A 2.30000% 20-30.04.30	2 000 000.00	2 108 539.62	0.04
USD GFL ENVIRONMENTAL INC-144A 3.50000% 20-01.09.28	2 413 000.00	2 374 560.91	0.04
USD HEALTH CARE SER CORP A MUT LGL RES-144A 2.20000% 20-01.06.30	1 150 000.00	1 193 529.44	0.02
USD HUNTINGTON BANCSHARES INC/OH 2.55000% 20-04.02.30	3 750 000.00	3 977 203.91	0.07
USD IHS MARKIT LTD-144A 5.00000% 16-01.11.22	4 672 000.00	4 975 423.18	0.09
USD INGEVITY CORP-144A 3.87500% 20-01.11.28	861 000.00	863 247.21	0.01
USD IPALCO ENTERPRISES INC-144A 4.25000% 20-01.05.30	930 000.00	1 061 457.13	0.02
USD ITC HOLDINGS CORP-144A 2.95000% 20-14.05.30	500 000.00	542 724.79	0.01
USD JACKSON NATIONAL LIFE GLOBAL FUND-REG-S 2.50000% 17-27.06.22	2 200 000.00	2 266 592.55	0.04
USD KEURIG DR PEPPER INC 4.41700% 19-25.05.25	2 650 000.00	3 038 256.72	0.05
USD KFC HLDG/PIZZA HUT HLDG/TACO BELL-144A 4.75000% 17-01.06.27	1 950 000.00	2 047 500.00	0.04
USD KLABIN AUSTRIA GMBH-144A 3.20000% 21-12.01.31	3 500 000.00	3 488 100.00	0.06
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 3.75000% 21-01.04.30	755 000.00	810 447.13	0.01
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 3.87500% 21-15.05.27	1 000 000.00	1 094 815.30	0.02
USD LAMAR MEDIA CORP-144A 3.62500% 21-15.01.31	3 150 000.00	3 177 562.50	0.06
USD LEVEL 3 FINANCING INC-144A 3.75000% 21-15.07.29	450 000.00	452 477.25	0.01
USD MICROCHIP TECHNOLOGY INC-144A 2.67000% 20-01.09.23	6 595 000.00	6 895 719.74	0.12
USD NIAGARA MOHAWK POWER CORP-144A 1.96000% 20-27.06.30	3 725 000.00	3 818 781.12	0.07
USD NRG ENERGY INC-144A 3.37500% 20-15.02.29	3 125 000.00	3 196 562.50	0.06
USD NUTRITION & BIOSCIENCES INC-144A 1.83200% 20-15.10.27	3 525 000.00	3 614 956.56	0.06
USD NUVEEN LLC-REG-S 4.00000% 18-01.11.28	4 315 000.00	5 101 579.02	0.09
USD ROYALTY PHARMA PLC-144A 2.20000% 20-02.09.30	3 225 000.00	3 265 704.76	0.06
USD SABRA HEALTH CARE LP 4.80000% 19-01.06.24	2 812 000.00	3 050 230.08	0.05
USD SEAGATE HDD CAYMAN-144A 3.37500% 20-15.07.31	2 500 000.00	2 432 875.00	0.04
USD SLM CORP 4.20000% 20-29.10.25	1 752 000.00	1 857 645.60	0.03
USD T-MOBILE USA INC-144A 4.37500% 20-15.04.40	1 645 000.00	1 926 344.35	0.03
USD T-MOBILE USA INC-144A 4.50000% 20-15.04.50	395 000.00	465 468.00	0.01
USD T-MOBILE USA INC-144A 3.50000% 20-15.04.25	1 950 000.00	2 137 581.22	0.04
USD T-MOBILE USA INC-144A 3.87500% 20-15.04.30	5 845 000.00	6 599 998.65	0.12
USD TAYLOR MORRISON COMMUNITIES INC-REG-S 5.12500% 20-01.08.30	425 000.00	466 023.12	0.01
USD TELEFLEX INC-144A 4.25000% 20-01.06.28	600 000.00	630 630.00	0.01
USD TRACTOR SUPPLY CO 1.75000% 20-01.11.30	1 650 000.00	1 627 868.77	0.03
USD TRANSCONTINENTAL GAS PIPE LINE 3.25000% 20-15.05.30	3 080 000.00	3 384 612.00	0.06
USD UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC-144A 2.65000% 20-15.10.30	3 225 000.00	3 271 730.25	0.06
USD USA COMPRESSION PARTNERS LLC 6.87500% 19-01.09.27	569 000.00	603 140.00	0.01
USD VALVOLINE INC-144A 3.62500% 20-15.06.31	2 000 000.00	2 007 500.00	0.04
USD WALT DISNEY CO 7.75000% 19-20.01.24	478 000.00	575 863.86	0.01
米ドル合計		202 974 069.35	3.63
ノート、固定利付債合計		202 974 069.35	3.63
ノート、変動利付債			
USD			
USD BNP PARIBAS SA-144A 1.323%/VAR 21-13.01.27	1 453 000.00	1 457 300.88	0.03
USD CIT BANK NA 2.969%/VAR 19-27.09.25	6 750 000.00	7 154 999.99	0.13
USD CREDIT SUISSE GROUP AG -144A 1.305%/VAR 21-02.02.27	3 865 000.00	3 859 074.64	0.07
USD FIFTH THIRD BANCORP-SUB 4.500%/VAR 20-PRP	1 160 000.00	1 229 600.00	0.02
USD FIRST REPUBLIC BANK 1.912%/VAR 20-12.02.24	3 100 000.00	3 190 618.21	0.06
USD LYB INTERNATIONAL FINANCE III LLC 3M LIBOR+100BP 20-01.10.23	2 640 000.00	2 648 578.47	0.05
米ドル合計		19 540 172.19	0.36
ノート、変動利付債合計		19 540 172.19	0.36

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

2021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			
USD			
USD AVALONBAY COMMUNITIES INC 2.45000% 20-15.01.31	1 585 000.00	1 681 664.48	0.03
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 2.40000% 19-17.06.22	2 875 000.00	2 956 798.01	0.05
米ドル合計		4 638 462.49	0.08
中期債券、固定利付債合計		4 638 462.49	0.08
債券、固定利付債			
USD			
USD ADVOCATE HEALTH & HOSPITALS CORP 3.82900% 18-15.08.28	980 000.00	1 117 686.94	0.02
USD AMERICAN AIRLINES 2019-1 CLASS A 3.50000% 19-15.08.33	4 200 000.00	3 754 950.06	0.07
USD ASCENSION HEALTH 2.53200% 19-15.11.29	1 495 000.00	1 605 217.09	0.03
USD BON SECOURS MERCY HEALTH INC 2.09500% 20-01.06.31	925 000.00	952 821.17	0.02
USD COMMONSPIRIT HEALTH 2.78200% 20-01.10.30	1 250 000.00	1 317 718.46	0.02
USD ENTERGY ARKANSAS LLC 4.00000% 18-01.06.28	7 125 000.00	8 321 696.76	0.15
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 2.25000% 19-01.07.22	2 900 000.00	2 979 617.01	0.05
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I-144A 2.95000% 20-09.04.30	1 560 000.00	1 730 536.70	0.03
USD NORTHWELL HEALTHCARE INC 3.39100% 17-01.11.27	8 000 000.00	8 379 059.12	0.15
USD PEACEHEALTH OBLIGATED GROUP 1.37500% 20-15.11.25	5 730 000.00	5 854 505.34	0.10
USD STANFORD HEALTH CARE 3.31000% 20-15.08.30	990 000.00	1 124 784.09	0.02
米ドル合計		37 138 592.74	0.66
債券、固定利付債合計		37 138 592.74	0.66
地方債、固定利付			
USD			
USD ATLANTA GEORGIA WATER & WASTEWR REV 2.25700% 20-01.11.35	925 000.00	977 503.00	0.02
USD LOS ANGELES UNIFIED SCHOOL DISTRICT A-1 5.75000% 09-01.07.34	3 750 000.00	5 273 850.00	0.09
米ドル合計		6 251 353.00	0.11
地方債、固定利付合計		6 251 353.00	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 いない譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		276 781 161.62	4.95
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			
USD			
USD AIRCASTLE LTD-144A 2.85000% 21-26.01.28	2 300 000.00	2 247 859.00	0.04
USD ALLIANT ENERGY FINANCE LLC-144A 1.40000% 20-15.03.26	2 715 000.00	2 734 854.60	0.05
USD BBVA BANCOMER SA/TEXAS-144A 1.87500% 20-18.09.25	4 500 000.00	4 526 100.00	0.08
USD BERKSHIRE HATHAWAY ENERGY CO-144A 4.05000% 20-15.04.25	1 975 000.00	2 226 261.55	0.04
USD BERRY GLOBAL INC-144A 0.95000% 21-15.02.24	1 250 000.00	1 252 975.00	0.02
USD BORGWARNER INC-144A 5.00000% 20-01.10.25	2 315 000.00	2 726 405.78	0.05
USD BROADCOM INC-144A 1.95000% 21-15.02.28	11 910 000.00	11 951 738.95	0.21
USD CCL INDUSTRIES INC-144A 3.05000% 20-01.06.30	3 200 000.00	3 440 040.80	0.06
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 4.50000% 20-01.05.32	497 000.00	516 989.34	0.01
USD CENTURYLINK INC-144A 4.50000% 20-15.01.29	1 265 000.00	1 298 471.90	0.02
USD CITIZENS FINANCIAL GROUP INC-144A-SUB 2.63800% 20-30.09.32	3 960 000.00	4 051 452.60	0.07
USD CNX RESOURCES CORP-144A 6.00000% 20-15.01.29	250 000.00	258 362.50	0.01
USD FEDERATION DES CAISSES DESJARDINS-144A 2.05000% 20-10.02.25	7 300 000.00	7 655 976.76	0.14
USD FS INVESTMENT CORP II-144A 4.25000% 20-14.02.25	9 975 000.00	10 141 561.55	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

2021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 GE CAPITAL FUNDING LLC-144A 4.40000% 20-15.05.30	2 430 000.00	2 818 630.00	0.05
USD HILTON DOMESTIC OPERATING CO INC-144A 3.62500% 21-15.02.32	4 392 000.00	4 343 204.88	0.08
USD HYUNDAI CAPITAL AMERICA-144A 1.25000% 20-18.09.23	4 750 000.00	4 798 135.70	0.09
USD HYUNDAI CAPITAL AMERICA-144A 1.80000% 21-10.01.28	4 490 000.00	4 472 636.99	0.08
USD ICAHN ENTERPRISES LP / ICAHN FINAN-144A 4.37500% 21-01.02.29	4 265 000.00	4 234 718.50	0.08
USD LEIDOS INC-144A 3.62500% 20-15.05.25	750 000.00	833 392.50	0.02
USD LEIDOS INC-144A 4.37500% 20-15.05.30	1 705 000.00	2 016 742.20	0.04
USD MGM GROWTH POP LP/CO-ISSUER INC-144A 3.87500% 20-15.02.29	2 737 000.00	2 783 186.88	0.05
USD MURPHY OIL USA INC-144A 3.75000% 21-15.02.31	2 961 000.00	2 961 000.00	0.05
USD NATIONAL SECURITIES CLEARING CORP-144A 1.50000% 20-23.04.25	3 450 000.00	3 558 171.65	0.06
USD NRG ENERGY INC-144A 2.00000% 20-02.12.25	285 000.00	295 772.04	0.01
USD NXP BV / NXP FDNG LLC / NXP USA-144A 3.15000% 20-01.05.27	2 205 000.00	2 426 697.62	0.04
USD PARSLEY ENERGY LLC/FINANCE CORP-144A 4.12500% 20-15.02.28	1 080 000.00	1 147 500.00	0.02
USD QUICKEN LOANS LLC-144A 3.62500% 20-01.03.29	1 180 000.00	1 180 531.00	0.02
USD ROYALTY PHARMA PLC-144A 1.75000% 20-02.09.27	6 900 000.00	7 042 702.49	0.13
USD SBA COMMUNICATIONS CORP-144A 3.12500% 21-01.02.29	2 475 000.00	2 468 812.50	0.04
USD SINCLAIR TELEVISION GROUP INC-144A 4.12500% 20-01.12.30	1 870 000.00	1 862 987.50	0.03
USD TARGA RESOURCES PARTNERS-144A 4.00000% 21-15.01.32	1 600 000.00	1 584 000.00	0.03
USD UNICREDIT SPA-144A 2.56900% 20-22.09.26	3 225 000.00	3 269 476.42	0.06
USD USAA CAPITAL CORP-144A 2.12500% 20-01.05.30	9 100 000.00	9 500 629.05	0.17
USD VOLKSWAGEN GRP OF AMERICA FINANCE-144A 3.35000% 20-13.05.25	1 180 000.00	1 292 829.80	0.02
USD VOLKSWAGEN GRP OF AMERICA FINANCE-144A 0.75000% 20-23.11.22	1 830 000.00	1 837 136.79	0.03
USD VOLKSWAGEN GRP OF AMERICA FINANCE-144A 1.25000% 20-24.11.25	4 600 000.00	4 624 545.97	0.08
USD YARA INTERNATIONAL ASA-144A 3.14800% 20-04.06.30	2 000 000.00	2 128 125.00	0.04
米ドル合計		128 510 615.81	2.30
ノート、固定利付債合計		128 510 615.81	2.30
ノート、変動利付債			
USD			
USD 7-ELEVEN INC-144A 3M US LIBOR +45BP 21-10.08.22	3 665 000.00	3 667 202.85	0.07
USD BNP PARIBAS-144A 2.219%/VAR 20-09.06.26	5 085 000.00	5 316 214.95	0.09
USD MACQUARIE GROUP LTD-144A 1.340%/VAR 21-12.01.27	3 361 000.00	3 381 358.71	0.06
米ドル合計		12 364 776.51	0.22
ノート、変動利付債合計		12 364 776.51	0.22
中期債券、変動利付債			
USD			
USD CREDIT AGRICOLE SA/LONDON-144A 1.907%/VAR 20-16.06.26	1 776 000.00	1 832 602.65	0.03
米ドル合計		1 832 602.65	0.03
中期債券、変動利付債合計		1 832 602.65	0.03
債券、固定利付債			
USD			
USD NRG ENERGY INC-144A 2.45000% 20-02.12.27	1 220 000.00	1 274 018.63	0.03
米ドル合計		1 274 018.63	0.03
債券、固定利付債合計		1 274 018.63	0.03
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		143 982 013.60	2.58
投資有価証券合計		5 538 785 959.73	99.15

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 - US マルチ・クレジット

2021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 (%)			
金融派生商品						
公認の証券取引所に上場されている金融派生商品						
債券に係る金融先物						
EUR	EURO-BUND FUTURE 08.03.21	-3.00	-182.24	0.00		
USD	US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 22.03.21	-72.00	630 775.56	0.01		
USD	US LONG BOND FUTURE 22.03.21	-237.00	1 179 675.22	0.02		
USD	US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.21	486.00	87 132.18	0.00		
USD	US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.21	57.00	-7 533.23	0.00		
USD	US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 22.03.21	-103.00	-29 421.88	0.00		
USD	US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 22.03.21	657.00	-527 234.66	-0.01		
債券に係る金融先物合計			1 333 210.95	0.02		
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計			1 333 210.95	0.02		
金融派生商品合計			1 333 210.95	0.02		
先渡為替契約						
購入通貨	購入額	売却通貨	売却額	満期日		
JPY	3 266 820 896.00	USD	31 760 000.00	5.2.2021	-555 590.13	-0.01
CHF	1 214 850 465.56	USD	1 382 836 000.00	5.2.2021	-17 027 245.30	-0.30
EUR	1 367 924 221.45	USD	1 682 265 000.00	5.2.2021	-20 209 721.66	-0.36
GBP	75 395 433.93	USD	102 778 000.00	5.2.2021	757 020.33	0.01
USD	2 192 897.32	EUR	1 786 799.00	2.2.2021	22 115.21	0.00
EUR	26 726 014.62	USD	33 000 000.00	5.2.2021	-527 357.90	-0.01
CHF	26 286 180.00	USD	30 000 000.00	5.2.2021	-447 478.28	-0.01
USD	8 000 000.00	EUR	6 595 229.34	5.2.2021	-13 335.51	0.00
USD	16 000 000.00	EUR	13 164 292.84	5.2.2021	5 121.00	0.00
USD	8 000 000.00	CHF	7 093 168.00	5.2.2021	25 429.28	0.00
EUR	1 786 799.00	USD	2 171 621.90	2.2.2021	-839.79	0.00
USD	2 172 970.93	EUR	1 786 799.00	2.3.2021	953.64	0.00
先渡為替契約合計					-37 970 929.11	-0.68
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産					85 439 476.79	1.53
当座借越およびその他の短期負債					-58 074.37	0.00
その他の資産および負債					-1 513 589.85	-0.02
純資産総額					5 586 016 054.14	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

2021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			
優先株式			
アメリカ合衆国 USD BK OF AMERICA CORP 4.375% DP SH RP 1/1000TH IN アメリカ合衆国合計	20 000.00	507 000.00 507 000.00	0.01 0.01
優先株式合計		507 000.00	0.01
記名株式			
アメリカ合衆国 USD EXTRACTION OIL & GAS INC アメリカ合衆国合計	8 379.00	234 612.00 234 612.00	0.01 0.01
記名株式合計		234 612.00	0.01
預託証券			
アメリカ合衆国 USD WESCO INTL INC DEP SHS EACH REP 1/1000TH アメリカ合衆国合計	67 546.00	2 099 329.68 2 099 329.68	0.05 0.05
預託証券合計		2 099 329.68	0.05
アセット・バック証券、固定利付			
EUR EUR CRC BREEZE FINANCE SA 5.29000% 06-08.05.26 EUR CRC BREEZE FINANCE SA 6.11000% 06-08.05.26 EUR CRC BREEZE FINANCE SA 6.70800% 07-19.04.27 EUR CRC BREEZE FINANCE SA 4.52400% 07-19.04.27 ユーロ合計	1 550 000.00 550 000.00 900 000.00 4 100 000.00	621 711.35 129 992.29 297 458.39 1 373 674.92 2 422 836.95	0.02 0.00 0.01 0.03 0.06
アセット・バック証券、固定利付合計		2 422 836.95	0.06
ノート、固定利付債			
CHF CHF SELECTA GROUP BV-REG-S 5.87500% 18-01.02.24 スイスフラン合計	1 375 000.00	772 819.59 772 819.59	0.02 0.02
EUR EUR 3AB OPTIQUE DEVELOPPEMENT SAS-REG-S 4.00000% 17-01.10.23 EUR ADIENT GLOBAL HOLDINGS LTD-REG-S 3.50000% 16-15.08.24 EUR ADLER GROUP SA-REG-S 2.75000% 20-13.11.26 EUR ADLER GROUP SA-REG-S 1.87500% 21-14.01.26 EUR ADLER GROUP SA-REG-S 2.25000% 21-14.01.29 EUR ADO PROPERTIES SA-REG-S 3.25000% 20-05.08.25 EUR ALGECO SCOTSMAN GLOBAL FINANCE-REG-S 6.50000% 18-15.02.23 EUR ALTICE FINCO SA-REG-S 4.75000% 17-15.01.28 EUR ALTICE FRANCE-REG-S 5.87500% 18-01.02.27 EUR AMPLIFON SPA-REG-S 1.12500% 20-13.02.27 EUR AMS AG-REG-S 6.00000% 20-31.07.25 EUR ARD FINANCE SA-REG-S (PIK) 5.00000% 19-30.06.27 EUR ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-REG-S 2.12500% 19-15.08.26 EUR ARENA LUXEMBOURG FINANCE SARL-REG-S 1.87500% 20-01.02.28	2 335 000.00 2 200 000.00 200 000.00 600 000.00 1 600 000.00 1 700 000.00 700 000.00 1 500 000.00 7 845 000.00 1 000 000.00 2 900 000.00 2 000 000.00 1 170 000.00 3 775 000.00	2 858 067.44 2 675 810.93 244 237.67 710 349.12 1 872 889.84 2 140 198.21 863 002.76 1 763 590.15 10 217 267.11 1 204 369.25 3 786 605.18 2 492 663.79 1 424 946.78 4 187 106.38	0.07 0.07 0.01 0.02 0.05 0.05 0.02 0.04 0.26 0.03 0.10 0.06 0.04 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

2021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 ASHLAND SERVICES BV-REG-S 2.00000% 20-30.01.28	2 735 000.00	3 327 071.09	0.08
EUR AUTOSTRADA PER L' ITALIA SPA-REG-S 2.00000% 20-04.12.28	5 546 000.00	6 720 990.82	0.17
EUR AVANTOR FUNDING INC-REG-S 3.87500% 20-15.07.28	1 963 000.00	2 504 353.46	0.06
EUR BALL CORP 4.37500% 15-15.12.23	3 500 000.00	4 698 549.21	0.12
EUR BLITZ F18-674 GMBH-REG-S 6.00000% 18-30.07.26	2 425 000.00	3 053 666.33	0.08
EUR CANPACK SA AND EASTERN PA-REG-S 2.37500% 20-01.11.27	1 110 000.00	1 388 806.37	0.04
EUR CASINO GUICHARD PERRACHON SA-REG-S 6.62500% 20-15.01.26	707 000.00	855 713.30	0.02
EUR CATALENT PHARMA SOLUTIONS INC-REG-S 2.37500% 20-01.03.28	3 350 000.00	4 060 147.20	0.10
EUR CELLNEX TELECOM SA 1.87500% 20-26.06.29	2 200 000.00	2 725 433.76	0.07
EUR CEMEX SAB DE CV-REG-S 2.75000% 17-05.12.24	1 000 000.00	1 224 011.75	0.03
EUR CHEPLAPHARM ARZNEIMITTEL GMBH-REG-S 3.50000% 20-11.02.27	800 000.00	969 599.05	0.02
EUR CMA CGM SA-REG-S 7.50000% 20-15.01.26	6 382 000.00	8 283 737.59	0.21
EUR CONSTELLUM SE-REG-S 4.25000% 17-15.02.26	2 570 000.00	3 165 224.54	0.08
EUR CONSUS REAL ESTATE AG-REG-S 9.62500% 19-15.05.24	3 885 000.00	5 045 558.68	0.13
EUR COTY INC-REG-S 4.75000% 18-15.04.26	2 600 000.00	2 859 323.04	0.07
EUR CROWN EUROPEAN HOLDINGS SA-REG-S 2.25000% 18-01.02.23	1 965 000.00	2 443 833.13	0.06
EUR CROWN EUROPEAN HOLDINGS SA-REG-S 2.87500% 18-01.02.26	1 350 000.00	1 755 077.22	0.04
EUR CROWN EUROPEAN HOLDINGS SA-REG-S 0.75000% 19-15.02.23	3 100 000.00	3 760 352.41	0.09
EUR DEMIRE DUTCH MITSTND REL EST AG-REG-S 1.87500% 19-15.10.24	1 800 000.00	2 115 748.36	0.05
EUR DIEBOLD NIXDORF DUTCH HOLDING BV-REG-S 9.00000% 20-15.07.25	520 000.00	691 625.07	0.02
EUR DKT FINANCE APS-REG-S 7.00000% 18-17.06.23	7 200 000.00	8 967 886.41	0.23
EUR DOVALUE SPA-REG-S 5.00000% 20-04.08.25	1 500 000.00	1 908 547.15	0.05
EUR DUFREY ONE BV-REG-S 2.50000% 17-15.10.24	1 400 000.00	1 602 740.78	0.04
EUR DUFREY ONE BV-REG-S 2.00000% 19-15.02.27	2 000 000.00	2 230 916.01	0.06
EUR EDREAMS ODIGEO SA-REG-S 5.50000% 18-01.09.23	1 000 000.00	1 132 894.25	0.03
EUR EG GLOBAL FINANCE PLC-REG-S 4.37500% 19-07.02.25	2 550 000.00	3 047 807.48	0.08
EUR EG GLOBAL FINANCE PLC-REG-S 6.25000% 19-30.10.25	1 000 000.00	1 244 422.07	0.03
EUR EL CORTE INGLES SA-REG-S 3.00000% 18-15.03.24	2 300 000.00	2 825 984.97	0.07
EUR ELLAKTOR VALUE PLC-REG-S 6.37500% 19-15.12.24	2 375 000.00	2 669 675.93	0.07
EUR EQUINIX INC 2.87500% 17-01.02.26	1 800 000.00	1 110 165.41	0.03
EUR FAURECIA SE-REG-S 3.75000% 20-15.06.28	1 500 000.00	1 915 581.42	0.05
EUR FINANCIAL & RISK US HOLDINGS INC-REG-S 6.87500% 18-15.11.26	1 000 000.00	1 309 620.90	0.03
EUR FINANCIAL & RISK US HOLDINGS INC-REG-S 4.50000% 18-15.05.26	950 000.00	1 210 847.10	0.03
EUR FORD MOTOR CREDIT CO LLC 1.51400% 19-17.02.23	1 325 000.00	1 606 523.01	0.04
EUR FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.38600% 19-17.02.26	2 000 000.00	2 446 444.13	0.06
EUR FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.33000% 19-25.11.25	1 125 000.00	1 376 031.88	0.03
EUR FORTUNE STAR BVI LTD-REG-S 4.35000% 19-06.05.23	1 630 000.00	2 002 565.23	0.05
EUR GARFUNKELUX HOLDCO 3 SA-REG-S 6.75000% 20-01.11.25	330 000.00	410 162.15	0.01
EUR GRIFOLS SA-REG-S 1.62500% 19-15.02.25	913 000.00	1 105 953.73	0.03
EUR HEMA BONDCO II BV-REG-S * DEFAULTED * 8.50000% 17-15.01.23	1 542 000.00	14 893.34	0.00
EUR HOUSE OF FINANCE NV/THE-REG-S 4.37500% 19-15.07.26	2 275 000.00	2 763 925.13	0.07
EUR HOUSE OF HR-REG-S-SUB 7.50000% 20-15.01.27	775 000.00	960 378.45	0.02
EUR IHO VERWALTUNGS GMBH-REG-S (PIK) 3.62500% 19-15.05.25	2 600 000.00	3 226 115.92	0.08
EUR IHO VERWALTUNGS GMBH-REG-S (PIK) 3.87500% 19-15.05.27	4 275 000.00	5 376 266.35	0.14
EUR INEOS QUATTRO FINANCE 1 PLC-REG-S 3.75000% 21-15.07.26	160 000.00	196 977.08	0.00
EUR INTERNATIONAL DESIGN GROUP SPA-REG-S 6.50000% 18-15.11.25	4 425 000.00	5 594 206.11	0.14
EUR INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC-REG-S 4.75000% 15-15.02.23	2 325 000.00	2 925 182.84	0.07
EUR INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC-REG-S 3.50000% 19-15.06.26	280 000.00	345 206.55	0.01
EUR INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC-REG-S 2.37500% 19-15.04.28	1 000 000.00	1 180 979.99	0.03
EUR INTERTRUST GROUP BV-REG-S 3.37500% 18-15.11.25	3 025 000.00	3 741 958.82	0.09
EUR INTRUM AB-REG-S 3.00000% 19-15.09.27	3 325 000.00	3 868 589.06	0.10
EUR INTRUM AB-REG-S 4.87500% 20-15.08.25	2 425 000.00	3 041 881.80	0.08
EUR IQVIA INC-REG-S 2.25000% 19-15.01.28	2 985 000.00	3 657 025.94	0.09
EUR IQVIA INC-REG-S 2.87500% 20-15.06.28	4 550 000.00	5 693 628.85	0.14
EUR JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-REG-S 4.50000% 18-15.01.26	700 000.00	848 099.82	0.02
EUR JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-REG-S 6.87500% 19-15.11.26	847 000.00	1 129 036.95	0.03
EUR JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-REG-S 5.87500% 19-15.11.24	1 110 000.00	1 435 519.75	0.04
EUR JAMES HARDIE INTERNATIONAL LTD-REG-S 3.62500% 18-01.10.26	1 600 000.00	1 993 077.46	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

2021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 KRONOS INTERNATIONAL INC-REG-S 3.75000% 17-15.09.25	3 705 000.00	4 565 076.58	0.12
EUR LA FINANCIERE ATALIAN SA-REG-S 5.12500% 18-15.05.25	3 205 000.00	3 679 379.96	0.09
EUR LABORATOIRE EIMER SELARL-REG-S 5.00000% 21-01.02.29	670 000.00	830 822.28	0.02
EUR LHMC FINCO SARL-REG-S 6.25000% 18-20.12.23	1 500 000.00	1 780 618.18	0.05
EUR LINCOLN FINANCING SARL-REG-S 3.62500% 19-01.04.24	4 245 000.00	5 170 143.62	0.13
EUR LOUIS DREYFUS CO BV-REG-S 2.37500% 20-27.11.25	1 327 000.00	1 663 761.81	0.04
EUR LOXAM SAS-REG-S-SUB 5.75000% 19-15.07.27	625 000.00	760 831.12	0.02
EUR MATTERHORN TELECOM SA-REG-S 4.00000% 17-15.11.27	4 127 000.00	5 090 103.47	0.13
EUR MAXEDA DIY HOLDING BV-REG-S 5.87500% 20-01.10.26	2 005 000.00	2 490 681.68	0.06
EUR MONITCHEM HOLDCO 2 SA-REG-S-SUB 9.50000% 19-15.09.26	500 000.00	652 957.72	0.02
EUR MONITCHEM HOLDCO 3 SA-REG-S 5.25000% 19-15.03.25	500 000.00	625 673.50	0.02
EUR MOTION BONDCO DAC-REG-S 4.50000% 19-15.11.27	475 000.00	535 758.75	0.01
EUR MYTILINEOS FINANCIAL PARTNERS SA-REG-S 2.50000% 19-01.12.24	1 000 000.00	1 249 524.65	0.03
EUR NETFLIX INC 3.62500% 17-15.05.27	9 075 000.00	12 761 689.25	0.32
EUR NETFLIX INC-REG-S 3.87500% 19-15.11.29	3 260 000.00	4 839 124.37	0.12
EUR NETFLIX INC-REG-S 3.62500% 19-15.06.30	1 210 000.00	1 780 572.63	0.05
EUR NEXI SPA-REG-S 1.75000% 19-31.10.24	580 000.00	717 325.56	0.02
EUR NIDDA HEALTHCARE HOLDING AG-REG-S 3.50000% 17-30.09.24	13 704 000.00	16 670 600.02	0.42
EUR NITROGENMUEK RT-REG-S 7.00000% 18-14.05.25	1 260 000.00	1 484 372.41	0.04
EUR NOMAD FOODS BONDCO PLC-REG-S 3.25000% 17-15.05.24	1 000 000.00	1 227 073.30	0.03
EUR OCI NV-REG-S 3.12500% 19-01.11.24	2 000 000.00	2 480 111.44	0.06
EUR PEACH PROPERTY FINANCE GMBH-REG-S 3.50000% 19-15.02.23	2 190 000.00	2 708 986.89	0.07
EUR PIAGGIO & C SPA-REG-S 3.62500% 18-30.04.25	430 000.00	530 560.73	0.01
EUR PLAYTECH PLC-REG-S 3.75000% 18-12.10.23	3 100 000.00	3 808 559.64	0.10
EUR PROGROUPE AG-REG-S 3.00000% 18-31.03.26	4 500 000.00	5 517 838.89	0.14
EUR PVH CORP-REG-S 3.12500% 17-15.12.27	675 000.00	921 090.22	0.02
EUR QUINTILES IMS INC-REG-S 2.87500% 17-15.09.25	4 353 000.00	5 339 546.22	0.13
EUR RAFFINERIE HEIDE GMBH-REG-S 6.37500% 17-01.12.22	1 400 000.00	1 489 953.36	0.04
EUR SALINI IMPREGILO SPA-REG-S 1.75000% 17-26.10.24	400 000.00	446 986.01	0.01
EUR SALINI IMPREGILO SPA-REG-S 3.62500% 20-28.01.27	910 000.00	994 472.43	0.02
EUR SAZKA GROUP AS-REG-S 4.12500% 19-20.11.24	2 500 000.00	3 043 893.99	0.08
EUR SAZKA GROUP AS-REG-S 3.87500% 20-15.02.27	700 000.00	820 399.19	0.02
EUR SCIENTIFIC GAMES INTERNATIONAL-REG-S 5.50000% 18-15.02.26	1 400 000.00	1 670 414.61	0.04
EUR SELECTA GROUP BV-REG-S 5.87500% 18-01.02.24	1 725 000.00	946 255.78	0.02
EUR SIG COMBIBLOC PURCHASECO SARL-REG-S 2.12500% 20-18.06.25	520 000.00	670 000.34	0.02
EUR SILGAN HOLDINGS INC 3.25000% 18-15.03.25	460 000.00	563 112.47	0.01
EUR SILGAN HOLDINGS INC 2.25000% 20-01.06.28	4 418 000.00	5 434 220.47	0.14
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 3.12500% 17-19.09.25	2 925 000.00	3 653 367.09	0.09
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 4.00000% 17-19.09.29	2 100 000.00	2 728 859.78	0.07
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 5.00000% 18-15.04.28	5 475 000.00	7 448 902.09	0.19
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 4.00000% 18-20.04.23	3 100 000.00	3 931 676.39	0.10
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 4.50000% 18-20.04.25	1 575 000.00	2 074 753.67	0.05
EUR STANDARD INDUSTRIES INC/NJ-REG-S 2.25000% 19-21.11.26	6 380 000.00	7 872 167.69	0.20
EUR STELLANTIS NV-REG-S 3.37500% 20-07.07.23	1 200 000.00	1 558 529.12	0.04
EUR STELLANTIS NV-REG-S 3.87500% 20-05.01.26	2 140 000.00	3 009 264.05	0.08
EUR STELLANTIS NV-REG-S 4.50000% 20-07.07.28	1 067 000.00	1 640 055.86	0.04
EUR SUMMER BC HOLDCO A SARL-REG-S 9.25000% 19-31.10.27	500 000.00	581 553.45	0.01
EUR SYNTHOMER PLC-REG-S 3.87500% 20-01.07.25	2 125 000.00	2 703 258.80	0.07
EUR TELE COLUMBUS AG-REG-S 3.87500% 18-02.05.25	850 000.00	1 040 723.92	0.03
EUR TELENET FINANCE LUXEMBOURG-REG-S 3.50000% 17-01.03.28	1 700 000.00	2 141 115.22	0.05
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 3.25000% 18-15.04.22	1 630 000.00	2 009 991.30	0.05
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 4.50000% 18-01.03.25	275 000.00	349 653.92	0.01
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FIN 6.00000% 20-31.01.25	990 000.00	1 318 139.93	0.03
EUR THYSSENKRUPP AG-REG-S 1.37500% 17-03.03.22	1 000 000.00	1 211 862.75	0.03
EUR UNILABS SUBHOLDING AB-REG-S 5.75000% 17-15.05.25	1 350 000.00	1 672 917.30	0.04
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 4.87500% 17-01.07.24	1 625 000.00	2 013 696.75	0.05
EUR VERISURE MIDHOLDING AB-REG-S 5.25000% 21-15.02.29	9 626 000.00	11 956 446.72	0.30
EUR VERITAS US INC / BERMUDA LTD-REG-S 7.50000% 16-01.02.23	2 350 000.00	2 855 015.00	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

2021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 VERTICAL HOLDCO GMBH-REG-S 6.62500% 20-15.07.28	1 650 000.00	2 131 567.45	0.05
EUR VICTORIA PLC-REG-S 5.25000% 19-15.07.24	1 340 000.00	1 684 944.81	0.04
EUR VIRGIN MEDIA FINANCE PLC-REG-S 3.75000% 20-15.07.30	2 100 000.00	2 608 694.03	0.07
EUR VIRIDIAN GROUP FIN/ POWER & ENER-REG-S 4.00000% 17-15.09.25	2 550 000.00	3 128 627.97	0.08
EUR WEBUILD SPA-REG-S 5.87500% 20-15.12.25	590 000.00	720 618.66	0.02
EUR WMG ACQUISITION CORP-REG-S 3.62500% 18-15.10.26	4 500 000.00	5 648 534.20	0.14
EUR WMG ACQUISITION CORP-REG-S 2.75000% 20-15.07.28	5 204 000.00	6 524 401.56	0.16
EUR ZF EUROPE FINANCE BV-REG-S 3.00000% 19-23.10.29	1 400 000.00	1 718 038.69	0.04
EUR ZF EUROPE FINANCE BV-REG-S 2.50000% 19-23.10.27	800 000.00	964 603.39	0.02
EUR ZF EUROPE FINANCE BV-REG-S 1.25000% 19-23.10.23	1 000 000.00	1 208 286.08	0.03
EUR ZIGGO BOND CO BV-REG-S 3.37500% 20-28.02.30	3 915 000.00	4 741 018.11	0.12
ユーロ合計		387 021 426.50	9.73
GBP			
GBP AA BOND CO LTD-REG-S 6.50000% 21-31.01.26	340 000.00	474 591.65	0.01
GBP ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-REG-S 4.75000% 17-15.07.27	2 750 000.00	3 915 630.37	0.10
GBP CPUK FINANCE LTD-REG-S 4.87500% 17-28.08.25	800 000.00	1 086 783.43	0.03
GBP CPUK FINANCE LTD-REG-S 6.50000% 20-28.08.26	175 000.00	247 639.46	0.01
GBP HEATHROW FINANCE PLC-REG-S 5.75000% 14-03.03.25	2 058 000.00	3 021 042.75	0.08
GBP MPT OPERATING PARTNERSHIP LP/FIN CORP 3.69200% 19-05.06.28	1 400 000.00	2 083 399.27	0.05
GBP PINNACLE BIDCO PLC-REG-S 6.37500% 18-15.02.25	1 650 000.00	2 226 400.74	0.06
GBP SHOP DIRECT FUNDING PLC-REG-S 7.75000% 17-15.11.22	700 000.00	978 215.50	0.02
GBP TALKTALK TELECOM GROUP PLC-REG-S 3.87500% 20-20.02.25	600 000.00	800 248.78	0.02
GBP VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC-REG-S 5.25000% 19-15.05.29	1 750 000.00	2 598 231.72	0.06
GBP VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC-REG-S 4.25000% 19-15.01.30	1 380 000.00	1 954 519.50	0.05
GBP WAGAMAMA FINANCE PLC-REG-S 4.12500% 17-01.07.22	1 300 000.00	1 749 456.80	0.04
英ポンド合計		21 136 159.97	0.53
USD			
USD ALGECO SCOTSMAN GLOBAL FINANCE-144A 8.00000% 18-15.02.23	575 000.00	586 787.50	0.01
USD ALTICE FINANCING SA-144A 5.00000% 20-15.01.28	1 600 000.00	1 640 000.00	0.04
USD ALTICE FRANCE HOLDING SA 6.00000% 20-15.02.28	668 000.00	673 010.00	0.02
USD ALTICE FRANCE SA/FRANCE-144A 5.50000% 19-15.01.28	1 752 000.00	1 824 270.00	0.05
USD ALTICE FRANCE-144A 7.37500% 16-01.05.26	1 306 000.00	1 366 010.70	0.03
USD ALTICE FRANCE-144A 8.12500% 18-01.02.27	4 539 000.00	5 004 247.50	0.13
USD AMERICAN AXLE & MANUFACTURING INC 6.25000% 18-01.04.25	405 000.00	417 150.00	0.01
USD AMERICAN AXLE & MANUFACTURING INC 6.50000% 18-01.04.27	75 000.00	78 453.75	0.00
USD AMERICAN AXLE & MANUFACTURING INC 6.25000% 18-15.03.26	1 975 000.00	2 019 437.50	0.05
USD AMERICAN AXLE & MANUFACTURING INC 6.87500% 20-01.07.28	475 000.00	499 296.25	0.01
USD AMERIGAS FINANCE LLC/AMERIGAS FIN CORP 5.87500% 16-20.08.26	110 000.00	126 222.25	0.00
USD AMS AG-144A 7.00000% 20-31.07.25	1 894 000.00	2 078 665.00	0.05
USD ANTERO RESOURCES CORP 5.00000% 17-01.03.25	1 350 000.00	1 279 125.00	0.03
USD APACHE CORP 4.25000% 19-15.01.30	569 000.00	561 887.50	0.01
USD APACHE CORP 4.37500% 18-15.10.28	1 272 000.00	1 266 454.08	0.03
USD APACHE CORP 4.62500% 20-15.11.25	455 000.00	466 375.00	0.01
USD APACHE CORP 4.87500% 20-15.11.27	1 030 000.00	1 058 325.00	0.03
USD APACHE CORP 6.00000% 07-15.01.37	1 050 000.00	1 170 750.00	0.03
USD ARCONIC INC 5.12500% 14-01.10.24	3 515 000.00	3 866 886.65	0.10
USD ARCONIC INC 5.95000% 07-01.02.37	670 000.00	819 912.50	0.02
USD ARD FINANCE SA-144A (PIK) 6.50000% 19-30.06.27	5 441 000.00	5 719 851.25	0.14
USD ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-144A 6.00000% 17-15.02.25	1 725 000.00	1 775 680.50	0.04
USD ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-144A 4.12500% 19-15.08.26	600 000.00	618 750.00	0.01
USD ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-144A 5.25000% 19-15.08.27	1 800 000.00	1 865 772.00	0.05
USD B&G FOODS INC 5.25000% 17-01.04.25	854 000.00	877 058.00	0.02
USD B&G FOODS INC 5.25000% 19-15.09.27	1 849 000.00	1 946 072.50	0.05
USD BANFF MERGER SUB INC-144A 9.75000% 18-01.09.26	1 162 000.00	1 229 535.44	0.03
USD BANIJAY ENTERTAINMENT SASU-144A 5.37500% 20-01.03.25	200 000.00	204 250.00	0.01
USD BARRY CALLEBAUT SERVICES NV-REG-S 5.50000% 13-15.06.23	1 954 000.00	2 085 895.00	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

2021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 BAUSCH HEALTH COS INC-144A 7.00000% 19-15.01.28	450 000.00	486 990.00	0.01
USD BAUSCH HEALTH COS INC-144A 7.25000% 19-30.05.29	469 000.00	522 348.75	0.01
USD BEAZER HOMES USA INC 5.87500% 18-15.10.27	316 000.00	333 775.00	0.01
USD BED BATH & BEYOND INC 3.74900% 14-01.08.24	900 000.00	911 430.00	0.02
USD BED BATH & BEYOND INC 5.16500% 14-01.08.44	3 980 000.00	3 633 740.00	0.09
USD BLUE CUBE SPINCO INC 10.00000% 16-15.10.25	4 104 000.00	4 360 500.00	0.11
USD BOEING CO 3.62500% 20-01.02.31	679 000.00	731 785.55	0.02
USD BOMBARDIER INC-144A 8.75000% 16-01.12.21	375 000.00	392 812.50	0.01
USD BRINKER INTERNATIONAL INC 3.87500% 13-15.05.23	510 000.00	513 187.50	0.01
USD BRUNDAGE-BONE CON HOLD INC-144A 6.00000% 21-01.02.26	880 000.00	895 400.00	0.02
USD BUCKEYE PARTNERS LP 3.95000% 16-01.12.26	395 000.00	397 879.55	0.01
USD BUCKEYE PARTNERS LP 4.12500% 17-01.12.27	335 000.00	342 721.75	0.01
USD CALPINE CORP-144A 3.75000% 20-01.03.31	1 465 000.00	1 424 712.50	0.03
USD CARNIVAL CORP-144A 7.62500% 20-01.03.26	362 000.00	382 764.32	0.01
USD CDK GLOBAL INC 5.87500% 18-15.06.26	1 446 000.00	1 507 708.05	0.04
USD CEDAR FAIR LP/CANADAS WONDERLAND 5.37500% 15-01.06.24	320 000.00	320 000.00	0.01
USD CEMEX SAB DE CV-REG-S 5.45000% 19-19.11.29	1 250 000.00	1 357 500.00	0.03
USD CEMEX SAB DE CV-REG-S 7.37500% 20-05.06.27	594 000.00	670 329.00	0.02
USD CEMEX SAV DE CV-REG-S 5.20000% 20-17.09.30	862 000.00	937 425.00	0.02
USD CEMEX SAV DE CV-REG-S 3.87500% 21-11.07.31	532 000.00	532 000.00	0.01
USD CENOVUS ENERGY INC 5.37500% 20-15.07.25	470 000.00	531 067.47	0.01
USD CENTENE CORP 3.00000% 20-15.10.30	1 265 000.00	1 323 126.75	0.03
USD CENTRAL GARDEN & PET CO 5.12500% 17-01.02.28	960 000.00	1 012 800.00	0.02
USD CENTRAL GARDEN & PET CO 4.12500% 20-15.10.30	2 534 000.00	2 649 056.27	0.07
USD CENTURY COMMUNITIES INC 6.75000% 20-01.06.27	2 420 000.00	2 591 529.60	0.07
USD CENTURYLINK INC 5.62500% 15-01.04.25	1 000 000.00	1 090 000.00	0.03
USD CENTURYLINK INC 6.75000% 13-01.12.23	2 065 000.00	2 288 649.82	0.06
USD CENTURYLINK INC 7.50000% 16-01.04.24	184 000.00	207 421.36	0.01
USD CENTURYLINK INC 7.60000% 09-15.09.39	1 150 000.00	1 421 515.00	0.03
USD CENTURYLINK INC 7.65000% 12-15.03.42	600 000.00	742 920.00	0.02
USD CHEMOURS CO/THE 7.00000% 16-15.05.25	538 000.00	556 157.50	0.01
USD CHEPLAPHARM ARZNEIMITTEL GMBH-144A 5.50000% 20-15.01.28	2 263 000.00	2 328 061.25	0.06
USD CIMPRESS PLC-144A 7.00000% 18-15.06.26	2 016 000.00	2 112 566.40	0.05
USD CINEMARK USA INC 4.87500% 13-01.06.23	1 655 000.00	1 590 868.75	0.04
USD CIT GROUP INC 4.12500% 18-09.03.21	2 465 000.00	2 466 232.50	0.06
USD CIT GROUP INC-SUB 6.12500% 18-09.03.28	1 580 000.00	1 963 150.00	0.05
USD CLEVELAND-CLIFFS INC 5.75000% 18-01.03.25	5 563 000.00	5 688 167.50	0.14
USD CONTINENTAL RESOURCES INC 4.37500% 18-15.01.28	926 000.00	944 325.54	0.02
USD CORNERSTONE BUILDING BRANDS INC-144A 8.00000% 18-15.04.26	1 948 000.00	2 035 660.00	0.05
USD COVANTA HOLDING CORP 5.87500% 17-01.07.25	940 000.00	975 250.00	0.02
USD COVANTA HOLDING CORP 5.00000% 20-01.09.30	2 042 000.00	2 144 100.00	0.05
USD CRESTWOOD MIDSTREAM PART LP/FIN 5.75000% 17-01.04.25	2 200 000.00	2 178 000.00	0.05
USD CROWDSTRIKE HOLDINGS INC 3.00000% 21-15.02.29	1 833 000.00	1 854 766.88	0.05
USD CROWN AMERICAS LLC/CAPITAL CORP V 4.25000% 17-30.09.26	790 000.00	856 498.25	0.02
USD CSC HOLDINGS LLC 6.75000% 11-15.11.21	2 000 000.00	2 071 870.00	0.05
USD DANA INC 5.37500% 19-15.11.27	1 105 000.00	1 163 012.50	0.03
USD DANA INC 5.62500% 20-15.06.28	170 000.00	181 261.65	0.00
USD DCP MIDSTREAM OPERATING LP 5.12500% 19-15.05.29	725 000.00	788 517.25	0.02
USD DELL INC 6.50000% 08-15.04.38	740 000.00	913 900.00	0.02
USD DELTA AIR LINES INC 2.90000% 19-28.10.24	785 000.00	771 262.50	0.02
USD DELTA AIR LINES INC 7.37500% 20-15.01.26	1 480 000.00	1 700 263.65	0.04
USD DIEBOLD INC 8.50000% 16-15.04.24	5 580 000.00	5 691 600.00	0.14
USD DISH DBS CORP 5.00000% 13-15.03.23	650 000.00	669 532.50	0.02
USD DISH DBS CORP 5.87500% 12-15.07.22	3 013 000.00	3 133 520.00	0.08
USD DISH DBS CORP 5.87500% 14-15.11.24	75 000.00	77 720.25	0.00
USD DRAX FINCO PLC-144A 6.62500% 18-01.11.25	2 518 000.00	2 615 572.50	0.06
USD ENCOMPASS HEALTH CORP 4.50000% 19-01.02.28	1 874 000.00	1 951 302.50	0.05
USD ENCOMPASS HEALTH CORP 4.75000% 19-01.02.30	2 419 000.00	2 601 852.21	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

2021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 ENCOMPASS HEALTH CORP 4.62500% 20-01.04.31	544 000.00	578 000.00	0.01
USD ENLINK MIDSTREAM LLC 5.37500% 19-01.06.29	1 299 000.00	1 240 545.00	0.03
USD ENLINK MIDSTREAM PARTNERS LP 5.60000% 14-01.04.44	400 000.00	321 000.00	0.01
USD ENLINK MIDSTREAM PARTNERS LP 5.45000% 17-01.06.47	750 000.00	600 000.00	0.02
USD EQT CORP 3.00000% 17-01.10.22	864 000.00	877 482.72	0.02
USD EQT CORP 3.90000% 17-01.10.27	3 750 000.00	3 895 312.50	0.10
USD EQT CORP 5.00000% 20-15.01.29	226 000.00	245 775.00	0.01
USD EQT CORP 6.12500% 20-01.02.25	1 078 000.00	1 270 369.10	0.03
USD EQT CORP 7.00000% 20-01.02.30	456 000.00	581 500.32	0.01
USD FIRST QUANTUM MINERALS LTD-144A 7.25000% 17-01.04.23	852 000.00	869 086.86	0.02
USD FIRST QUANTUM MINERALS LTD-144A 7.50000% 17-01.04.25	585 000.00	605 855.25	0.01
USD FIRSTENERGY CORP 2.65000% 20-01.03.30	475 000.00	470 250.00	0.01
USD FIRSTENERGY CORP 3.90000% 17-15.07.27	622 000.00	679 535.00	0.02
USD FIRSTENERGY CORP 4.85000% 17-15.07.47	830 000.00	1 003 702.40	0.03
USD FLUOR CORP 3.50000% 14-15.12.24	820 000.00	815 637.60	0.02
USD FORD MOTOR CO 4.75000% 13-15.01.43	2 186 000.00	2 206 338.76	0.06
USD FORD MOTOR CO 8.50000% 20-21.04.23	4 459 000.00	4 996 309.50	0.13
USD FORD MOTOR CO 9.00000% 20-22.04.25	9 380 000.00	11 431 875.00	0.29
USD FORD MOTOR CO 9.62500% 20-22.04.30	2 626 000.00	3 721 537.26	0.09
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.08700% 20-09.01.23	200 000.00	202 210.00	0.01
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 5.12500% 20-16.06.25	2 263 000.00	2 457 618.00	0.06
USD FORD MOTOR CREDIT CO 4.12500% 20-17.08.27	3 246 000.00	3 416 415.00	0.09
USD FORD MOTOR CREDIT CO 4.00000% 20-13.11.30	9 060 000.00	9 286 500.00	0.23
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.25000% 12-20.09.22	391 000.00	403 711.41	0.01
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.37500% 13-06.08.23	1 979 000.00	2 061 049.34	0.05
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.66400% 14-08.09.24	570 000.00	584 592.00	0.01
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.33600% 16-18.03.21	1 106 000.00	1 107 278.54	0.03
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.81000% 17-09.01.24	272 000.00	281 180.00	0.01
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.33900% 17-28.03.22	502 000.00	508 541.06	0.01
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.81500% 17-02.11.27	1 007 000.00	1 035 623.98	0.03
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.81300% 18-12.10.21	1 700 000.00	1 722 576.00	0.04
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 5.59600% 19-07.01.22	952 000.00	980 560.00	0.02
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 5.58400% 19-18.03.24	203 000.00	219 347.59	0.01
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.35000% 19-01.11.22	850 000.00	863 557.50	0.02
USD FREEPORT-MCMORAN COPPER & GOLD INC 5.00000% 19-01.09.27	550 000.00	585 750.00	0.01
USD FREEPORT-MCMORAN INC 5.40000% 14-14.11.34	95 000.00	118 037.50	0.00
USD FREEPORT-MCMORAN INC 4.55000% 14-14.11.24	285 000.00	312 515.19	0.01
USD FREEPORT-MCMORAN INC 4.37500% 20-01.08.28	605 000.00	641 103.38	0.02
USD FREEPORT-MCMORAN INC 4.62500% 20-01.08.30	585 000.00	649 510.87	0.02
USD GEMS MENASA CAYMAN LTD/GEDL-144A 7.12500% 19-31.07.26	3 706 000.00	3 870 453.75	0.10
USD GENESIS ENERGY LP 7.75000% 20-01.02.28	4 939 000.00	4 580 922.50	0.12
USD GENESIS ENERGY LP 8.00000% 20-15.01.27	2 026 000.00	1 925 307.80	0.05
USD GLOBAL PARTNERS LP 7.00000% 20-01.08.27	865 000.00	913 656.25	0.02
USD GOODYEAR TIRE & RUBBER CO 9.50000% 20-31.05.25	625 000.00	700 000.00	0.02
USD HB FULLER CO 4.00000% 17-15.02.27	100 000.00	104 000.00	0.00
USD HB FULLER CO 4.25000% 20-15.10.28	140 000.00	143 150.00	0.00
USD HCA INC 3.50000% 20-01.09.30	1 563 000.00	1 623 347.78	0.04
USD HCA INC 5.37500% 18-01.09.26	2 710 000.00	3 087 137.15	0.08
USD HCA INC 5.62500% 18-01.09.28	875 000.00	1 024 773.75	0.03
USD HCA INC 5.87500% 15-15.02.26	980 000.00	1 120 875.00	0.03
USD HCA INC 5.87500% 19-01.02.29	1 430 000.00	1 703 265.85	0.04
USD HCA INC 7.69000% 95-15.06.25	1 970 000.00	2 371 387.50	0.06
USD HECLA MINING CO 7.25000% 20-15.02.28	3 890 000.00	4 206 062.50	0.11
USD HILLENBRAND INC 4.50000% 19-15.09.26	2 607 000.00	2 958 945.00	0.07
USD HILLENBRAND INC 5.75000% 20-15.06.25	604 000.00	649 300.00	0.02
USD HILTON WORLDWIDE FIN LLC/CORP 4.87500% 17-01.04.27	2 150 000.00	2 248 308.75	0.06
USD HOWMET AEROSPACE INC 6.87500% 20-01.05.25	3 631 000.00	4 230 115.00	0.11
USD ICAHN ENTERPRISES LP/FINANCE CORP 6.25000% 19-15.05.26	6 047 000.00	6 389 188.23	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 - ハイ・イールド

2021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 IHEARTCOMMUNICATIONS INC-144A 4.75000% 19-15.01.28	150 000.00	153 187.50	0.00
USD IHO VERWALTUNGS GMBH-144A (PIK) 6.37500% 19-15.05.29	773 000.00	850 300.00	0.02
USD INEOS GROUP HOLDINGS SA-144A 5.62500% 16-01.08.24	3 310 000.00	3 368 620.10	0.08
USD ISTAR INC 4.25000% 19-01.08.25	3 235 000.00	3 186 475.00	0.08
USD ISTAR INC 4.75000% 19-01.10.24	3 325 000.00	3 410 502.38	0.09
USD ISTAR INC 5.50000% 20-15.02.26	1 195 000.00	1 214 418.75	0.03
USD JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-114A 5.87500% 20-15.01.28	2 100 000.00	2 138 482.50	0.05
USD KB HOME 6.87500% 19-15.06.27	3 050 000.00	3 591 375.00	0.09
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 6.87500% 12-26.01.39	4 454 000.00	6 122 180.67	0.15
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 3.00000% 16-01.06.26	1 675 000.00	1 771 428.48	0.04
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 4.62500% 18-30.01.29	563 000.00	643 104.76	0.02
USD L BRANDS INC 6.75000% 16-01.07.36	338 000.00	386 165.00	0.01
USD L BRANDS INC 6.87500% 15-01.11.35	1 631 000.00	1 890 801.99	0.05
USD L BRANDS INC 7.50000% 19-15.06.29	3 670 000.00	4 110 400.00	0.10
USD L BRANDS INC 7.60000% 07-15.07.37	219 000.00	242 542.50	0.01
USD LAREDO PETROLEUM 9.50000% 20-15.01.25	3 259 000.00	2 796 613.08	0.07
USD LAREDO PETROLEUM INC 10.12500% 20-15.01.28	562 000.00	488 940.00	0.01
USD LEVEL 3 FINANCING INC 5.37500% 16-15.01.24	2 050 000.00	2 051 845.00	0.05
USD LEVEL 3 FINANCING INC 5.25000% 17-15.03.26	1 190 000.00	1 227 128.00	0.03
USD MANITOWOC FOODSERVICE INC 9.50000% 16-15.02.24	6 125 000.00	6 307 463.75	0.16
USD MDC HOLDINGS INC 6.00000% 13-15.01.43	485 000.00	657 175.00	0.02
USD MELCO RESORTS FINANCE LTD-144A 5.37500% 19-04.12.29	424 000.00	443 800.80	0.01
USD MERCER INTERNATIONAL INC 5.50000% 18-15.01.26	355 000.00	363 431.25	0.01
USD MEREDITH CORP 6.87500% 19-01.02.26	5 577 000.00	5 639 183.55	0.14
USD METHANEX CORP 5.12500% 20-15.10.27	770 000.00	804 650.00	0.02
USD METHANEX CORP 5.25000% 19-15.12.29	820 000.00	858 437.50	0.02
USD MGM CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 5.25000% 20-18.06.25	330 000.00	341 675.40	0.01
USD MGM GROWTH POP LP/CO-ISSUER INC 5.62500% 17-01.05.24	5 125 000.00	5 498 023.13	0.14
USD MGM RESORTS INTERNATIONAL 6.75000% 20-01.05.25	2 350 000.00	2 515 968.75	0.06
USD MGM RESORTS INTERNATIONAL 4.75000% 20-15.10.28	1 865 000.00	1 943 003.62	0.05
USD MGM RESORTS INTL 5.50000% 19-15.04.27	1 350 000.00	1 462 009.50	0.04
USD MGM RESORTS INTL 5.75000% 18-15.06.25	1 312 000.00	1 435 754.41	0.04
USD MOTION BONDCO DAC-144A 6.62500% 19-15.11.27	200 000.00	199 704.00	0.01
USD MPT OPERATING PARTNERSHIP LP/FIN CORP 5.00000% 17-15.10.27	4 350 000.00	4 611 000.00	0.12
USD MPT OPERATING PARTNERSHIP LP/FIN CORP 4.62500% 19-01.08.29	2 110 000.00	2 256 581.70	0.06
USD MSCI INC-144A 4.75000% 16-01.08.26	2 108 000.00	2 181 780.00	0.05
USD MURPHY OIL CORP 6.87500% 16-15.08.24	640 000.00	625 600.00	0.02
USD MURPHY OIL USA INC 4.75000% 19-15.09.29	1 910 000.00	2 044 177.50	0.05
USD MURPHY OIL USA INC 5.62500% 17-01.05.27	245 000.00	262 211.25	0.01
USD NABORS INDUSTRIES INC 5.75000% 18-01.02.25	975 000.00	614 250.00	0.02
USD NAVIENT CORP 4.87500% 21-15.03.28	740 000.00	733 525.00	0.02
USD NAVIENT CORP 5.00000% 20-15.03.27	870 000.00	881 962.50	0.02
USD NAVIENT CORP 7.25000% 16-25.09.23	4 176 000.00	4 598 820.00	0.12
USD NEPTUNE ENERGY BONDCO PLC-144A 6.62500% 18-15.05.25	2 350 000.00	2 297 125.00	0.06
USD NETFLIX INC 4.87500% 18-15.04.28	2 090 000.00	2 446 491.30	0.06
USD NETFLIX INC 5.50000% 15-15.02.22	1 000 000.00	1 046 250.00	0.03
USD NETFLIX INC 5.87500% 18-15.11.28	4 045 000.00	5 076 475.00	0.13
USD NEWELL BRANDS INC 4.20000% 16-01.04.26	930 000.00	1 022 469.90	0.03
USD NEWFIELD EXPLORATION CO 5.37500% 15-01.01.26	460 000.00	502 565.27	0.01
USD NOBLE HOLDING INTERNATIONAL *DEFAULTED* 7.75000% 16-15.01.24	147 000.00	2 940.00	0.00
USD NOKIA CORP 6.62500% 09-15.05.39	90 000.00	117 731.70	0.00
USD NORDSTROM INC 5.00000% 14-15.01.44	3 504 000.00	3 453 765.57	0.09
USD NOURYON HOLDING BV-144A 8.00000% 18-01.10.26	4 046 000.00	4 295 638.20	0.11
USD NRG ENERGY INC 5.75000% 18-15.01.28	1 035 000.00	1 125 277.87	0.03
USD NUSTAR LOGISTICS LP 5.62500% 17-28.04.27	2 100 000.00	2 205 000.00	0.06
USD NUSTAR LOGISTICS LP 5.75000% 20-01.10.25	2 350 000.00	2 491 000.00	0.06
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 2.70000% 12-15.02.23	700 000.00	691 547.50	0.02
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 3.40000% 16-15.04.26	349 000.00	337 109.57	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

2021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 OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 4.40000% 16-15.04.46	4 801 000.00	4 228 576.77	0.11
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 4.20000% 18-15.03.48	2 066 000.00	1 735 440.00	0.04
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 3.50000% 19-15.08.29	458 000.00	424 964.46	0.01
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 2.90000% 19-15.08.24	74 000.00	71 595.00	0.00
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 4.40000% 19-15.08.49	1 663 000.00	1 413 550.00	0.04
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 8.50000% 20-15.07.27	1 502 000.00	1 764 399.40	0.04
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 8.87500% 20-15.07.30	1 287 000.00	1 616 150.25	0.04
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 5.87500% 20-01.09.25	710 000.00	744 222.00	0.02
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 6.37500% 20-01.09.28	424 000.00	462 160.00	0.01
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 6.62500% 20-01.09.30	3 311 000.00	3 724 875.00	0.09
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 5.50000% 20-01.12.25	230 000.00	241 500.00	0.01
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 6.12500% 20-01.01.31	1 828 000.00	1 988 544.10	0.05
USD OCEANEERING INTERNATIONAL INC 4.65000% 14-15.11.24	250 000.00	235 625.00	0.01
USD OCEANEERING INTERNATIONAL INC 6.00000% 18-01.02.28	850 000.00	790 500.00	0.02
USD OCI NV-144A 4.62500% 20-15.10.25	520 000.00	538 109.00	0.01
USD ONEMAIN FINANCE CORP 4.00000% 20-15.09.30	133 000.00	133 958.93	0.00
USD OVINTIV INC 6.50000% 07-01.02.38	30 000.00	35 752.17	0.00
USD OVINTIV INC 8.12500% 00-15.09.30	165 000.00	216 693.40	0.01
USD PARK AEROSPACE HOLDINGS LTD-144A 5.50000% 17-15.02.24	1 400 000.00	1 536 542.24	0.04
USD PENSKE AUTOMOTIVE GROUP INC-SUB 3.50000% 20-01.09.25	1 201 000.00	1 228 082.55	0.03
USD PETROLEOS MEXICANOS 5.35000% 18-12.02.28	2 950 000.00	2 817 987.50	0.07
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.49000% 20-23.01.27	1 000 000.00	1 030 000.00	0.03
USD PG&E CORP 5.25000% 20-01.07.30	785 000.00	863 500.00	0.02
USD PITNEY BOWES INC 4.62500% 14-15.03.24	1 950 000.00	2 008 500.00	0.05
USD QVC INC 5.95000% 13-15.03.43	455 000.00	471 150.90	0.01
USD RADIAN GROUP INC 4.50000% 17-01.10.24	1 920 000.00	2 011 200.00	0.05
USD RADIAN GROUP INC 4.87500% 19-15.03.27	900 000.00	969 750.00	0.02
USD RANGE RESOURCES CORP 4.87500% 16-15.05.25	1 250 000.00	1 223 353.13	0.03
USD RANGE RESOURCES CORP 5.00000% 17-15.03.23	1 397 000.00	1 400 946.53	0.04
USD ROLLS-ROYCE PLC-144A 5.75000% 20-15.10.27	3 552 000.00	3 800 640.00	0.10
USD ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD 7.50000% 97-15.10.27	206 000.00	222 480.00	0.01
USD ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD 5.25000% 12-15.11.22	4 045 000.00	3 984 951.97	0.10
USD ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD 3.70000% 17-15.03.28	465 000.00	405 712.50	0.01
USD SANDS CHINA LTD-REG-S 4.37500% 20-18.06.30	230 000.00	251 562.50	0.01
USD SERVICE PROPERTIES TRUST 4.65000% 14-15.03.24	300 000.00	297 900.00	0.01
USD SERVICE PROPERTIES TRUST 4.95000% 19-01.10.29	90 000.00	85 126.05	0.00
USD SIGMA HOLDCO BV-144A 7.87500% 18-15.05.26	4 426 000.00	4 525 585.00	0.11
USD SM ENERGY CO 6.62500% 18-15.01.27	940 000.00	836 600.00	0.02
USD SM ENERGY CO 6.75000% 16-15.09.26	1 020 000.00	920 550.00	0.02
USD SOUTHWESTERN ENERGY CO 7.50000% 17-01.04.26	4 305 000.00	4 497 864.00	0.11
USD SOUTHWESTERN ENERGY CO 7.75000% 17-01.10.27	6 800 000.00	7 174 000.00	0.18
USD SOUTHWESTERN ENERGY CO 8.37500% 20-15.09.28	780 000.00	834 681.90	0.02
USD SPCM SA-144A 4.87500% 17-15.09.25	1 161 000.00	1 195 830.00	0.03
USD SPRINGLEAF FINANCE CORP 7.12500% 18-15.03.26	3 445 000.00	4 030 650.00	0.10
USD SPRINGLEAF FINANCE CORP 6.12500% 19-15.03.24	1 100 000.00	1 202 102.00	0.03
USD SPRINGLEAF FINANCE CORP 6.62500% 19-15.01.28	1 075 000.00	1 255 062.50	0.03
USD SPRINGLEAF FINANCE CORP 5.37500% 19-15.11.29	925 000.00	1 017 500.00	0.03
USD SPRINGLEAF FINANCE CORP 8.87500% 20-01.06.25	2 066 000.00	2 309 994.60	0.06
USD SPRINT CORP 7.12500% 14-15.06.24	420 000.00	489 736.80	0.01
USD SPRINT CORP 7.62500% 15-15.02.25	2 914 000.00	3 482 230.00	0.09
USD SPRINT CORP 7.62500% 18-01.03.26	3 924 000.00	4 836 330.00	0.12
USD SPRINT CORP 7.87500% 14-15.09.23	2 957 000.00	3 415 335.00	0.09
USD SUBURBAN PROPANE PARTNERS LP/ENERGY 5.87500% 17-01.03.27	350 000.00	364 875.00	0.01
USD SYMANTEC CORP-144A 5.00000% 17-15.04.25	2 662 000.00	2 709 383.60	0.07
USD T-MOBILE USA INC 2.25000% 21-15.02.26	827 000.00	835 716.58	0.02
USD T-MOBILE USA INC 2.62500% 21-15.02.29	711 000.00	713 580.93	0.02
USD T-MOBILE USA INC 2.87500% 21-15.02.31	687 000.00	692 585.31	0.02
USD T-MOBILE USA INC 4.50000% 18-01.02.26	400 000.00	409 200.00	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 - ハイ・イールド

2021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 T-MOBILE USA INC 4.75000% 18-01.02.28	445 000.00	475 304.50	0.01
USD T-MOBILE USA INC 6.00000% 14-01.03.23	2 572 000.00	2 575 215.00	0.06
USD T-MOBILE USA INC 6.00000% 16-15.04.24	4 562 000.00	4 612 090.76	0.12
USD TALEN ENERGY SUPPLY LLC 6.50000% 16-01.06.25	1 360 000.00	1 080 356.80	0.03
USD TARGA RESOURCES PARTNERS 5.87500% 18-15.04.26	2 631 000.00	2 755 998.81	0.07
USD TELECOM ITALIA CAPITAL 6.37500% 04-15.11.33	1 110 000.00	1 369 767.75	0.03
USD TELECOM ITALIA CAPITAL 7.20000% 06-18.07.36	3 811 000.00	5 034 597.77	0.13
USD TELECOM ITALIA CAPITAL 7.72100% 08-06.04.38	2 020 000.00	2 838 100.00	0.07
USD TELECOM ITALIA SPA-144A 5.30300% 14-30.05.24	988 000.00	1 073 427.42	0.03
USD TELENET FINANCE LUXEMBOURG-144A 5.50000% 17-01.03.28	3 600 000.00	3 808 800.00	0.10
USD TENET HEALTHCARE CORP 6.75000% 15-15.06.23	626 000.00	679 210.00	0.02
USD TENET HEALTHCARE CORP 7.00000% 17-01.08.25	1 275 000.00	1 318 031.25	0.03
USD TENNECO INC 5.00000% 16-15.07.26	410 000.00	378 225.00	0.01
USD TESLA INC-144A 5.30000% 17-15.08.25	520 000.00	540 644.00	0.01
USD TRANSDIGM INC-SUB 5.50000% 20-15.11.27	6 104 000.00	6 263 924.80	0.16
USD TRANSDIGM INC-SUB 6.50000% 15-15.05.25	2 544 000.00	2 607 600.00	0.07
USD TRANSDIGM INC-SUB 6.37500% 17-15.06.26	1 980 000.00	2 044 350.00	0.05
USD TRANSDIGM INC-SUB 7.50000% 19-15.03.27	1 480 000.00	1 583 600.00	0.04
USD TRANSOCEAN PHOENIX 2 LTD-144A 7.75000% 16-15.10.24	213 000.00	122 688.00	0.00
USD TREEHOUSE FOODS INC 4.00000% 20-01.09.28	338 000.00	341 380.00	0.01
USD TRIUMPH GROUP INC 7.75000% 18-15.08.25	65 000.00	60 937.50	0.00
USD TRIVIUM PACKAGING FINANCE BV-144A 5.50000% 19-15.08.26	3 673 000.00	3 872 535.72	0.10
USD TRIVIUM PACKAGING FINANCE BV-144A 8.50000% 19-15.08.27	1 826 000.00	1 983 529.02	0.05
USD UNITED STATES STEEL CORP 6.65000% 07-01.06.37	50 000.00	47 500.00	0.00
USD UNITED STATES STEEL CORP 6.87500% 17-15.08.25	1 295 000.00	1 276 228.98	0.03
USD UNITED STATES STEEL CORP 6.25000% 18-15.03.26	6 285 000.00	6 033 600.00	0.15
USD VALARIS PLC *DEFAULTED* 5.75000% 14-01.10.44	845 000.00	58 621.88	0.00
USD VERISIGN INC 4.75000% 17-15.07.27	1 520 000.00	1 615 136.80	0.04
USD VERISIGN INC 5.25000% 15-01.04.25	3 473 000.00	3 920 148.75	0.10
USD VERITAS US INC / BERMUDA LTD-144A 7.50000% 20-01.09.25	600 000.00	616 500.00	0.02
USD VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC-144A 5.50000% 19-15.05.29	205 000.00	219 987.55	0.01
USD VIRGIN MEDIA VENDOR FINANC-144A 5.00000% 20-15.07.28	400 000.00	418 000.00	0.01
USD VISTA OUTDOOR INC 5.87500% 16-01.10.23	2 220 000.00	2 252 756.10	0.06
USD VMED O2 UK FINANCING I PLC-144A 4.25000% 20-31.01.31	1 911 000.00	1 906 623.81	0.05
USD WESTERN GAS PARTNERS LP 5.45000% 14-01.04.44	440 000.00	461 450.00	0.01
USD WESTERN GAS PARTNERS LP 4.50000% 18-01.03.28	113 000.00	116 955.00	0.00
USD WESTERN GAS PARTNERS LP 5.30000% 18-01.03.48	1 500 000.00	1 537 500.00	0.04
USD WESTERN GAS PARTNERS LP 4.75000% 18-15.08.28	113 000.00	119 497.50	0.00
USD WESTERN MIDSTREAM OPERATING LP 4.05000% 20-01.02.30	907 000.00	997 700.00	0.03
USD WPX ENERGY INC 4.50000% 20-15.01.30	2 291 000.00	2 425 023.50	0.06
USD WPX ENERGY INC 5.87500% 20-15.06.28	710 000.00	768 759.60	0.02
USD WYNDHAM WORLDWIDE CORP 3.90000% 13-01.03.23	510 000.00	517 650.00	0.01
USD YUM BRANDS INC 3.62500% 20-15.03.31	1 028 000.00	1 007 440.00	0.03
USD ZIGGO BOND CO BV-144A 6.00000% 16-15.01.27	3 130 000.00	3 278 675.00	0.08
USD ZIGGO BV-144A 4.87500% 19-15.01.30	696 000.00	729 481.08	0.02
USD ZIGGO BV-144A 5.50000% 16-15.01.27	5 114 000.00	5 330 859.17	0.13
米ドル合計		527 200 094.72	13.25
ノート、固定利付債合計		936 130 500.78	23.53
ノート、変動利付債			
EUR ABERTIS INFRA FINANCE BV-REG-S-SUB 3.248%/VAR 20-PRP	2 600 000.00	3 235 162.55	0.08
EUR ABERTIS INFRA FINANCE BV-REG-S-SUB 2.625%/VAR 20-PRP	1 000 000.00	1 190 602.00	0.03
EUR AIB GROUP PLC-REG-S-SUB 6.250%/VAR 19-PRP	600 000.00	805 478.70	0.02
EUR AKELIUS RESIDENTIAL PROPERT-REG-S-SUB 2.249%/VAR 20-17.05.81	1 050 000.00	1 266 587.92	0.03
EUR ALGECO SCOTSMAN FIN PLC-REG-S 3M EURIBOR+625BP 18-15.02.23	500 000.00	606 538.82	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

2021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	ALLIANZ SE-REG-S-SUB 2.625%/VAR 20-PRP	400 000.00	490 382.24	0.01
EUR	BANCA MONT DEI PAS DI SIENA-REG-S-SUB 8.000%/VAR 20-22.01.30	1 000 000.00	1 204 816.33	0.03
EUR	BANCO BPM SPA-REG-S-SUB 5.000%/VAR 20-14.09.30	2 350 000.00	3 028 525.68	0.08
EUR	BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 2.000%/VAR 20-17.01.30	600 000.00	708 103.98	0.02
EUR	BNP PARIBAS CARDIF SA-SUB 4.032%/3M EURIBOR+393BP 14-PRP	2 000 000.00	2 730 949.41	0.07
EUR	COMMERZBANK AG-REG-S-SUB 6.125%/VAR 20-PRP	1 000 000.00	1 278 682.25	0.03
EUR	DEUTSCHE BOERSE AG-REG-S-SUB 1.250%/VAR 20-16.06.47	1 100 000.00	1 374 547.41	0.04
EUR	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA-REG-S-SUB 1.700%/VAR 20-20.07.80	1 100 000.00	1 327 850.47	0.03
EUR	ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 3.000%/VAR 19-PRP	600 000.00	762 194.24	0.02
EUR	ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 3.375%/VAR 20-PRP	6 800 000.00	8 836 638.32	0.22
EUR	ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 2.875%/VAR 20-PRP	2 200 000.00	2 752 963.40	0.07
EUR	ELM BV FOR FIRMENICH INTL SA-REG-S-SUB 3.750%/VAR 20-PRP	4 410 000.00	5 739 467.20	0.14
EUR	ENERGIAS DE PORTUGAL SA-REG-S-SUB 1.875%/VAR 21-02.08.81	1 400 000.00	1 700 860.00	0.04
EUR	ENI SPA-REG-S-SUB 3.375%/VAR 20-PRP	2 521 000.00	3 248 366.33	0.08
EUR	GALAPAGO SA/LUX-REG-S *DEFAULT* 3M EURIBOR+475BP 14-15.06.21	1 066 000.00	2 460.66	0.00
EUR	GUALA CLOSURES SPA-REG-S 3M EURIBOR+350BP 18-15.04.24	350 000.00	424 896.08	0.01
EUR	HEIMSTADEN BOSTAD AB-REG-S-SUB 3.248%/VAR 19-PRP	2 500 000.00	3 108 880.51	0.08
EUR	ITALMATCH CHEMICALS SPA-REG-S 3M EURIBOR+475BP 18-30.09.24	600 000.00	695 080.73	0.02
EUR	KONINKLIJKE KPN NV-REG-S-SUB 2.000%/VAR 19-PRP	2 000 000.00	2 423 565.13	0.06
EUR	LINCOLN FINANCING SARL-REG-S 3M EURIBOR+387.5BP 19-01.04.24	475 000.00	572 749.42	0.02
EUR	PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 3M EURIBOR+240BP 18-24.08.23	1 800 000.00	2 085 679.57	0.05
EUR	RCI BANQUE SA-REG-S-SUB 2.625%/VAR 19-18.02.30	3 000 000.00	3 683 406.71	0.09
EUR	REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S-SUB 3.750%/VAR 20-PRP	2 367 000.00	3 076 965.08	0.08
EUR	REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV-SUB 4.247%/VAR 20-PRP	3 289 000.00	4 424 875.76	0.11
EUR	SAMHALLSBYGGNADSBOLAGET I NORDEN-REG-S-SUB 2.625%/VAR 20-PRP	260 000.00	312 715.26	0.01
EUR	SOLVAY SA-SUB 2.500%/VAR 20-PRP	600 000.00	743 189.31	0.02
EUR	SYNLAB BONDCO PLC-REG-S 3M EURIBOR+475BP 20-01.07.25	3 180 000.00	3 921 332.73	0.10
EUR	TENNET HOLDING BV-REG-S-SUB 2.374%/VAR 20-PRP	2 180 000.00	2 747 800.08	0.07
EUR	UNICREDIT SPA-REG-S-SUB 2.731%/VAR 20-15.01.32	3 690 000.00	4 494 430.53	0.11
EUR	VEOLIA ENVIRONNEMENT SA-REG-S-SUB 2.500%/VAR 20-PRP	7 000 000.00	8 530 765.38	0.21
EUR	VODAFONE GROUP PLC-REG-S-SUB 2.625%/VAR 20-27.08.80	625 000.00	779 396.31	0.02
EUR	VODAFONE GROUP PLC-REG-S-SUB 3.000%/VAR 20-27.08.80	5 125 000.00	6 444 285.19	0.16
EUR	VOLKSWAGEN INTL FINANCE NV-REG-S-SUB 3.500%/VAR 20-PRP	1 300 000.00	1 656 759.13	0.04
EUR	VOLKSWAGEN INTL FINANCE NV-REG-S-SUB 3.875%/VAR 20-PRP	3 900 000.00	5 123 223.58	0.13
EUR	WINTERSHALL DEA FINANCE 2BV-REG-S-SUB 2.498%/VAR 21-PRP	1 200 000.00	1 439 656.49	0.04
EUR	WINTERSHALL DEA FINANCE 2BV-REG-S-SUB 3.000%/VAR 21-PRP	3 600 000.00	4 324 908.90	0.11
ユーロ合計			103 305 739.79	2.60
GBP	NATWEST GROUP PLC-SUB 5.125%/VAR 20-PRP	1 550 000.00	2 240 204.15	0.06
GBP	TVL FINANCE PLC-REG-S 3M LIBOR+537.5BP 19-15.07.25	1 075 000.00	1 322 666.24	0.03
英ポンド合計			3 562 870.39	0.09
USD	AERCAP HOLDINGS NV-SUB 5.875%/VAR 19-10.10.79	260 000.00	263 972.80	0.01
USD	ALLIANZ SE-144A-SUB 3.500%/VAR 20-PRP	400 000.00	403 752.00	0.01
USD	BANCO MERCANTIL DEL NORT SA/G CA-REG-S-SUB 6.875%/VAR 17-PRP	2 490 000.00	2 560 031.25	0.06
USD	BNP PARIBAS SA-REG-S-SUB 6.625%/VAR 19-PRP	460 000.00	498 088.00	0.01
USD	CHARLES SCHWAB CORP-SUB 5.375%/VAR 20-PRP	585 000.00	648 390.60	0.02
USD	CITIGROUP INC-SUB 4.000%/VAR 20-PRP	300 000.00	304 125.00	0.01
USD	COMMERZBANK AG-REG-S-SUB 7.000%/VAR 19-PRP	1 200 000.00	1 276 500.00	0.03
USD	CREDIT SUISSE GROUP AG-144A-SUB 4.500%/VAR 20-PRP	708 000.00	700 920.00	0.02
USD	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S-SUB 6.375%/VAR 19-PRP	1 235 000.00	1 375 481.25	0.03
USD	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S-SUB 5.250%/VAR 20-PRP	275 000.00	290 798.75	0.01
USD	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S-SUB 6.250%/VAR 14-PRP	1 458 000.00	1 594 672.92	0.04
USD	DEUTSCHE BANK AG-SUB 4.296%/VAR 13-24.05.28	1 300 000.00	1 334 664.68	0.03
USD	DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY-SUB 4.875%/VAR 17-01.12.32	850 000.00	912 356.00	0.02
USD	DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY-SUB 3.729%/VAR 21-14.01.32	700 000.00	696 189.69	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

2021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 EFG INTERNATIONAL AG-REG-S-SUB 5.500%/VAR 21-PRP	475 000.00	488 338.00	0.01
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3M LIBOR+127BP 17-28.03.22	227 000.00	225 581.25	0.01
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3M LIBOR+123.5BP 18-15.02.23	341 000.00	332 048.75	0.01
USD SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN-REG-S-SUB 5.625%/VAR 17-PRP	1 600 000.00	1 644 992.00	0.04
USD SOCIETE GENERALE SA-REG-S-SUB 7.375%/VAR 16-PRP	1 250 000.00	1 282 812.50	0.03
USD SOFTBANK GROUP CORP-REG-S-SUB 6.000%/VAR 17-PRP	800 000.00	780 408.00	0.02
USD STANDARD CHARTERED PLC-REG-S-SUB 6.000%/VAR 20-PRP	1 210 000.00	1 314 423.00	0.03
USD UBS GROUP AG-144A-SUB 7.000%/VAR 19-PRP	1 000 000.00	1 097 500.00	0.03
USD UBS GROUP AG-REG-S-SUB 5.125%/VAR 20-31.12.99	200 000.00	213 408.00	0.01
米ドル合計		20 239 454.44	0.51

ノート、変動利付債合計		127 108 064.62	3.20
-------------	--	----------------	------

中期債券、固定利付債

EUR ATLANTIA SPA-REG-S 1.62500% 17-03.02.25	1 450 000.00	1 748 392.96	0.04
EUR AUCHAN SA-REG-S 3.25000% 20-23.07.27	1 200 000.00	1 698 799.92	0.04
EUR AUTOSTRADE PER L' ITALIA SPA 5.87500% 04-09.06.24	700 000.00	969 150.03	0.02
EUR AUTOSTRADE PER L' ITALIA SPA 4.37500% 10-16.09.25	1 150 000.00	1 567 627.38	0.04
EUR AUTOSTRADE PER L' ITALIA SPA 2.87500% 13-26.02.21	1 811 000.00	2 202 252.07	0.06
EUR AUTOSTRADE PER L' ITALIA SPA-REG-S 1.87500% 15-04.11.25	850 000.00	1 037 683.75	0.03
EUR AUTOSTRADE PER L' ITALIA SPA-REG-S 1.75000% 15-26.06.26	800 000.00	969 684.58	0.02
EUR BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA-REG-S 3.62500% 19-24.09.24	600 000.00	775 616.65	0.02
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 5.62500% 16-06.05.26	500 000.00	715 272.38	0.02
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 2.50000% 21-15.04.31	800 000.00	961 345.51	0.02
EUR CASINO GUICHARD PERRACHON SA-REG-S STEP-UP 14-07.03.24	3 300 000.00	3 888 894.90	0.10
EUR CASINO GUICHARD PERRACHON SA-REG-S 2.79800% 14-05.08.26	1 700 000.00	1 860 036.20	0.05
EUR CASINO GUICHARD PERRACHON SA-REG-S STEP-UP 14-07.02.25	2 800 000.00	3 082 332.51	0.08
EUR CELLNEX TELECOM SA-REG-S 2.87500% 17-18.04.25	400 000.00	525 439.39	0.01
EUR CELLNEX TELECOM SA-REG-S 1.75000% 20-23.10.30	2 700 000.00	3 267 135.31	0.08
EUR COMMERZBANK AG-REG-S-SUB 4.00000% 16-23.03.26	1 000 000.00	1 352 985.54	0.03
EUR DEUTSCHE BANK AG-REG-S 1.75000% 18-17.01.28	1 500 000.00	1 909 367.21	0.05
EUR DEUTSCHE BANK AG-SUB 4.50000% 16-19.05.26	5 000 000.00	6 857 041.39	0.17
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA AG-REG-S 3.00000% 20-29.05.26	400 000.00	475 025.90	0.01
EUR DOMETIC GROUP AB-REG-S 3.00000% 19-08.05.26	1 000 000.00	1 261 340.77	0.03
EUR ELIS SA-REG-S 1.00000% 19-03.04.25	1 300 000.00	1 535 068.67	0.04
EUR ELIS SA-REG-S 1.62500% 19-03.04.28	500 000.00	592 737.56	0.02
EUR ELIS SA-REG-S 1.75000% 19-11.04.24	1 300 000.00	1 599 980.78	0.04
EUR ELIS SA-REG-S 1.87500% 18-15.02.23	1 200 000.00	1 478 800.58	0.04
EUR ELIS SA-REG-S 2.87500% 18-15.02.26	2 100 000.00	2 691 610.95	0.07
EUR FCE BANK PLC-REG-S 1.61500% 16-11.05.23	1 100 000.00	1 337 285.37	0.03
EUR FIAT CHRYSLER FINANCE EUROPE SENC-REG-S 4.75000% 14-22.03.21	4 000 000.00	4 890 818.07	0.12
EUR FORD MOTOR CREDIT CO LLC 1.35500% 18-07.02.25	425 000.00	503 131.95	0.01
EUR FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.02100% 19-06.03.24	4 375 000.00	5 487 314.53	0.14
EUR FORD MOTOR CREDIT CO LLC 1.74400% 20-19.07.24	1 850 000.00	2 228 496.66	0.06
EUR FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.25000% 20-15.09.25	4 967 000.00	6 320 855.63	0.16
EUR GESTAMP AUTOMOCION SA-REG-S 3.25000% 18-30.04.26	1 105 000.00	1 344 478.20	0.03
EUR GREIF LUXEMBOURG FINANCE SCA-REG-S 7.37500% 11-15.07.21	489 000.00	612 116.62	0.02
EUR INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALI SPA-REG-S 1.87500% 20-08.07.26	3 256 000.00	4 138 088.66	0.10
EUR INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALI SPA-REG-S 1.62500% 20-21.10.28	1 486 000.00	1 849 922.51	0.05
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB 3.92800% 14-15.09.26	2 000 000.00	2 717 308.52	0.07
EUR INTRUM JUSTITIA AB-REG-S 3.50000% 19-15.07.26	1 550 000.00	1 863 134.19	0.05
EUR K+S AG-REG-S 3.00000% 12-20.06.22	600 000.00	733 221.79	0.02
EUR KION GROUP AG-REG-S 1.62500% 20-24.09.25	800 000.00	1 007 375.64	0.03
EUR MAX TWO LTD 5.70000% 04-02.04.24	350 000.00	62 976.67	0.00
EUR MOBILUX FINANCE SAS-REG-S 5.50000% 16-15.11.24	2 950 000.00	3 626 998.30	0.09
EUR NOKIA OYJ-REG-S 2.00000% 17-15.03.24	2 500 000.00	3 163 107.57	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

2021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 NOKIA OYJ-REG-S 2.0000% 19-11.03.26	3 750 000.00	4 775 158.38	0.12
EUR NOKIA OYJ-REG-S 3.1250% 20-15.05.28	3 395 000.00	4 563 416.65	0.11
EUR ORANO SA 4.8750% 09-23.09.24	2 000 000.00	2 776 046.50	0.07
EUR ORANO SA-REG-S 2.7500% 20-08.03.28	1 100 000.00	1 408 501.60	0.04
EUR ORANO SA-REG-S 3.3750% 19-23.04.26	5 500 000.00	7 242 899.71	0.18
EUR PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 1.8750% 15-21.04.22	500 000.00	602 324.64	0.02
EUR PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 5.1250% 16-15.03.23	2 000 000.00	2 514 083.69	0.06
EUR PPF ARENA 1 BV-REG-S 3.1250% 19-27.03.26	300 000.00	387 196.16	0.01
EUR PPF ARENA 1 BV-REG-S 2.1250% 19-31.01.25	2 020 000.00	2 498 836.20	0.06
EUR PPF TELECOM GROUP BV-REG-S 3.5000% 20-20.05.24	850 000.00	1 095 915.73	0.03
EUR PPF TELECOM GROUP BV-REG-S 3.2500% 20-29.09.27	2 423 000.00	3 168 748.77	0.08
EUR RAIFFEISEN BANK INTL AG-REG-S-SUB 6.0000% 13-16.10.23	700 000.00	982 216.04	0.02
EUR RENAULT SA-REG-S 2.3750% 20-25.05.26	2 100 000.00	2 585 921.21	0.06
EUR ROADSTER FINANCE DESIGNATED ACTIVITY CO 2.3750% 17-08.12.27	400 000.00	513 763.72	0.01
EUR ROLLS-ROYCE PLC-REG-S 0.8750% 18-09.05.24	875 000.00	997 926.46	0.03
EUR SAMSONITE FINCO SARL-REG-S 3.5000% 18-15.05.26	500 000.00	566 609.92	0.01
EUR SCHAEFFLER AG-REG-S 2.7500% 20-12.10.25	3 100 000.00	3 992 161.41	0.10
EUR SEALED AIR CORP-REG-S 4.5000% 15-15.09.23	2 500 000.00	3 303 878.03	0.08
EUR SHAEFFLER AG-REG-S 3.3750% 20-12.10.28	7 100 000.00	9 488 196.49	0.24
EUR STELLANTIS NV-REG-S 3.7500% 16-29.03.24	2 000 000.00	2 692 621.75	0.07
EUR TELECOM ITALIA FINANCE SA 7.7500% 03-24.01.33	2 190 000.00	3 933 695.04	0.10
EUR TELECOM ITALIA SPA-REG-S 2.8750% 18-28.01.26	5 320 000.00	6 864 184.51	0.17
EUR TELECOM ITALIA SPA-REG-S 4.0000% 19-11.04.24	2 553 000.00	3 350 651.73	0.08
EUR TELECOM ITALIA SPA-REG-S 2.7500% 19-15.04.25	500 000.00	639 019.18	0.02
EUR TELECOM ITALIA SPA/MILANO-REG-S 1.6250% 21-18.01.29	1 000 000.00	1 199 713.75	0.03
EUR TELEFON AB L M ERICSSON REG-S 0.8750% 17-01.03.21	1 349 000.00	1 639 981.77	0.04
EUR TELEFON AB L M ERICSSON-REG-S 1.8750% 17-01.03.24	1 750 000.00	2 242 277.75	0.06
EUR TEOLLISUUDEN VOIMA OY-REG-S 1.1250% 19-09.03.26	2 000 000.00	2 288 307.88	0.06
EUR THYSSENKRUPP AG-REG-S 2.8750% 19-22.02.24	2 900 000.00	3 554 777.97	0.09
EUR THYSSENKRUPP AG-REG-S 1.8750% 19-06.03.23	4 615 000.00	5 590 189.91	0.14
EUR TRAFIGURA FUNDING SA-REG-S 3.8750% 21-02.02.26	960 000.00	1 166 097.21	0.03
EUR VALEO SA-REG-S 1.6250% 16-18.03.26	1 500 000.00	1 890 870.36	0.05
EUR VOLVO CAR AB-REG-S 2.5000% 20-07.10.27	2 025 000.00	2 644 685.44	0.07
EUR ZF FINANCE GMBH-REG-S 3.7500% 20-21.09.28	5 400 000.00	6 965 909.55	0.18
EUR ZF FINANCE GMBH-REG-S 3.0000% 20-21.09.25	3 600 000.00	4 485 841.36	0.11
EUR ZF FINANCE GMBH-REG-S 2.7500% 20-25.05.27	1 700 000.00	2 075 375.76	0.05
ユーロ合計		193 598 256.00	4.87
GBP			
GBP ANGLIAN WATER/OSPREY FINANCING-REG-S 5.0000% 15-30.04.23	906 000.00	1 283 682.19	0.03
GBP ANGLIAN WATER/OSPREY FINANCING-REG-S 4.0000% 17-08.03.26	1 350 000.00	1 870 504.38	0.05
GBP PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 6.2500% 11-14.12.26	1 300 000.00	2 124 898.26	0.04
GBP TELECOM ITALIA SPA 5.8750% 06-19.05.23	1 500 000.00	2 260 070.24	0.06
GBP THAMES WATER KEMBLE FINANCE PLC-REG-S 5.8750% 15-15.07.22	2 129 000.00	3 060 978.26	0.08
GBP WILLIAM HILL PLC-REG-S 4.7500% 19-01.05.26	400 000.00	606 954.40	0.02
英ポンド合計		11 207 087.73	0.28
USD			
USD FIRSTENERGY CORP 7.3750% 01-15.11.31	180 000.00	252 351.00	0.01
USD NAVIENT CORP 5.6250% 03-01.08.33	935 000.00	893 205.50	0.02
USD NAVIENT CORP 6.7500% 18-15.06.26	635 000.00	700 684.40	0.02
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.6250% 05-15.06.35	1 000 000.00	941 500.00	0.02
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.8750% 17-04.08.26	1 500 000.00	1 606 875.00	0.04
USD SPRINT CAPITAL CORPORATION 8.7500% 02-15.03.32	2 898 000.00	4 426 695.00	0.11
米ドル合計		8 821 310.90	0.22
中期債券、固定利付債合計		213 626 654.63	5.37

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

2021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、変動利付債			
EUR			
EUR	AGEAS-REG-S-SUB 3.250%/3M EURIBOR+380BP 19-02.07.49	600 000.00	822 893.07 0.02
EUR	ARKEMA SA-REG-S-SUB 2.750%/VAR 19-PRP	800 000.00	1 014 004.14 0.03
EUR	AXA SA-REG-S-SUB 3.941%/VAR 14-PRP	1 250 000.00	1 678 080.63 0.04
EUR	BANCA MONT DEI PAS DI SIENA-REG-S-SUB 5.375%/VAR 18-18.01.28	650 000.00	683 867.21 0.02
EUR	BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 5.375%/VAR 18-12.12.28	1 300 000.00	1 721 671.24 0.04
EUR	BANKIA SA-REG-S-SUB 3.750%/VAR 19-15.02.29	4 100 000.00	5 365 082.23 0.14
EUR	CAIXABANK SA-REG-S-SUB 2.750%/VAR 17-14.07.28	600 000.00	760 768.43 0.02
EUR	CAIXABANK-REG-S-SUB 2.250%/VAR 18-17.04.30	500 000.00	635 133.38 0.02
EUR	COMMERZBANK AG-REG-S-SUB 4.000%/VAR 20-05.12.30	1 800 000.00	2 382 461.66 0.06
EUR	DANSKE BANK AS-REG-S-SUB 5.875%/VAR 15-PRP	400 000.00	506 608.44 0.01
EUR	DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG-REG-S-SUB 2.875%/VAR 17-28.06.27	1 900 000.00	2 317 566.32 0.06
EUR	ERSTE GROUP BANK AG-REG-S-SUB 8.875%/VAR 16-PRP	1 400 000.00	1 792 281.22 0.05
EUR	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3M EURIBOR+42BP 18-07.12.22	500 000.00	587 963.00 0.01
EUR	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3M EURIBOR+43BP 18-14.05.21	750 000.00	908 441.48 0.02
EUR	MEDIOBANCA SPA-REG-S-SUB 2.300%/VAR 20-23.11.30	370 000.00	455 919.46 0.01
EUR	ORANGE SA REG-S-SUB 5.000%/VAR 14-PRP	3 000 000.00	4 392 854.86 0.11
EUR	OTP BANK NYRT-REG-S-SUB 2.875%/VAR 19-15.07.29	1 750 000.00	2 147 335.76 0.05
EUR	TALANX FINANZ LUX-SUB 8.3673%/VAR 12-15.06.42	1 000 000.00	1 345 501.75 0.03
EUR	TDC A/S 3.750%/RATING LINKED 12-02.03.22	350 000.00	444 009.50 0.01
EUR	TOTAL SE-REG-S-SUB 1.625%/VAR 21-PRP	927 000.00	1 133 251.12 0.03
EUR	TOTAL SE-REG-S-SUB 2.625%/VAR 15-PRP	2 750 000.00	3 529 225.58 0.09
EUR	TOTAL SE-REG-S-SUB 3.369%/VAR 16-PRP	1 000 000.00	1 343 983.13 0.03
EUR	TRAFIGURA GROUP PTE LTD-REG-S-SUB 7.500%/VAR 19-PRP	999 000.00	1 272 633.78 0.03
EUR	UNICREDIT SPA-REG-S-SUB 4.375%/VAR 16-03.01.27	800 000.00	1 001 408.05 0.03
EUR	UNIONE DI BANCHE ITALIANE-REG-S-SUB 4.450%/VAR 17-15.09.27	1 875 000.00	2 386 417.44 0.06
EUR	UNIONE DI BANCHE ITALIANE-REG-S-SUB 5.875%/VAR 19-04.03.29	600 000.00	811 310.22 0.02
EUR	UNIONE DI BANCHE ITALIANE-REG-S-SUB 4.375%/VAR 19-12.07.29	625 000.00	814 362.66 0.02
ユーロ合計			42 255 035.76 1.06
GBP			
GBP	ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 6.000%/VAR 13-PRP	2 000 000.00	3 112 341.32 0.08
GBP	M&G PLC-REG-S-SUB 5.700%/VAR 13-19.12.63	700 000.00	1 266 187.62 0.03
GBP	M&G PLC-REG-S-SUB 5.000%/VAR 15-20.07.55	800 000.00	1 314 782.98 0.03
英債券合計			5 693 311.92 0.14
USD			
USD	BANK OF IRELAND GROUP PLC-REG-S-SUB 4.125%/VAR 17-19.09.27	1 170 000.00	1 193 443.52 0.03
USD	JPMORGAN CHASE & CO-SUB 6.750%/3M LIBOR+378BP 14-PRP	1 100 000.00	1 236 820.07 0.03
USD	NATWEST GROUP PLC-SUB 8.000%/VAR 15-PRP	800 000.00	939 200.00 0.03
米ドル合計			3 369 463.59 0.09
中期債券、変動利付債合計			51 317 811.27 1.29
債券、固定利付債			
CHF			
CHF	TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE 0.50000% 16-28.07.22	525 000.00	577 464.59 0.01
スイスフラン合計			577 464.59 0.01
EUR			
EUR	ADEVINTA ASA-REG-S 2.62500% 20-15.11.25	2 801 000.00	3 469 292.14 0.09
EUR	ADEVINTA ASA-REG-S 3.00000% 20-15.11.27	1 755 000.00	2 193 342.18 0.05
EUR	ADLER REAL ESTATE AG-REG-S 1.87500% 18-27.04.23	600 000.00	727 117.65 0.02
EUR	ADLER REAL ESTATE AG-REG-S 3.00000% 18-27.04.26	1 000 000.00	1 256 753.31 0.03
EUR	ALMAVIVA-THE ITALIAN INNOVATION-REG-S 7.25000% 17-15.10.22	1 430 000.00	1 764 236.81 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

2021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 ALTICE FINANCING SA-REG-S 2.25000% 20-15.01.25	500 000.00	586 189.25	0.01
EUR ALTICE FINANCING SA-REG-S 3.00000% 20-15.01.28	6 851 000.00	7 918 768.50	0.20
EUR ALTICE FRANCE-REG-S 3.37500% 19-15.01.28	6 879 000.00	8 284 170.75	0.21
EUR ALTICE FRANCE-REG-S 2.50000% 19-15.01.25	2 620 000.00	3 135 292.43	0.08
EUR ALTICE FRANCE-REG-S 2.12500% 20-15.02.25	1 700 000.00	2 012 664.08	0.05
EUR ALTICE FRANCE-REG-S 4.12500% 20-15.01.29	1 900 000.00	2 345 820.03	0.06
EUR ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-REG-S 2.12500% 20-15.08.26	3 454 000.00	4 207 258.80	0.10
EUR AUTOSTRADE PER L'ITALIA SPA REG-S 2.00000% 21-15.01.30	5 224 000.00	6 255 246.02	0.16
EUR AVANTOR FUNDING INC-REG-S 2.62500% 20-01.11.25	3 517 000.00	4 360 626.50	0.11
EUR AXALTA COATING SYSTEMS DUTCH HLDG-REG-S 3.75000% 16-15.01.25	3 850 000.00	4 734 990.15	0.12
EUR BANIJAY ENTERTAINMENT SASU-REG-S 3.50000% 20-01.03.25	2 950 000.00	3 549 907.44	0.09
EUR BANIJAY GROUP SAS-REG-S 6.50000% 20-01.03.26	2 192 000.00	2 609 799.59	0.06
EUR BELDEN INC-REG-S-SUB 4.12500% 16-15.10.26	2 800 000.00	3 503 771.60	0.09
EUR BELDEN INC-REG-S-SUB 3.37500% 17-15.07.27	1 550 000.00	1 930 172.37	0.05
EUR BELDEN INC-REG-S-SUB 3.87500% 18-15.03.28	4 318 000.00	5 471 513.54	0.14
EUR BERRY GLOBAL INC-REG-S 1.00000% 20-15.01.25	1 000 000.00	1 230 086.25	0.03
EUR BRUNELLO BIDCO SPA-REG-S 3.50000% 21-15.02.28	1 245 000.00	1 517 088.15	0.04
EUR BWAY HOLDING CO-REG-S 4.75000% 18-15.04.24	2 775 000.00	3 360 660.32	0.08
EUR CAB SELAS-REG-S 3.37500% 21-01.02.28	875 000.00	1 063 569.02	0.03
EUR CARNIVAL CORP-REG-S 10.12500% 20-01.02.26	2 205 000.00	3 074 842.77	0.08
EUR CARNIVAL CORP-REG-S 7.62500% 20-01.03.26	1 055 000.00	1 348 163.84	0.03
EUR CENTURION BIDCO SPA-REG-S 5.87500% 20-30.09.26	2 847 000.00	3 575 382.54	0.09
EUR CHEMOURS CO/THE 4.00000% 18-15.05.26	4 250 000.00	5 178 298.65	0.13
EUR CHEPLAPHARM ARZNEIMITTEL GMBH-REG-S 4.37500% 20-15.01.28	620 000.00	770 185.86	0.02
EUR CMA CGM SA-REG-S 5.25000% 17-15.01.25	5 265 000.00	6 403 164.77	0.16
EUR COLFAX CORP-REG-S 3.25000% 17-15.05.25	775 000.00	952 162.51	0.02
EUR CONSTANTIN INVESTISSEMENT 3 SASU-REG-S 5.37500% 18-15.04.25	300 000.00	368 931.11	0.01
EUR CONTOURGLOBAL POWER HOLDINGS SA-REG-S 4.12500% 18-01.08.25	550 000.00	683 257.45	0.02
EUR CONTOURGLOBAL POWER HOLDINGS SA-REG-S 2.75000% 20-01.01.26	507 000.00	616 447.07	0.01
EUR CONTOURGLOBAL POWER HOLDINGS SA-REG-S 3.12500% 20-01.01.28	320 000.00	393 036.67	0.01
EUR CROWN EUROPEAN HOLDINGS SA-REG-S 3.37500% 15-15.05.25	2 850 000.00	3 743 485.58	0.09
EUR CROWN EUROPEAN HOLDINGS SA-REG-S 2.62500% 16-30.09.24	4 500 000.00	5 733 306.26	0.14
EUR CRYSTAL ALMOND SARL-REG-S 4.25000% 19-15.10.24	1 000 000.00	1 239 198.01	0.03
EUR CTC BONDCO GMBH-REG-S 5.25000% 17-15.12.25	2 700 000.00	3 339 943.30	0.08
EUR DRAX FINCO PLC-REG-S 2.62500% 20-01.11.25	460 000.00	573 272.43	0.01
EUR EIRCOM FINANCE DAC-REG-S 3.50000% 19-15.05.26	6 969 000.00	8 670 091.41	0.22
EUR EIRCOM FINANCE DAC-REG-S 2.62500% 19-15.02.27	1 600 000.00	1 924 401.60	0.05
EUR ENCORE CAPITAL GROUP INC-REG-S 4.87500% 20-15.10.25	740 000.00	936 515.38	0.02
EUR ENERGIZER GAMMA ACQUISITION BV-REG-S 4.62500% 18-15.07.26	2 950 000.00	3 696 584.37	0.09
EUR FAURECIA SA-REG-S 2.62500% 18-15.06.25	4 230 000.00	5 209 688.62	0.13
EUR FAURECIA SA-REG-S 3.12500% 19-15.06.26	3 600 000.00	4 493 066.60	0.11
EUR FAURECIA SE-REG-S 2.37500% 19-15.06.27	4 200 000.00	5 142 890.38	0.13
EUR FNAC DARTY SA-REG-S 2.62500% 19-30.05.26	3 000 000.00	3 743 106.90	0.09
EUR FRIGOGLASS FINANCE BV-REG-S 6.87500% 20-12.02.25	2 090 000.00	1 970 021.78	0.05
EUR GALAPAGO SA/LUX-REG-S *DEFAULT* 5.37500% 14-15.06.21	1 680 000.00	2 163.50	0.00
EUR GAMMA BIDCO SPA-REG-S 6.25000% 20-15.07.25	880 000.00	1 106 530.92	0.03
EUR GETLINK SE-REG-S 3.50000% 20-30.10.25	4 750 000.00	5 955 093.56	0.15
EUR GRIFOLS SA-REG-S 2.25000% 19-15.11.27	3 650 000.00	4 493 681.59	0.11
EUR GRIFOLS SA-REG-S 3.20000% 17-01.05.25	5 065 000.00	6 199 619.52	0.16
EUR GRUPO-ANTOLIN IRAUSA SA-REG-S 3.25000% 17-30.04.24	1 180 000.00	1 395 950.47	0.04
EUR GRUPO-ANTOLIN IRAUSA SA-REG-S 3.37500% 18-30.04.26	950 000.00	1 114 272.02	0.03
EUR HORNBAACH BAUMARKT AG 3.25000% 19-25.10.26	1 500 000.00	1 959 062.70	0.05
EUR HP PELZER HOLDING GMBH-REG-S 4.12500% 17-01.04.24	200 000.00	225 971.40	0.01
EUR HT TROPLAST GMBH-REG-S 9.25000% 20-15.07.25	1 500 000.00	2 010 963.23	0.05
EUR IHO VERWALTUNGS GMBH-REG-S (PIK) 3.75000% 16-15.09.26	3 350 000.00	4 156 482.08	0.10
EUR INEOS FINANCE PLC-REG-S 3.37500% 20-31.03.26	300 000.00	375 440.54	0.01
EUR INEOS GROUP HOLDINGS SA-REG-S 5.37500% 16-01.08.24	500 000.00	613 524.50	0.02
EUR INEOS QUATTRO FINANCE 2 PLC-REG-S 2.50000% 21-15.01.26	3 167 000.00	3 847 588.30	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

2021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 INEOS STYROLUTION GROUP GMBH-REG-S 2.25000% 20-16.01.27	1 900 000.00	2 262 143.80	0.06
EUR INTER MEDIA COMMUNICATION SRL-REG-S 4.87500% 17-31.12.22	1 300 000.00	1 479 890.22	0.04
EUR INTER MEDIA COMMUNICATION SRL-REG-S 4.87500% 20-31.12.22	320 000.00	380 516.02	0.01
EUR INTRUM JUSTITIA AB-REG-S 3.12500% 17-15.07.24	1 500 000.00	1 817 794.12	0.05
EUR IPD 3 BV-REG-S 5.50000% 20-01.12.25	4 195 000.00	5 236 659.41	0.13
EUR K+S AG-REG-S 4.12500% 13-06.12.21	1 600 000.00	1 978 829.12	0.05
EUR KAEFER ISOLIERTECHNIK-REG-S 5.50000% 18-10.01.24	2 975 000.00	3 654 988.69	0.09
EUR KAPLA HOLDING SAS-REG-S 3.37500% 19-15.12.26	850 000.00	1 022 193.78	0.03
EUR KIRK BEAUTY ONE GMBH-REG-S 8.75000% 15-15.07.23	3 550 000.00	3 838 476.55	0.10
EUR KIRK BEAUTY ZERO GMBH-REG-S 6.25000% 15-15.07.22	1 550 000.00	1 839 474.98	0.05
EUR KME AG-REG-S 6.75000% 18-01.02.23	2 600 000.00	2 820 476.85	0.07
EUR KONGSBERG ACTUATION SYSTEMS BV-REG-S 5.00000% 18-15.07.25	1 000 000.00	1 169 584.23	0.03
EUR KRAFT HEINZ FOODS CO-REG-S 2.25000% 16-25.05.28	2 422 000.00	3 165 828.53	0.08
EUR KRATON POLYMERS LLC/CAPITAL CORP-REG-S 5.25000% 18-15.05.26	2 300 000.00	2 864 825.32	0.07
EUR LA FINANCIERE ATALIAN SA-REG-S 4.00000% 17-15.05.24	300 000.00	342 601.80	0.01
EUR LHC3 PLC-REG-S (PIK) 4.12500% 17-15.08.24	2 600 000.00	3 212 438.58	0.08
EUR LHMC FINCO 2 SARL-REG-S (PIK) 7.25000% 19-02.10.25	865 280.00	863 941.77	0.02
EUR LKQ EUROPEAN HOLDINGS BV-REG-S 3.62500% 18-01.04.26	6 165 000.00	7 611 568.70	0.19
EUR LKQ EUROPEAN HOLDINGS BV-REG-S 4.12500% 18-01.04.28	2 025 000.00	2 632 374.74	0.07
EUR LKQ ITALIA BONDCO SPA-REG-S 3.87500% 16-01.04.24	3 000 000.00	3 914 590.03	0.10
EUR LORCA TELECOM BONDCO SAU-REG-S 4.00000% 20-18.09.27	4 871 000.00	6 230 828.36	0.16
EUR LOUVRE BIDCO SAS-REG-S 4.25000% 17-30.09.24	1 540 000.00	1 852 142.99	0.05
EUR LOUVRE BIDCO SAS-REG-S 6.50000% 20-30.09.24	730 000.00	910 822.68	0.02
EUR LOXAM SAS-REG-S 3.25000% 19-14.01.25	2 150 000.00	2 582 618.26	0.06
EUR LOXAM SAS-REG-S 3.50000% 16-03.05.23	2 470 000.00	3 006 654.56	0.08
EUR LOXAM SAS-REG-S 3.50000% 17-15.04.22	620 000.00	755 202.45	0.02
EUR LOXAM SAS-REG-S 4.25000% 17-15.04.24	1 060 000.00	1 299 283.70	0.03
EUR LSF9 BALTA ISSUER SA-REG-S 7.75000% 15-15.09.22	1 500 000.00	1 417 112.50	0.04
EUR MANGROVE LUXCO III-REG-S (PIK) 7.77500% 19-09.10.25	1 246 547.00	1 279 693.30	0.03
EUR MASARIA INVESTMENTS SAU-REG-S 5.00000% 17-15.09.24	500 000.00	564 928.50	0.01
EUR MATTERHORN TELECOM SA-REG-S 3.12500% 19-15.09.26	2 628 000.00	3 160 829.63	0.08
EUR MOTION FINCO SARL-REG-S 7.00000% 20-15.05.25	1 980 000.00	2 489 425.16	0.06
EUR MPT OPERATING PARTNERSHIP LP/FIN CORP 4.00000% 15-19.08.22	750 000.00	955 676.79	0.02
EUR MPT OPERATING PARTNERSHIP LP/FIN CORP 3.32500% 17-24.03.25	1 400 000.00	1 821 774.14	0.05
EUR NETFLIX INC 4.62500% 18-15.05.29	7 990 000.00	12 327 954.77	0.31
EUR NEXANS SA-REG-S 3.25000% 16-26.05.21	2 000 000.00	2 433 687.68	0.06
EUR NH HOTEL GROUP SA-REG-S 3.75000% 16-01.10.23	1 000 000.00	1 067 647.16	0.03
EUR NIDDA BONDCO GMBH-REG-S 7.25000% 18-30.09.25	300 000.00	378 597.58	0.01
EUR NORICAN GROUP APS-REG-S 4.50000% 17-15.05.23	3 000 000.00	3 278 516.98	0.08
EUR NOURYON HOLDING BV-144A 6.50000% 18-01.10.26	1 750 000.00	2 223 444.98	0.06
EUR OI EUROPEAN GROUP BV-REG-S 3.12500% 16-15.11.24	3 760 000.00	4 721 281.21	0.12
EUR OI EUROPEAN GROUP BV-REG-S 2.87500% 19-15.02.25	2 075 000.00	2 554 269.24	0.06
EUR PAPREC HOLDING-REG-S 4.00000% 18-31.03.25	2 040 000.00	2 489 588.44	0.06
EUR PARTS EUROPE SA-REG-S 6.50000% 20-16.07.25	2 140 000.00	2 702 831.09	0.07
EUR PHOENIX PIB DUTCH FINANCE BV-REG-S 3.62500% 14-30.07.21	1 000 000.00	1 230 086.25	0.03
EUR PLATIN 1426 GMBH-REG-S 5.37500% 17-15.06.23	3 550 000.00	4 312 895.00	0.11
EUR PLATIN 1426 GMBH-REG-S 6.87500% 18-15.06.23	670 000.00	813 576.01	0.02
EUR PLT VII FINANCE SARL-REG-S 4.62500% 20-05.01.26	690 000.00	870 554.82	0.02
EUR POLYGON AB-REG-S 4.00000% 18-23.02.23	1 800 000.00	2 208 688.20	0.06
EUR PRESTIGE BIDCO GMBH-REG-S 6.25000% 16-15.12.23	2 075 000.00	2 558 590.09	0.06
EUR PRIMO WATER HOLDINGS INC-REG-S 3.87500% 20-31.10.28	6 437 000.00	7 996 268.31	0.20
EUR PRO-GEST SPA-REG-S 3.25000% 17-15.12.24	1 300 000.00	1 486 976.86	0.04
EUR Q-PARK HOLDING I BV-REG-S 1.50000% 20-01.03.25	3 900 000.00	4 489 359.22	0.11
EUR Q-PARK HOLDING I BV-REG-S 2.00000% 20-01.03.27	4 703 000.00	5 342 285.85	0.13
EUR QUATRIM SASU-REG-S 5.87500% 19-15.01.24	2 180 000.00	2 754 972.16	0.07
EUR QUINTILES IMS INC-REG-S 3.25000% 17-15.03.25	6 278 000.00	7 691 515.28	0.19
EUR RCS & RDS SA-REG-S 3.25000% 20-05.02.28	3 500 000.00	4 303 973.08	0.11
EUR REBECCA BIDCO GMBH-REG-S 5.75000% 20-15.07.25	1 450 000.00	1 847 923.65	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

2021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 REKEEP SPA-REG-S 7.25000% 21-01.02.26	1 250 000.00	1 554 692.34	0.04
EUR REXEL SA-REG-S 2.75000% 19-15.06.26	5 000 000.00	6 195 807.77	0.16
EUR ROSSINI SARL-REG-S 6.75000% 18-30.10.25	2 500 000.00	3 231 779.79	0.08
EUR RUBIS TERMINAL INFRA SAS -REG-S 5.62500% 20-15.05.25	760 000.00	978 880.40	0.02
EUR SAFARI HOLDING VERWALTUNGS GMBH-REG-S 5.37500% 17-30.11.22	500 000.00	577 016.75	0.01
EUR SALINI IMPREGILO SPA-REG-S 5.87500% 21-15.12.25	720 000.00	878 463.09	0.02
EUR SCHOELLER PACKAGING BV-REG-S 6.37500% 19-01.11.24	1 800 000.00	2 247 394.91	0.06
EUR SGL CARBON SE-REG-S 4.62500% 19-30.09.24	2 225 000.00	2 639 466.23	0.07
EUR SIGMA HOLDCO BV-REG-S 5.75000% 18-15.05.26	825 000.00	972 478.31	0.02
EUR SMURFIT KAPPA ACQUISITIONS-REG-S 2.87500% 18-15.01.26	2 000 000.00	2 663 998.70	0.07
EUR SMURFIT KAPPA TREASURY ULC-REG-S 1.50000% 19-15.09.27	3 950 000.00	4 988 860.86	0.13
EUR SOFIMA HOLDING SPA-REG-S 3.75000% 20-15.01.28	3 882 000.00	4 734 399.33	0.12
EUR SPCM SA-REG-S 2.62500% 20-01.02.29	3 040 000.00	3 797 483.88	0.10
EUR SPECTRUM BRANDS INC-REG-S 4.00000% 16-01.10.26	4 590 000.00	5 764 995.69	0.14
EUR SPIE SA-REG-S 2.62500% 19-18.06.26	9 900 000.00	12 418 404.07	0.31
EUR SPIE SA-REG-S 3.12500% 17-22.03.24	700 000.00	892 951.50	0.02
EUR SUMMER BC HOLDCO B SARL-REG-S 5.75000% 19-31.10.26	2 830 000.00	3 584 289.10	0.09
EUR SUMMER BIDCO BV-REG-S (PIK) STEP-DOWN 20-15.11.25	800 000.00	1 017 939.20	0.03
EUR SUMMIT GERMANY LTD-REG-S 2.00000% 18-31.01.25	500 000.00	595 519.68	0.01
EUR SUNSHINE MID BV-REG-S 6.50000% 18-15.05.26	1 825 000.00	2 286 524.11	0.06
EUR SUPERIOR INDUSTRIES INTERNATIONAL-REG-S 6.00000% 17-15.06.25	300 000.00	353 557.77	0.01
EUR TECHEM VERWALTUNGSGESELLSCHAFT-REG-S 2.00000% 20-15.07.25	5 775 000.00	6 910 049.06	0.17
EUR TEREOS FINANCE GROUPE I SA-REG-S 4.12500% 16-16.06.23	1 000 000.00	1 189 763.72	0.03
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV-REG-S 1.25000% 15-31.03.23	1 200 000.00	1 418 699.47	0.04
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV-REG-S 1.87500% 15-31.03.27	6 043 000.00	6 791 017.65	0.17
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV-REG-S 1.12500% 16-15.10.24	11 675 000.00	13 390 542.38	0.34
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV-REG-S 1.62500% 16-15.10.28	5 387 000.00	5 882 018.84	0.15
EUR TRANSCOM HOLDING AB 6.50000% 18-22.03.23	1 500 000.00	1 754 011.87	0.04
EUR TRIVIUM PACKAGING FINANCE BV-REG-S 3.75000% 19-15.08.26	4 075 000.00	5 052 712.18	0.13
EUR UGI INTERNATIONAL LLC-REG-S 3.25000% 18-01.11.25	1 470 000.00	1 826 085.82	0.05
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 4.00000% 20-15.11.27	1 150 000.00	1 384 055.02	0.03
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 3.12500% 20-15.02.26	2 600 000.00	3 062 335.26	0.08
EUR UPCB FINANCE IV LTD-REG-S 4.00000% 15-15.01.27	5 500 000.00	6 113 222.51	0.15
EUR UPCB FINANCE VII LTD-REG-S 3.62500% 17-15.06.29	3 100 000.00	3 878 241.69	0.10
EUR VERISURE HOLDING AB-REG-S 3.50000% 18-15.05.23	300 000.00	368 355.25	0.01
EUR VERISURE HOLDING AB-REG-S 3.87500% 20-15.07.26	4 826 000.00	6 011 631.63	0.15
EUR VERISURE HOLDING AB-REG-S 3.25000% 21-15.02.27	1 825 000.00	2 227 697.56	0.06
EUR VERTICAL MIDCO GMBH-REG-S 4.37500% 20-15.07.27	7 560 000.00	9 607 137.63	0.24
EUR VIVION INVESTMENTS SARL-REG-S 3.00000% 19-08.08.24	4 300 000.00	4 838 011.24	0.12
EUR VMED O2 UK FINANCING I PLC-REG-S 3.25000% 20-31.01.31	5 257 000.00	6 514 463.88	0.16
EUR VZ VENDOR FINANCING II BV-REG-S 2.87500% 20-15.01.29	5 118 000.00	6 139 388.83	0.15
EUR WEPA HYGIENEPRODUKTE GMBH-REG-S 2.87500% 19-15.12.27	2 480 000.00	3 056 374.66	0.08
EUR WIENERBERGER AG-REG-S 2.75000% 20-04.06.25	800 000.00	1 044 814.00	0.03
EUR ZF NORTH AMERICA CAPITAL INC 2.75000% 15-27.04.23	1 300 000.00	1 624 827.43	0.04
EUR ZIGGO BV-REG-S 2.87500% 19-15.01.30	1 325 000.00	1 624 461.99	0.04
EUR ZIGGO BV-REG-S 4.25000% 16-15.01.27	5 200 000.00	5 273 023.67	0.13
ユーロ合計		516 603 647.96	12.98
GBP			
GBP AA BOND CO LTD-REG-S 5.50000% 15-31.07.22	125 000.00	171 601.94	0.00
GBP ARQIVA BROADCAST FINANCE PLC-REG-S 6.75000% 18-30.09.23	1 230 000.00	1 747 307.74	0.04
GBP BOPARAN FINANCE PLC-REG-S 7.62500% 20-30.11.25	440 000.00	616 224.49	0.02
GBP CPUK FINANCE LTD-REG-S 4.25000% 17-28.08.22	500 000.00	356 593.31	0.01
GBP GALAXY BIDCO LTD-REG-S 6.50000% 19-31.07.26	770 000.00	1 110 232.20	0.03
GBP HEATHROW FINANCE PLC-REG-S 4.12500% 19-01.09.29	1 650 000.00	2 246 520.87	0.06
GBP MOTO FINANCE PLC-REG-S 4.50000% 17-01.10.22	2 180 000.00	2 888 261.99	0.07
GBP PINEWOOD FINCO PLC-REG-S 3.25000% 19-30.09.25	600 000.00	840 604.38	0.02
GBP VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC-REG-S 5.00000% 17-15.04.27	1 425 000.00	2 054 650.50	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 - ハイ・イールド

2021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 (%)
GBP VIRGIN MEDIA VENDOR FINANCING-REG-S 4.87500% 20-15.07.28	1 025 000.00	1 444 477.67	0.04
GBP VMED 02 UK FINANCING I PLC-REG-S 4.00000% 20-31.01.29	450 000.00	630 298.80	0.02
GBP WILLIAM HILL PLC-REG-S 4.87500% 16-07.09.23	600 000.00	875 382.04	0.02
英債券合計		14 982 155.93	0.38
USD			
USD ALCATEL-LUCENT USA INC 6.45000% 99-15.03.29	1 230 000.00	1 340 700.00	0.03
USD ALLEGHENY LUDLUM CORP 6.95000% 95-15.12.25	130 000.00	141 050.00	0.00
USD ALTICE FINANCING SA-144A 7.50000% 16-15.05.26	1 100 000.00	1 153 625.00	0.03
USD BALL CORP 4.87500% 18-15.03.26	5 287 000.00	5 933 071.40	0.15
USD BUCKEYE PARTNERS L P 4.35000% 14-15.10.24	10 000.00	10 260.80	0.00
USD CENTURYLINK INC 6.87500% 98-15.01.28	3 850 000.00	4 497 185.00	0.11
USD CHARLES SCHWAB CORP/THE-SUB 4.00000% 20-PRP	700 000.00	721 000.00	0.02
USD DELL INC 7.10000% 98-15.04.28	1 000 000.00	1 280 000.00	0.03
USD DEUTSCHE BANK AG-SUB 4.50000% 15-01.04.25	5 375 000.00	5 752 377.41	0.15
USD FORD MOTOR CO 7.40000% 96-01.11.46	340 000.00	411 298.00	0.01
USD FORD MOTOR CO 7.45000% 99-16.07.31	757 000.00	967 067.50	0.02
USD HCA INC 5.37500% 15-01.02.25	1 000 000.00	1 122 740.00	0.03
USD IHO VERWALTUNGS GMBH-144A (PIK) 6.00000% 19-15.05.27	400 000.00	424 626.00	0.01
USD INTELSAT LUXEMBOURG SA *DEFAULTED* 8.12500% 13-01.06.23	4 910 000.00	357 398.90	0.01
USD L BRANDS INC 6.95000% 03-01.03.33	1 492 000.00	1 590 472.00	0.04
USD NETFLIX INC 4.37500% 16-15.11.26	155 000.00	177 234.75	0.01
USD NEW ALBERTSONS LP 7.45000% 99-01.08.29	853 000.00	1 006 540.00	0.03
USD NUSTAR LOGISTICS LP 6.00000% 19-01.06.26	2 230 000.00	2 369 375.00	0.06
USD SPRINT CAPITAL CORPORATION 6.87500% 98-15.11.28	1 532 000.00	1 966 705.00	0.05
USD T-MOBILE USA INC 6.50000% 15-15.01.26	3 551 000.00	3 662 536.91	0.09
USD TELECOM ITALIA CAPITAL 6.00000% 05-30.09.34	1 800 000.00	2 154 375.00	0.05
USD YUM BRANDS INC 6.87500% 07-15.11.37	1 425 000.00	1 831 125.00	0.05
米ドル合計		38 870 763.67	0.98
債券、固定利付債合計		571 034 032.15	14.35
ゼロ・クーポン債			
USD			
USD NYRSTAR HOLDINGS PLC-REG-S 0.00000% 19-31.07.26	763 000.00	586 365.50	0.02
米ドル合計		586 365.50	0.02
ゼロ・クーポン債合計		586 365.50	0.02
債券、変動利付債			
EUR			
EUR 3AB OPTIQUE DEVELOPPEMENT 3M EURIBOR+412.5BP 17-01.10.23	150 000.00	170 532.91	0.00
EUR AAREAL BANK AG-REG-S-SUB 7.625%/VAR 14-PRP	600 000.00	726 206.48	0.02
EUR ABN AMRO BANK NV-REG-S-SUB 4.750%/VAR 17-PRP	1 800 000.00	2 358 966.47	0.06
EUR ABN AMRO BANK NV-REG-S-SUB 4.375%/VAR 20-PRP	1 200 000.00	1 541 399.03	0.04
EUR AKELIUS RESIDENTIAL PROPERT-REG-S-SUB 3.875%/VAR 18-05.10.78	2 040 000.00	2 596 774.10	0.06
EUR ASR NEDERLAND NV-REG-S-SUB 3.375%/VAR 19-02.05.49	2 100 000.00	2 836 881.39	0.07
EUR ASSEMBLIN FINANCING AB-REG-S 3M EURIBOR+500BP 19-15.05.25	2 200 000.00	2 679 461.95	0.07
EUR BANCO BPM SPA-REG-S-SUB 4.375%/VAR 17-21.09.27	1 000 000.00	1 245 097.56	0.03
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 6.500%/VAR 17-PRP	1 800 000.00	2 151 830.88	0.05
EUR BANCO SANTANDER SA-REG-S-SUB 4.375%/VAR 20-PRP	1 200 000.00	1 452 412.95	0.04
EUR BANKIA SA-REG-S-SUB 6.000%/VAR 17-PRP	1 200 000.00	1 508 905.80	0.04
EUR BANKINTER SA-REG-S-SUB 2.500%/VAR 17-06.04.27	1 500 000.00	1 865 612.59	0.05
EUR BAYER AG-REG-S-SUB 3.125%/VAR 19-12.11.79	1 800 000.00	2 263 398.06	0.06
EUR BELFIUS BANK SA/NV-REG-S-SUB 3.625%/VAR 18-PRP	600 000.00	706 926.01	0.02
EUR BNP PARIBAS SA-REG-S-SUB 6.125%/VAR 15-PRP	1 000 000.00	1 281 743.80	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

2021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	BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S-SUB 3.625%/VAR 20-PRP	1 200 000.00	1 585 610.70	0.04
EUR	BRUNELLO BIDCO SPA-REG-S 3M EURIBOR+371BP 21-15.02.28	210 000.00	256 736.31	0.01
EUR	CAIXABANK SA-REG-S-SUB 6.750%/VAR 17-PRP	600 000.00	799 670.50	0.02
EUR	CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S-SUB 4.875%/VAR 19-PRP	975 000.00	1 234 499.76	0.03
EUR	CREDIT AGRICOLE ASSURANCES SA-REG-S-SUB 4.250%/VAR 15-PRP	1 300 000.00	1 743 344.93	0.04
EUR	CREDIT AGRICOLE SA REG-S-SUB 6.500%/VAR 14-PRP	1 800 000.00	2 230 468.93	0.06
EUR	DIOCLE SPA-REG-S 3M EURIBOR+387.5BP 19-30.06.26	850 000.00	930 649.47	0.02
EUR	ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 4.000%/VAR 18-PRP	2 300 000.00	2 996 854.57	0.07
EUR	ELM BV-REG-S-SUB 2.600%/VAR 15-PRP	2 500 000.00	3 250 355.61	0.08
EUR	ERSTE BANK DER OESTER SPARKS-REG-S-SUB 4.250%/VAR 20-PRP	1 800 000.00	2 259 737.32	0.06
EUR	GAMMA BIDCO SPA-REG-S 3M EURIBOR+600BP 20-15.07.25	500 000.00	607 450.00	0.01
EUR	GAS NATURAL FENOSA FINANCE BV-REG-S-SUB 4.125%/VAR 14-PRP	3 400 000.00	4 339 795.32	0.11
EUR	HEMA BDC I BV-REG-S *DEFAULTED* 3M EURIBOR+625BP 17-19.10.25	2 025 000.00	2 533 485.64	0.06
EUR	HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA-REG-S-SUB 3.000%/VAR 19-PRP	4 000 000.00	5 024 340.44	0.13
EUR	HSBC HOLDINGS PLC-144A-REG-S-SUB 5.250%/VAR 14-PRP	1 300 000.00	1 642 544.80	0.04
EUR	INTERNATIONAL DESIGN GRP-REG-S 3M EURIBOR+600BP 18-15.11.25	400 000.00	486 216.59	0.01
EUR	INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB 7.750%/VAR 17-PRP	2 500 000.00	3 618 124.07	0.09
EUR	KBC GROEP NV-REG-S-SUB 4.250%/VAR 18-PRP	1 600 000.00	2 025 286.89	0.05
EUR	LA POSTE SA-REG-S-SUB 3.125%/VAR 18-PRP	4 000 000.00	5 141 427.64	0.13
EUR	LOUVRE BIDCO SAS-REG-S 3M EURIBOR+537.5BP 18-30.09.24	470 000.00	327 918.86	0.01
EUR	MERCK KGAA-REG-S-SUB 2.875%/VAR 19-25.06.79	800 000.00	1 066 682.20	0.03
EUR	NOVEM GROUP GMBH-REG-S 3M EURIBOR+525BP 19-15.05.24	2 625 000.00	3 196 766.37	0.08
EUR	ORSTED A/S-SUB VAR 13-PRP	2 000 000.00	2 733 525.00	0.07
EUR	RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S-SUB 6.625%/VAR 16-PRP	1 800 000.00	2 241 193.10	0.06
EUR	RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S-SUB 3.250%/VAR 19-PRP	3 600 000.00	4 422 843.46	0.11
EUR	RAIFFEISEN BANK INTL AG-REG-S-SUB 6.125%/VAR 17-PRP	600 000.00	759 118.12	0.02
EUR	SAMHALLSBYGGNADSBOLAGET I NOR-REG-S-SUB 4.625%/VAR 19-PRP	1 500 000.00	1 948 365.50	0.05
EUR	SAMHALLSBYGGNADSBOLAGET I NOR-REG-S-SUB 2.624%/VAR 20-PRP	440 000.00	532 898.88	0.01
EUR	SES SA-REG-S-SUB 5.625%/VAR 16-PRP	1 000 000.00	1 330 356.81	0.03
EUR	SISAL PAY SPA-REG-S 3M EURIBOR+387.5BP 19-17.12.26	225 000.00	272 800.33	0.01
EUR	SOFIMA HOLDING SPA-REG-S 3M EURIBOR+400BP 20-15.01.28	1 818 000.00	2 216 418.61	0.05
EUR	SOLVAY FIN SA-REG-S-SUB 5.425%/VAR 13-PRP	4 700 000.00	6 266 757.93	0.16
EUR	SOLVAY FINANCE SA-REG-S-SUB 5.869%/VAR 15-PRP	2 500 000.00	3 417 562.30	0.09
EUR	SOLVAY SA-REG-S-SUB 4.250%/VAR 18-PRP	600 000.00	776 838.65	0.02
EUR	STONEGATE PUB CO FIN-REG-S 3M EURIBOR+575BP 20-31.07.25	650 000.00	756 865.69	0.02
EUR	TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 5.875%/VAR 14-PRP	7 600 000.00	10 322 983.92	0.26
EUR	TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 3.000%/VAR 18-PRP	10 800 000.00	13 448 943.00	0.34
EUR	TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 3.875%/VAR 18-PRP	3 400 000.00	4 450 786.15	0.11
EUR	TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 4.375%/VAR 19-PRP	6 000 000.00	7 872 581.16	0.20
EUR	TENNET HOLDING BV-REG-S-SUB 2.993%/VAR 17-PRP	4 000 000.00	5 114 534.62	0.13
EUR	TRIVIUM PACKAGING FIN BV-REG-S 3M EURIBOR+375BP 19-15.08.26	270 000.00	325 908.56	0.01
EUR	UBS GROUP AG-REG-S-SUB 5.750%/VAR 15-PRP	1 000 000.00	1 264 382.87	0.03
EUR	UNIBAIL-RODAMCO SE-REG-S-SUB 2.125%/VAR 18-PRP	1 500 000.00	1 700 981.49	0.04
EUR	UNIBAIL-RODAMCO SE-REG-S-SUB 2.875%/VAR 18-PRP	1 300 000.00	1 472 762.53	0.04
EUR	VERISURE HOLDING AB-REG-S 3M EURIBOR+500BP 20-15.04.25	950 000.00	1 176 407.11	0.03
EUR	VERTICAL MIDCO GMBH-REG-S 3M EURIBOR+475BP 20-15.07.27	4 673 000.00	5 747 330.11	0.14
EUR	VODAFONE GROUP PLC-REG-S-SUB 3.100%/VAR 18-03.01.79	13 772 000.00	17 317 208.90	0.43
EUR	VOLKSWAGEN INTL FIN NV-REG-S-SUB 3.875%/VAR 17-PRP	1 500 000.00	1 953 316.46	0.05
EUR	VOLKSWAGEN INTL FINANCE NV-REG-S-SUB 4.625%/VAR 18-PRP	2 000 000.00	2 737 164.84	0.07
EUR	WEPA HYGIENEPDUKTE-REG-S 3M EURIBOR+287.5BP 19-15.12.26	600 000.00	728 437.03	0.02
ユーロ合計			175 993 390.03	4.42
<hr/>				
GBP	BARCLAYS PLC-REG-S-SUB 7.875%/VAR 15-PRP	490 000.00	714 081.16	0.02
GBP	M&G PLC-REG-S-SUB 5.625%/VAR 18-20.10.51	925 000.00	1 527 745.08	0.04
GBP	QUILTER PLC-REG-S-SUB 4.478%/VAR 18-28.02.28	2 025 000.00	2 895 435.11	0.07
英ポンド合計			5 137 261.35	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

2021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			
USD BARCLAYS PLC-SUB 7.750%/VAR 18-PRP	800 000.00	871 160.00	0.02
USD CITIGROUP INC-SUB 5.950%/VAR 15-PRP	590 000.00	640 887.50	0.01
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S-SUB 7.125%/VAR 17-PRP	900 000.00	952 875.00	0.02
USD DANSKE BANK AS-REG-S-SUB 6.125%/VAR 17-PRP	1 900 000.00	2 011 625.00	0.05
USD ING GROEP NV-SUB 5.750%/VAR 19-PRP	1 000 000.00	1 083 750.00	0.03
USD JP MORGAN CHASE & CO-SUB 4.600%/VAR 20-PRP	1 487 000.00	1 530 123.00	0.04
USD PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP 6.125%/VAR 17-PRP	1 821 000.00	1 511 065.80	0.04
USD SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN-REG-S-SUB 5.125%/VAR 19-PRP	1 000 000.00	1 047 500.00	0.03
USD SVENSKA HANDELSBANKEN AB-REG-S-SUB 5.250%/VAR 15-PRP	1 500 000.00	1 503 069.00	0.04
USD VODAFONE GROUP PLC-REG-S-SUB 6.250%/VAR 18-03.10.78	3 000 000.00	3 307 812.00	0.08
米ドル合計		14 459 867.30	0.36
債券、変動利付債合計		195 590 518.68	4.91
転換社債型新株予約権付社債、固定利付			
EUR			
EUR TELECOM ITALIA SPA-REG-S 1.12500% 15-26.03.22	2 900 000.00	3 521 025.61	0.09
ユーロ合計		3 521 025.61	0.09
USD			
USD STANDARD CHARTERED PLC-REG-S-SUB COCO 4.75000% 21-PRP	370 000.00	373 814.70	0.01
米ドル合計		373 814.70	0.01
転換社債型新株予約権付社債、固定利付合計		3 894 840.31	0.10
転換社債型新株予約権付社債、変動利付			
EUR			
EUR BANCO BPM SPA-REG-S-SUB COCO 6.125%/VAR 20-PRP	800 000.00	950 848.77	0.02
EUR BANK OF IRELAND GROUP PLC-REG-S-SUB COCO 7.500%/VAR 20-PRP	260 000.00	362 443.30	0.01
EUR BANK OF IRELAND GROUP PLC-REG-S-SUB COCO 6.000%/VAR 20-PRP	300 000.00	390 883.14	0.01
EUR BANKIA SA-REG-S-SUB 6.375%/VAR 18-PRP	1 000 000.00	1 291 511.59	0.03
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB COCO 5.500%/VAR 20-PRP	800 000.00	1 018 484.69	0.03
EUR KBC GROUP NV-REG-S-SUB 4.750%/VAR 19-PRP	600 000.00	773 478.23	0.02
EUR UNIONE DI BANCHE ITALIANE-REG-S-SUB COCO 5.875%/VAR 20-PRP	800 000.00	1 026 639.10	0.03
ユーロ合計		5 814 288.82	0.15
GBP			
GBP BARCLAYS PLC-REG-S-SUB COCO 6.375%/VAR 19-PRP	655 000.00	970 169.44	0.02
GBP LEGAL & GENERAL GROUP PLC-REG-S-SUB COCO 5.625%/VAR 20-PRP	1 800 000.00	2 712 806.04	0.07
GBP NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S-SUB COCO 5.750%/VAR 20-PRP	550 000.00	838 225.31	0.02
英ポンド合計		4 521 200.79	0.11
USD			
USD DANSKE BANK AS-REG-S-SUB 7.000%/VAR 18-PRP	675 000.00	748 122.75	0.02
USD DEUTSCHE BANK AG-SUB COCO 6.000%/VAR 20-PRP	1 000 000.00	968 330.00	0.02
USD JULIUS BAER GROUP-REG-S-SUB COCO 4.875%/VAR 20-PRP	250 000.00	259 967.50	0.01
USD UBS GROUP AG-REG-S-SUB 7.000%/VAR 19-PRP	1 200 000.00	1 311 372.00	0.03
米ドル合計		3 287 792.25	0.08
転換社債型新株予約権付社債、変動利付合計		13 623 281.86	0.34
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		2 118 175 848.43	53.24

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

2021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 (%)
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			
EUR			
EUR	ALTICE FRANCE HOLDING SA-REG-S 8.00000% 19-15.05.27	6 550 000.00	8 721 524.12
ユーロ合計			0.22
ユーロ合計			8 721 524.12
USD			
USD	1011778 BC ULC/NEW RED FINANCE INC-144A 4.25000% 17-15.05.24	727 000.00	739 780.66
USD	1011778 BC ULC/NEW RED FINANCE INC-144A 3.87500% 19-15.01.28	592 000.00	600 761.60
USD	1011778 BC ULC/NEW RED FINANCE IN-144A 4.37500% 19-15.01.28	1 987 000.00	2 026 740.00
USD	1011778 BC ULC/NEW RED FINANCE INC-144A 5.75000% 20-15.04.25	3 004 000.00	3 201 092.44
USD	1011778 BC ULC/NEW RED FINANCE INC-144A 4.00000% 20-15.10.30	2 969 000.00	2 946 732.50
USD	ACADIA HEALTHCARE CO INC-144A 5.00000% 20-15.04.29	689 000.00	725 172.50
USD	ACCO BRANDS CORP-144A 5.25000% 16-15.12.24	3 454 000.00	3 548 985.00
USD	ACI WORLDWIDE INC-144A 5.75000% 18-15.08.26	4 057 000.00	4 275 063.75
USD	ACRISURE LLC / FINANCE INC-144A 7.00000% 17-15.11.25	2 494 000.00	2 565 702.50
USD	ACRISURE LLC / FINANCE INC-144A 8.12500% 19-15.02.24	7 358 000.00	7 686 166.80
USD	ADIANT GLOBAL HOLDINGS LTD-144A 4.87500% 16-15.08.26	1 345 000.00	1 361 812.50
USD	ADT CORP-144A 4.87500% 16-15.07.32	3 676 000.00	3 978 167.20
USD	ALBERTSONS COS INC / SAFEWAY INC-144A 5.87500% 19-15.02.28	2 286 000.00	2 465 496.72
USD	ALBERTSONS COS LLC / SAFEWAY INC-144A 7.50000% 19-15.03.26	520 000.00	573 300.00
USD	ALBERTSONS COS LLC / SAFEWAY INC-144A 4.62500% 19-15.01.27	1 004 000.00	1 052 839.58
USD	ALBERTSONS COS LLC / SAFEWAY INC-144A 3.50000% 20-15.03.29	2 047 000.00	2 021 412.50
USD	ALGECO SCOTSMAN FIN 2 PLC-144A-SUB 10.00000% 18-15.08.23	1 790 000.00	1 807 900.00
USD	ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC STEP-UP 13-15.08.23	680 000.00	743 875.80
USD	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP-144A 4.75000% 19-15.12.24	5 003 000.00	5 078 045.00
USD	ALLIANT HLDG INTER LLC/ISSUER-144A 6.75000% 19-15.10.27	6 822 000.00	7 214 265.00
USD	ALLIED UNIVERSAL HOLDCO/FIN CORP-144A 6.62500% 19-15.07.26	7 473 000.00	8 005 077.60
USD	ALLIED UNIVERSAL HOLDCO LLC-144A 9.75000% 19-15.07.27	5 516 000.00	6 002 842.16
USD	ALLISON TRANSMISSION INC-144A 4.75000% 17-01.10.27	6 955 000.00	7 270 061.50
USD	AMERI MIDSTRM PARTNERS LP/FIN CORP-144A STEP-UP 16-15.12.21	7 593 000.00	7 562 628.00
USD	AMERICAN AIRLINES GROUP INC-144A 5.00000% 19-01.06.22	620 000.00	582 800.00
USD	AMERICAN WOODMARK CORP-144A 4.87500% 18-15.03.26	610 000.00	623 725.00
USD	AMKOR TECHNOLOGY INC-144A 6.62500% 19-15.09.27	1 700 000.00	1 850 875.00
USD	AMN HEALTHCARE INC-144A 4.62500% 19-01.10.27	180 000.00	186 975.00
USD	AMWINS-144A 7.75000% 18-01.07.26	1 263 000.00	1 353 784.44
USD	ANGI GROUP LLC-144A 3.87500% 20-15.08.28	1 220 000.00	1 215 425.00
USD	ANTERO MIDSTREAM PARTNERS/FIN CORP-144A 5.75000% 19-01.03.27	8 364 000.00	8 341 521.75
USD	ANTERO MIDSTREAM PARTNERS/FIN CORP-144A 5.75000% 19-15.01.28	2 500 000.00	2 500 000.00
USD	ANTERO RESOURCES CORP-144A 8.37500% 21-15.07.26	1 375 000.00	1 450 917.19
USD	ARAMARK SERVICES INC-144A 5.00000% 17-01.04.25	1 816 000.00	1 865 395.20
USD	ARCHROCK PARTNERS LP/FIN CORP-144A 6.25000% 19-01.04.28	561 000.00	572 921.25
USD	ASBURY AUTOMOTIVE GROUP INC 4.50000% 20-01.03.28	305 000.00	313 387.50
USD	ASBURY AUTOMOTIVE GROUP INC 4.75000% 20-01.03.30	1 646 000.00	1 731 098.20
USD	ASCEND LEARNING LLC-144A 6.87500% 19-01.08.25	2 893 000.00	2 965 325.00
USD	ASCENT RESOURCES UTICA HOLDINGS-144A 7.00000% 18-01.11.26	4 925 000.00	4 703 375.00
USD	ASGN INC-144A 4.62500% 19-15.05.28	377 000.00	389 787.84
USD	AVANTOR FUNDING INC-144A 4.62500% 20-15.07.28	1 225 000.00	1 286 911.50
USD	AVIS BUDGET CAR RENT LLC/FIN INC-144A 5.25000% 15-15.03.25	850 000.00	850 000.00
USD	AVIS BUDGET CAR RENT LLC/FIN INC-144A 6.37500% 16-01.04.24	3 230 000.00	3 270 375.00
USD	AVIS BUDGET CAR RENT LLC/FIN INC-144A 5.75000% 19-15.07.27	2 363 000.00	2 387 610.65
USD	AXALTA COATING SYSTEMS LLC-144A 3.37500% 20-15.02.29	780 000.00	763 733.10
USD	BAUSCH HEALTH COS INC-144A 5.75000% 19-15.08.27	342 000.00	368 077.50
USD	BAUSCH HEALTH COS INC-144A 5.00000% 19-30.01.28	1 117 000.00	1 150 845.10
USD	BAUSCH HEALTH COS INC-144A 5.25000% 19-30.01.30	1 167 000.00	1 204 997.52
USD	BAUSCH HEALTH COS INC-144A 6.25000% 20-15.02.29	4 151 000.00	4 452 279.58

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

2021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 BEACON ROOFING SUPPLY INC-144A 4.87500% 17-01.11.25	7 348 000.00	7 437 645.60	0.19
USD BEAZER HOMES USA INC 7.25000% 20-15.10.29	800 000.00	898 000.00	0.02
USD BERRY GLOBAL INC-144A 5.62500% 19-15.07.27	1 300 000.00	1 382 875.00	0.03
USD BERRY PLASTICS CORP 5.12500% 15-15.07.23	1 071 501.00	1 094 270.40	0.03
USD BIG RIVER STEEL LLC/BRS FIN CORP-144A 6.62500% 20-31.01.29	994 000.00	1 067 541.09	0.03
USD BLACK KNIGHT INFOSERV LLC-144A 3.62500% 20-01.09.28	4 014 000.00	4 061 967.30	0.10
USD BLUE RACER MIDSTREAM / FINANC CORP-144A 6.62500% 18-15.07.26	4 115 000.00	4 115 000.00	0.10
USD BOMBARDIER INC-144A 6.12500% 13-15.01.23	2 943 000.00	2 955 360.60	0.07
USD BOMBARDIER INC-144A 6.00000% 14-15.10.22	940 000.00	932 950.00	0.02
USD BOMBARDIER INC-144A 7.87500% 19-15.04.27	504 000.00	465 277.68	0.01
USD BOOZ ALLEN HAMILTON INC-144A 3.87500% 20-01.09.28	1 362 000.00	1 402 614.84	0.04
USD BOYD GAMING CORP 4.75000% 20-01.12.27	1 160 000.00	1 188 797.00	0.03
USD BOYD GAMING CORP 6.00000% 18-15.08.26	260 000.00	268 811.40	0.01
USD BOYD GAMING CORP-144A 8.62500% 20-01.06.25	2 372 000.00	2 621 060.00	0.07
USD BRINK ' S CO-144A 5.50000% 20-15.07.25	1 184 000.00	1 258 000.00	0.03
USD BRINKER INTERNATIONAL INC-144A 5.00000% 16-01.10.24	1 780 000.00	1 851 200.00	0.05
USD BROOKFIELD PROPERTY REIT-144A 5.75000% 19-15.05.26	2 158 000.00	2 239 745.04	0.06
USD BROOKFIELD RESIDENT PROPERTIES INC-144A 6.37500% 15-15.05.25	895 000.00	921 850.00	0.02
USD BROOKFIELD RESIDENTIAL PRO/US CORP-144A 6.25000% 19-15.09.27	290 000.00	305 950.00	0.01
USD BUCKEYE PARTNERS LP-144A 4.12500% 20-01.03.25	1 493 000.00	1 513 528.75	0.04
USD BUCKEYE PARTNERS LP-144A 4.50000% 20-01.03.28	783 000.00	808 776.36	0.02
USD BUILDERS FIRSTSOURCE INC-144A 6.75000% 19-01.06.27	4 142 000.00	4 457 827.50	0.11
USD BURLINGTON COAT FACTORY WAREHOUSE-144A 6.25000% 20-15.04.25	796 000.00	851 720.00	0.02
USD BWAY HOLDING CO-144A 5.50000% 17-15.04.24	4 472 000.00	4 526 021.76	0.11
USD BWAY HOLDING CO-144A 7.25000% 17-15.04.25	9 708 000.00	9 606 066.00	0.24
USD BWX TECHNOLOGIES INC-144A 5.37500% 18-15.07.26	1 573 000.00	1 626 686.49	0.04
USD CAESARS ENTERTAINMENT INC-144A 6.25000% 20-01.07.25	5 755 000.00	6 065 280.82	0.15
USD CAESARS ENTERTAINMENT INC-144A 8.12500% 20-01.07.27	2 805 000.00	3 078 487.49	0.08
USD CALPINE CORP-144A 4.50000% 19-15.02.28	2 305 000.00	2 367 696.00	0.06
USD CALPINE CORP-144A 5.25000% 16-01.06.26	262 000.00	270 273.96	0.01
USD CALPINE CORP-144A 5.12500% 19-15.03.28	2 077 000.00	2 149 695.00	0.05
USD CALUMET SPECIALTY PROD PART LP/FIN 7.75000% 15-15.04.23	1 190 000.00	1 148 350.00	0.03
USD CALUMET SPECIALTY PROD PRT LP/FIN-144A 11.00000% 19-15.04.25	2 695 000.00	2 668 050.00	0.07
USD CAMELOT FINANCE SA-144A 4.50000% 19-01.11.26	8 301 000.00	8 633 040.00	0.22
USD CARDTRONICS INC/USA-144A 5.50000% 17-01.05.25	4 084 000.00	4 226 940.00	0.11
USD CARGO AIRCRAFT MANAGEMENT INC-144A 4.75000% 20-01.02.28	636 000.00	661 440.00	0.02
USD CASTLE US HOLDING CORP-144A 9.50000% 20-15.02.28	509 000.00	522 544.49	0.01
USD CATALENT PHARMA SOLUTIONS INC-144A 4.87500% 17-15.01.26	1 641 000.00	1 675 871.25	0.04
USD CATALENT PHARMA SOLUTIONS INC-144A 5.00000% 19-15.07.27	1 758 000.00	1 852 492.50	0.05
USD CBS OUTDOOR AMERICAS CAPITAL LLC-144A 4.62500% 19-15.03.30	836 000.00	833 910.00	0.02
USD CCO HOLDINGS LLC-144A 4.25000% 20-01.02.31	1 680 000.00	1 721 496.00	0.04
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.87500% 15-01.05.27	3 432 000.00	3 566 706.00	0.09
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.75000% 15-15.02.26	2 905 000.00	2 997 379.00	0.08
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.50000% 16-01.05.26	3 000 000.00	3 107 130.00	0.08
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.12500% 17-01.05.27	939 000.00	987 320.94	0.03
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.37500% 19-01.06.29	7 979 000.00	8 655 698.99	0.22
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 4.75000% 19-01.03.30	6 385 000.00	6 791 852.20	0.17
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 4.50000% 20-15.08.30	2 141 000.00	2 254 729.92	0.06
USD CDK GLOBAL INC-144A 5.25000% 19-15.05.29	1 703 000.00	1 845 728.43	0.05
USD CENOVUS ENERGY INC 6.75000% 10-15.11.39	1 549 000.00	2 006 470.79	0.05
USD CENTENE CORP 3.37500% 20-15.02.30	2 672 000.00	2 798 920.00	0.07
USD CENTENE CORP 4.25000% 20-15.12.27	900 000.00	952 096.50	0.02
USD CENTENE CORP 4.62500% 20-15.12.29	1 574 000.00	1 745 101.67	0.04
USD CENTENE CORP-144A 5.37500% 18-01.06.26	3 840 000.00	4 016 448.00	0.10
USD CENTENNIAL RESOURCE PRODUCTION LLC-144A 5.37500% 17-15.01.26	1 250 000.00	1 050 000.00	0.03
USD CENTENNIAL RESOURCE PRODUCTION LLC-144A 6.87500% 19-01.04.27	1 743 000.00	1 513 882.65	0.04
USD CENTURY COMMUNITIES INC 5.87500% 17-15.07.25	2 530 000.00	2 631 200.00	0.07
USD CENTURYLINK INC-144A 5.12500% 19-15.12.26	3 861 000.00	4 105 710.18	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

2021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 CENTURYLINK INC-144A 4.00000% 20-15.02.27	2 520 000.00	2 605 734.94	0.07
USD CHANGE HC HLDS LLC/CHNG HC FIN INC-144A 5.75000% 17-01.03.25	8 651 000.00	8 873 330.70	0.22
USD CHARLES RIVER LABORATORIES INC-144A 5.50000% 18-01.04.26	910 000.00	949 812.50	0.02
USD CHENIERE ENERGY INC-144A 4.62500% 20-15.10.28	2 621 000.00	2 742 221.25	0.07
USD CHENIERE ENERGY PARTNERS LP 4.50000% 20-01.10.29	2 550 000.00	2 741 250.00	0.07
USD CHOBANI LLC/FINANCE CORP-144A 7.50000% 17-15.04.25	781 000.00	806 382.50	0.02
USD CHOBANI LLC/FINANCE CORP-144A 4.62500% 20-15.11.28	295 000.00	300 900.00	0.01
USD CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC-144A 8.12500% 18-30.06.24	2 453 000.00	2 575 650.00	0.06
USD CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC-144A 6.87500% 19-01.04.28	4 541 000.00	4 115 303.96	0.10
USD CHURCHILL DOWNS INC-144A 4.75000% 17-15.01.28	7 970 000.00	8 288 800.00	0.21
USD CHURCHILL DOWNS INC-144A 5.50000% 19-01.04.27	3 036 000.00	3 176 415.00	0.08
USD CINCINNATI BELL INC-144A 7.00000% 16-15.07.24	6 910 000.00	7 169 125.00	0.18
USD CLEAN HARBORS INC-144A 4.87500% 19-15.07.27	488 000.00	513 800.56	0.01
USD CLEAN HARBORS INC-144A 5.12500% 19-15.07.29	1 692 000.00	1 835 820.00	0.05
USD CLEVELAND-CLIFFS INC-144A 6.75000% 20-15.03.26	2 017 000.00	2 170 372.68	0.05
USD CLEVELAND-CLIFFS INC 5.87500% 20-01.06.27	2 199 000.00	2 281 462.50	0.06
USD CLEVELAND-CLIFFS INC-144A 9.87500% 20-17.10.25	1 252 000.00	1 472 201.76	0.04
USD COGENT COMMUNICATIONS GROUP INC-144A 5.37500% 15-01.03.22	650 000.00	665 743.00	0.02
USD COLFAX CORP-144A 6.00000% 19-15.02.24	397 000.00	409 902.50	0.01
USD COLFAX CORP-144A 6.37500% 19-15.02.26	648 000.00	694 306.08	0.02
USD COLGATE ENERGY PARTNERS III LLC-144A 7.75000% 21-15.02.26	923 000.00	881 465.00	0.02
USD COMMSCOPE INC-144A 5.50000% 19-01.03.24	4 014 000.00	4 118 905.89	0.10
USD COMMSCOPE INC-144A 6.00000% 19-01.03.26	2 928 000.00	3 100 020.00	0.08
USD COMMSCOPE INC-144A 8.25000% 19-01.03.27	4 800 000.00	5 169 312.00	0.13
USD COMMSCOPE TECHNOLOGIES LLC-144A 5.00000% 17-15.03.27	80 000.00	79 300.00	0.00
USD COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC-144A 6.50000% 21-15.02.29	747 000.00	747 000.00	0.02
USD COMPASS MINERALS INTERNATIONAL INC-144A 6.75000% 19-01.12.27	1 900 000.00	2 037 750.00	0.05
USD CONNECT FINCO SARL / US FINCO LLC-144A 6.75000% 19-01.10.26	1 431 000.00	1 528 737.30	0.04
USD CONSOL ENERGY INC-144A 7.25000% 19-14.03.27	4 709 000.00	5 063 587.70	0.13
USD CONSTELLUM SE-144A 5.87500% 17-15.02.26	1 639 000.00	1 685 055.90	0.04
USD CONTINENTAL RESOURCES INC 4.90000% 14-01.06.44	36 000.00	34 785.00	0.00
USD CORE & MAIN HOLDINGS LP-144A (PIK) 8.62500% 19-15.09.24	1 405 000.00	1 429 587.50	0.04
USD CORE & MAIN LP-144A 6.12500% 17-15.08.25	1 272 000.00	1 300 620.00	0.03
USD CRC ESCROW ISSUER LLC / FINCO INC-144A 5.25000% 17-15.10.25	2 346 000.00	2 334 516.33	0.06
USD CRESTWOOD MIDSTREAM PART LP/FIN-144A 5.62500% 19-01.05.27	2 105 000.00	2 026 578.23	0.05
USD CROWNROCK LP / CROWNROCK FIN INC-144A 5.62500% 17-15.10.25	7 327 000.00	7 291 427.42	0.18
USD CSC HOLDINGS INC-144A 4.62500% 20-01.12.30	2 087 000.00	2 128 740.00	0.05
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 5.25000% 14-01.06.24	2 000 000.00	2 152 500.00	0.05
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 5.50000% 16-15.04.27	332 000.00	350 160.40	0.01
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 5.50000% 18-15.05.26	1 245 000.00	1 291 326.45	0.03
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 7.50000% 18-01.04.28	3 823 000.00	4 238 751.25	0.11
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 6.50000% 19-01.02.29	452 000.00	502 987.86	0.01
USD CUMULUS MEDIA NEW HOLDINGS INC-144A 6.75000% 19-01.07.26	1 536 000.00	1 559 040.00	0.04
USD CURO GROUP HOLDINGS CORP-144A 8.25000% 18-01.09.25	4 365 000.00	4 277 700.00	0.11
USD DAE FUNDING LLC-144A 5.00000% 17-01.08.24	1 464 000.00	1 511 433.60	0.04
USD DANA FINANCING LUXEMBOURG SARL-144A 5.75000% 17-15.04.25	515 000.00	531 093.75	0.01
USD DAVE & BUSTER ' S INC-144A 7.62500% 20-01.11.25	3 425 000.00	3 604 812.50	0.09
USD DAVITA INC-144A 4.62500% 20-01.06.30	420 000.00	441 134.40	0.01
USD DCP MIDSTREAM OPERATING LP 5.62500% 20-15.07.27	570 000.00	621 300.00	0.02
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP-144A 5.85000% 20-15.07.25	400 000.00	475 087.74	0.01
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP-144A 5.87500% 16-15.06.21	1 995 000.00	1 999 389.00	0.05
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP-144A 7.12500% 16-15.06.24	5 340 000.00	5 546 124.00	0.14
USD DELTA AIR LINES INC / SKYMILES LTD-144A 4.50000% 20-20.10.25	470 000.00	502 262.16	0.01
USD DELTA AIR LINES INC-144A 7.00000% 20-01.05.25	590 000.00	684 156.87	0.02
USD DIAMOND SPORTS GROUP LLC-144A 5.37500% 19-15.08.26	2 885 000.00	2 329 637.50	0.06
USD DIAMOND SPORTS GROUP LLC-144A 6.62500% 19-15.08.27	8 842 000.00	5 614 670.00	0.14
USD DISH DBS CORP 7.75000% 16-01.07.26	2 400 000.00	2 603 820.00	0.07
USD DKT FINANCE APS-144A 9.37500% 18-17.06.23	500 000.00	517 200.00	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 - ハイ・イールド

2021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 DOUBLE EAGLE III MIDCO 1 LLC-144A 7.75000% 20-15.12.25	739 000.00	764 865.00	0.02
USD DUN & BRADSTREET CORP-144A 10.25000% 19-15.02.27	7 676 000.00	8 577 930.00	0.22
USD EG GLOBAL FINANCE PLC-144A 8.50000% 19-30.10.25	4 193 000.00	4 455 062.50	0.11
USD ELDORADO GOLD CORP-144A 9.50000% 19-01.06.24	361 000.00	401 845.12	0.01
USD ENDEAVOR ENERGY RESOURCES LP/FIN-144A 5.50000% 17-30.01.26	1 334 000.00	1 380 690.00	0.03
USD ENDEAVOR ENERGY RESOURCES LP/FIN-144A 6.62500% 20-15.07.25	1 215 000.00	1 297 771.88	0.03
USD ENERGIZER HOLDINGS INC-144A 4.75000% 20-15.06.28	2 978 000.00	3 103 671.60	0.08
USD ENLINK MIDSTREAM PARTNERS LP 4.40000% 14-01.04.24	1 740 000.00	1 722 600.00	0.04
USD ENLINK MIDSTREAM PARTNERS LP 4.85000% 16-15.07.26	1 370 000.00	1 330 324.80	0.03
USD ENOVA INTERNATIONAL INC-144A 8.50000% 17-01.09.24	5 856 000.00	5 753 520.00	0.14
USD ENTEGRIS INC-144A 4.62500% 17-10.02.26	1 195 000.00	1 237 571.87	0.03
USD ENTERCOM MEDIA CORP-144A 7.25000% 16-01.11.24	701 000.00	713 775.72	0.02
USD ENTERCOM MEDIA CORP-144A 6.50000% 19-01.05.27	292 000.00	299 300.00	0.01
USD ENVIVA PARTNERS LP/FINANCE CORP-144A 6.50000% 19-15.01.26	4 227 000.00	4 453 355.85	0.11
USD EQM MIDSTREAM PARTNERS LP-144A 6.00000% 20-01.07.25	538 000.00	562 785.66	0.01
USD EQM MIDSTREAM PARTNERS LP-144A 6.50000% 20-01.07.27	1 970 000.00	2 109 466.15	0.05
USD ESH HOSPITALITY INC-144A 4.62500% 19-01.10.27	1 010 000.00	1 032 704.80	0.03
USD EVERI PAYMENTS INC-144A 7.50000% 17-15.12.25	2 299 000.00	2 373 717.50	0.06
USD EW SCRIPPS CO-144A 5.12500% 17-15.05.25	810 000.00	826 200.00	0.02
USD FAIR ISAAC CORP-144A 4.00000% 19-15.06.28	721 000.00	743 495.20	0.02
USD FAIR ISSAC CORP-144A 5.25000% 18-15.05.26	3 960 000.00	4 474 800.00	0.11
USD FIRSTENERGY TRANSMISSION LLC-144A 5.45000% 14-15.07.44	450 000.00	555 915.88	0.01
USD FIVE POINT OPERATING/CAPITAL CORP-144A 7.87500% 17-15.11.25	519 000.00	547 812.29	0.01
USD FLEX ACQUISITION CO INC-144A 6.87500% 17-15.01.25	300 000.00	304 875.00	0.01
USD FLEX ACQUISITION CO INC-144A 7.87500% 18-15.07.26	6 199 000.00	6 429 602.80	0.16
USD FMG RESOURCES AUGUST 2006 PTY LTD-144A 4.75000% 17-15.05.22	3 695 000.00	3 795 356.20	0.10
USD FMG RESOURCES AUGUST 2006 PTY LTD-144A 5.12500% 17-15.05.24	2 530 000.00	2 722 963.10	0.07
USD FMG RESOURCES AUGUST 2006 PTY LTD-144A 5.12500% 18-15.03.23	1 229 000.00	1 290 142.75	0.03
USD FMG RESOURCES AUGUST 2006 PTY LTD-144A 4.50000% 19-15.09.27	1 350 000.00	1 485 351.00	0.04
USD FREEDOM MORTGAGE CORP-144A 8.25000% 18-15.04.25	6 212 000.00	6 453 522.56	0.16
USD FREEPORT-MCMORAN INC 5.45000% 13-15.03.43	2 224 000.00	2 780 000.00	0.07
USD GANNETT CO INC-144A 5.50000% 14-15.09.2024	660 000.00	671 550.00	0.02
USD GAP INC-144A 8.87500% 20-15.05.27	1 880 000.00	2 194 900.00	0.06
USD GARDA WORLD SECURITY CORP-144A 9.50000% 19-01.11.27	3 767 000.00	4 134 282.50	0.10
USD GARTNER INC-144A 3.75000% 20-01.10.30	457 000.00	469 846.27	0.01
USD GARTNER INC-144A 4.50000% 20-01.07.28	697 000.00	735 125.90	0.02
USD GATEWAY CASINO & ENTERTAINMENT LTD-144A 8.25000% 17-01.03.24	2 194 000.00	2 032 192.50	0.05
USD GENESIS ENERGY LP 5.62500% 14-15.06.24	2 677 000.00	2 516 380.00	0.06
USD GETTY IMAGES INC-144A 9.75000% 19-01.03.27	7 561 000.00	8 071 367.50	0.20
USD GFL ENVIRONMENTAL INC-144A 8.50000% 19-01.05.27	2 174 000.00	2 403 628.75	0.06
USD GFL ENVIRONMENTAL INC-144A 5.12500% 19-15.12.26	1 988 000.00	2 097 340.00	0.05
USD GFL ENVIRONMENTAL INC-144A 3.75000% 20-01.08.25	1 605 000.00	1 637 100.00	0.04
USD GLOBAL AIRCRAFT LEASING CO-144A (PIK) 6.50000% 19-15.09.24	1 113 962.00	996 995.99	0.03
USD GO DADDY OPRNG CO LLC/GD FNE INC-144A 5.25000% 19-01.12.27	3 793 000.00	3 996 058.25	0.10
USD GOEASY LTD-144A 5.37500% 19-01.12.24	4 000 000.00	4 170 000.00	0.11
USD GOLDEN ENTERTAINMENT INC-144A 7.62500% 19-15.04.26	2 485 000.00	2 658 950.00	0.07
USD GOLDEN NUGGET INC-144A 6.75000% 17-15.10.24	992 000.00	994 281.60	0.02
USD GRAHAM HOLDINGS CO-144A 5.75000% 18-01.06.26	885 000.00	928 143.75	0.02
USD GRAHAM PACKAGING CO INC-144A 7.12500% 20-15.08.28	1 909 000.00	2 064 106.25	0.05
USD GRANITE MERGER SUB 2 INC-144A 11.00000% 19-15.07.27	5 240 000.00	6 026 000.00	0.15
USD GRAY ESCROW INC-144A 7.00000% 18-15.05.27	850 000.00	929 007.50	0.02
USD GREAT WESTERN PETROLEUM/FIN INC-144A 9.00000% 16-30.09.21	902 000.00	570 515.00	0.01
USD GREYSTAR REAL ESTATE PARTNERS LLC-144A 5.75000% 17-01.12.25	7 453 000.00	7 676 590.00	0.19
USD GRUBHUB HOLDINGS INC-144A 5.50000% 19-01.07.27	755 000.00	794 637.50	0.02
USD GTCR AP FINANCE INC-144A 8.00000% 19-15.05.27	1 020 000.00	1 099 050.00	0.03
USD H&E EQUIPMENT SERVICES INC-144A 3.87500% 20-15.12.28	280 000.00	278 642.00	0.01
USD H-FOOD HEARTHSIDE FINANCE CO INC-144A 8.50000% 18-01.06.26	660 000.00	688 050.00	0.02
USD HC2 HOLDINGS INC-144A 11.50000% 18-01.12.21	1 938 000.00	1 950 500.10	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

2021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 HERBALIFE NTRTON LTD/HLF FING INC-144A 7.87500% 20-01.09.25	9 111 000.00	9 930 990.00	0.25
USD HERC HOLDINGS INC-144A 5.50000% 19-15.07.27	883 000.00	930 858.60	0.02
USD HESS MIDSTREAM PARTNERS LP-144A 5.62500% 19-15.02.26	2 410 000.00	2 501 375.15	0.06
USD HEXION INC-144A 7.87500% 19-15.07.27	18 000.00	19 237.50	0.00
USD HILCORP ENERGY I LP/FINANCE CO-144A 6.25000% 18-01.11.28	3 141 000.00	3 313 755.00	0.08
USD HILL-ROM HOLDINGS INC-144A 5.00000% 17-15.02.25	1 782 000.00	1 833 232.50	0.05
USD HILLMAN GROUP INC-144A 6.37500% 14-15.07.22	1 149 000.00	1 143 795.03	0.03
USD HILTON DOMESTIC OPERATING CO INC 5.12500% 19-01.05.26	928 000.00	962 057.60	0.02
USD HILTON DOMESTIC OPERATING CO INC 4.87500% 19-15.01.30	6 190 000.00	6 672 355.75	0.17
USD HLF FIN SARL LLC / HERBALF INT INC-144A 7.25000% 18-15.08.26	1 996 000.00	2 107 646.26	0.05
USD HORIZON PHARMA USA INC-144A 5.50000% 19-01.08.27	2 850 000.00	3 035 250.00	0.08
USD HOSPITALITY PROPERTIES TRUST 4.50000% 14-15.03.25	1 040 000.00	1 008 800.00	0.03
USD HOWARD HUGHES CORP-144A 5.37500% 17-15.03.25	3 724 000.00	3 839 481.24	0.10
USD HUB INTERNATIONAL LTD-144A 7.00000% 18-01.05.26	8 909 000.00	9 243 087.50	0.23
USD HUGHES SATELLITE SYSTEMS CORP 5.25000% 17-01.08.26	580 000.00	643 104.00	0.02
USD HUGHES SATELLITE SYSTEMS CORP 6.62500% 17-01.08.26	1 155 000.00	1 306 362.75	0.03
USD IAA SPINCO INC-144A 5.50000% 19-15.06.27	1 742 000.00	1 829 274.20	0.05
USD ICAHN ENTERPRISES FINANCE CORP 4.75000% 20-15.09.24	6 195 000.00	6 543 468.75	0.16
USD ICAHN ENTERPRISES FINANCE CORP 5.25000% 20-15.05.27	1 435 000.00	1 506 778.70	0.04
USD ICAHN ENTERPRISES LP/FINANCE CORP 6.37500% 18-15.12.25	305 000.00	314 531.25	0.01
USD IHEARTCOMMUNICATIONS INC 8.37500% 19-01.05.27	530 000.00	565 308.60	0.01
USD IHEARTCOMMUNICATIONS INC-144A 5.25000% 19-15.08.27	1 245 000.00	1 291 015.20	0.03
USD INDIGO NATURAL RESOURCES LLC-144A 6.87500% 18-15.02.26	1 972 000.00	2 043 386.40	0.05
USD INFRABUILD AUSTRALIA PTY LTD-144A 12.00000% 19-01.10.24	943 000.00	1 004 295.00	0.03
USD INTELLIGENT PACKGING LTD FINCO INC-144A 6.00000% 20-15.09.28	2 548 000.00	2 630 810.00	0.07
USD INTELSAT JACK HOLD SA-144A *DEFAULTED* 9.75000% 17-15.07.25	3 475 000.00	2 519 375.00	0.06
USD INTELSAT JACKHOLD SA-144A *DEFAULTED* 8.50000% 18-15.10.24	2 110 000.00	1 524 475.00	0.04
USD IRB HOLDING CORP-144A 6.75000% 18-15.02.26	3 263 000.00	3 362 423.61	0.08
USD IRON MOUNTAIN INC-144A 4.87500% 17-15.09.27	290 000.00	303 050.00	0.01
USD ITRON INC-144A 5.00000% 17-15.01.26	5 010 000.00	5 110 200.00	0.13
USD JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-144A 7.75000% 20-15.10.25	420 000.00	455 700.00	0.01
USD JBS USA LUX SA/FOOD/FINANCE INC-144A 5.50000% 19-15.01.30	3 298 000.00	3 746 198.20	0.09
USD JELD-WEN INC-144A 4.62500% 17-15.12.25	1 543 000.00	1 573 860.00	0.04
USD KAR AUCTION SERVICES INC-144A 5.12500% 17-01.06.25	2 920 000.00	2 996 650.00	0.08
USD KEN GARFF AUTOMOTIVE LLC-144A 4.87500% 20-15.09.28	3 180 000.00	3 267 609.00	0.08
USD KENNEDY-WILSON INC 4.75000% 21-01.03.29	140 000.00	140 350.00	0.00
USD KENNEDY-WILSON INC 5.87500% 14-01.04.24	1 805 000.00	1 832 977.50	0.05
USD KENNEDY-WILSON INC 5.00000% 21-01.03.31	1 035 000.00	1 037 587.50	0.03
USD KOPPERS INC-144A 6.00000% 17-15.02.25	545 000.00	559 987.50	0.01
USD KORN FERRY-144A 4.62500% 19-15.12.27	1 066 000.00	1 120 899.00	0.03
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 4.37500% 16-01.06.46	15 859 000.00	16 887 923.83	0.42
USD LABL ESCROW ISSUER LLC-144A 10.50000% 19-15.07.27	4 768 000.00	5 280 560.00	0.13
USD LABL ESCROW ISSUER LLC-144A 6.75000% 19-15.07.26	5 467 000.00	5 853 106.87	0.15
USD LAMAR MEDIA CORP 3.75000% 20-15.02.28	651 000.00	660 576.21	0.02
USD LAMB WESTON HOLDINGS INC-144A 4.62500% 16-01.11.24	556 000.00	579 240.80	0.01
USD LAMB WESTON HOLDINGS INC-144A 4.87500% 16-01.11.26	4 338 000.00	4 500 675.00	0.11
USD LD HOLDINGS GROUP LLC-144A 6.50000% 20-01.11.25	735 000.00	780 937.50	0.02
USD LEVEL 3 FINANCING INC-144A 4.62500% 19-15.09.27	2 278 000.00	2 366 636.98	0.06
USD LGI HOMES INC-144A 6.87500% 18-15.07.26	1 860 000.00	1 964 625.00	0.05
USD LIFE TIME INC-144A-SUB 8.50000% 15-15.06.23	6 490 000.00	6 498 112.50	0.16
USD LIFEPOINT HEALTH INC-144A 6.75000% 20-15.04.25	580 000.00	619 150.00	0.02
USD LIONS GATE CAPITAL HOLDINGS LLC-144A 6.37500% 19-01.02.24	1 166 000.00	1 192 235.00	0.03
USD LIVE NATION ENTERTAINMENT INC-144A 4.87500% 16-01.11.24	7 776 000.00	7 814 880.00	0.20
USD LIVE NATION ENTERTAINMENT INC-144A 4.75000% 19-15.10.27	1 060 000.00	1 062 650.00	0.03
USD LPL HOLDINGS INC-144A 5.75000% 17-15.09.25	95 000.00	98 163.50	0.00
USD M/I HOMES INC 4.95000% 20-01.02.28	420 000.00	442 365.00	0.01
USD MACY ' S INC-144A 8.37500% 20-15.06.25	845 000.00	935 837.50	0.02
USD MACYS RETAIL HOLDINGS INC 2.87500% 12-15.02.23	900 000.00	875 907.00	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

2021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 MAGNOLIA OIL & GAS OPERATING LLC-144A 6.00000% 18-01.08.26	720 000.00	748 080.00	0.02
USD MANITOWOC CO INC/THE-144A 9.00000% 19-01.04.26	1 300 000.00	1 399 125.00	0.04
USD MASONITE INTERNATIONAL CORP-144A 5.37500% 19-01.02.28	2 087 000.00	2 234 363.07	0.06
USD MASTEC INC-144A 4.50000% 20-15.08.28	1 826 000.00	1 923 325.80	0.05
USD MATADOR RESOURCES CO 5.87500% 18-15.09.26	8 003 000.00	7 642 865.00	0.19
USD MATCH GROUP HOLDINGS II LLC-144A 5.00000% 17-15.12.27	2 429 000.00	2 563 129.38	0.06
USD MATCH GROUP HOLDINGS II LLC-144A 5.62500% 19-15.02.29	5 630 000.00	6 108 550.00	0.15
USD MATTAMY GROUP CORP-144A 5.25000% 19-15.12.27	375 000.00	394 687.50	0.01
USD MATTEL INC 3.15000% 13-15.03.23	900 000.00	914 625.00	0.02
USD MATTEL INC-144A 5.87500% 19-15.12.27	351 000.00	387 058.23	0.01
USD MATTHEWS INTERNATIONAL CORP-144A 5.25000% 17-01.12.25	6 306 000.00	6 424 237.50	0.16
USD MEG ENERGY CORP-144A 7.12500% 20-01.02.27	3 956 000.00	4 084 570.00	0.10
USD MEREDITH CORP-144A 6.50000% 20-01.07.25	235 000.00	248 806.25	0.01
USD MERITOR INC-144A 6.25000% 20-01.06.25	145 000.00	154 425.00	0.00
USD METHANEX CORP 5.65000% 14-01.12.44	660 000.00	686 400.00	0.02
USD MGM GROWTH POP LP/CO-ISSUER INC 4.50000% 18-15.01.28	2 900 000.00	3 045 000.00	0.08
USD MGM GROWTH POP LP/CO-ISSUER INC-144A 4.62500% 20-15.06.25	4 018 000.00	4 259 080.00	0.11
USD MILEAGE PLUS HOLDINGS LLC-144A 6.50000% 20-20.06.27	2 657 000.00	2 906 093.75	0.07
USD MINERAL RESOURCES LTD-144A 8.12500% 19-01.05.27	5 760 000.00	6 364 800.00	0.16
USD MOLINA HEALTHCARE INC-144A 4.37500% 20-15.06.28	630 000.00	656 441.10	0.02
USD MOLINA HEALTHCARE INC-144A 3.87500% 20-15.11.30	1 308 000.00	1 397 925.00	0.04
USD MOOG INC-144A 4.25000% 19-15.12.27	447 000.00	463 762.50	0.01
USD MOSS CREEK RESOURCES HOLDINGS INC-144A 7.50000% 18-15.01.26	699 000.00	591 892.23	0.02
USD MPH ACQUISITION HOLDINGS LLC-144A 5.75000% 20-01.11.28	4 851 000.00	4 808 553.75	0.12
USD MSCI INC-144A 4.00000% 19-15.11.29	443 000.00	471 090.63	0.01
USD MUELLER WATER PRODUCTS INC-144A 5.50000% 18-15.06.26	2 532 000.00	2 620 620.00	0.07
USD NABORS INDUSTRIES LTD-144A 7.25000% 20-15.01.26	1 161 000.00	934 605.00	0.02
USD NABORS INDUSTRIES LTD-144A 7.50000% 20-15.01.28	605 000.00	479 087.40	0.01
USD NATIONAL CINEMEDIA LLC-144A 5.87500% 19-15.04.28	1 594 000.00	1 438 585.00	0.04
USD NATIONSTAR MORTGAGE HOLDINGS INC-144A 6.00000% 20-15.01.27	605 000.00	639 787.50	0.02
USD NAVIENT CORP 5.50000% 13-25.01.23	635 000.00	665 331.09	0.02
USD NAVIENT CORP 5.87500% 14-25.10.24	635 000.00	673 893.75	0.02
USD NAVISTAR INTERNATIONAL CORP-144A 9.50000% 20-01.05.25	2 640 000.00	2 938 729.20	0.07
USD NCL CORP LTD-144A 3.62500% 19-15.12.24	429 000.00	380 823.30	0.01
USD NCR ESCROW CORP-144A 5.00000% 20-01.10.28	4 329 000.00	4 448 047.50	0.11
USD NETFLIX INC-144A 4.87500% 19-15.06.30	1 146 000.00	1 392 390.00	0.03
USD NEW ENTERPRISE STONE&LIME CO INC-144A 6.25000% 18-15.03.26	4 095 000.00	4 217 850.00	0.11
USD NEW GOLD INC-144A 6.37500% 17-15.05.25	283 000.00	292 905.00	0.01
USD NEWFIELD EXPLORATION CO 5.62500% 12-01.07.24	7 781 000.00	8 467 685.53	0.21
USD NEXSTAR BROADCASTING INC-144A 5.62500% 19-15.07.27	4 408 000.00	4 678 915.68	0.12
USD NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD-144A 5.87500% 14-15.11.21	705 000.00	707 263.05	0.02
USD NEXTERA ENERGY PARTNERS LP-144A 4.50000% 17-15.09.27	1 212 000.00	1 345 320.00	0.03
USD NIELSEN CO LUXEMBOURG SARL/THE-144A 5.00000% 17-01.02.25	640 000.00	656 000.00	0.02
USD NIELSEN FINANCE LLC/CO-144A 5.00000% 14-15.04.22	544 000.00	544 000.00	0.01
USD NIELSEN FINANCE LLC/NIELSEN-144A 5.62500% 20-01.10.28	2 004 000.00	2 141 614.68	0.05
USD NINE ENERGY SERVICE INC-144A 8.75000% 18-01.11.23	312 000.00	129 480.00	0.00
USD NOBLE HOLDING INTL-144A *DEFAULTED* 7.87500% 18-01.02.26	935 000.00	537 625.00	0.01
USD NOVA CHEMICALS CORP-144A 5.25000% 13-01.08.23	1 960 000.00	1 964 900.00	0.05
USD NOVA CHEMICALS CORP-144A 4.87500% 17-01.06.24	1 000 000.00	1 025 000.00	0.03
USD NOVELIS CORP-144A 4.75000% 20-30.01.30	7 007 000.00	7 357 350.00	0.19
USD NOVELIS CORP-144A 5.87500% 16-30.09.26	1 205 000.00	1 262 237.50	0.03
USD NRG ENERGY INC-144A 5.25000% 19-15.06.29	1 219 000.00	1 340 900.00	0.03
USD NUFARM AUSTRALIA LTD/AMERICAS-144A 5.75000% 18-30.04.26	4 906 000.00	5 053 572.48	0.13
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 4.62500% 15-15.06.45	833 000.00	726 282.30	0.02
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 3.45000% 19-15.07.24	187 000.00	179 520.00	0.00
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 6.45000% 19-15.09.36	8 561 000.00	9 394 627.38	0.24
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 6.20000% 19-15.03.40	367 000.00	381 680.00	0.01
USD OPE KAG FINANCE SUB INC-144A 7.87500% 15-31.07.23	7 430 000.00	7 392 850.00	0.19

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

2021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 OPEN TEXT CORP-144A 3.87500% 20-15.02.28	2 475 000.00	2 536 875.00	0.06
USD OPEN TEXT HOLDINGS INC-144A 4.12500% 20-15.02.30	761 000.00	798 821.70	0.02
USD OUTFRONT MEDIA CAPITAL LLC/CORP-144A 5.00000% 19-15.08.27	355 000.00	365 934.00	0.01
USD OUTFRONT MEDIA CAPITAL LLC/CORP-144A 6.25000% 20-15.06.25	797 000.00	843 823.75	0.02
USD OVINTIV INC 6.62500% 07-15.08.37	500 000.00	601 974.77	0.02
USD OWENS-BROCKWAY GLASS CONTAINER INC-144A 5.87500% 15-15.08.23	635 000.00	679 450.00	0.02
USD OWENS-BROCKWAY GLASS CONTAINER INC-144A 6.62500% 20-13.05.27	1 754 000.00	1 900 327.45	0.05
USD PANTHER BF AGGR 2/PANTHER FIN CO-144A 6.25000% 19-15.05.26	1 402 000.00	1 491 966.34	0.04
USD PANTHER BF AGGR 2/PANTHER FIN CO-144A 8.50000% 19-15.05.27	4 054 000.00	4 293 186.00	0.11
USD PAR PHARMACEUTICAL INC-144A 7.50000% 19-01.04.27	1 020 000.00	1 099 886.40	0.03
USD PARK INTERMEDIATE HOLDINGS/PK DOME-144A 5.87500% 20-01.10.28	3 141 000.00	3 290 197.50	0.08
USD PARKLAND FUEL CORP-144A 6.00000% 18-01.04.26	4 865 000.00	5 108 250.00	0.13
USD PARKLAND FUEL CORP-144A 5.87500% 19-15.07.27	963 000.00	1 030 410.00	0.03
USD PARSLEY ENERGY LLC/FINANCE CORP-144A 5.62500% 17-15.10.27	599 000.00	655 156.25	0.02
USD PBF LOGISTICS LP/FINANCE CORP 6.87500% 15-15.05.23	9 238 000.00	8 859 242.00	0.22
USD PDC ENERGY INC 5.75000% 18-15.05.26	2 500 000.00	2 546 825.00	0.06
USD PENN NATIONAL GAMING INC-144A 5.62500% 17-15.01.27	4 019 000.00	4 227 988.00	0.11
USD PENNYMAC FINANCIAL SERVICES INC-144A 5.37500% 20-15.10.25	321 000.00	336 247.50	0.01
USD PERFORMANCE FOOD GROUP INC-144A 5.50000% 19-15.10.27	829 000.00	872 522.50	0.02
USD PERFORMANCE FOOD GROUP INC-144A 5.50000% 16-01.06.24	4 845 000.00	4 875 523.50	0.12
USD PHOTO HOLDINGS MERGER SUB INC-144A 8.50000% 19-01.10.26	6 208 000.00	6 549 440.00	0.16
USD PICASSO FINANCE SUB INC -144A 6.12500% 20-15.06.25	1 003 000.00	1 070 411.63	0.03
USD PILGRIMS PRIDE CORP-144A 5.87500% 17-30.09.27	2 008 000.00	2 136 913.60	0.05
USD PLANTRONICS INC-144A 5.50000% 15-31.05.23	3 560 000.00	3 573 350.00	0.09
USD POLYONE CORP -144A 5.75000% 20-15.05.25	1 983 000.00	2 104 458.75	0.05
USD POST HOLDINGS INC-144A 5.00000% 16-15.08.26	3 575 000.00	3 687 719.75	0.09
USD POST HOLDINGS INC-144A 5.75000% 17-01.03.27	6 661 000.00	6 985 723.75	0.18
USD POST HOLDINGS INC-144A 5.62500% 17-15.01.28	3 810 000.00	4 040 981.25	0.10
USD POST HOLDINGS INC-144A 4.62500% 20-15.04.30	4 344 000.00	4 502 425.68	0.11
USD PRECISION DRILLING CORP 5.25000% 15-15.11.24	230 000.00	211 600.00	0.01
USD PRESIDIO HOLDINGS INC-144A 4.87500% 20-01.02.27	219 000.00	230 031.03	0.01
USD PRESIDIO HOLDINGS INC-144A 8.25000% 20-01.02.28	2 035 000.00	2 261 393.75	0.06
USD PRESTIGE BRANDS INC-144A 6.37500% 16-01.03.24	3 761 000.00	3 836 220.00	0.10
USD PRESTIGE BRANDS INC-144A 5.12500% 19-15.01.28	318 000.00	338 169.15	0.01
USD PRIME SEC SER BORROWER LLC/FIN INC-144A 5.25000% 19-15.04.24	975 000.00	1 037 156.25	0.03
USD PRIME SEC SER BORROWER LLC/FIN INC-144A 6.25000% 20-15.01.28	1 209 000.00	1 287 585.00	0.03
USD PRIME SEC SER BORROWER LLC/FIN INC-144A 3.37500% 20-31.08.27	3 012 000.00	2 972 964.48	0.07
USD PROVIDENCE SERVICE CORP/THE-144A 5.87500% 20-15.11.25	1 302 000.00	1 380 120.00	0.03
USD PTC INC-144A 3.62500% 20-15.02.25	215 000.00	220 375.00	0.01
USD QUEBECOR MEDIA INC 5.75000% 13-15.01.23	4 994 000.00	5 354 566.80	0.13
USD QUICKEN LOANS INC-144A 5.25000% 17-15.01.28	320 000.00	341 600.00	0.01
USD QUINTILES IMS INC-144A 5.00000% 16-15.10.26	2 000 000.00	2 077 500.00	0.05
USD RADIATE HOLDCO LLC/FINANCE INC-144A 6.50000% 20-15.09.28	808 000.00	850 420.00	0.02
USD RAYONIER AM PRODUCTS INC-144A 5.50000% 14-01.06.24	3 333 000.00	3 009 699.00	0.08
USD REALOGY GROUP/CO ISSUER-144A 4.87500% 16-01.06.23	2 840 000.00	2 932 300.00	0.07
USD REGIONALCARE HOSPITAL PTRS HLDNGS-144A 9.75000% 18-01.12.26	2 022 000.00	2 204 839.35	0.06
USD RESIDEO FUNDING INC-144A 6.12500% 18-01.11.26	2 750 000.00	2 921 875.00	0.07
USD RESOLUTE FOREST PRODUCTS-144A 4.87500% 21-01.03.26	1 960 000.00	1 950 200.00	0.05
USD RITE AID CORP-144A 7.50000% 20-01.07.25	971 000.00	1 021 977.50	0.03
USD SCHWEITZER-MAUDUIT INTERNATNAL INC-144A 6.87500% 18-01.10.26	1 960 000.00	2 078 344.80	0.05
USD SCIENTIFIC GAMES INTERNATIONAL-144A 8.25000% 19-15.03.26	2 320 000.00	2 453 133.20	0.06
USD SCIENTIFIC GAMES INTERNATIONAL INC-144A 7.00000% 19-15.05.28	444 000.00	470 640.00	0.01
USD SCIENTIFIC GAMES INTERNATIONAL-144A 7.25000% 19-15.11.29	480 000.00	517 200.00	0.01
USD SCIENTIFIC GAMES INTERNATIONAL INC-144A 8.62500% 20-01.07.25	5 245 000.00	5 671 156.25	0.14
USD SCRIPPS ESCROW INC-144A 5.87500% 19-15.07.27	2 111 000.00	2 200 084.20	0.06
USD SELECT MEDICAL CORP-144A 6.25000% 19-15.08.26	335 000.00	357 947.50	0.01
USD SENSATA TECHNOLOGIES BV-144A 4.87500% 13-15.10.23	1 000 000.00	1 072 500.00	0.03
USD SENSATA TECHNOLOGIES BV-144A 5.62500% 14-01.11.24	2 188 000.00	2 423 210.00	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

2021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 SENSATA TECHNOLOGIES BV-144A 5.00000% 15-01.10.25	6 067 000.00	6 688 867.50	0.17
USD SENSATA TECHNOLOGIES UK FINANCING-144A 6.25000% 15-15.02.26	1 102 000.00	1 138 178.66	0.03
USD SENSATA TECHNOLOGIES INC-144A 4.37500% 19-15.02.30	625 000.00	672 656.25	0.02
USD SENSATA TECHNOLOGIES INC-144A 3.75000% 20-15.02.31	823 000.00	844 636.67	0.02
USD SERVICE PROPERTIES TRUST 3.95000% 17-15.01.28	1 019 000.00	927 290.00	0.02
USD SERVICEMASTER CO LLC/THE 7.45000% 97-15.08.27	2 900 000.00	3 400 250.00	0.09
USD SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD-144A 5.37500% 17-30.09.25	3 244 000.00	3 293 627.69	0.08
USD SHELF DRILLING HOLDINGS LTD-144A 8.25000% 18-15.02.25	1 645 000.00	908 862.50	0.02
USD SINCLAIR TELEVISION GROUP INC-144A 5.50000% 19-01.03.30	3 820 000.00	3 936 930.20	0.10
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 5.00000% 17-01.08.27	5 762 000.00	6 056 063.67	0.15
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 4.62500% 19-15.07.24	5 731 000.00	5 925 624.76	0.15
USD SIX FLAGS ENTERTAINMENT CORP-144A 4.87500% 16-31.07.24	2 015 000.00	1 999 887.50	0.05
USD SOLERA LLC/SOLERA FINANCE INC-144A 10.50000% 16-01.03.24	9 734 000.00	9 994 092.48	0.25
USD SPECTRUM BRANDS INC-144A 5.00000% 19-01.10.29	1 298 000.00	1 373 683.13	0.03
USD SPECTRUM BRANDS INC-144A 5.50000% 20-15.07.30	1 022 000.00	1 098 650.00	0.03
USD SPIRIT AEROSYSTEMS INC-144A 7.50000% 20-15.04.25	4 530 000.00	4 859 376.30	0.12
USD SRS DISTRIBUTION INC-144A 8.25000% 18-01.07.26	1 809 000.00	1 918 082.70	0.05
USD SS&C TECHNOLOGIES INC-144A 5.50000% 19-30.09.27	4 897 000.00	5 185 971.97	0.13
USD SSL ROBOTICS LLC-144A 9.75000% 19-31.12.23	7 013 000.00	7 894 043.19	0.20
USD STANDARD INDUSTRIES INC/NJ-144A 5.00000% 17-15.02.27	353 000.00	367 561.25	0.01
USD STANDARD INDUSTRIES INC/NJ-144A 4.75000% 17-15.01.28	1 000 000.00	1 054 050.00	0.03
USD STAPLES INC-144A 7.50000% 19-15.04.26	715 000.00	729 364.35	0.02
USD STARWOOD PROPERTY TRUST INC 4.75000% 18-15.03.25	8 843 000.00	8 849 985.97	0.22
USD SUBURBAN PROPANE PARTNERS LP/SUBURBAN 5.50000% 14-01.06.24	635 000.00	642 950.20	0.02
USD SUMMIT MATERIALS LLC/FIN-144A 6.50000% 19-15.03.27	1 174 000.00	1 244 440.00	0.03
USD SUMMIT MATERIALS LLC/FIN CORP-144A 5.25000% 20-15.01.29	3 537 000.00	3 722 692.50	0.09
USD SUMMIT MIDSTREAM HLDG LLC/FIN CORP 5.50000% 14-15.08.22	4 736 000.00	4 546 560.00	0.11
USD SUNOCO LP/FINANCE CORP 5.50000% 18-15.02.26	915 000.00	940 327.20	0.02
USD SUNOCO LP/FINANCE CORP 6.00000% 19-15.04.27	5 900 000.00	6 246 625.00	0.16
USD SUNOCO LP/FINANCE CORP-144A 4.50000% 20-15.05.29	390 000.00	398 620.95	0.01
USD TALEN ENERGY SUPPLY LLC-144A 10.50000% 17-15.01.26	1 310 000.00	1 205 200.00	0.03
USD TALEN ENERGY SUPPLY LLC-144A 6.62500% 19-15.01.28	480 000.00	499 200.00	0.01
USD TALLGRASS ENRGY PART LP/FIN CORP-144A 5.50000% 17-15.01.28	400 000.00	396 000.00	0.01
USD TARGA RESOURCES PARTNERS 5.00000% 17-15.01.28	355 000.00	366 537.50	0.01
USD TARGA RESOURCES PARTNERS-144A 4.87500% 20-01.02.31	2 454 000.00	2 560 749.00	0.06
USD TAYLOR MORRISON COMMUNITIES INC-144A 5.87500% 19-15.06.27	2 485 000.00	2 807 354.20	0.07
USD TAYLOR MORRISON COMMUNITIES INC-144A 5.75000% 19-15.01.28	953 000.00	1 074 507.50	0.03
USD TEAM HEALTH HOLDINGS INC-144A 6.37500% 17-01.02.25	1 348 000.00	1 213 200.00	0.03
USD TECHNIPFMC PLC-144A 6.50000% 21-01.02.26	1 914 000.00	1 993 739.48	0.05
USD TEGNA INC-144A 4.62500% 20-15.03.28	1 235 000.00	1 250 270.77	0.03
USD TEGNA INC-144A 4.75000% 20-15.03.26	305 000.00	323 300.00	0.01
USD TELESAT CANADA/TELESAT LLC-144A 4.87500% 19-01.06.27	102 000.00	106 069.80	0.00
USD TENET HEALTHCARE CORP-144A 4.87500% 19-01.01.26	4 334 000.00	4 520 925.42	0.11
USD TENET HEALTHCARE CORP-144A 5.12500% 19-01.11.27	1 426 000.00	1 502 804.36	0.04
USD TENET HEALTHCARE CORP-144A 4.62500% 19-01.09.24	238 000.00	244 247.50	0.01
USD TENET HEALTHCARE CORP-144A 4.62500% 20-15.06.28	1 923 000.00	2 011 640.69	0.05
USD TEREX CORP-144A 5.62500% 17-01.02.25	690 000.00	706 387.50	0.02
USD TERRAFORM POWER OPERATING LLC-144A 4.25000% 17-31.01.23	1 916 000.00	1 972 608.22	0.05
USD TERRIER MEDIA BUYER INC-144A 8.87500% 19-15.12.27	2 510 000.00	2 713 937.50	0.07
USD TMS INTERNATIONAL CORP-144A 7.25000% 17-15.08.25	702 000.00	712 530.00	0.02
USD TOPBUILD CORP-144A 5.62500% 18-01.05.26	2 420 000.00	2 492 600.00	0.06
USD TOWNSQUARE MEDIA INC-144A 6.87500% 21-01.02.26	760 000.00	784 700.00	0.02
USD TRANSDIGM INC-144A 6.25000% 19-15.03.26	1 994 000.00	2 109 053.80	0.05
USD TRANSDIGM INC-144A 8.00000% 20-15.12.25	241 000.00	263 593.75	0.01
USD TRANSDIGM UK HOLDINGS PLC-SUB 6.87500% 19-15.05.26	7 890 000.00	8 311 890.13	0.21
USD TRANSOCEAN GUARDIAN LTD-144A 5.87500% 18-15.01.24	465 000.00	298 355.62	0.01
USD TRANSOCEAN INC-144A 7.50000% 17-15.01.26	1 115 000.00	557 500.00	0.01
USD TRANSOCEAN PONTUS LTD-144A 6.12500% 18-01.08.25	320 000.00	230 880.00	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 - ハイ・イールド

2021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 TRANSOCEAN POSEIDON LTD-144A 6.87500% 19-01.02.27	310 000.00	279 000.00	0.01
USD TRI POINTE HOLDINGS INC 5.87500% 15-15.06.24	5 710 000.00	6 231 037.50	0.16
USD TRIDENT MERGER SUB INC-144A 6.62500% 17-01.11.25	365 000.00	372 300.00	0.01
USD TRIMAS CORP-144A 4.87500% 17-15.10.25	1 875 000.00	1 918 040.62	0.05
USD TRIUMPH GROUP INC 5.25000% 14-01.06.22	1 780 000.00	1 691 000.00	0.04
USD TRIUMPH GROUP INC-144A 6.25000% 19-15.09.24	4 220 000.00	4 159 337.50	0.10
USD TRONOX FINANCE PLC-144A 5.75000% 17-01.10.25	1 870 000.00	1 916 750.00	0.05
USD TUTOR PERINI CORP-144A 6.87500% 17-01.05.25	2 706 000.00	2 746 590.00	0.07
USD TWIN RIVER WORLDWIDE HOLDINGS INC-144A 6.75000% 19-01.06.27	1 750 000.00	1 876 875.00	0.05
USD UBER TECHNOLOGIES INC-144A 8.00000% 18-01.11.26	75 000.00	80 934.37	0.00
USD UBER TECHNOLOGIES INC-144A 7.50000% 19-15.09.27	7 870 000.00	8 627 566.20	0.22
USD UNITI GROUP LP/FIBER HLDG/CSL CAP-144A 7.12500% 16-15.12.24	166 000.00	170 930.20	0.00
USD UNIVAR SOLUTIONS USA-144A 5.12500% 19-01.12.27	3 950 000.00	4 147 500.00	0.10
USD UPC HOLDING BV-144A 5.50000% 17-15.01.28	617 000.00	645 536.25	0.02
USD US FOODS INC-144A 5.87500% 16-15.06.24	521 000.00	528 710.80	0.01
USD US FOODS INC-144A 6.25000% 20-15.04.25	4 204 000.00	4 487 770.00	0.11
USD USA COMPRESSION PARTNERS LLC 6.87500% 19-01.04.26	1 565 000.00	1 635 738.00	0.04
USD USI INC/NY-144A 6.87500% 17-01.05.25	1 240 000.00	1 259 926.80	0.03
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 6.12500% 15-15.04.25	155 000.00	158 806.80	0.00
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 7.00000% 17-15.03.24	6 868 000.00	7 020 469.60	0.18
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 5.50000% 17-01.11.25	1 828 000.00	1 882 291.60	0.05
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 9.25000% 18-01.04.26	6 789 000.00	7 535 111.10	0.19
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 8.50000% 18-31.01.27	3 541 000.00	3 921 657.50	0.10
USD VAREX IMAGING CORP-144A 7.87500% 20-15.10.27	3 071 000.00	3 285 970.00	0.08
USD VECTOR GROUP LTD-144A 10.50000% 18-01.11.26	5 840 000.00	6 250 435.20	0.16
USD VERSCEND ESCROW CORP-144A 9.75000% 18-15.08.26	6 755 000.00	7 286 618.50	0.18
USD VIASAT INC-144A 5.62500% 19-15.04.27	2 026 000.00	2 129 832.50	0.05
USD VICI PROPERTIES LP /VCI NTE CO INC-144A 4.25000% 19-01.12.26	700 000.00	724 045.00	0.02
USD VICI PROPERTIES LP /VCI NTE CO INC-144A 4.62500% 19-01.12.29	3 315 000.00	3 530 475.00	0.09
USD VIKING CRUISES LTD-144A 5.87500% 17-15.09.27	3 306 000.00	3 197 364.84	0.08
USD VIKING OCEAN CRUISES SHIP VII LTD-144A 5.62500% 21-15.02.29	283 000.00	283 000.00	0.01
USD VISTRA OPERATIONS CO LLC-144A 5.62500% 19-15.02.27	811 000.00	855 532.01	0.02
USD VISTRA OPERATIONS CO LLC-144A 4.30000% 19-15.07.29	176 000.00	202 422.02	0.01
USD VISTRA OPERATIONS CO LLC-144A 5.00000% 19-31.07.27	2 207 000.00	2 323 308.90	0.06
USD VIZIENT INC-144A 6.25000% 19-15.05.27	1 643 000.00	1 745 687.50	0.04
USD WEST STREET MERGER SUB INC-144A 6.37500% 17-01.09.25	4 345 000.00	4 475 350.00	0.11
USD WESTERN GAS PARTNERS LP 3.95000% 15-01.06.25	700 000.00	710 500.00	0.02
USD WILLIAM CARTER CO-144A 5.50000% 20-15.05.25	254 000.00	269 875.00	0.01
USD WILLIAM CARTER COMPANY-144A 5.62500% 19-15.03.27	675 000.00	712 968.75	0.02
USD WILLIAMS SCOTSMAN INTL INC-144A 4.62500% 20-15.08.28	1 128 000.00	1 161 840.00	0.03
USD WOLVERINE ESCROW LLC-144A 9.00000% 19-15.11.26	60 000.00	57 150.00	0.00
USD WOLVERINE ESCROW LLC-144A 8.50000% 19-15.11.24	750 000.00	717 187.50	0.02
USD WR GRACE & CO-CONN-144A 5.62500% 14-01.10.24	3 550 000.00	3 852 495.50	0.10
USD WYNN LAS VEGAS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.50000% 15-01.03.25	3 065 000.00	3 157 777.55	0.08
USD WYNN LAS VEGAS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.25000% 17-15.05.27	970 000.00	984 166.85	0.02
USD YUM BRANDS INC 3.87500% 13-01.11.23	1 425 000.00	1 492 687.50	0.04
USD ZAYO GROUP HOLDINGS INC-144A 4.00000% 20-01.03.27	2 461 000.00	2 467 940.02	0.06
USD ZAYO GROUP HOLDINGS INC-144A 6.12500% 20-01.03.28	3 268 000.00	3 399 267.39	0.09
米ドル合計		1 236 946 197.53	31.09
ノート、固定利付債合計		1 245 667 721.65	31.31
ノート、変動利付債			
USD ENERGY TRANSFER PARTNERS-SUB 6.250%/VAR 17-PRP	280 000.00	226 800.00	0.01
米ドル合計		226 800.00	0.01
ノート、変動利付債合計		226 800.00	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 - ハイ・イールド

2021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			
USD			
USD INTESA SANPAOLO SPA-144A-SUB 5.01700% 14-26.06.24	10 220 000.00	11 118 457.17	0.28
米ドル合計		11 118 457.17	0.28
中期債券、固定利付債合計		11 118 457.17	0.28
中期債券、変動利付債			
USD			
USD UNICREDIT SPA-144A-SUB 5.459%/VAR 20-30.06.35	1 325 000.00	1 425 080.78	0.04
米ドル合計		1 425 080.78	0.04
中期債券、変動利付債合計		1 425 080.78	0.04
債券、固定利付債			
EUR			
EUR PANTHER BF AGGR 2/PANTHER FIN CO-REG-S 4.37500% 19-15.05.26	1 700 000.00	2 129 974.83	0.05
ユーロ合計		2 129 974.83	0.05
GBP			
GBP VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC-REG-S 4.12500% 20-15.08.30	2 250 000.00	3 156 746.49	0.08
英ポンド合計		3 156 746.49	0.08
USD			
USD CARRIAGE SERVICES INC-144A 6.62500% 18-01.06.26	945 000.00	996 975.00	0.03
USD CONTINENTAL RESOURCES INC 4.50000% 13-15.04.23	539 000.00	553 197.26	0.02
USD CVR ENERGY INC-144A 5.75000% 20-15.02.28	1 301 000.00	1 276 996.55	0.03
USD HJ HEINZ CO-144A 7.12500% 09-01.08.39	660 000.00	936 800.09	0.02
USD LIBERTY INTERACTIVE LLC 8.25000% 00-01.02.30	4 922 000.00	5 641 842.50	0.14
USD NUANCE COMMUNICATIONS INC 5.62500% 16-15.12.26	515 000.00	542 230.62	0.01
USD PACTIV CORP 8.75000% 99-15.04.27	615 000.00	714 937.50	0.02
USD PETSMA RT INC-144A 7.12500% 15-15.03.23	1 620 000.00	1 623 969.00	0.04
USD SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD-144A 6.75000% 15-01.05.23	825 000.00	833 250.00	0.02
USD XPO LOGISTICS INC-144A 6.12500% 16-01.09.23	1 300 000.00	1 321 125.00	0.03
米ドル合計		14 441 323.52	0.36
債券、固定利付債合計		19 728 044.84	0.49
債券、変動利付債			
USD			
USD CITIGROUP INC-SUB 6.300%/VAR 14-PRP	1 630 000.00	1 742 649.30	0.04
米ドル合計		1 742 649.30	0.04
債券、変動利付債合計		1 742 649.30	0.04
転換社債型新株予約権付社債、固定利付			
USD			
USD BURLINGTON STORES INC-144A 2.25000% 20-15.04.25	368 000.00	494 783.36	0.01
米ドル合計		494 783.36	0.01
転換社債型新株予約権付社債、固定利付合計		494 783.36	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		1 280 403 537.10	32.18

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 - ハイ・イールド

2021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譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
記名株式			
イギリス			
USD EP ENERGY CORP USD0.01 A	5 403.00	107 735.82	0.00
イギリス合計		107 735.82	0.00
アメリカ合衆国			
USD UNIT CORP SHS	50 030.00	459 275.40	0.02
アメリカ合衆国合計		459 275.40	0.02
記名株式合計		567 011.22	0.02
ノート、固定利付債			
USD			
USD ABERCROMBIE & FITCH MANAGEMENT CO-144A 8.75000% 20-15.07.25	590 000.00	654 900.00	0.02
USD ACADIA HEALTHCARE CO INC-144A 5.50000% 20-01.07.28	1 691 000.00	1 800 915.00	0.05
USD ADAPTHEALTH LLC-144A 6.12500% 20-01.08.28	3 296 000.00	3 543 200.00	0.09
USD ADAPTHEALTH LLC-144A 4.62500% 21-01.08.29	2 058 000.00	2 102 020.62	0.05
USD AFFINITY GAMING-144A 6.87500% 20-15.12.27	329 000.00	345 450.00	0.01
USD ALLISON TRANSMISSION INC-144A 3.75000% 20-30.01.31	546 000.00	542 986.08	0.01
USD ALTICE FRANCE HOLDING SA 10.50000% 20-15.05.27	1 100 000.00	1 233 375.00	0.03
USD AMERICAN BUILDER & CONTRACT SUPPLY-144A 5.87500% 18-15.05.26	385 000.00	398 475.00	0.01
USD AMN HEALTHCARE INC-144A 4.00000% 20-15.04.29	709 000.00	724 066.25	0.02
USD ARAMARK SERVICES INC-144A 6.37500% 20-01.05.25	1 595 000.00	1 695 644.50	0.04
USD ARCHES BUYER INC-144A 4.25000% 20-01.06.28	856 000.00	854 930.00	0.02
USD ARCHES BUYER INC-144A 6.12500% 20-01.12.28	148 000.00	151 700.00	0.00
USD ARDAGH PACKAGING FINANCE PLC-144A 5.25000% 20-30.04.25	890 000.00	937 837.50	0.02
USD ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-REG-S 5.25000% 20-30.04.25	500 000.00	526 875.00	0.01
USD ASCEND LEARNING LLC-144A 6.87500% 17-01.08.25	4 394 000.00	4 531 312.50	0.11
USD AUSTIN BIDCO INC-144A 7.12500% 20-15.12.28	114 000.00	118 132.50	0.00
USD AVIATION CAPTIAL GROUP LLC-144A 5.50000% 20-15.12.24	1 772 000.00	2 000 849.05	0.05
USD AXALTA COAT SYS LLC/AXALTA COAT-144A 4.75000% 20-15.06.27	401 000.00	420 648.80	0.01
USD BERRY PETROLEUM CORP-144A 7.00000% 18-15.02.26	1 059 000.00	1 006 050.00	0.03
USD BLUE RACER MIDSTREAM LLC-144A 7.62500% 20-15.12.25	1 075 000.00	1 137 489.75	0.03
USD BRIGHTSTAR ESCROW CORP-144A 9.75000% 20-15.10.25	3 316 000.00	3 552 066.04	0.09
USD BRUCE MANSFIELD UNIT *ESCROW* *DEFAULTED* 8.87500% 18-PRP	625 000.00	6 250.00	0.00
USD CALPINE CORP-144A 4.62500% 20-01.02.29	520 000.00	525 200.00	0.01
USD CAPITOL INVSTMNT MERGER SUB 2 LLC-144A 10.00000% 19-01.08.24	3 448 000.00	3 754 010.00	0.09
USD CARNIVAL CORP-144A 11.50000% 20-01.04.23	421 000.00	478 361.25	0.01
USD CARNIVAL CORP-144A 9.87500% 20-01.08.27	220 000.00	251 266.40	0.01
USD CARS.COM INC-144A 6.37500% 20-01.11.28	1 203 000.00	1 272 172.50	0.03
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.00000% 17-01.02.28	1 640 000.00	1 722 820.00	0.04
USD CEDAR FAIR LP/CANADA WL CO/MMC/MOP-144A 5.50000% 20-01.05.25	601 000.00	624 481.07	0.02
USD CENTENE CORP-144A 5.37500% 20-15.08.26	3 308 000.00	3 469 265.00	0.09
USD CENTENE CORP-REG-S 5.37500% 20-15.08.26	3 285 000.00	3 445 143.75	0.09
USD CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC-144A 8.00000% 19-15.03.26	910 000.00	978 250.00	0.02
USD CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC-144A 5.62500% 20-15.03.27	613 000.00	643 650.00	0.02
USD CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC-144A 6.00000% 20-15.01.29	787 000.00	836 187.50	0.02
USD CINEMARK USA INC-144A 8.75000% 20-01.05.25	628 000.00	674 503.40	0.02
USD CLARK EQUIPMENT CO-144A 5.87500% 20-01.06.25	1 176 000.00	1 242 885.00	0.03
USD CLEAR CHANNEL WORLDWIDE HLDGS INC-SUB 9.25000% 20-15.02.24	1 044 000.00	1 085 979.24	0.03
USD COMMERCIAL METALS CO 3.87500% 21-15.02.31	290 000.00	296 887.50	0.01
USD CORNERSTONE BUILDING BRANDS INC-144A 6.12500% 20-15.01.29	128 000.00	133 760.00	0.00
USD CRESTWOOD MIDSTREAM PART LP/FIN-144A 6.00000% 21-01.02.29	3 249 000.00	3 129 875.41	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

2021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	CSC HOLDINGS LLC-144A 5.75000% 19-15.01.30	1 280 000.00	1 374 009.60	0.03
USD	DAVITA INC-144A 3.75000% 20-15.02.31	1 812 000.00	1 797 277.50	0.05
USD	DCP MIDSTREAM OPERATING LP 5.37500% 18-15.07.25	1 010 000.00	1 080 700.00	0.03
USD	DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP-144A 6.10000% 20-15.07.27	806 000.00	997 597.62	0.03
USD	DELTA AIR LINES INC / SKYMILES LTD-144A 4.75000% 20-20.10.28	472 000.00	523 041.44	0.01
USD	DIGICEL GROUP 0.5 LTD-144A 8.00000% 20-01.04.25	980 906.00	598 352.66	0.02
USD	DISH DBS CORP 7.37500% 20-01.07.28	615 000.00	640 368.75	0.02
USD	DUN & BRADSTREET CORP-144A 6.87500% 19-15.08.26	2 267 000.00	2 425 690.00	0.06
USD	ENDURANCE ACQUISITION MERGER-144A 6.00000% 21-15.02.29	1 940 000.00	1 906 050.00	0.05
USD	ENLINK MIDSTREAM LLC-144A 5.62500% 20-15.01.28	644 000.00	642 792.50	0.02
USD	ENOVA INTERNATIONAL INC-144A 8.50000% 18-15.09.25	1 880 000.00	1 833 000.00	0.05
USD	EQT MIDSTREAM PARTNERS LP-144A 4.50000% 21-15.01.29	575 000.00	555 001.50	0.01
USD	EQT MIDSTREAM PARTNERS LP -144A 4.75000% 21-15.01.31	1 160 000.00	1 119 840.80	0.03
USD	EXTERRAN ENE SOL LP / EES FIN CORP 8.12500% 18-01.05.25	555 000.00	493 314.52	0.01
USD	FORESTAR GROUP INC-144A 5.00000% 20-01.03.28	190 000.00	198 075.00	0.00
USD	FREEDOM MORTGAGE CORP-144A 7.62500% 20-01.05.26	2 064 000.00	2 187 220.80	0.05
USD	GFL ENVIRONMENTAL INC-144A 4.25000% 20-01.06.25	175 000.00	180 687.50	0.00
USD	GFL ENVIRONMENTAL INC-144A 3.50000% 20-01.09.28	1 744 000.00	1 716 218.08	0.04
USD	GRAFTECH FINANCE INC-144A 4.62500% 20-15.12.28	445 000.00	450 562.50	0.01
USD	GRAY TELEVISION INC-144A 4.75000% 20-15.10.30	4 979 000.00	4 949 499.42	0.12
USD	GRIFFON CORP 5.75000% 20-01.03.28	277 000.00	292 927.50	0.01
USD	HAT HOLDINGS I LLC / II LLC-144A 3.75000% 20-15.09.30	704 000.00	708 400.00	0.02
USD	HILCORP ENERGY I LP / HILCORP FINA-144A 6.00000% 21-01.02.31	370 000.00	375 550.00	0.01
USD	HILCORP ENERGY I LP/FINANCE CO-144A 5.75000% 21-01.02.29	1 709 000.00	1 737 745.38	0.04
USD	HILTON DOMESTIC OPERATING CO INC-144A 5.75000% 20-01.05.28	2 240 000.00	2 416 400.00	0.06
USD	HOSPITALITY PROPERTIES TRUST 5.50000% 20-15.12.27	2 080 000.00	2 221 991.06	0.06
USD	ILLUMINATE BUYER LLC / ILLUMI HOLD-144A 9.00000% 20-01.07.28	4 132 000.00	4 605 940.40	0.12
USD	INDIGO NATURAL RESOURCES LLC-144A 5.37500% 21-01.02.29	1 447 000.00	1 428 912.50	0.04
USD	INGEVITY CORP-144A 3.87500% 20-01.11.28	825 000.00	827 153.25	0.02
USD	INSTALLED BUILDING PRODUCTS INC-144A 5.75000% 19-01.02.28	2 200 000.00	2 343 000.00	0.06
USD	INTELSAT JACKSON HOLDINGS SA-144A 9.50000% 16-30.09.22	65 000.00	72 800.00	0.00
USD	IRB HOLDING CORP-144A 7.00000% 20-15.06.25	347 000.00	376 866.29	0.01
USD	IRON MOUNTAIN INC-144A 5.00000% 20-15.07.28	3 133 000.00	3 292 595.02	0.08
USD	J2 GLOBAL INC-144A 4.62500% 20-15.10.30	555 000.00	579 975.00	0.02
USD	KAISER ALUMINUM CORP-144A 6.50000% 20-01.05.25	1 279 000.00	1 365 332.50	0.03
USD	KFC HLDG/PIZZA HUT HLDG/TACO BELL-144A 4.75000% 17-01.06.27	1 110 000.00	1 165 500.00	0.03
USD	KRAFT HEINZ FOODS CO 4.62500% 21-01.10.39	1 550 000.00	1 685 160.85	0.04
USD	KRAFT HEINZ FOODS CO 4.87500% 21-01.10.49	4 015 000.00	4 542 845.59	0.11
USD	KRAFT HEINZ FOODS CO 3.87500% 21-15.05.27	4 870 000.00	5 331 750.52	0.13
USD	KRAFT HEINZ FOODS CO 4.25000% 21-01.03.31	1 767 000.00	1 987 713.15	0.05
USD	KRAFT HEINZ FOODS CO 5.50000% 21-01.06.50	915 000.00	1 124 256.75	0.03
USD	KRATON POLYMERS LLC/CAPITAL CORP -144A 4.25000% 20-15.12.25	800 000.00	804 000.00	0.02
USD	LAMAR MEDIA CORP-144A 3.62500% 21-15.01.31	200 000.00	201 750.00	0.01
USD	LBM ACQUISITION LLC-144A 6.25000% 20-15.01.29	1 635 000.00	1 654 947.00	0.04
USD	LEVEL 3 FINANCING INC-144A 3.75000% 21-15.07.29	287 000.00	288 579.94	0.01
USD	LIFE TIME INC-144A 5.75000% 21-15.01.26	709 000.00	716 178.63	0.02
USD	LIONS GATE CAPITAL HOLDINGS LLC 5.87500% 17-01.11.24	1 398 000.00	1 426 840.74	0.04
USD	LITHIA MOTORS INC-144A 4.37500% 20-15.01.31	441 000.00	466 794.09	0.01
USD	LIVE NATION ENTERTAINMENT INC-144A 3.75000% 21-15.01.28	609 000.00	614 456.64	0.02
USD	MGM GROWTH POP LP/CO-ISSUER INC 5.75000% 20-01.02.27	483 000.00	541 397.11	0.01
USD	MICHAELS STORES INC-144A 8.00000% 19-15.07.27	1 880 000.00	2 014 796.00	0.05
USD	MSCI INC-144A 3.62500% 20-01.09.30	441 000.00	468 011.25	0.01
USD	NATIONSTAR MORTGAGE HOLDINGS INC-144A 5.50000% 20-15.08.28	784 000.00	809 480.00	0.02
USD	NCR CORP-144A 8.12500% 20-15.04.25	1 241 000.00	1 358 895.00	0.03
USD	NEXTERA ENERGY OPERATING PARTNERS-144A 4.25000% 17-15.09.24	23 000.00	24 564.00	0.00
USD	NGL ENERGY OPERATING LLC-144A 7.50000% 21-01.02.26	1 080 000.00	1 094 850.00	0.03
USD	NIELSEN FINANCE LLC / NIELSEN FIN-144A 5.87500% 20-01.10.30	3 315 000.00	3 682 716.38	0.09
USD	NRG ENERGY INC-144A 3.37500% 20-15.02.29	865 000.00	884 808.50	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 - ハイ・イールド

2021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 OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 7.95000% 19-15.06.39	3 246 000.00	3 765 360.00	0.09
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 6.60000% 19-15.03.46	550 000.00	592 465.50	0.02
USD OLIN CORP-144A 9.50000% 20-01.06.25	2 470 000.00	3 073 297.50	0.08
USD ON SEMICONDUCTOR CORP-144A 3.87500% 20-01.09.28	1 916 000.00	1 985 455.00	0.05
USD OUTFRONT MEDIA CAPITAL LLC / OUTFR-144A 4.25000% 21-15.01.29	500 000.00	496 250.00	0.01
USD PARK RIVER HOLDINGS INC-144A 5.62500% 21-01.02.29	1 045 000.00	1 038 468.75	0.03
USD PARK-OHIO INDUSTRIES INC 6.62500% 17-15.04.27	1 680 000.00	1 688 416.80	0.04
USD POWERTEAM SERVICES LLC-144A 9.03300% 20-04.12.25	4 362 667.00	4 831 653.70	0.12
USD PQ CORP-144A 5.75000% 17-15.12.25	4 067 000.00	4 158 507.50	0.10
USD PRA GROUP INC-144A 7.37500% 20-01.09.25	1 036 000.00	1 111 110.00	0.03
USD PRECISION DRILLING CORP 7.75000% 17-15.12.23	3 263 000.00	3 250 763.75	0.08
USD PRECISION DRILLING CORP-144A 7.12500% 17-15.01.26	2 097 000.00	2 035 400.62	0.05
USD RANGE RESOURCES CORP 9.25000% 20-01.02.26	6 620 000.00	7 214 409.80	0.18
USD RANGE RESOURCES CORP-144A 8.25000% 21-15.01.29	599 000.00	628 950.00	0.02
USD RAYONIER AM PRODUCTS INC-144A 7.62500% 20-15.01.26	96 000.00	100 560.00	0.00
USD REAL HERO MERGER SUB 2 INC-144A 6.25000% 21-01.02.29	2 073 000.00	2 126 690.70	0.05
USD REALOGY GROUP/CO ISSUER-144A 9.37500% 19-01.04.27	5 346 000.00	5 927 377.50	0.15
USD REALOGY GROUP/CO ISSUER-144A 5.75000% 21-15.01.29	1 757 000.00	1 794 336.25	0.05
USD ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD-144A 10.87500% 20-01.06.23	405 000.00	456 637.50	0.01
USD SABRE GLBL INC-144A 9.25000% 20-15.04.25	384 000.00	455 596.80	0.01
USD SCIENCE APPLICATIONS INTRNTNL CORP-144A 4.87500% 20-01.04.28	2 640 000.00	2 778 600.00	0.07
USD SEAGATE HDD CAYMAN-144A 3.37500% 20-15.07.31	2 673 000.00	2 601 229.95	0.07
USD SEG HOLDING LLC/SEG FIN CORP-144A 5.62500% 20-15.10.28	120 000.00	127 920.00	0.00
USD SERVICE PROPERTIES TRUST 7.50000% 20-15.09.25	1 639 000.00	1 845 097.37	0.05
USD SHEA HOMES LP/FNDG CORP-144A 4.75000% 20-01.04.29	305 000.00	314 150.00	0.01
USD SM ENERGY CO-144A 10.00000% 20-15.01.25	984 000.00	1 091 010.00	0.03
USD SPECIALTY BUILDING PRODUCTS HLD LLC-144A 6.37500% 20-30.09.26	4 921 000.00	5 167 050.00	0.13
USD TALLGRASS ENERGY PARTNERS LP-144A 6.00000% 20-31.12.30	840 000.00	842 100.00	0.02
USD TALLGRASS ENRGY PART LP/FIN CORP-144A 5.50000% 16-15.09.24	327 000.00	332 895.81	0.01
USD TARGA RESOURCES PARTNERS 6.50000% 19-15.07.27	1 486 000.00	1 597 450.00	0.04
USD TEGNA INC 5.00000% 19-15.09.29	2 928 000.00	3 046 906.08	0.08
USD TENET HEALTHCARE CORP-144A 7.50000% 20-01.04.25	900 000.00	972 418.50	0.02
USD TRONOX INC-144A 6.50000% 20-01.05.25	700 000.00	750 750.00	0.02
USD TTM TECHNOLOGIES INC-144A 5.62500% 17-01.10.25	450 000.00	459 000.00	0.01
USD UNISYS CORP-144A 6.87500% 20-01.11.27	3 088 000.00	3 419 960.00	0.09
USD UNITED NATURAL FODDS INC-144A 6.75000% 20-15.10.28	1 966 000.00	2 079 045.00	0.05
USD URBAN ONE INC-144A 7.37500% 21-01.02.28	1 515 000.00	1 530 695.40	0.04
USD VAIL RESORTS INC-144A 6.25000% 20-15.05.25	1 550 000.00	1 646 875.00	0.04
USD VALVOLINE INC-144A 3.62500% 20-15.06.31	662 000.00	664 482.50	0.02
USD VIRGIN MEDIA FINANCE PLC-144A 5.00000% 20-15.07.30	1 472 000.00	1 515 468.16	0.04
USD WYNDHAM HOTELS & RESORTS INC-144A 4.37500% 20-15.08.28	2 457 000.00	2 481 570.00	0.06
USD XPO LOGISTICS INC-144A 6.25000% 20-01.05.25	4 514 000.00	4 846 907.50	0.12
米ドル合計		220 898 341.78	5.55
ノート、固定利付債合計		220 898 341.78	5.55
債券、固定利付債			
USD			
USD DELEK LOGISTICS PARTNERS LP 6.75000% 18-15.05.25	4 978 000.00	4 903 330.00	0.12
米ドル合計		4 903 330.00	0.12
債券、固定利付債合計		4 903 330.00	0.12

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

2021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 (%)
転換社債型新株予約権付社債、固定利付			
USD			
USD INTELSAT SA * DEFAULTED * 4.50000% 18-15.06.25	1 600 000.00	832 000.00	0.02
米ドル合計		832 000.00	0.02
転換社債型新株予約権付社債、固定利付合計			
		832 000.00	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 いない譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		227 200 683.00	5.71
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			
USD			
USD ACADEMY LTD-144A 6.00000% 20-15.11.27	655 000.00	690 206.25	0.02
USD AETHON UNITED/AETHON UNITED FIN C-144A-8.25000% 21-15.02.26	1 709 000.00	1 747 452.50	0.04
USD ALBERTSONS COS LLC / SAFEWAY INC-144A 4.87500% 20-15.02.30	925 000.00	988 631.30	0.02
USD ALCOA NEDERLAND HOLDING BV-144A 5.50000% 20-15.12.27	985 000.00	1 059 140.95	0.03
USD ALLEN MEDIA CO-ISS INC-144A 10.50000% 20-15.02.28	604 000.00	629 670.00	0.02
USD ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP-144A 7.00000% 20-15.01.26	3 312 000.00	3 510 720.00	0.09
USD ALTICE FRANCE SA/FRANCE-144A 5.12500% 20-15.01.29	3 601 000.00	3 713 531.25	0.09
USD ANTERO MIDSTREAM PARTNERS LP-144A 7.87500% 20-15.05.26	592 000.00	633 514.00	0.02
USD ANTERO RESOURCES FIN CORP-144A 7.62500% 21-01.02.29	2 810 000.00	2 872 353.90	0.07
USD APX GROUP INC-144A 6.75000% 20-15.02.27	660 000.00	702 900.00	0.02
USD ASSUREDPARTNERS INC-144A 5.62500% 20-15.01.29	1 223 000.00	1 241 345.00	0.03
USD AVIS BUDGET CAR RENT LLC/FIN INC-144A 5.75000% 20-15.07.27	2 510 000.00	2 552 368.80	0.06
USD BAUSCH HEALTH COS INC-144A 5.25000% 20-15.02.31	7 303 000.00	7 510 952.93	0.19
USD BAUSCH HEALTH COS INC-144A 5.00000% 20-15.02.29	3 120 000.00	3 193 803.60	0.08
USD BEASLEY MEZZANINE HOLDINGS LLC-144A 8.62500% 21-01.02.26	287 000.00	288 435.00	0.01
USD BOISE CASCADE CO-144A 4.87500% 20-01.07.30	531 000.00	576 798.75	0.01
USD BOXER PARENT CO INC-144A 7.12500% 20-02.10.25	3 716 000.00	4 018 333.76	0.10
USD BROADCOM INC-144A 2.45000% 21-15.02.31	634 000.00	631 810.96	0.02
USD BROOKFIELD RESIDENTIAL PRO/US CORP-144A 4.87500% 20-15.02.30	143 000.00	146 663.66	0.00
USD BUILDERS FIRSTSOURCE INC-144A 5.00000% 20-01.03.30	625 000.00	667 968.75	0.02
USD BWX TECHNOLOGIES INC-144A 4.12500% 20-30.06.28	718 000.00	750 310.00	0.02
USD BY CROWN PARENT LLC/BOND FINANCE-144A 4.25000% 20-31.01.26	1 303 000.00	1 335 575.00	0.03
USD CABLEVISION LIGHTPATH LLC-144A 5.62500% 20-15.09.28	236 000.00	241 900.00	0.01
USD CAESARS RESORT COLLECTION LLC-144A 5.75000% 20-01.07.25	309 000.00	324 308.78	0.01
USD CALIFORNIA RESOURCES CORP-144A 7.12500% 21-01.02.26	820 000.00	812 825.00	0.02
USD CARVANA CO-144A 5.62500% 20-01.10.25	5 800 000.00	5 990 820.00	0.15
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 4.50000% 20-01.05.32	5 424 000.00	5 642 153.28	0.14
USD CD&R SMOKEY BUYER INC-144A 6.75000% 20-15.07.25	1 794 000.00	1 924 065.00	0.05
USD CENTURYLINK INC-144A 4.50000% 20-15.01.29	120 000.00	123 175.20	0.00
USD CHEMOURS CO/THE-144A 5.75000% 20-15.11.28	770 000.00	797 061.65	0.02
USD CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC-144A 6.62500% 20-15.02.25	550 000.00	578 985.00	0.01
USD CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC-144A 6.87500% 21-15.04.29	736 000.00	744 280.00	0.02
USD CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC-144A 4.75000% 21-15.02.31	1 384 000.00	1 384 000.00	0.03
USD CLARIOS GLOBAL LP-144A 6.75000% 20-15.05.25	369 000.00	393 099.39	0.01
USD CNX RESOURCES CORP-144A 6.00000% 20-15.01.29	632 000.00	653 140.40	0.02
USD CONTINENTAL RESOURCES INC-144A 5.75000% 20-15.01.31	982 000.00	1 063 015.00	0.03
USD CP ATLAS BUYER INC-144A 7.00000% 20-01.12.28	1 108 000.00	1 150 935.00	0.03
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 3.37500% 20-15.02.31	1 753 000.00	1 710 664.87	0.04
USD CUSHMAN & WAKEFIELD US BORROWER-144A 6.75000% 20-15.05.28	1 673 000.00	1 819 722.10	0.05
USD DEALER TIRE LLC / DT ISSUER LLC-144A 8.00000% 20-01.02.28	1 339 000.00	1 422 687.50	0.04
USD EDGEWELL PERSONAL CARE CO-144A 5.50000% 20-01.06.28	3 418 000.00	3 656 337.14	0.09
USD EMERGENT BIOSOLUTIONS INC-144A 3.87500% 20-15.08.28	845 000.00	867 426.30	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

2021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	EMPIRE COMMUNITIES CORP-144A 7.00000% 20-15.12.25	678 000.00	715 764.60	0.02
USD	ENERGIZER HOLDINGS INC-144A 4.37500% 20-31.03.29	809 000.00	827 202.50	0.02
USD	ENTEGRIS INC-144A 4.37500% 20-15.04.28	710 000.00	749 050.00	0.02
USD	FORTERRA FINANCE LLC/FRTA FIN CORP-144A 6.50000% 20-15.07.25	1 707 000.00	1 817 955.00	0.05
USD	G-III APPAREL GROUP LTD-144A 7.87500% 20-15.08.25	4 072 000.00	4 458 840.00	0.11
USD	GLOBAL MEDICAL RESPONSE INC-144A 6.50000% 20-01.10.25	810 000.00	836 932.50	0.02
USD	GLOBAL NET LEASE INC/OP LP-144A 3.75000% 20-15.12.27	1 881 000.00	1 915 267.57	0.05
USD	GLP FINANCE CORP-144A 6.87500% 20-15.01.29	390 000.00	417 300.00	0.01
USD	GRAPHIC PACKAGING INTERNATIONL INC-144A 3.50000% 20-15.03.28	48 000.00	50 040.00	0.00
USD	GROUP 1 AUTOMOTIVE INC-144A 4.00000% 20-15.08.28	1 120 000.00	1 143 464.00	0.03
USD	HAT HOLDINGS I LLC / II LLC-144A 6.00000% 20-15.04.25	571 000.00	606 687.50	0.02
USD	HILTON DOMESTIC OPERATING CO INC-144A 4.00000% 20-01.05.31	394 000.00	404 805.45	0.01
USD	HOLLY ENERGY PARTNERS LP FIN CORP-144A 5.00000% 20-01.02.28	2 569 000.00	2 584 285.55	0.06
USD	HOWARD HUGHES CORP-144A 5.37500% 20-01.08.28	1 425 000.00	1 503 375.00	0.04
USD	HOWARD HUGHES CORP/THE-144A 4.37500% 21-01.02.31	2 209 000.00	2 204 383.19	0.06
USD	HUSKY III HOLDING LTD-144A (PIK) 13.00000% 20-15.02.25	798 000.00	861 840.00	0.02
USD	ICAHN ENTERPRISES LP / ICAHN FINAN-144A 4.37500% 21-01.02.29	3 472 000.00	3 447 348.80	0.09
USD	INTERFACE INC-144A 5.50000% 20-01.12.28	908 000.00	960 210.00	0.02
USD	INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC-144A 5.25000% 20-15.01.29	1 504 000.00	1 605 520.00	0.04
USD	JAGUAR HOLDINGS/PHARMA PROD DEV-144A 5.00000% 20-15.06.28	1 237 000.00	1 311 492.14	0.03
USD	JAGUAR HOLDINGS/PHARMA PROD DEV-144A 4.62500% 20-15.06.25	1 211 000.00	1 270 036.25	0.03
USD	JELD-WEN INC-144A 6.25000% 20-15.05.25	2 612 000.00	2 801 370.00	0.07
USD	KBR INC 144-A 4.75000% 20-30.09.28	557 000.00	576 495.00	0.01
USD	KRONOS ACQUISITION HOLDINGS INC-144A 5.00000% 20-31.12.26	1 339 000.00	1 365 780.00	0.03
USD	KRONOS ACQUISITION HOLDINGS INC-144A 7.00000% 20-31.12.27	769 000.00	786 302.50	0.02
USD	L BRANDS INC-144A 6.87500% 20-01.07.25	186 000.00	202 543.87	0.01
USD	L BRANDS INC-144A 6.62500% 20-01.10.30	612 000.00	685 088.10	0.02
USD	L BRANDS INC-144A 9.37500% 20-01.07.25	3 821 000.00	4 718 935.00	0.12
USD	LAMB WESTON HOLDINGS INC-144A 4.87500% 20-15.05.28	185 000.00	204 832.00	0.01
USD	LEVEL 3 FINANCING INC-144A 4.25000% 20-01.07.28	631 000.00	646 592.01	0.02
USD	LEVEL 3 FINANCING INC-144A 3.62500% 20-15.01.29	680 000.00	676 608.50	0.02
USD	LIVE NATION ENTERTAINMENT INC-144A 6.50000% 20-15.05.27	1 760 000.00	1 955 201.60	0.05
USD	LOGAN MERGER SUB INC-144A 5.50000% 20-01.09.27	3 466 000.00	3 626 302.50	0.09
USD	MATCH GROUP HOLDINGS II LLC-144A 4.62500% 20-01.06.28	1 324 000.00	1 379 151.22	0.03
USD	MATTAMY GROUP CORP-144A 4.62500% 20-01.03.30	456 000.00	473 100.00	0.01
USD	MCGRAW HILL LLC-144A 8.00000% 21-30.11.24	3 884 000.00	3 877 707.92	0.10
USD	MEG ENERGY CORP-144A 5.87500% 21-01.02.29	1 736 000.00	1 722 980.00	0.04
USD	MERCER INTERNATIONAL INC-144A 5.12500% 21-01.02.29	1 170 000.00	1 190 475.00	0.03
USD	MGM GROWTH POP LP/CO-ISSUER INC-144A 3.87500% 20-15.02.29	406 000.00	412 851.25	0.01
USD	MINERALS TECHNOLOGIES INC-144A 5.00000% 20-01.07.28	3 123 000.00	3 279 150.00	0.08
USD	MURPHY OIL USA INC-144A 3.75000% 21-15.02.31	3 170 000.00	3 170 000.00	0.08
USD	NABORS INDUSTRIES INC-144A 9.00000% 20-01.02.25	117 000.00	118 755.00	0.00
USD	NATIONAL FINANCIAL PARTNERS-144A 6.87500% 20-15.08.28	4 066 000.00	4 273 975.90	0.11
USD	NATIONSTAR MORTGAGE HOLDINGS INC-144A 5.12500% 20-15.12.30	114 000.00	118 275.00	0.00
USD	NCL CORP LTD-144A 10.25000% 20-01.02.26	1 644 000.00	1 885 635.12	0.05
USD	NCL CORP LTD-144A 5.87500% 20-15.03.26	444 000.00	438 352.32	0.01
USD	NEW GOLD INC-144A 7.50000% 20-15.07.27	4 278 000.00	4 621 138.38	0.12
USD	NRG ENERGY INC-144A 3.62500% 20-15.02.31	1 862 000.00	1 936 480.00	0.05
USD	P&L DEVELOPMENT LLC / PLD FIN-144A 7.75000% 20-15.11.25	2 943 000.00	3 149 010.00	0.08
USD	PARK INTERMEDIATE HOLDINGS/PK DOME-144A 7.50000% 20-01.06.25	1 889 000.00	2 035 397.50	0.05
USD	PATTERN ENERGY OPERATIONS LP/INC-144A 4.50000% 20-15.08.28	515 000.00	544 664.00	0.01
USD	PENINSULA PACIFIC ENTERTAINMENT-144A 8.50000% 20-15.11.27	549 000.00	588 956.22	0.01
USD	PERFORMANCE FOOD GROUP INC-144A 6.87500% 20-01.05.25	1 749 000.00	1 880 699.70	0.05
USD	PIKE CORP-144A 5.50000% 20-01.09.28	2 854 000.00	2 946 755.00	0.07
USD	POWDR CORP-144A 6.00000% 20-01.08.25	1 860 000.00	1 948 350.00	0.05
USD	PRIME HEALTHCARE SERVICES INC-144A 7.25000% 20-01.11.25	994 000.00	1 066 065.00	0.03
USD	QORVO INC-144A 3.37500% 20-01.04.31	900 000.00	920 250.00	0.02
USD	RACKSPACE TECHNOLOGY GLOBAL INC-144A 5.37500% 20-01.12.28	2 959 000.00	3 084 757.50	0.08
USD	REALOGY GROUP/CO ISSUER-144A 7.62500% 20-15.06.25	2 524 000.00	2 741 695.00	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

2021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 REGIONALCARE HOSPITAL PARTNERS-144A 5.37500% 20-15.01.29	1 681 000.00	1 693 607.50	0.04
USD REYNOLDS GROUP-144A 4.00000% 20-15.10.27	1 176 000.00	1 182 997.20	0.03
USD ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD-144A 9.12500% 20-15.06.23	386 000.00	416 397.50	0.01
USD RYERSON/JOSEPH T RYERSON & SON-144A 8.50000% 20-01.08.28	1 532 000.00	1 728 019.40	0.04
USD SBA COMMUNICATIONS CORP-144A 3.12500% 21-01.02.29	673 000.00	671 317.50	0.02
USD SCRIPPS ESCROW II INC-144A 5.37500% 20-15.01.31	677 000.00	683 770.00	0.02
USD SEAGATE HDD CAYMAN-144A 3.12500% 20-15.07.29	2 178 000.00	2 112 137.28	0.05
USD SEAWORLD PARKS & ENTERTAINMENT INC-144A 9.50000% 20-01.08.25	1 872 000.00	2 007 720.00	0.05
USD SHEA HOMES LP/FNDG CORP-144A 4.75000% 20-15.02.28	769 000.00	788 225.00	0.02
USD SHIFT4 PAYMENTS LLC / SHIFT4 PAY-144A 4.62500% 20-01.11.26	1 850 000.00	1 928 625.00	0.05
USD SINCLAIR TELEVISION GROUP INC-144A 4.12500% 20-01.12.30	650 000.00	647 562.50	0.02
USD SIX FLAGS THEME PARKS INC-144A 7.00000% 20-01.07.25	551 000.00	593 702.50	0.02
USD SIZZLING PLAT LLC/SIZZLING PLA FIN-144A 8.50000% 20-28.11.25	1 904 000.00	1 984 920.00	0.05
USD SRM ESCROW ISSUER LLC-144A 6.00000% 20-01.11.28	1 759 000.00	1 848 357.20	0.05
USD STANDARD INDUSTRIES INC/NJ-144A 4.37500% 20-15.07.30	2 479 000.00	2 630 838.75	0.07
USD STATION CASINOS LLC-144A 4.50000% 20-15.02.28	4 626 000.00	4 533 480.00	0.11
USD STERICYCLE INC-144A 3.87500% 20-15.01.29	842 000.00	865 155.00	0.02
USD STUDIO CITY FINANCE LTD-144A 5.00000% 21-15.01.29	340 000.00	342 125.00	0.01
USD TALLGRASS ENRGY PART LP/FIN CORP-144A 7.50000% 20-01.10.25	699 000.00	744 435.00	0.02
USD TARGA RESOURCES PARTNERS-144A 4.00000% 21-15.01.32	2 640 000.00	2 613 600.00	0.07
USD TAYLOR MORRISON COMMUNITIES INC-144A 6.62500% 20-15.07.27	2 141 000.00	2 309 603.75	0.06
USD TAYLOR MORRISON COMMUNITIES INC-144A 5.12500% 20-01.08.30	734 000.00	804 849.35	0.02
USD TENET HEALTHCARE CORP-144A 6.12500% 20-01.10.28	2 141 000.00	2 236 242.38	0.06
USD TRANSDIGM INC-144A-SUB 4.62500% 21-15.01.29	1 391 000.00	1 381 443.83	0.03
USD TRANSOCEAN INC-144A 11.50000% 20-30.01.27	79 000.00	61 027.50	0.00
USD TREVITA CORP-144A 11.00000% 20-01.12.25	721 000.00	784 087.50	0.02
USD TRIUMPH GROUP INC-144A 8.87500% 20-01.06.24	290 000.00	319 181.25	0.01
USD UBER TECHNOLOGIES INC-144A 7.50000% 20-15.05.25	4 210 000.00	4 509 836.20	0.11
USD UNITED SHORE FINANCIAL SERVICE LLC-144A 5.50000% 20-15.11.25	550 000.00	578 875.00	0.01
USD UNIVISION COMMUNICATIONS INC-144A 6.62500% 20-01.06.27	850 000.00	894 625.00	0.02
USD US FOODS INC-144A 4.75000% 21-15.02.29	2 043 000.00	2 048 107.50	0.05
USD VALVOLINE INC-144A 4.25000% 20-15.02.30	2 080 000.00	2 173 600.00	0.05
USD VICI PROPERTIES LP /VCI NTE CO INC-144A 3.50000% 20-15.02.25	87 000.00	88 413.75	0.00
USD VICI PROPERTIES LP /VCI NTE CO INC-144A 3.75000% 20-15.02.27	972 000.00	987 795.00	0.02
USD VICI PROPERTIES LP /VCI NTE CO INC-144A 4.12500% 20-15.08.30	2 812 000.00	2 926 251.56	0.07
USD WATCO COS LLC / WATCO FINANCE CORP-144A 6.50000% 20-15.06.27	9 667 000.00	10 367 857.50	0.26
USD WEEKLEY HOMES LLC / WEEKLEY FIN-144A 4.87500% 20-15.09.28	2 242 000.00	2 331 680.00	0.06
USD WESCO DISTRIBUTION INC-144A 7.12500% 20-15.06.25	2 320 000.00	2 524 380.39	0.06
USD WESCO DISTRIBUTION INC-144A 7.25000% 20-15.06.28	4 650 000.00	5 223 647.25	0.13
USD WHITE CAP BUYER LLC-144A 6.87500% 20-15.10.28	3 049 000.00	3 169 161.09	0.08
USD WINDSTREAM ESCROW LLC/FINANCE CORP-144A 7.75000% 20-15.08.28	1 851 000.00	1 874 137.50	0.05
USD WMG ACQUISITION CORP-144A 3.00000% 20-15.02.31	1 033 000.00	1 004 592.50	0.03
USD WR GRACE & CO-CONN-144A 4.87500% 20-15.06.27	1 588 000.00	1 665 325.76	0.04
USD WYNDHAM DESTINATIONS INC-144A 6.62500% 20-31.07.26	702 000.00	783 993.60	0.02
USD XEROX HOLDINGS CORP-144A 5.00000% 20-15.08.25	3 605 000.00	3 780 851.90	0.10
USD XEROX HOLDINGS CORP-144A 5.50000% 20-15.08.28	180 000.00	186 912.00	0.00
USD XHR LP-144A 6.37500% 20-15.08.25	3 246 000.00	3 392 070.00	0.09
USD YUM BRANDS INC-144A 7.75000% 20-01.04.25	70 000.00	76 832.70	0.00
米ドル合計		257 007 940.22	6.46
ノート、固定利付債合計		257 007 940.22	6.46
債券、固定利付債			
USD HUBBAY MINERALS INC-144A 6.12500% 20-01.04.29	4 167 000.00	4 402 685.52	0.11
米ドル合計		4 402 685.52	0.11
債券、固定利付債合計		4 402 685.52	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

2021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 (%)
転換社債型新株予約権付社債、固定利付			
USD			
USD ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD-144A 4.25000% 20-15.06.23	33 000.00	40 081.91	0.00
米ドル合計		40 081.91	0.00
転換社債型新株予約権付社債、固定利付合計			40 081.91 0.00
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			261 450 707.65 6.57
投資有価証券合計			3 887 230 776.18 97.70

金融派生商品

公認の証券取引所に上場されている金融派生商品

債券に係る金融先物

EUR EURO-BUND FUTURE 08.03.21	-33.00	1 154.15	0.00
EUR EURO-BOBL FUTURE 08.03.21	-111.00	-6 815.59	0.00
EUR EURO-SCHATZ FUTURE 08.03.21	329.00	-13 989.57	0.00
EUR EURO-BUXL FUTURE 08.03.21	4.00	-10 302.35	0.00
USD US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 22.03.21	-24.00	88 662.78	0.00
USD US LONG BOND FUTURE 22.03.21	3.00	-14 875.00	0.00
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.21	-131.00	-9 172.67	0.00
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.21	-325.00	-16 546.90	0.00
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 22.03.21	75.00	-105 723.05	0.00
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 22.03.21	95.00	-44 251.64	0.00
債券に係る金融先物合計		-131 859.84	0.00
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計			-131 859.84 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金融派生商品

指数に係るスワップおよびフォワード・スワップ

EUR BNP/IBOXX CORP OVERALL PERF TR EQS PAY PERF 21-20.12.21	-5 400 000.00	5 161.11	0.00
EUR BNP/IBOXX CORP OVERALL 3M TR EQS REC 21-20.12.21			
EUR BNP/IBOXX CORP OVERALL TR EQS PAY PERF 21-20.12.21	-5 400 000.00	1 137.72	0.00
EUR BNP/IBOXX CORP OVERALL PERF TR EQS REC FLR 21-20.12.21			
指数に係るスワップおよびフォワード・スワップ合計		6 298.83	0.00

クレジット・デフォルト・スワップ*

EUR BNP/ROLLS-ROYCE PLC PAYER 1.00000% 20-20.12.27	-750 000.00	-130 193.77	-0.01
EUR BARCLAYS/MARKS&SPENCER PLC PAYER 1.00000% 20-20.12.25	-700 000.00	-60 021.38	0.00
EUR BNP/MARKS&SPENCER PLC PAYER 1.00000% 20-20.12.25	-700 000.00	-60 021.38	0.00
クレジット・デフォルト・スワップ合計		-250 236.53	-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金融派生商品合計

金融派生商品合計 -375 797.54 -0.01

* 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」

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

2021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						
購入通貨	購入額	売却通貨	売却額	満期日		
USD	9 407 705.58	GBP	7 020 000.00	10.2.2021	-232 576.55	-0.02
USD	44 841 196.00	EUR	37 600 000.00	10.2.2021	-848 557.30	-0.02
USD	57 212 187.20	EUR	47 150 000.00	24.2.2021	-98 348.38	0.00
USD	21 174 775.70	GBP	15 940 000.00	24.2.2021	-716 437.06	-0.02
USD	561 095.56	CHF	499 000.00	10.2.2021	5.04	0.00
USD	72 329 800.13	EUR	59 125 000.00	10.3.2021	441 778.41	0.01
USD	56 531 854.25	EUR	45 875 000.00	24.3.2021	735 967.16	0.02
USD	22 405 448.52	GBP	16 380 000.00	10.3.2021	-91 727.66	0.00
JPY	1 051 739 410.00	USD	10 225 000.00	5.2.2021	-178 869.93	0.00
SGD	6 161 702.55	USD	4 678 000.00	5.2.2021	-35 087.11	0.00
CHF	646 200 514.16	USD	735 555 000.00	5.2.2021	-9 057 093.83	-0.23
EUR	1 272 113 866.22	USD	1 564 438 000.00	5.2.2021	-18 794 218.82	-0.47
GBP	60 002 816.93	USD	81 795 000.00	5.2.2021	602 468.21	0.02
CHF	12 308 170.00	USD	14 000 000.00	5.2.2021	-162 406.97	0.00
EUR	25 238 976.47	USD	31 000 000.00	5.2.2021	-334 138.98	-0.01
USD	8 400 000.00	EUR	6 905 225.78	5.2.2021	10 012.62	0.00
USD	6 000 000.00	CHF	5 346 546.00	5.2.2021	-10 912.08	0.00
USD	4 500 000.00	EUR	3 711 312.66	5.2.2021	-9 319.08	0.00
USD	14 610.43	CHF	13 000.00	10.3.2021	-18.37	0.00
USD	273 685 541.67	EUR	225 289 893.25	9.4.2021	-426 875.75	-0.01
USD	638 530.20	EUR	525 000.00	9.4.2021	-242.44	0.00
EUR	2 525 968.02	USD	3 072 984.08	9.4.2021	385.92	0.00
CHF	10 637 772.00	USD	12 000 000.00	5.2.2021	-40 369.95	0.00
EUR	20 585 094.25	USD	25 000 000.00	5.2.2021	11 301.08	0.00
GBP	1 020 735.51	USD	1 400 000.00	5.2.2021	1 701.22	0.00
SGD	105 876.48	USD	80 000.00	5.2.2021	-220.87	0.00
JPY	16 567 648.00	USD	160 000.00	5.2.2021	-1 747.16	0.00
USD	1 202 270.75	EUR	985 960.00	9.4.2021	2 643.57	0.00
EUR	2 578 000.00	USD	3 144 476.83	9.4.2021	-7 799.01	0.00
USD	221 123 352.94	EUR	181 400 000.00	31.3.2021	458 190.28	0.01
USD	1 042 972.21	EUR	858 878.48	9.4.2021	-2 033.64	0.00
USD	48 544 256.00	EUR	40 000 000.00	26.2.2021	-77 446.80	0.00
USD	242 740 958.79	EUR	199 999 999.00	26.2.2021	-367 553.97	-0.01
CHF	4 708 371.60	USD	5 300 000.00	1.2.2021	-7 316.10	0.00
EUR	1 000 000.00	USD	1 212 918.50	31.3.2021	3 537.74	0.00
USD	5 300 000.00	CHF	4 707 952.90	5.2.2021	7 033.11	0.00
EUR	7 429 935.71	USD	9 000 000.00	1.2.2021	26 628.89	0.00
USD	9 000 000.00	EUR	7 429 487.97	5.2.2021	-26 976.42	0.00
USD	456 506 939.12	EUR	376 730 677.00	26.2.2021	-1 425 236.15	-0.04
USD	19 000 546.64	GBP	13 874 564.00	26.2.2021	-54 278.79	0.00
EUR	2 826 742.50	USD	3 428 168.71	9.4.2021	11 156.55	0.00
先渡為替契約合計					-30 694 999.37	-0.77
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産					105 968 170.17*	2.66
当座借越およびその他の短期負債					-4 946 682.93	-0.12
その他の資産および負債					21 522 376.19	0.54
純資産総額					3 978 703 842.70	100.00

* 2021年1月31日現在、パークレイズに対する270,000.00米ドル、ソシエテ・ジェネラルに対する6,660,000.00米ドルおよびビー・エヌ・ピー・バリバ・ロンドンに対する180,004.70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

2021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2021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
6,704,648.8020 (112,884.9290)	7,739,008.2940 (80,041)	14,683,277.5490 (248,897)

(クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券)

販売口数	買戻し口数	発行済口数
22,370 (22,370)	28,260.8820 (28,260.8820)	124,459.1180 (124,459.1180)

(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
3,003,292.6860 (230,693.0390)	5,107,245.6250 (180,549)	13,361,163.9220 (491,364)

(クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券)

販売口数	買戻し口数	発行済口数
42,341 (42,205)	76,597 (76,597)	302,151 (302,015)

(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
2,994,422.349 (86,605.2780)	4,182,763.858 (65,324)	10,608,712.158 (200,232)

(クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券)

販売口数	買戻し口数	発行済口数
14,280 (14,280)	22,180 (22,180)	95,736 (95,736)

(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り、受渡日を基準として算出している。一方、()の上段の数字は約定日を基準として算出している。

[次へ](#)

(2) その他の訂正

(注) 下線部は訂正部分を示します。

第一部 証券情報

第1 外国投資証券(外国新投資口予約権証券及び外国投資法人債券を除く。)

(12) 払込取扱場所

<訂正前>

U B S 証券株式会社 東京都千代田区大手町一丁目5番1号
大手町ファーストスクエア イーストタワー

各申込日の発行価格の総額は、申込日から起算してルクセンブルグにおける4営業日以内(以下「ファンド払込日」という。)に日本における販売会社によって保管受託銀行であるU B S ヨーロッパ S E ルクセンブルグ支店のファンド口座に各投資証券の基準通貨で払い込まれる。

<訂正後>

U B S 証券株式会社 東京都千代田区大手町一丁目5番1号
大手町ファーストスクエア イーストタワー(注)

(注) 2021年5月2日に、東京都千代田区大手町一丁目2番1号 Otemachi Oneタワーに変更する予定である。

各申込日の発行価格の総額は、申込日から起算してルクセンブルグにおける4営業日以内(以下「ファンド払込日」という。)に日本における販売会社によって保管受託銀行であるU B S ヨーロッパ S E ルクセンブルグ支店のファンド口座に各投資証券の基準通貨で払い込まれる。

第二部 ファンド情報

第1 ファンドの状況

6 手続等の概要

<訂正前>

販売手続等

申込取扱場所

U B S 証券株式会社 東京都千代田区丸の内一丁目4番1号
丸の内永楽ビルディング

払込取扱場所

U B S 証券株式会社 東京都千代田区大手町一丁目5番1号
大手町ファーストスクエア イーストタワー

(注) 各申込日の発行価格の総額は、申込日から起算してルクセンブルグにおける4営業日以内(「ファンド払込日」)に日本における販売会社によって保管受託銀行であるU B S ヨーロッパ S E ルクセンブルグ支店のファンド口座に各投資証券の基準通貨で払い込まれる。

(後略)

<訂正後>

販売手続等

申込取扱場所

U B S 証券株式会社 東京都千代田区丸の内一丁目4番1号
丸の内永楽ビルディング

払込取扱場所

U B S 証券株式会社 東京都千代田区大手町一丁目5番1号

大手町ファーストスクエア イーストタワー(注2)

(注1) 各申込日の発行価格の総額は、申込日から起算してルクセンブルグにおける4営業日以内(「ファンド払込日」)に日本における販売会社によって保管受託銀行であるU B S ヨーロッパ S E ルクセンブルグ支店のファンド口座に各投資証券の基準通貨で払い込まれる。

(注2) 2021年5月2日に、東京都千代田区大手町一丁目2番1号 Otemachi Oneタワーに変更する予定である。

(後略)