

【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4年4月28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・サステナブル
- ハイ・イールド
(Multi Manager Access
- Emerging Markets Debt
- US Multi Credit Sustainable
- 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・サステナブル
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：14億3,680万米ドル(約1,635億円)を上限とする。

クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券

1,079億6,000万円を上限とする。

U S マルチ・クレジット・サステナブル

クラスF - a c c 投資証券：16億4,930万米ドル(約1,876億円)を上限とする。

クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券

1,083億1,000万円を上限とする。

ハイ・イールド

クラスF - a c c 投資証券：14億4,230万米ドル(約1,641億円)を上限とする。

クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券

1,130億4,000万円を上限とする。

(注1) 上限見込額は、便宜上、各サブ・ファンドの投資証券の2021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143.68米ドル(約16,346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10,796円、U S マルチ・クレジット・サステナブルのクラスF - a c c 投資証券については164.93米ドル(約18,764円)、U S マルチ・クレジット・サステナブルのクラスF - a c c 円ヘッジ投資証券については10,831円、ハイ・イールドのクラスF - a c c 投資証券については144.23米ドル(約16,409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11,304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、2021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=113.77円)による。

(注3) 2022年2月8日付で、サブ・ファンドの名称である「U S マルチ・クレジット(US Multi Credit)」が「U S マルチ・クレジット・サステナブル(US Multi Credit Sustainable)」に変更された。

【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、2022年1月31日付をもって提出した有価証券届出書(2022年3月11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、本訂正届出書を提出するものです。

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

2【訂正箇所および訂正事項】

半期報告書に係る訂正

半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正内容は、以下のとおりです。

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

原届出書		半期報告書		訂正の方法
第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 1 外国投資法人の概況	(1) 主要な経営指標等の推移	1 外国投資法人の概況	(1) 主要な経営指標等の推移	追加または更新
	(5) 外国投資法人の出資総額		(2) 外国投資法人の出資総額	追加
	(6) 主要な投資主の状況		(3) 主要な投資主の状況	更新
3 投資リスク		2 外国投資法人の運用状況	(3) 投資リスク	追加または更新
5 運用状況	(1) 投資状況	2 外国投資法人の運用状況	(1) 投資状況	更新
	(3) 運用実績		(2) 運用実績	追加または更新
第2 財務ハイライト情報		4 外国投資法人の経理状況	(1) 資産及び負債の状況 「純資産計算書」 「運用計算書」 「重要な会計方針の要約」の注記	追加
第三部 外国投資法人の詳細情報 第1 外国投資法人の追加情報 2 役員の状況		1 外国投資法人の概況	(4) 役員の状況	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) 役員の状況		(3) 役員の状況	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・サステナブルおよびハイ・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・サステナブルおよび/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。

(注) 2022年2月8日付で、サブ・ファンドの名称が「U S マルチ・クレジット (US Multi Credit)」から「U S マルチ・クレジット・サステナブル (US Multi Credit Sustainable)」に、変更されました。以下、同じです。

(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)

	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	2021年7月末日 に終了する 会計年度末	2022年1月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	205,152,492.83	351,514,548.83	419,923,653.21	373,448,972.32	- 423,368,854.95
(b) 経常利益金額 または経常損失金額	205,152,492.83	351,514,548.83	419,923,653.21	373,448,972.32	- 423,368,854.95
(c) 当期純利益金額 または当期純損失金額	205,152,492.83	351,514,548.83	419,923,653.21	373,448,972.32	- 423,368,854.95
(d) 出資総額 ⁽²⁾	6,485,463,790.78	6,297,057,630.99	7,088,189,524.66	5,915,111,579.13	5,474,543,845.01
(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)	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	14,882,210.4190口 152,362.1180口	15,216,044.4050口 147,117口
(f) 純資産額	6,485,463,790.78	6,297,057,630.99	7,088,189,524.66	5,915,111,579.13	5,474,543,845.01
(g) 資産総額	6,664,804,223.36	6,355,513,053.74	7,262,997,802.48	5,960,493,070.97	5,567,728,095.87
(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)	138.80 10,611円	137.43 10,398円	144.28 10,883円	145.38 10,937円	138.75 10,417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)	4.60 2.34	4.19 3.34	6.71 5.95	9.05 1.32	- 6.60 - 9.13
(j) 分配総額	12,736,384.92	12,856,778.29	15,638,449.34	15,638,449.34	21,530,436.66
(k) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	97.31%	99.08%	97.59%	99.24%	98.33%
(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)	11.20% 6.11%	2.35% - 0.01%	3.95% 2.56%	5.78% 5.18%	- 3.83% - 4.28%

(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。USマルチ・クレジット・サステナブルは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。

(USマルチ・クレジット・サステナブル)

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	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	2021年7月末日 に終了する 会計年度末	2022年1月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	202,052,254.46	651,975,966.37	155,668,842.68	110,134,972.72	-445,326,175.61
(b) 経常利益金額 または経常損失金額	202,052,254.46	651,975,966.37	155,668,842.68	110,134,972.72	-445,326,175.61
(c) 当期純利益金額 または当期純損失金額	202,052,254.46	651,975,966.37	155,668,842.68	110,134,972.72	-445,326,175.61
(d) 出資総額 ⁽²⁾	5,671,072,733.01	6,198,677,594.06	5,586,016,054.14	5,573,488,091.35	7,937,453,531.49
(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)	15,327,746.8270口 327,767口	14,063,084.4420口 329,750口	13,261,111.2100口 309,435口	13,589,831.6990口 358,650口	21,629,552.5740口 353,863口
(f) 純資産額	5,671,072,733.01	6,198,677,594.06	5,586,016,054.14	5,573,488,091.35	7,937,453,531.49
(g) 資産総額	5,731,345,460.24	6,214,829,242.92	5,674,469,422.74	5,795,505,353.28	8,108,933,139.57
(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)	156.50 10,461円	163.20 10,788円	165.92 10,934円	167.01 10,981円	161.68 10,605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)	5.97 2.56	12.79 8.01	2.73 2.46	3.76 -1.36	-5.13 -7.85
(j) 分配総額	7,699,227.71	7,802,905.72	9,503,304.77	9,503,304.77	8,731,326.71
(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	98.95%	99.74%	98.44%	96.17%	97.89%
(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)	9.78% 4.61%	8.48% 5.94%	6.02% 4.52%	2.33% 1.79%	-2.56% -3.01%

(ハイ・イールド)

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	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	2021年7月末日 に終了する 会計年度末	2022年1月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	145,821,659.70	239,578,445.72	300,321,786.73	397,458,480.04	-160,689,477.07
(b) 経常利益金額 または経常損失金額	145,821,659.70	239,578,445.72	300,321,786.73	397,458,480.04	-160,689,477.07
(c) 当期純利益金額 または当期純損失金額	145,821,659.70	239,578,445.72	300,321,786.73	397,458,480.04	-160,689,477.07
(d) 出資総額 ⁽²⁾	4,460,382,133.69	4,411,256,071.12	3,978,703,842.70	5,180,776,616.51	3,996,682,251.01
(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)	11,932,941.4770口 101,356口	12,116,942.6060口 107,946口	10,543,921.530口 97,986口	14,749,235.0260口 118,296口	12,357,772.1670口 113,331口
(f) 純資産額	4,460,382,133.69	4,411,256,071.12	3,978,703,842.70	5,180,776,616.51	3,996,682,251.01
(g) 資産総額	4,536,686,484.21	4,468,225,679.24	4,079,272,705.52	5,212,922,698.70	4,077,429,685.42
(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)	131.17 10,460円	131.06 10,333円	139.45 10,962円	143.96 11,293円	142.12 11,125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)	4.34 2.07	3.76 3.39	8.74 7.49	10.29 4.78	-1.35 -6.50
(j) 分配総額	8,555,219.29	8,604,497.14	8,742,699.34	8,742,699.34	11,344,013.45
(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	98.32%	98.73%	97.53%	99.38%	98.02%
(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)	10.07% 4.60%	3.44% 1.02%	6.31% 4.80%	9.84% 9.29%	1.91% 1.49%

(2) 外国投資法人の出資総額

2022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		
2022年2月末日現在	5,155,426,309.27	595,710	クラスF - a c c 投資証券	15,293,318.5360
			クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券	155,047

(U S マルチ・クレジット・サステナブル)

	出資総額		発行済投資証券総数 (口)	
	米ドル	百万円		
2022年2月末日現在	7,907,171,939.96	913,674	クラスF - a c c 投資証券	21,730,642.5000
			クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券	369,933

(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		
2022年2月末日現在	3,955,582,002.22	457,068	クラスF - a c c 投資証券	12,499,386.8290
			クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券	119,211

(注) 米ドルの円貨換算は、特に記載がない限り、2022年2月28日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売相場場の仲値(1米ドル=115.55円)による。以下、同じ。

(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

(2022年2月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有株式
アンドレアス・エバーソルド (Andreas Aebersold)	チェアマン・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ	ユービーエス・スイス・エイ・ジー、エグゼクティブ・ディレクター	該当なし
マデュ・ラマチャンドラン (Madhu Ramachandran)	メンバー・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ	UBSヨーロッパSE ルクセンブルグ支店 エグゼクティブ・ディレクター	該当なし
クリスティアン・シェーン (Christian Schön)	メンバー・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ	UBSヨーロッパSE ルクセンブルグ支店 エグゼクティブ・ディレクター	該当なし
ジェーン・ウィルキンソン (Jane Wilkinson)	インディペンデント・ディレクター	インディペンデント・ディレクター、リップル・エフェクト・サール・エス、ルクセンブルグ 創設パートナー	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ス・ソシエテ・コーペラティブ(PricewaterhouseCoopers, Société coopérative)である。

(5) その他

a. 定款の変更

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

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

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

b. 事業譲渡または事業譲受

投資法人、サブ・ファンドおよび投資証券クラスの解散および合併

本投資法人、サブ・ファンドおよび投資証券クラスの解散

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

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

サブ・ファンドもしくは投資証券クラスの純資産総額がサブ・ファンドの投資証券クラスを経済的に合理的に管理できない水準(1,000万ユーロまたはサブ・ファンドについての他の通貨建ての相当する金額と見積もられている。)未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)

(2022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	375,654,077.53	7.20
	ケイマン諸島	190,299,117.29	3.65
	コロンビア	181,526,618.53	3.48
	インドネシア	169,410,797.60	3.25
	オランダ	165,590,958.82	3.17
	トルコ	158,540,327.99	3.04
	チリ	147,394,035.37	2.82
	ペルー	136,386,020.07	2.61
	アラブ首長国連邦	131,743,235.45	2.52
	ブラジル	129,745,205.54	2.49
	ドミニカ共和国	125,217,619.68	2.40
	サウジアラビア	111,267,806.00	2.13
	英領ヴァージン諸島	109,032,467.66	2.09
	ルクセンブルグ	100,873,502.76	1.93
	オマーン	95,734,797.50	1.83
	インド	94,959,081.26	1.82
	エジプト	93,124,714.91	1.78
	カタール	90,275,637.00	1.73
	アルゼンチン	89,812,490.16	1.72
	香港	81,835,848.47	1.57
	パラグアイ	77,353,762.99	1.48
	エクアドル	72,458,781.96	1.39
	パナマ	68,949,638.85	1.32
	中国	68,927,149.78	1.32
	ルーマニア	68,276,646.80	1.31
	アゼルバイジャン	65,761,809.80	1.26
	ナイジェリア	64,588,685.20	1.24
	マレーシア	64,419,431.97	1.23
	シンガポール	63,736,135.45	1.22
	南アフリカ	61,444,826.70	1.18
	カザフスタン	59,989,719.92	1.15
	米国	58,477,860.21	1.12
モーリシャス	57,433,142.70	1.10	
アンゴラ	50,461,187.50	0.97	
バーレーン	50,034,476.45	0.96	

イスラエル	49,521,616.78	0.95
クロアチア	48,572,159.41	0.93
モロッコ	44,230,706.73	0.85
ガーナ	43,650,035.00	0.84
イギリス	41,749,909.17	0.80
グアテマラ	41,149,608.18	0.79
コートジボワール	39,496,306.61	0.76
ウクライナ	36,773,449.60	0.70
パキスタン	36,384,373.28	0.70
韓国	36,256,971.33	0.69
フィリピン	33,874,587.28	0.65
スリランカ	32,097,096.21	0.62
マン島	31,444,920.34	0.60
タイ	27,990,940.16	0.54
カナダ	27,171,093.66	0.52
セルビア	25,714,150.09	0.49
バミューダ	25,169,365.13	0.48
ハンガリー	24,442,635.73	0.47
セネガル	22,886,593.03	0.44
コスタリカ	22,863,857.44	0.44
エルサルバドル	22,863,208.87	0.44
アイルランド	20,963,383.89	0.40
モンゴル	20,935,885.99	0.40
ガボン	19,852,850.67	0.38
ザンビア	18,881,457.69	0.36
ベニン	17,287,309.09	0.33
ロシア連邦	17,263,389.28	0.33
ケニヤ	17,114,415.00	0.33
ウズベキスタン	15,809,645.00	0.30
ジャマイカ	15,551,620.38	0.30
オーストリア	15,522,047.25	0.30
ウルグアイ	14,897,272.69	0.29
ヨルダン	14,757,221.37	0.28
スペイン	13,682,077.76	0.26
マカオ	13,532,713.92	0.26
レバノン	12,877,978.75	0.25
トーゴ	12,060,972.78	0.23
マケドニア(旧ユーゴスラビア)	11,336,232.27	0.22
トリニダード・アンド・トバゴ	11,092,072.51	0.21
イラク	10,159,786.01	0.19
アルメニア	9,649,625.00	0.18
ベネズエラ	8,620,603.00	0.17

多国籍	8,250,228.00	0.16
ジョージア	7,884,698.58	0.15
ノルウェー	7,767,430.00	0.15
ジャージー	7,255,879.16	0.14
ホンデュラス	6,419,326.63	0.12
ブルガリア	6,308,609.43	0.12
ブルンディ	6,305,421.84	0.12
カメルーン	5,283,147.86	0.10
エチオピア	5,014,138.88	0.10
ベトナム	4,123,853.75	0.08
国際機関	4,118,768.76	0.08
ポーランド	3,789,704.00	0.07
マーシャル諸島	2,997,502.00	0.06
チュニジア	2,793,842.07	0.05
アルバニア	2,616,410.16	0.05
クウェート	2,507,167.00	0.05
パプアニューギニア	1,637,300.09	0.03
カンボジア	1,560,600.00	0.03
バハマ	1,423,361.25	0.03
ベラルーシ	963,300.00	0.02
タジキスタン	408,106.88	0.01
ボリビア	173,975.00	0.00
小計	4,846,492,531.54	92.88
ポートフォリオ合計	4,846,492,531.54	92.88
現金・その他資産(負債控除後)	371,469,490.62	7.12
資産総額	5,217,962,022.16	100.00
負債総額	62,535,712.89	1.20
合計 (純資産総額)	5,155,426,309.27 (約595,710百万円)	98.80

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

(U S マルチ・クレジット・サステナブル)

(2022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	5,633,610,523.77	70.43
	イギリス	422,648,460.21	5.28
	カナダ	218,968,056.80	2.74
	日本	211,130,452.69	2.64
	オランダ	206,788,866.32	2.59
	フランス	160,792,689.46	2.01
	アイルランド	114,466,118.13	1.43
	オーストラリア	110,430,376.09	1.38
	スイス	61,445,372.55	0.77
	イタリア	58,686,444.37	0.73
	ノルウェー	52,404,590.68	0.66
	ルクセンブルグ	39,179,742.85	0.49
	スペイン	37,953,258.68	0.47
	ニュージーランド	30,345,837.13	0.38
	メキシコ	27,079,376.50	0.34
	ケイマン諸島	27,001,059.68	0.34
	フィンランド	22,865,668.82	0.29
	英領ヴァージン諸島	20,945,266.30	0.26
	ガーンジー	15,516,031.40	0.19
	スウェーデン	14,568,572.19	0.18
	バミューダ	14,407,461.25	0.18
	中国	14,269,988.67	0.18
	チリ	11,468,083.34	0.14
	ブラジル	10,574,878.56	0.13
	ドイツ	7,713,095.66	0.10
	デンマーク	7,497,905.14	0.09
	ペルー	7,455,954.38	0.09
	韓国	6,778,378.98	0.08
	オーストリア	4,877,775.00	0.06
	サウジアラビア	4,527,130.00	0.06
	アラブ首長国連邦	4,321,762.50	0.05
	カタール	2,722,737.50	0.03
	マレーシア	1,495,962.26	0.02
コロンビア	998,984.03	0.01	
カザフスタン	967,330.00	0.01	
小計	7,586,904,191.89	94.85	

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	48,910,543.14	0.61
	米国	23,012,121.52	0.29
	小計	71,922,664.66	0.90
短期金融商品	米国	75,197,564.79	0.94
株式	米国	5,537,626.88	0.07
	バミューダ	1,930,751.79	0.02
	小計	7,468,378.67	0.09
ポートフォリオ合計		7,741,492,800.01	96.78
現金・その他資産(負債控除後)		257,436,306.01	3.22
資産総額		7,998,929,106.02	100.00
負債総額		91,757,166.06	1.15
合計 (純資産総額)		7,907,171,939.96 (約913,674百万円)	98.85

(ハイ・イールド)

(2022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	2,094,974,138.66	52.49
	オランダ	254,463,519.32	6.38
	ドイツ	207,867,145.18	5.21
	フランス	206,358,684.97	5.17
	ルクセンブルグ	164,341,205.03	4.12
	イギリス	152,797,667.43	3.83
	イタリア	150,440,273.19	3.77
	カナダ	125,202,926.08	3.14
	スペイン	103,723,231.35	2.60
	スウェーデン	52,230,178.88	1.31
	アイルランド	35,835,100.20	0.90
	ケイマン諸島	21,703,817.57	0.54
	デンマーク	18,297,583.31	0.46
	日本	16,188,328.28	0.41
	多国籍	15,653,518.37	0.39
	イスラエル	14,905,409.71	0.37
	リベリア	12,458,838.00	0.31
	ジャージー	11,398,397.08	0.29
	メキシコ	10,968,758.71	0.27
	ベルギー	10,887,033.26	0.27
	パナマ	10,779,593.53	0.27
	フィンランド	10,720,132.58	0.27
	スイス	10,571,531.50	0.26
	バミューダ	10,132,812.50	0.25
	オーストラリア	8,950,687.69	0.22
	オーストリア	7,189,414.74	0.18
	ルーマニア	5,153,733.00	0.13
	マン島	4,442,971.76	0.11
	ポーランド	4,284,730.01	0.11
	ノルウェー	3,618,701.96	0.09
	ポルトガル	2,892,499.45	0.07
	チェコ共和国	2,497,823.72	0.06
	アラブ首長国連邦	2,296,066.50	0.06
ハンガリー	2,038,737.86	0.05	
マーシャル諸島	1,963,102.50	0.05	
ギリシャ	1,959,306.90	0.05	

	シンガポール	1,173,758.64	0.03
	英領ヴァージン諸島	1,054,085.65	0.03
	マルタ	552,638.65	0.01
	小計	3,772,968,083.72	94.53
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	593,944.98	0.01
株式	米国	1,651,385.54	0.04
	ケイマン諸島	21,499.73	0.00
	小計	1,672,885.27	0.04
ワラント	ケイマン諸島	8,639.40	0.00
ポートフォリオ合計		3,775,243,553.37	94.59
現金・その他資産(負債控除後)		215,971,583.04	5.41
資産総額		3,991,215,136.41	100.00
負債総額		35,633,134.19	0.89
合計 (純資産総額)		3,955,582,002.22 (約457,068百万円)	99.11

(2) 運用実績

純資産等の推移

2022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
2021年3月末日	5,784,642	668,415	5,706,422	659,377	140.56	16,242	10,590
4月末日	5,937,151	686,038	5,897,390	681,443	143.03	16,527	10,770
5月末日	6,018,901	695,484	5,978,622	690,830	144.42	16,688	10,871
6月末日	5,958,422	688,496	5,897,131	681,413	145.28	16,787	10,933
7月末日	5,960,493	688,735	5,915,112	683,491	145.38	16,799	10,937
8月末日	5,913,359	683,289	5,890,097	680,601	147.10	16,997	11,064
9月末日	5,773,271	667,101	5,732,264	662,363	144.35	16,680	10,853
10月末日	5,838,680	674,659	5,758,875	665,438	143.68	16,602	10,796
11月末日	5,625,258	649,999	5,588,000	645,693	140.69	16,257	10,570
12月末日	5,702,057	658,873	5,678,716	656,176	142.35	16,449	10,690
2022年1月末日	5,567,728	643,351	5,474,544	632,584	138.75	16,033	10,417
2月末日	5,217,962	602,936	5,155,426	595,709	130.22	15,047	9,774

(U S マルチ・クレジット・サステナブル)

	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
2021年3月末日	5,335,813	616,553	5,301,365	612,573	163.01	18,836	10,733
4月末日	5,479,723	633,182	5,436,977	628,243	164.16	18,969	10,804
5月末日	5,568,507	643,441	5,503,086	635,882	164.99	19,065	10,856
6月末日	5,515,313	637,294	5,486,701	633,988	165.73	19,150	10,901
7月末日	5,795,505	669,671	5,573,488	644,017	167.01	19,298	10,981
8月末日	5,633,505	650,952	5,610,425	648,285	166.77	19,270	10,962
9月末日	8,169,091	943,938	7,960,886	919,880	165.93	19,173	10,902
10月末日	8,114,251	937,602	8,039,542	928,969	164.93	19,058	10,831
11月末日	8,147,642	941,460	8,032,188	928,119	164.56	19,015	10,804
12月末日	8,132,951	939,762	8,095,916	935,483	164.85	19,048	10,815
2022年1月末日	8,108,933	936,987	7,937,454	917,173	161.68	18,682	10,605
2月末日	7,998,929	924,276	7,907,172	913,674	159.72	18,456	10,474

(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
2021年3月末日	5,247,740	606,376	5,076,926	586,639	140.69	16,257	11,052
4月末日	5,228,707	604,177	5,183,591	598,964	141.85	16,391	11,139
5月末日	5,276,772	609,731	5,206,849	601,651	142.19	16,430	11,162
6月末日	5,250,696	606,718	5,162,486	596,525	143.60	16,593	11,269
7月末日	5,212,923	602,353	5,180,777	598,639	143.96	16,635	11,293
8月末日	4,129,271	477,137	4,098,605	473,594	144.66	16,715	11,346
9月末日	4,393,193	507,633	4,061,186	469,270	144.71	16,721	11,346
10月末日	4,128,478	477,046	4,076,629	471,054	144.23	16,666	11,304
11月末日	4,059,655	469,093	4,023,436	464,908	142.97	16,520	11,205

12月末日	4,132,112	477,466	4,122,345	476,337	145.34	16,794	11,383
2022年1月末日	4,077,430	471,147	3,996,682	461,817	142.12	16,422	11,125
2月末日	3,991,215	461,185	3,955,582	457,068	139.63	16,134	10,928

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・サステナブル)
- (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

2022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)
- 8.38	- 8.80

- (US マルチ・クレジット・サステナブル)

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)
- 2.95	- 3.41

- (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)
- 0.22	- 0.64

(注) 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$

a = 2022年2月末日現在の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額)。

b = 2021年2月末日現在の1口当たり純資産価格(分配額の額)。

(3) 投資リスク

当中間計算期間において、2022年1月31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

2022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、2022年2月28日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1ユーロ=129.34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

2022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、2022年2月28日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1スイスフラン=124.86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

(2022年2月末日現在)

名 称	住 所	所有株式数 (株)	比率 (%)
UBS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

(2022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 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

(2022年2月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有株式
マイケル・カール (Michael Kehl)	チェアマン	UBSアセット・マネジメント・ スイス・エイ・ジー、チューリッ ヒ、 ヘッド・オブ・プロダクト	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
アンドレ・ヴァレンテ (André Valente)	ディレクター/ ボード・メンバー	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
アン - シャルロット・ ローヤー (Ann-Charlotte Lawyer)	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、 インディペンデント・ディレクター	該当なし
ミリアム・ウエベル (Miriam Uebel)	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、 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

(2022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 (2020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。

2022年2月末日現在、管理会社は以下のとおり、411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	356	570,103,263.27オーストラリア・ドル
			285,468,522.15カナダ・ドル
			14,087,898,698.99スイス・フラン
			23,429,544,784.60中国元
			543,006,395.68デンマーク・クローネ
			50,286,953,932.25ユーロ
			1,730,007,891.51英ポンド
			216,811,064.04香港ドル
			107,210,978,830.34日本円
			41,347,333.68シンガポール・ドル
			126,855,397,952.26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	55	505,621,477.97オーストラリア・ドル
			192,385,571.35スイス・フラン
			2,429,909,559.54ユーロ
			2,599,260,266.56英ポンド
			17,247,097,666日本円
			34,006,113,460.10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。

2022年2月末日現在、ユービーエス・スイス・エイ・ジーは以下の98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	6	22億スイスフラン
スイス (共同ポートフォリオ・マネ ジャー)	オープン・エンド型 ファンド	9	39億スイスフラン
ケイマン諸島 (ポートフォリオ・マネジャー)	ヘッジ・ファンド	4	54億スイスフラン
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	35	340億スイスフラン
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	42	191億スイスフラン
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	10億スイスフラン

(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^(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
 - 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
- (注) サブ・ファンド「U S マルチ・クレジット」は、2022年2月8日付で「U S マルチ・クレジット・サステナブル」に名称が変更された。
- 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、2022年2月28日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝115.55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

	2022年1月31日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	5,562,622,287.97	642,761,005
投資有価証券、未実現評価(損)益	(381,085,770.74)	(44,034,461)
投資有価証券合計(注1)	5,181,536,517.23	598,726,545
現金預金、要求払預金および預託金勘定	278,337,015.96 *	32,161,842
その他の流動資産(委託証拠金)	8,524,772.70	985,037
投資有価証券売却未収金(注1)	9,567,979.60	1,105,580
発行未収金	10,387,979.30	1,200,331
有価証券に係る未収利息	72,706,658.87	8,401,254
その他の未収金	2,173,089.75	251,101
金融先物に係る未実現利益(注1)	4,494,082.46	519,291
資産合計	5,567,728,095.87	643,350,981
負 債		
先渡為替契約に係る未実現損失(注1)	(29,638,143.12)	(3,424,687)
当座借越	(1,118,028.59)	(129,188)
投資有価証券購入未払金(注1)	(35,800,681.90)	(4,136,769)
買戻未払金	(13,382,354.07)	(1,546,331)
その他の未払金	(20,812.10)	(2,405)
報酬引当金(注2)	(13,055,177.29)	(1,508,526)
年次税引当金(注3)	(47,141.97)	(5,447)
その他の手数料および報酬に係る引当金(注2)	(121,911.82)	(14,087)
引当金合計	(13,224,231.08)	(1,528,060)
負債合計	(93,184,250.86)	(10,767,440)
期末現在純資産	5,474,543,845.01	632,583,541

* 2022年1月31日現在、モルガン・スタンレーに対する70,000.00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
純資産計算書

2022年1月31日現在

	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	7,884,406,550.95	911,043,177
投資有価証券、未実現評価(損)益	(135,657,167.70)	(15,675,186)
投資有価証券合計(注1)	7,748,749,383.25	895,367,991
現金預金、要求払預金および預託金勘定	216,291,378.81	24,992,469
その他の流動資産(委託証拠金)	4,083,581.35	471,858
投資有価証券売却未収金(注1)	51,567,792.08	5,958,658
発行未収金	29,239,267.70	3,378,597
有価証券に係る未収利息	57,351,992.06	6,627,023
分配に係る未収金	44,980.60	5,198
金融先物に係る未実現利益(注1)	1,604,763.72	185,430
資産合計	8,108,933,139.57	936,987,224
負 債		
先渡為替契約に係る未実現損失(注1)	(46,501,604.37)	(5,373,260)
当座借越	(35,960.85)	(4,155)
当座借越に係る未払利息	(42.91)	(5)
投資有価証券購入未払金(注1)	(85,055,428.33)	(9,828,155)
買戻未払金	(27,532,245.00)	(3,181,351)
その他の未払金	(28,525.35)	(3,296)
報酬引当金(注2)	(12,139,022.74)	(1,402,664)
年次税引当金(注3)	(68,350.39)	(7,898)
その他の手数料および報酬に係る引当金(注2)	(118,428.14)	(13,684)
引当金合計	(12,325,801.27)	(1,424,246)
負債合計	(171,479,608.08)	(19,814,469)
期末現在純資産	7,937,453,531.49	917,172,756

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

2022年1月31日現在

	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	3,971,837,539.82	458,945,828
投資有価証券、未実現評価(損)益	(124,036,968.01)	(14,332,472)
投資有価証券合計(注1)	3,847,800,571.81	444,613,356
現金預金、要求払預金および預託金勘定	156,025,959.94 *	18,028,800
その他の流動資産(委託証拠金)	277,421.06	32,056
投資有価証券売却未収金(注1)	6,845,225.36	790,966
発行未収金	10,724,285.90	1,239,191
有価証券に係る未収利息	53,832,150.68	6,220,305
分配に係る未収金	3,828.13	442
金融先物に係る未実現利益(注1)	943,349.61	109,004
スワップに係る未実現利益(注1)	976,892.93	112,880
資産合計	4,077,429,685.42	471,147,000
負 債		
先渡為替契約に係る未実現損失(注1)	(21,552,283.32)	(2,490,366)
当座借越	(1,378,792.79)	(159,320)
当座借越に係る未払利息	(33.67)	(4)
投資有価証券購入未払金(注1)	(37,319,431.19)	(4,312,260)
買戻未払金	(12,190,204.70)	(1,408,578)
その他の未払金	(9,742.93)	(1,126)
報酬引当金(注2)	(8,059,307.15)	(931,253)
年次税引当金(注3)	(34,415.90)	(3,977)
その他の手数料および報酬に係る引当金(注2)	(203,222.76)	(23,482)
引当金合計	(8,296,945.81)	(958,712)
負債合計	(80,747,434.41)	(9,330,366)
期末現在純資産	3,996,682,251.01	461,816,634

* 2022年1月31日現在、シティバンクに対する30,000.00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 - エマージング・マーケット・デッド
運用計算書

自2021年8月1日 至2022年1月31日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	177.59	21
有価証券に係る利息	136,840,581.90	15,811,929
貸付証券に係る純利益	282,021.73	32,588
その他の収益(注4)	4,769,303.62	551,093
収益合計	<u>141,892,084.84</u>	<u>16,395,630</u>
費 用		
定率報酬(注2)	(21,687,044.14)	(2,505,938)
年次税(注3)	(285,029.06)	(32,935)
当座借越に係る利息	(212,775.17)	(24,586)
その他の手数料および報酬(注2)	(230,859.91)	(26,676)
その他の費用	(84,656.25)	(9,782)
費用合計	<u>(22,500,364.53)</u>	<u>(2,599,917)</u>
投資純(損)益	<u>119,391,720.31</u>	<u>13,795,713</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	(20,524,380.93)	(2,371,592)
金融先物に係る実現(損)益	(11,663,008.02)	(1,347,661)
先渡為替契約に係る実現(損)益	(85,810,558.83)	(9,915,410)
外国為替に係る実現(損)益	(9,036,709.80)	(1,044,192)
実現(損)益合計	<u>(127,034,657.58)</u>	<u>(14,678,855)</u>
当期実現純(損)益	<u>(7,642,937.27)</u>	<u>(883,141)</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	(380,864,147.08)	(44,008,852)
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	(25,439.66)	(2,940)
金融先物に係る未実現評価(損)益	10,107,870.81	1,167,964
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	(44,944,201.75)	(5,193,303)
未実現評価(損)益の変動合計	<u>(415,725,917.68)</u>	<u>(48,037,130)</u>
運用の結果による純資産の純増(減)	<u>(423,368,854.95)</u>	<u>(48,920,271)</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2021年8月1日 至2022年1月31日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	64,258.03	7,425
有価証券に係る利息	102,024,877.00	11,788,975
分配金	43,135.77	4,984
貸付証券に係る純利益	50,701.25	5,859
その他の収益(注4)	5,197,814.99	600,608
収益合計	107,380,787.04	12,407,850
費 用		
定率報酬(注2)	(18,737,607.20)	(2,165,131)
年次税(注3)	(425,501.29)	(49,167)
当座借越に係る利息	(161,705.50)	(18,685)
その他の手数料および報酬(注2)	(112,727.21)	(13,026)
費用合計	(19,437,541.20)	(2,246,008)
投資純(損)益	87,943,245.84	10,161,842
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	14,127,732.33	1,632,459
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	79,074.22	9,137
金融先物に係る実現(損)益	250,220.50	28,913
先渡為替契約に係る実現(損)益	(131,890,984.95)	(15,240,003)
外国為替に係る実現(損)益	3,153,569.21	364,395
実現(損)益合計	(114,280,388.69)	(13,205,099)
当期実現純(損)益	(26,337,142.85)	(3,043,257)
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	(364,201,096.36)	(42,083,437)
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	(39,483.29)	(4,562)
金融先物に係る未実現評価(損)益	2,746,842.48	317,398
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	(57,495,295.59)	(6,643,581)
未実現評価(損)益の変動合計	(418,989,032.76)	(48,414,183)
運用の結果による純資産の純増(減)	(445,326,175.61)	(51,457,440)

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2021年8月1日 至2022年1月31日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	521.32	60
有価証券に係る利息	100,263,880.68	11,585,491
スワップに係る受取利息(注1)	144,176.25	16,660
分配金	38,844.73	4,489
貸付証券に係る純利益	210,988.36	24,380
その他の収益(注4)	13,401,415.44	1,548,534
収益合計	114,059,826.78	13,179,613
費 用		
スワップに係る支払利息(注1)	(52,459.77)	(6,062)
定率報酬(注2)	(13,522,755.83)	(1,562,554)
年次税(注3)	(197,364.53)	(22,805)
当座借越に係る利息	(149,785.04)	(17,308)
その他の手数料および報酬(注2)	(96,387.97)	(11,138)
費用合計	(14,018,753.14)	(1,619,867)
投資純(損)益	100,041,073.64	11,559,746
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	59,894,970.26	6,920,864
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	(164,716.62)	(19,033)
金融先物に係る実現(損)益	(200,905.68)	(23,215)
先渡為替契約に係る実現(損)益	10,402,024.36	1,201,954
スワップに係る実現(損)益	293,912.19	33,962
外国為替に係る実現(損)益	(3,194,270.50)	(369,098)
実現(損)益合計	67,031,014.01	7,745,434
当期実現純(損)益	167,072,087.65	19,305,180
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	(298,697,958.81)	(34,514,549)
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	322,456.48	37,260
金融先物に係る未実現評価(損)益	1,466,974.46	169,509
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	(31,612,233.11)	(3,652,794)
スワップに係る未実現評価(損)益	759,196.26	87,725
未実現評価(損)益の変動合計	(327,761,564.72)	(37,872,849)
運用の結果による純資産の純増(減)	(160,689,477.07)	(18,567,669)

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2021年8月1日 至2022年1月31日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	5,915,111,579.13	683,491,143
発行額	513,017,467.15	59,279,168
買戻額	(508,685,909.66)	(58,778,657)
純発行(買戻)合計	4,331,557.49	500,511
支払分配金	(21,530,436.66)	(2,487,842)
投資純(損)益	119,391,720.31	13,795,713
実現(損)益合計	(127,034,657.58)	(14,678,855)
未実現評価(損)益の変動合計	(415,725,917.68)	(48,037,130)
運用の結果による純資産の純増(減)	(423,368,854.95)	(48,920,271)
期末現在純資産	5,474,543,845.01	632,583,541

発行済投資証券数の変動表

	自2021年8月1日 至2022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	14,882,210.4190	
期中発行投資証券数	1,586,311.1570	
期中買戻投資証券数	(1,252,477.1710)	
期末現在発行済投資証券数	15,216,044.4050	
クラスF - a c c円ヘッジ		
期首現在発行済投資証券数	152,362.1180	
期中発行投資証券数	5,134.0000	
期中買戻投資証券数	(10,379.1180)	
期末現在発行済投資証券数	147,117.0000	

最重要数値

日付	ISIN	2022年1月31日	2021年7月31日	2020年7月31日
純資産額(米ドル)		5,474,543,845.01	5,915,111,579.13	6,297,057,630.99
クラスF - a c c	LU0985399996			
発行済投資証券数(口)		15,216,044.4050	14,882,210.4190	16,214,122.0160
1口当たり純資産価格(米ドル)		138.75	145.38	137.43
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) ¹		138.75	145.38	137.43
クラスF - a c c円ヘッジ	LU1749433899			
発行済投資証券数(口)		147,117.0000	152,362.1180	140,170.0000
1口当たり純資産価格(米ドル)		10,417	10,937	10,398
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) ¹		10,417	10,937	10,398

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	6.98	マケドニア	0.22
ケイマン諸島	3.72	レバノン	0.21
コロンビア	3.61	トリニダード・トバゴ共和国	0.21
オランダ	3.47	アルメニア	0.19
インドネシア	3.10	イラク	0.19
トルコ	2.97	ホンジュラス	0.18
チリ	2.74	ベネズエラ	0.16
ブラジル	2.57	多国籍企業	0.16
ペルー	2.57	ノルウェー	0.14
アラブ首長国連邦	2.40	ジョージア	0.14
ドミニカ共和国	2.30	ジャージー	0.14
サウジアラビア	2.04	ブルガリア	0.12
英国領バージン諸島	2.01	ブルンジ	0.12
ウクライナ	1.88	カメルーン	0.10
エジプト	1.86	ペラルーシ	0.10
ルクセンブルグ	1.80	エチオピア	0.10
インド	1.78	国際機関	0.08
カタール	1.74	ベトナム	0.08
オマーン	1.73	チュニジア	0.08
アルゼンチン	1.65	ポーランド	0.07
香港	1.57	マーシャル諸島	0.06
パラグアイ	1.49	アルバニア	0.05
ルーマニア	1.33	クウェート	0.05
中国	1.33	パプアニューギニア	0.03
エクアドル	1.32	カンボジア	0.03
パナマ	1.31	タジキスタン	0.01
ロシア連邦 (CIS)	1.24	合計	94.65
アゼルバイジャン	1.23		
マレーシア	1.21	業種別分類	純資産割合%
シンガポール	1.19	国債および中央政府債	38.57
ナイジェリア	1.18	金融および持株会社	14.84
南アフリカ	1.18	石油	9.96
カザフスタン	1.18	銀行および金融機関	7.41
アイルランド	1.09	エネルギー・水道	3.99
アメリカ合衆国	1.08	通信	2.39
モーリシャス	1.01	化学	2.13
クロアチア	0.95	交通・運輸	1.97
アンゴラ	0.95	鉱業・石炭・鋼鉄	1.51
イスラエル	0.94	モーゲージおよび貸付機関	1.30
バーレーン	0.93	食品・清涼飲料	1.11
ガーナ	0.91	不動産	0.88
モロッコ	0.87	建築業・資材	0.68
イギリス	0.82	各種サービス	0.61
コートジボワール	0.79	国際機関	0.60
グアテマラ	0.74	非分類会社	0.59
パキスタン	0.66	宿泊・仕出し・レジャー	0.56
スリランカ	0.64	電気装置・部品	0.55
フィリピン	0.64	医薬品・化粧品・医療品	0.54
韓国	0.60	インターネット、ソフトウェア・ITサービス	0.47
マン島	0.58	貴金属および宝石	0.41
タイ	0.54	保険	0.41
セルビア	0.53	非鉄金属	0.39
カナダ	0.49	投資信託	0.33
ハンガリー	0.48	林業、紙・パルプ製品	0.30
バミューダ	0.47	機械工学・産業機器	0.26
セネガル	0.45	航空宇宙産業	0.25
コスタリカ	0.39	州、連邦州	0.23
モンゴル	0.39	たばこ・アルコール	0.23
エルサルバドル	0.39	小売り・百貨店	0.23
ガボン	0.38	グラフィックデザイン・出版・メディア	0.19
ザンビア	0.35	農業・漁業	0.18
ケニア	0.35	市および地方自治体	0.15
ベナン共和国	0.34	各種貿易会社	0.13
ヨルダン	0.31	自動車	0.10
ウズベキスタン	0.30	包装業	0.08
ジャマイカ	0.30	その他消費財	0.06
オーストリア	0.29	電子工学・半導体	0.03
ウルグアイ	0.28	公的、非営利機関	0.01
スペイン	0.26	ヘルスケア、社会事業	0.01
トーゴ	0.23	コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置	0.01
マカオ	0.23	合計	94.65

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2021年8月1日 至2022年1月31日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	5,573,488,091.35	644,016,549
発行額	3,382,517,482.07	390,849,895
買戻額	(564,494,539.61)	(65,227,344)
純発行(買戻)合計	2,818,022,942.46	325,622,551
支払分配金	(8,731,326.71)	(1,008,905)
投資純(損)益	87,943,245.84	10,161,842
実現(損)益合計	(114,280,388.69)	(13,205,099)
未実現評価(損)益の変動合計	(418,989,032.76)	(48,414,183)
運用の結果による純資産の純増(減)	(445,326,175.61)	(51,457,440)
期末現在純資産	7,937,453,531.49	917,172,756

発行済投資証券数の変動表

	自2021年8月1日 至2022年1月31日	
	(口)	(口)
クラスF - a c c		
期首現在発行済投資証券数	13,589,831.6990	
期中発行投資証券数	9,410,602.5110	
期中買戻投資証券数	(1,370,881.6360)	
期末現在発行済投資証券数	21,629,552.5740	
クラスF - a c c円ヘッジ		
期首現在発行済投資証券数	358,650.0000	
期中発行投資証券数	19,867.0000	
期中買戻投資証券数	(24,654.0000)	
期末現在発行済投資証券数	353,863.0000	

最重要数値

日付	ISIN	2022年1月31日	2021年7月31日	2020年7月31日
純資産額(米ドル)		7,937,453,531.49	5,573,488,091.35	6,198,677,594.06
クラスF - a c c	LU0313364738			
発行済投資証券数(口)		21,629,552.5740	13,589,831.6990	14,063,084.4420
1口当たり純資産価格(米ドル)		161.68	167.01	163.20
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) ¹		161.68	167.01	163.20
クラスF - a c c円ヘッジ	LU1749433972			
発行済投資証券数(口)		353,863.0000	358,650.0000	329,750.0000
1口当たり純資産価格(米ドル)		10,605	10,981	10,788
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) ¹		10,605	10,981	10,788

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	72.11	銀行および金融機関	27.05
イギリス	5.49	金融および持株会社	18.79
カナダ	2.75	国債および中央政府債	4.75
日本	2.68	通信	4.17
オランダ	2.51	不動産	4.07
フランス	2.06	医薬品・化粧品・医療品	3.81
オーストラリア	1.42	インターネット、ソフトウェア・ITサービス	3.39
アイルランド	1.39	保険	2.82
ケイマン諸島	0.96	エネルギー・水道	2.51
スイス	0.79	石油	2.35
イタリア	0.76	電子工学・半導体	2.22
ノルウェー	0.67	コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置	2.13
ルクセンブルグ	0.54	ヘルスケア、社会事業	2.01
スペイン	0.49	交通・運輸	1.87
ニュージーランド	0.39	小売り・百貨店	1.87
メキシコ	0.35	モーゲージおよび貸付機関	1.22
フィンランド	0.29	バイオテクノロジー	1.21
英国領バージン諸島	0.27	グラフィックデザイン・出版・メディア	1.18
バミューダ	0.21	食品・清涼飲料	1.14
ガーンジー	0.20	その他消費財	0.89
スウェーデン	0.19	宿泊・仕出し・レジャー	0.81
中国	0.18	自動車	0.72
チリ	0.15	電気装置・部品	0.68
ブラジル	0.14	建築業・資材	0.62
ドイツ	0.10	公的、非営利機関	0.57
ペルー	0.10	機械工学・産業機器	0.56
デンマーク	0.10	各種貿易会社	0.48
韓国	0.09	各種サービス	0.47
オーストリア	0.06	鉱業・石炭・鋼鉄	0.44
サウジアラビア	0.06	繊維・衣服・革製品	0.37
アラブ首長国連邦	0.05	化学	0.36
カタール	0.03	包装業	0.36
マレーシア	0.02	投資信託	0.36
コロンビア	0.01	貴金属および宝石	0.26
カザフスタン	0.01	林業、紙・パルプ製品	0.25
合計	97.62	農業・漁業	0.19
		環境サービスおよびリサイクル	0.19
		州、連邦州	0.18
		市および地方自治体	0.14
		非分類会社	0.08
		各種資本財	0.05
		ゴム・タイヤ	0.03
		合計	97.62

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2021年8月1日 至2022年1月31日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	5,180,776,616.51	598,638,738
発行額	337,501,868.88	38,998,341
買戻額	(1,349,562,743.86)	(155,941,975)
純発行(買戻)合計	(1,012,060,874.98)	(116,943,634)
支払分配金	(11,344,013.45)	(1,310,801)
投資純(損)益	100,041,073.64	11,559,746
実現(損)益合計	67,031,014.01	7,745,434
未実現評価(損)益の変動合計	(327,761,564.72)	(37,872,849)
運用の結果による純資産の純増(減)	(160,689,477.07)	(18,567,669)
期末現在純資産	3,996,682,251.01	461,816,634

発行済投資証券数の変動表

	自2021年8月1日 至2022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	14,749,235.0260	
期中発行投資証券数	1,346,585.6980	
期中買戻投資証券数	(3,738,048.5570)	
期末現在発行済投資証券数	<u>12,357,772.1670</u>	
クラスF - a c c円ヘッジ		
期首現在発行済投資証券数	118,296.0000	
期中発行投資証券数	3,510.0000	
期中買戻投資証券数	(8,475.0000)	
期末現在発行済投資証券数	<u>113,331.0000</u>	

最重要数値

日付	ISIN	2022年1月31日	2021年7月31日	2020年7月31日
純資産額(米ドル)		3,996,682,251.01	5,180,776,616.51	4,411,256,071.12
クラスF - a c c	LU1344275315			
発行済投資証券数(口)		12,357,772.1670	14,749,235.0260	12,116,942.6060
1口当たり純資産価格(米ドル)		142.12	143.96	131.06
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) ¹		142.12	143.96	131.06
クラスF - a c c円ヘッジ	LU1749434194			
発行済投資証券数(口)		113,331.0000	118,296.0000	107,946.0000
1口当たり純資産価格(米ドル)		11,125	11,293	10,333
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) ¹		11,125	11,293	10,333

¹ 注記1を参照

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

組入証券の構造

地域別分類	純資産割合%	業種別分類	純資産割合%
アメリカ合衆国	53.23	金融および持株会社	36.66
オランダ	6.49	石油	6.89
ドイツ	5.36	通信	6.15
フランス	5.27	宿泊・仕出し・レジャー	4.20
ルクセンブルグ	4.24	銀行および金融機関	4.08
イギリス	4.09	インターネット、ソフトウェア・ITサービス	2.76
イタリア	3.76	交通・運輸	2.68
カナダ	3.22	各種サービス	2.47
スペイン	2.65	自動車	2.46
スウェーデン	1.35	エネルギー・水道	2.38
アイルランド	0.85	医薬品・化粧品・医療品	2.35
ケイマン諸島	0.60	不動産	2.24
デンマーク	0.46	ヘルスケア、社会事業	2.23
日本	0.44	食品・清涼飲料	2.15
多国籍企業	0.39	化学	1.71
イスラエル	0.38	機械工学・産業機器	1.54
ジャージー	0.35	建築業・資材	1.36
フィンランド	0.33	コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置	1.26
オーストラリア	0.30	包装業	1.19
スイス	0.29	グラフィックデザイン・出版・メディア	1.03
メキシコ	0.28	電気装置・部品	0.94
ベルギー	0.28	その他消費財	0.93
リベリア	0.27	小売り・百貨店	0.92
オーストリア	0.19	航空宇宙産業	0.82
パナマ	0.18	鉱業・石炭・鋼鉄	0.66
バミューダ	0.15	電子工学・半導体	0.57
ルーマニア	0.13	繊維・衣服・革製品	0.54
マン島	0.11	バイオテクノロジー	0.52
ポーランド	0.11	非分類会社	0.41
ノルウェー	0.09	林業、紙・パルプ製品	0.38
マーシャル諸島	0.07	環境サービスおよびリサイクル	0.37
アラブ首長国連邦	0.06	モーゲージおよび貸付機関	0.29
ポルトガル	0.06	保険	0.26
チェコ共和国	0.06	ゴム・タイヤ	0.23
ハンガリー	0.05	各種資本財	0.21
ギリシャ	0.05	非鉄金属	0.17
シンガポール	0.03	各種貿易会社	0.09
英国領バージン諸島	0.03	農業・漁業	0.08
マルタ共和国	0.02	写真および光学	0.04
合計	96.27	たばこ・アルコール	0.03
		貴金属および宝石	0.02
		合計	96.27

マルチ・マネージャー・アクセス

財務書類に対する注記

2022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(以下「スウィング・プライシング」という。)。

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сп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сп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、通常連絡手段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。

期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ることができる。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2022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、2022年1月31日現在の結合財務書類の換算に用いられた。

$$\begin{array}{l} \text{為替レート} \\ \hline 1 \text{ユーロ} = 1.121000 \text{米ドル} \end{array}$$

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。

l) 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。

m) クロス・サブ・ファンド投資

2022年1月31日現在、マルチ・マネージャー・アクセス - サステナブル・インベスティング・バランスド、マルチ・マネージャー・アクセス - サステナブル・インベスティング・グロースおよびマルチ・マネージャー・アクセス - サステナブル・インベスティング・イールドは、マルチ・マネージャー・アクセス のその他のサブ・ファンドに以下の投資を行った。

マルチ・マネージャー・アクセス - サステナブル・インベスティング・バランスド	米ドルでの金額
マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット 米ドル F - a c c	203,802,005.36 米ドル
マルチ・マネージャー・アクセス - フューチャー・オブ・アース 米ドル F - a c c	34,646,735.04 米ドル
合計	238,448,740.40 米ドル

マルチ・マネージャー・アクセス - サステナブル・インベスティング・グロース	米ドルでの金額
マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット 米ドル F - a c c	20,400,620.72 米ドル
マルチ・マネージャー・アクセス - フューチャー・オブ・アース 米ドル F - a c c	11,141,879.20 米ドル
合計	31,542,499.92 米ドル

マルチ・マネージャー・アクセス - サステナブル・インベスティング・イールド	米ドルでの金額
マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット 米ドル F - a c c	128,830,666.00 米ドル
マルチ・マネージャー・アクセス - フューチャー・オブ・アース 米ドル F - a c c	11,337,488.64 米ドル
合計	140,168,154.64 米ドル

2022年1月31日現在、クロス・サブ・ファンド投資の総額は365,887,060.61ユーロにのぼる。したがって、クロス・サブ・ファンド投資なしの年度末の調整後の結合純資産合計は23,607,315,388.50ユーロである。

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	0.38%
- ハイ・イールド	0.32%
- US マルチ・クレジット	0.22%

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

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

本投資法人の運用費用および管理事務費用

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

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

- 純資産価額の公表および投資者に対する通知の公告に関連するコストおよび費用
- 証券取引所または規制ある市場への本投資法人の投資証券の上場に関連して請求される手数料および費用
- 投資主への配当金支払における手数料およびその他のコスト
- 監査における手数料、コストおよび費用(監査人の報酬および費用を含む。)
- KIIDの作成、翻訳および監督機関への提出に関する手数料および費用

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

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

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

サブ・ファンドの現行の費用の詳細は、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

2021年8月1日から2022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

2022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	505,932,826.26 米ドル	657,663,007.48 米ドル
- ハイ・イールド	109,664,189.64 米ドル	134,349,495.47 米ドル
- US マルチ・クレジット	404,396,718.76 米ドル	377,140,370.03 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。		

マルチ・マネージャー・アクセス	指数に係る金融先物 (購入)	指数に係る金融先物 (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)
- ハイ・イールド	- 米ドル	3,225,142.19 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	45,723,947.33 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	0.66%
- 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	0.54%

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

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

注9 - 後発事象

ウクライナにおける戦争は、ロシアおよびウクライナの証券をはじめとして、世界的に広範な市場に影響を及ぼし、金融市場にも重大な影響を及ぼしている。この状況は依然として非常に不安定であり、ファンドの管理会社は、ファンドの投資者の利益を守るための適切な措置を迅速にとるために、注意深く監視している。特に、欧州連合、スイス、英国および米国において最近制定された制裁制度 (これらに限定されない) 等、適用される法律および規則を常に遵守するために必要な措置を講じてきた。我々は、制裁を受けたロシア証券を超えて深刻な取引制限を経験しているため、(入手可能であれば) 価格相場がその時々市場価値を反映していると考えられないすべての関連証券に対して公正価値の価格設定を適用している。今後の金融市場の動向次第では、投資戦略にもさらなる影響が出てくる可能性がある。現時点では、これが一定のファンドにおける流動性対策の適用を必要とするかどうかは不明である。これらには、各ファンドの英文目論見書に示されているようなすべての措置が含まれる可能性がある。

2022年1月31日現在、サブ・ファンドのマルチ・マネージャー・アクセス - フューチャー・オブ・ヒューマンズは、その純資産に対して0.18%のロシア証券を保有しており、決定された公正価値の影響を受けている。2022年2月28日から2022年3月3日までの間に価格設定のヘアカットが適用され、2022年3月3日の純資産価額について、ロシアのすべての現地株式、グローバル預託証券、米国預託証券の価格をゼロとする最終決定が行われた。

ファンドの経営陣は、これらの事象をファンドおよびそのサブ・ファンドの報告期間後の調整不要事象とみなしている。

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

2022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			
EUR ALBANIA, REPUBLIC OF-REG-S 3.5000% 21-23.11.31	2 610 000.00	2 859 979.27	0.05
EUR ARGENTINA, REPUBLIC OF 0.1250% 20-09.07.30	1 008 800.00	346 185.99	0.01
EUR ARGENTINA, REPUBLIC OF 0.5000% 20-09.07.29	34 392.00	13 204.55	0.00
EUR BANQUE OUEST AFRICAINE DE DEV-REG-S 2.7500% 21-22.01.33	3 964 000.00	4 545 936.68	0.08
EUR BENIN GOVT INTERNATIONAL BD-REG-S 4.8750% 21-19.01.32	5 077 000.00	5 476 754.35	0.10
EUR BULGARIA, REPUBLIC OF-REG-S 1.3750% 20-23.09.50	925 000.00	937 120.97	0.02
EUR BULGARIAN ENERGY HOLDING EAD-REG-S 2.4500% 21-22.07.28	5 270 000.00	5 756 729.04	0.11
EUR CENTRAL BANK OF TUNISIA-REG-S 6.7500% 18-31.10.23	1 120 000.00	1 097 010.60	0.02
EUR CENTRAL BANK OF TUNISIA-REG-S 6.3750% 19-15.07.26	1 271 000.00	1 100 651.05	0.02
EUR CREDIT BK MOSCOW/CBOM FINANCE-REG-S 3.1000% 21-21.01.26	800 000.00	771 248.00	0.01
EUR CROATIA, REPUBLIC OF-REG-S 1.1250% 19-19.06.29	10 100 000.00	11 237 184.25	0.21
EUR GOVERNMENT OF BENIN-REG-S 6.8750% 21-19.01.52	4 688 000.00	5 103 502.71	0.09
EUR GTC AURORA LUXEMBOURG SA-REG-S 2.2500% 21-23.06.26	1 150 000.00	1 252 484.00	0.02
EUR HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 1.6250% 20-28.04.32	8 885 000.00	10 176 716.84	0.19
EUR HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 1.7500% 20-05.06.35	2 835 000.00	3 219 444.80	0.06
EUR HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 1.5000% 20-17.11.50	1 272 000.00	1 266 409.48	0.02
EUR INDONESIA GOVERNMENT INTERNATIONAL 1.1000% 21-12.03.33	2 204 000.00	2 310 089.54	0.04
EUR INDONESIA, REPUBLIC OF 1.4000% 19-30.10.31	1 890 000.00	2 084 261.28	0.04
EUR INDONESIA, REPUBLIC OF 0.9000% 20-14.02.27	599 000.00	662 791.74	0.01
EUR IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 5.8750% 19-17.10.31	6 050 000.00	6 819 351.27	0.12
EUR IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 4.8750% 20-30.01.32	2 508 000.00	2 638 914.15	0.05
EUR MACEDONIA GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.6250% 16-26.07.23	855 000.00	1 012 248.29	0.02
EUR MACEDONIA GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 3.6750% 20-03.06.26	1 775 000.00	2 078 319.99	0.04
EUR MACEDONIA GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 1.6250% 21-10.03.28	8 930 000.00	9 209 687.60	0.17
EUR MEXICO, UNITED STATES OF 1.3500% 20-18.09.27	2 980 000.00	3 345 590.87	0.06
EUR MEXICO, UNITED STATES OF 2.1250% 21-25.10.51	780 000.00	692 946.15	0.01
EUR MEXICO, UNITED STATES OF 2.2500% 21-12.08.36	2 300 000.00	2 391 373.25	0.04
EUR MOROCCO GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 2.0000% 20-30.09.30	3 420 000.00	3 620 084.53	0.07
EUR MOROCCO, KINGDOM OF-REG-S 1.5000% 19-27.11.31	1 210 000.00	1 216 360.67	0.02
EUR NE PROPERTY BV-REG-S 3.3750% 20-14.07.27	2 800 000.00	3 389 904.00	0.06
EUR NOVOLIPETSK STEEL VIA STEEL FDG-REG-S 1.4500% 21-02.06.26	3 343 000.00	3 510 600.85	0.06
EUR PERU, REPUBLIC OF 0.1250% 21-11.03.33	12 195 000.00	12 782 006.33	0.23
EUR PERU, REPUBLIC OF 1.9500% 21-17.11.36	2 079 000.00	2 243 163.04	0.04
EUR PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 1.8750% 19-05.11.31	2 813 000.00	2 912 928.31	0.05
EUR PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 0.7000% 20-03.02.29	1 610 000.00	1 766 457.79	0.03
EUR PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 1.7500% 21-28.04.41	1 784 000.00	1 919 869.44	0.04
EUR REPUBLIC OF CAMEROON INTRNTNL BOND-REG-S 5.9500% 21-07.07.32	5 392 000.00	5 551 206.35	0.10
EUR ROMANIA-REG-S 2.6250% 20-02.12.40	7 028 000.00	6 568 605.99	0.12
EUR SENEGAL, REPUBLIC OF-REG-S 5.3750% 21-08.06.37	4 607 000.00	4 750 051.77	0.09
EUR SERBIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 1.5000% 19-26.06.29	17 384 000.00	18 464 372.15	0.34
EUR SERBIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 3.1250% 20-15.05.27	374 000.00	446 505.51	0.01
EUR SERBIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 1.6500% 21-03.03.33	3 133 000.00	3 138 933.12	0.06
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 3.7500% 21-09.05.27	2 580 000.00	2 797 490.03	0.05
EUR UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 4.3750% 20-27.01.30	2 310 000.00	1 983 888.35	0.04
EUR UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 6.7500% 19-20.06.26	3 230 000.00	3 095 809.65	0.06
ユーロ合計		168 564 374.59	3.08
USD			
USD 1MDB ENERGY LTD-REG-S 5.9900% 12-11.05.22	33 400 000.00	33 567 000.00	0.61
USD ABENGOA TRANSMISION SUR SA-REG-S 6.8750% 14-30.04.43	3 165 000.00	3 922 432.21	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 - エマージング・マーケット・デッド

2022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	ABJA INVESTMENT CO PTE LTD-REG-S 5.45000% 18-24.01.28	4 720 000.00	5 004 143.99	0.09
USD	ABU DHABI CRUDE OIL PIPELINE LLC-REG-S 3.65000% 17-02.11.29	4 619 000.00	4 922 987.94	0.09
USD	ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO PJSC-REG-S 4.87500% 18-23.04.30	1 353 000.00	1 568 465.25	0.03
USD	ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO PJSC-REG-S 2.00000% 21-29.04.28	902 000.00	869 302.50	0.02
USD	ABU DHABI ,GOVERNMENT OF-REG-S 2.50000% 17-11.10.22	1 368 000.00	1 382 791.50	0.03
USD	ACCESS BANK PLC-REG-S 6.12500% 21-21.09.26	6 165 000.00	6 072 525.00	0.11
USD	ADANI ELECTRICITY MUMBAI LTD-REG-S 3.94900% 20-12.02.30	4 161 000.00	4 004 442.38	0.07
USD	ADANI GREEN ENERGY LTD-REG-S 4.37500% 21-08.09.24	1 457 000.00	1 455 470.15	0.03
USD	ADANI INTERNATIONAL CONTAINER TER-REG-S 3.00000% 20-16.02.31	2 140 000.00	1 973 727.35	0.04
USD	ADANI PORTS & SPECIAL ECO ZONE-REG-S 4.20000% 20-04.08.27	7 289 000.00	7 433 868.87	0.14
USD	ADANI PORTS & SPECIAL ECO ZONE-REG-S 3.10000% 21-02.02.31	608 000.00	554 154.00	0.01
USD	ADANI PORTS AND SPECIAL ECO ZONE-REG-S 4.37500% 19-03.07.29	5 123 000.00	5 196 002.75	0.09
USD	ADANI TRANSMISSION LTD-REG-S 4.25000% 19-21.05.36	790 000.00	717 459.48	0.01
USD	AEROPUERTO INTERNACIONAL DE TOCUM-REG-S 4.00000% 21-11.08.41	1 930 000.00	1 871 255.62	0.03
USD	AEROPUERTO INTERNACIONAL DE TOCU-REG-S 5.12500% 21-11.08.61	12 096 000.00	11 731 608.00	0.21
USD	AEROPUERTOS DOMINICANOS-REG-S 6.75000% 17-30.03.29	6 760 000.00	6 844 500.00	0.13
USD	AES PANAMA GENERATION HOLDING SRL-REG-S 4.37500% 20-31.05.30	15 217 000.00	15 177 055.37	0.28
USD	AFRICA FINANCE CORP-REG-S 3.75000% 19-30.10.29	1 533 000.00	1 560 256.74	0.03
USD	AFRICA FINANCE CORP-REG-S 2.87500% 21-28.04.28	724 000.00	708 419.52	0.01
USD	AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK/THE-REG-S 2.63400% 21-17.05.26	2 248 000.00	2 216 528.00	0.04
USD	AI CANDELARIA SPAIN SLU-REG-S 7.50000% 18-15.12.28	4 480 000.00	4 659 200.00	0.09
USD	AI CANDELARIA SPAIN SLU-REG-S 5.75000% 21-15.06.33	5 257 000.00	4 853 788.10	0.09
USD	AIA GROUP LTD-REG-S 3.60000% 19-09.04.29	1 050 000.00	1 125 888.71	0.02
USD	AIA GROUP LTD-REG-S 3.37500% 20-07.04.30	250 000.00	262 882.65	0.00
USD	AIA GROUP LTD-REG-S-SUB 3.20000% 20-16.09.40	248 000.00	243 280.28	0.00
USD	AIRPORT AUTHORITY-REG-S 3.25000% 22-12.01.52	2 965 000.00	2 934 107.96	0.05
USD	AKBANK TAS-REG-S 6.80000% 20-06.02.26	2 908 000.00	2 893 460.00	0.05
USD	ALIBABA GROUP HOLDING LTD 4.00000% 17-06.12.37	800 000.00	832 150.01	0.02
USD	ALIBABA GROUP HOLDING LTD 4.20000% 17-06.12.47	400 000.00	414 950.00	0.01
USD	ALIBABA GROUP HOLDING LTD 3.25000% 21-09.02.61	208 000.00	180 007.36	0.00
USD	ALPEK SA DE CV-REG-S 4.25000% 19-18.09.29	7 963 000.00	8 240 709.62	0.15
USD	ALPEK SA DE CV-REG-S 3.25000% 21-25.02.31	2 774 000.00	2 658 358.88	0.05
USD	ALSEA SAB DE CV-REG-S 7.75000% 21-14.12.26	2 579 000.00	2 674 584.19	0.05
USD	AMERICA MOVIL SAB DE CV 3.62500% 19-22.04.29	2 341 000.00	2 465 073.00	0.05
USD	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT S-REG-S 3.37500% 21-29.06.28	6 750 000.00	6 480 000.00	0.12
USD	ANGLOGOLD ASHANTI HOLDINGS PLC 3.75000% 20-01.10.30	1 617 000.00	1 572 532.50	0.03
USD	ANGLOGOLD ASHANTI HOLDINGS PLC 3.37500% 21-01.11.28	5 300 000.00	5 127 750.00	0.09
USD	ANGOLAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 9.37500% 18-08.05.48	14 570 000.00	14 172 056.87	0.26
USD	ANTOFAGASTA PLC-REG-S 2.37500% 20-14.10.30	539 000.00	500 596.25	0.01
USD	ARCOR SAIC-REG-S 6.00000% 16-06.07.23	4 901 000.00	4 764 078.31	0.09
USD	ARGENTINA, REPUBLIC OF STEP-UP 20-09.07.30	24 428 369.00	8 256 788.72	0.15
USD	ARGENTINA, REPUBLIC OF STEP-UP 20-09.07.35	61 612 215.00	19 007 368.33	0.35
USD	ARGENTINA, REPUBLIC OF STEP-UP 20-09.01.38	23 763 235.00	9 006 266.06	0.16
USD	ARGENTINA, REPUBLIC OF 1.00000% 20-09.07.29	2 631 550.00	930 252.92	0.02
USD	ARMENIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 3.60000% 21-02.02.31	8 364 000.00	7 502 508.00	0.14
USD	ARMENIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 3.95000% 19-26.09.29	3 145 000.00	2 964 162.50	0.05
USD	ATP TOWER HOLDINGS LLC-REG-S 4.05000% 21-27.04.26	3 857 000.00	3 779 860.00	0.07
USD	AXTEL SAB DE CV-REG-S 6.37500% 17-14.11.24	8 668 000.00	8 915 168.02	0.16
USD	AZUL INVESTMENTS LLP-REG-S 5.87500% 17-26.10.24	300 000.00	275 625.00	0.01
USD	AZUL INVESTMENTS LLP-REG-S 7.25000% 21-15.06.26	830 000.00	749 230.62	0.01
USD	B2W DIGITAL LUX SARL-REG-S 4.37500% 20-20.12.30	787 000.00	694 527.50	0.01
USD	BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.75000% 17-20.09.29	4 067 000.00	4 262 216.00	0.08
USD	BANCO BRADESCO SA/CAYMAN ISLANDS-REG-S 4.37500% 22-18.03.27	2 814 000.00	2 866 368.54	0.05
USD	BANCO BTG PACTUAL SA/CAYMAN-REG-S 4.50000% 19-10.01.25	711 000.00	715 577.06	0.01
USD	BANCO BTG PACTUAL SA/CAY IS-REG-S 2.75000% 21-11.01.26	1 637 000.00	1 537 552.25	0.03
USD	BANCO CONTINENTAL SAECA-REG-S 2.75000% 20-10.12.25	4 304 000.00	4 139 372.00	0.08
USD	BANCO DE BOGOTA SA-REG-S-SUB 5.37500% 13-19.02.23	850 000.00	869 868.75	0.02
USD	BANCO DE BOGOTA SA-REG-S-SUB 6.25000% 16-12.05.26	24 585 000.00	26 075 465.62	0.48

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

2022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 BANCO DE BOGOTA SA-REG-S 4.37500% 17-03.08.27	437 000.00	436 803.35	0.01
USD BANCO DE CHILE-REG-S 2.99000% 21-09.12.31	370 000.00	357 975.00	0.01
USD BANCO DEL ESTADO DE CHILE-REG-S 3.87500% 12-08.02.22	430 000.00	430 430.00	0.01
USD BANCO DO BRASIL SA/CAYMAN-REG-S 3.25000% 21-30.09.26	3 383 000.00	3 286 373.06	0.06
USD BANCO DO BRASIL SA/CAYMAN-REG-S 4.87500% 22-11.01.29	2 883 000.00	2 919 037.50	0.05
USD BANCO GENERAL SA-REG-S 4.12500% 17-07.08.27	1 834 000.00	1 924 324.50	0.04
USD BANCO INBURSA SA-REG-S 4.37500% 17-11.04.27	855 000.00	896 296.50	0.02
USD BANCO INTL PERU-REG-S 3.25000% 19-04.10.26	1 709 000.00	1 729 080.75	0.03
USD BANCO NACIONAL DE COM EXTER SNC-REG-S 4.37500% 15-14.10.25	850 000.00	916 831.25	0.02
USD BANCO NACIONAL DE PANAMA-144A 2.50000% 20-11.08.30	920 000.00	828 579.60	0.02
USD BANCO NACIONAL DE PANAMA-REG-S 2.50000% 20-11.08.30	3 442 000.00	3 099 968.46	0.06
USD BANCO SANTANDER CHILE SA-REG-S 3.17700% 21-26.10.31	1 620 000.00	1 602 261.00	0.03
USD BANCO SANTANDER SA-REG-S 5.37500% 20-17.04.25	795 000.00	857 606.25	0.02
USD BANCOCOLMBIA SA 3.00000% 20-29.01.25	710 000.00	695 711.25	0.01
USD BANQUE OUEST AFRICAINE DE DEV-REG-S 5.00000% 17-27.07.27	4 141 000.00	4 474 640.37	0.08
USD BANQUE OUEST AFRICAINE DE DEV-REG-S 4.70000% 19-22.10.31	3 379 000.00	3 634 452.40	0.07
USD BBVA BANCOMER SA/TEXAS-REG-S-SUB 6.75000% 12-30.09.22	3 520 000.00	3 629 120.00	0.07
USD BECLE SAB DE CV-REG-S 2.50000% 21-14.10.31	1 670 000.00	1 571 002.40	0.03
USD BELARUS INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.87500% 17-28.02.23	3 420 000.00	3 231 900.00	0.06
USD BELARUS INTERNATIONAL BOND-REG-S 7.62500% 17-29.06.27	493 000.00	423 240.50	0.01
USD BELARUS, REPUBLIC OF-REG-S 6.37800% 20-24.02.31	2 225 000.00	1 618 687.50	0.03
USD BERMUDA, GOVERNMENT OF-REG-S 3.71700% 16-25.01.27	2 307 000.00	2 428 550.06	0.04
USD BERMUDA, GOVERNMENT OF-REG-S 2.37500% 20-20.08.30	1 653 000.00	1 607 335.88	0.03
USD BERMUDA, GOVERNMENT OF-REG-S 3.37500% 20-20.08.50	3 345 000.00	3 230 642.81	0.06
USD BHARTI AIRTEL LTD-REG-S 4.37500% 15-10.06.25	2 249 000.00	2 359 763.25	0.04
USD BHARTI AIRTEL LTD-REG-S 3.25000% 21-03.06.31	1 462 000.00	1 440 026.14	0.03
USD BIDVEST GROUP UK PLC/THE-REG-S 3.62500% 21-23.09.26	6 173 000.00	6 072 812.21	0.11
USD BMF BOVESPA SA-REG-S 4.12500% 21-20.09.31	3 000 000.00	2 774 625.00	0.05
USD BOLIVIA, REPUBLIC OF-REG-S 4.50000% 17-20.03.28	200 000.00	175 350.00	0.00
USD BRASKEM AMERICA FINANCE CO-REG-S 7.12500% 11-22.07.41	210 000.00	252 761.25	0.00
USD BRASKEM IDESA SAPI-REG-S 7.45000% 19-15.11.29	500 000.00	510 752.50	0.01
USD BRASKEM IDESA SAPI-REG-S 6.99000% 21-20.02.32	10 896 000.00	10 759 800.00	0.20
USD BRASKEM NETHERLANDS FINANCE BV-REG-S 4.50000% 17-10.01.28	1 315 000.00	1 356 258.13	0.02
USD BRASKEM NETHERLANDS FINANCE BV-REG-S 4.50000% 19-31.01.30	7 370 000.00	7 485 156.25	0.14
USD BRASKEM NETHERLANDS FINANCE BV-REG-S 5.87500% 19-31.01.50	755 000.00	818 372.81	0.01
USD BRAZIL LOAN TRUST 1-REG-S 5.47700% 13-24.07.23	2 920 000.00	704 880.39	0.01
USD BRAZIL, FEDERAL REPUBLIC OF 3.87500% 20-12.06.30	3 484 000.00	3 274 524.50	0.06
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 5.62500% 09-07.01.41	320 000.00	313 060.00	0.01
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 4.25000% 13-07.01.25	5 000 000.00	5 260 312.50	0.10
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 4.62500% 17-13.01.28	10 701 000.00	10 950 467.06	0.20
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 4.75000% 19-14.01.50	313 000.00	263 565.56	0.00
USD BRAZIL, REPUBLIC OF 3.75000% 21-12.09.31	6 070 000.00	5 529 769.99	0.10
USD BRF SA-REG-S 4.87500% 19-24.01.30	6 712 000.00	6 597 896.00	0.12
USD BRF SA-REG-S 5.75000% 20-21.09.50	2 600 000.00	2 442 862.51	0.04
USD CA MAGNUM HOLDINGS-REG-S 5.37500% 21-31.10.26	1 040 000.00	1 061 008.00	0.02
USD CABLE ONDA SA-REG-S 4.50000% 19-30.01.30	7 425 000.00	7 540 087.50	0.14
USD CANACOL ENERGY LTD-REG-S 5.75000% 21-24.11.28	1 856 000.00	1 801 248.00	0.03
USD CBQ FINANCE LTD-REG-S 2.00000% 20-15.09.25	1 212 000.00	1 193 820.00	0.02
USD CEMEX SAB DE CV-REG-S 5.45000% 19-19.11.29	880 000.00	915 200.00	0.02
USD CEMEX SAB DE CV-REG-S 7.37500% 20-05.06.27	1 400 000.00	1 522 360.00	0.03
USD CEMEX SAV DE CV-REG-S 5.20000% 20-17.09.30	1 290 000.00	1 328 700.00	0.02
USD CEMEX SAV DE CV-REG-S 3.87500% 21-11.07.31	1 800 000.00	1 700 460.00	0.03
USD CEMIG GERACAO E TRANSMISSAO SA-REG-S 9.25000% 17-05.12.24	2 288 000.00	2 534 389.00	0.05
USD CENCOSUD SA-144A 6.62500% 15-12.02.45	400 000.00	500 950.00	0.01
USD CENCOSUD SA-REG-S 4.37500% 17-17.07.27	1 220 000.00	1 281 610.00	0.02
USD CENCOSUD SA-REG-S 6.62500% 15-12.02.45	1 886 000.00	2 361 979.24	0.04
USD CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA-REG-S 3.62500% 20-04.02.25	1 190 000.00	1 188 363.75	0.02
USD CENTRAL AMERICAN BOTTLING CORP-REG-S 5.25000% 22-27.04.29	16 941 000.00	17 195 115.00	0.31

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

2022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 CHINA REAL ESTATE-REG-S 7.25000% 19-24.04.23	200 000.00	118 040.00	0.00
USD CERRO DEL AGUILA SA-REG-S 4.12500% 17-16.08.27	4 606 000.00	4 677 393.00	0.09
USD CHAMPION PATH HOLDINGS-REG-S 4.50000% 21-27.01.26	459 000.00	407 362.50	0.01
USD CHAMPION PATH HOLDINGS-REG-S 4.85000% 21-27.01.28	2 180 000.00	1 874 527.49	0.03
USD CHILE, REPUBLIC OF 2.55000% 21-27.07.33	8 620 000.00	8 055 390.00	0.15
USD CHILE, REPUBLIC OF 2.75000% 22-31.01.27	4 767 000.00	4 824 204.00	0.09
USD CHILE, REPUBLIC OF 3.24000% 18-06.02.28	353 000.00	364 428.38	0.01
USD CHILE, REPUBLIC OF 3.50000% 19-25.01.50	7 374 000.00	7 078 118.25	0.13
USD CHILE, REPUBLIC OF 3.10000% 21-22.01.61	1 589 000.00	1 368 824.20	0.03
USD CHILE, REPUBLIC OF 3.10000% 21-07.05.41	734 000.00	678 950.00	0.01
USD CHILE, REPUBLIC OF 3.25000% 21-21.09.71	1 550 000.00	1 325 250.00	0.02
USD CHILE, REPUBLIC OF 3.50000% 22-31.01.34	6 253 000.00	6 353 048.00	0.12
USD CHILE, REPUBLIC OF 4.00000% 22-31.01.52	2 758 000.00	2 826 950.00	0.05
USD CHINA AOYUAN GROUP LTD-REG-S 5.98000% 20-18.08.25	770 000.00	130 900.00	0.00
USD CHINA EVERGRANDE GROUP-REG-S 9.50000% 19-11.04.22	6 070 000.00	1 001 550.00	0.02
USD CHINA HONGQIAO GROUP LTD-REG-S 6.25000% 21-08.06.24	667 000.00	655 327.50	0.01
USD CIA DE MINAS BUENAVENTURA SAA-REG-S 5.50000% 21-23.07.26	605 000.00	599 933.12	0.01
USD CIA GENERAL DE COMBUSTIBLES SA-REG-S 9.50000% 20-08.03.25	2 454 000.00	2 360 441.25	0.04
USD CIBANCO SA INST DE BANCA MUTI TRS-REG-S 4.37500% 21-22.07.31	5 182 000.00	4 838 044.75	0.09
USD CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD-REG-S 6.00000% 20-16.07.25	1 982 000.00	1 749 115.00	0.03
USD CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD-REG-S 5.95000% 20-20.10.25	1 250 000.00	1 093 750.00	0.02
USD CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD REG-S 4.37500% 21-12.04.27	1 980 000.00	1 643 400.00	0.03
USD CIKARANG LISTRINDO TBK PT-REG-S 4.95000% 16-14.09.26	2 080 000.00	2 094 690.00	0.04
USD CIMPOR FINANCIAL OPERATIONS BV-REG-S 5.75000% 14-17.07.24	2 289 000.00	1 991 430.00	0.04
USD CLEAN RENEWABLE POWER MAURITIUS-REG-S 4.25000% 21-25.03.27	820 000.00	806 060.00	0.01
USD CLIFFTON LTD-REG-S 6.25000% 21-25.10.25	1 080 000.00	1 036 800.00	0.02
USD CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 5.12500% 18-14.03.28	1 350 000.00	1 501 956.00	0.03
USD CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 3.87500% 19-19.06.29	1 590 000.00	1 657 972.50	0.03
USD CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 3.00000% 20-22.09.30	740 000.00	721 818.20	0.01
USD COCA-COLA ICECEK AS-REG-S 4.21500% 17-19.09.24	5 910 000.00	6 040 389.37	0.11
USD COCA-COLA ICECEK AS-REG-S 4.50000% 22-20.01.29	2 970 000.00	2 973 712.50	0.05
USD COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.25000% 21-22.04.32	4 985 000.00	4 262 175.00	0.08
USD COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.12500% 21-22.02.42	1 330 000.00	1 049 370.00	0.02
USD COLOMBIA TELECOMUNICACIONES SA-REG-S 4.95000% 20-17.07.30	4 439 000.00	4 222 598.75	0.08
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 3.87500% 17-25.04.27	4 664 000.00	4 578 882.00	0.08
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 4.50000% 18-15.03.29	9 364 000.00	9 193 107.00	0.17
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 5.20000% 19-15.05.49	15 863 000.00	13 664 983.06	0.25
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 3.00000% 20-30.01.30	7 946 000.00	6 926 925.50	0.13
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 3.12500% 20-15.04.31	26 946 000.00	23 094 406.13	0.42
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 4.12500% 20-15.05.51	4 631 000.00	3 511 745.18	0.06
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 3.87500% 21-15.02.61	2 450 000.00	1 779 006.25	0.03
USD COMETA ENERGIA SA DE CV-REG-S 6.37500% 18-24.04.35	7 327 000.00	7 229 202.86	0.13
USD COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD-REG-S 4.75000% 16-23.02.27	920 000.00	998 200.00	0.02
USD COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD-REG-S 3.34800% 21-09.02.31	4 525 000.00	4 217 582.81	0.08
USD COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD-REG-S 4.67700% 21-09.02.51	2 073 000.00	1 829 163.37	0.03
USD COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD-REG-S 4.87500% 13-15.01.24	686 000.00	718 585.00	0.01
USD COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD-REG-S 3.87500% 21-26.07.33	648 000.00	602 964.00	0.01
USD CONSORCIO TRANSMANTARO-REG-S 4.37500% 13-07.05.23	690 000.00	705 007.50	0.01
USD CONSORCIO TRANSMANTARO-REG-S 4.70000% 19-16.04.34	4 930 000.00	5 299 750.00	0.10
USD CONTINUUM ENERGY LEVAN PTE LTD-REG-S 4.50000% 21-09.02.27	3 180 000.00	3 120 643.30	0.06
USD CONTROLADORA MABE SA DE CV-REG-S 5.60000% 18-23.10.28	1 670 000.00	1 872 800.63	0.03
USD CORP FINANCIERA DE DESARROLLO SA-REG-S 4.75000% 15-15.07.25	1 545 000.00	1 650 060.00	0.03
USD CORP FINANCIERA DE DESARROLLO SA-REG-S 2.40000% 20-28.09.27	2 830 000.00	2 706 187.50	0.05
USD CORP INMOBILIARIA VESTA SAB DE-REG-S 3.62500% 21-13.05.31	1 085 000.00	1 047 025.00	0.02
USD CORP LINDLEY SA-REG-S 4.62500% 13-12.04.23	1 943 000.00	1 478 471.21	0.03
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 4.50000% 17-01.08.47	247 000.00	265 802.87	0.00
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 4.37500% 19-05.02.49	507 000.00	537 198.19	0.01
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 3.00000% 19-30.09.29	1 715 000.00	1 690 668.44	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

2022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 CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 3.70000% 19-30.01.50	2 527 000.00	2 391 647.56	0.04
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 3.15000% 20-14.01.30	4 561 000.00	4 523 371.75	0.08
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 3.75000% 20-15.01.31	864 000.00	898 560.00	0.02
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 3.15000% 20-15.01.51	311 000.00	269 170.50	0.00
USD COSAN LTD-REG-S 5.50000% 19-20.09.29	1 111 000.00	1 142 455.19	0.02
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 4.37500% 13-30.04.25	1 700 000.00	1 714 662.50	0.03
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 5.62500% 13-30.04.43	2 717 000.00	2 207 222.88	0.04
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 7.00000% 14-04.04.44	3 019 000.00	2 794 084.50	0.05
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 7.15800% 15-12.03.45	6 681 000.00	6 268 865.81	0.11
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 6.12500% 19-19.02.31	7 086 000.00	6 923 464.86	0.13
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 7.25000% 19-08.04.26	550 000.00	482 625.00	0.01
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 3.30000% 21-12.01.31	3 019 000.00	2 309 535.00	0.04
USD CREDICORP LTD-REG-S 2.75000% 20-17.06.25	3 246 000.00	3 247 623.00	0.06
USD CREDIT BK MOSCOW/CBOM FIN-REG-S 4.70000% 20-29.01.25	2 218 000.00	2 029 192.75	0.04
USD CREDIT BK MOSCOW/CBOM FINANCE-REG-S 3.87500% 21-21.09.26	1 705 000.00	1 383 181.25	0.03
USD CROATIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.50000% 13-04.04.23	10 925 000.00	11 416 625.00	0.21
USD CSN ISLANDS XI CORP-REG-S 6.75000% 20-28.01.28	2 711 000.00	2 831 341.29	0.05
USD CSN RESOURCES SA-REG-S 4.62500% 21-10.06.31	3 143 000.00	2 967 777.75	0.05
USD DAE FUNDING LLC-REG-S 2.62500% 21-20.03.25	3 157 000.00	3 125 035.37	0.06
USD DAE FUNDING LLC-REG-S 3.37500% 21-20.03.28	3 385 000.00	3 338 456.25	0.06
USD DEBT AND ASSET TRADING CORP-REG-S 1.00000% 13-10.10.25	4 570 000.00	4 152 416.25	0.08
USD DEVELOPMENT BANK OF KAZAKHSTAN-REG-S 4.12500% 12-10.12.22	1 255 000.00	1 268 569.69	0.02
USD DEVELOPMENT BANK OF KAZAKHSTAN-REG-S 2.95000% 21-06.05.31	1 308 000.00	1 222 980.00	0.02
USD DNO ASA-144A-REG-S 7.87500% 21-09.09.26	3 118 000.00	3 203 745.00	0.06
USD DOMINICAN REPUBLIC INT BOND-REG-S 4.87500% 20-23.09.32	29 474 000.00	28 917 678.25	0.53
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 5.50000% 15-27.01.25	2 135 000.00	2 273 775.00	0.04
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.85000% 15-27.01.45	5 355 000.00	5 622 080.62	0.10
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.87500% 16-29.01.26	10 622 000.00	11 949 750.00	0.22
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 5.95000% 17-25.01.27	2 915 000.00	3 188 281.25	0.06
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.50000% 18-15.02.48	4 385 000.00	4 424 190.93	0.08
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.00000% 18-19.07.28	6 236 000.00	6 810 101.77	0.12
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.40000% 19-05.06.49	2 538 000.00	2 535 303.37	0.05
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 4.50000% 20-30.01.30	20 012 000.00	19 615 512.26	0.36
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 5.87500% 20-30.01.60	23 528 000.00	21 297 251.50	0.39
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 5.30000% 21-21.01.41	5 113 000.00	4 867 895.56	0.09
USD E.CL SA-REG-S 4.50000% 14-29.01.25	2 995 000.00	3 122 287.50	0.06
USD EASY TACTIC LTD-REG-S 8.12500% 19-11.07.24	210 000.00	71 442.00	0.00
USD ECOPETROL SA 4.62500% 21-02.11.31	2 869 000.00	2 638 848.82	0.05
USD ECOPETROL SA 5.87500% 13-18.09.23	3 450 000.00	3 622 500.00	0.07
USD ECOPETROL SA 6.87500% 20-29.04.30	6 305 000.00	6 758 960.00	0.12
USD ECUADOR GOVT INTERNATIONAL BD-REG-S STEP-UP/DOWN 20-31.07.35	65 842 967.00	46 102 422.46	0.84
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S STEP-UP 0.50000% 20-31.07.30	13 359 171.00	11 633 333.10	0.21
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S STEP-UP 20-31.07.40	19 408 432.00	11 860 978.01	0.22
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.90300% 18-21.02.48	13 972 000.00	11 125 205.00	0.20
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 6.58800% 18-21.02.28	263 000.00	247 877.50	0.00
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.62500% 20-29.05.32	8 443 000.00	7 577 592.50	0.14
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 8.87500% 20-29.05.50	5 306 000.00	4 536 630.00	0.08
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 20-06.10.25	4 685 000.00	4 620 581.25	0.08
USD EHI CAR SERVICES LTD-REG-S 7.00000% 21-21.09.26	360 000.00	306 900.00	0.01
USD EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 7.75000% 02-24.01.23	4 374 000.00	3 448 078.88	0.06
USD EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 7.62500% 11-01.02.41	2 315 000.00	1 226 660.63	0.02
USD EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 5.87500% 12-30.01.25	1 830 000.00	1 075 468.13	0.02
USD EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 6.37500% 14-18.01.27	3 300 000.00	1 842 431.25	0.03
USD EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 8.62500% 17-28.02.29	5 480 000.00	3 155 452.49	0.06
USD EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 7.12460% 19-20.01.50	4 562 000.00	2 367 392.87	0.04
USD EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 9.50000% 20-15.07.52	13 273 000.00	7 675 941.82	0.14
USD EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 8.25000% 02-10.04.32	613 000.00	354 697.13	0.01
USD ELECTRICIDAD FIRME DE MEXICO-REG-S 4.90000% 21-20.11.26	2 275 000.00	2 222 390.63	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

2022年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD EMBRAER NETHERLANDS FINANCE BV 5.40000% 17-01.02.27	1 951 000.00	1 996 116.88	0.04
USD EMBRAER NETHERLANDS FINANCE BV-REG-S 6.95000% 20-17.01.28	2 079 000.00	2 247 918.75	0.04
USD EMBRAER OVERSEAS LTD-REG-S 5.69600% 13-16.09.23	231 000.00	241 077.38	0.00
USD EMPRESA DE L FERROCARRILE DEL EST-REG-S 3.06800% 20-18.08.50	1 194 000.00	950 573.25	0.02
USD EMPRESA DE LOS FERROCARRILES DEL-REG-S 3.83000% 21-14.09.61	1 710 000.00	1 519 548.75	0.03
USD EMPRESA DE TRANSMISION ELECTRICA-REG-S 5.12500% 19-02.05.49	3 890 000.00	4 145 281.25	0.08
USD EMPRESA DE TRANSPORTE DE PASA MET-REG-S 5.00000% 17-25.01.47	200 000.00	220 412.50	0.00
USD EMPRESA DE TRANSPORTE DE PASA MET-REG-S 3.65000% 20-07.05.30	2 370 000.00	2 465 985.00	0.05
USD EMPRESA DE TRANSPORTE DE PASA MET-REG-S 4.70000% 20-07.05.50	2 424 000.00	2 657 916.00	0.05
USD EMPRESA GENERADORA DE ELECTRICID-REG-S 5.62500% 21-08.11.28	2 913 000.00	2 895 522.00	0.05
USD EMPRESA NACIONAL DE TELECOM-REG-S 4.75000% 14-01.08.26	5 345 000.00	5 655 010.00	0.10
USD EMPRESA NACIONAL DE TELECOM SA-REG-S 3.05000% 21-14.09.32	1 598 000.00	1 507 413.38	0.03
USD EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO-REG-S 3.75000% 16-05.08.26	3 157 000.00	3 202 973.82	0.06
USD EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO-REG-S 4.50000% 17-14.09.47	1 693 000.00	1 509 944.38	0.03
USD EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO-REG-S 5.25000% 18-06.11.29	10 318 000.00	10 846 797.50	0.20
USD EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO-REG-S 3.45000% 21-16.09.31	1 974 000.00	1 797 327.00	0.03
USD EMPRESAS PUBLICAS DE MEDELLIN ESP-REG-S 4.25000% 19-18.07.29	15 518 000.00	14 197 030.25	0.26
USD EMPRESAS PUBLICAS DE MEDELLIN ESP-REG-S 4.37500% 20-15.02.31	340 000.00	308 401.25	0.01
USD ENDEAVOUR MINING PLC-REG-S 5.00000% 21-14.10.26	1 501 000.00	1 455 970.00	0.03
USD ENEL CHILE SA 4.87500% 18-12.06.28	1 077 000.00	1 172 112.56	0.02
USD ENERGEAN PLC-REG-S 6.50000% 21-30.04.27	5 025 000.00	4 878 646.88	0.09
USD ENERGUATE TRUST-REG-S 5.87500% 17-03.05.27	4 375 000.00	4 459 218.75	0.08
USD ENERSIS AMERICAS SA 4.00000% 16-25.10.26	2 770 000.00	2 909 954.25	0.05
USD ENGIE ENERGIA CHILE SA-REG-S 3.40000% 20-28.01.30	1 000 000.00	976 600.00	0.02
USD ENN CLEAN ENERGY INTERNAT INVEST-REG-S 3.37500% 21-12.05.26	4 264 000.00	4 194 454.16	0.08
USD ENN ENERGY HOLDINGS LTD-REG-S 2.62500% 20-17.09.30	8 765 000.00	8 503 693.43	0.16
USD ESKOM HOLDINGS SOC LTD-REG-S 6.75000% 13-06.08.23	2 370 000.00	2 394 885.00	0.04
USD ESKOM HOLDINGS SOC LTD-REG-S 7.12500% 15-11.02.25	1 950 000.00	1 972 303.13	0.04
USD EUROTORG LLC VIA BONITRON DAC-REG-S 9.00000% 20-22.10.25	900 000.00	900 000.00	0.02
USD EVRAZ PLC-REG-S 5.37500% 17-20.03.23	500 000.00	509 468.75	0.01
USD EXPORT CREDIT BANK OF TURKEY-REG-S 5.37500% 16-24.10.23	8 764 000.00	8 699 913.25	0.16
USD EXPORT CREDIT BANK OF TURKEY-REG-S 6.12500% 18-03.05.24	1 230 000.00	1 223 850.00	0.02
USD FALABELLA SA-REG-S 3.37500% 21-15.01.32	4 543 000.00	4 395 352.50	0.08
USD FANTASIA HOLDINGS GROUP CO LTD-REG-S 10.87500% 20-09.01.23	870 000.00	178 350.00	0.00
USD FANTASIA HOLDINGS GROUP CO LTD-REG-S 11.87500% 20-01.06.23	3 955 000.00	810 775.00	0.01
USD FBN VIA FINANCE CO BV-REG-S 8.62500% 20-27.10.25	3 980 000.00	4 164 075.00	0.08
USD FENIX POWER PERU SA-REG-S 4.31700% 17-20.09.27	1 160 000.00	969 371.48	0.02
USD FIRST QUANTUM MINERALS LTD-REG-S 7.25000% 17-01.04.23	698 000.00	703 671.25	0.01
USD FIRST QUANTUM MINERALS LTD-REG-S 7.50000% 17-01.04.25	570 000.00	582 825.00	0.01
USD FORTUNE STAR BVI LTD-REG-S 6.75000% 19-02.07.23	1 020 000.00	1 015 104.00	0.02
USD FORTUNE STAR BVI LTD-REG-S 6.85000% 20-02.07.24	318 000.00	316 410.00	0.01
USD FORTUNE STAR BVI LTD-REG-S 5.00000% 21-18.05.26	3 561 000.00	3 258 315.00	0.06
USD FRANSION BRILLIANT LTD-REG-S 4.25000% 19-23.07.29	1 886 000.00	1 744 903.62	0.03
USD FRESNILLO PLC-REG-S 4.25000% 20-02.10.50	390 000.00	378 616.87	0.01
USD FS LUXEMBOURG SARL-REG-S 10.00000% 20-15.12.25	1 642 000.00	1 748 730.00	0.03
USD FUTURE RETAIL LTD-REG-S 5.60000% 20-22.01.25	350 000.00	200 774.00	0.00
USD FWD GROUP LTD-REG-S-SUB 5.75000% 19-09.07.24	1 800 000.00	1 844 292.96	0.03
USD GABON, REPUBLIC OF-REG-S 6.62500% 20-06.02.31	10 955 000.00	10 590 746.25	0.19
USD GABON, REPUBLIC OF-REG-S 7.00000% 21-24.11.31	3 445 000.00	3 363 181.25	0.06
USD GALAXY PIPELINE ASSETS BIDCO LTD-REG-S 2.94000% 21-30.09.40	4 169 000.00	3 968 888.00	0.07
USD GENM CAPITAL LABUAN LTD-REG-S 3.88200% 21-19.04.31	2 960 000.00	2 747 805.00	0.05
USD GEOPARK LTD-REG-S 5.50000% 20-17.01.27	3 430 000.00	3 224 200.00	0.06
USD GEOPARK LTD-REG-S 6.50000% 17-21.09.24	214 000.00	218 654.50	0.00
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 7.62500% 18-16.05.29	14 526 000.00	11 330 280.00	0.21
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 8.62700% 18-16.06.49	450 000.00	334 125.00	0.01
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 6.37500% 20-11.02.27	3 011 000.00	2 401 272.50	0.04
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 8.62500% 21-07.04.34	5 467 000.00	4 141 252.50	0.08
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 8.87500% 21-07.05.42	4 283 000.00	3 190 835.00	0.06

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2022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 GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 7.75000% 21-07.04.29	5 080 000.00	3 975 100.00	0.07
USD GLOBAL PRIME CAPITAL PTE LTD-REG-S 5.95000% 20-23.01.25	360 000.00	361 800.00	0.01
USD GLOBO COMUNICACAO E PARTICIPACOES-REG-S 5.50000% 22-14.01.32	300 000.00	288 180.00	0.01
USD GNL QUINTERO SA-REG-S 4.63400% 14-31.07.29	5 815 000.00	5 684 475.64	0.10
USD GOL FINANCE SA-REG-S 7.00000% 17-31.01.25	3 040 000.00	2 619 188.00	0.05
USD GOLD FIELDS OROGEN HOLDINGS-REG-S 6.12500% 19-15.05.29	4 675 000.00	5 214 962.50	0.10
USD GREENKO MAURITIUS LTD-REG-S 6.25000% 19-21.02.23	5 539 000.00	5 588 574.05	0.10
USD GROWTHPOINT PROPERTIES INT PTY-REG-S 5.87200% 18-02.05.23	840 000.00	863 257.50	0.02
USD GRUMA SA DE CV-REG-S 4.87500% 14-01.12.24	6 727 000.00	7 207 560.06	0.13
USD GRUPO AVAL LTD-REG-S 4.75000% 12-26.09.22	3 610 000.00	3 643 392.50	0.07
USD GRUPO AVAL LTD-REG-S 4.37500% 20-04.02.30	2 425 000.00	2 267 829.68	0.04
USD GRUPO BIMBO SA DE CV-REG-S 4.00000% 19-06.09.49	490 000.00	507 241.88	0.01
USD GRUPO BIMBO SAB DE CV-REG-S 4.70000% 17-10.11.47	200 000.00	228 662.50	0.00
USD GTLK EUROPE CAPITAL DAC-REG-S 4.34900% 21-27.02.29	2 160 000.00	1 851 255.00	0.03
USD GTLK EUROPE CAPITAL DAC-REG-S 4.94900% 19-18.02.26	2 909 000.00	2 748 641.38	0.05
USD GUARA NORTE SARL-REG-S 5.19800% 21-15.06.34	3 889 000.00	3 486 295.00	0.06
USD GUATEMALA GOVERNMENT BOND-REG-S 4.65000% 21-07.10.41	2 392 000.00	2 307 233.50	0.04
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 4.50000% 16-03.05.26	4 871 000.00	5 019 565.50	0.09
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 4.37500% 17-05.06.27	788 000.00	808 586.50	0.01
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 4.90000% 19-01.06.30	7 440 000.00	7 780 845.01	0.14
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 6.12500% 19-01.06.50	3 952 000.00	4 313 361.00	0.08
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 5.37500% 20-24.04.32	946 000.00	1 020 083.63	0.02
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 3.70000% 21-07.10.33	1 026 000.00	971 686.13	0.02
USD GUSAP III-REG-S 4.25000% 19-21.01.30	1 820 000.00	1 880 651.50	0.03
USD HKT CAPITAL NO 6 LTD-REG-S 3.00000% 22-18.01.32	500 000.00	493 050.00	0.01
USD HONDURAS, REPUBLIC OF-REG-S 6.25000% 17-19.01.27	2 525 000.00	2 519 160.93	0.05
USD HONDURAS, REPUBLIC OF-REG-S 5.62500% 20-24.06.30	2 717 000.00	2 647 886.31	0.05
USD HONDURAS, REPUBLIC OF-REG-S 7.50000% 13-15.03.24	4 560 000.00	4 609 305.00	0.08
USD HONG KONG AIRPORT AUTHORITY-REG-S 2.50000% 22-12.01.32	2 965 000.00	2 948 892.93	0.05
USD HPHT FINANCE 21 LTD-REG-S 2.00000% 21-19.03.26	1 583 000.00	1 557 956.94	0.03
USD HTA GROUP LTD/MAURITIUS-REG-S 7.00000% 20-18.12.25	8 048 000.00	8 373 622.08	0.15
USD HUARONG FINANCE 2017 CO-REG-S 4.75000% 17-27.04.27	1 510 000.00	1 521 325.00	0.03
USD HUNGARY, REPUBLIC OF 5.75000% 13-22.11.23	1 568 000.00	1 684 762.69	0.03
USD HUNGARY, REPUBLIC OF 5.37500% 14-25.03.24	1 024 000.00	1 099 822.49	0.02
USD HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 2.12500% 21-22.09.31	387 000.00	366 210.33	0.01
USD HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 3.12500% 21-21.09.51	4 868 000.00	4 528 152.75	0.08
USD HUNT OIL CO OF PERU LLC SUCUAL DL-REG-S 6.37500% 18-01.06.28	3 260 000.00	3 104 731.90	0.06
USD HYUNDAI CAPITAL AMERICA-REG-S 2.75000% 16-27.09.26	854 000.00	855 988.73	0.02
USD HYUNDAI CAPITAL AMERICA-REG-S 3.50000% 19-02.11.26	2 254 000.00	2 340 527.17	0.04
USD ICL GROUP LTD-144A-REG-S 6.37500% 18-31.05.38	1 265 000.00	1 567 018.75	0.03
USD IHS NETHERLANDS HOLDCO BV-REG-S 8.00000% 19-18.09.27	5 118 000.00	5 386 695.00	0.10
USD INDIA GREEN POWER HOLDINGS-REG-S 4.00000% 21-22.02.27	4 519 000.00	4 366 709.70	0.08
USD INDIKA ENERGY CAPITAL IV PTE LTD-REG-S 8.25000% 20-22.10.25	990 000.00	990 000.00	0.02
USD INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT-REG-S 4.74500% 21-09.06.51	820 000.00	770 890.20	0.01
USD INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT-REG-S 3.39800% 21-09.06.31	3 594 000.00	3 423 680.34	0.06
USD INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT-REG-S 3.54100% 21-27.04.32	2 200 000.00	2 095 742.00	0.04
USD INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT-REG-S 4.80500% 21-27.04.52	1 110 000.00	1 043 522.10	0.02
USD INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM TBK PT-REG-S 5.71000% 18-15.11.23	692 000.00	730 622.25	0.01
USD INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM TBK PT-REG-S 6.53000% 18-15.11.28	2 189 000.00	2 532 809.81	0.05
USD INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM TBK PT-REG-S 6.75700% 18-15.11.48	2 919 000.00	3 423 074.82	0.06
USD INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM TBK PT-REG-S 4.75000% 20-15.05.25	2 183 000.00	2 276 017.63	0.04
USD INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM TBK PT-REG-S 5.45000% 20-15.05.30	1 288 000.00	1 405 369.00	0.03
USD INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM TBK PT-REG-S 5.80000% 20-15.05.50	1 059 000.00	1 120 422.00	0.02
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 3.35000% 21-12.03.71	390 000.00	343 242.90	0.01
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 3.20000% 21-23.09.61	690 000.00	602 100.90	0.01
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 7.75000% 08-17.01.38	2 063 000.00	2 977 553.68	0.05
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 12-17.01.42	9 039 000.00	10 588 623.56	0.19
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 16-08.01.47	432 000.00	514 213.92	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

2022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 INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV-REG-S 4.75000% 20-06.08.50	2 184 000.00	2 232 184.50	0.04
USD INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA-REG-S 4.75000% 20-15.01.51	1 260 000.00	1 198 811.25	0.02
USD INKIA ENERGY LTD-REG-S 5.87500% 17-09.11.27	3 498 000.00	3 525 984.00	0.06
USD INRETAIL SHOPPING MALLS-REG-S 5.75000% 18-03.04.28	1 170 000.00	1 196 544.37	0.02
USD INSTITUTO COSTARRICENSE DE ELEC-REG-S 6.37500% 13-15.05.43	540 000.00	439 863.75	0.01
USD INSTITUTO COSTARRICENSE DE ELECT-REG-S 6.75000% 21-07.10.31	1 270 000.00	1 262 697.50	0.02
USD INTERCHILE SA-REG-S 4.50000% 21-30.06.56	3 540 000.00	3 632 482.50	0.07
USD INTERCORP PERU LTD-REG-S 3.87500% 19-15.08.29	1 330 000.00	1 282 036.88	0.02
USD INTERNATIONAL AIRPORT FINANCE SA-REG-S 12.00000% 19-15.03.33	4 465 000.00	4 744 224.14	0.09
USD INVERSIONES CMPC SA-REG-S 3.00000% 21-06.04.31	1 100 000.00	1 038 950.00	0.02
USD INVESTMENT ENERGY RESOURCES LTD-REG-S 6.25000% 21-26.04.29	889 000.00	920 115.00	0.02
USD IOCHPE-MAXION AUSTRIA GMBH / MAXI-REG-S 5.00000% 21-07.05.28	834 000.00	790 215.00	0.01
USD IRSA PROPIEDADES COMERCIALES SA-REG-S 8.75000% 16-23.03.23	1 722 000.00	1 656 671.63	0.03
USD ISRAEL ELECTRIC CORP LTD-144A-REG-S 5.00000% 14-12.11.24	1 642 000.00	1 765 199.26	0.03
USD ISRAEL ELECTRIC CORP LTD-REG-S 6.87500% 13-21.06.23	2 732 000.00	2 925 459.75	0.05
USD IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S STEP-UP 10-31.12.32	1 377 000.00	900 259.80	0.02
USD JAMAICA, GOVERNMENT OF 6.75000% 15-28.04.28	4 150 000.00	4 716 215.63	0.09
USD JAMAICA, GOVERNMENT OF 7.87500% 15-28.07.45	7 936 000.00	10 925 888.00	0.20
USD JD.COM INC 4.12500% 20-14.01.50	1 913 000.00	1 921 780.67	0.04
USD JMH CO LTD-REG-S 2.50000% 21-09.04.31	1 500 000.00	1 449 450.81	0.03
USD JOLLIBEE WORLDWIDE PTE LTD-REG-S 4.75000% 20-24.06.30	2 070 000.00	2 155 387.50	0.04
USD JORDAN, KINGDOM OF-REG-S 6.12500% 15-29.01.26	3 325 000.00	3 500 185.94	0.06
USD JORDAN, KINGDOM OF-REG-S 5.75000% 16-31.01.27	534 000.00	553 624.50	0.01
USD JORDAN, KINGDOM OF-REG-S 5.85000% 20-07.07.30	7 955 000.00	7 855 562.50	0.14
USD JORDAN, KINGDOM OF-REG-S 4.95000% 20-07.07.25	2 870 000.00	2 938 162.50	0.05
USD JSC GEORGIAN RAILWAY-REG-S 4.00000% 21-17.06.28	2 011 000.00	1 970 780.00	0.04
USD JSL EUROPE SA-REG-S 5.20000% 21-26.01.31	1 931 000.00	1 713 521.13	0.03
USD JSM GLOBAL SARL-REG-S 4.75000% 20-20.10.30	1 840 000.00	1 644 500.00	0.03
USD JSW HYDRO ENERGY LTD-REG-S 4.12500% 21-18.05.31	1 558 000.00	1 413 562.50	0.03
USD JSW STEEL LTD-REG-S 3.95000% 21-05.04.27	2 417 000.00	2 317 298.75	0.04
USD KAISA GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 11.50000% 19-30.01.23	1 345 000.00	357 938.13	0.01
USD KAISA GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 11.25000% 20-16.04.25	1 450 000.00	387 875.00	0.01
USD KALLPA GENERACION SA-REG-S 4.87500% 16-24.05.26	735 000.00	772 576.88	0.01
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO-REG-S 4.75000% 17-19.04.27	8 110 000.00	8 605 723.75	0.16
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO-REG-S 5.75000% 17-19.04.47	10 727 000.00	12 014 239.99	0.22
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO-REG-S 6.37500% 18-24.10.48	8 514 000.00	10 131 660.00	0.19
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO-REG-S 5.37500% 18-24.04.30	10 164 000.00	11 250 836.52	0.21
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO JSC-REG-S 3.50000% 20-14.04.33	5 681 000.00	5 558 858.50	0.10
USD KENBOURNE INVEST SA-REG-S 6.87500% 19-26.11.24	5 013 000.00	5 149 403.73	0.09
USD KENYA, REPUBLIC OF-REG-S 7.25000% 18-28.02.28	640 000.00	660 000.00	0.01
USD KENYA, REPUBLIC OF-REG-S 8.25000% 18-28.02.48	5 300 000.00	5 088 000.00	0.09
USD KENYA, REPUBLIC OF-REG-S 8.00000% 19-22.05.32	7 427 000.00	7 761 215.00	0.14
USD KENYA, REPUBLIC OF-REG-S 7.00000% 19-22.05.27	2 200 000.00	2 257 750.00	0.04
USD KENYA, REPUBLIC OF-REG-S 6.30000% 21-23.01.34	3 437 000.00	3 213 595.00	0.06
USD KLABIN AUSTRIA GMBH-REG-S 5.75000% 19-03.04.29	1 480 000.00	1 585 257.60	0.03
USD KLABIN AUSTRIA GMBH-REG-S 7.00000% 19-03.04.49	2 948 000.00	3 210 018.24	0.06
USD KLABIN AUSTRIA GMBH-REG-S 3.20000% 21-12.01.31	2 627 000.00	2 354 790.26	0.04
USD KOC HOLDING AS-REG-S 5.25000% 16-15.03.23	1 537 000.00	1 547 374.75	0.03
USD KOC HOLDING AS-REG-S 6.50000% 19-11.03.25	1 860 000.00	1 911 429.00	0.03
USD KOSMOS ENERGY LTD-144A 7.12500% 19-04.04.26	910 000.00	888 842.50	0.02
USD KOSMOS ENERGY LTD-REG-S 7.12500% 19-04.04.26	3 782 000.00	3 694 068.50	0.07
USD KOSMOS ENERGY LTD-REG-S 7.50000% 21-01.03.28	4 435 000.00	4 235 425.00	0.08
USD KOSMOS ENERGY LTD-REG-S 7.75000% 21-01.05.27	2 048 000.00	2 004 480.00	0.04
USD KSA SUKUK LTD-REG-S 2.25000% 21-17.05.31	2 755 000.00	2 668 906.25	0.05
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S * DEFAULTED * 6.65000% 15-26.02.30	9 630 000.00	999 112.50	0.02
USD LEVIATHAN BOND LTD-144A-REG-S 5.75000% 20-30.06.23	3 600 000.00	3 685 050.00	0.07
USD LEVIATHAN BOND LTD-144A-REG-S 6.75000% 20-30.06.30	5 475 000.00	5 803 500.00	0.11
USD LG CHEM LTD-REG-S 2.37500% 21-07.07.31	3 015 000.00	2 857 797.90	0.05

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2022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 LIQUID TELECOMMUNICATIONS FIN-REG-S 5.50000% 21-04.09.26	3 676 000.00	3 703 570.00	0.07
USD LLPL CAPITAL PTE LTD-REG-S 6.87500% 19-04.02.39	8 230 000.00	8 103 065.41	0.15
USD LUKOIL CAPITAL DAC-REG-S 2.80000% 21-26.04.27	1 970 000.00	1 817 325.00	0.03
USD LUKOIL CAPITAL DAC-REG-S 3.60000% 21-26.10.31	4 888 000.00	4 423 640.00	0.08
USD LUKOIL INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 4.75000% 16-02.11.26	1 990 000.00	2 018 979.38	0.04
USD LUKOIL SECURITIES BV-REG-S 3.87500% 20-06.05.30	4 550 000.00	4 254 250.00	0.08
USD MALDIVES SUKUK ISSUANCE LTD-REG-S 9.87500% 21-08.04.2026	400 000.00	392 044.00	0.01
USD MC BRAZIL DOWNSTREAM TRADING SARL-REG-S 7.25000% 21-30.06.31	2 908 000.00	2 774 232.00	0.05
USD MEDCO BELL PTE LTD-REG-S 6.37500% 20-30.01.27	2 079 000.00	2 016 630.00	0.04
USD MEDCO LAUREL TREE PTE LTD-REG-S 6.95000% 21-12.11.28	3 020 000.00	2 921 850.00	0.05
USD MEDCO OAK TREE PTE LTD-REG-S 7.37500% 19-14.05.26	3 235 000.00	3 287 568.74	0.06
USD MEGAWORLD CORP-REG-S 4.12500% 20-30.07.27	1 030 000.00	1 071 393.13	0.02
USD MEITUAN DIANPING-REG-S 2.12500% 20-28.10.25	5 145 000.00	4 845 972.60	0.09
USD MEITUAN DIANPING-REG-S 3.05000% 20-28.10.30	3 950 000.00	3 460 693.75	0.06
USD MELCO RESORTS FINANCE LTD-REG-S 5.62500% 19-17.07.27	2 738 000.00	2 652 769.62	0.05
USD MELCO RESORTS FINANCE LTD-REG-S 5.37500% 19-04.12.29	700 000.00	659 856.75	0.01
USD MELCO RESORTS FINANCE LTD-REG-S 5.75000% 20-21.07.28	2 826 000.00	2 714 526.17	0.05
USD MERCADOLIBRE INC 3.12500% 21-14.01.31	399 000.00	359 339.40	0.01
USD MERSIN ULUSLARARASI LIMAN-REG-S 5.37500% 19-15.11.24	6 908 000.00	7 008 597.75	0.13
USD METALLOINVEST FINANCE LTD-REG-S 3.37500% 21-22.10.28	2 740 000.00	2 520 800.00	0.05
USD METINVEST BV-144A 7.65000% 20-01.10.27	3 250 000.00	2 799 062.50	0.05
USD METINVEST BV-REG-S 7.65000% 20-01.10.27	600 000.00	516 750.00	0.01
USD METINVEST BV-REG-S 8.50000% 18-23.04.26	6 855 000.00	6 039 255.00	0.11
USD MEXICAN, UNITED STATES OF 4.60000% 15-23.01.46	200 000.00	200 400.00	0.00
USD MEXICHEM SAB DE CV-REG-S 5.87500% 14-17.09.44	3 520 000.00	4 091 560.00	0.07
USD MEXICHEM SAB DE CV-REG-S 5.50000% 17-15.01.48	650 000.00	715 934.38	0.01
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-REG-S 4.25000% 16-31.10.26	4 900 000.00	5 110 700.00	0.09
USD MEXICO GEN DE ENERGIA S DE RL-REG-S 5.50000% 12-06.12.32	2 715 000.00	2 099 819.52	0.04
USD MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.65900% 20-24.05.31	5 571 000.00	5 247 881.99	0.10
USD MEXICO, UNITED STATES OF 6.05000% 08-11.01.40	244 000.00	289 262.00	0.01
USD MEXICO, UNITED STATES OF 5.75000% 10-12.10.110	7 832 000.00	8 497 720.00	0.16
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.35000% 16-15.01.47	1 470 000.00	1 422 960.00	0.03
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.60000% 17-10.02.48	210 000.00	209 685.00	0.00
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.50000% 19-22.04.29	1 000 000.00	1 082 500.00	0.02
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.50000% 19-31.01.50	3 400 000.00	3 364 300.00	0.06
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.75000% 20-27.04.32	2 000 000.00	2 187 000.00	0.04
USD MEXICO, UNITED STATES OF 5.00000% 20-27.04.51	1 850 000.00	1 962 850.00	0.04
USD MEXICO, UNITED STATES OF 3.77100% 20-24.05.61	14 905 000.00	12 728 870.00	0.23
USD MEXICO, UNITED STATES OF 3.50000% 22-12.02.34	1 656 000.00	1 598 868.00	0.03
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.40000% 22-12.02.52	5 654 000.00	5 458 937.00	0.10
USD MGM CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 5.87500% 19-15.05.26	520 000.00	520 812.51	0.01
USD MGM CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 5.25000% 20-18.06.25	700 000.00	694 399.51	0.01
USD MGM CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 4.75000% 21-01.02.27	1 090 000.00	1 043 821.17	0.02
USD MHP LUX SA-REG-S 6.95000% 18-03.04.26	610 000.00	540 536.25	0.01
USD MHP SA-REG-S 7.75000% 17-10.05.24	7 130 000.00	6 453 986.88	0.12
USD MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-REG-S 5.12500% 17-15.01.28	2 101 000.00	1 911 936.26	0.03
USD MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-REG-S 6.25000% 19-25.03.29	3 483 000.00	3 288 104.38	0.06
USD MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-REG-S 4.50000% 20-27.04.31	5 368 000.00	5 202 799.79	0.10
USD MINERVA LUXEMBOURG SA-REG-S 4.37500% 21-18.03.31	2 084 000.00	1 927 700.00	0.04
USD MINSUR SA-REG-S 4.50000% 21-28.10.31	6 770 000.00	6 775 500.64	0.12
USD MONG DUONG FINANCE HOLDINGS BV-REG-S 5.12500% 19-07.05.29	2 510 000.00	2 301 042.50	0.04
USD MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 5.62500% 17-01.05.23	2 963 000.00	3 021 556.28	0.06
USD MOROCCO GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 4.00000% 20-15.12.50	2 455 000.00	2 111 300.00	0.04
USD MOROCCO, KINGDOM OF-REG-S 2.37500% 20-15.12.27	1 850 000.00	1 755 187.50	0.03
USD MOROCCO, KINGDOM OF-REG-S 3.00000% 20-15.12.32	5 255 000.00	4 854 306.25	0.09
USD MOVIDA EUROPE SA-REG-S 5.25000% 21-08.02.31	1 120 000.00	985 810.00	0.02
USD MTN MAURITIUS INVESTMENTS LTD-REG-S 4.75000% 14-11.11.24	5 050 000.00	5 167 728.12	0.09
USD MTN MAURITIUS INVESTMENTS LTD-REG-S 6.50000% 16-13.10.26	7 992 000.00	8 777 713.51	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 - エマージング・マーケット・デッド

2022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 NAGACORP LTD-REG-S 7.95000% 20-06.07.24	1 700 000.00	1 576 537.50	0.03
USD NATIONAL BANK OF UZBEKISTAN-REG-S 4.85000% 20-21.10.25	1 420 000.00	1 378 997.50	0.03
USD NATIONAL CENTRAL COOLING CO-REG-S 2.50000% 20-21.10.27	5 890 000.00	5 654 400.00	0.10
USD NEMAK SAB DE CV-REG-S 3.62500% 21-28.06.31	2 434 000.00	2 248 723.92	0.04
USD NEXA RESOURCES SA-REG-S 6.50000% 20-18.01.28	3 099 000.00	3 337 816.69	0.06
USD NG PET R&P LATIN AMERICA SA-REG-S 3.50000% 21-02.08.28	7 530 000.00	7 273 980.00	0.13
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.87500% 17-16.02.32	3 581 000.00	3 473 570.00	0.06
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.14300% 18-23.02.30	11 700 000.00	11 422 125.00	0.21
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.69600% 18-23.02.38	3 579 000.00	3 221 100.00	0.06
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.62500% 18-21.11.25	1 500 000.00	1 619 999.99	0.03
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 8.74700% 18-21.01.31	4 068 000.00	4 174 785.00	0.08
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 9.24800% 18-21.01.49	2 320 000.00	2 305 500.00	0.04
USD NPC UKRENERGO-REG-S 6.87500% 21-09.11.26	3 196 000.00	2 504 465.50	0.05
USD OCP SA-144A 5.12500% 21-23.06.51	700 000.00	632 450.00	0.01
USD OCP SA-REG-S 3.75000% 21-23.06.31	3 134 000.00	3 008 640.00	0.05
USD OCP SA-REG-S 4.50000% 15-22.10.25	5 420 000.00	5 617 491.25	0.10
USD OCP SA-REG-S 5.12500% 21-23.06.51	6 096 000.00	5 507 736.00	0.10
USD OCP SA-REG-S 6.87500% 14-25.04.44	9 451 000.00	10 536 683.62	0.19
USD OI MOVEL SA-REG-S 8.75000% 21-30.07.26	1 210 000.00	1 237 225.00	0.02
USD OIL AND GAS HOLDING CO BSCC/THE-REG-S 7.62500% 18-07.11.24	3 190 000.00	3 409 312.50	0.06
USD OIL AND GAS HOLDING CO BSCC/THE-REG-S 8.37500% 18-07.11.28	3 791 000.00	4 260 136.25	0.08
USD OLEODUCTO CENTRAL SA-REG-S 4.00000% 20-14.07.27	1 015 000.00	985 108.25	0.02
USD OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 7.00000% 21-25.01.51	7 970 000.00	8 009 850.00	0.15
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 4.75000% 16-15.06.26	4 363 000.00	4 450 260.00	0.08
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.37500% 17-08.03.27	16 273 000.00	16 761 190.00	0.31
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.50000% 17-08.03.47	2 624 000.00	2 496 080.00	0.05
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.62500% 18-17.01.28	7 190 000.00	7 477 600.00	0.14
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.75000% 18-17.01.48	13 205 000.00	12 924 393.75	0.24
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.25000% 21-25.01.31	21 209 000.00	22 534 562.50	0.41
USD ORAZUL ENERGY EGENOR SCA-REG-S 5.62500% 17-28.04.27	2 832 000.00	2 685 090.00	0.05
USD ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV-REG-S 2.87500% 21-11.05.31	1 032 000.00	980 271.00	0.02
USD ORIFLAME INVESTMENT HOLDING PLC-REG-S 5.12500% 21-04.05.26	400 000.00	355 400.00	0.01
USD ORYX FUNDING LTD-REG-S 5.80000% 21-03.02.31	2 798 000.00	2 892 432.50	0.05
USD PAKISTAN WATER & POWER DEVEL AUTH-REG-S 7.50000% 21-04.06.31	1 540 000.00	1 390 019.40	0.03
USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 8.25000% 14-15.04.24	4 572 000.00	4 771 453.50	0.09
USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 8.25000% 15-30.09.25	307 000.00	323 175.06	0.01
USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 6.87500% 17-05.12.27	16 341 000.00	15 848 727.38	0.29
USD PAKUWON JATI TBK PT-REG-S 4.87500% 21-29.04.28	300 000.00	300 866.25	0.01
USD PAMPA ENERGIA SA-REG-S 7.50000% 17-24.01.27	4 299 000.00	3 633 729.75	0.07
USD PAMPA ENERGIA SA-REG-S 7.37500% 16-21.07.23	3 954 000.00	3 771 868.88	0.07
USD PANAMA, REPUBLIC OF 4.50000% 17-15.05.47	470 000.00	484 775.63	0.01
USD PANAMA, REPUBLIC OF 3.87000% 19-23.07.60	4 330 000.00	3 968 174.37	0.07
USD PANAMA, REPUBLIC OF 4.50000% 20-01.04.56	1 180 000.00	1 201 240.00	0.02
USD PANAMA, REPUBLIC OF 2.25200% 20-29.09.32	1 600 000.00	1 461 800.00	0.03
USD PANAMA, REPUBLIC OF 4.50000% 22-19.01.63	970 000.00	980 670.00	0.02
USD PAPUA NEW GUINEA GOVT INTL BOND-REG-S 8.37500% 18-04.10.28	1 819 000.00	1 773 725.09	0.03
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 6.10000% 14-11.08.44	5 710 000.00	6 663 926.87	0.12
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 4.70000% 17-27.03.27	2 117 000.00	2 284 110.69	0.04
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 5.60000% 18-13.03.48	3 770 000.00	4 108 828.76	0.08
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 5.40000% 19-30.03.50	10 849 000.00	11 610 464.19	0.21
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 4.95000% 20-28.04.31	15 146 000.00	16 483 581.13	0.30
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 2.73900% 21-29.01.33	15 149 000.00	13 973 058.87	0.26
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 3.84900% 22-28.06.33	3 250 000.00	3 274 984.38	0.06
USD PERIAMA HOLDINGS LLC/DE-REG-S 5.95000% 20-19.04.26	1 800 000.00	1 858 860.00	0.03
USD PERTAMINA PT-REG-S 5.62500% 13-20.05.43	282 000.00	309 283.50	0.01
USD PERTAMINA PT-REG-S 6.00000% 12-03.05.42	390 000.00	444 916.88	0.01
USD PERU LNG SRL-REG-S 5.37500% 18-22.03.30	3 260 000.00	2 803 600.00	0.05
USD PERU, REPUBLIC OF 2.84400% 19-20.06.30	430 000.00	424 571.25	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

2022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 PERU, REPUBLIC OF 3.0000% 21-15.01.34	10 449 000.00	10 015 366.50	0.18
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 4.8750% 19-17.07.49	2 920 000.00	2 874 922.50	0.05
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 4.5500% 16-29.03.26	5 690 000.00	6 242 285.63	0.11
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 4.4000% 18-01.03.28	21 010 000.00	23 119 141.38	0.42
USD PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.7800% 20-01.12.60	2 061 000.00	1 654 983.00	0.03
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 6.8750% 09-20.01.40	2 460 000.00	2 597 760.00	0.05
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 6.7500% 20-03.06.50	3 085 000.00	3 081 722.19	0.06
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 5.6000% 20-03.01.31	810 000.00	835 110.00	0.02
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 5.5000% 21-10.06.51	3 591 000.00	3 155 142.37	0.06
USD PETROFAC LTD-REG-S 9.7500% 21-15.11.26	448 000.00	451 360.00	0.01
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 12.7500% 11-17.02.22	560 000.00	18 200.00	0.00
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 8.5000% 16-27.10.20	34 620 000.00	2 596 500.00	0.05
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 5.3750% 07-12.04.27	23 369 600.00	876 360.00	0.02
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 5.5000% 07-12.04.37	370 000.00	13 875.00	0.00
USD PETROLEOS DEL PERU SA-REG-S 4.7500% 17-19.06.32	8 038 000.00	7 878 747.12	0.14
USD PETROLEOS DEL PERU SA-REG-S 5.6250% 17-19.06.47	12 058 000.00	11 103 157.13	0.20
USD PETROLEOS MEXICANOS 3.5000% 13-30.01.23	6 115 000.00	6 156 826.60	0.11
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.3750% 14-23.01.45	2 535 000.00	2 116 953.15	0.04
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.5000% 18-13.03.27	2 650 000.00	2 760 968.75	0.05
USD PETROLEOS MEXICANOS 5.3500% 18-12.02.28	8 450 000.00	8 240 102.00	0.15
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.3500% 18-12.02.48	8 101 000.00	6 667 123.00	0.12
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.5000% 18-23.01.29	1 811 000.00	1 840 881.50	0.03
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.4900% 20-23.01.27	1 610 000.00	1 680 035.00	0.03
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.8400% 20-23.01.30	985 000.00	1 003 222.50	0.02
USD PETROLEOS MEXICANOS 7.6900% 20-23.01.50	41 707 000.00	38 537 268.00	0.70
USD PETROLEOS MEXICANOS 5.9500% 20-28.01.31	23 795 000.00	22 566 583.12	0.41
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.9500% 20-28.01.60	15 933 000.00	13 547 033.24	0.25
USD PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 6.8750% 20-16.10.25	1 225 000.00	1 313 812.50	0.02
USD PETRORIO LUXEMBOURG SARL-REG-S 6.1250% 21-09.06.26	800 000.00	784 008.00	0.01
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 9.5000% 05-02.02.30	923 000.00	1 376 525.28	0.02
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 2.9500% 20-05.05.45	755 000.00	694 683.05	0.01
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 2.6500% 20-10.12.45	2 010 000.00	1 774 046.10	0.03
USD PHOSAGRO BOND FUNDING LTD-REG-S 3.0500% 20-23.01.25	7 450 000.00	7 207 875.00	0.13
USD PJSC KOKS VIA IMH CAP-REG-S 5.9000% 20-23.09.25	455 000.00	441 150.94	0.01
USD PLDT INC-REG-S 2.5000% 20-23.01.31	690 000.00	663 607.50	0.01
USD POLAND, REPUBLIC OF 3.0000% 12-17.03.23	3 760 000.00	3 840 419.64	0.07
USD POLYUS FINANCE PLC-REG-S 3.2500% 21-14.10.28	1 200 000.00	1 084 800.00	0.02
USD PROMIGAS SA ESP/GASES DEL PACIFIC-REG-S 3.7500% 19-16.10.29	2 430 000.00	2 338 571.25	0.04
USD PROSUS NV-144A 3.6800% 20-21.01.30	200 000.00	195 537.50	0.00
USD PROSUS NV-REG-S 3.2570% 22-19.01.27	2 625 000.00	2 615 156.25	0.05
USD PROSUS NV-REG-S 3.6800% 20-21.01.30	10 187 000.00	9 959 702.56	0.18
USD PROVINCE OF CORDOBA-REG-S *DEFAULTED* 7.1250% 16-10.12.25	982 676.00	716 002.31	0.01
USD PUMA INTL FINANCING-REG-S 5.0000% 18-24.01.26	1 970 000.00	1 961 135.00	0.04
USD QATAR PETROLEUM-REG-S 1.3750% 21-12.09.26	1 725 000.00	1 660 312.50	0.03
USD QATAR PETROLEUM-REG-S 2.2500% 21-12.07.31	3 515 000.00	3 383 187.50	0.06
USD QATAR PETROLEUM-REG-S 3.3000% 21-12.07.51	5 489 000.00	5 392 942.50	0.10
USD QATAR PETROLEUM-REG-S 3.1250% 21-12.07.41	9 536 000.00	9 234 853.12	0.17
USD QATAR, STATE OF-REG-S 4.5000% 18-23.04.28	2 700 000.00	3 024 000.00	0.06
USD QATAR, STATE OF-REG-S 5.1030% 18-23.04.48	1 532 000.00	1 978 195.00	0.04
USD QATAR, STATE OF-REG-S 4.8170% 19-14.03.49	17 228 000.00	21 491 930.00	0.39
USD QATAR, STATE OF-REG-S 3.4000% 20-16.04.25	11 063 000.00	11 571 898.00	0.21
USD QATAR, STATE OF-REG-S 3.7500% 20-16.04.30	12 915 000.00	14 109 637.50	0.26
USD QATAR, STATE OF-REG-S 4.4000% 20-16.04.50	10 992 000.00	12 998 040.00	0.24
USD QNB FINANSBANK AS-REG-S 6.8750% 19-07.09.24	1 200 000.00	1 257 600.00	0.02
USD REC LTD-REG-S 3.5000% 19-12.12.24	900 000.00	916 481.25	0.02
USD REDE D'OR FINANCE SARL-REG-S 4.5000% 20-22.01.30	4 334 000.00	4 115 403.88	0.07
USD REDSUN PROPERTIES GROUP LTD-REG-S 9.7000% 20-16.04.23	480 000.00	144 000.00	0.00
USD RELIANCE INDUSTRIES LTD-REG-S 2.8750% 22-12.01.32	8 023 000.00	7 776 132.29	0.14

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2022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	RELIANCE INDUSTRIES LTD-REG-S 3.75000% 22-12.01.62	1 800 000.00	1 718 586.00	0.03
USD	RELIANCE INDUSTRIES LTD-REG-S 3.62500% 22-12.01.52	7 614 000.00	7 262 842.32	0.13
USD	REPUBLIC OF AZERBAIJAN-REG-S 4.75000% 14-18.03.24	3 080 000.00	3 242 277.49	0.06
USD	REPUBLIC OF TAJIKISTAN INTER BOND-REG-S 7.12500% 17-14.09.27	470 000.00	407 519.38	0.01
USD	RIO ENERGY SA/UGEN SA/UENSA SA-REG-S 6.87500% 18-01.02.25	698 000.00	550 242.13	0.01
USD	ROMANIA-REG-S 3.00000% 20-14.02.31	6 100 000.00	5 910 900.00	0.11
USD	ROMANIA-REG-S 3.00000% 22-27.02.27	2 788 000.00	2 792 182.00	0.05
USD	ROMANIA-REG-S 3.62500% 22-27.03.32	2 254 000.00	2 254 000.00	0.04
USD	ROMANIA-REG-S 4.00000% 20-14.02.51	3 306 000.00	3 087 804.00	0.06
USD	RSHB CAPITAL SA-REG-S LPN 8.50000% 13-16.10.23	1 838 000.00	1 859 022.13	0.03
USD	RUSSIA, FEDERATION OF-REG-S 5.62500% 12-04.04.42	14 400 000.00	16 027 200.00	0.29
USD	SA GLOBAL SUKUK LTD-REG-S 1.60200% 21-17.06.26	810 000.00	783 270.00	0.01
USD	SA GLOBAL SUKUK LTD-REG-S 2.69400% 21-17.06.31	4 285 000.00	4 240 007.50	0.08
USD	SAGICOR FINANCIAL CO LTD-REG-S 5.30000% 21-13.05.28	1 610 000.00	1 630 125.00	0.03
USD	SAGICOR FINANCIAL CO LTD-REG-S 5.30000% 21-13.05.28	2 147 000.00	2 179 205.00	0.04
USD	SAKA ENERGI INDONESIA PT-REG-S 4.45000% 17-05.05.24	2 200 000.00	2 130 975.00	0.04
USD	SAMARCO MINERACAO SA-REG-S 5.37500% 14-26.09.24	1 280 000.00	799 440.00	0.01
USD	SAMBA FUNDING LTD-REG-S 2.75000% 19-02.10.24	3 026 000.00	3 051 153.62	0.06
USD	SANDS CHINA LTD 3.80000% 21-08.01.26	330 000.00	320 092.11	0.01
USD	SANDS CHINA LTD 4.37500% 21-18.06.30	300 000.00	292 770.00	0.01
USD	SANDS CHINA LTD 5.40000% 19-08.08.28	5 022 000.00	5 159 330.61	0.09
USD	SASOL FINANCING INTERNATIONAL PLC 4.50000% 12-14.11.22	5 212 000.00	5 247 441.60	0.10
USD	SASOL FINANCING USA LLC 5.87500% 18-27.03.24	11 832 000.00	12 157 380.00	0.22
USD	SASOL FINANCING USA LLC 6.50000% 18-27.09.28	5 819 000.00	6 153 592.50	0.11
USD	SASOL FINANCING USA LLC 4.37500% 21-18.09.26	781 000.00	769 285.00	0.01
USD	SASOL FINANCING USA LLC 5.50000% 21-18.03.31	800 000.00	782 000.00	0.01
USD	SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 2.25000% 20-24.11.30	4 267 000.00	4 048 316.25	0.07
USD	SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 3.25000% 20-24.11.50	2 898 000.00	2 669 637.60	0.05
USD	SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 3.50000% 20-24.11.70	3 823 000.00	3 505 691.00	0.06
USD	SCENERY JOURNEY LTD-REG-S * DEFAULTED * 11.50000% 20-24.10.22	3 690 000.00	369 000.00	0.01
USD	SCENERY JOURNEY LTD-REG-S * DEFAULTED * 12.00000% 20-24.10.23	900 000.00	90 000.00	0.00
USD	SENEGAL, REPUBLIC OF-REG-S 6.75000% 18-13.03.48	10 691 000.00	9 944 634.55	0.18
USD	SERBIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 2.12500% 20-01.12.30	1 984 000.00	1 778 160.00	0.03
USD	SF HOLDING INVESTMENT-REG-S 3.12500% 21-17.11.31	521 000.00	504 515.56	0.01
USD	SF HOLDING INVESTMENT-REG-S 2.37500% 22-17.11.26	1 030 000.00	1 011 813.70	0.02
USD	SHAMARAN PETROLEUM-144A-REG-S 12.00000% 21-30.07.25	1 130 000.00	1 130 000.00	0.02
USD	SHELF DRILLING HOLDINGS LTD-REG-S 8.25000% 18-15.02.25	800 000.00	612 000.00	0.01
USD	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD-REG-S 6.12500% 19-21.02.24	910 000.00	432 432.00	0.01
USD	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD-REG-S 3.45000% 21-11.01.31	4 058 000.00	1 643 490.00	0.03
USD	SIGMA ALIMENTOS-REG-S 4.12500% 16-02.05.26	400 000.00	416 575.00	0.01
USD	SIGMA FINANCE NETHERLANDS BV-REG-S 4.87500% 18-27.03.28	982 000.00	1 061 419.25	0.02
USD	SILKNET JSC-REG-S 8.37500% 22-31.01.27	1 890 000.00	1 865 808.00	0.03
USD	SINOPEC GROUP OVERSEAS DEV12 LTD-REG-S 4.87500% 12-17.05.42	404 000.00	475 920.08	0.01
USD	SINOPEC GRP OVERSEAS DEV LTD-REG-S 2.15000% 20-13.05.25	1 623 000.00	1 622 626.71	0.03
USD	SINOPEC GRP OVERSEAS DEV LTD-REG-S 2.70000% 20-13.05.30	7 433 000.00	7 395 983.66	0.13
USD	SINOPEC GRP OVERSEAS DEV LTD-REG-S 3.35000% 20-13.05.50	273 000.00	260 158.08	0.00
USD	SK BATTERY AMERICA INC-REG-S 2.12500% 21-26.01.26	2 487 000.00	2 397 617.22	0.04
USD	SK HYNIX INC-REG-S 2.37500% 21-19.01.31	1 153 000.00	1 071 736.56	0.02
USD	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHIL-REG-S 4.37500% 14-28.01.25	940 000.00	989 232.50	0.02
USD	SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.87500% 07-30.05.22	427 000.00	434 018.81	0.01
USD	SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 4.87500% 16-14.04.26	1 750 000.00	1 827 437.50	0.03
USD	SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 4.85000% 17-27.09.27	620 000.00	641 041.25	0.01
USD	SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.65000% 17-27.09.47	1 464 000.00	1 326 567.00	0.02
USD	SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.75000% 19-30.09.49	14 326 000.00	13 106 499.25	0.24
USD	SOUTHERN COPPER CORP 6.75000% 10-16.04.40	1 272 000.00	1 710 283.50	0.03
USD	SOVCOMBANK VIA SOVCOM CAPITAL DAC-REG-S 3.40000% 21-26.01.25	770 000.00	737 275.00	0.01
USD	SOVEREIGN WEALTH SAMRUK-KAZYNA-REG-S 2.00000% 21-28.10.26	1 658 000.00	1 580 903.00	0.03
USD	SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 5.87500% 12-25.07.22	1 669 000.00	1 228 784.56	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

2022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 6.12500% 15-03.06.25	2 650 000.00	1 361 934.37	0.02
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 6.82500% 16-18.07.26	4 223 000.00	2 078 729.52	0.04
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 6.20000% 17-11.05.27	7 390 000.00	3 603 364.00	0.07
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 5.75000% 18-18.04.23	1 260 000.00	663 692.40	0.01
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 6.75000% 18-18.04.28	22 570 000.00	10 835 254.38	0.20
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 6.85000% 19-14.03.24	8 787 000.00	4 496 073.28	0.08
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 7.85000% 19-14.03.29	18 867 000.00	9 198 794.52	0.17
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 6.35000% 19-28.06.24	1 940 000.00	993 021.40	0.02
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 7.55000% 19-28.03.30	1 365 000.00	655 891.64	0.01
USD SRI REJEKI ISMAN TBK PT-REG-S 7.25000% 19-16.01.25	200 000.00	27 106.00	0.00
USD SSB #1 PLC-REG-S LPN STEP-UP 15-20.03.25	1 300 000.00	419 737.50	0.01
USD ST MARYS CEMENT INC CANADA-REG-S 5.75000% 16-28.01.27	750 000.00	822 093.75	0.01
USD STATE AGENCY OF ROADS OF UKRAINE-REG-S 6.25000% 21-24.06.28	1 069 000.00	828 475.00	0.01
USD STILLWATER MINING CO-REG-S 4.00000% 21-16.11.26	1 073 000.00	1 023 856.60	0.02
USD STUDIO CITY FINANCE LTD-REG-S 6.00000% 20-15.07.25	7 279 000.00	6 911 865.44	0.13
USD STUDIO CITY FINANCE LTD-REG-S 6.50000% 20-15.01.28	5 304 000.00	4 965 870.00	0.09
USD STUDIO CITY FINANCE LTD-REG-S 5.00000% 21-15.01.29	400 000.00	346 450.00	0.01
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 8.35000% 18-19.04.23	600 000.00	378 000.00	0.01
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 6.50000% 20-09.07.23	1 130 000.00	683 650.00	0.01
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 7.00000% 20-09.07.25	1 096 000.00	635 680.00	0.01
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 6.65000% 20-03.08.24	330 000.00	196 350.00	0.00
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 6.50000% 21-26.01.26	819 000.00	481 768.56	0.01
USD SUZANO AUSTRIA GMBH 6.00000% 19-15.01.29	6 468 000.00	7 263 240.60	0.13
USD SUZANO AUSTRIA GMBH 5.00000% 19-15.01.30	550 000.00	585 062.50	0.01
USD SUZANO AUSTRIA GMBH 3.75000% 20-15.01.31	1 541 000.00	1 501 800.82	0.03
USD SUZANO AUSTRIA GMBH 3.12500% 19-15.01.32	1 811 000.00	1 675 175.00	0.03
USD SUZANO AUSTRIA GMBH 2.50000% 21-15.09.28	1 300 000.00	1 230 125.00	0.02
USD SUZANO AUSTRIA GMBH-REG-S 7.00000% 17-16.03.47	4 075 000.00	4 909 865.63	0.09
USD TECPETROL SA-REG-S 4.87500% 17-12.12.22	2 411 000.00	2 357 958.00	0.04
USD TELECOM ARGENTINA SA-REG-S 8.00000% 19-18.07.26	814 000.00	763 277.63	0.01
USD TELEFONICA CELULAR DEL PARAGUAY-REG-S 5.87500% 19-15.04.27	13 052 000.00	13 460 984.42	0.25
USD TELEFONICA MOVILES CHILE SA-REG-S 3.53700% 21-18.11.31	1 500 000.00	1 442 156.25	0.03
USD TERMOCANDELARIA POWER LTD-REG-S 7.87500% 19-30.01.29	6 950 000.00	6 444 821.88	0.12
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 2.80000% 16-21.07.23	980 000.00	962 159.59	0.02
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 3.15000% 16-01.10.26	12 841 000.00	11 786 240.26	0.22
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 4.10000% 16-01.10.46	3 260 000.00	2 608 000.00	0.05
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 6.75000% 18-01.03.28	4 530 000.00	4 779 217.95	0.09
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 6.00000% 18-15.04.24	1 070 000.00	1 084 712.50	0.02
USD THIRD PAKISTAN INTERNATIONAL SUK-REG-S 5.62500% 17-05.12.22	4 488 000.00	4 543 539.00	0.08
USD TOTAL PLAY TELECOMUNICACIONES SA-REG-S 6.37500% 21-20.09.28	482 000.00	449 465.00	0.01
USD TOWER BERSAMA INFRA TBK PT-REG-S 4.25000% 20-21.01.25	1 540 000.00	1 580 232.50	0.03
USD TOWER BERSAMA INFRA TBK PT-REG-S 2.75000% 21-20.01.26	750 000.00	729 196.87	0.01
USD TRANSNET SOC LTD-REG-S 4.00000% 12-26.07.22	2 000 000.00	1 986 150.00	0.04
USD TRANSPORTADORA DE GAS INTER-REG-S 5.55000% 18-01.11.28	940 000.00	1 015 082.50	0.02
USD TRANSPORTADORA DE GAS DEL SUR SA-REG-S 6.75000% 18-02.05.25	430 000.00	384 850.00	0.01
USD TRINIDAD & TOBAGO, REPUBLIC OF-REG-S 4.50000% 20-26.06.30	2 930 000.00	2 952 524.38	0.05
USD TRINIDAD GENERATION UNLTD-REG-S 5.25000% 16-04.11.27	2 944 000.00	2 985 032.00	0.05
USD TRINIDAD PETROLEUM HOLDINGS LTD-REG-S 9.75000% 19-15.06.26	5 150 000.00	5 420 375.00	0.10
USD TRUST F/1401-REG-S 4.86900% 19-15.01.30	1 610 000.00	1 654 073.75	0.03
USD TRUST F/1401-REG-S 5.25000% 14-15.12.24	2 385 000.00	2 545 689.38	0.05
USD TRUST F/1401-REG-S 5.25000% 15-30.01.26	600 000.00	644 737.50	0.01
USD TRUST F/1401-REG-S 6.39000% 19-15.01.50	8 336 000.00	9 335 027.94	0.17
USD TSMC ARIZONA CORP 2.50000% 21-25.10.31	602 000.00	592 289.74	0.01
USD TULLOW OIL PLC-REG-S 10.25000% 21-15.05.26	4 221 000.00	4 263 210.00	0.08
USD TUPRAS TURKIYE PETROL-REG-S 4.50000% 17-18.10.24	3 314 000.00	3 242 127.63	0.06
USD TUPY OVERSEAS SA-REG-S 4.50000% 21-16.02.31	520 000.00	480 772.50	0.01
USD TURK SISE VE CAM FABRIKA-REG-S 6.95000% 19-14.03.26	700 000.00	721 131.25	0.01
USD TURK TELEKOMUNIKASYON AS-REG-S 6.87500% 19-28.02.25	526 000.00	535 961.13	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

2022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 TURKCELL ILETISIM HIZMETLERI AS-REG-S 5.80000% 18-11.04.28	3 616 000.00	3 498 480.00	0.06
USD TURKEY, REPUBLIC OF 6.87500% 06-17.03.36	290 000.00	261 507.50	0.00
USD TURKEY, REPUBLIC OF 6.00000% 11-14.01.41	5 930 000.00	4 778 468.13	0.09
USD TURKEY, REPUBLIC OF 3.25000% 13-23.03.23	280 000.00	277 690.00	0.00
USD TURKEY, REPUBLIC OF 4.87500% 13-16.04.43	1 301 000.00	937 370.50	0.02
USD TURKEY, REPUBLIC OF 4.87500% 16-09.10.26	3 000 000.00	2 732 437.50	0.05
USD TURKEY, REPUBLIC OF 6.00000% 17-25.03.27	457 000.00	431 807.88	0.01
USD TURKEY, REPUBLIC OF 5.75000% 17-11.05.47	6 546 000.00	5 031 419.25	0.09
USD TURKEY, REPUBLIC OF 6.35000% 19-10.08.24	3 572 000.00	3 587 181.00	0.07
USD TURKEY, REPUBLIC OF 5.60000% 19-14.11.24	10 125 000.00	9 968 695.32	0.18
USD TURKEY, REPUBLIC OF 4.25000% 20-13.03.25	1 693 000.00	1 589 621.20	0.03
USD TURKEY, REPUBLIC OF 5.25000% 20-13.03.30	4 680 000.00	3 994 965.00	0.07
USD TURKEY, REPUBLIC OF 5.95000% 20-15.01.31	14 381 000.00	12 644 494.25	0.23
USD TURKEY, REPUBLIC OF 6.50000% 21-20.09.33	2 522 000.00	2 240 324.12	0.04
USD TURKIYE GARANTI BANKASI AS-REG-S 5.87500% 17-16.03.23	1 869 000.00	1 899 721.68	0.03
USD TURKIYE IS BANKASI-REG-S 6.12500% 17-25.04.24	1 791 000.00	1 785 268.80	0.03
USD TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO-REG-S 6.50000% 20-08.01.26	1 443 000.00	1 406 925.00	0.03
USD TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO-REG-S 5.50000% 21-01.10.26	500 000.00	463 750.00	0.01
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.22	5 010 000.00	4 842 165.00	0.09
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.23	5 479 000.00	5 034 858.56	0.09
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.24	6 735 000.00	6 008 040.95	0.11
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.25	11 809 000.00	10 391 920.00	0.19
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.26	13 669 000.00	11 950 123.25	0.22
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.27	6 033 000.00	5 272 842.00	0.10
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.37500% 17-25.09.32	12 606 000.00	10 639 464.00	0.19
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 8.99400% 18-01.02.24	2 029 000.00	1 876 825.00	0.03
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 9.75000% 18-01.11.28	2 904 000.00	2 737 020.00	0.05
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 6.87600% 21-21.05.29	5 729 000.00	4 800 902.00	0.09
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.25300% 20-15.03.33	10 701 000.00	8 988 840.00	0.16
USD ULKER BISKUVI SANAYI-REG-S 6.95000% 20-30.10.25	441 000.00	419 446.12	0.01
USD ULTRAPAR INTERNATIONAL SA-REG-S 5.25000% 19-06.06.29	1 889 000.00	1 918 279.50	0.03
USD UNIFIN FINANCIERA SA DE CV-REG-S 7.37500% 18-12.02.26	1 060 000.00	629 573.75	0.01
USD UNIFIN FINANCIERA SA DE CV-REG-S 8.37500% 19-27.01.28	580 000.00	346 550.00	0.01
USD UNIGEL LUXEMBOURG SA-REG-S 8.75000% 19-01.10.26	2 294 000.00	2 434 220.75	0.04
USD UPL CORP LTD-REG-S 4.50000% 18-08.03.28	1 520 000.00	1 562 085.00	0.03
USD URUGUAY, REPUBLIC OF 4.12500% 12-20.11.45	655 000.00	740 682.18	0.01
USD USIMINAS INTERNATIONAL SARL-REG-S 5.87500% 19-18.07.26	800 000.00	821 348.00	0.01
USD UZBEKNEFTEGAZ JSC-REG-S 4.75000% 21-16.11.28	5 965 000.00	5 517 625.00	0.10
USD VALE OVERSEAS LTD 3.75000% 20-08.07.30	666 000.00	672 660.00	0.01
USD VALE OVERSEAS LTD 6.87500% 06-21.11.36	2 619 000.00	3 322 987.20	0.06
USD VEB FINANCE PLC-REG-S LPN 5.94200% 13-21.11.23	2 800 000.00	2 837 275.00	0.05
USD VEDANTA RESOURCES PLC-REG-S 7.12500% 13-31.05.23	500 000.00	473 375.00	0.01
USD VEDANTA RESOURCES PLC-REG-S 6.37500% 17-30.07.22	3 330 000.00	3 286 918.13	0.06
USD VEDANTA RESOURCES PLC-REG-S 6.12500% 17-09.08.24	3 380 000.00	2 903 208.75	0.05
USD VENEZUELA, REP. OF REG-S *DEFAULTED* 8.25000% 09-13.10.24	16 419 700.00	944 132.75	0.02
USD VENEZUELA, REP. OF-REG-S *DEFAULTED* 7.75000% 09-13.10.19	4 923 700.00	283 112.75	0.01
USD VEON HOLDINGS BV-REG-S 4.00000% 19-09.04.25	9 473 000.00	9 174 316.31	0.17
USD VFU FUNDING PLC VIA VF UKRAINE-REG-S 6.20000% 20-11.02.25	1 095 000.00	1 012 875.00	0.02
USD VIVO ENERGY INVEST BV-REG-S 5.12500% 20-24.09.27	890 000.00	912 138.75	0.02
USD VM HOLDING SA-REG-S 5.37500% 17-04.05.27	4 055 000.00	4 196 925.00	0.08
USD VOLCAN CIA MINERA SAA-REG-S 4.37500% 21-11.02.26	2 867 000.00	2 751 961.63	0.05
USD VOTORANTIM CIMENTOS INTL SA-REG-S 7.25000% 11-05.04.41	1 345 000.00	1 703 358.43	0.03
USD VTR COMUNICACION SPA-REG-S 5.12500% 20-15.01.28	709 000.00	696 238.00	0.01
USD VTR FINANCE NV-REG-S 6.37500% 20-15.07.28	2 834 000.00	2 876 510.00	0.05
USD WYNN MACAU LTD-REG-S 5.50000% 20-15.01.26	3 460 000.00	3 246 518.00	0.06
USD WYNN MACAU LTD-REG-S 5.62500% 20-26.08.28	340 000.00	309 825.00	0.01
USD XP INC-REG-S 3.25000% 21-01.07.26	1 400 000.00	1 318 625.00	0.02
USD YPF SA-144A 8.50000% 20-23.03.25	1 106 000.00	832 090.80	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

2022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 6.95000% 17-21.07.27	5 822 000.00	3 747 184.75	0.07
USD YPF SA-REG-S 7.00000% 17-15.12.47	1 712 000.00	1 027 200.00	0.02
USD YPF SA-REG-S 8.50000% 15-28.07.25	3 153 000.00	2 382 091.50	0.04
USD YPF SA-REG-S 8.50000% 19-27.06.29	1 980 000.00	1 386 000.00	0.03
USD YPF SA-REG-S 8.50000% 20-23.03.25	1 577 000.00	1 186 444.12	0.02
USD YPF SA-REG-S 8.75000% 14-04.04.24	8 891 000.00	8 048 022.06	0.15
USD YPF SA-REG-S STEP-UP 21-12.02.26	1 408 515.00	1 144 277.59	0.02
USD YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD-REG-S 7.85000% 20-12.08.26	2 045 000.00	440 697.50	0.01
USD YUZHOU PROPERTIES CO LTD-REG-S 8.37500% 19-30.10.24	3 544 000.00	779 680.00	0.01
USD ZAMBIA, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 8.50000% 14-14.04.24	2 335 000.00	1 762 925.00	0.03
USD ZAMBIA, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 8.97000% 15-30.07.27	13 321 000.00	9 835 060.82	0.18
USD ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD-REG-S 7.87500% 20-14.04.24	1 883 000.00	866 180.00	0.02
USD ZHONGAN ONLINE P&C INSUR CO LTD-REG-S 3.12500% 20-16.07.25	1 000 000.00	960 000.00	0.02
USD ZORLU YENILENEBILIR ENERJI AS-REG-S 9.00000% 21-01.06.26	3 135 000.00	2 823 067.50	0.05
米ドル合計		2 775 650 806.79	50.70
ノート、固定利付債合計		2 944 215 181.38	53.78
ノート、ゼロ・クーポン			
USD			
USD BIOCEANICO SOVEREIGN CERTIFICATE-REG-S 0.00000% 19-05.06.34	9 700 000.00	6 923 080.30	0.13
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 20-31.07.30	4 326 423.00	2 527 712.64	0.04
USD RUTAS 2 AND 7 FINANCE LTD-REG-S 0.00000% 19-30.09.36	5 320 000.00	3 918 180.00	0.07
USD SPRC EM SPC PANAMA METRO LINE2 SP-REG-S 0.00000% 17-05.12.22	7 558 000.00	923 486.31	0.02
米ドル合計		14 292 459.25	0.26
ノート、ゼロ・クーポン合計		14 292 459.25	0.26
ノート、変動利付債			
USD			
USD ABSA GROUP LTD-REG-S-SUB 6.375%/VAR 21-PRP	4 518 000.00	4 518 000.00	0.08
USD ACCESS BANK PLC-SUB-REG-S 9.125%/VAR 21-PRP	310 000.00	300 700.00	0.01
USD AES GENER SA-REG-S-SUB 7.125%/VAR 19-26.03.79	1 737 000.00	1 747 943.10	0.03
USD ALFA BD ISS OJSC ALFA BK-REG-S-SUB 5.950%/VAR 19-15.04.30	6 060 000.00	5 772 150.00	0.11
USD BANCO DE CREDITO DEL PERU-REG-S-SUB 3.125%/VAR 20-01.07.30	3 330 000.00	3 258 821.25	0.06
USD BANCO DE CREDITO DEL PERU-REG-S-SUB 3.250%/VAR 21-30.09.31	1 155 000.00	1 126 341.56	0.02
USD BANCO DO BRASIL CAYMAN-REG-S-SUB 6.250%/VAR 13-PRP	13 160 000.00	12 987 275.00	0.24
USD BANCO DO BRASIL CAYMAN-REG-S-SUB 9.000%/VAR 14-PRP	1 367 000.00	1 457 563.75	0.03
USD BANCO DO ESTADO DO RIO G-REG-S-SUB 5.37500%/VAR 21-28.01.31	853 000.00	795 422.50	0.01
USD BANCO MER DEL NORTE SA/GRAND CY-REG-S-SUB 7.625%/VAR 17-PRP	3 170 000.00	3 226 013.90	0.06
USD BANCO MERCANTIL DEL NORTE-REG-S-SUB 5.750%/VAR 16-04.10.31	3 410 000.00	3 508 676.88	0.06
USD BANCO MERCANTIL DEL NORTE SA-REG-S-SUB 8.375%/VAR 20-PRP	987 000.00	1 080 641.63	0.02
USD BANCO NACIONAL DE COM-REG-S-SUB 2.720%/VAR 21-11.08.31	1 680 000.00	1 663 200.00	0.03
USD BANCO SANTANDER SA-REG-S-SUB 5.950%/VAR 18-01.10.28	2 660 000.00	2 765 655.20	0.05
USD BANGKOK BANK -REG-S-SUB 3.466%/VAR 21-23.09.36	4 680 000.00	4 540 208.40	0.08
USD BANK HAPOLIM BM-144A-REG-S-SUB 3.255%/VAR 21-21.01.32	1 600 000.00	1 560 000.00	0.03
USD BANK LEUMI ISRAEL BM-144A-REG-S-SUB 3.275%/VAR 20-29.01.31	12 871 000.00	12 653 801.86	0.23
USD BBVA BANCOMER SA/TEXAS-REG-S-SUB 5.125%/VAR 18-18.01.33	14 089 000.00	14 160 713.01	0.26
USD BBVA BANCOMER SA/TEXAS-REG-S-SUB 5.875%/VAR 19-13.09.34	1 778 000.00	1 889 125.00	0.03
USD BLOSSOM JOY LTD-REG-S-SUB 3.100%/VAR 20-PRP	568 000.00	573 290.86	0.01
USD BRASKEM NETHERLANDS FINANCE-REG-S-SUB 8.500%/VAR 20-23.01.81	4 727 000.00	5 402 961.00	0.10
USD BURGAN BANK SAK-REG-S-SUB 2.750%/VAR 20-15.12.31	2 104 000.00	1 885 710.00	0.03
USD CEMEX SAB DE CV-REG-S-SUB 5.125%/VAR 21-PRP	6 183 000.00	6 192 336.33	0.11
USD CHINA DEV BANK FIN LEASING-REG-S-SUB 2.875%/VAR 20-28.09.30	1 800 000.00	1 806 525.00	0.03
USD CHINA HUADIAN OVERSEAS DEVP MANG-REG-S 4.000%/VAR 19-PRP	222 000.00	230 869.45	0.00
USD CK HUTCHISON CAPITAL SEC 17 LTD-REG-S-SUB 4.000%/VAR 17-PRP	8 513 000.00	8 554 500.87	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 - エマージング・マーケット・デッド

2022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 COMMERCIAL BK PS-REG-S-SUB 4.500%/VAR 21-PRP	1 400 000.00	1 407 000.00	0.03
USD CORP FINANCIERA DE DESARROL-REG-S-SUB 5.250%/VAR 14-15.07.29	880 000.00	910 800.00	0.02
USD CREDIT BK MOSCOW/CBOM FIN-REG-S-SUB 7.500%/VAR 17-05.10.27	8 470 000.00	7 516 066.25	0.14
USD CREDIT BK MOSCOW/CBOM FIN-REG-S-SUB 8.875%/VAR 17-PRP	3 300 000.00	2 901 525.00	0.05
USD CREDIT BK MOSCOW/CBOM FINANCE-REG-S-SUB 7.625%/VAR 21-PRP	2 300 000.00	1 771 000.00	0.03
USD DP WORLD SALAAM-REG-S-SUB 6.000%/VAR 20-PRP	10 681 000.00	11 432 007.81	0.21
USD EMIRATES NBD BANK PJSC-REG-S-SUB 4.250%/VAR 21-PRP	1 400 000.00	1 410 500.00	0.03
USD GAZPROM PJSC VIA GAZ FIN PLC-REG-S-SUB 4.598%/VAR 20-PRP	3 633 000.00	3 451 350.00	0.06
USD GRUPO BIMBO SA DE CV-REG-S-SUB 5.950%/VAR 18-PRP	2 750 000.00	2 823 562.50	0.05
USD HANWHA LIFE INSURANCE CO LT-REG-S-SUB 3.379%/VAR 22-04.02.32	7 519 000.00	7 541 857.76	0.14
USD HUARONG FINANCE 2017 CO-REG-S 3M LIBOR+185BP 17-27.04.22	1 270 000.00	1 265 555.00	0.02
USD ITAU UNIBANCO HOLDING SA-REG-S-SUB 4.500%/VAR 19-21.11.29	1 500 000.00	1 478 718.75	0.03
USD MINMETALS BOUNTEOUS FIN BVI LTD-REG-S 3.375%/VAR 20-PRP	2 278 000.00	2 329 198.50	0.04
USD NANYANG COMMERCIAL BANK LTD-REG-S-SUB 3.800%/VAR 19-20.11.29	6 190 000.00	6 303 277.00	0.12
USD NBK SPC LTD-REG-S 1.625%/VAR 21-15.09.27	972 000.00	929 475.00	0.02
USD NBK TIER 2 LTD-REG-S-SUB 2.500%/VAR 20-24.11.30	1 870 000.00	1 843 469.38	0.03
USD OVERSEA-CHINESE BKNG-REG-S-SUB 1.832%/VAR 20-10.09.30	291 000.00	284 644.56	0.01
USD PETROLEOS MEXICANOS 3M LIBOR+365BP 18-11.03.22	1 137 000.00	1 135 294.50	0.02
USD TINKOFF BK JSC VIA TCS FIN-144A-REG-S-SUB 6.000%/VAR 21-PRP	4 646 000.00	4 227 860.00	0.08
USD TURKIYE GARANTI BANK AS-REG-S-SUB 6.125%/VAR 17-24.05.27	1 820 000.00	1 805 553.75	0.03
USD YAPI VE KREDI BANKASI AS-REG-S-SUB 7.875%/VAR 21-22.01.31	3 531 000.00	3 478 035.00	0.06
米ドル合計		169 905 197.31	3.10
ノート、変動利付債合計		169 905 197.31	3.10
中期債券、固定利付債			
EUR EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 5.62500% 18-16.04.30	9 536 000.00	9 273 450.08	0.17
EUR EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 4.75000% 18-16.04.26	2 650 000.00	2 803 550.93	0.05
EUR EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 4.75000% 19-11.04.25	2 272 000.00	2 470 504.64	0.05
EUR EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 6.37500% 19-11.04.31	2 407 000.00	2 360 966.13	0.04
EUR INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 3.75000% 16-14.06.28	5 071 000.00	6 465 511.70	0.12
EUR KAZAKHSTAN, REPUBLIC OF-REG-S 2.37500% 18-09.11.28	1 006 000.00	1 185 803.89	0.02
EUR NE PROPERTY BV-REG-S 1.87500% 19-09.10.26	3 060 000.00	3 459 845.99	0.06
EUR NE PROPERTY BV-REG-S 2.00000% 22-20.01.30	650 000.00	709 807.84	0.01
EUR PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 5.12500% 16-15.03.23	3 520 000.00	4 099 810.88	0.08
EUR PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 0.87500% 19-17.05.27	5 080 000.00	5 723 153.40	0.11
EUR ROMANIA-REG-S 1.37500% 20-02.12.29	2 195 000.00	2 254 520.17	0.04
EUR ROMANIA-REG-S 1.75000% 21-13.07.30	2 700 000.00	2 754 297.00	0.05
EUR ROMANIA-REG-S 2.00000% 20-28.01.32	2 168 000.00	2 153 878.20	0.04
EUR ROMANIA-REG-S 2.12400% 19-16.07.31	220 000.00	225 349.03	0.00
EUR ROMANIA-REG-S 2.50000% 18-08.02.30	3 040 000.00	3 305 604.80	0.06
EUR ROMANIA-REG-S 2.75000% 21-14.04.41	2 435 000.00	2 282 657.27	0.04
EUR ROMANIA-REG-S 2.87500% 18-11.03.29	2 940 000.00	3 390 492.53	0.06
EUR ROMANIA-REG-S 2.87500% 21-13.04.42	2 106 000.00	1 983 093.84	0.04
EUR ROMANIA-REG-S 3.37500% 20-28.01.50	13 636 000.00	13 298 781.72	0.24
EUR ROMANIA-REG-S 4.62500% 19-03.04.49	6 548 000.00	7 707 323.40	0.14
EUR ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 2.00000% 21-14.04.33	10 730 000.00	10 404 505.45	0.19
EUR SERBIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 1.00000% 21-23.09.28	3 020 000.00	3 169 599.47	0.06
EUR SERBIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 2.05000% 21-23.09.36	2 001 000.00	1 968 338.68	0.04
ユーロ合計		93 450 847.04	1.71
USD ABQ FINANCE LTD-REG-S 3.12500% 19-24.09.24	3 023 000.00	3 094 796.25	0.06
USD ABU DHABI GOVERNMENT INTERNAT-REG-S 3.00000% 21-15.09.51	5 130 000.00	4 873 500.00	0.09
USD ABU DHABI PORTS CO PJSC-REG-S 2.50000% 21-06.05.31	701 000.00	678 217.50	0.01
USD ABU DHABI, EMIRATE OF-REG-S 3.87500% 20-16.04.50	2 067 000.00	2 291 786.25	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

2022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 ADCB FINANCE CAYMAN LTD-REG-S-SUB 4.50000% 13-06.03.23	360 000.00	370 642.50	0.01
USD AFRICA FINANCE CORP-REG-S 4.37500% 19-17.04.26	3 288 000.00	3 510 597.60	0.06
USD AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK-REG-S 4.12500% 17-20.06.24	1 924 000.00	1 997 920.08	0.04
USD AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK/THE-REG-S 3.99400% 19-21.09.29	1 062 000.00	1 078 184.88	0.02
USD ALDAR SUKUK NO 2 LTD-REG-S 3.87500% 19-22.10.29	2 395 000.00	2 494 242.81	0.05
USD ANGOLAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 8.00000% 19-26.11.29	11 045 000.00	10 936 620.92	0.20
USD ANGOLAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 9.12500% 19-26.11.49	10 943 000.00	10 415 000.25	0.19
USD ARAB REPUBLIC OF EGYPT-REG-S 5.87500% 21-16.02.31	14 308 000.00	12 054 490.00	0.22
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF 6.62500% 17-06.07.28	0.00	100 762.31	0.00
USD AXIATA SPV5 LABUAN LTD-REG-S 3.06400% 20-19.08.50	1 230 000.00	1 127 218.13	0.02
USD AZURE POWER SOLAR ENERGY PVT LTD-REG-S 5.65000% 19-24.12.24	925 000.00	957 548.44	0.02
USD BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.25000% 21-25.01.33	1 780 000.00	1 615 350.00	0.03
USD BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.62500% 21-18.05.34	12 950 000.00	11 800 687.50	0.22
USD BAHRAIN, KINGDOM OF-REG-S 4.25000% 21-25.01.28	760 000.00	727 700.00	0.01
USD BANCO DE CREDITO E INVERSIONES SA-REG-S 2.87500% 21-14.10.31	1 245 000.00	1 201 425.00	0.02
USD BANCO DO BRASIL SA/CAYMAN-REG-S 4.75000% 19-20.03.24	5 460 000.00	5 669 186.25	0.10
USD BANK MANDIRI PERSERO TBK PT-REG-S 3.75000% 19-11.04.24	1 409 000.00	1 446 690.75	0.03
USD BANK MANDIRI PERSERO TBK PT-REG-S 4.75000% 20-13.05.25	1 656 000.00	1 769 125.50	0.03
USD BANK MUSCAT SAOG-REG-S 4.75000% 21-17.03.26	1 416 000.00	1 456 710.00	0.03
USD BANK NEGARA INDONESIA PERSERO-REG-S-SUB 3.75000% 21-30.03.26	936 000.00	931 610.16	0.02
USD BANK OF CHINA LTD-REG-S-SUB 5.00000% 14-13.11.24	1 286 000.00	1 384 132.21	0.03
USD BOC AVIATION LTD-144A 3.25000% 20-29.04.25	650 000.00	667 387.50	0.01
USD BOC AVIATION LTD-REG-S 3.50000% 17-18.09.27	391 000.00	404 562.82	0.01
USD BOC AVIATION LTD-REG-S 3.00000% 19-11.09.29	2 774 000.00	2 756 912.64	0.05
USD BOC AVIATION USA CORP-REG-S 1.62500% 21-29.04.24	4 060 000.00	4 014 909.72	0.07
USD CATHAY PACIFIC MTN FINANCING HK LT-REG-S 4.87500% 21-17.0.26	300 000.00	284 679.83	0.01
USD CBQ FINANCE LTD-REG-S 2.00000% 21-12.05.26	1 043 000.00	1 019 532.50	0.02
USD CDBL FUNDING 2-REG-S 2.00000% 21-04.03.26	3 031 000.00	2 956 164.61	0.05
USD CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT-REG-S 2.50000% 21-20.01.28	660 000.00	628 155.00	0.01
USD CHINA CINDA FINANCE 2017 I LTD-REG-S 4.75000% 18-08.02.28	320 000.00	343 260.00	0.01
USD CHINA RESOURCES LAND LTD-REG-S 4.12500% 19-26.02.29	829 000.00	879 931.69	0.02
USD CMB INTERNATIONAL LEASING MGT LTD-REG-S 1.87500% 20-12.08.25	760 000.00	741 617.50	0.01
USD CMB INTERNATIONAL LEASING MGT LTD-REG-S 2.75000% 20-12.08.30	459 000.00	437 857.31	0.01
USD DIB SUKUK LTD-REG-S 1.95900% 21-22.06.26	934 000.00	912 985.00	0.02
USD DOHA FINANCE LTD-REG-S 2.37500% 21-31.03.26	875 000.00	860 781.25	0.02
USD DP WORLD CRESCENT LTD-REG-S 4.84800% 18-26.09.28	1 060 000.00	1 159 375.00	0.02
USD DP WORLD CRESCENT LTD-REG-S 3.87500% 19-18.07.29	3 059 000.00	3 175 242.00	0.06
USD DP WORLD CRESCENT LTD-REG-S 3.75000% 19-30.01.30	591 000.00	607 252.50	0.01
USD DP WORLD PLC-144A 6.85000% 07-02.07.37	330 000.00	412 046.25	0.01
USD DP WORLD PLC-REG-S 5.62500% 18-25.09.48	1 320 000.00	1 532 850.00	0.03
USD DP WORLD PLC-REG-S 6.85000% 07-02.07.37	1 450 000.00	1 810 506.25	0.03
USD DUBAI, GOVERNMENT OF-REG-S 3.90000% 20-09.09.50	9 162 000.00	8 390 674.13	0.15
USD EASTERN AND SOUTHERN AFRICAN TRAD-REG-S 4.87500% 19-23.05.24	1 883 000.00	1 918 777.00	0.04
USD EASTERN AND SOUTHERN AFRICAN TRAD-REG-S 4.12500% 21-30.06.28	4 622 000.00	4 528 635.60	0.08
USD EGYPT GOVERNMENT INTRNTINL BD-144A 7.50000% 21-16.02.61	2 390 000.00	1 849 262.50	0.03
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 5.87500% 15-11.06.25	400 000.00	404 000.00	0.01
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 8.50000% 17-31.01.47	10 223 000.00	8 536 205.00	0.16
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.50000% 17-31.01.27	5 000 000.00	5 037 500.00	0.09
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.60030% 19-01.03.29	3 167 000.00	3 060 113.75	0.06
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 8.70020% 19-01.03.49	4 811 000.00	4 059 281.25	0.07
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.05290% 19-15.01.32	6 140 000.00	5 380 175.00	0.10
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 8.15000% 19-20.11.59	9 538 000.00	7 666 167.50	0.14
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 3.87500% 21-16.02.26	3 700 000.00	3 367 000.00	0.06
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.50000% 21-16.02.61	3 032 000.00	2 346 010.00	0.04
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.30000% 21-30.09.33	1 826 000.00	1 590 902.50	0.03
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 8.75000% 21-30.09.51	801 000.00	675 843.75	0.01
USD EMAAR SUKUK LTD-REG-S 3.87500% 19-17.09.29	798 000.00	815 107.12	0.02
USD EMIRATES DEVELOPMENT BANK PJSC-REG-S 3.51600% 19-06.03.24	800 000.00	826 000.00	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 - エマージング・マーケット・デッド

2022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 BANK PJSC-REG-S 2.62500% 20-18.02.25	565 000.00	575 593.75	0.01
USD	EQUATE PETROCHEMICAL BV-REG-S 4.25000% 16-03.11.26	2 588 000.00	2 754 279.00	0.05
USD	EQUATE PETROCHEMICAL BV-REG-S 2.62500% 21-28.04.28	389 000.00	378 788.75	0.01
USD	ESKOM HOLDINGS SOC LTD-REG-S 8.45000% 18-10.08.28	522 000.00	541 346.63	0.01
USD	ESKOM HOLDINGS SOC LTD-REG-S 6.35000% 18-10.08.28	3 360 000.00	3 515 400.00	0.06
USD	EXPORT-IMPORT BANK OF INDIA-REG-S 2.25000% 21-13.01.31	638 000.00	577 217.74	0.01
USD	EXPORT-IMPORT BANK OF INDIA-REG-S 4.00000% 13-14.01.23	551 000.00	561 606.75	0.01
USD	FINANCE DEPRTMENT GOVT OF SHARJAH-REG-S 4.00000% 20-28.07.50	5 570 000.00	4 704 213.12	0.09
USD	FINANCE DEPRTMENT GOVT OF SHARJAH-REG-S 3.62500% 21-10.03.33	910 000.00	853 125.00	0.02
USD	GC TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 2.98000% 21-18.03.31	3 601 000.00	3 542 033.63	0.06
USD	GC TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 4.30000% 21-18.03.51	1 830 000.00	1 924 007.10	0.04
USD	GEMDALE EVER PROSPERITY INVESTMENT-REG-S 4.95000% 21-08.24	748 000.00	735 751.50	0.01
USD	GLP CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 2.95000% 21-29.03.26	1 136 000.00	1 104 135.20	0.02
USD	GOL FINANCE SA-REG-S 8.00000% 20-30.06.26	925 000.00	852 165.50	0.02
USD	GOODMAN HK FINANCE-REG-S 3.00000% 20-22.07.30	825 000.00	825 899.66	0.02
USD	GREENKO POWER II LTD-REG-S 4.30000% 21-13.12.28	5 508 000.00	5 389 578.00	0.10
USD	GULF INTERNATIONAL BANK BSC-REG-S 2.37500% 20-23.09.25	1 383 000.00	1 370 898.75	0.03
USD	HLP FINANCE LTD-REG-S 4.75000% 12-25.06.22	500 000.00	505 010.00	0.01
USD	HONGKONG ELECTRIC FINANCE LTD-REG-S 2.25000% 20-09.06.30	1 330 000.00	1 287 716.09	0.02
USD	HONGKONG ELECTRIC FINANCE LTD-REG-S 1.87500% 20-27.08.30	806 000.00	755 350.96	0.01
USD	HPCL MITTAL ENERGY LTD-REG-S 5.45000% 19-22.10.26	2 844 000.00	2 886 660.00	0.05
USD	HUARONG FINANCE 2017 CO-REG-S 4.25000% 17-07.11.27	770 000.00	760 375.00	0.01
USD	HUARONG FINANCE II CO LTD-REG-S 5.50000% 15-16.01.25	5 600 000.00	5 782 000.00	0.11
USD	HUARONG FINANCE II CO LTD-REG-S 5.00000% 15-19.11.25	2 410 000.00	2 464 225.00	0.05
USD	HUARONG FINANCE II CO LTD-REG-S 4.87500% 16-22.11.26	1 720 000.00	1 745 800.00	0.03
USD	HUARONG FINANCE-REG-S 3.75000% 19-29.05.24	1 250 000.00	1 240 625.00	0.02
USD	HUARONG FINANCE-REG-S 4.50000% 19-29.05.29	801 000.00	793 150.20	0.01
USD	HUARONG FINANCE-REG-S 3.25000% 19-13.11.24	320 000.00	312 400.00	0.01
USD	HUARONG FINANCE-REG-S 3.87500% 19-13.11.29	2 340 000.00	2 234 700.00	0.04
USD	HUARONG FINANCE-REG-S 3.37500% 20-24.02.30	910 000.00	834 925.00	0.02
USD	HUARONG FINANCE-REG-S 2.12500% 20-30.09.23	723 000.00	703 262.10	0.01
USD	HUARONG FINANCE-REG-S 3.62500% 20-30.09.30	1 330 000.00	1 233 575.00	0.02
USD	HUTAMA KARYA PERSERO PT-REG-S 3.75000% 20-11.05.30	3 664 000.00	3 774 607.00	0.07
USD	HYUNDAI CAPITAL SERVICES INC-REG-S 1.25000% 21-08.02.26	1 259 000.00	1 208 100.03	0.02
USD	ICD SUKUK CO LTD-REG-S 5.00000% 17-01.02.27	3 315 000.00	3 542 906.25	0.06
USD	INDIAN RAILWAY FINANCE CORP LTD-REG-S 3.24900% 20-13.02.30	2 100 000.00	2 073 907.50	0.04
USD	INDIAN RAILWAY FINANCE CORP LTD-REG-S 3.95000% 20-13.02.50	1 160 000.00	1 066 692.50	0.02
USD	INDIAN RAILWAY FINANCE CORP LTD-REG-S 3.57000% 22-21.01.32	2 453 000.00	2 446 560.87	0.04
USD	INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 6.75000% 14-15.01.44	2 570 000.00	3 579 521.70	0.07
USD	INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.12500% 15-15.01.45	1 463 000.00	1 697 533.53	0.03
USD	INDONESIA, REPUBLIC OF 5.95000% 15-08.01.46	575 000.00	743 115.63	0.01
USD	INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 4.75000% 17-18.07.47	533 000.00	596 227.12	0.01
USD	IOI INVESTMENT L BHD-REG-S 3.37500% 21-02.11.31	2 460 000.00	2 377 841.41	0.04
USD	ISRAEL ELECTRIC CORP LTD-144A-REG-S 4.25000% 18-14.08.28	14 585 000.00	15 798 617.85	0.29
USD	KAZAKHSTAN, REPUBLIC OF-REG-S 6.50000% 15-21.07.45	1 600 000.00	2 132 000.00	0.04
USD	KINGDOM OF SAUDI ARABIA-REG-S 2.25000% 21-02.02.33	8 434 000.00	8 021 661.74	0.15
USD	KSA SUKUK LTD-REG-S 4.30300% 18-19.01.29	6 090 000.00	6 751 678.50	0.12
USD	KSA SUKUK LTD-REG-S 2.96900% 19-29.10.29	10 820 000.00	11 074 919.20	0.20
USD	LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 8.25000% 06-12.04.21	6 777 000.00	728 527.50	0.01
USD	LEBANON, REPUBLIC OF *DEFAULT* 6.37500% 10-09.03.20	27 177 000.00	2 887 556.25	0.05
USD	LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.10000% 10-04.10.22	4 222 000.00	448 587.50	0.01
USD	LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.60000% 11-27.11.26	6 760 000.00	701 350.00	0.01
USD	LEBANON, REPUBLIC OF *DEFAULTED* 6.15000% 13-19.06.20	9 027 000.00	959 118.75	0.02
USD	LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 5.80000% 14-14.04.20	2 179 000.00	231 518.75	0.00
USD	LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 7.00000% 17-20.03.28	270 000.00	25 987.50	0.00
USD	LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 7.15000% 17-20.11.31	180 000.00	17 100.00	0.00
USD	LENOVO GROUP LTD-REG-S 5.87500% 20-24.04.25	500 000.00	541 370.00	0.01
USD	MDGH - GMTN BV-REG-S 2.87500% 19-07.11.29	5 110 000.00	5 154 712.50	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

2022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 MDGH - GMTN BV-REG-S 3.7000% 19-07.11.49	3 770 000.00	3 911 375.00	0.07
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 3.9500% 20-21.05.50	1 230 000.00	1 334 550.00	0.02
USD MEGLOBAL CANADA INC-REG-S 5.8750% 20-18.05.30	1 905 000.00	2 238 136.88	0.04
USD MEGLOBAL CANADA INC-REG-S 5.0000% 20-18.05.25	14 094 000.00	15 109 648.88	0.28
USD METROPOLITAN BANK & TRUST CO-REG-S 2.1250% 20-15.01.26	2 755 000.00	2 734 337.50	0.05
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.7500% 12-08.03.44	512 000.00	526 336.00	0.01
USD MEXICO, UNITED STATES OF 5.5500% 14-21.01.45	620 000.00	704 010.00	0.01
USD MEXICO, UNITED STATES OF 3.7500% 21-19.04.71	4 732 000.00	3 932 292.00	0.07
USD MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 8.7500% 17-09.03.24	6 944 000.00	7 587 622.00	0.14
USD MTR CORP LTD-REG-S 1.6250% 20-19.08.30	1 000 000.00	943 310.25	0.02
USD MUTHOOT FINANCE LTD-REG-S 6.1250% 19-31.10.22	1 300 000.00	1 314 056.25	0.02
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 6.5000% 17-28.11.27	10 403 000.00	10 429 007.50	0.19
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.6250% 17-28.11.47	3 157 000.00	2 762 375.00	0.05
USD NIGERIA, FEDERAL REP OF-REG-S 6.1250% 21-28.09.28	1 100 000.00	1 054 831.25	0.02
USD NIGERIA, FEDERAL REP OF-REG-S 7.3750% 21-28.09.33	3 886 000.00	3 613 494.25	0.07
USD NIGERIA, FEDERAL REP OF-REG-S 8.2500% 21-28.09.51	1 987 000.00	1 813 137.50	0.03
USD NTPC LTD-REG-S 4.5000% 18-19.03.28	560 000.00	592 305.00	0.01
USD NWD MTN LTD-REG-S 4.5000% 20-19.05.30	206 000.00	204 898.46	0.00
USD OIL & NATURAL GAS CORP LTD-REG-S 3.3750% 19-05.12.29	595 000.00	597 156.87	0.01
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 4.8750% 19-01.02.25	4 930 000.00	5 071 737.50	0.09
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.0000% 19-01.08.29	1 123 000.00	1 179 150.00	0.02
USD OVERSEA-CHINESE BANKING CORP-REG-S-SUB 4.2500% 14-19.06.24	1 300 000.00	1 364 837.50	0.03
USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 6.0000% 21-08.04.26	2 054 000.00	1 977 200.94	0.04
USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 7.3750% 21-08.04.31	3 849 000.00	3 599 238.39	0.07
USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 8.8750% 21-08.04.51	2 822 000.00	2 624 770.42	0.05
USD PANAMA, REPUBLIC OF 9.3750% 99-01.04.29	7 126 000.00	9 930 081.00	0.18
USD PERTAMINA PERSERO PT-REG-S 4.7000% 19-30.07.49	1 300 000.00	1 324 212.50	0.02
USD PERTAMINA PERSERO PT-REG-S 4.1750% 20-21.01.50	5 503 000.00	5 328 623.68	0.10
USD PERTAMINA PERSERO PT-REG-S 4.1500% 20-25.02.60	240 000.00	220 470.00	0.00
USD PERTAMINA PT-REG-S 6.4500% 14-30.05.44	777 000.00	939 587.25	0.02
USD PERTAMINA PT-REG-S 6.5000% 18-07.11.48	1 806 000.00	2 248 808.62	0.04
USD PERU PERS PT PERSUSAHAAN LIST NEG-REG-S 4.0000% 20-30.06.50	5 473 000.00	4 894 230.25	0.09
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 4.1250% 17-15.05.27	2 500 000.00	2 586 406.25	0.05
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 5.2500% 17-15.05.47	6 073 000.00	6 277 204.63	0.11
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 5.4500% 18-21.05.28	1 253 000.00	1 388 324.00	0.03
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 6.1500% 18-21.05.48	2 621 000.00	2 996 622.07	0.05
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 4.3750% 19-05.02.50	823 000.00	765 801.50	0.01
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 4.4500% 19-20.02.29	13 380 000.00	14 900 302.50	0.27
USD PETROLEOS MEXICANOS 4.5000% 16-23.01.26	2 066 000.00	2 050 505.00	0.04
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.8750% 17-04.08.26	9 390 000.00	10 061 385.00	0.18
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.7500% 17-21.09.47	4 097 000.00	3 494 741.00	0.06
USD PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 4.5000% 15-18.03.45	900 000.00	1 053 731.25	0.02
USD PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 4.5500% 20-21.04.50	4 634 000.00	5 464 644.50	0.10
USD PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 4.8000% 20-21.04.60	2 729 000.00	3 390 591.47	0.06
USD PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 3.4040% 21-28.04.61	943 000.00	906 340.88	0.02
USD PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 2.4800% 21-28.01.32	768 000.00	742 848.00	0.01
USD PHILIPPINE NATIONAL BANK-REG-S 3.2800% 19-27.09.24	3 212 000.00	3 250 744.75	0.06
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 10.6250% 00-16.03.25	408 000.00	518 714.88	0.01
USD POWER FINANCE CORP LTD-REG-S 6.1500% 18-06.12.28	600 000.00	690 487.50	0.01
USD PROSUS NV-REG-S 3.0610% 21-13.07.31	1 535 000.00	1 412 200.00	0.03
USD PTT TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 3.7000% 20-16.07.70	3 650 000.00	3 460 200.00	0.06
USD PTTEP TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 3.9030% 19-06.12.59	710 000.00	710 830.70	0.01
USD PTTEP TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 2.9930% 20-15.01.30	4 090 000.00	4 173 845.00	0.08
USD QNB FINANCE LTD-REG-S 3.5000% 19-28.03.24	4 663 000.00	4 827 079.32	0.09
USD QNB FINANCE LTD-REG-S 2.7500% 20-12.02.27	800 000.00	808 400.00	0.02
USD QNB FINANCE LTD-REG-S 2.6250% 20-12.05.25	3 156 000.00	3 183 615.00	0.06
USD QNB FINANCE LTD-REG-S 1.6250% 20-22.09.25	760 000.00	742 900.00	0.01
USD QTEL INTERNATIONAL FINANCE LTD-REG-S 2.6250% 21-08.04.31	4 235 000.00	4 155 593.75	0.08

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2022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 / 先渡し替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD REC LTD-REG-S 2.25000% 21-01.09.26	1 170 000.00	1 119 763.12	0.02
USD REPUBLIC OF UZBEKISTAN BOND-REG-S 5.37500% 19-20.02.29	2 475 000.00	2 586 375.00	0.05
USD REPUBLIC OF UZBEKISTAN BOND-REG-S 4.75000% 19-20.02.24	5 967 000.00	6 169 878.00	0.11
USD REPUBLIC OF UZBEKISTAN BOND-REG-S 3.70000% 20-25.11.30	760 000.00	708 700.00	0.01
USD RIZAL COMMERCIAL BANKING CORP-REG-S 3.00000% 19-11.09.24	1 253 000.00	1 274 379.31	0.02
USD ROMANIA-REG-S 6.12500% 14-22.01.44	212 000.00	262 880.00	0.01
USD SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 2.87500% 19-16.04.24	2 895 000.00	2 947 110.00	0.05
USD SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 3.50000% 19-16.04.29	17 785 000.00	18 567 540.00	0.34
USD SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 4.25000% 19-16.04.39	12 750 000.00	13 737 487.50	0.25
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-144A 3.25000% 21-17.11.51	4 760 000.00	4 468 450.00	0.08
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 4.50000% 16-26.10.46	971 000.00	1 091 161.25	0.02
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 4.62500% 17-04.10.47	7 086 000.00	8 095 755.00	0.15
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 5.00000% 18-17.04.49	1 501 000.00	1 819 962.50	0.03
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 2.75000% 20-03.02.32	4 480 000.00	4 487 392.00	0.08
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 3.75000% 20-21.01.55	10 588 000.00	10 733 585.00	0.20
USD SAUDI GOVERNMENT INTER-REG-S 4.50000% 20-22.04.60	4 796 000.00	5 605 325.00	0.10
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 3.45000% 21-02.02.61	4 127 000.00	3 925 808.75	0.07
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 3.25000% 21-17.11.51	3 035 000.00	2 849 106.25	0.05
USD SF HOLDING INVESTMENT 2021 LTD-REG-S 3.12500% 22-17.11.31	2 386 000.00	2 310 861.52	0.04
USD SHARJAH SUKUK PROGRAM LTD-REG-S 4.22600% 18-14.03.28	2 260 000.00	2 374 130.00	0.04
USD SHARJAH SUKUK PROGRAM LTD-REG-S 3.85400% 19-03.04.26	2 830 000.00	2 945 499.37	0.05
USD SHINHAN BANK CO LTD-REG-S-SUB 4.00000% 19-23.04.29	1 106 000.00	1 197 245.00	0.02
USD SHINHAN BANK-REG-S-SUB 4.50000% 18-26.03.28	1 886 000.00	2 074 953.63	0.04
USD SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD-REG-S 5.10000% 20-16.07.23	500 000.00	501 875.00	0.01
USD SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD-REG-S 4.40000% 21-13.03.24	3 948 000.00	3 898 650.00	0.07
USD STATE OIL OF THE AZERBAIJAN REP-REG-S 4.75000% 13-13.03.23	2 020 000.00	2 076 560.00	0.04
USD SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD-REG-S 3.75000% 19-25.02.29	3 429 000.00	3 664 315.11	0.07
USD TBC BANK JSC-REG-S 5.75000% 19-19.06.24	3 907 000.00	4 075 001.00	0.07
USD TC ZIRAAT BANKASI AS-REG-S 5.12500% 17-03.05.22	850 000.00	852 018.75	0.02
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.59500% 18-19.01.28	1 749 000.00	1 815 077.22	0.03
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.97500% 19-11.04.29	890 000.00	942 732.50	0.02
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 2.39000% 20-03.06.30	7 351 000.00	7 004 676.01	0.13
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.24000% 20-03.06.50	536 000.00	475 298.00	0.01
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.29000% 20-03.06.60	238 000.00	206 810.10	0.00
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.84000% 21-22.04.51	820 000.00	810 455.20	0.01
USD THAIOIL TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 4.62500% 18-20.11.28	3 058 000.00	3 273 589.00	0.06
USD THAIOIL TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 5.37500% 18-20.11.48	1 157 000.00	1 239 118.31	0.02
USD THAIOIL TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 3.75000% 20-18.06.50	2 305 000.00	1 964 666.75	0.04
USD TURKIYE SINAI KALKINMA BANKASI AS-REG-S 5.87500% 21-14.01.26	2 879 000.00	2 713 457.50	0.05
USD UNION BANK OF THE PHILIPPINES-REG-S 2.12500% 20-22.10.25	1 432 000.00	1 430 031.00	0.03
USD VEON HOLDINGS BV-REG-S 3.37500% 20-25.11.27	4 689 000.00	4 269 006.27	0.08
USD VLL INTERNATIONAL INC-REG-S 7.25000% 20-20.07.27	700 000.00	722 006.25	0.01
USD YAPI VE KREDI BANKASI AS-REG-S 5.85000% 17-21.06.24	280 000.00	279 300.00	0.01
USD YAPI VE KREDI BANKASI AS-REG-S 8.25000% 19-15.10.24	7 965 000.00	8 309 984.07	0.15
USD YES BANK IFSC BANKING UNIT BR-REG-S 3.75000% 18-06.02.23	4 399 000.00	4 339 338.56	0.08
米ドル合計		644 706 546.16	11.77
中期債券、固定利付債合計		738 157 393.20	13.48
中期債券、変動利付債			
EUR			
EUR OTP BANK NYRT-REG-S-SUB 2.875%/VAR 19-15.07.29	3 590 000.00	4 104 877.80	0.07
ユーロ合計		4 104 877.80	0.07
USD			
USD AIA GROUP LTD-REG-S-SUB 2.700%/VAR 21-PRP	5 063 000.00	4 981 333.95	0.09
USD AXIS BANK LTD/GIFT CITY-REG-S-SUB 4.100%/VAR 21-PRP	450 000.00	436 725.00	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

2022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 BANGKOK BANK PCL/HONG KONG-REG-S-SUB 3.733%/VAR 19-25.09.34	5 720 000.00	5 715 710.00	0.10
USD BANGKOK BANK PCL/HONG KONG-REG-S-SUB 5.000%/VAR 20-PRP	1 610 000.00	1 637 470.63	0.03
USD BANK OF EAST ASIA LTD-REG-S-SUB 5.825%/VAR 20-PRP	1 763 000.00	1 821 531.60	0.03
USD DBS GROUP HOLDINGS LTD-REG-S-SUB 4.520%/VAR 18-11.12.28	1 284 000.00	1 343 169.29	0.03
USD DBS GROUP HOLDINGS LTD-REG-S-SUB 3.300%/VAR 20-PRP	2 980 000.00	2 991 175.00	0.06
USD DIANJIAN HAIYU LTD-REG-S 4.300%/VAR 19-PRP	617 000.00	638 569.58	0.01
USD FAR EAST HORIZON LTD-REG-S 4.350%/VAR 17-PRP	300 000.00	296 647.50	0.01
USD HUARONG FINANCE 2017 CO-REG-S 3M LIBOR+115BP 17-07.11.22	751 000.00	739 735.00	0.01
USD HUARONG FINANCE 2017 CO-REG-S 4.000%/VAR 17-PRP	2 190 000.00	2 183 430.00	0.04
USD HUARONG FINANCE 2017 CO-REG-S 3M LIBOR+132.5BP 18-03.07.23	584 000.00	567 940.00	0.01
USD KOOKMIN BANK-REG-S-SUB 4.350%/VAR 19-PRP	509 000.00	528 182.93	0.01
USD LEADER GOAL INTERNATIONAL LTD-REG-S 4.250%/VAR 18-PRP	500 000.00	509 971.05	0.01
USD PARKWAY PANTAI LTD-REG-S 4.250%/VAR 17-PRP	2 700 000.00	2 691 225.00	0.05
USD QIB SUKUK LTD-REG-S 3M LIBOR+135BP 20-07.02.25	3 835 000.00	3 846 505.00	0.07
USD SHINHAN FIN GROUP CO LTD-REG-S-SUB 3.340%/VAR 19-05.02.30	1 860 000.00	1 887 086.25	0.03
USD UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S-SUB 3.750%/VAR 19-15.04.29	1 200 000.00	1 240 619.64	0.02
USD UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S-SUB 2.000%/VAR 21-14.10.31	1 100 000.00	1 072 700.31	0.02
USD UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S-SUB 2.880%/VAR 16-08.03.27	982 000.00	983 126.65	0.02
USD UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S-SUB 3.875%/VAR 17-PRP	1 220 000.00	1 247 560.54	0.02
USD WING LUNG BANK LTD-REG-S-SUB 3.750%/H15T5Y+175BP 17-22.11.27	2 000 000.00	2 021 940.00	0.04
米ドル合計		39 382 354.92	0.72
中期債券、変動利付債合計		43 487 232.72	0.79
債券、固定利付債			
EUR			
EUR ALTICE FINANCING SA-REG-S 3.00000% 20-15.01.28	2 050 000.00	2 095 821.60	0.04
EUR ALTICE FINANCING SA-REG-S 4.25000% 21-15.08.29	4 640 000.00	4 885 629.37	0.09
EUR BENIN GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 4.95000% 21-22.01.35	7 909 000.00	8 247 958.65	0.15
EUR CENTRAL BANK OF TUNISIA-REG-S 5.62500% 17-17.02.24	1 950 000.00	1 784 281.69	0.03
EUR CROATIA, REPUBLIC OF-REG-S 2.75000% 17-27.01.30	1 517 000.00	1 874 864.09	0.03
EUR CROATIA, REPUBLIC OF-REG-S 1.50000% 20-17.06.31	10 667 000.00	11 972 654.13	0.22
EUR CROATIA, REPUBLIC OF-REG-S 1.12500% 21-04.03.33	5 383 000.00	5 747 711.70	0.11
EUR CROATIA, REPUBLIC OF-REG-S 1.75000% 21-04.03.41	7 590 000.00	8 306 315.74	0.15
EUR FORTUNE STAR BVI LTD-REG-S 3.95000% 21-02.10.26	760 000.00	788 396.97	0.01
EUR IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 18-22.03.30	7 540 000.00	8 438 076.68	0.15
EUR IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 6.62500% 18-22.03.48	8 351 000.00	8 912 705.50	0.16
EUR IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 6.87500% 19-17.10.40	10 686 000.00	12 067 351.17	0.22
EUR METINVEST BV-REG-S 5.62500% 19-17.06.25	1 460 000.00	1 436 476.02	0.03
EUR NAK NAFTOGAZ UKRAINE VIA KONDOR-REG-S 7.12500% 19-19.07.24	1 343 000.00	1 143 053.15	0.02
EUR ROMANIAN GOVERNMENT INTERN BDS-REG-S 3.62400% 20-26.05.30	1 909 000.00	2 223 448.57	0.04
EUR RUSSIA, FEDERATION OF-REG-S 2.87500% 18-04.12.25	4 700 000.00	5 426 761.00	0.10
EUR SENEGAL, REPUBLIC OF-REG-S 4.75000% 18-13.03.28	5 930 000.00	6 589 364.12	0.12
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV-REG-S 1.25000% 15-31.03.23	1 270 000.00	1 411 034.91	0.03
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV-REG-S 1.12500% 16-15.10.24	510 000.00	546 983.54	0.01
ユーロ合計		93 898 888.60	1.71
USD			
USD ABJA INVESTMENT CO PTE LTD-REG-S 5.95000% 14-31.07.24	5 668 000.00	6 022 250.00	0.11
USD ABU DHABI CRUDE OIL PIPELINE LLC-REG-S 4.60000% 17-02.11.47	7 512 000.00	8 394 660.00	0.15
USD ABU DHABI, GOVERNMENT OF-REG-S 3.12500% 19-30.09.49	8 618 000.00	8 381 005.00	0.15
USD ACWA POWER MGMT & INVEST ONE LTD-REG-S 5.95000% 17-15.12.39	3 534 000.00	4 042 269.06	0.07
USD ADANI GREEN ENERGY UP LTD-REG-S 6.25000% 19-10.12.24	1 090 000.00	1 154 923.12	0.02
USD ADCB FINANCE CAYMAN LTD-REG-S 4.00000% 18-29.03.23	1 201 000.00	1 232 751.44	0.02
USD AKBANK TAS-REG-S 5.12500% 15-31.03.25	1 200 000.00	1 149 000.00	0.02
USD AKCB FINANCE LTD-REG-S 4.75000% 18-09.10.23	2 859 000.00	3 001 950.00	0.05
USD ALAM SUTERA REALTY TBK PT (PAY IN KIND) STEP UP 20-02.11.25	615 000.00	469 437.19	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

2022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 ALDAR SUKUK LTD-REG-S 4.75000% 18-29.09.25	550 000.00	590 665.63	0.01
USD ALFA DESARROLLO SPA-REG-S 4.55000% 21-27.09.51	9 421 000.00	8 575 465.25	0.16
USD ALTICE FINANCING SA-REG-S 5.75000% 21-15.08.29	2 640 000.00	2 467 555.20	0.04
USD ANGOLAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 8.25000% 18-09.05.28	16 243 000.00	16 296 804.94	0.30
USD ARABIAN CENTRES SUKUK II LTD-REG-S 5.62500% 21-07.10.26	2 146 000.00	2 052 112.50	0.04
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF STEP-UP 20-09.07.41	34 230 379.00	12 168 899.72	0.22
USD ATENTO LUXCO 1 SA-REG-S 8.00000% 21-10.02.26	1 698 000.00	1 793 937.00	0.03
USD AZURE POWER ENERGY LTD-REG-S 3.57500% 21-19.08.26	5 005 000.00	4 905 901.00	0.09
USD BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 7.00000% 16-12.10.28	5 670 000.00	6 031 462.50	0.11
USD BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 7.50000% 17-20.09.47	474 000.00	459 424.50	0.01
USD BAHRAIN, KINGDOM OF-REG-S 5.62500% 19-30.09.31	1 950 000.00	1 869 318.75	0.03
USD BAHRAIN, KINGDOM OF-REG-S 7.37500% 20-14.05.30	6 720 000.00	7 256 760.00	0.13
USD BAHRAIN, KINGDOM OF-REG-S 5.45000% 20-16.09.32	3 680 000.00	3 473 000.00	0.06
USD BANK OF BAHRAIN & KUWAIT-REG-S 5.50000% 19-09.07.24	2 134 000.00	2 198 420.13	0.04
USD BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO-REG-S-SUB 4.20000% 20-23.01.25	1 182 000.00	1 185 085.02	0.02
USD BELARUS INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.20000% 18-28.02.30	284 000.00	206 610.00	0.00
USD BHARTI AIRTEL INTL NETHERLANDS BV-REG-S 5.35000% 14-20.05.24	13 451 000.00	14 315 226.75	0.26
USD BIZ FINANCE PLC FOR UKREXIMBANK-REG-S 9.62500% 15-27.04.22	5 081 000.00	405 765.48	0.01
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 8.25000% 04-20.01.34	4 907 000.00	6 208 275.06	0.11
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 7.12500% 06-20.01.37	671 000.00	783 937.69	0.01
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 5.00000% 14-27.01.45	2 738 000.00	2 442 467.13	0.04
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 6.00000% 16-07.04.26	545 000.00	604 711.56	0.01
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 5.62500% 16-21.02.47	460 000.00	434 930.00	0.01
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 4.50000% 19-30.05.29	15 820 000.00	15 714 203.75	0.29
USD CBB INTERNATIONAL SUKUK PROGRAMME-REG-S 3.95000% 20-16.09.27	2 170 000.00	2 161 862.50	0.04
USD CENTRAL BANK OF TUNISIA-REG-S 5.75000% 15-30.01.25	200 000.00	155 000.00	0.00
USD CFLD CAYMAN INVEST-REG-S *DEFAULTED* 6.90000% 20-13.01.23	220 000.00	54 766.25	0.00
USD CHINA CONSTRUCTION BANK CORP-REG-S-SUB 4.25000% 19-27.02.29	1 384 000.00	1 441 961.92	0.03
USD CHINA EVERGRANDE GRO-REG-S *DEFAULTED* 7.50000% 17-28.06.23	2 521 000.00	403 360.00	0.01
USD CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN-REG-S 5.95000% 14-08.05.24	200 000.00	214 600.00	0.00
USD CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN-REG-S 6.45000% 14-11.06.34	550 000.00	694 993.75	0.01
USD CHINA SCE GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 7.00000% 20-02.05.25	200 000.00	141 000.00	0.00
USD CHINA SCE PROPERTY HOLDINGS LTD-REG-S 7.37500% 19-09.04.24	325 000.00	245 375.00	0.00
USD CHINA SCE PROPERTY HOLDINGS LTD-REG-S 5.95000% 21-29.09.24	470 000.00	345 450.00	0.01
USD CHINALCO CAPITAL HOLDINGS LTD-REG-S 4.25000% 17-21.04.22	3 162 000.00	3 175 217.16	0.06
USD CHINALCO CAPITAL HOLDINGS LTD-REG-S 2.12500% 21-03.06.26	1 172 000.00	1 135 574.24	0.02
USD CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 4.12500% 17-19.07.27	1 760 000.00	1 859 932.80	0.03
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 10.37500% 03-28.01.33	660 000.00	904 530.00	0.02
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 8.12500% 04-21.05.24	2 860 000.00	3 206 417.50	0.06
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 7.37500% 06-18.09.37	2 753 000.00	3 055 485.87	0.06
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 6.12500% 09-18.01.41	1 166 000.00	1 141 076.75	0.02
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 4.00000% 13-26.02.24	3 160 000.00	3 233 667.50	0.06
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 5.62500% 14-26.02.44	4 723 000.00	4 320 954.63	0.08
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 5.00000% 15-15.06.45	14 005 000.00	11 906 875.95	0.22
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 2.62500% 13-15.03.23	8 320 000.00	8 336 640.00	0.15
USD COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD-REG-S 5.75000% 12-14.02.42	960 000.00	997 680.00	0.02
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 5.62500% 13-18.10.43	957 000.00	1 168 018.50	0.02
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 4.87500% 14-04.11.44	384 000.00	429 072.00	0.01
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 5.62500% 16-15.12.26	330 000.00	276 441.00	0.01
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 6.15000% 19-17.09.25	3 941 000.00	3 428 670.00	0.06
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 4.80000% 20-06.08.30	823 000.00	650 170.00	0.01
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 3.12500% 20-22.10.25	1 220 000.00	979 050.00	0.02
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 3.87500% 20-22.10.30	500 000.00	383 750.00	0.01
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 2.70000% 21-12.07.26	1 072 000.00	838 840.00	0.02
USD CROATIA, REPUBLIC OF-REG-S 6.00000% 13-26.01.24	1 597 000.00	1 725 558.50	0.03
USD DAR AL-ARKAN SUKUK CO LTD-REG-S 6.87500% 18-21.03.23	200 000.00	205 600.00	0.00
USD DAR AL-ARKAN SUKUK CO LTD-REG-S 6.75000% 19-15.02.25	325 000.00	337 085.94	0.01
USD DAR AL-ARKAN SUKUK CO LTD-REG-S 6.87500% 20-26.02.27	2 446 000.00	2 512 194.88	0.05

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2022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 DEVELOPMENT BANK OF MONGOLIA LLC-REG-S 7.25000% 18-23.10.23	3 368 000.00	3 526 506.49	0.06
USD DIB SUKUK LTD-REG-S 2.95000% 20-16.01.26	2 200 000.00	2 235 200.00	0.04
USD DNO ASA-144A-REG-S 8.37500% 19-29.05.24	4 550 000.00	4 709 250.00	0.09
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 5.87500% 13-18.04.24	3 430 000.00	3 567 200.00	0.07
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 7.45000% 14-30.04.44	790 000.00	891 860.63	0.02
USD EA PARTNERS I BV-REG-S *DEFAULTED* 6.87500% 15-28.09.20	4 113 000.00	1 663 996.82	0.03
USD EA PARTNERS II BV-REG-S *DEFAULTED* 6.75000% 16-01.06.21	1 710 000.00	9 618.75	0.00
USD EASY TACTIC LTD-REG-S 8.62500% 19-27.02.24	360 000.00	120 700.80	0.00
USD ECOPETROL SA 4.12500% 14-16.01.25	2 870 000.00	2 879 506.87	0.05
USD EHI CAR SERVICES LTD-REG-S 7.75000% 21-14.11.24	270 000.00	260 550.00	0.00
USD EIG PEARL HOLDINGS SARL-REG-S 3.54500% 22-31.08.36	3 850 000.00	3 834 215.00	0.07
USD EIG PEARL HOLDINGS SARL-REG-S 4.38700% 22-30.11.46	7 342 000.00	7 299 783.50	0.13
USD EL FONDO MIVIVIENDA-REG-S 3.50000% 13-31.01.23	1 950 000.00	1 981 443.75	0.04
USD EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 7.65000% 05-15.06.35	257 000.00	139 069.13	0.00
USD EL SUKUK CO LTD-REG-S 1.82700% 20-23.09.25	1 350 000.00	1 334 812.50	0.02
USD ELECT GLOBAL INVESTMENTS LTD-REG-S 4.85000% 20-PRP	458 000.00	457 976.17	0.01
USD ETHIOPIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.62500% 14-11.12.24	7 109 000.00	5 341 969.19	0.10
USD EXPORT CREDIT BANK OF TURKEY-REG-S 8.25000% 19-24.01.24	1 775 000.00	1 839 121.87	0.03
USD EXPORT-IMPORT BANK OF INDIA-REG-S 3.37500% 16-05.08.26	380 000.00	390 877.50	0.01
USD FANTASIA HOLDINGS GROUP CO LTD-REG-S 10.87500% 21-02.03.24	330 000.00	67 650.00	0.00
USD FORMOSA GROUP CAYMAN LTD-REG-S 3.37500% 15-22.04.25	1 458 000.00	1 497 912.75	0.03
USD FOXCONN FAR EAST LTD-REG-S 2.50000% 20-28.10.30	870 000.00	845 966.25	0.02
USD FPC RESOURCES LTD-REG-S 4.37500% 20-11.09.27	320 000.00	333 060.00	0.01
USD GABON, REPUBLIC OF-REG-S 6.37500% 13-12.12.24	590 014.00	604 137.46	0.01
USD GABON, REPUBLIC OF-REG-S 6.95000% 15-16.06.25	6 125 000.00	6 363 492.19	0.12
USD GALAXY PIPELINE ASSETS BIDCO LTD-REG-S 2.62500% 20-31.03.36	14 474 000.00	13 587 467.50	0.25
USD GALAXY PIPELINE ASSETS BIDCO LTD-REG-S 3.25000% 20-30.09.40	2 920 000.00	2 792 250.00	0.05
USD GAZ CAPITAL SA/GAZPROM-REG-S LPN 5.15000% 19-11.02.26	2 132 000.00	2 163 980.00	0.04
USD GAZPROM PJSC VIA GAZ FINANCE PLC-REG-S 3.25000% 20-25.02.30	1 280 000.00	1 145 126.40	0.02
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 10.75000% 15-14.10.30	9 331 000.00	9 890 860.00	0.18
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 7.87500% 19-26.03.27	2 800 000.00	2 310 000.00	0.04
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 8.12500% 19-26.03.32	4 640 000.00	3 526 400.00	0.06
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 8.95000% 19-26.03.51	2 594 000.00	1 932 530.00	0.04
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 7.87500% 20-11.02.35	4 936 000.00	3 658 810.00	0.07
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 8.75000% 20-11.03.61	3 984 000.00	2 938 200.00	0.05
USD GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD-REG-S 3.87500% 15-04.06.25	3 172 000.00	3 247 929.74	0.06
USD GOHL CAPITAL LTD-REG-S 4.25000% 17-24.01.27	19 962 000.00	19 772 361.00	0.36
USD GREENKO DUTCH BV-REG-S 3.85000% 21-29.03.26	7 226 000.00	6 993 051.83	0.13
USD GREENKO SOLAR MAURITIUS LTD-REG-S 5.55000% 19-29.01.25	2 736 000.00	2 750 227.20	0.05
USD GREENKO SOLAR MAURITIUS LTD-REG-S 5.95000% 19-29.07.26	1 180 000.00	1 218 586.00	0.02
USD GRUPOSURA FINANCE-REG-S 5.50000% 16-29.04.26	1 000 000.00	1 025 000.00	0.02
USD GTLK EUROPE CAPITAL DAC-REG-S 5.95000% 19-17.04.25	2 175 000.00	2 106 900.75	0.04
USD HKT CAPITAL NO 5 LTD-REG-S 3.25000% 19-30.09.29	1 870 000.00	1 924 604.18	0.03
USD HUARONG FINANCE II CO LTD-REG-S 4.62500% 16-03.06.26	3 390 000.00	3 406 950.00	0.06
USD ICD FUNDING LTD-REG-S 3.22300% 20-28.04.26	1 700 000.00	1 691 500.00	0.03
USD IHS HOLDING LTD-REG-S 5.62500% 21-29.11.26	3 070 000.00	3 093 025.00	0.06
USD IHS HOLDING LTD-REG-S 6.25000% 21-29.11.28	5 345 000.00	5 402 726.00	0.10
USD INDIAN OIL CORP LTD-REG-S 4.75000% 19-16.01.24	2 060 000.00	2 156 305.00	0.04
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 8.50000% 05-12.10.35	3 203 000.00	4 838 131.50	0.09
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 6.62500% 07-17.02.37	493 000.00	647 000.87	0.01
USD IRAQ INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.80000% 06-15.01.28	10 606 000.00	7 605 496.33	0.14
USD IRAQ INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.75200% 17-09.03.23	2 735 000.00	2 747 478.43	0.05
USD ISRAEL, STATE OF 3.87500% 20-03.07.50	1 709 000.00	1 899 980.75	0.03
USD ISRAEL, STATE OF 4.50000% 20-03.04.20	810 000.00	965 925.00	0.02
USD IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 6.12500% 17-15.06.33	3 311 000.00	3 388 187.69	0.06
USD JAMAICA, GOVERNMENT OF 9.25000% 05-17.10.25	496 000.00	589 093.00	0.01
USD JORDAN, KINGDOM OF-REG-S 7.37500% 17-10.10.47	2 100 000.00	2 053 800.00	0.04
USD JSW STEEL LTD-REG-S 5.95000% 19-18.04.24	1 634 000.00	1 693 559.30	0.03

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2022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 KAISA GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 9.37500% 17-30.06.24	1 675 000.00	452 250.00	0.01
USD KAISA GROUP HOLDINGS-REG-S *DEFAULT* 11.70000% 21-11.11.25	200 000.00	52 537.50	0.00
USD KAZAKHSTAN TEMIR ZHOLY FINANCE BV-REG-S 6.95000% 12-10.07.42	2 037 000.00	2 541 539.44	0.05
USD KING POWER CAPITAL LTD-REG-S 5.62500% 14-03.11.24	2 300 000.00	2 500 962.50	0.05
USD KOOKMIN BANK-REG-S-SUB 2.50000% 20-04.11.30	1 061 000.00	1 009 403.57	0.02
USD KUNZHI LTD-REG-S 6.25000% 18-17.10.20	310 000.00	43 400.00	0.00
USD KWG GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 6.00000% 21-14.08.26	2 665 000.00	1 439 100.00	0.03
USD KWG PROPERTY HOLDING LTD-REG-S 7.40000% 20-13.01.27	210 000.00	112 350.00	0.00
USD LAMAR FUNDING LTD-REG-S 3.95800% 15-07.05.25	3 640 000.00	3 596 138.00	0.07
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.75000% 12-29.11.27	825 000.00	85 593.75	0.00
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.00000% 12-27.01.23	564 000.00	58 515.00	0.00
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.20000% 15-26.02.25	4 600 000.00	477 250.00	0.01
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 7.05000% 15-02.11.35	765 000.00	78 412.50	0.00
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.65000% 15-03.11.28	5 549 000.00	575 708.75	0.01
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.65000% 16-22.04.24	390 000.00	40 462.50	0.00
USD LEBANON, REPUBLIC OF *DEFAULTED* 6.85000% 16-25.05.29	5 109 000.00	530 058.75	0.01
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.85000% 17-23.03.27	7 906 000.00	820 247.50	0.01
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 7.25000% 17-23.03.37	693 000.00	75 363.75	0.00
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 7.00000% 17-23.03.32	1 098 000.00	113 917.50	0.00
USD LEBANON, REPUBLIC OF *DEFAULTED* 8.25000% 18-17.05.34	17 049 000.00	1 640 966.25	0.03
USD LEBANON, REPUBLIC OF *DEFAULTED* 8.20000% 18-17.05.33	180 000.00	17 325.00	0.00
USD LIMA METRO LINE 2 FINANCE LTD-REG-S 4.35000% 19-05.04.36	4 350 000.00	4 363 300.26	0.08
USD LIMAK ISKENDERUN ULUSLARARASI-REG-S 9.50000% 21-10.07.36	2 020 000.00	1 984 397.50	0.04
USD LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 3.95000% 19-16.09.29	1 579 000.00	1 529 458.87	0.03
USD MAR SUKUK LTD-REG-S 2.21000% 20-02.09.25	2 091 000.00	2 078 323.31	0.04
USD MARB BONDCO PLC-REG S-3.95000% 21-29.01.31	1 635 000.00	1 499 066.10	0.03
USD MASHREQBANK PSC-REG-S 4.25000% 19-26.02.24	1 101 000.00	1 140 429.56	0.02
USD MELCO RESORTS FINANCE LTD-REG-S 5.25000% 19-26.04.26	1 201 000.00	1 168 618.04	0.02
USD METINVEST BV-REG-S 7.75000% 18-23.04.23	3 166 000.00	2 908 762.50	0.05
USD METINVEST BV-REG-S 7.75000% 19-17.10.29	1 345 000.00	1 149 975.00	0.02
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-144A 5.50000% 16-31.10.46	1 500 000.00	1 397 250.00	0.03
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-144A 3.87500% 17-30.04.28	3 880 000.00	3 918 800.00	0.07
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-REG-S 5.50000% 16-31.10.46	1 561 000.00	1 454 071.50	0.03
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-REG-S 3.87500% 17-30.04.28	840 000.00	848 400.00	0.02
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-REG-S 5.50000% 17-31.07.47	13 057 000.00	12 143 010.00	0.22
USD MINEJESA CAPITAL BV-REG-S 4.62500% 17-10.08.30	5 540 000.00	5 422 884.40	0.10
USD MINEJESA CAPITAL BV-REG-S 5.62500% 17-10.08.37	2 864 000.00	2 827 842.00	0.05
USD MINERA Y METALURGICA DEL BOLEO-REG-S 3.25000% 19-17.04.24	357 000.00	367 776.94	0.01
USD MINMETALS BOUNTEOUS FIN BVI LTD-REG-S 4.20000% 16-27.07.26	3 500 000.00	3 717 315.00	0.07
USD MODERN LAND CHINA CO LTD-REG-S 11.95000% 20-04.03.24	950 000.00	171 000.00	0.00
USD MODERNLA OVE PTE LTD-REG-S 6.95000% 17-30.04.27	883 749.00	400 062.13	0.01
USD MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 5.12500% 20-07.04.26	2 534 000.00	2 559 618.74	0.05
USD MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 4.45000% 21-07.07.31	3 117 000.00	2 899 152.87	0.05
USD MOROCCO, KINGDOM OF THE-REG-S 5.50000% 12-11.12.42	5 809 000.00	6 138 660.75	0.11
USD MOROCCO, KINGDOM OF-REG-S 4.25000% 12-11.12.22	862 000.00	879 132.25	0.02
USD NAKILAT INC-REG-S 6.06700% 06-31.12.33	2 665 000.00	3 079 569.14	0.06
USD NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH GRP-REG-S 2.12500% 20-02.07.25	660 000.00	620 400.00	0.01
USD NWD MTN LTD-REG-S 4.12500% 19-18.07.29	4 374 000.00	4 284 158.04	0.08
USD OI SA (PIK) 10.00000% 18-27.07.25	4 030 000.00	3 344 900.00	0.06
USD OIL INDIA INTERNATIONAL PTE LTD-REG-S 4.00000% 17-21.04.27	1 880 000.00	1 937 340.00	0.04
USD OIL INDIA LTD-REG-S 5.12500% 19-04.02.29	1 953 000.00	2 134 018.68	0.04
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.75000% 20-28.10.27	5 819 000.00	6 379 078.75	0.12
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 7.37500% 20-28.10.32	4 208 000.00	4 770 820.00	0.09
USD OMAN SOVEREIGN SUKUK CO-REG-S 4.87500% 21-15.06.30	1 090 000.00	1 145 862.50	0.02
USD OZTEL HOLDINGS SPC-REG-S 6.62500% 18-24.04.28	2 240 000.00	2 405 760.00	0.04
USD PAKISTAN GLOBAL SUKUK PROGRAMME-REG-S 7.95000% 22-31.01.29	1 200 000.00	1 224 132.00	0.02
USD PANAMA, REPUBLIC OF 8.87500% 97-30.09.27	536 000.00	706 950.50	0.01

USD PANAMA, REPUBLIC OF 7.12500% 05-29.01.26

171 000.00

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

2022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 PANAMA, REPUBLIC OF 6.70000% 06-26.01.36	1 469 000.00	1 869 118.87	0.03
USD PANAMA, REPUBLIC OF 4.30000% 13-29.04.53	832 000.00	825 136.00	0.01
USD PANAMA, REPUBLIC OF 4.00000% 14-22.09.24	276 000.00	288 644.25	0.01
USD PANAMA, REPUBLIC OF 3.75000% 15-16.03.25	510 000.00	531 770.63	0.01
USD PANAMA, REPUBLIC OF 4.50000% 18-16.04.50	3 108 000.00	3 177 541.50	0.06
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 5.00000% 16-15.04.26	5 112 000.00	5 533 101.00	0.10
USD PELABUHAN INDONESIA II PT-REG-S 4.25000% 15-05.05.25	2 400 000.00	2 514 264.00	0.05
USD PERU, REPUBLIC OF 2.39200% 20-23.01.26	2 380 000.00	2 378 958.75	0.04
USD PERU, REPUBLIC OF 2.78300% 20-23.01.31	9 160 000.00	8 864 017.50	0.16
USD PERU, REPUBLIC OF 7.35000% 05-21.07.25	3 455 000.00	4 044 077.50	0.07
USD PERU, REPUBLIC OF 8.75000% 03-21.11.33	1 501 000.00	2 259 286.44	0.04
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 5.37500% 18-25.01.29	1 200 000.00	1 326 132.00	0.02
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 3.87500% 19-17.07.29	2 160 000.00	2 181 330.00	0.04
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 3.80000% 20-23.06.50	815 000.00	790 639.65	0.01
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 2.55000% 21-09.06.31	2 040 000.00	2 004 524.40	0.04
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 9.75000% 12-17.05.35	1 493 000.00	55 987.50	0.00
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 6.00000% 14-16.05.24	33 023 021.00	1 238 363.29	0.02
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 7.75000% 06-14.01.31	522 000.00	728 247.42	0.01
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 6.37500% 09-23.10.34	682 000.00	913 102.52	0.02
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 3.95000% 15-20.01.40	1 859 000.00	1 952 154.49	0.04
USD PHOENIX LEAD LTD-REG-S-SUB 4.85000% 17-PRP	1 280 000.00	1 274 453.08	0.02
USD PIK SECURITIES DAC-REG-S 5.62500% 21-19.11.26	500 000.00	465 000.00	0.01
USD POWER FINANCE CORP LTD-REG-S 4.50000% 19-18.06.29	2 742 000.00	2 848 766.62	0.05
USD POWERLONG REAL ESTATE HOLDINGS-REG-S 5.95000% 20-30.04.25	200 000.00	144 000.00	0.00
USD PTTEP CANADA INTERNATIONAL FIN-REG-S 6.35000% 12-12.06.42	1 020 000.00	1 385 160.00	0.03
USD QATAR, STATE OF-REG-S 4.62500% 16-02.06.46	1 250 000.00	1 507 812.50	0.03
USD QATAR, STATE OF-REG-S 3.25000% 16-02.06.26	1 235 000.00	1 291 501.25	0.02
USD QIB SUKUK LTD-REG-S 1.950000% 20-27.10.25	2 850 000.00	2 814 375.00	0.05
USD QIIB SENIOR SUKUK LTD-REG-S 4.26400% 19-05.03.24	492 000.00	514 755.00	0.01
USD REDSUN PROPERTIES GROUP LTD-REG-S 7.30000% 21-13.01.25	1 150 000.00	310 730.00	0.01
USD REPUBLIC OF AZERBAIJAN-REG-S 3.50000% 17-01.09.32	14 935 000.00	14 746 445.62	0.27
USD RUSSIA, FEDERATION OF-REG-S 4.75000% 16-27.05.26	19 000 000.00	19 437 000.00	0.35
USD RUSSIA, FEDERATION OF-REG-S 4.25000% 17-23.06.27	8 000 000.00	7 992 000.00	0.15
USD RUSSIA, FEDERATION OF-REG-S 12.75000% 98-24.06.28	4 000 000.00	5 896 000.00	0.11
USD RUSSIA, FEDERATION OF-REG-S STEP-UP 00-31.03.30	5 775 070.00	1 215 666.67	0.02
USD RUSSIA, FEDERATION OF-REG-S 5.87500% 13-16.09.43	800 000.00	929 600.00	0.02
USD RZD CAP PLC/RUSSIAN RAILWAYS LPN-REG-S 5.70000% 12-05.04.22	2 850 000.00	2 863 893.75	0.05
USD SABIC CAPTIAL BV-REG-S 2.15000% 20-14.09.30	665 000.00	621 775.00	0.01
USD SAMARCO MINERACAO SA-REG-S 4.12500% 12-01.11.22	18 644 000.00	10 770 405.75	0.20
USD SAMBA FUNDING LTD-REG-S 2.90000% 20-29.01.27	1 100 000.00	1 119 800.00	0.02
USD SANDS CHINA LTD 5.12500% 19-08.08.25	2 549 000.00	2 619 581.81	0.05
USD SAUDI ELECTRICITY GLOBAL SUKIK CO REG-S 5.50000% 14-08.04.44	3 076 000.00	3 770 599.24	0.07
USD SAUDI ELECTRICITY GLOBAL SUKUK CO-REG-S 4.22200% 18-27.01.24	624 000.00	648 960.00	0.01
USD SAUDI ELECTRICITY GLOBAL SUKUK CO-REG-S 4.72300% 18-27.09.28	1 399 000.00	1 569 678.00	0.03
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 5.25000% 19-16.01.50	2 232 000.00	2 809 530.00	0.05
USD SENEGAL, REPUBLIC OF-REG-S 6.25000% 17-23.05.33	3 646 000.00	3 655 115.00	0.07
USD SEPLAT PETROLEUM DEVELOPMENT CO-REG-S 7.75000% 21-01.04.26	5 977 000.00	5 984 471.25	0.11
USD SHANDONG IRON AND STEEL XINHENG-REG-S 6.50000% 20-05.11.23	2 247 000.00	2 323 987.84	0.04
USD SHANDONG IRON AND STEEL XINHENG-REG-S 4.80000% 21-28.07.24	1 408 000.00	1 418 560.00	0.03
USD SHANGHAI PORT GROUP BVI DEVELOP-REG-S 2.85000% 19-11.09.29	300 000.00	303 915.00	0.01
USD SHANGHAI PORT GRP BVI DEP 2 CO LTD-REG-S 20-13.07.30	671 000.00	655 157.69	0.01
USD SHARJAH SUKUK PROGRAM LTD-REG-S 3.23400% 19-23.10.29	1 390 000.00	1 378 532.50	0.03
USD SHARJAH SUKUK PROGRAM LTD 2.94200% 20-10.06.27	1 649 000.00	1 634 571.25	0.03
USD SNB SUKUK LTD-REG-S 2.34200% 22-19.01.27	894 000.00	890 844.18	0.02
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 4.30000% 16-12.10.28	12 951 000.00	12 949 381.13	0.24
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.00000% 16-12.10.46	14 716 000.00	12 637 365.00	0.23
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.87500% 18-22.06.30	1 575 000.00	1 708 185.93	0.03
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 6.30000% 18-22.06.48	2 060 000.00	2 032 705.00	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

2022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 SOUTHERN GAS CORRIDOR CJSC-REG-S 6.87500% 16-24.03.26	29 181 000.00	33 299 168.63	0.61
USD SOVCOMBANK CAP DAC-REG-S-SUB 8.00000% 19-07.04.30	3 730 000.00	3 646 774.38	0.07
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 6.85000% 15-03.11.25	200 000.00	102 475.00	0.00
USD STAR ENERGY GEOTHERMAL DARAJAT II-REG-S 4.85000% 20-14.10.38	2 615 000.00	2 735 616.87	0.05
USD STATE OIL OF THE AZERBAIJAN REP-REG-S 6.95000% 15-18.03.30	11 908 000.00	14 035 066.50	0.26
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 7.95000% 19-11.10.23	1 835 000.00	1 110 175.00	0.02
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 7.50000% 19-01.02.24	1 420 000.00	852 000.00	0.02
USD SURA ASSET MANAGEMENT SA-REG-S 4.87500% 14-17.04.24	405 000.00	421 529.06	0.01
USD SWEIHAN PV POWER CO-REG-S 3.62500% 22-31.01.49	2 950 000.00	2 841 587.50	0.05
USD TALENT YIELD INTERNATIONAL LTD-REG-S 3.12500% 21-06.05.31	1 903 000.00	1 925 841.33	0.04
USD TAQA ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO-REG-S 6.50000% 06-27.10.36	515 000.00	711 923.12	0.01
USD TIANQI FINCO CO LTD-REG-S 3.75000% 17-28.11.22	600 000.00	562 612.50	0.01
USD TIGER HOLDCO PTE LTD-REG-S-144A 13.00000% 21-10.06.23	1 771 068.00	1 789 885.60	0.03
USD TIMES CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 6.20000% 20-22.03.26	3 365 000.00	1 514 552.85	0.03
USD TINGYI CAYMAN ISLANDS HOLD CORP-REG-S 1.62500% 20-24.09.25	755 000.00	730 658.80	0.01
USD TML HOLDINGS PTE LTD-REG-S 4.34000% 21-09.06.26	690 000.00	680 650.50	0.01
USD TNB GLOBAL VENTURES CAPITAL-REG-S 4.85100% 18-01.11.28	2 467 000.00	2 784 317.88	0.05
USD TULLOW OIL PLC-REG-S 7.00000% 18-01.03.25	4 260 000.00	3 578 400.00	0.07
USD TURKEY, REPUBLIC OF 5.75000% 14-22.03.24	1 420 000.00	1 419 378.75	0.03
USD TURKEY, REPUBLIC OF 4.25000% 15-14.04.26	10 050 000.00	9 090 853.13	0.17
USD TURKEY, REPUBLIC OF 6.12500% 18-24.10.28	4 681 000.00	4 332 265.50	0.08
USD TURKEY, REPUBLIC OF 6.37500% 20-14.10.25	3 020 000.00	2 975 266.25	0.05
USD TURKEY, REPUBLIC OF 5.87500% 21-26.06.31	3 572 000.00	3 126 169.75	0.06
USD TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO-REG-S 8.12500% 19-28.03.24	5 050 000.00	5 216 650.00	0.10
USD UNITED BANK FOR AFRICA PLC-REG-S 7.75000% 17-08.06.22	800 000.00	797 900.00	0.01
USD UPL CORP LTD-REG-S 4.62500% 20-16.06.30	2 520 000.00	2 574 022.50	0.05
USD URUGUAY, REPUBLIC OF 7.62500% 06-21.03.36	781 715.00	1 141 939.05	0.02
USD URUGUAY, REPUBLIC OF 5.10000% 14-18.06.50	1 266 915.00	1 573 983.51	0.03
USD URUGUAY, REPUBLIC OF 4.97500% 18-20.04.55	6 819 506.00	8 423 368.57	0.15
USD VALE OVERSEAS LTD 6.87500% 09-10.11.39	1 020 000.00	1 310 011.49	0.02
USD VALE OVERSEAS LTD 8.25000% 04-17.01.34	1 385 000.00	1 875 463.12	0.03
USD VEDANTA RESOURCES FINANCE II PLC-REG-S 9.25000% 19-23.04.26	810 000.00	722 925.00	0.01
USD VEDANTA RESOURCES FINANCE II PLC-REG-S 8.00000% 19-23.04.23	200 000.00	191 412.50	0.00
USD VEDANTA RESOURCES FINANCE II PLC-REG-S 8.95000% 21-11.03.25	1 340 000.00	1 267 975.00	0.02
USD VEDANTA RESOURCES FINANCE II PLC-REG-S 13.87500% 20-21.01.24	1 800 000.00	1 868 400.00	0.03
USD VENEZUELA, REP. OF REG-S *DEFAULTED* 11.75000% 11-21.10.26	4 098 600.00	235 669.50	0.00
USD VENEZUELA, REP. OF-REG-S *DEFAULTED* 9.00000% 08-07.05.23	378 000.00	21 735.00	0.00
USD VENEZUELA, REP. OF-REG-S *DEFAULTED* 9.25000% 08-07.05.28	2 977 000.00	171 177.50	0.00
USD VENEZUELA, REP. OF-REG-S *DEFAULTED* 12.75000% 10-23.08.22	2 305 600.00	132 572.00	0.00
USD VENEZUELA, REP. OF-REG-S *DEFAULTED* 11.95000% 11-05.08.31	6 682 000.00	384 215.00	0.01
USD VENEZUELA, REPUBLIC OF *DEFAULTED* 9.25000% 97-15.09.27	1 002 000.00	57 615.00	0.00
USD VTB BK OJSC VIA VTB CPTL-REG-S-SUB LPN 6.95000% 12-17.10.22	5 600 000.00	5 594 050.00	0.10
USD WANDA GROUP OVERSEAS LTD-REG-S 8.87500% 20-21.03.23	720 000.00	637 344.00	0.01
USD WOORI BANK-REG-S-SUB 4.75000% 14-30.04.24	800 000.00	846 400.00	0.02
USD XIAOMI BEST TIME INTER LTD-REG-S 4.10000% 21-14.07.51	2 079 000.00	2 022 217.31	0.04
USD XINGSHENG BVI CO LTD-REG-S 3.37500% 19-25.07.22	1 445 000.00	1 453 579.69	0.03
USD YUNDA HOLDING INVESTMENT LTD-REG-S 2.25000% 20-19.08.25	2 248 000.00	2 154 528.16	0.04
USD ZAMBIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.37500% 12-20.09.22	10 370 000.00	7 414 550.00	0.14
USD ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 3.00000% 21-13.01.26	783 000.00	772 380.56	0.01
米ドル合計		820 923 586.95	15.00
債券、固定利付債合計		914 822 475.55	16.71
債券、変動利付債			
USD AIRPORT AUTHORITY-REG-S 2.100%/VAR 20-PRP	1 796 000.00	1 763 546.37	0.03
USD BANCO DAVIVIENDA SA-REG-S-SUB 6.650%/VAR 21-PRP	5 717 000.00	5 652 683.75	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

2022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 BANCOLUMBIA SA-SUB 4.625%/VAR 19-18.12.29	5 771 000.00	5 706 509.08	0.10
USD BANK NEGARA INDONESIA PERSERO-REG-S-SUB 4.300%/VAR 21-PRP	4 646 000.00	4 449 056.06	0.08
USD BURGAN BANK SAK-REG-S-SUB 5.749%/VAR 19-PRP	700 000.00	694 225.00	0.01
USD CASHLD FLR REG-S-SUB 4.000%/VAR 21-PRP	6 595 000.00	6 553 834.01	0.12
USD CCB LIFE INSURANCE CO LTD-REG-S-SUB 4.500%/VAR 17-21.04.77	4 169 000.00	4 182 340.80	0.08
USD CELESTIAL MILES LTD-REG-S 5.750%/VAR 19-PRP	1 622 000.00	1 663 036.60	0.03
USD CHINA CONSTRUCTION BK CORP-REG-S-SUB 2.450%/VAR 20-24.06.30	1 458 000.00	1 455 302.70	0.03
USD CHINA MINMETALS CORP-REG-S 3.750%/VAR 17-PRP	8 276 000.00	8 399 699.71	0.15
USD CHINALCO CAPITAL HOLDINGS LTD-REG-S 4.100%/VAR 19-PRP	558 000.00	576 812.58	0.01
USD CLP POWER HK FINANCE LTD-REG-S-SUB 3.550%/VAR 19-PRP	400 000.00	408 223.00	0.01
USD DIANJIAN INTERNATIONAL FINANCE LTD-REG-S 4.600%/VAR 18-PRP	2 044 000.00	2 095 508.80	0.04
USD DIB TIER 1 SUKUK 3 LTD-REG-S-SUB 6.250%/VAR 19-PRP	1 330 000.00	1 399 825.00	0.03
USD ELECT GLOBAL INVESTMENTS LTD-REG-S-SUB 4.100%/VAR 20-PRP	2 660 000.00	2 647 152.20	0.05
USD EMIRATES NBD PJSC-REG-S-SUB 6.125%/VAR 19-PRP	3 358 000.00	3 492 320.00	0.06
USD FIRST ABU DHABI BANK-REG-S-SUB 4.500%/VAR 20-PRP	3 990 000.00	4 104 712.50	0.07
USD GLOBE TELECOM INC-REG-S 4.200%/VAR 21-PRP	3 970 000.00	3 984 887.50	0.07
USD HEUNGKUK LIFE INSURANCE CO-REG-S-SUB 4.475%/VAR 17-09.11.47	3 000 000.00	3 024 937.50	0.05
USD HONG KONG AIRPORT AUTHORITY 2.400%/VAR 20-PRP	670 000.00	647 220.00	0.01
USD INDUSTRIAL & COMM BK OF CHINA-REG-S 3.200%/VAR 21-PRP	560 000.00	564 200.00	0.01
USD JOLLIBEE WORLDWIDE PTE LTD-REG-S 3.900%/VAR 20-PRP	6 060 000.00	5 996 748.75	0.11
USD KAISA GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 10.875%/VAR 20-PRP	920 000.00	147 200.00	0.00
USD KING TALENT MANAGEMENT LTD-REG-S-SUB 5.600%/VAR 17-PRP	400 000.00	370 000.00	0.01
USD MAF GLOBAL SECURITIES LTD-REG-S-SUB 6.375%/VAR 18-PRP	1 520 000.00	1 620 700.00	0.03
USD NBK TIER 1 FINANCING 2 LTD-REG-S-SUB 4.500%/VAR 19-PRP	11 932 000.00	11 971 524.75	0.22
USD NBK TIER 1 FINANCING LTD-REG-S-SUB 3.625%/VAR 21-PRP	3 260 000.00	3 172 387.50	0.06
USD NETWORK 121 LTD-REG-S-SUB 5.650%/VAR 19-PRP	6 341 000.00	6 574 031.75	0.12
USD NETWORK 121 LTD-REG-S-SUB VAR 21-PRP	1 080 000.00	1 056 240.00	0.02
USD NWD FINANCE BVI LTD-REG-S 5.250%/VAR 20-PRP	870 000.00	896 187.00	0.02
USD NWD FINANCE BVI LTD-REG-S 4.125%/VAR 21-PRP	460 000.00	445 050.00	0.01
USD POWERCHINA ROADBRIDGE GRP BRITISH-REG-S 3.080%/VAR 21-PRP	794 000.00	795 982.14	0.01
USD RIYAD BANK 3.174%/VAR 20-25.02.30	430 000.00	430 215.00	0.01
USD RIZAL COMMERCIAL BANKING CORP-REG-S-SUB 6.500%/VAR 20-PRP	1 090 000.00	1 095 313.75	0.02
USD ROYAL CAPITAL BV-REG-S 5.000%/VAR 20-PRP	2 130 000.00	2 222 255.63	0.04
USD SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD-REG-S-SUB 2.875%/VAR 21-PRP	2 030 000.00	1 991 937.50	0.04
USD SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD-REG-S-SUB 5.875%/VAR 18-PRP	1 833 000.00	1 922 702.44	0.03
USD SMC GLOBAL POWER HOLDINGS CORP-REG-S 6.500%/VAR 19-PRP	870 000.00	866 628.75	0.02
USD SMC GLOBAL POWER HOLDINGS CORP-REG-S 7.000%/VAR 20-PRP	1 430 000.00	1 441 440.00	0.03
USD STANDARD BANK GROUP LTD-REG-S-SUB 5.950%/VAR 19-31.05.29	2 161 000.00	2 247 169.87	0.04
USD SUNNY EXPRESS ENTERPRISES CORP-REG-S 3.350%/VAR 19-PRP	840 000.00	849 655.29	0.02
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S VAR 15-31.05.40	19 147 000.00	14 363 840.07	0.26
USD UPL CORP LTD-REG-S-SUB 5.250%/VAR 20-PRP	1 480 000.00	1 466 865.00	0.03
USD URUGUAY, REPUBLIC OF (PIK) 7.87500% 03-15.01.33	2 534 423.00	3 593 019.80	0.07
USD YUZHOU PROPERTIES CO LTD-REG-S 5.375%/VAR 17-PRP	810 000.00	81 000.00	0.00
米ドル合計		129 084 128.15	2.36
債券、変動利付債合計		129 084 128.15	2.36
固定利付ゼロ・クーポン債			
USD ECUADOR SOCIAL BOND SARL-REG-S 0.00000% 20-30.01.35	7 910 000.00	5 212 593.49	0.10
米ドル合計		5 212 593.49	0.10
固定利付ゼロ・クーポン債合計		5 212 593.49	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

2022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、変動利付債			
USD			
USD BANCO MER DEL NORTE SA/GRAN-REG-S-SUB 7.500%/VAR 19-PRP	3 131 000.00	3 193 620.00	0.06
USD BANCO MERCANTIL DEL NOR-REG-S-SUB 6.750%/VAR 19-PRP	4 660 000.00	4 741 550.00	0.09
USD EMIRATES NBD PJSC-REG-S-SUB COCO 6.125%/VAR 20-PRP	1 766 000.00	1 878 600.16	0.04
USD HDFC BANK LTD-REG-S-SUB COCO 3.700%/VAR 21-PRP	5 045 000.00	4 880 785.25	0.09
USD KRUNG THAI/CAYMAN ISLANDS-REG-S-SUB COCO 4.400%/VAR 21-PRP	4 613 000.00	4 563 087.34	0.08
USD YAPI VE KREDI BANKASI AS-REG-S-SUB 13.875%/VAR 19-PRP	7 140 000.00	7 857 612.84	0.14
米ドル合計		27 115 255.59	0.50
転換社債型新株予約権付社債、変動利付債合計		27 115 255.59	0.50
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		4 986 291 916.64	91.08
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 ACU PETROLEO LUXEMBOURG-REG-S 7.50000% 22-13.01.32	1 660 000.00	1 612 690.00	0.03
USD AGROSUPER SA-REG-S 4.60000% 22-20.01.32	1 050 000.00	1 061 707.50	0.02
USD ALFA SAB DE CV-REG-S 6.87500% 14-25.03.44	3 625 000.00	4 471 210.94	0.08
USD BANGKOK BANK PUBLIC CO LTD HK-REG-S-SUB 9.02500% 97-15.03.29	1 580 000.00	2 096 758.75	0.04
USD BRAZIL MINAS SPE-REG-S 5.33300% 13-15.02.28	11 266 000.00	8 008 436.10	0.15
USD C&W SENIOR FIN DESIGNATD ACT V CO-REG-S 6.87500% 17-15.09.27	6 147 000.00	6 405 512.09	0.12
USD CAP SA-REG-S 3.90000% 21-27.04.31	1 500 000.00	1 335 000.00	0.02
USD CELULOSA ARAUCO Y CONSTITUCION SA-REG-S 4.20000% 19-29.01.30	1 670 000.00	1 726 362.50	0.03
USD CELULOSA ARAUCO Y CONSTITUCION SA-REG-S 5.15000% 19-29.01.50	3 465 000.00	3 716 559.00	0.07
USD DIGICEL INTL FINANCE LTD-144A (PIK) 13.00000% 20-31.12.25	1 506 538.00	1 537 610.35	0.03
USD DIGICEL INTL FINANCE LTD-REG-S (PIK) 13.00000% 20-31.12.25	648 575.00	661 951.86	0.01
USD ECOPETROL SA 5.37500% 15-26.06.26	1 202 000.00	1 242 868.00	0.02
USD ECOPETROL SA 5.87500% 14-28.05.45	8 465 000.00	7 443 994.03	0.14
USD ECOPETROL SA 7.37500% 13-18.09.43	1 490 000.00	1 530 323.13	0.03
USD INDIA GREEN ENERGY HOLDINGS-REG-S 5.37500% 20-29.04.24	500 000.00	505 100.00	0.01
USD INRETAIL CONSUMER-REG-S 3.25000% 21-22.03.28	7 884 000.00	7 629 248.26	0.14
USD INVERSIONES CMPC SA-REG-S 4.75000% 14-15.09.24	490 000.00	513 673.12	0.01
USD INVERSIONES CMPC SA-REG-S 3.85000% 20-13.01.30	1 590 000.00	1 602 481.50	0.03
USD KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV-144A 3.80000% 14-08.04.24	140 000.00	145 320.00	0.00
USD KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV-144A 3.25000% 15-12.03.25	307 000.00	315 308.19	0.01
USD METALSA SA DE CV-REG-S 3.75000% 21-04.05.31	1 940 000.00	1 796 682.50	0.03
USD MINERA MEXICO SA DE CV-144A 4.50000% 19-26.01.50	810 000.00	840 780.00	0.01
USD MINERA MEXICO SA DE CV-REG-S 4.50000% 19-26.01.50	4 055 000.00	4 209 090.00	0.08
USD MV24 CAPITAL BV-REG-S 6.74800% 19-01.06.34	17 751 000.00	16 018 372.77	0.29
USD PERU, REPUBLIC OF 5.62500% 10-18.11.50	808 000.00	1 065 954.00	0.02
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 6.85000% 15-05.06.115	5 541 000.00	5 244 556.50	0.10
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	1 022 125.00	0.02
USD SACI FALABELLA-REG-S 3.75000% 17-30.10.27	818 000.00	839 114.63	0.01
USD SAMARCO MINERACAO SA-REG-S *DEFAULT* 5.75000% 13-24.10.23	2 210 000.00	1 388 570.62	0.02
USD SIERRACOL ENERGY ANDINA LLC-REG-S 6.00000% 21-15.06.28	1 500 000.00	1 395 000.00	0.02
USD TRUST F/1401-REG-S 6.95000% 14-30.01.44	1 288 000.00	1 522 486.84	0.03
USD TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO-144A 5.25000% 20-05.02.25	970 000.00	920 469.37	0.02
USD WOORI BANK-REG-S 2.00000% 22-20.01.27	5 895 000.00	5 829 786.56	0.11
米ドル合計		96 459 700.53	1.76
ノート、固定利付債合計		96 459 700.53	1.76

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

2022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 DELTA MERLIN DUNIA TE 0.00000% 21-26.06.32	1 055 000.00	42 503.84	0.00
米ドル合計		42 503.84	0.00
ノート、ゼロ・クーポン合計			0.00
ノート、変動利付債			
USD			
USD BANCO INDUSTRIAL SA/GUATE-REG-S-SUB 4.875%/VAR 21-29.01.31	6 687 000.00	6 568 640.10	0.12
USD BANCO MERCANTILE-REG-S-SUB 6.625%/VAR 21-PRP	1 151 000.00	1 105 431.91	0.02
USD CEMEX SAB DE CV-144A-SUB 5.125%/VAR 21-PRP	900 000.00	901 359.00	0.02
米ドル合計		8 575 431.01	0.16
ノート、変動利付債合計			0.16
中期債券、固定利付債			
USD			
USD JSW INFRASTRUCTURE LTD-REG-S 4.95000% 22-21.01.29	500 000.00	485 406.25	0.01
米ドル合計		485 406.25	0.01
中期債券、固定利付債合計			0.01
債券、固定利付債			
USD			
USD 1MDB GLOBAL INV-REG-S 4.40000% 13-09.03.23	12 000 000.00	11 968 500.00	0.22
USD MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 3.50000% 21-07.07.27	1 851 000.00	1 721 430.00	0.03
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 9.00000% 11-17.11.21	2 611 961.00	97 948.54	0.00
USD TENGIZCHEVROIL FINANCE CO INT-REG-S 4.00000% 16-15.08.26	4 523 000.00	4 649 644.00	0.09
米ドル合計		18 437 522.54	0.34
債券、固定利付債合計			0.34
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		124 000 564.17	2.27
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 ATP TOWER HOLDINGS LLC-144A 4.05000% 21-27.04.26	2 280 000.00	2 234 400.00	0.04
USD COLBUN SA-REG-S 3.15000% 20-06.03.30	1 350 000.00	1 303 003.13	0.02
USD CT TRUST-REG-S 5.12500% 22-03.02.32	7 123 000.00	7 230 272.38	0.13
USD DIGICEL GROUP 0.5 LTD (PIK) 10.00000% 20-01.04.24	2 913 310.00	2 915 130.81	0.05
USD DIGICEL INTERNATIONAL FINANCE LTD-REG-S 8.75000% 20-25.05.24	3 906 100.00	4 003 752.50	0.07
USD FEL ENERGY VI SARL-REG-S 5.75000% 20-01.12.40	5 556 000.00	5 246 642.65	0.10
USD FIRST QUANTUM MINERALS LTD-REG-S 6.87500% 20-15.10.27	2 819 000.00	2 995 187.50	0.05
USD GCC SAB DE CV-REG-S 3.61400% 22-20.04.32	6 895 000.00	6 832 531.30	0.12
USD INTERCHILE SA-144A 4.50000% 21-30.06.56	1 670 000.00	1 713 628.75	0.03
USD JBS USA LUX SA/FOOD/FINANCE INC-REG-S 3.62500% 21-15.01.32	1 400 000.00	1 328 250.00	0.02
USD NATURA COSMETICOS SA-REG-S 4.12500% 21-03.05.28	386 000.00	374 777.05	0.01
USD PRUMO PARTICIPACOES E INVESTIMENT-REG-S 7.50000% 19-31.12.31	4 820 000.00	4 268 911.73	0.08
USD SABLE INTERNATIONAL FINANCE LTD-REG-S 5.75000% 19-07.09.27	2 000 000.00	2 030 000.00	0.04
USD SOCIEDAD DE TRANSMISION AUSTRAL-REG-S 4.00000% 22-27.01.32	1 660 000.00	1 640 287.50	0.03
USD TENGIZCHEVROIL FINANCE CO INTL-REG-S 3.25000% 20-15.08.30	4 465 000.00	4 270 772.50	0.08

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2022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 TENGIZCHEVROIL FINANCE CO INTL-REG-S 2.62500% 20-15.08.25	5 470 000.00	5 319 575.00	0.10
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NETHERLANDS 7.12500% 20-31.01.25	4 726 000.00	4 928 320.06	0.09
USD VTR COMUNICACIONES SPA-REG-S 4.37500% 21-15.04.29	360 000.00	348 912.00	0.01
米ドル合計		58 984 354.86	1.07
ノート、固定利付債合計		58 984 354.86	1.07
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	1 137 549.69	0.02
USD CIA CERVECERIAS UNIDAS SA-144A 3.35000% 22-19.01.32	2 010 000.00	1 984 875.00	0.04
USD CIA CERVECERIAS UNIDAS SA-REG-S 3.35000% 22-19.01.32	2 719 000.00	2 685 012.50	0.05
米ドル合計		5 807 437.19	0.11
債券、固定利付債合計		5 807 437.19	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		64 791 792.05	1.18
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 CIBANCO SA INSTITUCION DE BANCA M-144A 4.37500% 21-22.07.31	2 970 000.00	2 772 866.25	0.05
USD INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP-REG-S 3.82500% 21-26.11.33	495 000.00	495 092.81	0.01
USD JBS USA LUX SA/FOOD/FINANCE INC-REG-S 2.50000% 21-15.01.27	1 531 000.00	1 485 085.31	0.03
USD OCP SA-144A 3.75000% 21-23.06.31	1 770 000.00	1 699 200.00	0.03
米ドル合計		6 452 244.37	0.12
ノート、固定利付債合計		6 452 244.37	0.12
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		6 452 244.37	0.12
投資有価証券合計		5 181 536 517.23	94.65
派生商品			
公認の証券取引所に上場されている派生商品			
債券に係る金融先物			
EUR EURO-BUND FUTURE 08.03.22	-793.00	4 588 365.10	0.09
EUR EURO-BOBL FUTURE 08.03.22	-553.00	1 189 459.47	0.02
EUR EURO-SCHATZ FUTURE 08.03.22	-163.00	66 301.55	0.00
EUR EURO-BUXL FUTURE 08.03.22	-193.00	3 001 903.48	0.06
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 22.03.22	-1 045.00	1 256 267.96	0.02
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 22.03.22	-394.00	418 016.48	0.01
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.22	1 364.00	-1 671 589.62	-0.03
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.22	-173.00	-355 298.09	-0.01
USD US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 22.03.22	592.00	-2 544 655.44	-0.05
USD US LONG BOND FUTURE 22.03.22	630.00	-1 454 688.43	-0.03
債券に係る金融先物合計		4 494 082.46	0.08
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		4 494 082.46	0.08
派生商品合計		4 494 082.46	0.08

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2022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 (日 - 月 - 年)		
USD	4 016 131.18	EUR	3 561 735.00	3.3.2022		
USD	143 874 231.64	EUR	127 509 191.91	10.2.2022		
USD	105 076 514.04	EUR	92 548 550.00	3.3.2022		
EUR	6 600 000.00	USD	7 506 006.42	3.3.2022		
EUR	230 000.00	USD	260 769.58	16.3.2022		
USD	775 064.06	EUR	687 000.00	16.3.2022		
EUR	9 000.00	USD	10 236.58	16.3.2022		
USD	111 230 892.54	EUR	98 082 000.00	16.3.2022		
USD	2 117 734.60	EUR	1 868 000.00	16.3.2022		
USD	906 641.84	EUR	800 000.00	16.3.2022		
EUR	1 102 000.00	USD	1 250 505.52	16.3.2022		
USD	240 322.26	EUR	213 000.00	16.3.2022		
EUR	2 197 175.34	USD	2 479 428.88	10.2.2022		
EUR	1 996 000.00	USD	2 255 665.63	16.3.2022		
USD	962 101.23	EUR	849 000.00	16.3.2022		
EUR	737 000.00	USD	837 181.74	16.3.2022		
USD	477 155.91	EUR	420 000.00	16.3.2022		
EUR	630 000.00	USD	713 793.15	16.3.2022		
USD	4 994 120.49	EUR	4 412 340.20	15.2.2022		
CHF	955 576 601.30	USD	1 037 867 000.00	18.2.2022		
EUR	1 710 889 618.57	USD	1 939 846 000.00	18.2.2022		
GBP	87 607 441.84	USD	118 966 000.00	18.2.2022		
JPY	1 523 508 312.00	USD	13 190 000.00	18.2.2022		
SGD	15 797 858.33	USD	11 662 000.00	18.2.2022		
EUR	1 052 000.00	USD	1 193 267.82	16.3.2022		
USD	15 000 000.00	CHF	13 715 295.00	18.2.2022		
USD	27 000 000.00	EUR	23 705 566.33	18.2.2022		
USD	190 000.00	JPY	21 787 661.00	18.2.2022		
USD	1 800 000.00	GBP	1 325 258.09	18.2.2022		
USD	170 000.00	SGD	229 512.07	18.2.2022		
EUR	1 153 979.34	USD	1 310 430.09	28.2.2022		
USD	2 272.72	EUR	2 000.00	16.3.2022		
EUR	1 122 000.00	USD	1 275 225.59	16.3.2022		
USD	22 147 827.96	EUR	19 520 659.52	28.2.2022		
EUR	250 000.00	USD	283 778.50	28.2.2022		
EUR	1 000.00	USD	1 135.88	16.3.2022		
EUR	206 000.00	USD	233 053.03	16.3.2022		
EUR	9 000.00	USD	10 204.69	16.3.2022		
EUR	5 448 000.00	USD	6 148 547.42	10.2.2022		
先渡為替契約合計					-29 638 143.12	-0.54
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					286 861 788.66*	5.24
当座借越およびその他の短期負債					-1 118 028.59	-0.02
その他の資産および負債					32 407 628.37	0.59
純資産総額					5 474 543 845.01	100.00

* 2022年1月31日現在、モルガン・スタンレーに対する70,000.00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

2022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			
株式			
アメリカ合衆国			
USD GOLDMAN SACHS GRP 5% BDS 31/12/49 USD1000	3 440 000.00	3 376 532.00	0.04
アメリカ合衆国合計		3 376 532.00	0.04
株式合計		3 376 532.00	0.04
アセット・バック証券、変動利付債			
USD			
USD MIDOCEAN CREDIT CLO III -144A 3M LIBOR+112BP 18-21.04.31	3 000 000.00	2 964 440.95	0.04
米ドル合計		2 964 440.95	0.04
アセット・バック証券、変動利付債合計		2 964 440.95	0.04
ノート、固定利付債			
EUR			
EUR THERMO FISHER SCIENTIFIC FINANCE I BV 0.80000% 21-18.10.30	2 385 000.00	2 634 486.49	0.03
ユーロ合計		2 634 486.49	0.03
USD			
USD ABBOTT LABORATORIES 3.40000% 16-30.11.23	716 000.00	739 305.51	0.00
USD ABBOTT LABORATORIES 1.15000% 20-30.01.28	1 450 000.00	1 376 821.89	0.02
USD ABBVIE INC 2.60000% 20-21.11.24	11 825 000.00	12 034 066.00	0.15
USD ABBVIE INC 2.95000% 20-21.11.26	16 040 000.00	16 495 180.07	0.21
USD ABBVIE INC 3.20000% 16-14.05.26	2 480 000.00	2 565 069.26	0.03
USD ABBVIE INC 3.20000% 20-21.11.29	7 325 000.00	7 543 747.58	0.09
USD ABBVIE INC 3.60000% 15-14.05.25	8 700 000.00	9 104 631.70	0.11
USD ABBVIE INC 3.80000% 20-15.03.25	3 500 000.00	3 675 968.35	0.05
USD ABBVIE INC 4.05000% 20-21.11.39	1 730 000.00	1 863 753.19	0.02
USD ABBVIE INC 4.50000% 15-14.05.35	1 500 000.00	1 696 460.27	0.02
USD ABN AMRO BANK NV-144A-SUB 4.75000% 15-28.07.25	2 864 000.00	3 063 970.20	0.04
USD AERCAP IRE CAP LTD/GLB AVIA TRUST 3.65000% 17-21.07.27	4 064 000.00	4 173 706.98	0.05
USD AERCAP IRE CAP LTD/GLB AVIA TRUST 4.45000% 18-01.10.25	2 575 000.00	2 715 789.00	0.03
USD AERCAP IRE CAP LTD/GLB AVIA TRUST 3.15000% 20-15.02.24	1 859 000.00	1 893 954.12	0.02
USD AERCAP IRE CAP LTD/GLB AVIA TRUST 1.75000% 21-30.01.26	4 600 000.00	4 420 892.97	0.06
USD AERCAP IRELAND CAP/ GLBL AVIATION TRUST 6.50000% 20-15.07.25	640 000.00	717 130.78	0.01
USD AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP GLO 2.45000% 21-29.10.26	5 180 000.00	5 092 569.68	0.06
USD AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP GLO 3.00000% 21-29.10.28	10 655 000.00	10 438 257.27	0.13
USD AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP GLO 3.30000% 21-30.01.32	8 218 000.00	8 022 754.61	0.10
USD AETNA INC 3.50000% 14-15.11.24	1 000 000.00	1 039 164.38	0.01
USD AGILENT TECHNOLOGIES INC 2.10000% 20-04.06.30	3 150 000.00	2 954 991.88	0.04
USD AGILENT TECHNOLOGIES INC 2.30000% 21-12.02.31	3 000 000.00	2 852 994.75	0.04
USD AIR LEASE CORP 1.87500% 21-15.08.26	2 990 000.00	2 866 254.58	0.04
USD AIR LEASE CORP 2.10000% 21-01.09.28	3 019 000.00	2 822 474.69	0.04
USD AIR LEASE CORP 2.20000% 22-15.01.27	1 270 000.00	1 233 517.65	0.02
USD AIR LEASE CORP 3.00000% 16-15.09.23	750 000.00	763 824.53	0.01
USD AIR LEASE CORP 3.25000% 18-01.03.25	2 615 000.00	2 664 847.86	0.03
USD AIR LEASE CORP 3.62500% 17-01.12.27	1 604 000.00	1 648 812.41	0.02
USD AIR LEASE CORP 4.62500% 18-01.10.28	3 402 000.00	3 640 150.07	0.05
USD AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC 1.85000% 20-15.05.27	2 385 000.00	2 358 028.35	0.03
USD AIRCASTLE LTD 4.25000% 19-15.06.26	72 000.00	75 636.94	0.00
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC 3.45000% 17-30.04.25	1 015 000.00	1 061 606.71	0.01
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC 4.90000% 20-15.12.30	1 575 000.00	1 838 068.22	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

2022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 ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITY INC 1.87500% 20-01.02.33	3 500 000.00	3 159 775.29	0.04
USD ALIBABA GROUP HOLDING LTD 2.12500% 21-09.02.31	2 991 000.00	2 801 550.06	0.04
USD ALLY FINANCIAL INC 1.45000% 20-02.10.23	4 850 000.00	4 830 879.94	0.06
USD ALLY FINANCIAL INC 2.20000% 21-02.11.28	4 315 000.00	4 111 797.33	0.05
USD ALLY FINANCIAL INC 3.87500% 19-21.05.24	7 070 000.00	7 344 243.75	0.09
USD ALLY FINANCIAL INC 5.80000% 20-01.05.25	7 500 000.00	8 271 517.88	0.10
USD ALPEK SAB DE CV-144A 3.25000% 21-25.02.31	556 000.00	532 821.75	0.01
USD ALPHABET INC 0.45000% 20-15.08.25	1 010 000.00	967 718.68	0.01
USD ALPHABET INC 1.10000% 20-15.08.30	4 000 000.00	3 646 767.00	0.05
USD AMAZON.COM INC 0.80000% 20-03.06.25	2 050 000.00	1 990 967.28	0.03
USD AMAZON.COM INC 1.00000% 21-12.05.26	4 225 000.00	4 099 442.38	0.05
USD AMAZON.COM INC 1.65000% 21-12.05.28	10 000 000.00	9 679 672.00	0.12
USD AMAZON.COM INC 3.15000% 18-22.08.27	8 360 000.00	8 796 483.11	0.11
USD AMAZON.COM INC 3.80000% 14-05.12.24	3 275 000.00	3 459 826.03	0.04
USD AMCOR FINANCE USA INC 3.62500% 20-28.04.26	3 550 000.00	3 738 322.74	0.05
USD AMERICAN ASSETS TRUST LP 3.37500% 21-01.02.31	1 340 000.00	1 330 747.98	0.02
USD AMERICAN CAMPUS COMMUN OPER PARTN 4.12500% 14-01.07.24	585 000.00	615 812.12	0.01
USD AMERICAN CAMPUS COMMUN OPER PARTN 2.25000% 21-15.01.29	3 765 000.00	3 604 459.95	0.05
USD AMERICAN EXPRESS CO 3.70000% 18-03.08.23	12 500 000.00	12 913 135.87	0.16
USD AMERICAN EXPRESS CO 3.12500% 19-20.05.26	11 485 000.00	11 950 122.40	0.15
USD AMERICAN EXPRESS CO 2.50000% 19-30.07.24	1 750 000.00	1 785 237.02	0.02
USD AMERICAN EXPRESS CO 1.65000% 21-04.11.26	3 435 000.00	3 363 636.81	0.04
USD AMERICAN HOMES 4 RENT LP 2.37500% 21-15.07.31	665 000.00	630 817.14	0.01
USD AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC-SUB 3.75000% 15-10.07.25	11 100 000.00	11 728 061.42	0.15
USD AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC 3.90000% 16-01.04.26	1 460 000.00	1 551 064.78	0.02
USD AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC 4.20000% 18-01.04.28	1 755 000.00	1 920 716.63	0.02
USD AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC 4.25000% 19-15.03.29	1 985 000.00	2 181 076.25	0.03
USD AMERICAN INTL GROUP INC 2.50000% 20-30.06.25	6 075 000.00	6 171 624.21	0.08
USD AMERICAN INTL GROUP INC 3.40000% 20-30.06.30	3 500 000.00	3 672 199.79	0.05
USD AMERICAN TOWER CORP 5.00000% 13-15.02.24	4 958 000.00	5 269 223.58	0.07
USD AMERICAN TOWER CORP 4.40000% 16-15.02.26	5 152 000.00	5 513 596.93	0.07
USD AMERICAN TOWER CORP 3.37500% 16-15.10.26	4 480 000.00	4 658 582.52	0.06
USD AMERICAN TOWER CORP 3.00000% 17-15.06.23	2 750 000.00	2 806 390.01	0.04
USD AMERICAN TOWER CORP 3.80000% 19-15.08.29	4 708 000.00	4 966 579.70	0.06
USD AMERICAN TOWER CORP 1.60000% 21-15.04.26	2 400 000.00	2 323 217.90	0.03
USD AMERICAN TOWER CORP 1.45000% 21-15.09.26	4 375 000.00	4 205 050.81	0.05
USD AMERICAN WATER CAPITAL CORP 2.95000% 17-01.09.27	2 505 000.00	2 580 799.12	0.03
USD AMERISOURCEBERGEN CORP 3.45000% 17-15.12.27	1 475 000.00	1 547 281.11	0.02
USD AMERISOURCEBERGEN CORP 0.73700% 21-15.03.23	3 790 000.00	3 766 244.24	0.05
USD AMGEN INC 1.65000% 21-15.08.28	7 550 000.00	7 182 199.71	0.09
USD AMGEN INC 2.20000% 20-21.02.27	5 845 000.00	5 825 106.72	0.07
USD AMGEN INC 2.60000% 16-19.08.26	11 950 000.00	12 200 419.30	0.15
USD AMGEN INC 3.15000% 20-21.02.40	3 820 000.00	3 633 479.33	0.05
USD AMGEN INC 3.20000% 17-02.11.27	2 664 000.00	2 790 941.76	0.04
USD AMPHENOL CORP 2.20000% 21-15.09.31	2 100 000.00	1 991 428.88	0.03
USD ANALOG DEVICES INC 1.70000% 21-01.10.28	14 098 000.00	13 632 912.77	0.17
USD ANALOG DEVICES INC 2.95000% 20-01.04.25	435 000.00	449 799.59	0.01
USD ANTHEM INC 2.37500% 19-15.01.25	3 700 000.00	3 753 090.04	0.05
USD ANTHEM INC 2.87500% 19-15.09.29	2 190 000.00	2 221 052.14	0.03
USD ANTHEM INC 4.10100% 18-01.03.28	2 250 000.00	2 439 324.67	0.03
USD AON CORP / AON GLOBAL HOLDINGS PLC 2.05000% 21-23.08.31	3 430 000.00	3 219 745.67	0.04
USD AON CORP 2.80000% 20-15.05.30	2 050 000.00	2 047 217.88	0.03
USD AON CORP 3.75000% 19-02.05.29	1 620 000.00	1 727 623.76	0.02
USD APPLE INC 1.12500% 20-11.05.25	4 165 000.00	4 086 339.39	0.05
USD APPLE INC 1.20000% 21-08.02.28	1 275 000.00	1 204 829.23	0.02
USD APPLE INC 1.65000% 20-11.05.30	3 705 000.00	3 494 963.44	0.04
USD APPLE INC 2.05000% 19-11.09.26	11 700 000.00	11 751 121.75	0.15
USD APPLE INC 2.75000% 17-13.01.25	2 700 000.00	2 784 841.29	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

2022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 2.85000% 17-11.05.24	3 675 000.00	3 775 999.58	0.05
USD APPLE INC 3.00000% 17-20.06.27	1 085 000.00	1 137 140.11	0.01
USD APPLE INC 3.00000% 17-13.11.27	5 230 000.00	5 456 686.82	0.07
USD APPLE INC 3.25000% 16-23.02.26	3 525 000.00	3 694 682.36	0.05
USD APPLIED MATERIALS INC 1.75000% 20-01.06.30	7 057 000.00	6 695 944.47	0.08
USD ARCELORMITTAL 4.25000% 19-16.07.29	3 945 000.00	4 153 353.98	0.05
USD ASHTEAD CAPITAL INC-144A 1.50000% 21-12.08.26	1 595 000.00	1 536 977.60	0.02
USD ASTRAZENECA FINANCE LLC 2.25000% 21-28.05.31	9 967 000.00	9 740 583.65	0.12
USD ASTRAZENECA FINANCE LLC 1.75000% 21-28.05.28	3 130 000.00	3 026 388.89	0.04
USD ASTRAZENECA PLC 0.70000% 20-08.04.26	6 335 000.00	6 020 662.25	0.08
USD ASTRAZENECA PLC 1.37500% 20-06.08.30	5 700 000.00	5 224 500.53	0.07
USD ASTRAZENECA PLC 3.50000% 18-17.08.23	3 870 000.00	4 000 059.24	0.05
USD AT&T INC 1.65000% 20-01.02.28	3 875 000.00	3 686 522.52	0.05
USD AT&T INC 1.70000% 21-25.03.26	5 050 000.00	4 935 199.61	0.06
USD AT&T INC 2.30000% 20-01.06.27	645 000.00	639 506.19	0.01
USD AT&T INC 2.55000% 21-01.12.33	25 785 000.00	24 236 283.28	0.31
USD AT&T INC 3.50000% 20-01.06.41	1 935 000.00	1 885 893.01	0.02
USD AT&T INC 3.50000% 21-15.09.53	2 275 000.00	2 161 763.58	0.03
USD AT&T INC 4.30000% 18-15.02.30	11 430 000.00	12 572 404.73	0.16
USD AT&T INC 4.35000% 19-01.03.29	10 860 000.00	11 929 161.34	0.15
USD AT&T INC 4.50000% 15-15.05.35	1 615 000.00	1 783 410.78	0.02
USD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK-REG-S-SUB-4.40000% 16-19.05.26	6 800 000.00	7 305 014.24	0.09
USD AUTODESK INC 3.50000% 17-15.06.27	3 522 000.00	3 712 449.33	0.05
USD AUTODESK INC 4.37500% 15-15.06.25	4 540 000.00	4 864 006.82	0.06
USD AUTOZONE INC 3.12500% 19-18.04.24	2 675 000.00	2 762 563.21	0.03
USD AVALON BAY COMMUNITIES INC 3.30000% 19-01.06.29	1 325 000.00	1 396 791.67	0.02
USD AVALONBAY COMMUNITIES INC 2.05000% 21-15.01.32	3 210 000.00	3 041 899.90	0.04
USD AVANGRID INC 3.15000% 17-01.12.24	2 190 000.00	2 256 221.22	0.03
USD AVANGRID INC 3.20000% 20-15.04.25	8 500 000.00	8 789 419.56	0.11
USD AVANGRID INC 3.80000% 19-01.06.29	3 433 000.00	3 667 895.96	0.05
USD AVERY DENNISON CORP 2.25000% 21-15.02.32	2 790 000.00	2 614 935.36	0.03
USD BAIDU INC 2.87500% 17-06.07.22	929 000.00	933 496.36	0.01
USD BAIDU INC 3.07500% 20-07.04.25	406 000.00	415 025.38	0.01
USD BAKER HUGHES A GE CO/ CO-OBLIGATOR 4.48600% 20-01.05.30	5 000 000.00	5 591 566.50	0.07
USD BALTIMORE GAS & ELECTRIC CO 2.40000% 16-15.08.26	3 705 000.00	3 764 537.13	0.05
USD BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 1.12500% 20-18.09.25	6 600 000.00	6 323 209.40	0.08
USD BANCO SANTANDER SA 1.84900% 21-25.03.26	2 600 000.00	2 533 023.19	0.03
USD BANCO SANTANDER SA 2.95800% 21-25.03.31	600 000.00	587 717.40	0.01
USD BANCO SANTANDER SA 2.70600% 19-27.06.24	1 800 000.00	1 832 967.05	0.02
USD BANCO SANTANDER SA 4.25000% 17-11.04.27	800 000.00	860 095.27	0.01
USD BANCO SANTANDER SA-SUB 5.17900% 15-19.11.25	7 600 000.00	8 270 747.35	0.10
USD BANCO SANTANDER SA-SUB 2.74900% 20-03.12.30	800 000.00	753 046.02	0.01
USD BANK OF NOVA SCOTIA 1.05000% 21-02.03.26	5 325 000.00	5 108 488.64	0.06
USD BANK OF NOVA SCOTIA-SUB 4.50000% 15-16.12.25	13 751 000.00	14 818 143.46	0.19
USD BANK OF NOVA SCOTIA/THE 0.65000% 21-31.07.24	12 255 000.00	11 938 692.20	0.15
USD BARCLAYS PLC 3.65000% 15-16.03.25	8 000 000.00	8 316 066.24	0.10
USD BARCLAYS PLC 4.33700% 17-10.01.28	900 000.00	963 627.75	0.01
USD BARCLAYS PLC 4.37500% 16-12.01.26	5 040 000.00	5 382 875.89	0.07
USD BARCLAYS PLC-SUB 4.83600% 17-09.05.28	1 580 000.00	1 700 933.24	0.02
USD BARCLAYS PLC-SUB 5.20000% 16-12.05.26	5 350 000.00	5 850 653.00	0.07
USD BAXALTA INC 4.00000% 16-23.06.25	893 000.00	944 938.22	0.01
USD BECTON DICKINSON AND CO 3.73400% 14-15.12.24	2 510 000.00	2 627 779.01	0.03
USD BECTON DICKINSON AND CO 3.36300% 17-06.06.24	2 876 000.00	2 971 024.88	0.04
USD BECTON DICKINSON AND CO 1.95700% 21-11.02.31	2 650 000.00	2 459 531.62	0.03
USD BEMIS CO INC 2.63000% 20-19.06.30	5 670 000.00	5 568 076.70	0.07
USD BIDVEST GROUP UK PLC/THE-144A 3.625000% 21-23.09.26	951 000.00	936 735.00	0.01
USD BLOCK FINANCIAL CORP 2.50000% 21-15.07.28	3 510 000.00	3 417 508.17	0.04
USD BMW US CAPITAL LLC-REG-S 3.80000% 20-06.04.23	2 750 000.00	2 830 047.47	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

2022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 CIGNA CORP 4.37500% 19-15.10.28	20 207 000.00	22 237 966.77	0.28
USD CIT GROUP INC 5.25000% 18-07.03.25	984 000.00	1 072 434.79	0.01
USD CITIGROUP INC 3.20000% 16-21.10.26	4 505 000.00	4 669 259.69	0.06
USD CITIGROUP INC 3.40000% 16-01.05.26	1 800 000.00	1 890 522.07	0.02
USD CITIGROUP INC 3.70000% 16-12.01.26	2 481 000.00	2 628 340.96	0.03
USD CITIGROUP INC-SUB 4.40000% 15-10.06.25	10 912 000.00	11 622 072.43	0.15
USD CITIGROUP INC-SUB 4.45000% 15-29.09.27	26 993 000.00	29 355 911.61	0.37
USD CITIZENS BANK NA/PROVIDENCE RI 2.25000% 20-28.04.25	3 200 000.00	3 222 533.89	0.04
USD CITIZENS FINANCIAL GROUP INC-SUB 4.30000% 15-03.12.25	7 323 000.00	7 844 016.87	0.10
USD CNA FINANCIAL CORP 3.90000% 19-01.05.29	1 440 000.00	1 560 648.57	0.02
USD COACH INC 3.05000% 21-15.03.32	685 000.00	660 762.15	0.01
USD COACH INC 4.12500% 17-15.07.27	904 000.00	955 994.19	0.01
USD COLORADO INTERSTATE GAS/ ISSUING-REG-S 4.15000% 16-15.08.26	5 030 000.00	5 368 815.67	0.07
USD COMCAST CORP 1.95000% 20-15.01.31	1 750 000.00	1 652 377.91	0.02
USD COMCAST CORP 2.65000% 19-01.02.30	6 945 000.00	6 980 128.44	0.09
USD COMCAST CORP 3.55000% 18-01.05.28	2 926 000.00	3 118 306.99	0.04
USD COMCAST CORP 3.95000% 18-15.10.25	8 321 000.00	8 901 564.08	0.11
USD COMCAST CORP 4.15000% 18-15.10.28	2 800 000.00	3 082 361.83	0.04
USD COMCAST CORP 4.25000% 18-15.10.30	3 775 000.00	4 217 106.03	0.05
USD COMCAST CORP 4.40000% 15-15.08.35	2 930 000.00	3 348 515.93	0.04
USD CONAGRA BRANDS INC 4.30000% 18-01.05.24	2 110 000.00	2 220 644.62	0.03
USD CONAGRA BRANDS INC 4.85000% 18-01.11.28	2 720 000.00	3 042 991.21	0.04
USD CONAGRA INC 4.60000% 18-01.11.25	7 395 000.00	7 976 065.31	0.10
USD CONOCOPHILLIPS 6.95000% 99-15.04.29	6 000 000.00	7 687 342.86	0.10
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-144A 3.00000% 19-30.09.29	4 321 000.00	4 259 695.81	0.05
USD CREDIT SUISSE FIRST BOSTON NY 1.25000% 21-07.08.26	5 720 000.00	5 449 734.75	0.07
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-144A 4.28200% 17-09.01.28	4 300 000.00	4 563 975.50	0.06
USD CREDIT SUISSE GROUP AG 3.75000% 16-26.03.25	7 360 000.00	7 658 773.91	0.10
USD CREDIT SUISSE-REG-S-SUB 6.50000% 13-08.08.23	2 400 000.00	2 560 608.00	0.03
USD CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 3.70000% 16-15.05.26	2 250 000.00	2 360 225.27	0.03
USD CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 3.65000% 17-01.09.27	4 010 000.00	4 204 492.05	0.05
USD CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 3.30000% 20-01.07.30	2 280 000.00	2 313 735.95	0.03
USD CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 1.35000% 20-15.07.25	6 910 000.00	6 701 161.77	0.08
USD CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 1.05000% 21-15.07.26	14 385 000.00	13 574 640.45	0.17
USD CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 2.50000% 21-15.07.31	3 740 000.00	3 571 544.41	0.03
USD CSX CORP 2.60000% 16-01.11.26	2 000 000.00	2 043 600.04	0.03
USD CSX CORP 3.25000% 17-01.06.27	3 145 000.00	3 287 353.96	0.04
USD CSX CORP 4.25000% 18-15.03.29	10 000 000.00	11 011 374.20	0.14
USD CUBESMART LP 2.25000% 21-15.12.28	980 000.00	951 301.81	0.01
USD CUBESMART LP 4.37500% 19-15.02.29	1 315 000.00	1 452 315.17	0.02
USD CVS HEALTH CORP 1.30000% 20-21.08.27	14 850 000.00	13 978 258.37	0.18
USD CVS HEALTH CORP 2.12500% 21-15.09.31	4 390 000.00	4 136 843.01	0.05
USD CVS HEALTH CORP 2.62500% 19-15.08.24	1 700 000.00	1 734 092.26	0.02
USD CVS HEALTH CORP 3.62500% 20-01.04.27	8 064 000.00	8 536 284.37	0.11
USD CVS HEALTH CORP 3.75000% 20-01.04.30	6 000 000.00	6 379 713.36	0.08
USD CVS HEALTH CORP 3.87500% 15-20.07.25	5 979 000.00	6 325 370.83	0.08
USD CVS HEALTH CORP 4.30000% 18-25.03.28	7 222 000.00	7 872 510.68	0.10
USD CVS HEALTH CORP 4.78000% 18-25.03.38	1 020 000.00	1 176 456.89	0.01
USD CVS HEALTH CORP 5.00000% 16-01.12.24	1 830 000.00	1 974 004.29	0.02
USD CVS HEALTH CORP 5.05000% 18-25.03.48	2 830 000.00	3 465 767.82	0.04
USD DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA-REG-S 1.75000% 20-10.03.23	3 860 000.00	3 881 629.13	0.05
USD DANSKE BANK AS-144A 5.37500% 19-12.01.24	1 850 000.00	1 967 394.48	0.02
USD DDR CORP 3.62500% 15-01.02.25	3 859 000.00	3 992 563.54	0.05
USD DDR CORP 4.25000% 15-01.02.26	125 000.00	131 366.37	0.00
USD DDR CORP 4.70000% 17-01.06.27	5 843 000.00	6 350 589.06	0.08
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 6.02000% 21-15.06.26	5 673 000.00	6 438 321.28	0.08
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 6.20000% 21-15.07.30	3 750 000.00	4 554 300.00	0.06
USD DELTA AIR LINES INC 7.37500% 20-15.01.26	1 955 000.00	2 226 209.01	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

2022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 DENSO CORP-144A 1.23900% 21-16.09.26	5 000 000.00	4 813 811.50	0.06
USD DENTSPLY INTERNATIONAL INC 3.25000% 20-01.06.30	4 250 000.00	4 368 956.10	0.05
USD DH EUROPE FINANCE II SARL 2.20000% 19-15.11.24	5 265 000.00	5 319 082.24	0.07
USD DICK ' S SPORTING GOODS INC 3.15000% 22-15.01.32	5 250 000.00	5 135 141.76	0.06
USD DISCOVER BANK 4.20000% 13-08.08.23	1 750 000.00	1 820 432.15	0.02
USD DISCOVER BANK 4.65000% 18-13.09.28	3 560 000.00	3 929 245.33	0.05
USD DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC 2.95000% 17-20.03.23	709 000.00	720 318.62	0.01
USD DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC 3.95000% 17-20.03.28	5 750 000.00	6 063 416.46	0.08
USD DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC 4.12500% 19-15.05.29	7 596 000.00	8 109 743.07	0.10
USD DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC 3.62500% 20-15.05.30	4 350 000.00	4 483 303.67	0.06
USD DOLLAR GENERAL CORP 3.50000% 20-03.04.30	4 520 000.00	4 719 747.44	0.06
USD DOLLAR TREE INC 2.65000% 21-01.12.31	2 340 000.00	2 258 801.37	0.03
USD DOLLAR TREE INC 4.00000% 18-15.05.25	12 700 000.00	13 393 757.31	0.17
USD DOLLAR TREE INC 4.20000% 18-15.05.28	688 000.00	746 879.03	0.01
USD DOW CHEMICAL CO 3.62500% 19-15.05.26	670 000.00	707 149.71	0.01
USD DOW CHEMICAL CO 4.55000% 19-30.11.25	91 000.00	98 454.28	0.00
USD DR HORTON INC 2.50000% 19-15.10.24	4 600 000.00	4 661 998.39	0.06
USD DUKE REALTY LP 1.75000% 21-01.02.31	3 450 000.00	3 180 313.91	0.04
USD DUPONT DE NEMOURS INC 4.49300% 18-15.11.25	7 498 000.00	8 107 906.14	0.10
USD DXC TECHNOLOGY CO 1.80000% 21-15.09.26	3 960 000.00	3 830 850.30	0.05
USD EBAY INC 2.70000% 20-11.03.30	1 800 000.00	1 785 667.97	0.02
USD EBAY INC 3.60000% 17-05.06.27	6 495 000.00	6 883 796.35	0.09
USD ECOLAB INC 4.80000% 20-24.03.30	2 625 000.00	3 072 848.23	0.04
USD ELANCO ANIMAL HEALTH INC 4.90000% 19-28.08.28	2 565 000.00	2 795 850.00	0.04
USD EMPRESA DE TRANSPORTE DE PASA MET-144A 3.65000% 20-07.05.30	200 000.00	208 100.00	0.00
USD EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO-REG-S 3.75000% 16-05.08.26	213 000.00	216 101.82	0.00
USD EMPRESAS PUBLICAS DE MEDELLIN ESP-144A 4.25000% 19-18.07.29	1 131 000.00	1 034 723.63	0.01
USD ENABLE MIDSTREAM PARTNERS LP 4.40000% 17-15.03.27	3 134 000.00	3 333 203.69	0.04
USD ENABLE MIDSTREAM PARTNERS LP 4.95000% 18-15.05.28	290 000.00	315 115.95	0.00
USD ENBRIDGE INC 0.55000% 21-04.10.23	12 000 000.00	11 797 800.96	0.15
USD ENBRIDGE INC 1.60000% 21-04.10.26	12 265 000.00	11 881 537.96	0.15
USD ENBRIDGE INC 3.12500% 19-15.11.29	3 025 000.00	3 090 686.18	0.04
USD ENERSIS AMERICAS SA 4.00000% 16-25.10.26	686 000.00	720 660.15	0.01
USD ENI SPA-144A 4.00000% 18-12.09.23	2 185 000.00	2 264 349.02	0.03
USD ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC 3.12500% 19-31.07.29	2 000 000.00	2 054 567.50	0.03
USD ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LP 2.80000% 20-31.01.30	3 550 000.00	3 569 657.98	0.03
USD EOG RESOURCES INC 4.37500% 20-15.04.30	1 314 000.00	1 472 627.78	0.02
USD EQT CORP 3.00000% 17-01.10.22	1 290 000.00	1 295 798.55	0.02
USD EQT MIDSTREAM PARTNERS LP 4.75000% 18-15.07.23	906 000.00	917 325.00	0.01
USD EQUIFAX INC 2.35000% 21-15.09.31	1 860 000.00	1 750 043.18	0.02
USD EQUIFAX INC 2.60000% 19-01.12.24	3 385 000.00	3 442 421.35	0.04
USD EQUIFAX INC 3.10000% 20-15.05.30	2 000 000.00	2 007 288.48	0.03
USD EQUINIX INC 1.00000% 20-15.09.25	6 425 000.00	6 151 132.83	0.08
USD EQUINIX INC 1.45000% 21-15.05.26	3 775 000.00	3 640 285.77	0.05
USD EQUINIX INC 1.55000% 20-15.03.28	5 000 000.00	4 678 166.50	0.06
USD EQUINIX INC 2.00000% 21-15.05.28	4 845 000.00	4 626 219.23	0.06
USD EQUINIX INC 2.62500% 19-18.11.24	1 937 000.00	1 965 352.95	0.02
USD EQUINOR ASA 1.75000% 20-22.01.26	7 053 000.00	6 979 970.63	0.09
USD ERAC USA FINANCE LLC-REG-S 2.70000% 16-01.11.23	3 500 000.00	3 560 361.21	0.04
USD ERP OPERATING LP 1.85000% 21-01.08.31	4 615 000.00	4 340 021.69	0.05
USD ERP OPERATING LP 3.25000% 17-01.08.27	1 460 000.00	1 531 211.94	0.02
USD ESSENTIAL UTILITIES INC 2.70400% 20-15.04.30	2 120 000.00	2 103 649.84	0.03
USD ESSEX PORTFOLIO LP 1.70000% 21-01.03.28	1 000 000.00	948 078.37	0.01
USD EVERSOURCE ENERGY 1.65000% 20-15.08.30	2 750 000.00	2 509 451.50	0.03
USD EVERSOURCE ENERGY 1.40000% 21-15.08.26	10 000 000.00	9 643 221.00	0.12
USD EVERSOURCE ENERGY 2.90000% 17-01.10.24	5 000 000.00	5 111 236.45	0.06
USD EXPEDIA GROUP INC 2.95000% 21-15.03.31	3 075 000.00	2 957 563.66	0.04
USD FEDEX CORP 3.10000% 19-05.08.29	8 250 000.00	8 465 247.62	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 - US マルチ・クレジット

2022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 FEDEX CORP 3.25000% 16-01.04.26	2 000 000.00	2 105 034.46	0.03
USD FIDELITY NATIONAL INFO SERVICES 1.65000% 21-01.03.28	7 850 000.00	7 432 110.36	0.09
USD FIFTH THIRD BANCORP 2.55000% 20-05.05.27	2 855 000.00	2 888 575.31	0.04
USD FISERV INC 2.25000% 20-01.06.27	3 750 000.00	3 711 538.84	0.05
USD FISERV INC 3.20000% 19-01.07.26	4 087 000.00	4 235 608.83	0.05
USD FISERV INC 3.50000% 19-01.07.29	8 175 000.00	8 483 354.13	0.11
USD FLOWSERVE CORP 2.80000% 21-15.01.32	7 031 000.00	6 618 561.54	0.08
USD FMC CORP 3.45000% 19-01.10.29	1 847 000.00	1 919 483.89	0.02
USD FNB CORP/PA 2.20000% 20-24.02.23	1 890 000.00	1 903 460.15	0.02
USD FORD MOTOR CO 3.25000% 21-12.02.32	2 575 000.00	2 449 700.50	0.03
USD FORD MOTOR CO 5.29100% 16-08.12.46	570 000.00	625 575.00	0.01
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.08700% 20-09.01.23	3 125 000.00	3 132 812.50	0.04
USD FORD MOTOR CREDIT CO 2.90000% 21-16.02.28	4 085 000.00	3 887 286.00	0.05
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.62500% 21-17.06.31	1 025 000.00	1 009 625.00	0.01
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.30000% 22-10.02.25	13 700 000.00	13 440 796.00	0.17
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.25000% 12-20.09.22	4 495 000.00	4 554 839.68	0.06
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.37500% 13-06.08.23	5 700 000.00	5 819 130.00	0.07
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.09600% 16-04.05.23	6 200 000.00	6 255 986.00	0.08
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.81000% 17-09.01.24	2 605 000.00	2 634 306.25	0.03
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.33900% 17-28.03.22	3 495 000.00	3 496 747.50	0.04
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.97900% 17-03.08.22	3 850 000.00	3 861 665.50	0.05
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.35000% 19-01.11.22	3 200 000.00	3 221 824.00	0.04
USD FORTIS INC 3.05500% 17-04.10.26	1 154 000.00	1 184 211.63	0.01
USD FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC 3.25000% 19-15.09.29	4 400 000.00	4 508 323.65	0.06
USD FOX CORP 3.05000% 20-07.04.25	2 216 000.00	2 278 136.84	0.03
USD FOX CORP 4.03000% 20-25.01.24	2 500 000.00	2 613 084.27	0.03
USD FREEPORT-MCMORAN INC 5.25000% 19-01.09.29	4 503 000.00	4 755 483.21	0.06
USD FREEPORT-MCMORAN INC 4.37500% 20-01.08.28	5 700 000.00	5 876 415.00	0.07
USD FS KKR CAPITAL CORP 4.75000% 15-15.05.22	6 000 000.00	6 046 520.58	0.08
USD GENERAL MILLS INC 2.25000% 21-14.10.31	9 620 000.00	9 240 198.65	0.12
USD GENERAL MOTORS CO 4.20000% 17-01.10.27	2 200 000.00	2 349 286.54	0.03
USD GENERAL MOTORS CO 5.00000% 14-01.04.35	925 000.00	1 042 368.17	0.01
USD GENERAL MOTORS CO 6.80000% 20-01.10.27	3 173 000.00	3 809 813.68	0.05
USD GENERAL MOTORS CO 6.12500% 20-01.10.25	1 485 000.00	1 674 202.19	0.02
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 4.00000% 15-15.01.25	1 870 000.00	1 962 128.94	0.02
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 3.15000% 17-30.06.22	1 155 000.00	1 164 551.80	0.01
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO 3.85000% 18-05.01.28	3 510 000.00	3 701 347.61	0.05
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 4.15000% 18-19.06.23	2 525 000.00	2 605 715.87	0.03
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 2.90000% 20-26.02.25	818 000.00	833 402.94	0.01
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 2.750000% 20-20.06.25	3 410 000.00	3 453 080.07	0.04
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO LTD 3.60000% 20-21.06.30	2 365 000.00	2 424 666.49	0.03
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 2.70000% 20-20.08.27	8 200 000.00	8 149 979.67	0.10
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 1.25000% 21-08.01.26	2 775 000.00	2 653 199.56	0.03
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 2.40000% 21-10.04.28	2 450 000.00	2 376 438.85	0.03
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 3.10000% 22-12.01.32	2 125 000.00	2 080 499.97	0.03
USD GENPACT LUXEMBOURG SARL 3.37500% 19-01.12.24	2 355 000.00	2 435 559.67	0.03
USD GENUINE PARTS 1.75000% 22-01.02.25	3 959 000.00	3 934 290.06	0.05
USD GILEAD SCIENCES INC 3.65000% 15-01.03.26	814 000.00	860 044.59	0.01
USD GILEAD SCIENCES INC 2.95000% 16-01.03.27	5 245 000.00	5 410 612.92	0.07
USD GILEAD SCIENCES INC 0.75000% 20-29.09.23	2 956 000.00	2 923 427.18	0.04
USD GILEAD SCIENCES INC 1.20000% 20-01.10.27	7 880 000.00	7 424 889.81	0.09
USD GILEAD SCIENCES INC 1.65000% 20-01.10.30	3 200 000.00	2 962 341.70	0.04
USD GLAXOSMITHKLINE CAPITAL INC 3.37500% 18-15.05.23	2 675 000.00	2 749 428.98	0.03
USD GLENORE FUNDING LLC-144A 1.62500% 20-01.09.25	10 500 000.00	10 279 732.47	0.13
USD GLOBAL PAYMENTS INC 2.65000% 19-15.02.25	530 000.00	535 432.58	0.01
USD GLOBAL PAYMENTS INC 3.20000% 19-15.08.29	6 895 000.00	6 970 548.44	0.09
USD GLOBAL PAYMENTS INC 2.15000% 21-15.01.27	4 370 000.00	4 282 409.51	0.05
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC-SUB 4.25000% 15-21.10.25	13 240 000.00	14 147 745.25	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

2022年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD UNITED AIRLINES INC-144A 4.62500% 21-15.04.29	1 565 000.00	1 548 520.55	0.02
USD UNITED RENTALS NORTH AMERICA INC 3.87500% 19-15.11.27	5 145 000.00	5 296 520.25	0.07
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 3.37500% 17-15.04.27	2 315 000.00	2 460 291.30	0.03
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 3.85000% 18-15.06.28	5 611 000.00	6 105 913.32	0.08
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 2.37500% 19-15.08.24	1 640 000.00	1 672 712.82	0.02
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 2.30000% 21-15.05.31	4 785 000.00	4 645 849.52	0.06
USD UNUM GROUP 4.00000% 19-15.06.29	1 240 000.00	1 335 896.05	0.02
USD US BANCORP 2.40000% 19-30.07.24	2 915 000.00	2 969 514.87	0.04
USD VALERO ENERGY CORP 2.85000% 20-15.04.25	4 375 000.00	4 465 020.13	0.06
USD VALERO ENERGY CORP 4.00000% 19-01.04.29	2 530 000.00	2 674 496.75	0.03
USD VENTAS REALITY LP 3.75000% 14-01.05.24	535 000.00	554 455.91	0.01
USD VENTAS REALTY LP 2.50000% 21-01.09.31	1 295 000.00	1 239 096.61	0.02
USD VENTAS REALTY LP 3.85000% 17-01.04.27	2 296 000.00	2 449 569.18	0.03
USD VEON HOLDINGS BV-144A 3.37500% 20-25.11.27	2 815 000.00	2 562 860.45	0.03
USD VERISIGN INC 5.25000% 15-01.04.25	7 748 000.00	8 434 240.36	0.11
USD VERISK ANALYTICS INC 4.12500% 19-15.03.29	2 190 000.00	2 366 451.37	0.03
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 4.27200% 15-15.01.36	245 000.00	274 727.88	0.00
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.62500% 16-15.08.26	10 000 000.00	10 172 563.20	0.13
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 4.50000% 17-10.08.33	5 305 000.00	5 996 786.32	0.08
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.87500% 19-08.02.29	1 275 000.00	1 372 987.59	0.02
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 4.01600% 19-03.12.29	4 828 000.00	5 242 856.77	0.07
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.15000% 20-22.03.30	5 320 000.00	5 472 942.81	0.07
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.00000% 20-22.03.27	1 436 000.00	1 477 347.70	0.02
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.50000% 20-18.09.30	3 310 000.00	3 001 644.04	0.04
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.65000% 20-20.11.40	1 555 000.00	1 387 249.45	0.02
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.10000% 21-22.03.28	15 139 000.00	14 754 759.00	0.19
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.55000% 21-21.03.31	12 375 000.00	12 084 089.24	0.15
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.40000% 21-22.03.41	3 000 000.00	2 970 737.49	0.04
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.85000% 21-03.09.41	950 000.00	886 802.74	0.01
USD VF CORP 2.40000% 20-23.04.25	3 293 000.00	3 344 289.89	0.04
USD VF CORP 2.95000% 20-23.04.30	6 283 000.00	6 352 393.16	0.08
USD VIACOMCBS INC 3.87500% 14-01.04.24	1 000 000.00	1 042 278.29	0.01
USD VIACOMCBS INC 4.20000% 20-19.05.32	3 440 000.00	3 732 708.13	0.05
USD VIACOMCBS INC 4.75000% 20-15.05.25	5 150 000.00	5 537 855.82	0.07
USD VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC-144A 5.50000% 19-15.05.29	500 000.00	509 524.75	0.01
USD VMWARE INC 1.00000% 21-15.08.24	3 750 000.00	3 659 017.65	0.05
USD VMWARE INC 1.40000% 21-15.08.26	6 670 000.00	6 389 183.79	0.08
USD VMWARE INC 1.80000% 21-15.08.28	6 545 000.00	6 200 075.23	0.08
USD VMWARE INC 2.20000% 21-15.08.31	4 050 000.00	3 781 790.17	0.05
USD VODAFONE GROUP PLC 4.37500% 18-30.05.28	5 000 000.00	5 468 135.51	0.07
USD VODAFONE GROUP PLC 7.87500% 00-15.02.30	5 000 000.00	6 774 545.65	0.09
USD WABTEC CORP/DE 3.45000% 17-15.11.26	4 065 000.00	4 215 061.83	0.05
USD WAL-MART STORES INC 1.80000% 21-22.09.31	3 605 000.00	3 438 390.85	0.04
USD WALT DISNEY CO 1.75000% 19-30.08.24	2 800 000.00	2 805 873.39	0.04
USD WALT DISNEY CO 1.75000% 20-13.01.26	3 310 000.00	3 279 183.90	0.04
USD WALT DISNEY CO 2.20000% 20-13.01.28	2 705 000.00	2 680 527.73	0.03
USD WALT DISNEY CO 2.65000% 20-13.01.31	7 225 000.00	7 190 281.99	0.09
USD WALT DISNEY CO 3.00000% 19-15.09.22	3 092 000.00	3 133 228.48	0.04
USD WALT DISNEY CO 3.35000% 20-24.03.25	1 998 000.00	2 082 647.10	0.03
USD WALT DISNEY CO 3.70000% 19-15.09.24	1 600 000.00	1 672 386.37	0.02
USD WALT DISNEY CO 3.70000% 19-15.10.25	2 100 000.00	2 221 813.74	0.03
USD WASTE CONNECTIONS INC 2.60000% 20-01.02.30	3 250 000.00	3 194 192.43	0.04
USD WASTE MANAGEMENT INC 1.15000% 20-15.03.28	1 275 000.00	1 182 854.57	0.01
USD WASTE MANAGEMENT INC 2.00000% 21-01.06.29	1 225 000.00	1 190 426.63	0.00
USD WELLS FARGO & CO 3.00000% 16-23.10.26	4 164 000.00	4 278 220.52	0.05
USD WELLS FARGO & CO-SUB 4.12500% 13-15.08.23	4 230 000.00	4 395 519.26	0.06
USD WELLTOWER INC 2.75000% 20-15.01.31	825 000.00	814 071.14	0.01
USD WELLTOWER INC 3.10000% 19-15.01.30	5 040 000.00	5 122 085.62	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

2022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	WELLTOWER INC 3.62500% 19-15.03.24	2 856 000.00	2 960 727.40	0.04
USD	WELLTOWER INC 4.00000% 15-01.06.25	9 140 000.00	9 697 303.73	0.12
USD	WESTERN DIGITAL CORP 4.75000% 18-15.02.26	2 515 000.00	2 639 278.73	0.03
USD	WESTERN DIGITAL CORP 2.85000% 21-01.02.29	3 700 000.00	3 570 796.00	0.04
USD	WESTERN DIGITAL CORP 3.10000% 21-01.02.32	1 751 000.00	1 671 452.07	0.02
USD	WESTERN GAS PARTNERS LP 4.65000% 16-01.07.26	3 845 000.00	4 024 215.45	0.05
USD	WESTERN GAS PARTNERS LP 4.50000% 18-01.03.28	1 005 000.00	1 057 059.00	0.01
USD	WESTERN MIDSTREAM OPERATING LP 4.05000% 20-01.02.30	3 210 000.00	3 346 425.00	0.04
USD	WESTERN UNION CO 2.85000% 19-10.01.25	7 398 000.00	7 537 582.80	0.09
USD	WESTERN UNION CO/THE 1.35000% 21-15.03.26	6 675 000.00	6 417 018.32	0.08
USD	WEYERHAEUSER CO 4.00000% 20-15.04.30	4 240 000.00	4 580 553.41	0.06
USD	WILLIAMS COMPANIES INC 4.55000% 14-24.06.24	8 150 000.00	8 601 338.12	0.11
USD	WILLIAMS COS INC/THE 3.75000% 17-15.06.27	10 125 000.00	10 657 417.26	0.13
USD	WILLIAMS COS INC/THE 4.50000% 13-15.11.23	2 940 000.00	3 077 550.25	0.04
USD	WILLIAMS COS INC/THE 4.30000% 14-04.03.24	2 620 000.00	2 743 391.60	0.03
USD	WILLIAMS COS INC/THE 3.90000% 14-15.01.25	1 000 000.00	1 052 774.82	0.01
USD	WILLIS NORTH AMERICA INC 3.60000% 17-15.05.24	1 215 000.00	1 259 752.81	0.02
USD	WIPRO IT SERVICES LLC-144A 1.50000% 21-23.06.26	4 300 000.00	4 121 281.25	0.05
USD	WP CAREY INC 2.25000% 21-01.04.33	1 615 000.00	1 484 518.97	0.02
USD	WP CAREY INC 2.40000% 20-01.02.31	950 000.00	909 222.30	0.01
USD	WP CAREY INC 2.45000% 21-01.02.32	7 005 000.00	6 674 628.72	0.08
USD	WP CAREY INC 3.85000% 19-15.07.29	4 258 000.00	4 588 266.53	0.06
USD	WR BERKLEY CORP 4.62500% 12-15.03.22	2 785 000.00	2 797 994.25	0.04
USD	WRKCO INC 4.65000% 19-15.03.26	730 000.00	799 422.62	0.01
USD	XYLEM INC/NY 1.95000% 20-30.01.28	5 194 000.00	5 053 133.79	0.06
USD	XYLEM INC/NY 2.25000% 20-30.01.31	3 450 000.00	3 297 957.74	0.04
USD	YUM BRANDS INC 4.62500% 21-31.01.32	2 725 000.00	2 711 974.50	0.03
USD	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC 3.15000% 15-01.04.22	1 500 000.00	1 502 998.76	0.02
USD	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC 1.45000% 21-22.11.24	18 145 000.00	17 875 852.85	0.23
USD	ZOETIS INC 2.00000% 20-15.05.30	3 150 000.00	2 995 248.53	0.04
米ドル合計			3 639 489 056.78	45.86
ノート、固定利付債合計			3 642 123 543.27	45.89
ノート、ゼロ・クーポン				
USD				
USD	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 0.00000% 19-10.10.36	3 000 000.00	1 620 000.00	0.02
米ドル合計			1 620 000.00	0.02
ノート、ゼロ・クーポン合計			1 620 000.00	0.02
ノート、変動利付債				
EUR				
EUR	MORGAN STANLEY 1.102%/VAR 21-29.04.33	2 789 000.00	3 039 958.29	0.04
ユーロ合計			3 039 958.29	0.04
USD				
USD	ABN AMRO BANK NV-144A 2.470%/VAR 21-13.12.29	6 400 000.00	6 201 785.66	0.08
USD	AT&T INC 3M LIBOR+118 BP 18-12.06.24	8 600 000.00	8 766 056.02	0.11
USD	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING-REG-S-SUB 6.750%/VAR 16-PRP	1 485 000.00	1 655 134.22	0.02
USD	BANCO SANTANDER SA 0.701%/VAR 21-30.06.24	4 800 000.00	4 744 955.86	0.06
USD	BANCO SANTANDER SA 1.722%/VAR 21-14.09.27	5 000 000.00	4 793 586.70	0.06
USD	BANCO SANTANDER SA 3M LIBOR+112BP 18-12.04.23	400 000.00	403 685.72	0.00
USD	BANK OF AMERICA CORP 3.366%/VAR 18-23.01.26	6 650 000.00	6 876 497.80	0.09
USD	BANK OF AMERICA CORP 3.419%/VAR 18-20.12.28	3 803 000.00	3 949 595.12	0.05
USD	BANK OF AMERICA CORP 3.550%/3M LIBOR+78BP 18-05.03.24	2 720 000.00	2 780 752.13	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

2022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 2.651%/VAR 21-11.03.32	6 905 000.00	6 748 236.89	0.08
USD BANK OF AMERICA CORP 1.658%/VAR 21-11.03.27	11 805 000.00	11 460 994.99	0.14
USD BANK OF AMERICA CORP 1.734%/VAR 21-22.07.27	33 693 000.00	32 678 712.33	0.41
USD BANK OF AMERICA CORP 2.299%/VAR 21-21.07.32	4 000 000.00	3 786 390.80	0.05
USD BANK OF AMERICA CORP 2.572%/VAR 21-20.10.32	4 330 000.00	4 195 974.03	0.05
USD BANK OF IRELAND GROUP-144A 2.029%/VAR 21-30.09.27	22 541 000.00	21 598 786.20	0.27
USD BANK OF MONTREAL-SUB 3.088%/VAR 22-10.01.37	11 000 000.00	10 829 217.74	0.14
USD BANK OF NEW YORK MELLON CORP-SUB 4.700%/VAR 20-PRP	775 000.00	816 656.25	0.01
USD BARCLAYS PLC 2.279%/VAR 21-24.11.27	7 115 000.00	6 968 003.74	0.09
USD BARCLAYS PLC 2.852%/VAR 20-07.05.26	7 800 000.00	7 878 622.83	0.10
USD BARCLAYS PLC 3.932%/VAR 19-07.05.25	7 675 000.00	7 965 205.65	0.10
USD BARCLAYS PLC 4.610%/VAR 18-15.02.23	1 850 000.00	1 852 142.06	0.02
USD BARCLAYS PLC 5.088%/VAR 19-20.06.30	2 945 000.00	3 237 516.10	0.04
USD BBVA BANCOMER SA/TEXAS-144A-SUB 5.875%/VAR 19-13.09.34	2 350 000.00	2 496 875.00	0.03
USD BBVA BANCOMER SA/TEXAS-REG-S-SUB 5.125%/VAR 18-18.01.33	2 640 000.00	2 653 437.60	0.03
USD BK OF AMERICA CORP 3.004%/VAR 18-20.12.23	1 861 000.00	1 889 258.68	0.02
USD CHARLES SCHWAB CORP-SUB 5.375%/VAR 20-PRP	3 394 000.00	3 645 156.00	0.05
USD CHARLES SCHWAB CORP-SUB 4.000%/VAR 21-PRP	2 990 000.00	2 953 910.70	0.04
USD CITIGROUP INC 0.776%/VAR 20-30.10.24	6 180 000.00	6 086 796.70	0.08
USD CITIGROUP INC 0.981%/VAR 21-01.05.25	4 695 000.00	4 595 766.38	0.06
USD CITIGROUP INC 1.122%/VAR 21-28.01.27	2 550 000.00	2 432 820.23	0.03
USD CITIGROUP INC 1.462%/VAR 21-09.06.27	13 275 000.00	12 738 721.72	0.16
USD CITIGROUP INC 1.678%/VAR 20-15.05.24	8 385 000.00	8 410 759.72	0.11
USD CITIGROUP INC 2.520%/VAR 21-03.11.32	805 000.00	775 388.92	0.01
USD CITIGROUP INC 2.561%/VAR 21-01.05.32	5 850 000.00	5 672 461.56	0.07
USD CITIGROUP INC 2.572%/VAR 20-03.06.31	4 285 000.00	4 175 514.82	0.05
USD CITIGROUP INC 2.666%/VAR 20-29.01.31	5 725 000.00	5 614 150.77	0.07
USD CITIGROUP INC 2.876%/VAR 17-24.07.23	2 000 000.00	2 016 193.70	0.03
USD CITIGROUP INC 2.976%/VAR 19-05.11.30	15 865 000.00	15 956 113.17	0.20
USD CITIGROUP INC 3.057%/VAR 22-25.01.33	2 030 000.00	2 050 337.14	0.03
USD CITIGROUP INC 3.106%/VAR 20-08.04.26	2 025 000.00	2 076 610.87	0.03
USD CITIGROUP INC 3.352%/VAR 19-24.04.25	2 750 000.00	2 834 624.46	0.04
USD CITIGROUP INC 3.520%/VAR 17-27.10.28	7 500 000.00	7 839 698.63	0.10
USD CITIGROUP INC 3.668%/VAR 17-24.07.28	4 500 000.00	4 734 008.95	0.06
USD CITIGROUP INC 3.980%/3M LIBOR+133.8BP 19-20.03.30	7 070 000.00	7 563 231.27	0.10
USD CITIGROUP INC-SUB 3.875%/VAR 21-PRP	1 351 000.00	1 315 198.50	0.02
USD CITIGROUP INC-SUB 4.000%/VAR 20-PRP	3 937 000.00	3 887 787.50	0.05
USD CITIGROUP INC-SUB 4.150%/VAR 21-PRP	3 051 000.00	2 976 921.72	0.04
USD COMERICA INC-SUB 5.625%/VAR 20-PRP	2 570 000.00	2 765 834.00	0.03
USD CREDIT AGRICOLE SA-REG-S-SUB 8.125%/VAR 16-PRP	2 875 000.00	3 325 656.25	0.04
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-144A 3.869%/VAR 18-12.01.29	1 300 000.00	1 349 612.34	0.02
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-144A-SUB 6.375%/VAR 19-PRP	2 053 000.00	2 142 818.75	0.03
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-144A 4.194%/VAR 20-01.04.31	2 492 000.00	2 649 640.21	0.03
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-144A 2.193%/VAR 20-05.06.26	1 699 000.00	1 678 231.59	0.02
USD CREDIT SUISSE GROUP AG -144A 1.305%/VAR 21-02.02.27	7 600 000.00	7 177 355.94	0.09
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S 2.593%/VAR 19-11.09.25	2 375 000.00	2 387 329.98	0.03
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S-SUB 6.250%/VAR 14-PRP	2 350 000.00	2 464 562.50	0.03
USD CREDIT SUISSE GRP AG-144A 6M SORF+173BP 21-14.05.32	7 272 000.00	7 062 577.75	0.09
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 3.961%/VAR 19-26.11.25	2 500 000.00	2 602 421.53	0.03
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 2.129%/VAR 20-24.11.26	3 775 000.00	3 688 780.97	0.05
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 2.311%/VAR 21-16.11.27	7 040 000.00	6 838 508.65	0.09
USD DISCOVER BANK-SUB 4.682%/VAR 18-09.08.28	3 168 000.00	3 277 100.35	0.04
USD DISCOVER FINANCIAL SERVICES-SUB 6.125%/VAR 20-PRP	3 793 000.00	4 092 874.58	0.05
USD ENTERPRISE PRODUCTS-SUB 5.375%/VAR 18-15.02.78	2 450 000.00	2 398 259.40	0.03
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3M LIBOR+127BP 17-28.03.22	1 500 000.00	1 500 937.02	0.02
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3M LIBOR+108BP 17-03.08.22	1 750 000.00	1 749 969.71	0.02
USD GENERAL MILLS INC 3M LIBOR+101BP 18-17.10.23	1 005 000.00	1 017 814.62	0.01
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.905%/VAR 17-24.07.23	10 091 000.00	10 169 944.11	0.13
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.272%/VAR 17-29.09.25	935 000.00	962 289.27	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

2022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 MORGAN STANLEY 1.593%/VAR 21-04.05.27	10 450 000.00	10 089 549.62	0.13
USD MORGAN STANLEY 1.928%/VAR 21-28.04.32	11 000 000.00	10 116 921.43	0.13
USD MORGAN STANLEY 3.217%/VAR 21-22.04.42	95 000.00	94 228.60	0.00
USD MORGAN STANLEY 3.591%/VAR 17-22.07.28	7 100 000.00	7 450 267.14	0.09
USD MORGAN STANLEY 3.737%/VAR 18-24.04.24	3 000 000.00	3 081 097.29	0.04
USD NATIONWIDE BUIL SOC-144A 3.766%/3M LIBOR+106.4BP 18-08.03.24	5 400 000.00	5 517 936.65	0.07
USD NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-144A 4.302%/VAR 18-08.03.29	3 958 000.00	4 240 436.95	0.05
USD NATWEST GROUP PLC 1.642%/VAR 21-14.06.27	7 825 000.00	7 545 700.95	0.09
USD NATWEST GROUP PLC 2.359%/VAR 20-22.05.24	1 090 000.00	1 099 169.78	0.01
USD NATWEST GROUP PLC 3.498%/VAR 17-15.05.23	4 480 000.00	4 506 664.59	0.06
USD NATWEST GROUP PLC 3.073%/VAR 20-22.05.28	9 814 000.00	9 988 955.55	0.13
USD NATWEST GROUP PLC 3M LIBOR+147BP 17-15.05.23	1 070 000.00	1 073 466.84	0.01
USD NATWEST GROUP PLC 4.892%/VAR 18-18.05.29	3 275 000.00	3 636 014.58	0.05
USD NATWEST GROUP PLC 4.519%/VAR 18-25.06.24	3 880 000.00	4 018 275.40	0.05
USD NATWEST GROUP PLC 4.269%/VAR 19-22.03.25	5 700 000.00	5 951 428.76	0.06
USD NATWEST GROUP PLC 5.076%/VAR 18-27.01.30	1 510 000.00	1 694 756.38	0.02
USD NIPPON LIFE INSURANCE CO-144A-SUB 2.750%/VAR 21-21.01.51	4 470 000.00	4 259 308.78	0.05
USD NORDEA BANK ABP-REG-S-SUB 6.625%/VAR 19-PRP	3 020 000.00	3 350 327.60	0.04
USD PNC FINANCIAL SERVICES GRP-SUB 6.750%/3M LIBOR+367.8BP 11-PRP	322 000.00	324 255.63	0.00
USD PRINCIPAL FINANCIAL GROUP-SUB 4.700%/VAR 15-15.05.55	3 936 000.00	3 842 053.31	0.05
USD PRUDENTIAL FINANCIAL INC-SUB 5.625%/VAR 12-15.06.43	13 297 000.00	13 763 328.58	0.17
USD PRUDENTIAL FINANCIAL-SUB 5.200%/3M LIBOR+304BP 13-15.03.44	1 849 000.00	1 909 264.73	0.02
USD PRUDENTIAL FINANCIAL INC-SUB 5.375%/VAR 15-15.05.45	3 185 000.00	3 367 693.13	0.04
USD PRUDENTIAL PLC-SUB-REG-S 2.950%/VAR 21-03.11.33	11 852 000.00	11 377 920.00	0.14
USD SANTANDER HOLDINGS USA INC 2.490%/VAR 21-06.01.28	1 337 000.00	1 316 432.71	0.02
USD SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC 1.089%/VAR 21-15.03.25	860 000.00	841 625.46	0.01
USD SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC 1.673%/VAR 21-14.06.27	2 235 000.00	2 146 551.56	0.03
USD SANTANDER UK GROUP HOLD PLC 2.469%/VAR 22-11.01.28	10 072 000.00	9 938 537.85	0.13
USD SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN-REG-S-SUB 5.625%/VAR 17-PRP	400 000.00	403 000.00	0.00
USD SOCIETE GENERALE SA-REG-S-SUB 8.000%/VAR 15-PRP	1 480 000.00	1 671 378.80	0.02
USD STANDARD CHARTERED PLC-144A-SUB 6.409%/3M LIBOR+151BP 06-PRP	200 000.00	192 000.00	0.00
USD STANDARD CHARTERED PLC-144A 3.785%/VAR 19-21.05.25	2 626 000.00	2 717 464.57	0.03
USD STANDARD CHARTERED PLC-144A 1.456%/VAR 21-14.01.27	1 423 000.00	1 354 206.40	0.02
USD STANDARD CHARTERED PLC-144A 2.608%/VAR 22-12.01.28	2 993 000.00	2 952 553.32	0.04
USD SWEDBANK AB-REG-S-SUB 4.000%/VAR 21-PRP	800 000.00	750 000.00	0.01
USD SWISS RE FINANCE LUXEMBOURG-144A-SUB 5.000%/VAR 19-02.04.49	4 024 000.00	4 416 340.00	0.06
USD SWISS RE FINANCE LUXEMBOURG-REG-S-SUB 5.000%/VAR 19-02.04.49	3 000 000.00	3 292 500.00	0.04
USD THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 3M SOFR+39BP 21-18.10.23	9 950 000.00	9 943 178.68	0.13
USD TRUIST FINANCIAL CORP-SUB 4.950%/VAR 20-PRP	5 405 000.00	5 720 760.10	0.07
USD TRUIST FINANCIAL CORP-SUB 5.100%/VAR 20-PRP	2 561 000.00	2 778 685.00	0.03
USD UBS GROUP AG-144A 1.494%/VAR 21-10.08.27	9 115 000.00	8 687 695.63	0.11
USD UBS GROUP AG-144A 2.859%/VAR 17-15.08.23	1 960 000.00	1 976 683.52	0.02
USD VODAFONE GROUP PLC-SUB 3.250%/VAR 21-04.06.81	1 365 000.00	1 300 162.50	0.02
USD WABTEC CORP STEP-UP/RATING LINKED 18-15.09.28	2 610 000.00	2 904 795.72	0.04
USD WABTEC CORP/DE STEP-UP/RATING LINKED 18-15.03.24	9 001 000.00	9 431 223.14	0.12
USD WELLS FARGO & CO 2.188%/VAR 20-30.04.26	16 104 000.00	16 075 919.94	0.20
USD WELLS FARGO & CO-SUB 3.900%/VAR 21-PRP	5 950 000.00	5 893 177.50	0.07
USD WESTPAC BANKING CORP-SUB 4.110%/VAR 19-24.07.34	3 900 000.00	4 093 545.69	0.05
USD WESTPAC BANKING CORP-SUB 2.668%/VAR 20-15.11.35	7 700 000.00	7 259 505.33	0.09
米ドル合計		1 081 872 611.02	13.63
ノート、変動利付債合計		1 084 912 569.31	13.67
中期債券、固定利付債			
USD			
USD ABU DHABI, EMIRATE OF-144A 2.50000% 20-16.04.25	1 001 000.00	1 020 019.00	0.01
USD AIR LEASE CORP 0.70000% 21-15.02.24	1 900 000.00	1 847 066.36	0.02
USD AIR LEASE CORP 2.30000% 20-01.02.25	6 450 000.00	6 426 033.86	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

2022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 AIR LEASE CORP 2.87500% 20-15.01.26	5 272 000.00	5 317 564.22	0.07
USD AMERICAN HONDA FINANCE CORP 1.20000% 20-08.07.25	2 550 000.00	2 486 532.62	0.03
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 4.20000% 14-26.08.24	3 685 000.00	3 889 393.25	0.05
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 4.45000% 16-03.03.26	12 875 000.00	13 911 567.16	0.18
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 4.18300% 16-25.11.27	4 650 000.00	4 990 769.43	0.06
USD BANK OF MONTREAL 1.85000% 20-01.05.25	2 565 000.00	2 561 608.19	0.03
USD BB&T CORP 2.50000% 19-01.08.24	2 950 000.00	3 003 338.98	0.04
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 3.70000% 18-30.05.24	4 200 000.00	4 344 751.45	0.06
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 4.00000% 14-03.03.24	3 690 000.00	3 855 550.30	0.05
USD KEYCORP 2.25000% 20-06.04.27	3 110 000.00	3 098 223.30	0.04
USD MCDONALD ' S CORP 1.45000% 20-01.09.25	2 400 000.00	2 363 049.58	0.03
USD MORGAN STANLEY 3.12500% 18-23.01.23	4 000 000.00	4 076 308.56	0.05
USD MORGAN STANLEY 3.12500% 16-27.07.26	2 200 000.00	2 276 552.58	0.03
USD MORGAN STANLEY 3.87500% 16-27.01.26	12 125 000.00	12 865 907.94	0.16
USD MORGAN STANLEY 4.00000% 15-23.07.25	1 635 000.00	1 737 122.20	0.02
USD MORGAN STANLEY-SUB 3.95000% 15-23.04.27	12 645 000.00	13 472 769.39	0.17
USD MORGAN STANLEY-SUB 4.35000% 14-08.09.26	7 510 000.00	8 113 299.03	0.10
USD MORGAN STANLEY-SUB 4.10000% 13-22.05.23	6 470 000.00	6 681 607.17	0.08
USD NORDEA BANK ABP-144A 1.50000% 21-30.09.26	16 475 000.00	15 919 305.99	0.20
USD PETRONAS CAPITAL LTD-144A 3.50000% 20-21.04.30	1 462 000.00	1 537 921.66	0.02
USD PUBLIC SERVICE ELECTRIC & GAS CO 3.00000% 17-15.05.27	455 000.00	472 104.99	0.01
USD PUBLIC SERVICE ELECTRIC & GAS CO 3.70000% 18-01.05.28	835 000.00	899 193.34	0.01
USD PUBLIC SERVICE ELECTRIC & GAS CO 3.65000% 18-01.09.28	1 530 000.00	1 638 565.24	0.02
USD PUBLIC SERVICE ELECTRIC & GAS CO 3.20000% 19-15.05.29	1 685 000.00	1 767 103.38	0.02
USD ROYAL BANK OF CANADA-SUB 4.65000% 16-27.01.26	4 225 000.00	4 622 170.95	0.06
USD ROYAL BANK OF CANADA 2.55000% 19-16.07.24	2 985 000.00	3 040 050.45	0.04
USD ROYAL BANK OF CANADA 1.15000% 20-10.06.25	2 880 000.00	2 806 733.98	0.03
USD ROYAL BANK OF CANADA 1.15000% 21-14.07.26	12 400 000.00	11 916 358.33	0.15
USD ROYAL BANK OF CANADA 0.65000% 21-29.07.24	4 300 000.00	4 190 727.84	0.05
USD ROYAL BANK OF CANADA 1.40000% 21-02.11.26	5 160 000.00	4 982 446.26	0.06
USD RYDER SYSTEM INC 1.75000% 21-01.09.26	8 470 000.00	8 277 745.22	0.11
USD RYDER SYSTEM INC 3.35000% 20-01.09.25	5 000 000.00	5 193 216.90	0.07
USD RYDER SYSTEM INC 3.65000% 19-18.03.24	6 165 000.00	6 400 536.42	0.08
USD RYDER SYSTEM INC 4.62500% 20-01.06.25	675 000.00	724 746.47	0.01
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-144A 3.25000% 16-26.10.26	1 764 000.00	1 838 088.00	0.02
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-144A 3.25000% 20-22.10.30	1 752 000.00	1 825 584.00	0.02
USD SHINHAN FIN GROUP CO LTD-144A 1.35000% 20-10.01.26	2 520 000.00	2 445 206.40	0.03
USD SOCIETE GENERALE SA-144A 3.87500% 19-28.03.24	1 665 000.00	1 727 330.20	0.02
USD SUMITOMO MITSUI TRUST BK ECD-144A 0.85000% 21-25.03.24	2 770 000.00	2 721 219.19	0.04
USD TENCENT HOLDINGS LTD-144A 3.28000% 19-11.04.24	5 800 000.00	5 965 938.00	0.08
USD TENCENT HOLDINGS LTD-144A 3.97500% 19-11.04.29	4 105 000.00	4 348 221.25	0.06
USD TENCENT HOLDINGS LTD-144A 2.88000% 21-22.04.31	3 545 000.00	3 502 601.80	0.04
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.57500% 19-11.04.26	480 000.00	502 590.00	0.01
USD TORONTO-DOMINION BANK 1.95000% 22-12.01.27	7 570 000.00	7 468 734.60	0.09
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 0.80000% 21-09.01.26	7 400 000.00	7 077 462.04	0.09
米ドル合計		222 150 937.47	2.80

中期債券、固定利付債合計		222 150 937.47	2.80
--------------	--	----------------	------

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	3 760 000.00	3 679 630.00	0.05
USD BANK OF AMERICA CORP 3.824%/VAR 17-20.01.28	5 560 000.00	5 890 549.84	0.07
USD BANK OF AMERICA CORP 2.881%/VAR 17-24.04.23	2 635 000.00	2 643 469.52	0.03
USD BANK OF AMERICA CORP 3.593%/VAR 17-21.07.28	12 480 000.00	13 082 321.49	0.17
USD BANK OF AMERICA CORP 3M LIBOR+79BP 18-05.03.24	3 910 000.00	3 929 628.51	0.05
USD BANK OF AMERICA CORP 3.970%/3M LIBOR+107BP 18-05.03.29	1 000 000.00	1 067 103.76	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

2022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 3.974%/VAR 19-07.02.30	3 300 000.00	3 532 568.06	0.04
USD BANK OF AMERICA CORP 3.458%/3M LIBOR+97BP 19-15.03.25	13 270 000.00	13 687 170.85	0.17
USD BANK OF AMERICA CORP 3.559%/VAR 19-23.04.27	15 460 000.00	16 176 322.10	0.20
USD BANK OF AMERICA CORP 3.194%/VAR 19-23.07.30	14 525 000.00	14 848 650.26	0.19
USD BANK OF AMERICA CORP 2.456%/VAR 19-22.10.25	2 500 000.00	2 521 456.85	0.03
USD BANK OF AMERICA CORP 2.884%/VAR 19-22.10.30	14 450 000.00	14 447 760.11	0.18
USD BANK OF AMERICA CORP 2.496%/3M LIBOR+99BP 20-13.02.31	10 600 000.00	10 299 912.30	0.13
USD BANK OF AMERICA CORP 1.319%/VAR 20-19.06.23	9 265 000.00	8 990 925.64	0.11
USD BANK OF AMERICA CORP 1.898%/VAR 20-23.07.31	5 695 000.00	5 278 201.12	0.07
USD BANK OF AMERICA CORP 2.087%/VAR 21-14.06.29	24 061 000.00	23 126 672.40	0.29
USD BANK OF NEW YORK MELLON CORP 2.661%/VAR 17-16.05.23	1 360 000.00	1 365 711.96	0.02
USD MORGAN STANLEY 0.864%/VAR 20-21.10.25	2 075 000.00	2 011 073.98	0.03
USD MORGAN STANLEY 1.164%/VAR 21-21.10.25	2 500 000.00	2 436 586.55	0.03
USD MORGAN STANLEY 1.512%/VAR 21-20.07.27	28 695 000.00	27 533 400.29	0.35
USD MORGAN STANLEY 2.188%/VAR 20-28.04.26	11 957 000.00	11 931 089.06	0.15
USD MORGAN STANLEY 2.239%/VAR 21-21.07.32	35 000.00	33 002.95	0.00
USD MORGAN STANLEY 2.475%/VAR 22-21.01.28	8 731 000.00	8 716 192.66	0.11
USD MORGAN STANLEY 2.699%/VAR 20-22.01.31	17 545 000.00	17 398 063.26	0.22
USD MORGAN STANLEY 2.720%/VAR 19-22.07.25	8 315 000.00	8 437 472.72	0.11
USD MORGAN STANLEY 2.943%/VAR 22-21.01.33	1 500 000.00	1 501 870.12	0.02
USD MORGAN STANLEY 3.622%/VAR 20-01.04.31	8 178 000.00	8 645 017.53	0.11
USD MORGAN STANLEY 4.431%/VAR 19-23.01.30	1 375 000.00	1 518 628.63	0.02
USD NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-144A 3.622%/VAR 19-26.04.23	3 105 000.00	3 121 147.24	0.04
USD WELLS FARGO & CO 1.654%/VAR 20-02.06.24	7 070 000.00	7 074 117.92	0.09
USD WELLS FARGO & CO 2.393%/VAR 20-02.06.28	13 061 000.00	12 952 960.97	0.16
USD WELLS FARGO & CO 2.572%/VAR 20-11.02.31	7 050 000.00	6 934 144.95	0.09
USD WELLS FARGO & CO 2.879%/VAR 19-30.10.30	8 985 000.00	9 033 103.62	0.11
USD WELLS FARGO & CO 3.584%/VAR 17-22.05.28	8 300 000.00	8 715 722.36	0.11
米ドル合計		282 561 649.58	3.56
中期債券、変動利付債合計		282 561 649.58	3.56
債券、固定利付債			
EUR			
EUR MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 2.25000% 19-07.03.39	200 000.00	244 106.72	0.00
EUR THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 0.50000% 19-01.03.28	1 100 000.00	1 215 974.71	0.02
ユーロ合計		1 460 081.43	0.02
USD			
USD ABU DHABI ,GOVERNMENT OF-144A 2.50000% 19-30.09.29	3 300 000.00	3 333 000.00	0.04
USD ACE CAPITAL TRUST II-SUB 9.70000% 00-01.04.30	4 424 000.00	6 370 154.89	0.08
USD ARES CAPITAL CORP 3.50000% 17-10.02.23	4 165 000.00	4 245 375.29	0.05
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 8.05000% 97-15.06.27	281 000.00	348 898.82	0.01
USD BIOGEN INC 4.05000% 15-15.09.25	3 778 000.00	3 998 322.12	0.05
USD BRANCH BANKING & TRUST CO-SUB 3.80000% 14-30.10.26	6 200 000.00	6 627 632.91	0.08
USD BRITISH TELECOMMUNICATIONS PLC STEP-UP/DOWN 00-15.12.30	4 585 000.00	6 544 843.53	0.08
USD CITIGROUP INC-SUB 4.30000% 14-20.11.26	1 542 000.00	1 667 924.51	0.02
USD COMCAST CORP 3.15000% 17-15.02.28	2 285 000.00	2 384 979.48	0.03
USD COMMONSPIRIT HEALTH 2.76000% 19-01.10.24	5 915 000.00	6 022 491.40	0.08
USD COMMONWEALTH EDISON CO 3.70000% 18-15.08.28	520 000.00	555 850.05	0.01
USD CONSOLIDATED EDISON CO OF NEW YORK 2.90000% 21-01.12.26	1 585 000.00	1 624 217.66	0.02
USD CONSOLIDATED EDISON CO OF NEW YORK INC 4.00000% 18-01.12.28	2 580 000.00	2 826 796.35	0.04
USD CONSOLIDATED EDISON CO OF NEW YORK INC 3.35000% 20-01.04.30	10 000 000.00	10 484 395.80	0.13
USD CVS CAREMARK CORP 6.25000% 07-01.06.27	1 100 000.00	1 302 079.03	0.02
USD DANONE-REG-S 2.58900% 16-02.11.23	4 740 000.00	4 814 323.34	0.06
USD DISCOVER BANK 3.45000% 16-27.07.26	7 125 000.00	7 422 387.88	0.09
USD DISCOVER BANK 4.25000% 14-13.03.26	500 000.00	537 115.58	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

2022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 DOW CHEMICAL CO 4.25000% 14-01.10.34	674 000.00	742 788.91	0.01
USD ENTERGY TEXAS INC 4.00000% 19-30.03.29	1 680 000.00	1 811 030.86	0.02
USD ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC 3.75000% 14-15.02.25	1 390 000.00	1 455 557.18	0.02
USD FRESENIUS US FINANCE II INC-144A 4.50000% 15-15.01.23	1 025 000.00	1 048 154.97	0.01
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 4.35000% 17-17.01.27	2 035 000.00	2 176 187.94	0.03
USD IBERDROLA INTERNATIONAL BV 5.81000% 05-15.03.25	2 290 000.00	2 564 733.70	0.03
USD ING GROEP NV-144A 4.62500% 18-06.01.26	3 625 000.00	3 961 351.25	0.05
USD JP MORGAN CHASE & CO-SUB 4.25000% 15-01.10.27	4 200 000.00	4 572 553.52	0.06
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 5.30000% 15-PRP	1 129 000.00	1 129 000.00	0.01
USD MARB BONDCO PLC-144A-3.95000% 21-29.01.31	10 250 000.00	9 397 815.00	0.12
USD MICROSOFT CORP 2.00000% 16-08.08.23	9 316 000.00	9 432 426.25	0.12
USD MIZUHO FINANCE GROUP CAYMAN 3-144A-SUB 4.60000% 14-27.03.24	11 277 000.00	11 858 462.42	0.15
USD MMI CAPITAL TRUST I-SUB 7.62500% 98-15.12.27	3 050 000.00	3 756 117.55	0.05
USD PERU, REPUBLIC OF 2.39200% 20-23.01.26	288 000.00	287 874.00	0.00
USD PERU, REPUBLIC OF 2.78300% 20-23.01.31	1 050 000.00	1 016 071.87	0.01
USD PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP 4.50000% 16-15.12.26	1 839 000.00	1 976 951.78	0.03
USD SABIC CAPITAL II BV-REG-S 4.00000% 18-10.10.23	1 650 000.00	1 716 000.00	0.02
USD TOLEDO HOSPITAL 5.32500% 18-15.11.28	4 490 000.00	4 995 570.46	0.06
USD TOLEDO HOSPITAL 6.01500% 18-15.11.48	2 900 000.00	3 445 485.04	0.04
USD VIACOMCBS INC 5.85000% 13-01.09.43	1 790 000.00	2 267 029.63	0.03
USD WALT DISNEY CO/THE 3.00000% 16-13.02.26	6 860 000.00	7 091 634.14	0.09
米ドル合計		147 813 585.11	1.86
債券、固定利付債合計		149 273 666.54	1.88
債券、変動利付債			
USD ALLIANZ SE-144A-SUB 3.220%/VAR 21-PRP	1 200 000.00	1 108 500.00	0.01
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 6.25000%/VAR 14-PRP	2 935 000.00	3 111 100.00	0.04
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 6.500%/VAR 14-PRP	572 000.00	615 586.40	0.01
USD BARCLAYS BANK PLC-144A-SUB 6.860%/6M LIBOR+173BP 02-PRP	188 000.00	249 570.00	0.00
USD CITIGROUP INC-SUB 4.700%/VAR 20-PRP	485 000.00	485 630.50	0.01
USD CLOVERIE PLC VIA SWISS RE-REG-S-SUB 4.500%/VAR 14-11.09.44	4 445 000.00	4 645 593.96	0.06
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S-SUB 7.500%/VAR 18-PRP	1 311 000.00	1 364 279.04	0.02
USD DEMETER INVESTMENTS BV-REG-S-SUB 5.125%/VAR 18-01.06.48	4 020 000.00	4 376 324.76	0.05
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 1.44700%/VAR 21-01.04.25	2 575 000.00	2 532 074.73	0.03
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 2.552%/VAR 22-07.01.28	6 955 000.00	6 814 890.62	0.08
USD DEUTSCHE TELEKOM INTL FIN 8.250%/RATING LINKED 00-15.06.30	4 450 000.00	6 277 792.33	0.08
USD DNB BANK ASA-REG-S-SUB 6.500%/VAR 16-PRP	5 199 000.00	5 232 793.50	0.06
USD ING GROEP NV-REG-S-SUB 6.875%/VAR 16-PRP	6 710 000.00	6 775 516.43	0.09
USD JP MORGAN CHASE & CO 2.005%/VAR 20-13.03.26	10 045 000.00	9 995 383.63	0.13
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 5.150%/3M LIBOR+325BP 13-PRP	781 000.00	798 267.91	0.01
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 5.000%/VAR 14-PRP	381 000.00	380 806.65	0.00
USD NATWEST GROUP PLC-SUB 7.640%/VAR 07-PRP	4 600 000.00	4 577 000.00	0.06
USD NIPPON LIFE INSURANCE CO-144A-SUB 2.900%/VAR 21-16.09.51	2 750 000.00	2 638 786.70	0.03
USD QBE INSURANCE GROUP LTD-REG-S-SUB 6.750%/VAR 14-02.12.44	4 130 000.00	4 488 495.15	0.06
USD WESTPAC BANKING CORP-SUB 4.322%/VAR 16-23.11.31	3 505 000.00	3 712 552.43	0.05
米ドル合計		70 180 944.74	0.88
債券、変動利付債合計		70 180 944.74	0.88
財務省証券(T-note)、固定利付債			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 20-31.01.27	37 745 000.00	37 547 428.33	0.47
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.12500% 21-15.02.31	10 330 000.00	9 783 236.30	0.12
USD AMERICA, UNITED STATES OF TN 0.12500% 21-31.03.23	94 797 000.00	93 949 011.44	1.19

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 - US マルチ・クレジット

2022年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.12500% 21-15.08.31	40 070 000.00	38 235 545.31	0.48
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.12500% 21-31.08.23	58 070 000.00	57 219 365.09	0.72
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.50000% 21-30.11.23	9 130 000.00	9 022 651.19	0.12
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.25000% 21-31.12.26	55 335 000.00	54 392 575.78	0.69
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.75000% 21-31.12.23	25 690 000.00	25 489 296.88	0.32
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.87500% 22-31.08.24	14 670 000.00	14 581 177.70	0.18
米ドル合計		340 220 288.02	4.29
財務省証券(T-note)、固定利付債合計		340 220 288.02	4.29
地方債、固定利付債			
USD			
USD OREGON, STATE OF 5.76200% 03-01.06.23	3 000 000.00	1 177 934.39	0.01
米ドル合計		1 177 934.39	0.01
地方債、固定利付債合計		1 177 934.39	0.01
転換社債型新株予約権付社債、変動利付債			
USD			
USD BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA-SUB COCO 6.500%/VAR 19-PRP	5 600 000.00	5 817 000.00	0.08
USD BANCO SANTANDER SA-144A-SUB COCO 7.500%/VAR 19-PRP	1 600 000.00	1 698 064.00	0.02
USD BANK OF MONTREAL-SUB 3.803%/VAR 17-15.12.32	4 020 000.00	4 219 171.31	0.05
USD BANK OF MONTREAL-SUB 4.338%/VAR 18-05.10.28	9 865 000.00	10 254 149.98	0.13
USD SWEDBANK AB-REG-S-SUB COCO 5.625%/VAR 19-PRP	3 200 000.00	3 338 592.00	0.04
米ドル合計		25 326 977.29	0.32
転換社債型新株予約権付社債、変動利付債合計		25 326 977.29	0.32
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		5 825 889 483.56	73.40
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			
株式			
アメリカ合衆国			
USD CITIGROUP INC 5.95%-FR SUB PERP USD1000 ' A	2 172 000.00	2 228 124.48	0.03
アメリカ合衆国合計		2 228 124.48	0.03
株式合計		2 228 124.48	0.03
財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン			
USD			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 09.09.21-10.03.22	2 200 000.00	2 199 925.95	0.03
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 16.09.21-17.03.22	2 200 000.00	2 199 914.62	0.03
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 12.10.21-08.02.22	10 000 000.00	9 999 938.70	0.12
米ドル合計		14 399 779.27	0.18
財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン合計		14 399 779.27	0.18
アセット・バック証券、変動利付債			
USD			
USD BALLYROCK CLO 2020-2 LTD-144A 3M LIBOR +101BP 21-20.10.31	6 000 000.00	5 998 132.20	0.07
USD C1FC FUNDING LTD-144A 3M LIBOR+105BP 18-24.04.30	1 500 000.00	1 501 336.95	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

2022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 ICG US CLO 2020-1 LTD-144A 3M LIBOR+120BP 21-20.01.35	12 500 000.00	12 499 962.50	0.16
USD ROMARK CLO 11-144A 3M LIBOR+117.5BP 18-25.07.31	5 500 000.00	5 500 008.80	0.07
USD VENTURE 28A CLO LTD-144A 3M LIBOR+121BP 21-20.10.34	12 000 000.00	11 999 952.00	0.15
米ドル合計		37 499 392.45	0.47
アセット・バック証券、変動利付債合計			0.47
モーゲージ・バック証券、固定利付債			
USD			
USD CD 2017-CD4 MORTGAGE TRUST-SUB 3.24820% 17-01.05.50	5 000 000.00	5 206 607.00	0.07
USD MORGAN STANLEY BANK OF AMERICA ML 2.84000% 16-01.11.49	2 500 000.00	2 515 342.75	0.03
USD MORGAN STANLEY BK OF AMERICA MERRI TRT 3.29500% 17-01.05.50	5 000 000.00	5 069 076.00	0.06
USD MORGAN STANLEY CAPITAL I TRUST 3.15300% 17-01.06.50	2 800 000.00	2 861 205.20	0.04
米ドル合計		15 652 230.95	0.20
モーゲージ・バック証券、固定利付債合計			0.20
モーゲージ・バック証券、変動利付債			
USD			
USD AMERICAN HOME MORTGAGE INVESTMENT 6M LIBOR+200BP 05-01.06.45	29 470 000.00	730 912.35	0.01
USD BANC OF AMERICA FUND TRUST 1M LIBOR+30BP 05-20.05.35	16 952 000.00	328 208.57	0.00
USD WAMU MORTGAGE PASS-TH TRUST 1M LIBOR+27BP 05-25.12.45	12 000 000.00	723 865.76	0.01
米ドル合計		1 782 986.68	0.02
モーゲージ・バック証券、変動利付債合計			0.02
ノート、固定利付債			
USD			
USD 1011778 BC ULC/NEW RED FINANCE INC-144A 3.87500% 19-15.01.28	690 000.00	672 646.50	0.01
USD 7-ELEVEN INC-144A 0.95000% 21-10.02.26	2 275 000.00	2 162 972.71	0.03
USD 7-ELEVEN INC-144A 1.30000% 21-10.02.28	2 500 000.00	2 326 057.63	0.03
USD ABBVIE INC 4.55000% 20-15.03.35	3 500 000.00	3 978 621.08	0.05
USD ADT SECURITY CORP/THE-144A 4.12500% 21-01.08.29	2 180 000.00	2 050 551.60	0.03
USD ADVANCE AUTO PARTS INC 3.90000% 20-15.04.30	7 326 000.00	7 774 811.71	0.10
USD ADVOCATE HEALTH & HOSPITALS CORP 2.21100% 20-15.06.30	2 000 000.00	1 945 338.38	0.02
USD AIG GLOBAL FUNDING-144A 0.65000% 21-17.06.24	1 750 000.00	1 703 780.73	0.02
USD AIRCASTLE LTD-144A 2.85000% 21-26.01.28	3 483 000.00	3 414 830.72	0.04
USD AIRCASTLE LTD-144A 5.25000% 20-11.08.25	2 870 000.00	3 089 734.38	0.04
USD AKER BP ASA-144A 2.87500% 20-15.01.26	8 000 000.00	8 168 294.80	0.10
USD AKER BP ASA-144A 3.00000% 20-15.01.25	11 250 000.00	11 493 535.50	0.14
USD ALBERTSONS COS LLC / SAFEWAY INC-144A 3.50000% 20-15.03.29	4 655 000.00	4 395 064.80	0.06
USD ALCON FINANCE CORP-144A 2.75000% 19-23.09.26	4 975 000.00	5 046 679.95	0.06
USD AMERICAN CAMPUS COMMUN OPER PARTN 3.75000% 13-15.04.23	2 000 000.00	2 043 288.92	0.03
USD AMERICAN TRANSMISSION SYSTEMS INC-144A 2.65000% 21-15.01.32	5 365 000.00	5 261 276.52	0.07
USD ARCH CAPITAL FINANCE LLC 4.01100% 16-15.12.26	1 615 000.00	1 740 510.78	0.02
USD ASB BANK LTD-144A 3.12500% 19-23.05.24	5 985 000.00	6 184 009.87	0.08
USD ATHENE GLOBAL FUNDING-144A 2.95000% 19-12.11.26	7 500 000.00	7 678 209.60	0.10
USD AUTODESK INC 2.40000% 21-15.12.31	15 915 000.00	15 189 750.27	0.19
USD AVIATION CAPITAL GROUP-144A 3.50000% 17-01.11.27	741 000.00	740 986.17	0.01
USD AVIATION CAPITAL GROUP-144A 4.12500% 18-01.08.25	4 390 000.00	4 557 107.59	0.06
USD AVIATION CAPITAL GROUP-144A 1.95000% 21-30.01.26	5 563 000.00	5 346 349.08	0.07
USD BAKER HUGHES HOLDINGS LLC / BAKER HUGH 1.23100% 21-15.12.23	1 535 000.00	1 527 946.72	0.02
USD BANK OF NEW ZEALAND-144A 3.50000% 19-20.02.24	4 900 000.00	5 088 706.94	0.06
USD BBVA BANCOMER SA/TEXAS-144A 1.87500% 20-18.09.25	11 500 000.00	11 215 375.00	0.14
USD BERRY GLOBAL INC 0.95000% 21-15.02.24	1 250 000.00	1 229 443.75	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

2022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 REGENERON PHARMACEUTICALS INC 1.75000% 20-15.09.30	5 185 000.00	4 717 374.39	0.06
USD ROCHE HOLDINGS INC-144A 2.07600% 21-13.12.31	29 507 000.00	28 387 246.23	0.36
USD ROCKIES EXPRESS PIPELINE LLC-144A 4.95000% 19-15.07.29	975 000.00	1 001 812.50	0.01
USD ROCKIES EXPRESS PIPELINE LLC-144A 3.60000% 20-15.05.25	1 260 000.00	1 251 986.40	0.02
USD ROCKIES EXPRESS PIPELINE LLC-144A 4.80000% 20-15.05.30	900 000.00	897 750.00	0.01
USD RUBY PIPELINE LLC-144A 6.00000% 12-01.04.22	2 140 000.00	1 103 753.23	0.01
USD SANTANDER HOLDINGS USA INC 3.24400% 20-05.10.26	3 750 000.00	3 834 496.58	0.05
USD SCHLUMBERGER HOLDINGS CORP-144A 3.75000% 19-01.05.24	5 700 000.00	5 899 414.96	0.07
USD SEAGATE HDD CAYMAN 3.37500% 20-15.07.31	8 300 000.00	7 706 550.00	0.10
USD SEALED AIR CORP-144A 4.00000% 19-01.12.27	1 677 000.00	1 681 192.50	0.02
USD SIMPAR EUROPE SA-144A 5.20000% 21-26.01.31	3 000 000.00	2 662 125.00	0.03
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 5.00000% 17-01.08.27	650 000.00	663 715.00	0.01
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 4.00000% 21-15.07.28	4 342 000.00	4 200 885.00	0.05
USD SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-144A 1.20000% 21-09.09.26	6 715 000.00	6 465 497.46	0.08
USD SMITHFIELD FOODS INC-144A 5.20000% 19-01.04.29	4 305 000.00	4 804 587.72	0.06
USD SMITHFIELD FOODS INC-144A 3.00000% 20-15.10.30	1 350 000.00	1 309 842.08	0.02
USD SPRINT SPECTRUM CO III LLC-144A 4.73800% 18-20.03.25	5 355 000.00	4 541 508.56	0.06
USD SPRINT SPECTRUM CO III LLC-144A 5.15200% 18-20.03.28	6 130 000.00	6 681 700.00	0.08
USD STATE STREET CORP 2.90100% 20-30.03.26	3 220 000.00	3 313 462.24	0.04
USD STELLANTIS FINANCE US INC-144A 1.71100% 21-29.01.27	5 228 000.00	5 032 027.43	0.06
USD STELLANTIS FINANCE US INC-144A 2.69100% 21-15.09.31	4 980 000.00	4 714 965.14	0.06
USD SYDNEY AIRPORT FINANCE CO PTY LTD-144A 3.90000% 12-22.03.23	3 340 000.00	3 425 336.33	0.04
USD TECK RESOURCES LTD 3.90000% 20-15.07.30	6 965 000.00	7 268 872.92	0.09
USD TENGIZCHEVROIL FINANCE CO INTL-144A 3.25000% 20-15.08.30	1 063 000.00	1 016 759.50	0.01
USD TEXAS EASTERN TRANSMISSION LP-144A 2.80000% 12-15.10.22	1 375 000.00	1 386 099.29	0.02
USD TRANSCONTINENTAL GAS PIPE LINE 4.60000% 18-15.03.48	1 955 000.00	2 233 371.86	0.03
USD TRANSOCEAN PONTUS LTD-144A 6.12500% 18-01.08.25	255 000.00	168 287.25	0.00
USD TRANSOCEAN POSEIDON LTD-144A 6.87500% 19-01.02.27	479 000.00	464 630.00	0.01
USD UNICREDIT SPA-144A 2.56900% 20-22.09.26	1 542 000.00	1 512 656.47	0.02
USD UNITED AIRLINES AA PASS THROUGH TRUST 3.50000% 18-01.03.30	1 500 000.00	1 200 523.57	0.02
USD USAA CAPITAL CORP-144A 2.12500% 20-01.05.30	5 000 000.00	4 874 194.15	0.06
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 9.25000% 18-01.04.26	85 000.00	87 533.00	0.00
USD VALVOLINE INC-144A 4.25000% 20-15.02.30	2 000 000.00	1 931 860.00	0.02
USD VERISK ANALYTICS INC 4.12500% 12-12.09.22	1 500 000.00	1 528 035.00	0.02
USD VIATRIS INC 1.65000% 21-22.06.25	1 680 000.00	1 649 491.64	0.02
USD VIATRIS INC 2.30000% 21-22.06.27	3 500 000.00	3 454 868.59	0.04
USD VIATRIS INC 2.70000% 21-22.06.30	4 785 000.00	4 619 117.87	0.06
USD VITERRA FINANCE BV-144A 2.00000% 21-21.04.26	2 475 000.00	2 416 222.73	0.03
USD VM HOLDING SA-144A 5.37500% 17-04.05.27	730 000.00	755 550.00	0.01
USD WEA FIN LLC/ WESTF UK&EUR FIN PLC-144A 3.75000% 14-17.09.24	4 429 000.00	4 583 635.48	0.06
USD WEA FINANCE LLC-144A 4.12500% 18-20.09.28	2 620 000.00	2 770 049.73	0.03
USD WEIR GROUP PLC/THE-144A 2.20000% 21-13.05.26	2 565 000.00	2 497 349.30	0.03
USD WELLTOWER INC 4.25000% 16-01.04.26	1 230 000.00	1 329 613.64	0.02
USD WILLIS NORTH AMERICA INC 4.50000% 18-15.09.28	1 750 000.00	1 896 097.56	0.02
USD WILLIS NORTH AMERICA INC 2.95000% 19-15.09.29	6 425 000.00	6 380 612.83	0.08
USD WRKCO INC 3.75000% 19-15.03.25	2 795 000.00	2 930 738.48	0.04
USD YAMANA GOLD INC 2.63000% 22-15.08.31	3 044 000.00	2 876 906.63	0.04
USD YARA INTERNATIONAL ASA-144A 3.14800% 20-04.06.30	2 475 000.00	2 476 237.50	0.03
米ドル合計		914 125 192.17	11.52
ノート、固定利付債合計		914 125 192.17	11.52
ノート、変動利付債			
USD			
USD BNP PARIBAS SA-144A 2.871%/VAR 21-19.04.32	4 267 000.00	4 151 077.64	0.05
USD BNP PARIBAS SA-144A 2.159%/VAR 21-15.09.29	8 315 000.00	7 922 919.06	0.10
USD BNP PARIBAS-144A 2.219%/VAR 20-09.06.26	10 800 000.00	10 703 202.62	0.14
USD BNP PARIBAS-144A 3.052%/VAR 20-13.01.31	2 020 000.00	2 007 275.61	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

2022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 CREDIT AGRICOLE SA-144A 1.247%/VAR 21-26.01.27	4 475 000.00	4 270 182.15	0.05
USD DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA-144A 3M LIBOR+90BP 19-15.02.22	3 500 000.00	3 501 049.86	0.04
USD DUPONT DE NEMOURS INC 3M LIBOR+111BP 18-15.11.23	3 490 000.00	3 536 757.03	0.05
USD ELANCO ANIMAL HEALTH INC STEP-UP/RTG LKD 19-27.08.23	5 300 000.00	5 506 355.50	0.07
USD FARMERS EXCHANGE CAPITAL II-144A-SUB 6.151%/VAR 13-01.11.53	1 000 000.00	1 243 035.96	0.02
USD FARMERS INSURANCE EXCHANGE-144A-SUB 4.747%/VAR 17-01.11.57	1 000 000.00	1 097 417.37	0.01
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC-SUB 4.125%/VAR 21-PRP	1 006 000.00	982 107.50	0.01
USD HARTFORD FINANCIAL-144A-SUB 3M LIBOR+212.5BP 17-12.02.47	5 875 000.00	5 641 404.13	0.07
USD HYATT HOTELS CORP O/N SOFR +105.00000 21-01.10.23	1 180 000.00	1 182 470.72	0.02
USD MACQUARIE GROUP LTD-144A 3.189%/VAR 17-28.11.23	7 935 000.00	8 043 016.78	0.10
USD MACQUARIE GROUP LTD-144A 1.340%/VAR 21-12.01.27	6 664 000.00	6 373 751.54	0.08
USD SOCIETE GENERALE SA-144A O/N SOFR+105BP 22-21.01.26	1 670 000.00	1 677 414.80	0.02
USD SOCIETE GENERALE SA-144A 2.226%/VAR 22-21.01.26	27 000 000.00	26 749 269.63	0.34
USD SOCIETE GENERALE-144A 2.797%/VAR 22-19.01.28	3 445 000.00	3 408 031.78	0.04
USD TEACHER INS&AN-144A-SUB 4.375%/3M LIBOR+266.1BP 14-15.09.54	4 900 000.00	5 024 719.06	0.06
USD VOYA FINANCIAL INC-SUB 5.650%/VAR 13-15.05.53	7 145 000.00	7 281 469.50	0.09
米ドル合計		110 302 928.24	1.39
ノート、変動利付債合計		110 302 928.24	1.39
中期債券、固定利付債			
USD			
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 4.00000% 15-22.01.25	3 742 000.00	3 938 352.51	0.05
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 3.95000% 15-21.04.25	9 890 000.00	10 401 040.04	0.13
USD BPCE SA-144A-SUB 4.62500% 14-11.07.24	6 610 000.00	6 964 530.39	0.09
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 3.85000% 14-08.07.24	18 040 000.00	18 803 339.87	0.24
USD INTESA SANPAOLO SPA-144A-SUB 5.01700% 14-26.06.24	2 546 000.00	2 650 354.99	0.03
USD INTESA SANPAOLO SPA-144A-SUB 5.71000% 16-15.01.26	5 332 000.00	5 749 535.54	0.07
USD SOCIETE GENERALE SA-144A 2.62500% 20-22.01.25	5 360 000.00	5 396 640.31	0.07
米ドル合計		53 903 793.65	0.68
中期債券、固定利付債合計		53 903 793.65	0.68
中期債券、変動利付債			
USD			
USD CREDIT AGRICOLE SA/LONDON-144A 1.907%/VAR 20-16.06.26	7 156 000.00	7 061 742.74	0.09
USD MACQUARIE GRP LTD-144A 4.150%/VAR 18-27.03.24	2 555 000.00	2 626 300.60	0.03
USD TORONTO-DOMINION BANK/THE 3M SOFRRATE+59BP 21-10.09.26	5 395 000.00	5 414 221.90	0.07
USD TRUIST FINANCIAL CORP 1.887%/VAR 21-07.06.29	3 730 000.00	3 578 860.40	0.05
米ドル合計		18 681 125.64	0.24
中期債券、変動利付債合計		18 681 125.64	0.24
債券、固定利付債			
USD			
USD AMERICAN AIRLINES 2019-1 CLASS AA 3.15000% 19-15.02.32	4 500 000.00	4 117 700.94	0.05
USD AMERICAN AIRLINES 3.20000% 16-15.06.28	2 000 000.00	1 524 849.07	0.02
USD ATLANTIC CITY ELECTRIC CO 2.30000% 21-15.03.31	710 000.00	696 638.03	0.01
USD BANNER HEALTH 2.33800% 20-01.01.30	1 130 000.00	1 123 325.41	0.01
USD BARNABAS HEALTH INC 4.00000% 12-01.07.28	2 000 000.00	2 154 593.38	0.03
USD COMMONSPIRIT HEALTH 3.34700% 19-01.10.29	1 250 000.00	1 289 708.49	0.02
USD CONTINENTAL AIRLINES PASS THRU TRUST 5.98300% 07-19.04.22	3 000 000.00	454 239.84	0.01
USD CONTINENTAL AIRLINES PASS THROUGH TRUST 6.90300% 07-19.04.22	16 415 000.00	330 741.75	0.00
USD COX ENTERPRISES INC-144A 7.37500% 97-15.07.27	280 000.00	344 691.24	0.00
USD DEUTSCHE TELEKOM INTL FINANCE BV-144A 4.37500% 18-21.06.28	1 700 000.00	1 856 380.94	0.02
USD FARMERS INSURANCE EXCHANGE-144A-SUB 8.62500% 94-01.05.24	700 000.00	795 093.12	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

2022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 FIVE CORNERS FUNDING TRUST-144A 4.41900% 13-15.11.23	6 220 000.00	6 512 398.53	0.08
USD INTERSTATE POWER & LIGHT CO 3.60000% 19-01.04.29	2 245 000.00	2 388 855.20	0.03
USD METROPOLITAN EDISON CO-144A 4.00000% 14-15.04.25	2 400 000.00	2 519 728.20	0.03
USD NBD BANK NA MICHIGAN-SUB 8.25000% 94-01.11.24	1 300 000.00	1 514 022.43	0.02
USD NGPL PIPECO LLC-144A 4.87500% 17-15.08.27	1 000 000.00	1 091 449.79	0.01
USD OHIOHEALTH CORP 2.29700% 21-15.11.31	3 530 000.00	3 448 660.83	0.04
USD PACIFIC LIFE CORP-144A 6.60000% 03-15.09.33	4 500 000.00	6 074 829.94	0.08
USD PEOPLES UNITED BANK-SUB 4.00000% 14-15.07.24	1 700 000.00	1 772 405.23	0.02
USD ROCHESTER GAS & ELECTRIC CORP-144A 3.10000% 17-01.06.27	3 500 000.00	3 640 462.00	0.05
USD SMBC AVIATION CAPITAL FINANCE DAC-144A 3.00000% 17-15.07.22	1 750 000.00	1 763 733.69	0.02
USD STATOIL ASA 7.15000% 95-15.11.25	3 500 000.00	4 149 771.22	0.05
USD SUTTER HEALTH 3.69500% 18-15.08.28	2 015 000.00	2 149 280.77	0.03
USD SYDNEY AIRPORT FINANCE CO PTY LTD-144A 3.62500% 16-28.04.26	9 547 000.00	10 015 941.96	0.13
USD UNITED AIRLINES PASS THRU TRUST 4.30000% 13-15.08.25	4 000 000.00	2 801 812.08	0.04
USD US AIRWAYS 2012-1 CLASS A PAS THRO TRST 5.90000% 12-01.10.24	1 220 000.00	584 683.28	0.01
USD WILLIAMS COMPANIES INC 7.50000% 01-15.01.31	150 000.00	197 816.07	0.00
USD YALE UNIVERSITY 0.87300% 20-15.04.25	4 500 000.00	4 391 258.27	0.06
米ドル合計		69 705 071.70	0.88
債券、固定利付債合計		69 705 071.70	0.88
債券、変動利付債			
USD			
USD HSBC HOLDINGS PLC-SUB 6.375%/VAR 15-PRP	1 585 000.00	1 675 693.70	0.02
USD METLIFE CAPITAL TRUST IV-144A-SUB 7.875%/VAR 07-15.12.37	1 760 000.00	2 345 200.00	0.03
米ドル合計		4 020 893.70	0.05
債券、変動利付債合計		4 020 893.70	0.05
地方債、固定利付債			
USD			
USD CALIFORNIA, STATE OF 2.50000% 19-01.10.22	8 415 000.00	8 511 493.96	0.11
USD CAMPBELL UNION SCHOOL DISTRICT 5.40600% 11-01.08.27	4 000 000.00	4 464 836.80	0.06
USD CITY OF BALTIMORE MD 5.00000% 10-15.10.25	4 150 000.00	4 473 172.54	0.06
USD COUNTY OF MIAMI-DADE FL AVIATION REV 3.50400% 17-01.10.31	865 000.00	917 425.66	0.01
USD HOUSTON TEXAS WATER & SEWER SYSTEM 3.82800% 14-15.05.28	800 000.00	860 834.24	0.01
USD LOS ANGELES DEPARTMENT OF POWER 5.51600% 10-01.07.27	1 520 000.00	1 779 610.84	0.02
USD LOS ANGELES UNIFIED SCHOOL DISTRICT 6.75800% 10-01.07.34	1 285 000.00	1 748 354.81	0.02
USD MASSACHUSETTS, STATE OF-SUB-S 2.96600% 19-15.10.32	850 000.00	878 697.19	0.01
USD NEW YORK CITY 2.80000% 19-01.08.30	1 325 000.00	1 360 604.08	0.02
USD NEW YORK CITY TRANS FINANCE AUTH REV 5.26700% 10-01.05.27	1 400 000.00	1 619 735.88	0.02
USD NEW YORK CITY TRANS FINANCE AUTH REV 5.76700% 09-01.08.36	1 125 000.00	1 375 951.61	0.02
USD NEW YORK CITY TRANS FIN AUTH REV-SUB 3.95000% 18-01.08.32	1 000 000.00	1 097 344.10	0.01
USD NEW YORK CITY TRANSITIONAL FIN AUTH-SUB 1.25000% 20-01.26	2 000 000.00	1 941 628.40	0.02
USD NEW YORK N Y, CITY OF 1.92300% 21-01.08.31	340 000.00	323 150.45	0.00
USD NEW YORK STATE DORMITORY AUTHORITY 5.50000% 10-15.03.30	4 755 000.00	5 452 850.46	0.07
USD NEW YORK STATE DORMITORY AUTHORITY 1.92500% 21-15.03.29	2 300 000.00	2 259 631.78	0.03
USD NEW YORK STATE URBAN DEV CORP 3.37000% 17-15.03.30	1 295 000.00	1 365 366.67	0.02
USD NEW YORK, CITY OF 0.43100% 21-01.08.22	810 000.00	809 271.00	0.01
USD SANTA CLARA VALLEY TRANSPORTATION AUTH 5.87600% 10-01.04.32	2 205 000.00	2 628 809.82	0.03
USD UNIVERSITY OF CALIFORNIA 4.60100% 13-15.05.31	1 385 000.00	1 580 754.93	0.02
USD UNIVERSITY OF CALIFORNIA REVS 0.88300% 20-15.05.25	3 000 000.00	2 925 130.50	0.04
USD UNIVERSITY OF CALIFORNIA REVS 1.31600% 20-15.05.27	3 650 000.00	3 526 085.42	0.04
米ドル合計		51 900 741.14	0.65
地方債、固定利付債合計		51 900 741.14	0.65
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		1 294 202 260.07	16.31

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 - US マルチ・クレジット

2022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			
株式			
バミューダ			
USD AIRCASTLE LIMITED 5.25%-FRN JNR PERP USD ' 144A	2 003 000.00	2 014 737.58	0.03
バミューダ合計		2 014 737.58	0.03
株式合計		2 014 737.58	0.03
アセット・バック証券、変動利付債			
USD			
USD NAVIENT STUDENT LOAN TRUST-144A VAR 16-25.06.65	1 000 000.00	1 034 537.80	0.01
USD TRINITAS CLO IV LTD-144A 3M LIBOR+110BP 21-18.10.31	8 500 000.00	8 495 967.60	0.11
米ドル合計		9 530 505.40	0.12
アセット・バック証券、変動利付債合計		9 530 505.40	0.12
モーゲージ・バック証券、固定利付債			
USD			
USD JP MORGAN CHASE COM MTG SEC TRUST-SUB 3.80460% 14-01.07.47	4 750 000.00	4 922 252.57	0.06
米ドル合計		4 922 252.57	0.06
モーゲージ・バック証券、固定利付債合計		4 922 252.57	0.06
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	1 677 720.74	0.02
USD ABBVIE INC 3.85000% 20-15.06.24	2 939 000.00	3 072 533.22	0.04
USD AIR CANADA CLASS AA PASS THR TRT-144A 3.30000% 17-15.01.30	1 750 000.00	1 435 497.65	0.02
USD BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUT-144A 3.75000% 18-20.07.23	3 170 000.00	3 274 689.09	0.04
USD BBVA USA 2.50000% 19-27.08.24	3 650 000.00	3 727 748.36	0.05
USD BMW US CAPITAL LLC-144A 3.90000% 20-09.04.25	10 510 000.00	11 129 691.57	0.14
USD BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 2.75000% 20-15.02.23	5 150 000.00	5 240 461.30	0.07
USD BRIXMOR OPERATING PARTNERSHIP LP 2.25000% 21-01.04.28	4 380 000.00	4 247 868.98	0.05
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.00000% 17-01.02.28	1 190 000.00	1 204 518.00	0.01
USD CCO HOLDINGS LLC/CCO HOLDINGS CAP-144A 4.50000% 21-01.06.33	1 635 000.00	1 555 048.50	0.02
USD CHARLES RIVER LABORATORIES INTL-144A 3.75000% 21-15.03.29	2 120 000.00	2 045 164.00	0.02
USD CHENIERE ENERGY INC 4.62500% 21-15.10.28	850 000.00	862 750.00	0.01
USD CITIZENS FINANCIAL GROUP INC-SUB 2.63800% 21-30.09.32	3 960 000.00	3 772 462.20	0.05
USD COMERICA BANK 2.50000% 19-23.07.24	5 700 000.00	5 812 082.57	0.07
USD CYRUSONE LP / CYRUSONE FIN CORP 3.45000% 19-15.11.29	4 610 000.00	4 935 097.89	0.06
USD DANSKE BANK A/S-144A 1.62100% 20-11.09.26	1 905 000.00	1 843 750.27	0.02
USD DANSKE BANK A/S-144A 1.54900% 21-10.09.27	3 960 000.00	3 795 519.02	0.05
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 4.90000% 21-01.10.26	3 625 000.00	3 978 466.94	0.05
USD DELTA AIR LN 2020-1 CLS AA PAS THRU TRT 2.00000% 20-10.06.28	2 015 000.00	1 789 698.10	0.02
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-144A 1.37500% 21-12.07.26	4 825 000.00	4 622 802.00	0.06
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-144A 2.25000% 21-12.07.31	5 635 000.00	5 250 226.92	0.07
USD FMG RESOURCES AUGUST 2006 PTY LTD-144A 4.37500% 21-01.04.31	530 000.00	530 704.31	0.01
USD FOX CORP 4.70900% 20-25.01.29	5 127 000.00	5 655 960.23	0.07
USD GEORGIA-PACIFIC LLC-144A 2.30000% 20-30.04.30	1 000 000.00	981 670.72	0.01
USD GFL ENVIRONMENTAL INC-144A 3.50000% 20-01.09.28	3 373 000.00	3 174 836.25	0.04
USD HEALTH CARE SER CORP A MUT LGL RES-144A 2.20000% 20-01.06.30	1 425 000.00	1 352 433.56	0.02
USD IHS MARKIT LTD-144A 5.00000% 16-01.11.22	4 672 000.00	4 748 293.76	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

2022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 INGEVITY CORP-144A 3.87500% 20-01.11.28	1 211 000.00	1 146 453.70	0.01
USD INTERNATIONAL FLAVORS & FRAG INC-144A 1.23000% 21-01.10.25	14 055 000.00	13 531 477.67	0.17
USD INTERNATIONAL FLAVORS & FRAG INC-144A 1.83200% 21-15.10.27	9 785 000.00	9 351 949.86	0.12
USD INTERNATIONAL FLAVORS & FRAG INC-144A 2.30000% 21-01.11.30	2 900 000.00	2 735 004.67	0.03
USD INVERSIONES CMPC SA-144A 3.00000% 21-06.04.31	2 350 000.00	2 209 440.63	0.03
USD ITC HOLDINGS CORP-144A 2.95000% 20-14.05.30	500 000.00	498 945.85	0.01
USD JAZZ SECURITIES DAC-144A 4.37500% 21-15.01.29	1 283 000.00	1 266 770.05	0.02
USD KFC HLDG/PIZZA HUT HLDG/TACO BELL-144A 4.75000% 17-01.06.27	1 950 000.00	1 988 590.50	0.02
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 3.75000% 21-01.04.30	5 000 000.00	5 167 862.15	0.06
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 3.87500% 21-15.05.27	7 615 000.00	7 903 221.12	0.10
USD LAMAR MEDIA CORP 3.62500% 21-15.01.31	3 150 000.00	2 929 500.00	0.04
USD LEVEL 3 FINANCING INC-144A 3.75000% 21-15.07.29	450 000.00	410 625.00	0.00
USD MACYS RETAIL HOLDINGS INC-144A 5.87500% 21-01.04.29	2 000 000.00	2 038 400.00	0.02
USD MATTEL INC-144A 3.37500% 21-01.04.26	1 678 000.00	1 670 868.50	0.02
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I-144A 1.55000% 21-07.01.31	10 000 000.00	9 126 781.10	0.11
USD NORDSTROM INC 2.30000% 21-08.04.24	4 800 000.00	4 717 584.00	0.06
USD PHILLIPS EDISON GROCERY CENTER 2.62500% 21-15.11.31	7 950 000.00	7 605 618.80	0.10
USD PROTECTIVE LIFE GLOBAL FUNDING-144A 1.61800% 21-15.04.26	1 735 000.00	1 700 055.65	0.02
USD PROTECTIVE LIFE GLOBAL FUNDING-144A 1.90000% 21-06.07.28	2 880 000.00	2 765 289.69	0.03
USD QUICKEN LOANS LLC-144A 2.87500% 21-15.10.26	8 950 000.00	8 511 136.75	0.11
USD ROYALTY PHARMA PLC 1.75000% 21-02.09.27	4 900 000.00	4 665 256.39	0.06
USD SBA COMMUNICATIONS CORP 3.12500% 22-01.02.29	2 475 000.00	2 306 576.25	0.03
USD SLM CORP 4.20000% 20-29.10.25	1 422 000.00	1 461 105.00	0.02
USD SMITHFIELD FOODS INC-144A 2.62500% 21-13.09.31	6 380 000.00	5 956 210.67	0.08
USD TELEFLEX INC-144A 4.25000% 20-01.06.28	600 000.00	595 338.00	0.01
USD TRACTOR SUPPLY CO 1.75000% 20-01.11.30	5 840 000.00	5 298 745.76	0.07
USD USA COMPRESSION PARTNERS LLC 6.87500% 19-01.09.27	569 000.00	584 306.10	0.01
USD VALVOLINE INC-144A 3.62500% 20-15.06.31	2 790 000.00	2 556 895.50	0.03
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC-144A 2.35500% 21-15.03.32	11 355 000.00	10 782 965.87	0.14
USD WALT DISNEY CO 7.75000% 19-20.01.24	478 000.00	532 601.93	0.01
米ドル合計		213 733 273.31	2.69
ノート、固定利付債合計		213 733 273.31	2.69
ノート、変動利付債			
USD			
USD ANALOG DEVICES INC O/N SOFR +25BP 21-01.10.24	9 000 000.00	8 998 919.82	0.11
USD BNP PARIBAS SA-144A 1.323%/VAR 21-13.01.27	2 550 000.00	2 434 133.13	0.03
USD BNP PARIBAS SA-144A 2.591%/VAR 22-20.01.28	1 970 000.00	1 955 936.33	0.03
USD CIT BANK NA 2.969%/VAR 19-27.09.25	6 750 000.00	6 892 026.75	0.09
USD DNB BANK ASA-144A 0.856%/VAR 21-30.09.25	5 690 000.00	5 554 236.60	0.07
USD FIFTH THIRD BANCORP-SUB 4.500%/VAR 20-PRP	1 700 000.00	1 751 000.00	0.02
米ドル合計		27 586 252.63	0.35
ノート、変動利付債合計		27 586 252.63	0.35
中期債券、固定利付債			
USD			
USD PRINCIPAL LIFE GLOBAL FUNDING-144A 1.25000% 21-16.08.26	3 000 000.00	2 878 705.44	0.04
USD RELIANCE STANDARD LIFE GLOBAL-144A 1.51200% 21-28.09.26	8 200 000.00	7 933 361.42	0.10
米ドル合計		10 812 066.86	0.14
中期債券、固定利付債合計		10 812 066.86	0.14

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

2022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 AIB GROUP PLC-144A 4.263%/3M LIBOR+187.4BP 19-10.04.25	2 595 000.00	2 697 513.55	0.03
米ドル合計		2 697 513.55	0.03
中期債券、変動利付債合計		2 697 513.55	0.03
債券、固定利付債			
EUR			
EUR ARDAGH METAL PACKAGING FINANCE-144A 2.00000% 21-01.09.28	2 236 000.00	2 390 627.78	0.03
ユーロ合計		2 390 627.78	0.03
USD			
USD ADVOCATE HEALTH & HOSPITALS CORP 3.82900% 18-15.08.28	1 215 000.00	1 319 434.46	0.02
USD AMERICAN AIRLINES 2019-1 CLASS A 3.50000% 19-15.08.33	4 200 000.00	3 626 306.11	0.04
USD ASCENSION HEALTH 2.53200% 19-15.11.29	1 495 000.00	1 508 589.67	0.02
USD BON SECOURS MERCY HEALTH INC 2.09500% 20-01.06.31	925 000.00	880 673.17	0.01
USD COMMONSPIRIT HEALTH 2.78200% 20-01.10.30	1 250 000.00	1 248 804.90	0.01
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I-144A 2.95000% 20-09.04.30	3 060 000.00	3 111 648.15	0.04
USD NORTHWELL HEALTHCARE INC 3.39100% 17-01.11.27	8 000 000.00	8 392 686.96	0.11
USD PEACEHEALTH OBLIGATED GROUP 1.37500% 20-15.11.25	6 455 000.00	6 317 335.24	0.08
USD PIEDMONT HEALTHCARE 2.04400% 21-01.01.32	1 605 000.00	1 514 622.79	0.02
USD PRINCIPAL LIFE GLOBAL FUNDING II-144A 0.75000% 21-12.04.24	2 165 000.00	2 124 210.21	0.03
USD STANFORD HEALTH CARE 3.31000% 20-15.08.30	990 000.00	1 049 754.34	0.01
米ドル合計		31 094 066.00	0.39
債券、固定利付債合計		33 484 693.78	0.42
地方債、固定利付債			
USD			
USD CALIFORNIA STATE UNIVERSITY 1.99400% 21-01.11.32	910 000.00	857 545.87	0.01
USD CALIFORNIA STATE UNIVERSITY 2.37400% 21-01.11.35	980 000.00	929 177.49	0.01
USD LOS ANGELES UNIFIED SCHOOL DISTRICT A-1 5.75000% 09-01.07.34	3 750 000.00	4 765 003.50	0.06
USD NEW YORK CITY TRANSITIONAL FINANCE 1.97000% 21-01.02.33	1 615 000.00	1 530 346.87	0.02
米ドル合計		8 082 073.73	0.10
地方債、固定利付債合計		8 082 073.73	0.10
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		312 863 369.41	3.94
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 AMERICAN EXPRESS CO-144A 3.30000% 21-03.05.27	4 315 000.00	4 503 419.99	0.06
USD AMFAM HOLDINGS INC-144A 2.80500% 21-11.03.31	2 100 000.00	2 084 314.99	0.03
USD ASB BANK LTD-144A 1.62500% 21-22.10.26	20 000 000.00	19 479 866.00	0.25
USD ATHENE GLOBAL FUNDING-144A 1.60800% 21-29.06.26	2 365 000.00	2 283 527.72	0.03
USD AVIATION CAPITAL GROUP-144A 1.95000% 21-20.09.26	2 548 000.00	2 428 660.35	0.03
USD AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD-144A 2.52800% 21-18.11.27	2 275 000.00	2 156 700.00	0.03
USD BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL-144A 1.60400% 21-04.10.26	19 190 000.00	18 625 974.43	0.23
USD BAXTER INTERNATIONAL INC-144A 0.86800% 21-01.12.23	3 300 000.00	3 254 807.09	0.04
USD BAXTER INTERNATIONAL-144A 1.91500% 21-01.02.27	9 270 000.00	9 091 568.35	0.11
USD BAXTER INTERNATIONAL-144A 2.27200% 21-01.12.28	4 800 000.00	4 697 244.19	0.06
USD BROADCOM INC-144A 3.41900% 21-15.04.33	5 386 000.00	5 364 922.42	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

2022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 COMMONWEALTH BANK OF AUS-144A-SUB 2.68800% 21-11.03.31	4 775 000.00	4 550 815.66	0.06
USD COX COMMUNICATIONS INC-144A 2.60000% 21-15.06.31	6 535 000.00	6 280 212.71	0.08
USD DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC-144A 2.45000% 21-02.03.31	2 460 000.00	2 418 144.78	0.03
USD DAIMLER TRUCKS FINANCE NORTH AMERI-144A 2.37500% 21-14.12.28	5 300 000.00	5 156 894.49	0.06
USD EQUITABLE FINANCIAL LIFE GLOBAL FU-144A 1.80000% 21-08.03.28	2 350 000.00	2 244 953.90	0.03
USD EQUITABLE FINANCIAL LIFE GLOBAL-144A 0.80000% 21-12.08.24	1 340 000.00	1 302 253.38	0.02
USD F&G GLOBAL FUNDING-144A 0.90000% 21-20.09.24	5 050 000.00	4 909 422.04	0.06
USD FRESENIUS MED CAR US FIN III INC-144A 1.87500% 21-01.12.26	5 890 000.00	5 710 622.82	0.07
USD HILTON DOMESTIC OPERATING CO INC-144A 3.62500% 21-15.02.32	4 392 000.00	4 167 700.56	0.05
USD INDEPENDENCE ENERGY FINANCE LLC-144A 7.25000% 21-01.05.26	2 025 000.00	2 077 852.50	0.03
USD INTESA SANPAOLO SPA-144A-SUB 4.19800% 21-01.06.32	9 225 000.00	8 833 707.42	0.11
USD JACKSON FINANCIAL INC-144A 1.12500% 21-22.11.23	3 950 000.00	3 903 385.93	0.05
USD JACKSON FINANCIAL-144A 3.12500% 21-23.11.31	12 729 000.00	12 409 077.97	0.16
USD JDE PEET ' S NV-144A 0.80000% 21-24.09.24	4 240 000.00	4 090 797.62	0.05
USD JDE PEET ' S NV-144A 1.37500% 21-15.01.27	11 200 000.00	10 595 772.20	0.13
USD LUNDIN ENERGY FINANCE BV-144A 3.10000% 21-15.07.31	19 150 000.00	18 701 162.69	0.24
USD MERITAGE HOMES CORP-144A 3.87500% 21-15.04.29	4 000 000.00	4 025 000.00	0.05
USD MONDELEZ INTERNATIONAL HOLDING NET-144A 0.75000% 21-24.09.24	6 785 000.00	6 585 675.22	0.08
USD MONDELEZ INTERNATIONAL HOLDING NET-144A 1.25000% 21-24.09.26	5 620 000.00	5 375 937.39	0.07
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-144A-SUB 2.99000% 21-21.05.31	7 000 000.00	6 794 295.90	0.09
USD NGPL PIPECO LLC-144A 3.25000% 21-15.07.31	2 250 000.00	2 227 584.60	0.03
USD NIAGARA MOHAWK POWER CORP-144A 2.75900% 22-10.01.32	3 500 000.00	3 483 700.81	0.04
USD ORGANON FINANCE 1 LLC-144A 4.12500% 21-30.04.28	3 500 000.00	3 444 070.00	0.04
USD PARKLAND CORP/CANADA-144A 4.50000% 21-01.10.29	2 500 000.00	2 403 537.50	0.03
USD SABRA HEALTH CARE LP 3.20000% 21-01.12.31	4 340 000.00	4 118 857.21	0.05
USD SEALED AIR CORP-144A 1.57300% 21-15.10.26	7 700 000.00	7 347 965.31	0.09
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 3.12500% 21-01.09.26	1 688 000.00	1 618 454.40	0.02
USD SQUARE INC-144A 2.75000% 21-01.06.26	4 034 000.00	3 910 438.58	0.05
USD STANDARD CHARTERED PLS-144A 1.82200% 21-23.11.25	4 370 000.00	4 286 894.92	0.05
USD STONECO LTD-144A 3.95000% 21-16.06.28	375 000.00	314 953.13	0.00
USD TARGA RESOURCES PARTNERS-144A 4.00000% 21-15.01.32	1 600 000.00	1 592 640.00	0.02
米ドル合計		228 853 787.17	2.88
ノート、固定利付債合計		228 853 787.17	2.88
ノート、変動利付債			
USD			
USD ATHENE GLOBAL FUNDING-144A 3M SOFRRATE+70BP 21-24.02.24	2 210 000.00	2 213 697.35	0.03
USD BNP PARIBAS SA-144A 1.675%/VAR 21-30.06.27	6 140 000.00	5 916 578.66	0.07
USD BPCE SA-144A-SUB 3.648%/VAR 22-14.01.37	3 900 000.00	3 852 450.89	0.05
USD DNB BANK ASA-144A 1.605%/VAR 21-30.03.28	9 365 000.00	8 966 062.99	0.11
USD MACQUARIE BANK LTD-144A-SUB VAR 21-03.03.36	5 300 000.00	5 065 914.90	0.06
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-144A-SUB 3.347%/VAR 22-12.01.37	4 700 000.00	4 618 897.27	0.06
USD UNICREDIT SPA-144A 1.982%/VAR 21-03.06.27	9 655 000.00	9 178 657.34	0.12
USD UNICREDIT SPA-144A 3.127%/VAR 21-03.06.32	900 000.00	849 706.80	0.01
米ドル合計		40 661 966.20	0.51
ノート、変動利付債合計		40 661 966.20	0.51
中期債券、固定利付債			
USD			
USD BRIGHTHOUSE FINANCIAL GLOBAL FUND-144A 1.75000% 22-13.01.25	7 100 000.00	7 023 675.00	0.09
USD NBN CO LTD-144A 0.87500% 21-08.10.24	6 700 000.00	6 524 844.58	0.08
USD NBN CO LTD-144A 1.62500% 21-08.01.27	12 425 000.00	11 947 361.87	0.15
米ドル合計		25 495 881.45	0.32
中期債券、固定利付債合計		25 495 881.45	0.32

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット

2022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 MACQUARIE GROUP LTD-144A 1.629%/VAR 21-23.09.27	1 320 000.00	1 267 630.72	0.02
USD MACQUARIE GROUP LTD-144A 2.691%/VAR 21-23.06.32	5 045 000.00	4 848 283.85	0.06
USD SOCIETE GENERALE SA-144A 1.792%/VAR 21-09.06.27	2 775 000.00	2 650 140.43	0.03
米ドル合計		8 766 055.00	0.11
中期債券、変動利付債合計		8 766 055.00	0.11
債券、変動利付債			
USD			
USD BPCE SA-144A 2.045%/VAR 21-19.10.27	12 390 000.00	12 016 580.39	0.15
米ドル合計		12 016 580.39	0.15
債券、変動利付債合計		12 016 580.39	0.15
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		315 794 270.21	3.97
投資有価証券合計		7 748 749 383.25	97.62
派生商品			
公認の証券取引所に上場されている派生商品			
債券に係る金融先物			
EUR EURO-BUND FUTURE 08.03.22	-35.00	192 730.11	0.00
EUR EURO-BOBL FUTURE 08.03.22	-4.00	9 550.92	0.01
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 22.03.22	338.00	-457 606.93	-0.01
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 22.03.22	-316.00	721 517.02	0.01
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.22	-376.00	614 131.32	0.01
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.22	757.00	-1 324 859.29	-0.02
USD US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 22.03.22	-57.00	257 370.42	0.00
USD US LONG BOND FUTURE 22.03.22	-463.00	1 591 930.15	0.02
債券に係る金融先物合計		1 604 763.72	0.02
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		1 604 763.72	0.02
派生商品合計		1 604 763.72	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

2022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(日-月-年)	
USD	4 131 117.35	EUR	3 644 738.00	2.2.2022	45 366.05 0.00
USD	6 722 874.42	EUR	5 944 000.00	10.2.2022	58 589.89 0.00
CHF	1 856 925 107.23	USD	2 016 836 000.00	18.2.2022	-21 575 798.61 -0.27
EUR	1 829 002 410.43	USD	2 073 765 000.00	18.2.2022	-22 798 866.65 -0.29
GBP	173 923 225.11	USD	236 178 000.00	18.2.2022	-2 858 801.99 -0.04
JPY	3 698 463 696.00	USD	32 020 000.00	18.2.2022	81 630.16 0.00
EUR	15 697 560.34	USD	18 000 000.00	18.2.2022	-397 418.15 0.00
USD	30 000 000.00	CHF	27 450 840.00	18.2.2022	504 158.55 0.01
USD	31 000 000.00	EUR	27 319 153.81	18.2.2022	365 453.57 0.00
USD	490 000.00	JPY	55 973 680.00	18.2.2022	4 164.12 0.00
USD	3 700 000.00	GBP	2 717 812.47	18.2.2022	54 035.95 0.00
EUR	3 644 738.00	USD	4 110 488.13	2.2.2022	-24 736.83 0.00
USD	4 112 831.70	EUR	3 644 738.00	2.3.2022	24 795.15 0.00
EUR	3 289 000.00	USD	3 671 731.40	10.2.2022	15 824.42 0.00
先渡為替契約合計					-46 501 604.37 -0.59
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					220 374 960.16 2.78
当座借越およびその他の短期負債					-35 960.85 0.00
その他の資産および負債					13 261 989.58 0.17
純資産総額					7 937 453 531.49 100.00

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

2022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			
株式			
アメリカ合衆国			
USD BK OF AMERICA CORP 4.375% DP SH RP 1/1000TH IN	20 000.00	472 800.00	0.01
USD NOBLE CORP NEW USDO.00001	46 834.00	1 156 331.46	0.03
アメリカ合衆国合計		1 629 131.46	0.04
株式合計			
		1 629 131.46	0.04
アセット・バック証券、固定利付債			
EUR			
EUR CRC BREEZE FINANCE SA 5.29000% 06-08.05.26	1 550 000.00	472 823.72	0.01
EUR CRC BREEZE FINANCE SA 6.11000% 06-08.05.26	550 000.00	119 945.13	0.00
ユーロ合計		592 768.85	0.01
アセット・バック証券、固定利付債合計			
		592 768.85	0.01
ノート、固定利付債			
EUR			
EUR ACCOR SA-REG-S 2.37500% 21-29.11.28	1 300 000.00	1 450 098.03	0.04
EUR ADIENT GLOBAL HOLDINGS LTD-REG-S 3.50000% 16-15.08.24	7 113 000.00	8 053 409.73	0.20
EUR ADLER GROUP SA-REG-S 2.75000% 20-13.11.26	200 000.00	180 481.00	0.00
EUR ADLER GROUP SA-REG-S 1.87500% 21-14.01.26	2 200 000.00	1 979 816.04	0.05
EUR ADLER GROUP SA-REG-S 2.25000% 21-14.01.29	3 100 000.00	2 729 385.25	0.07
EUR ADLER GROUP SA-REG-S 2.25000% 21-27.04.27	3 700 000.00	3 313 016.85	0.08
EUR ADO PROPERTIES SA-REG-S 3.25000% 20-05.08.25	1 800 000.00	1 728 076.21	0.04
EUR ALMIRALL SA-REG-S 2.12500% 21-30.09.26	1 613 000.00	1 788 102.28	0.04
EUR ALTICE FINCO SA-REG-S 4.75000% 17-15.01.28	2 425 000.00	2 470 847.16	0.06
EUR ALTICE FRANCE HOLDING SA-REG-S 8.00000% 19-15.05.27	7 725 000.00	9 035 210.68	0.23
EUR ALTICE FRANCE SA/FRANCE-REG-S 4.25000% 21-15.10.29	8 625 000.00	9 181 326.30	0.23
EUR ALTICE FRANCE-REG-S 5.87500% 18-01.02.27	4 275 000.00	4 946 107.03	0.12
EUR AMS AG-REG-S 6.00000% 20-31.07.25	2 000 000.00	2 342 890.00	0.06
EUR APCOA PARKING HOLDINGS GMBH-REG-S 4.62500% 21-15.01.27	3 505 000.00	3 876 179.96	0.10
EUR ARD FINANCE SA-REG-S (PIK) 5.00000% 19-30.06.27	1 468 400.00	1 660 891.09	0.04
EUR ARDAGH METAL PACKAGING FINANCE -REG-S 3.00000% 21-01.09.29	7 725 000.00	8 139 899.02	0.20
EUR ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-REG-S 2.12500% 19-15.08.26	1 890 000.00	2 018 052.23	0.05
EUR ARENA LUXEMBOURG FINANCE SARL-REG-S 1.87500% 20-01.02.28	3 950 000.00	4 051 574.25	0.10
EUR ASHLAND SERVICES BV-REG-S 2.00000% 20-30.01.28	2 050 000.00	2 246 114.07	0.06
EUR AUTOSTRADA PER L' ITALIA SPA-REG-S 2.00000% 20-04.12.28	2 750 000.00	3 124 841.87	0.08
EUR AVANTOR FUNDING INC-REG-S 3.87500% 20-15.07.28	500 000.00	565 396.47	0.01
EUR BELDEN INC-REG-S 3.37500% 21-15.07.31	1 865 000.00	2 031 666.44	0.05
EUR BLITZ F18-674 GMBH-REG-S 6.00000% 18-30.07.26	1 375 000.00	1 382 412.62	0.03
EUR BRITISH AIRWAYS PLC-REG-S 2.75000% 21-25.03.25	2 500 000.00	2 771 369.05	0.07
EUR CANPACK SA AND EASTERN PA-REG-S 2.37500% 20-01.11.27	2 855 000.00	3 140 446.47	0.08
EUR CATALENT PHARMA SOLUTIONS INC-REG-S 2.37500% 20-01.03.28	5 906 000.00	6 357 787.15	0.16
EUR CECONOMY AG-REG-S 1.75000% 21-24.06.26	4 000 000.00	4 341 408.80	0.11
EUR CELLNEX TELECOM SA 1.87500% 20-26.06.29	1 600 000.00	1 730 838.35	0.04
EUR CHROME HOLDCO REG-S-SUB 5.00000% 21-31.05.29	1 923 000.00	2 091 012.51	0.05
EUR CMA CGM SA-REG-S 7.50000% 20-15.01.26	2 200 000.00	2 686 698.01	0.07
EUR CONSOLIDATED ENERGY FINANCE SA-REG-S 5.00000% 21-15.10.28	2 600 000.00	2 768 578.54	0.07
EUR CONSTELLIUM SE-REG-S 4.25000% 17-15.02.26	220 000.00	247 176.86	0.01
EUR CONSTELLIUM SE-REG-S 3.12500% 21-15.07.29	3 270 000.00	3 462 445.25	0.09
EUR COTY INC-REG-S 4.00000% 18-15.04.23	1 125 000.00	1 251 666.56	0.03
EUR COTY INC-REG-S 4.75000% 18-15.04.26	2 200 000.00	2 461 810.16	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

2022年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR CROWN EUROPEAN HOLDINGS SA-REG-S 2.25000% 18-01.02.23	1 712 000.00	1 932 586.07	0.05
EUR DANA FINANCING LUXEMBOURG SARL-REG-S 3.00000% 21-15.07.29	1 375 000.00	1 487 241.91	0.04
EUR DEMIRE DUTCH MITSTND REL EST AG-REG-S 1.87500% 19-15.10.24	1 500 000.00	1 637 865.08	0.04
EUR DIEBOLD NIXDORF DUTCH HOLDING BV-REG-S 9.00000% 20-15.07.25	400 000.00	474 958.73	0.01
EUR DKT FINANCE APS-REG-S 7.00000% 18-17.06.23	8 100 000.00	9 132 237.93	0.23
EUR DOUGLAS GMBH-REG-S 6.00000% 21-08.04.26	2 320 000.00	2 542 333.84	0.06
EUR DOVALUE SPA-REG-S 5.00000% 20-04.08.25	1 000 000.00	1 151 827.50	0.03
EUR DUFYR ONE BV-REG-S 2.50000% 17-15.10.24	500 000.00	549 290.00	0.01
EUR DUFYR ONE BV-REG-S 2.00000% 19-15.02.27	8 225 000.00	8 453 212.92	0.21
EUR EDREAMS ODIGEO SA-REG-S 5.50000% 18-01.09.23	1 000 000.00	1 136 348.73	0.03
EUR EDREAMS ODIGEO SA-REG-S 5.50000% 22-15.07.27	860 000.00	953 214.33	0.02
EUR EG GLOBAL FINANCE PLC-REG-S 4.37500% 19-07.02.25	2 550 000.00	2 806 209.95	0.07
EUR EG GLOBAL FINANCE PLC-REG-S 6.25000% 19-30.10.25	500 000.00	562 443.82	0.01
EUR ELIOR GROUP SA-REG-S 3.75000% 21-15.07.26	3 150 000.00	3 438 017.02	0.09
EUR ELLAKTOR VALUE PLC-REG-S 6.37500% 19-15.12.24	2 375 000.00	2 432 441.65	0.06
EUR FAURECIA SE-REG-S 2.37500% 21-15.06.29	2 210 000.00	2 412 377.99	0.06
EUR FAURECIA-REG-S 2.75000% 21-15.02.27	4 603 000.00	5 132 986.70	0.13
EUR FLAMINGO LUX II SCA-REG-S 5.00000% 21-31.03.29	4 204 000.00	4 467 247.42	0.11
EUR FORTUNE STAR BVI LTD-REG-S 4.35000% 19-06.05.23	955 000.00	1 058 377.45	0.03
EUR GAMMA BIDCO SPA-REG-S 5.12500% 21-15.07.25	1 900 000.00	2 129 900.00	0.05
EUR GARFUNKELUX HOLDCO 3 SA-REG-S 6.75000% 20-01.11.25	330 000.00	378 105.46	0.01
EUR GOODYEAR DUNLOP TIRES EUROPE BV-REG-S 2.75000% 21-15.08.28	2 669 000.00	2 971 902.93	0.07
EUR GRIFOLS ESCROW ISSUER SA-REG-S 3.87500% 21-15.10.28	11 983 000.00	12 990 031.99	0.33
EUR GRIFOLS SA-REG-S 1.62500% 19-15.02.25	1 083 000.00	1 191 983.84	0.03
EUR HOUSE OF FINANCE NV/THE-REG-S 4.37500% 19-15.07.26	3 875 000.00	4 336 846.60	0.11
EUR HOUSE OF HR-REG-S-SUB 7.50000% 20-15.01.27	400 000.00	466 560.20	0.01
EUR IHO VERWALTUNGS GMBH-REG-S (PIK) 3.62500% 19-15.05.25	1 000 000.00	1 131 089.00	0.03
EUR IHO VERWALTUNGS GMBH-REG-S (PIK) 3.87500% 19-15.05.27	4 825 000.00	5 495 474.38	0.14
EUR ILIAD HOLDING SASU-REG-S 5.12500% 21-15.10.26	2 923 000.00	3 338 160.13	0.08
EUR ILIAD HOLDING SASU-REG-S 5.62500% 21-15.10.28	5 023 000.00	5 725 368.89	0.14
EUR INTERNATIONAL DESIGN GROUP SPA-REG-S 6.50000% 18-15.11.25	5 550 000.00	6 400 419.56	0.16
EUR INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC-REG-S 3.50000% 19-15.06.26	280 000.00	315 135.52	0.01
EUR INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC-REG-S 2.37500% 19-15.04.28	1 000 000.00	1 063 548.75	0.03
EUR INTERTRUST GROUP BV-REG-S 3.37500% 18-15.11.25	1 500 000.00	1 694 195.33	0.04
EUR INTL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP-REG-S 1.50000% 19-04.07.27	2 100 000.00	2 139 420.20	0.05
EUR INTL CONSOLIDATED AIRLINES GP-REG-S 3.75000% 21-25.03.29	4 000 000.00	4 405 530.00	0.11
EUR INTRUM AB-REG-S 3.00000% 19-15.09.27	2 725 000.00	2 924 899.18	0.07
EUR INTRUM AB-REG-S 4.87500% 20-15.08.25	1 500 000.00	1 723 107.04	0.04
EUR IQVIA INC-REG-S 1.75000% 21-15.03.26	1 100 000.00	1 225 516.43	0.03
EUR IQVIA INC-REG-S 2.25000% 19-15.01.28	3 195 000.00	3 500 335.77	0.09
EUR IQVIA INC-REG-S 2.87500% 20-15.06.28	3 400 000.00	3 805 149.31	0.10
EUR JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-REG-S 6.87500% 19-15.11.26	5 393 000.00	6 642 793.18	0.17
EUR JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-REG-S 5.87500% 19-15.11.24	1 110 000.00	1 312 747.05	0.03
EUR JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-REG-S 4.50000% 21-15.07.28	2 305 000.00	2 554 706.87	0.06
EUR JAMES HARDIE INTERNATIONAL LTD-REG-S 3.62500% 18-01.10.26	1 900 000.00	2 144 809.30	0.05
EUR KAIKO BONDSCO TELECOM SA-REG-S 5.12500% 21-30.09.29	875 000.00	955 852.88	0.02
EUR KLEOPATRA HOLDINGS 2 SCA-REG-S-SUB 6.50000% 21-01.09.26	2 425 000.00	2 381 084.76	0.06
EUR KRONOS INTERNATIONAL INC-REG-S 3.75000% 17-15.09.25	4 300 000.00	4 832 206.14	0.12
EUR LA FINANCIERE ATALIAN SA-REG-S 5.12500% 18-15.05.25	3 725 000.00	3 983 182.32	0.10
EUR LABORATOIRE EIMER SELARL-REG-S 5.00000% 21-01.02.29	1 175 000.00	1 292 554.36	0.03
EUR LHMC FINCO SARL-REG-S 6.25000% 18-20.12.23	2 000 000.00	1 915 739.12	0.05
EUR LINCOLN FINANCING SARL-REG-S 3.62500% 19-01.04.24	4 220 000.00	4 753 941.96	0.12
EUR LOXAM SAS-REG-S 3.75000% 19-15.07.26	600 000.00	657 910.41	0.02
EUR LOXAM SAS-REG-S-SUB 5.75000% 19-15.07.27	625 000.00	682 261.61	0.02
EUR LUNE HOLDINGS SARL-REG-S 5.62500% 21-15.11.28	2 100 000.00	2 254 050.75	0.06
EUR MATTERHORN TELECOM SA-REG-S 4.00000% 17-15.11.27	4 725 000.00	5 287 508.70	0.13
EUR MAXEDA DIY HOLDING BV-REG-S 5.87500% 20-01.10.26	1 325 000.00	1 467 798.16	0.04
EUR MONITCHEM HOLDCO 2 SA-REG-S-SUB 9.50000% 19-15.09.26	1 100 000.00	1 308 627.38	0.03
EUR MONITCHEM HOLDCO 3 SA-REG-S 5.25000% 19-15.03.25	1 250 000.00	1 416 005.17	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

2022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 MOTION BONDCO DAC-REG-S 4.50000% 19-15.11.27	475 000.00	510 909.76	0.01
EUR MYTILINEOS FINANCIAL PARTNERS SA-REG-S 2.50000% 19-01.12.24	1 000 000.00	1 132 210.00	0.03
EUR NEMAK SAB DE CV-REG-S 2.25000% 21-20.07.28	1 000 000.00	1 059 748.55	0.03
EUR NETFLIX INC 3.62500% 17-15.05.27	4 725 000.00	5 959 573.06	0.15
EUR NETFLIX INC-REG-S 3.87500% 19-15.11.29	400 000.00	521 668.56	0.01
EUR NEXI SPA-REG-S 1.62500% 21-30.04.26	1 300 000.00	1 400 407.01	0.04
EUR NH HOTEL GROUP SA-REG-S 4.00000% 21-02.07.26	2 850 000.00	3 180 153.69	0.08
EUR NIDDA HEALTHCARE HOLDING AG-REG-S 3.50000% 17-30.09.24	8 525 000.00	9 341 503.19	0.23
EUR NITROGENMUVEK RT-REG-S 7.00000% 18-14.05.25	1 260 000.00	1 229 722.99	0.03
EUR OLYMPUS WATER US HOLDING CORP-REG-S 3.87500% 21-01.10.28	2 995 000.00	3 252 006.37	0.08
EUR ONTEX GROUP N.V-REG-S 3.50000% 21-15.07.26	6 200 000.00	6 392 793.95	0.16
EUR ORGANON FINANCE 1 LLC-REG-S 2.87500% 21-30.04.28	5 628 000.00	6 124 336.54	0.15
EUR PEACH PROPERTY FINANCE GMBH-REG-S 3.50000% 19-15.02.23	2 000 000.00	2 242 677.53	0.06
EUR PEACH PROPERTY FINANCE GMBH-REG-S 4.37500% 20-15.11.25	1 000 000.00	1 146 317.00	0.03
EUR PIAGGIO & C SPA-REG-S 3.62500% 18-30.04.25	430 000.00	488 363.88	0.01
EUR PICARD BONDCO SA-REG-S 5.37500% 21-01.07.27	1 500 000.00	1 653 920.03	0.04
EUR PLAYTECH PLC-REG-S 3.75000% 18-12.10.23	3 250 000.00	3 648 241.24	0.09
EUR PLAYTECH PLC-REG-S 4.25000% 19-07.03.26	725 000.00	821 845.39	0.02
EUR PROGROUPE AG-REG-S 3.00000% 18-31.03.26	4 800 000.00	5 355 886.90	0.13
EUR QUINTILES IMS INC-REG-S 2.87500% 17-15.09.25	4 371 000.00	4 918 265.59	0.12
EUR RAFFINERIE HEIDE GMBH-REG-S 6.37500% 17-01.12.22	2 400 000.00	2 346 400.07	0.06
EUR REXEL SA-REG-S 2.12500% 21-15.12.28	1 540 000.00	1 689 655.27	0.04
EUR SAZKA GROUP AS-REG-S 4.12500% 19-20.11.24	2 000 000.00	2 253 210.00	0.06
EUR SCIENTIFIC GAMES INTERNATIONAL-REG-S 3.37500% 18-15.02.26	600 000.00	675 963.00	0.02
EUR SCIENTIFIC GAMES INTERNATIONAL-REG-S 5.50000% 18-15.02.26	1 400 000.00	1 593 167.00	0.04
EUR SECHE ENVIRONNEMENT SA-REG-S 2.25000% 04.11.21.28	1 210 000.00	1 309 040.14	0.03
EUR SELECTA GROUP BV-REG-S (PAY IN KIND) 8.00000% 20-01.04.26	1 929 279.00	2 173 535.37	0.05
EUR SILGAN HOLDINGS INC 2.25000% 20-01.06.28	2 446 000.00	2 666 534.51	0.07
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 3.12500% 17-19.09.25	1 825 000.00	1 995 889.88	0.05
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 4.00000% 17-19.09.29	3 000 000.00	3 041 147.46	0.08
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 5.00000% 18-15.04.28	1 775 000.00	1 954 124.80	0.05
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 4.00000% 18-20.04.23	500 000.00	566 214.69	0.01
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 2.12500% 21-06.07.24	1 000 000.00	1 089 724.10	0.03
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 2.87500% 21-06.01.27	3 395 000.00	3 484 829.47	0.09
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 3.37500% 21-06.07.29	4 125 000.00	4 022 988.75	0.10
EUR STANDARD INDUSTRIES INC/NJ-REG-S 2.25000% 19-21.11.26	8 155 000.00	8 619 303.70	0.22
EUR SUMMER BC HOLDCO A SARL-REG-S 9.25000% 19-31.10.27	500 000.00	533 956.57	0.01
EUR SYNTHOMER PLC-REG-S 3.87500% 20-01.07.25	400 000.00	456 701.68	0.01
EUR TELE COLUMBUS AG-REG-S 3.87500% 18-02.05.25	3 100 000.00	3 318 720.50	0.08
EUR TELENET FINANCE LUXEMBOURG-REG-S 3.50000% 17-01.03.28	3 100 000.00	3 511 067.30	0.09
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 4.50000% 18-01.03.25	650 000.00	738 122.45	0.02
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FIN 6.00000% 20-31.01.25	690 000.00	814 726.69	0.02
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 3.75000% 21-09.05.27	1 690 000.00	1 832 464.40	0.05
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 4.37500% 21-09.05.30	11 457 000.00	12 237 350.25	0.31
EUR TI AUTOMOTIVE FINANCE PLC-REG-S 3.75000% 21-15.04.29	6 468 000.00	7 126 816.28	0.18
EUR TITAN HOLDINGS II BV-REG-S 5.12500% 21-15.07.29	3 682 000.00	3 951 524.46	0.10
EUR TUI CRUISES GMBH-REG-S 6.50000% 21-15.05.26	2 360 000.00	2 612 490.50	0.07
EUR UGI INTERNATIONAL LLC-REG-S 2.50000% 21-01.12.29	1 320 000.00	1 426 094.95	0.04
EUR UNILABS SUBHOLDING AB-REG-S 5.75000% 17-15.05.25	1 000 000.00	1 127 075.82	0.03
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 4.87500% 17-01.07.24	1 000 000.00	1 126 605.00	0.03
EUR VERISURE MIDHOLDING AB-REG-S 5.25000% 21-15.02.29	12 075 000.00	13 351 984.38	0.33
EUR VERTICAL HOLDCO GMBH-REG-S 6.62500% 20-15.07.28	5 413 000.00	5 616 371.38	0.14
EUR VIRGIN MEDIA FINANCE PLC-REG-S 3.75000% 20-15.07.30	3 800 000.00	4 037 225.45	0.10
EUR VIRIDIAN GROUP FIN/ POWER & ENER-REG-S 4.00000% 17-15.09.25	3 550 000.00	3 939 245.11	0.10
EUR WEBUILD SPA-REG-S 3.87500% 22-28.07.26	1 900 000.00	2 100 613.88	0.05
EUR WEBUILD SPA-REG-S 5.87500% 20-15.12.25	1 900 000.00	2 247 044.50	0.06
EUR WMG ACQUISITION CORP-REG-S 2.75000% 20-15.07.28	3 090 000.00	3 472 722.93	0.09
EUR WP/AP TELECOM HOLDINGS III BV-REG-S 5.50000% 21-15.01.30	7 062 000.00	7 736 164.10	0.19
EUR ZF EUROPE FINANCE BV-REG-S 2.00000% 19-23.02.26	200 000.00	221 188.10	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

2022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 ZF EUROPE FINANCE BV-REG-S 3.0000% 19-23.10.29	1 400 000.00	1 552 764.36	0.04
EUR ZF EUROPE FINANCE BV-REG-S 2.5000% 19-23.10.27	800 000.00	879 985.00	0.02
EUR ZIGGO BOND CO BV-REG-S 3.3750% 20-28.02.30	3 625 000.00	3 750 595.83	0.09
ユーロ合計		468 146 613.27	11.71
GBP			
GBP AA BOND CO LTD-REG-S 6.5000% 21-31.01.26	340 000.00	460 722.61	0.01
GBP ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-REG-S 4.7500% 17-15.07.27	750 000.00	979 572.20	0.02
GBP CONSTELLATION AUTOMOTIVE FINANCI-REG-S 4.8750% 21-15.07.27	5 572 000.00	6 971 065.81	0.17
GBP CPUK FINANCE LTD-REG-S 4.8750% 17-28.08.25	1 750 000.00	2 332 602.75	0.06
GBP HEATHROW FINANCE PLC-REG-S 5.7500% 14-03.03.25	1 558 000.00	2 205 921.40	0.06
GBP INSPIRED ENTERTAINMENT FINANCING-REG-S 7.8750% 21-01.06.26	500 000.00	685 918.56	0.02
GBP OCADO GROUP PLC-REG-S 3.8750% 21-08.10.26	1 800 000.00	2 263 266.14	0.06
GBP PINNACLE BIDCO PLC-REG-S 6.3750% 18-15.02.25	2 175 000.00	2 932 597.49	0.07
GBP TALKTALK TELECOM GROUP PLC-REG-S 3.8750% 20-20.02.25	1 700 000.00	2 047 022.49	0.05
GBP VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC-REG-S 5.2500% 19-15.05.29	900 000.00	1 224 087.92	0.03
GBP VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC-REG-S 4.2500% 19-15.01.30	1 125 000.00	1 414 936.96	0.04
GBP VIRIDIAN GROUP FIN/ POWER & ENER-REG-S 4.7500% 17-15.09.24	1 900 000.00	2 526 702.61	0.06
英債券合計		26 044 416.94	0.65
USD			
USD ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC 4.8750% 21-01.10.29	1 755 000.00	1 723 111.65	0.04
USD ALTICE FINANCING SA-144A 5.0000% 20-15.01.28	4 847 000.00	4 509 067.16	0.11
USD ALTICE FRANCE SA/FRANCE-144A 5.5000% 19-15.01.28	2 440 000.00	2 327 516.00	0.06
USD ALTICE FRANCE SA/FRANCE-144A 5.1250% 21-15.07.29	1 471 000.00	1 365 882.34	0.03
USD ALTICE FRANCE SA/FRANCE-144A 5.5000% 21-15.10.29	5 969 000.00	5 656 761.61	0.14
USD ALTICE FRANCE-144A 8.1250% 18-01.02.27	2 148 000.00	2 271 746.28	0.06
USD AMERICAN AXLE & MANUFACTURING INC 6.2500% 18-15.03.26	2 705 000.00	2 755 718.75	0.07
USD ANTERO RESOURCES CORP 5.0000% 17-01.03.25	875 000.00	885 753.75	0.02
USD APACHE CORP 4.7500% 12-15.04.43	1 986 000.00	2 010 010.74	0.05
USD APACHE CORP 5.3500% 19-01.07.49	1 750 000.00	1 834 271.25	0.05
USD APACHE CORP 6.0000% 07-15.01.37	550 000.00	636 625.00	0.02
USD ARD FINANCE SA-144A (PIK) 6.5000% 19-30.06.27	4 138 000.00	4 179 380.00	0.10
USD ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-144A 5.2500% 19-15.08.27	3 370 000.00	3 302 600.00	0.08
USD AVIS BUDGET CAR RENT LLC/FIN INC-144A 5.3750% 21-01.03.29	4 372 000.00	4 381 093.76	0.11
USD BANIJAY ENTERTAINMENT SASU-144A 5.3750% 20-01.03.25	2 562 000.00	2 613 240.00	0.07
USD BAUSCH HEALTH COS INC-144A 7.0000% 19-15.01.28	1 870 000.00	1 675 987.50	0.04
USD BAUSCH HEALTH COS INC-144A 7.2500% 19-30.05.29	6 350 000.00	5 715 000.00	0.14
USD BAUSCH HEALTH COS INC-144A 5.2500% 20-15.02.31	3 927 000.00	3 125 911.63	0.08
USD BOMBARDIER INC-144A 7.8750% 19-15.04.27	10 750 000.00	10 894 910.00	0.27
USD BOMBARDIER INC-144A 6.0000% 21-15.02.28	1 460 000.00	1 413 455.20	0.04
USD BRUNDAGE-BONE CON HOLD INC-144A 6.0000% 21-01.02.26	1 494 000.00	1 512 181.98	0.04
USD BUCKEYE PARTNERS LP 3.9500% 16-01.12.26	980 000.00	978 015.50	0.02
USD CALPINE CORP-144A 3.7500% 20-01.03.31	660 000.00	599 629.80	0.02
USD CARNIVAL CORP-144A 7.6250% 20-01.03.26	1 547 000.00	1 577 940.00	0.04
USD CATALENT PHARMA SOLUTIONS INC-144A 3.5000% 21-01.04.30	227 000.00	212 292.67	0.01
USD CENTENE CORP 2.4500% 21-15.07.28	240 000.00	228 266.40	0.01
USD CENTENE CORP 2.5000% 21-01.03.31	800 000.00	742 584.00	0.02
USD CENTRAL GARDEN & PET CO 4.1250% 20-15.10.30	640 000.00	615 200.00	0.02
USD CENTURYLINK INC 5.6250% 15-01.04.25	777 000.00	802 687.62	0.02
USD CENTURYLINK INC 7.5000% 16-01.04.24	143 000.00	152 785.49	0.00
USD CENTURYLINK INC 7.6000% 09-15.09.39	1 000 000.00	1 000 000.00	0.03
USD CENTURYLINK INC 7.6500% 12-15.03.42	400 000.00	401 872.00	0.01
USD CHEPLAPHARM ARZNEIMITTEL GMBH-144A 5.5000% 20-15.01.28	4 183 000.00	4 212 699.30	0.11
USD CIMPRESS PLC-144A 7.0000% 18-15.06.26	2 016 000.00	2 072 306.88	0.05
USD CLEVELAND-CLIFFS INC 6.2500% 10-01.10.40	1 263 000.00	1 318 382.55	0.03
USD COMMERCIAL METALS CO 3.8750% 21-15.02.31	2 927 000.00	2 792 972.67	0.07
USD CONSOLIDATED ENERGY FINANCE SA-144A 5.6250% 21-15.10.28	2 500 000.00	2 350 675.00	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

2022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 COVANTA HOLDING CORP 5.00000% 20-01.09.30	2 596 000.00	2 570 040.00	0.06
USD CROWDSTRIKE HOLDINGS INC 3.00000% 21-15.02.29	673 000.00	630 937.50	0.02
USD DANA INC 4.25000% 21-01.09.30	670 000.00	649 062.50	0.02
USD DANA INC 5.37500% 19-15.11.27	505 000.00	522 043.75	0.01
USD DANA INC 5.62500% 20-15.06.28	170 000.00	176 800.00	0.00
USD DANAOS CORP-144A 8.50000% 21-01.03.28	1 710 000.00	1 863 900.00	0.05
USD DCP MIDSTREAM OPERATING LP 5.60000% 14-01.04.44	1 450 000.00	1 682 000.00	0.04
USD DELTA AIR LINES INC 7.37500% 20-15.01.26	1 674 000.00	1 906 227.06	0.05
USD DRAX FINCO PLC-144A 6.62500% 18-01.11.25	775 000.00	793 406.25	0.02
USD ENLINK MIDSTREAM LLC 5.37500% 19-01.06.29	740 000.00	746 808.00	0.02
USD ENLINK MIDSTREAM PARTNERS LP 5.60000% 14-01.04.44	400 000.00	362 000.00	0.01
USD ENLINK MIDSTREAM PARTNERS LP 5.05000% 14-01.04.45	1 950 000.00	1 671 150.00	0.04
USD ENLINK MIDSTREAM PARTNERS LP 5.45000% 17-01.06.47	2 225 000.00	1 980 250.00	0.05
USD EQT CORP 5.00000% 20-15.01.29	400 000.00	421 000.00	0.01
USD EQT CORP 6.12500% 20-01.02.25	820 000.00	883 550.00	0.02
USD FORD MOTOR CO 3.25000% 21-12.02.32	1 520 000.00	1 446 036.80	0.04
USD FORD MOTOR CO 4.75000% 13-15.01.43	3 148 000.00	3 217 381.92	0.08
USD FORD MOTOR CO 5.29100% 16-08.12.46	970 000.00	1 064 575.00	0.03
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 5.12500% 20-16.06.25	522 000.00	548 752.50	0.01
USD FORD MOTOR CREDIT CO 4.12500% 20-17.08.27	2 947 000.00	3 016 991.25	0.08
USD FORD MOTOR CREDIT CO 4.00000% 20-13.11.30	8 320 000.00	8 363 430.40	0.21
USD FORD MOTOR CREDIT CO 2.90000% 21-16.02.28	280 000.00	266 448.00	0.01
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.62500% 21-17.06.31	578 000.00	569 330.00	0.01
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.30000% 22-10.02.25	1 729 000.00	1 696 287.32	0.04
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.37500% 13-06.08.23	639 000.00	652 355.10	0.02
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.66400% 14-08.09.24	570 000.00	575 700.00	0.01
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.81500% 17-02.11.27	3 197 000.00	3 191 405.25	0.08
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 5.58400% 19-18.03.24	203 000.00	212 135.00	0.01
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 5.11300% 19-03.05.29	2 850 000.00	3 050 355.00	0.08
USD FREEPORT-MCMORAN INC 4.37500% 20-01.08.28	865 000.00	891 771.75	0.02
USD GEMS MENASA CAYMAN LTD/GEDL-144A 7.12500% 19-31.07.26	2 268 000.00	2 321 581.50	0.06
USD GENESIS ENERGY LP 6.50000% 17-01.10.25	2 585 000.00	2 529 370.80	0.06
USD GENESIS ENERGY LP 7.75000% 20-01.02.28	5 429 000.00	5 350 279.50	0.13
USD GENESIS ENERGY LP 8.00000% 20-15.01.27	4 569 000.00	4 598 150.22	0.12
USD GLOBAL PARTNERS LP 7.00000% 20-01.08.27	3 265 000.00	3 371 112.50	0.08
USD GOODYEAR TIRE & RUBBER CO 4.87500% 17-15.03.27	600 000.00	608 160.00	0.02
USD GOODYEAR TIRE & RUBBER CO 9.50000% 20-31.05.25	962 000.00	1 024 530.00	0.03
USD GOODYEAR TIRE & RUBBER CO/THE 5.25000% 2130.04.31	3 730 000.00	3 762 637.50	0.09
USD GOODYEAR TIRE & RUBBER CO/THE 5.62500% 21-30.04.33	2 360 000.00	2 405 288.40	0.06
USD GRIFOLS ESCROW ISSUER SA-144A 4.75000% 21-15.10.28	1 892 000.00	1 880 534.48	0.05
USD HCA INC 3.50000% 20-01.09.30	1 358 000.00	1 351 739.62	0.03
USD HCA INC 5.37500% 18-01.09.26	2 106 000.00	2 285 009.99	0.06
USD HCA INC 5.62500% 18-01.09.28	870 000.00	970 050.00	0.02
USD HCA INC 5.87500% 15-15.02.26	805 000.00	876 250.55	0.02
USD HCA INC 5.87500% 19-01.02.29	705 000.00	796 650.00	0.02
USD HCA INC 7.69000% 95-15.06.25	970 000.00	1 103 375.00	0.03
USD HERENS HOLDCO SARL-144A 4.75000% 21-15.05.28	1 785 000.00	1 704 335.85	0.04
USD HILLENBRAND INC 3.75000% 21-01.03.31	1 346 000.00	1 288 795.00	0.03
USD HILLENBRAND INC 4.50000% 19-15.09.26	2 607 000.00	2 828 595.00	0.07
USD HILLENBRAND INC 5.75000% 20-15.06.25	585 000.00	602 550.00	0.02
USD HOWMET AEROSPACE INC 3.00000% 21-15.01.29	1 205 000.00	1 141 279.60	0.03
USD ICAHN ENTERPRISES FINANCE CORP 5.25000% 20-15.05.27	1 950 000.00	1 964 040.00	0.05
USD IHEARTCOMMUNICATIONS INC-144A 4.75000% 19-15.01.28	150 000.00	148 873.50	0.00
USD IHO VERWALTUNGS GMBH-144A (PIK) 6.37500% 19-15.05.29	773 000.00	811 541.78	0.02
USD ISTAR INC 4.25000% 19-01.08.25	4 135 000.00	4 106 822.04	0.10
USD ISTAR INC 4.75000% 19-01.10.24	2 925 000.00	2 961 562.50	0.07
USD ISTAR INC 5.50000% 20-15.02.26	2 795 000.00	2 843 912.50	0.07
USD JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-144A 7.75000% 20-15.10.25	1 000 000.00	1 049 380.00	0.03
USD JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-114A 5.87500% 20-15.01.28	305 000.00	302 011.00	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

2022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 KB HOME 6.87500% 19-15.06.27	940 000.00	1 064 550.00	0.03
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 6.87500% 12-26.01.39	6 614 000.00	8 966 566.80	0.22
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 4.37500% 16-01.06.46	13 933 000.00	14 723 821.06	0.37
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 3.00000% 16-01.06.26	1 322 000.00	1 335 721.59	0.03
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 4.87500% 21-01.10.49	5 726 000.00	6 501 706.08	0.16
USD L BRANDS INC 7.50000% 19-15.06.29	1 277 000.00	1 394 356.30	0.03
USD LAREDO PETROLEUM 9.50000% 20-15.01.25	7 921 000.00	8 079 420.00	0.20
USD LAREDO PETROLEUM INC 10.12500% 20-15.01.28	900 000.00	947 250.00	0.02
USD LEVEL 3 FINANCING INC 5.25000% 17-15.03.26	3 868 000.00	3 936 502.28	0.10
USD MACYS RETAIL HOLDINGS INC 5.12500% 12-15.01.42	3 330 000.00	2 969 760.60	0.07
USD MACYS RETAIL HOLDINGS INC 4.30000% 12-15.02.43	1 970 000.00	1 640 025.00	0.04
USD MANITOWOC FOODSERVICE INC 9.50000% 16-15.02.24	5 145 000.00	5 174 223.60	0.13
USD MCLAREN FINANCE PLC-144A 7.50000% 21-01.08.26	200 000.00	204 000.00	0.01
USD MELCO RESORTS FINANCE LTD-144A 5.37500% 19-04.12.29	2 131 000.00	2 008 792.48	0.05
USD METHANEX CORP 5.12500% 20-15.10.27	4 946 000.00	4 996 745.97	0.13
USD METHANEX CORP 5.25000% 19-15.12.29	3 580 000.00	3 622 118.70	0.09
USD MGM CHINA HOLDINGS LTD-144A 5.25000% 20-18.06.25	529 000.00	520 172.31	0.01
USD MGM GROWTH POP LP/CO-ISSUER INC 5.62500% 17-01.05.24	3 625 000.00	3 833 437.50	0.10
USD MGM RESORTS INTERNATIONAL 6.75000% 20-01.05.25	2 350 000.00	2 432 249.98	0.06
USD MGM RESORTS INTERNATIONAL 4.75000% 20-15.10.28	478 000.00	474 099.52	0.01
USD MGM RESORTS INTL 5.50000% 19-15.04.27	1 000 000.00	1 032 585.00	0.03
USD MGM RESORTS INTL 5.75000% 18-15.06.25	1 483 000.00	1 557 150.00	0.04
USD MOTION BONDCO DAC-144A 6.62500% 19-15.11.27	200 000.00	199 500.00	0.00
USD MPT OPERATING PARTNERSHIP LP/FIN CORP 4.62500% 19-01.08.29	2 415 000.00	2 483 320.35	0.06
USD MPT OPERATING PARTNERSHIP LP/FIN CORP 3.50000% 20-15.03.31	1 610 000.00	1 553 650.00	0.04
USD MURPHY OIL CORP 5.87500% 19-01.12.27	600 000.00	608 886.00	0.02
USD MURPHY OIL CORP 6.37500% 21-15.07.28	11 287 000.00	11 673 918.36	0.29
USD MURPHY OIL USA INC 4.75000% 19-15.09.29	2 528 000.00	2 565 920.00	0.06
USD MURPHY OIL USA INC 5.62500% 17-01.05.27	201 000.00	207 281.25	0.01
USD NABORS INDUSTRIES INC 5.75000% 18-01.02.25	550 000.00	508 750.00	0.01
USD NAVIENT CORP 4.87500% 21-15.03.28	1 370 000.00	1 310 062.50	0.03
USD NAVIENT CORP 5.00000% 20-15.03.27	870 000.00	842 525.40	0.02
USD NAVIENT CORP 5.50000% 21-15.03.29	639 000.00	623 536.20	0.02
USD NEWELL BRANDS INC 4.20000% 16-01.04.26	618 000.00	647 225.22	0.02
USD NEWELL BRANDS INC 5.50000% 16-01.04.46	275 000.00	324 500.00	0.01
USD NGL ENRGY PARTNRS LP/ FINANCE CORP 6.12500% 17-01.03.25	1 625 000.00	1 416 805.00	0.04
USD NORDSTROM INC 4.37500% 19-01.04.30	685 000.00	641 769.65	0.02
USD NRG ENERGY INC 5.75000% 18-15.01.28	1 878 000.00	1 943 711.22	0.05
USD NUSTAR LOGISTICS LP 5.62500% 17-28.04.27	1 835 000.00	1 878 581.25	0.05
USD NUSTAR LOGISTICS LP 5.75000% 20-01.10.25	3 675 000.00	3 835 781.25	0.10
USD NUSTAR LOGISTICS LP 6.37500% 20-01.10.30	1 935 000.00	2 093 070.15	0.05
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 3.40000% 16-15.04.26	271 000.00	267 612.50	0.01
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 4.40000% 16-15.04.46	3 541 000.00	3 386 329.12	0.08
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 4.20000% 18-15.03.48	1 908 000.00	1 774 440.00	0.04
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 3.50000% 19-15.08.29	376 000.00	370 623.20	0.01
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 4.40000% 19-15.08.49	1 561 000.00	1 482 950.00	0.04
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 8.50000% 20-15.07.27	1 434 000.00	1 721 466.81	0.04
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 8.87500% 20-15.07.30	1 058 000.00	1 371 347.86	0.03
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 6.37500% 20-01.09.28	348 000.00	395 850.00	0.01
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 6.62500% 20-01.09.30	3 104 000.00	3 642 575.04	0.09
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 5.50000% 20-01.12.25	5 230 000.00	5 549 853.72	0.14
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 6.12500% 20-01.01.31	1 648 000.00	1 902 204.00	0.05
USD OCEANEERING INTERNATIONAL INC 4.65000% 14-15.11.24	60 000.00	60 382.20	0.00
USD OCEANEERING INTERNATIONAL INC 6.00000% 18-01.02.28	2 750 000.00	2 753 190.00	0.07
USD ONEMAIN FINANCE CORP 3.50000% 21-15.01.27	601 000.00	570 817.78	0.01
USD PBF HOLDING CO LLC/FIN CORP 7.25000% 17-15.06.25	4 780 000.00	3 792 714.90	0.09
USD PBF HOLDING CO LLC/FIN CORP 6.00000% 20-15.02.28	3 438 000.00	2 415 195.00	0.06
USD PENSKE AUTOMOTIVE GROUP INC-SUB 3.75000% 21-15.06.29	1 338 000.00	1 259 432.64	0.03
USD PERRIGO FINANCE UNLIMITED CO 3.15000% 20-15.06.30	1 015 000.00	976 221.17	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

2022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 PETROLEOS MEXICANOS 5.35000% 18-12.02.28	2 950 000.00	2 876 722.00	0.07
USD PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 6.70000% 21-16.02.32	677 000.00	666 587.74	0.02
USD PRIMO WATER HOLDINGS INC-144A 4.37500% 21-30.04.29	4 167 000.00	3 977 734.86	0.10
USD RADIANT GROUP INC 4.50000% 17-01.10.24	1 920 000.00	1 963 200.00	0.05
USD RADIANT GROUP INC 4.87500% 19-15.03.27	900 000.00	931 500.00	0.02
USD RANGE RESOURCES CORP 4.87500% 16-15.05.25	1 650 000.00	1 681 605.75	0.04
USD RANGE RESOURCES CORP 5.00000% 17-15.03.23	640 000.00	646 400.00	0.02
USD ROLLS-ROYCE PLC-144A 7.75000% 20-15.10.27	3 298 000.00	3 460 393.52	0.09
USD ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD 3.70000% 17-15.03.28	361 000.00	325 802.50	0.01
USD ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD-144A 5.50000% 21-01.04.28	3 205 000.00	3 109 779.45	0.08
USD SERVICE CORP 3.37500% 20-15.08.30	2 020 000.00	1 885 781.10	0.05
USD SERVICE CORP INTERNATIONAL/US 4.00000% 21-15.05.31	2 380 000.00	2 304 720.60	0.06
USD SERVICE PROPERTIES TRUST 4.35000% 19-01.10.24	880 000.00	840 576.00	0.02
USD SERVICE PROPERTIES TRUST 4.95000% 19-01.10.29	74 000.00	66 600.00	0.00
USD SIGMA HOLDCO BV-144A 7.87500% 18-15.05.26	5 358 000.00	4 818 047.55	0.12
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 3.87500% 21-01.09.31	2 305 000.00	2 132 125.00	0.05
USD SM ENERGY CO 6.50000% 21-15.07.28	1 480 000.00	1 528 840.00	0.04
USD SM ENERGY CO 6.62500% 18-15.01.27	4 478 000.00	4 601 145.00	0.12
USD SM ENERGY CO 6.75000% 16-15.09.26	2 870 000.00	2 898 700.00	0.07
USD SOUTHWESTERN ENERGY CO 7.75000% 17-01.10.27	3 290 000.00	3 504 935.70	0.09
USD SOUTHWESTERN ENERGY CO 8.37500% 20-15.09.28	606 000.00	664 903.20	0.02
USD SOUTHWESTERN ENERGY CO 5.37500% 21-15.03.30	3 447 000.00	3 531 830.67	0.09
USD SOUTHWESTERN ENERGY CO 4.75000% 21-01.02.32	2 763 000.00	2 758 330.53	0.07
USD SPCM SA-144A 3.37500% 21-15.03.30	740 000.00	694 601.00	0.02
USD SPIRIT AEROSYSTEMS INC 4.60000% 18-15.06.28	715 000.00	690 353.95	0.02
USD SPRINGLEAF FINANCE CORP 7.12500% 18-15.03.26	4 145 000.00	4 556 739.43	0.11
USD SPRINGLEAF FINANCE CORP 6.62500% 19-15.01.28	1 075 000.00	1 153 858.24	0.03
USD SPRINGLEAF FINANCE CORP 5.37500% 19-15.11.29	925 000.00	939 198.75	0.02
USD SPRINGLEAF FINANCE CORP 8.87500% 20-01.06.25	2 066 000.00	2 192 873.06	0.05
USD SPRINT CORP 7.62500% 18-01.03.26	2 856 000.00	3 270 120.00	0.08
USD SYMANTEC CORP-144A 5.00000% 17-15.04.25	2 662 000.00	2 669 639.94	0.07
USD T-MOBILE USA INC 3.37500% 21-15.04.29	976 000.00	959 017.60	0.02
USD TARGA RESOURCES PARTNERS 5.87500% 18-15.04.26	4 181 000.00	4 309 147.65	0.11
USD TELECOM ITALIA CAPITAL 7.20000% 06-18.07.36	2 167 000.00	2 306 706.49	0.06
USD TELECOM ITALIA CAPITAL 7.72100% 08-06.04.38	586 000.00	635 546.30	0.02
USD TELENET FINANCE LUXEMBOURG-144A 5.50000% 17-01.03.28	2 400 000.00	2 448 000.00	0.06
USD TENET HEALTHCARE CORP 6.87500% 02-15.11.31	800 000.00	864 000.00	0.02
USD TENET HEALTHCARE CORP-144A 4.25000% 21-01.06.29	740 000.00	713 432.15	0.02
USD TENNECO AUTOMOTIVE INC-144A 5.12500% 21-15.04.29	1 030 000.00	953 944.80	0.02
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 4.75000% 21-09.05.27	1 110 000.00	1 069 984.50	0.03
USD TRANSDIGM INC-SUB 5.50000% 20-15.11.27	2 560 000.00	2 572 800.00	0.06
USD TRANSDIGM INC-SUB 7.50000% 19-15.03.27	560 000.00	581 106.40	0.01
USD TRI POINTE GROUP INC 5.70000% 20-15.06.28	1 065 000.00	1 128 963.90	0.03
USD TRIUMPH GROUP INC 7.75000% 18-15.08.25	935 000.00	925 650.00	0.02
USD TRIVIUM PACKAGING FINANCE BV-144A 5.50000% 19-15.08.26	2 575 000.00	2 595 909.00	0.07
USD TRIVIUM PACKAGING FINANCE BV-144A 8.50000% 19-15.08.27	1 486 000.00	1 532 660.40	0.04
USD UNITED AIRLINES INC-144A 4.62500% 21-15.04.29	876 000.00	866 775.72	0.02
USD UNITED WHOLESale MORTGAGE LLC-144A 5.50000% 21-15.04.29	2 270 000.00	2 079 093.00	0.05
USD VERITAS US INC / BERMUDA LTD-144A 7.50000% 20-01.09.25	600 000.00	612 000.00	0.02
USD VIRGIN MEDIA VENDOR FINANC-144A 5.00000% 20-15.07.28	1 850 000.00	1 743 625.00	0.04
USD VISTRA OPERATIONS CO LLC-144A 4.37500% 21-01.05.29	4 229 000.00	4 080 985.00	0.10
USD WESTERN GAS PARTNERS LP 5.45000% 14-01.04.44	440 000.00	486 200.00	0.01
USD WESTERN GAS PARTNERS LP 4.50000% 18-01.03.28	1 253 000.00	1 317 905.40	0.03
USD WESTERN GAS PARTNERS LP 5.30000% 18-01.03.48	1 500 000.00	1 657 500.00	0.04
USD WESTERN GAS PARTNERS LP 4.75000% 18-15.08.28	88 000.00	93 500.00	0.00
USD WESTERN GAS PARTNERS LP 5.50000% 18-15.08.48	800 000.00	884 000.00	0.02
USD WESTERN MIDSTREAM OPERATING LP 4.05000% 20-01.02.30	704 000.00	733 920.00	0.02
USD WYNN MACAU LTD-144A 5.12500% 19-15.12.29	3 377 000.00	3 023 183.94	0.08
USD YUM BRANDS INC 3.62500% 20-15.03.31	3 413 000.00	3 225 762.82	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

2022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 ZIGGO BOND CO BV-144A 6.00000% 16-15.01.27	3 930 000.00	4 040 433.00	0.10
USD ZIGGO BV-144A 4.87500% 19-15.01.30	956 000.00	924 930.00	0.02
米ドル合計		450 636 666.78	11.28
ノート、固定利付債合計		944 827 696.99	23.64
ノート、変動利付債			
EUR			
EUR ABERTIS INFRA FINANCE BV-REG-S-SUB 3.248%/VAR 20-PRP	10 500 000.00	11 741 073.75	0.29
EUR ABERTIS INFRA FINANCE BV-REG-S-SUB 2.625%/VAR 20-PRP	1 100 000.00	1 175 711.53	0.03
EUR AIB GROUP PLC-REG-S-SUB 6.250%/VAR 19-PRP	500 000.00	607 144.81	0.01
EUR AKELIUS RESIDENTIAL PROPERT-REG-S-SUB 2.249%/VAR 20-17.05.81	1 095 000.00	1 166 994.23	0.03
EUR ALLIANZ SE-REG-S-SUB 2.625%/VAR 20-PRP	1 000 000.00	1 065 057.61	0.03
EUR ALLIANZ SE-REG-S-SUB 2.600%/VAR 21-PRP	600 000.00	632 244.00	0.02
EUR BANCO BPM SPA-REG-S-SUB 5.000%/VAR 20-14.09.30	2 350 000.00	2 787 900.99	0.07
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 2.000%/VAR 20-17.01.30	2 000 000.00	2 185 905.16	0.05
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 5.75000%/VAR 21-PRP	600 000.00	692 203.60	0.02
EUR BANCO SANTANDER SA SUB-REG-S 3.625%/VAR 21-PRP	600 000.00	605 861.94	0.01
EUR BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC-REG-S-SUB 3.000%/VAR 21-PRP	1 000 000.00	1 072 314.97	0.03
EUR CASTELLUM AB-REG-S 3.125%/VAR 21-PRP	775 000.00	803 616.88	0.02
EUR COMMERZBANK AG-REG-S-SUB 6.125%/VAR 20-PRP	2 000 000.00	2 373 605.40	0.06
EUR COOPERATIEVE RABOBANK UA-REG-S-SUB 4.375%/VAR 20-PRP	1 000 000.00	1 191 874.11	0.03
EUR DEUTSCHE BANK AG-REG-S-SUB 4.625%/VAR 21-PRP	1 200 000.00	1 326 170.80	0.03
EUR EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA-REG-S-SUB 1.875%/VAR 21-14.03.82	1 500 000.00	1 553 050.21	0.04
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 3.375%/VAR 20-PRP	3 600 000.00	3 920 157.62	0.10
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 2.875%/VAR 20-PRP	1 600 000.00	1 749 624.51	0.04
EUR ELECTRICITE DE FRANCE-REG-S-SUB 2.625%/VAR 21-PRP	3 000 000.00	3 206 317.83	0.08
EUR ELM BV FOR FIRMENICH INTL SA-REG-S-SUB 3.750%/VAR 20-PRP	4 450 000.00	5 177 941.27	0.13
EUR ENERGIAS DE PORTUGAL SA-REG-S-SUB 1.875%/VAR 21-02.08.81	700 000.00	763 167.84	0.02
EUR FASTIGHETS AB BALDER-REG-S-SUB 2.873%/VAR 21-02.06.81	1 525 000.00	1 593 448.25	0.04
EUR GALAPAGO SA/LUX-REG-S *DEFAULT* 3M EURIBOR+475BP 14-15.06.21	1 066 000.00	149.37	0.00
EUR HEIMSTADEN BOSTAD AB-REG-S-SUB 3.248%/VAR 19-PRP	2 000 000.00	2 203 437.60	0.06
EUR HEIMSTADEN BOSTAD AB-REG-S-SUB 3.000%/VAR 21-PRP	5 021 000.00	5 220 471.77	0.13
EUR INTERNATIONAL DESIGN GRP-REG-S 3M EURIBOR+425BP 21-15.05.26	100 000.00	111 987.90	0.00
EUR ITALMATCH CHEMICALS SPA-REG-S 3M EURIBOR+475BP 18-30.09.24	1 900 000.00	2 050 028.75	0.05
EUR KONINKLIJKE KPN NV-REG-S-SUB 2.000%/VAR 19-PRP	1 000 000.00	1 112 188.94	0.03
EUR LENZING AG-REG-S-SUB 5.750%/VAR 20-PRP	2 100 000.00	2 475 585.69	0.06
EUR MACIFS-REG-S-SUB 3.500%/VAR 21-PRP	300 000.00	319 939.01	0.01
EUR PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 3M EURIBOR+240BP 18-24.08.23	1 000 000.00	1 115 395.00	0.03
EUR RAKUTEN GROUP INC-REG-S-SUB 4.250%VAR 21-PRP	500 000.00	538 330.27	0.01
EUR RCI BANQUE SA-REG-S-SUB 2.625%/VAR 19-18.02.30	1 000 000.00	1 119 314.02	0.03
EUR REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S-SUB 3.750%/VAR 20-PRP	4 050 000.00	4 676 251.50	0.12
EUR REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV-SUB 4.247%/VAR 20-PRP	5 038 000.00	5 937 037.40	0.15
EUR REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S-SUB 2.500%/VAR 21-PRP	4 400 000.00	4 784 428.00	0.12
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 2.376%/VAR 21-PRP	2 200 000.00	2 287 400.50	0.06
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 2.880%/VAR 21-PRP	5 700 000.00	6 231 222.66	0.16
EUR UNICREDIT SPA-REG-S-SUB 2.731%/VAR 20-15.01.32	4 100 000.00	4 580 611.15	0.11
EUR VEOLIA ENVIRONNEMENT SA-REG-S-SUB 2.500%/VAR 20-PRP	1 000 000.00	1 090 163.53	0.03
EUR VODAFONE GROUP PLC-REG-S-SUB 3.000%/VAR 20-27.08.80	2 000 000.00	2 175 300.50	0.05
EUR VOLKSWAGEN INTL FINANCE NV-REG-S-SUB 3.875%/VAR 20-PRP	1 600 000.00	1 866 061.44	0.05
EUR WINTERSHALL DEA FINANCE 2BV-REG-S-SUB 2.498%/VAR 21-PRP	300 000.00	317 463.84	0.01
EUR WINTERSHALL DEA FINANCE 2BV-REG-S-SUB 3.000%/VAR 21-PRP	8 200 000.00	8 560 695.86	0.21
ユーロ合計		106 164 852.01	2.66
GBP			
GBP NATWEST GROUP PLC-SUB 5.125%/VAR 20-PRP	1 200 000.00	1 640 972.11	0.04
GBP NATWEST GROUP PLC-SUB 4.500%/VAR 21-PRP	1 675 000.00	2 177 535.64	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

2022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 TVL FINANCE PLC-REG-S 3M LIBOR+537.5BP 19-15.07.25	2 075 000.00	2 686 486.42	0.07
GBP UTMOST GROUP PLC-REG-S-SUB 6.125%/VAR 22-PRP	2 500 000.00	3 290 859.49	0.08
英ポンド合計		9 795 853.66	0.25
USD			
USD AERCAP GLOBAL AVIATION TRUST-144A-SUB 6.500%/VAR 15-15.06.45	2 422 000.00	2 592 678.34	0.06
USD BANCO MERCANTIL DEL NORT SA/G CA-REG-S-SUB 6.875%/VAR 17-PRP	2 655 000.00	2 669 602.50	0.07
USD BNP PARIBAS SA-REG-S-SUB 6.625%/VAR 19-PRP	460 000.00	485 162.00	0.01
USD CAPITAL ONE FINANCIAL CORP-SUB 3.950%/VAR 21-PRP	860 000.00	840 650.00	0.02
USD CITIGROUP INC-SUB 4.000%/VAR 20-PRP	430 000.00	424 625.00	0.01
USD COMMERZBANK AG-REG-S-SUB 7.000%/VAR 19-PRP	600 000.00	628 500.00	0.01
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-144A-SUB 4.500%/VAR 20-PRP	708 000.00	654 900.00	0.02
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S-SUB 6.375%/VAR 19-PRP	2 260 000.00	2 358 875.00	0.06
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S-SUB 5.250%/VAR 20-PRP	275 000.00	274 230.00	0.01
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S-SUB 6.250%/VAR 14-PRP	1 458 000.00	1 529 077.50	0.04
USD DANSKE BANK A/S-REG-S-SUB 4.375%/VAR 21-PRP	500 000.00	482 500.00	0.01
USD DEUTSCHE BANK AG-SUB 4.296%/VAR 13-24.05.28	625 000.00	634 854.62	0.02
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY-SUB 4.875%/VAR 17-01.12.32	850 000.00	888 734.82	0.02
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY-SUB 3.729%/VAR 21-14.01.32	700 000.00	680 329.83	0.02
USD EFG INTERNATIONAL AG-REG-S-SUB 5.500%/VAR 21-PRP	475 000.00	480 320.00	0.01
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3M LIBOR+127BP 17-28.03.22	227 000.00	227 141.81	0.01
USD ING GROEP NV-SUB 3.875%/VAR 21-PRP	700 000.00	640 500.00	0.02
USD SOCIETE GENERAL SA-REG-S-SUB 7.375%/VAR 18-PRP	1 600 000.00	1 688 000.00	0.04
USD SOFTBANK GROUP CORP-REG-S-SUB 6.000%/VAR 17-PRP	800 000.00	762 766.40	0.02
USD STANDARD CHARTERED PLC-REG-S-SUB 6.000%/VAR 20-PRP	1 210 000.00	1 264 450.00	0.03
USD UBS GROUP AG-REG-S-SUB 5.125%/VAR 20-31.12.99	200 000.00	206 520.00	0.00
USD UBS GROUP AG-REG-S-SUB 3.875%/VAR 21-PRP	2 325 000.00	2 232 581.25	0.06
USD UBS GROUP AG-REG-S-SUB 4.875%/VAR 22-PRP	1 500 000.00	1 497 900.00	0.04
USD VODAFONE GROUP PLC-SUB 5.125%/VAR 21-04.06.81	940 000.00	921 698.20	0.02
USD WYNDHAM WORLDWIDE CORP STEP UP/RATING LINKED 17-01.04.27	1 936 000.00	2 013 440.00	0.05
米ドル合計		27 080 037.27	0.68
ノート、変動利付債合計		143 040 742.94	3.59
中期債券、固定利付債			
EUR			
EUR AUTOSTRADA PER L'ITALIA SPA 5.87500% 04-09.06.24	2 900 000.00	3 611 847.43	0.09
EUR AUTOSTRADA PER L'ITALIA SPA 4.37500% 10-16.09.25	1 450 000.00	1 805 393.81	0.04
EUR AUTOSTRADA PER L'ITALIA SPA-REG-S 1.87500% 15-04.11.25	3 012 000.00	3 442 630.46	0.09
EUR AUTOSTRADA PER L'ITALIA SPA-REG-S 1.75000% 15-26.06.26	5 600 000.00	6 362 335.04	0.16
EUR AUTOSTRADA PER L'ITALIA SPA-REG-S 1.62500% 22-25.01.28	2 118 000.00	2 362 221.41	0.06
EUR BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA-REG-S 3.62500% 19-24.09.24	600 000.00	670 193.05	0.02
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 5.62500% 16-06.05.26	500 000.00	630 803.51	0.02
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 2.50000% 21-15.04.31	800 000.00	878 481.96	0.02
EUR CASINO GUICHARD PERRACHON SA-REG-S STEP-UP 14-07.03.24	2 600 000.00	2 836 395.45	0.07
EUR CELLNEX FINANCE CO SA -REG-S 1.25000% 21-15.01.29	3 000 000.00	3 131 800.49	0.08
EUR CELLNEX FINANCE CO SA-REG-S 2.00000% 21-15.02.33	1 300 000.00	1 333 009.80	0.03
EUR CELLNEX FINANCE CO SA-REG-S 1.50000% 21-08.06.28	8 700 000.00	9 355 316.48	0.23
EUR CELLNEX FINANCE CO SA-REG-S 2.00000% 21-15.09.32	1 800 000.00	1 875 754.95	0.05
EUR CELLNEX TELECOM SA-REG-S 2.87500% 17-18.04.25	400 000.00	474 689.69	0.01
EUR CELLNEX TELECOM SA-REG-S 1.75000% 20-23.10.30	3 300 000.00	3 458 978.67	0.09
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA AG-REG-S 3.00000% 20-29.05.26	600 000.00	674 281.50	0.02
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA AG-REG-S 3.75000% 21-11.02.28	3 000 000.00	3 438 284.12	0.09
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA AG-REG-S 3.50000% 21-14.07.29	2 600 000.00	2 921 449.31	0.07
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA AG-REG-S 1.62500% 21-16.11.23	900 000.00	1 012 027.59	0.02
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA AG-REG-S 2.87500% 21-16.05.27	6 400 000.00	7 067 214.45	0.18
EUR DOMETIC GROUP AB-REG-S 3.00000% 19-08.05.26	700 000.00	811 929.09	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

2022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	ELIS SA-REG-S 1.0000% 19-03.04.25	1 500 000.00	1 652 174.64	0.04
EUR	ELIS SA-REG-S 1.6250% 19-03.04.28	800 000.00	865 304.38	0.02
EUR	ELIS SA-REG-S 1.8750% 18-15.02.23	400 000.00	451 987.20	0.01
EUR	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.0210% 19-06.03.24	3 700 000.00	4 279 895.50	0.11
EUR	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 1.7440% 20-19.07.24	1 000 000.00	1 124 428.02	0.03
EUR	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.2500% 20-15.09.25	2 105 000.00	2 492 013.66	0.06
EUR	GESTAMP AUTOMOCION SA-REG-S 3.2500% 18-30.04.26	1 600 000.00	1 797 553.09	0.04
EUR	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALI SPA-REG-S 1.8750% 20-08.07.26	1 060 000.00	1 216 433.65	0.03
EUR	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALI SPA-REG-S 1.6250% 20-21.10.28	460 000.00	513 396.25	0.01
EUR	INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB 3.9280% 14-15.09.26	3 500 000.00	4 264 185.36	0.11
EUR	INTRUM JUSTITIA AB-REG-S 3.5000% 19-15.07.26	4 325 000.00	4 799 841.75	0.12
EUR	MAHLE GMBH-REG-S 2.3750% 21-14.05.28	1 900 000.00	2 001 944.13	0.05
EUR	MAX TWO LTD 5.7000% 04-02.04.24	350 000.00	68 344.87	0.00
EUR	NOKIA OYJ-REG-S 3.1250% 20-15.05.28	620 000.00	754 027.20	0.02
EUR	NOVELIS SHEET INGOT GMBH-REG-S 3.3750% 21-15.04.29	5 922 000.00	6 508 446.19	0.16
EUR	ORANO SA-REG-S 2.7500% 20-08.03.28	4 700 000.00	5 296 676.79	0.13
EUR	ORANO SA-REG-S 3.3750% 19-23.04.26	2 400 000.00	2 814 201.45	0.07
EUR	PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 2.7500% 15-21.04.27	1 500 000.00	1 557 489.37	0.04
EUR	PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 5.1250% 16-15.03.23	2 000 000.00	2 329 438.00	0.06
EUR	PPF ARENA 1 BV-REG-S 2.1250% 19-31.01.25	700 000.00	791 723.06	0.02
EUR	PPF TELECOM GROUP BV-REG-S 3.5000% 20-20.05.24	300 000.00	352 307.88	0.01
EUR	PPF TELECOM GROUP BV-REG-S 3.2500% 20-29.09.27	1 433 000.00	1 693 684.39	0.04
EUR	RENAULT SA-REG-S 2.0000% 18-28.09.26	600 000.00	658 307.25	0.02
EUR	RENAULT SA-REG-S 2.3750% 20-25.05.26	1 200 000.00	1 341 837.00	0.03
EUR	RENAULT SA-REG-S 2.5000% 21-01.04.28	2 100 000.00	2 300 897.34	0.06
EUR	RENAULT SA-REG-S 2.5000% 21-02.06.27	1 000 000.00	1 108 523.26	0.03
EUR	ROLLS-ROYCE PLC-REG-S 0.8750% 18-09.05.24	875 000.00	964 833.77	0.02
EUR	SAIPEM FINANCE INTERNATIONAL BV-REG-S 3.1250% 21-31.03.28	1 000 000.00	1 035 691.90	0.03
EUR	SAMSONITE FINCO SARL-REG-S 3.5000% 18-15.05.26	1 000 000.00	1 080 531.90	0.03
EUR	SCHAEFFLER AG-REG-S 2.7500% 20-12.10.25	600 000.00	705 651.56	0.02
EUR	SCHAEFFLER AG-REG-S 3.3750% 20-12.10.28	1 300 000.00	1 580 441.85	0.04
EUR	TELECOM ITALIA FINANCE SA 7.7500% 03-24.01.33	3 190 000.00	4 656 911.65	0.12
EUR	TELECOM ITALIA SPA-REG-S 2.3750% 17-12.10.27	1 375 000.00	1 495 586.91	0.04
EUR	TELECOM ITALIA SPA-REG-S 2.8750% 18-28.01.26	500 000.00	566 912.12	0.01
EUR	TELECOM ITALIA SPA-REG-S 4.0000% 19-11.04.24	1 500 000.00	1 750 777.80	0.04
EUR	TELECOM ITALIA SPA-REG-S 2.7500% 19-15.04.25	500 000.00	568 206.88	0.01
EUR	TELECOM ITALIA SPA/MILANO-REG-S 1.6250% 21-18.01.29	1 000 000.00	1 023 934.85	0.03
EUR	TEOLLISUUDEN VOIMA OYJ-REG-S 1.3750% 21-23.06.28	1 340 000.00	1 450 899.00	0.04
EUR	THYSSENKRUPP AG-REG-S 2.8750% 19-22.02.24	2 900 000.00	3 298 558.19	0.08
EUR	THYSSENKRUPP AG-REG-S 1.8750% 19-06.03.23	1 000 000.00	1 126 605.00	0.03
EUR	TRAFIGURA FUNDING SA-REG-S 3.8750% 21-02.02.26	960 000.00	1 079 834.01	0.03
EUR	ZF FINANCE GMBH-REG-S 3.7500% 20-21.09.28	10 800 000.00	12 591 072.00	0.32
EUR	ZF FINANCE GMBH-REG-S 3.0000% 20-21.09.25	1 500 000.00	1 726 073.20	0.04
EUR	ZF FINANCE GMBH-REG-S 2.7500% 20-25.05.27	5 500 000.00	6 150 086.25	0.15
EUR	ZF FINANCE GMBH-REG-S 2.0000% 21-06.05.27	800 000.00	873 884.96	0.02
EUR	ZF FINANCE GMBH-REG-S 2.2500% 21-03.05.28	2 700 000.00	2 918 658.92	0.07
ユーロ合計			157 835 252.66	3.95
GBP				
GBP	PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 6.2500% 11-14.12.26	1 300 000.00	1 874 737.85	0.05
GBP	WILLIAM HILL PLC-REG-S 4.7500% 19-01.05.26	2 950 000.00	4 072 645.66	0.10
英債券合計			5 947 383.51	0.15
USD				
USD	NAVIENT CORP 5.6250% 03-01.08.33	7 037 000.00	6 303 252.01	0.16
USD	NAVIENT CORP 6.1250% 14-25.03.24	4 083 000.00	4 252 444.50	0.11
USD	NAVIENT CORP 6.7500% 18-15.06.26	635 000.00	671 245.80	0.02
USD	PETROLEOS MEXICANOS 6.6250% 05-15.06.35	1 000 000.00	931 500.00	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

2022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 PETROLEOS MEXICANOS 6.87500% 17-04.08.26	1 500 000.00	1 607 250.00	0.04
USD SPRINT CAPITAL CORPORATION 8.75000% 02-15.03.32	4 698 000.00	6 562 871.10	0.16
米ドル合計		20 328 563.41	0.51
中期債券、固定利付債合計		184 111 199.58	4.61
中期債券、変動利付債			
EUR			
EUR BANCA MONT DEI PAS DI SIENA-REG-S-SUB 5.375%/VAR 18-18.01.28	650 000.00	550 130.75	0.01
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 5.375%/VAR 18-12.12.28	700 000.00	838 177.30	0.02
EUR BPER BANCA-REG-S-SUB 3.875%/VAR 22-25.07.32	2 875 000.00	3 243 017.97	0.08
EUR CAIXABANK SA-REG-S-SUB VAR 21-18.06.31	1 000 000.00	1 101 842.11	0.03
EUR COMMERZBANK AG-REG-S-SUB 4.000%/VAR 20-05.12.30	1 000 000.00	1 199 958.76	0.03
EUR COMMERZBANK AG-REG-S-SUB 1.375%/VAR 21-29.12.31	3 200 000.00	3 449 838.94	0.09
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 5.000%/VAR 14-PRP	2 500 000.00	2 998 675.00	0.08
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB 5.875%/VAR 19-04.03.29	1 600 000.00	1 955 267.93	0.05
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB 4.375%/VAR 19-12.07.29	625 000.00	748 315.14	0.02
EUR JYSKE BANK A/S-REG-S-SUB 3.625%/VAR 21-PRP	2 025 000.00	2 243 806.21	0.06
EUR MEDIOBANCA SPA-REG-S-SUB 2.300%/VAR 20-23.11.30	870 000.00	979 069.65	0.02
EUR OTP BANK NYRT-REG-S-SUB 2.875%/VAR 19-15.07.29	715 000.00	817 545.30	0.02
EUR TDC A/S 3.750%/RATING LINKED 12-02.03.22	350 000.00	392 033.76	0.01
EUR TRAFIGURA GROUP PTE LTD-REG-S-SUB 7.500%/VAR 19-PRP	999 000.00	1 196 155.19	0.03
EUR UNICREDIT SPA-REG-S-SUB 4.875%/VAR 19-20.02.29	800 000.00	954 110.91	0.02
ユーロ合計		22 667 944.92	0.57
GBP			
GBP ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 6.000%/VAR 13-PRP	2 500 000.00	3 481 246.34	0.09
英ポンド合計		3 481 246.34	0.09
USD			
USD BANK OF IRELAND GROUP PLC-REG-S-SUB 4.125%/VAR 17-19.09.27	720 000.00	724 282.56	0.02
USD NATWEST GROUP PLC-SUB 8.000%/VAR 15-PRP	600 000.00	675 750.00	0.01
USD NORDEA BANK ABP-REG-S 3.750%/VAR 21-PRP	3 000 000.00	2 722 500.03	0.07
米ドル合計		4 122 532.59	0.10
中期債券、変動利付債合計		30 271 723.85	0.76
債券、固定利付債			
CHF			
CHF DUFY ONE BV-REG-S 3.62500% 21-15.04.26	175 000.00	185 798.30	0.00
CHF TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE 0.50000% 16-28.07.22	525 000.00	559 424.84	0.01
スイスフラン合計		745 223.14	0.01
EUR			
EUR ADEVINTA ASA-REG-S 2.62500% 20-15.11.25	1 370 000.00	1 533 850.29	0.04
EUR ADEVINTA ASA-REG-S 3.00000% 20-15.11.27	1 953 000.00	2 170 265.97	0.05
EUR ADLER REAL ESTATE AG-REG-S 1.87500% 18-27.04.23	600 000.00	635 791.29	0.02
EUR ADLER REAL ESTATE AG-REG-S 3.00000% 18-27.04.26	700 000.00	697 902.77	0.02
EUR ADLER REAL ESTATE AG-REG-S 1.50000% 19-17.04.22	500 000.00	546 704.98	0.01
EUR ADO PROPERTIES SA-REG-S 1.50000% 17-26.07.24	900 000.00	864 066.35	0.02
EUR AEDAS HOMES OPCO SLU-REG-S 4.00000% 21-15.08.26	500 000.00	564 255.35	0.01
EUR AFFLELOU SAS-REG-S 4.25000% 21-19.05.26	2 300 000.00	2 533 386.01	0.06
EUR ALBION FINANCING-REG-S 5.25000% 21-15.10.26	1 290 000.00	1 418 625.85	0.04
EUR ALLIED UNIVERSAL HOLDCO/FIN/ATLAS-REG-S 3.62500% 21-01.06.28	6 505 000.00	6 854 578.70	0.17
EUR ALTICE FINANCING SA-REG-S 2.25000% 20-15.01.25	1 000 000.00	1 061 250.70	0.03
EUR ALTICE FINANCING SA-REG-S 3.00000% 20-15.01.28	5 350 000.00	5 469 583.20	0.14

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2022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 ARQIVA BROADCAST FINANCE PLC-REG-S 6.75000% 18-30.09.23	900 000.00	1 220 719.04	0.03
GBP B&M EUROPEAN VALUE RETAIL SA-REG-S 4.00000% 21-15.11.28	1 750 000.00	2 301 258.45	0.06
GBP BELLIS ACQUISITION CO PLC-REG-S 4.50000% 21-16.02.26	1 230 000.00	1 600 722.62	0.04
GBP BOPARAN FINANCE PLC-REG-S 7.62500% 20-30.11.25	1 000 000.00	1 113 328.00	0.03
GBP GALAXY BIDCO LTD-REG-S 6.50000% 19-31.07.26	770 000.00	1 055 798.05	0.03
GBP HEATHROW FINANCE PLC-REG-S 4.12500% 19-01.09.29	1 650 000.00	2 168 181.80	0.05
GBP KANE BIDCO LTD-REG-S 6.50000% 22-15.02.27	625 000.00	837 902.35	0.02
GBP PREMIER FOODS FINANCE PLC-REG-S 3.50000% 21-15.10.26	790 000.00	1 022 849.27	0.03
GBP VIRGIN MEDIA VENDOR FINANCING-REG-S 4.87500% 20-15.07.28	1 725 000.00	2 240 157.55	0.06
GBP VMED 02 UK FINANCING I PLC-REG-S 4.00000% 20-31.01.29	450 000.00	561 516.75	0.01
GBP VMED 02 UK FINANCING I PLC-REG-S 4.50000% 21-15.07.31	2 125 000.00	2 704 179.43	0.07
GBP WILLIAM HILL PLC-REG-S 4.87500% 16-07.09.23	700 000.00	960 285.99	0.02
英ポンド合計		19 601 833.78	0.50
USD			
USD ALCATEL-LUCENT USA INC 6.45000% 99-15.03.29	1 230 000.00	1 317 637.50	0.03
USD ALLEGHENY LUDLUM CORP 6.95000% 95-15.12.25	283 000.00	305 908.85	0.01
USD ALTICE FINANCING SA-144A 5.75000% 21-15.08.29	691 000.00	645 863.88	0.02
USD BALL CORP 4.87500% 18-15.03.26	5 287 000.00	5 617 437.50	0.14
USD BELO CORP 7.75000% 97-01.06.27	2 594 000.00	2 983 100.00	0.07
USD CENTURYLINK INC 6.87500% 98-15.01.28	3 545 000.00	3 793 150.00	0.09
USD DEUTSCHE BANK AG-SUB 4.50000% 15-01.04.25	5 375 000.00	5 594 625.56	0.14
USD EDISON INTERNATIONAL 5.37500% 21-PRP	1 225 000.00	1 242 609.37	0.03
USD FORD MOTOR CO 7.40000% 96-01.11.46	2 560 000.00	3 385 600.00	0.08
USD GRAPHIC PACKAGING INTERNATIONAL-144A 3.75000% 21-01.02.30	1 539 000.00	1 477 440.00	0.04
USD HCA INC 5.37500% 15-01.02.25	777 000.00	826 930.02	0.02
USD IHO VERWALTUNGS GMBH-144A (PIK) 6.00000% 19-15.05.27	1 850 000.00	1 904 945.00	0.05
USD INTELSAT LUXEMBOURG SA * DEFAULTED * 8.12500% 13-01.06.23	4 910 000.00	24 550.00	0.00
USD L BRANDS INC 6.95000% 03-01.03.33	1 492 000.00	1 624 444.84	0.04
USD NEW ALBERTSONS LP 7.45000% 99-01.08.29	853 000.00	970 287.50	0.02
USD NUSTAR LOGISTICS LP 6.00000% 19-01.06.26	1 420 000.00	1 489 395.40	0.04
USD SPA HOLDINGS 3 OY-144A 4.87500% 21-04.02.28	2 098 000.00	2 022 052.40	0.05
USD TELECOM ITALIA CAPITAL 6.00000% 05-30.09.34	655 000.00	645 175.00	0.02
USD VZ SECURED FINANCING BV-144A 5.00000% 22-15.01.32	6 235 000.00	6 012 909.30	0.15
USD YUM BRANDS INC 6.87500% 07-15.11.37	1 425 000.00	1 667 250.00	0.05
米ドル合計		43 551 312.12	1.09
債券、固定利付債合計		601 340 681.56	15.05
債券、ゼロ・クーポン債			
USD			
USD NYRSTAR HOLDINGS PLC-REG-S 0.00000% 19-31.07.26	763 000.00	598 269.24	0.01
米ドル合計		598 269.24	0.01
債券、ゼロ・クーポン債合計		598 269.24	0.01
債券、変動利付債			
EUR			
EUR ABN AMRO BANK NV-REG-S-SUB 4.750%/VAR 17-PRP	3 500 000.00	4 097 389.53	0.10
EUR ABN AMRO BANK NV-REG-S-SUB 4.375%/VAR 20-PRP	900 000.00	1 050 517.13	0.03
EUR AKELIUS RESIDENTIAL PROPERT-REG-S-SUB 3.875%/VAR 18-05.10.78	430 000.00	497 955.31	0.01
EUR APCOA PARKING HOLDINGS GM-REG-S 3M EURIBOR+500BP 21-15.01.27	1 965 000.00	2 200 082.04	0.05
EUR ASSEMBLIN FINANCING AB-REG-S 3M EURIBOR+500BP 19-15.05.25	2 200 000.00	2 466 200.00	0.06
EUR BACH BIDCO SPA-REG-S 3M EURIBOR+425BP 21-15.10.28	1 850 000.00	2 079 242.01	0.05
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 6.500%/VAR 17-PRP	3 600 000.00	4 086 045.00	0.10
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 5.000%/VAR 21-PRP	1 000 000.00	1 088 771.25	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

2022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 BAYER AG-REG-S-SUB 3.125%/VAR 19-12.11.79	1 000 000.00	1 112 345.88	0.03
EUR BRUNELLO BIDCO SPA-REG-S 3M EURIBOR+371BP 21-15.02.28	700 000.00	776 934.61	0.02
EUR BURGER KING FRANCE SAS-REG-S 3M EURIBOR+475BP 21-01.11.26	3 150 000.00	3 560 543.30	0.09
EUR CAIXABANK SA-REG-S-SUB 6.750%/VAR 17-PRP	2 600 000.00	3 182 609.13	0.08
EUR CAIXABANK SA-REG-S-SUB 6.000%/VAR 17-PRP	2 000 000.00	2 281 235.00	0.06
EUR CULLINAN HOLDCO SCSP-REG-S 3M EURIBOR+475BP 21-15.10.26	664 000.00	731 042.57	0.02
EUR DIOCLE SPA-REG-S 3M EURIBOR+387.5BP 19-30.06.26	850 000.00	754 307.48	0.02
EUR GAS NATURAL FENOSA FINANCE BV-REG-S-SUB 4.125%/VAR 14-PRP	800 000.00	922 708.55	0.02
EUR GOLDEN GOOSE SPA-REG-S 3M EURIBOR+487.5BP 21-14.05.27	1 400 000.00	1 543 504.90	0.04
EUR HSBC HOLDINGS PLC-144A-REG-S-SUB 5.250%/VAR 14-PRP	1 800 000.00	2 060 577.36	0.05
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB 7.750%/VAR 17-PRP	3 300 000.00	4 337 503.23	0.11
EUR LA POSTE SA-REG-S-SUB 3.125%/VAR 18-PRP	1 000 000.00	1 144 798.83	0.03
EUR LEATHER 2 SPA-REG-S 3M EURIBOR+450BP 21-30.09.28	660 000.00	736 974.55	0.02
EUR LION/POLARIS LUX 4 SA-REG-S 3M EURIBOR+400BP 21-01.07.26	2 367 000.00	2 640 989.06	0.07
EUR LOUVRE BIDCO SAS-REG-S 3M EURIBOR+537.5BP 18-30.09.24	470 000.00	299 262.16	0.01
EUR PAGANINI BIDCO SPA-REG-S 3M EURIBOR+425BP 21-30.10.28	2 950 000.00	3 322 452.98	0.08
EUR PARTS EUROPE SA-REG-S 3M EURIBOR+400BP 21-20.07.27	900 000.00	1 007 638.88	0.03
EUR PFLEIDERER GMBH-REG-S EURO03M+475BP 21-15.04.26	1 625 000.00	1 812 699.04	0.04
EUR RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S-SUB 3.250%/VAR 19-PRP	5 400 000.00	6 008 035.81	0.15
EUR RAIFFEISEN BANK INTL AG-REG-S-SUB 6.125%/VAR 17-PRP	600 000.00	687 733.50	0.02
EUR RIMINI BIDCO SPA-REG-S 3M EURIBOR+525BP 21-14.12.26	2 700 000.00	2 898 065.25	0.07
EUR SAMHALLSBYGGNADSBOLAGET I NOR-REG-S-SUB 2.624%/VAR 20-PRP	440 000.00	475 881.90	0.01
EUR SES SA-REG-S-SUB 5.625%/VAR 16-PRP	1 500 000.00	1 770 289.92	0.04
EUR SOFIMA HOLDING SPA-REG-S 3M EURIBOR+400BP 20-15.01.28	1 897 000.00	2 107 211.04	0.05
EUR SOLVAY FINANCE SA-REG-S-SUB 5.869%/VAR 15-PRP	2 000 000.00	2 437 726.60	0.06
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 5.875%/VAR 14-PRP	4 000 000.00	4 864 512.24	0.12
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 3.875%/VAR 18-PRP	6 400 000.00	7 469 784.40	0.19
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 4.375%/VAR 19-PRP	5 200 000.00	6 193 769.83	0.14
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 2.875%/VAR 19-PRP	3 300 000.00	3 639 186.38	0.09
EUR TRIVIUM PACKAGING FIN BV-REG-S 3M EURIBOR+375BP 19-15.08.26	270 000.00	300 172.98	0.01
EUR UNICREDIT SPA-REG-S-SUB 6.625%/VAR 17-PRP	1 400 000.00	1 640 211.33	0.04
EUR UNICREDIT SPA-REG-S-SUB 5.375%/VAR 17-PRP	1 000 000.00	1 156 845.10	0.03
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 3M EURIBOR+487.5BP 22-01.02.29	450 000.00	503 527.87	0.01
EUR VERISURE HOLDING AB-REG-S 3M EURIBOR+500BP 20-15.04.25	950 000.00	1 072 937.13	0.03
EUR VERTICAL MIDCO GMBH-REG-S 3M EURIBOR+475BP 20-15.07.27	5 153 000.00	5 776 513.00	0.14
EUR VODAFONE GROUP PLC-REG-S-SUB 3.100%/VAR 18-03.01.79	5 750 000.00	6 586 022.41	0.16
EUR VODAFONE GROUP PLC-REG-S-SUB 4.200%/VAR 18-03.10.78	1 000 000.00	1 196 488.14	0.03
EUR VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FIN NV-REG-S-SUB 2.500%/VAR 15-PRP	3 413 000.00	3 833 670.85	0.10
EUR WEPA HYGIENEPRODUKTE-REG-S 3M EURIBOR+287.5BP 19-15.12.26	1 825 000.00	1 956 831.61	0.05
ユーロ合計		112 369 747.07	2.79
USD			
USD ALLIANZ SE-REG-S-SUB 3.200%/VAR 21-PRP	400 000.00	369 500.00	0.01
USD ALLY FINANCIAL INC-SUB 4.700%/VAR 21-PRP	760 000.00	751 374.00	0.02
USD BARCLAYS PLC-SUB 7.750%/VAR 18-PRP	2 400 000.00	2 550 000.00	0.06
USD CITIGROUP INC-SUB 5.950%/VAR 15-PRP	635 000.00	669 925.00	0.02
USD DANSKE BANK AS-REG-S-SUB 6.125%/VAR 17-PRP	1 900 000.00	1 966 500.00	0.05
USD ING GROEP NV-SUB 5.750%/VAR 19-PRP	1 000 000.00	1 051 250.00	0.03
USD SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN-REG-S-SUB 5.125%/VAR 19-PRP	1 000 000.00	1 025 790.00	0.03
USD VODAFONE GROUP PLC-REG-S-SUB 6.250%/VAR 18-03.10.78	2 065 000.00	2 168 663.00	0.05
米ドル合計		10 553 002.00	0.27
債券、変動利付債合計		122 922 749.07	3.06
転換社債型新株予約権付社債、変動利付債			
EUR			
EUR BANCO BPM SPA-REG-S-SUB COCO 6.125%/VAR 20-PRP	800 000.00	911 480.61	0.02
EUR BANK OF IRELAND GROUP PLC-REG-S-SUB COCO 7.500%/VAR 20-PRP	260 000.00	329 198.24	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 - ハイ・イールド

2022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 BANK OF IRELAND GROUP PLC-REG-S-SUB COCO 6.000%/VAR 20-PRP	300 000.00	358 448.72	0.01
EUR ERSTE GROUP BANK AG-REG-S-SUB COCO 5.125%/VAR 19-PRP	1 600 000.00	1 902 381.84	0.05
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB COCO 5.875%/VAR 20-PRP	2 800 000.00	3 328 163.81	0.08
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB COCO 5.500%/VAR 20-PRP	400 000.00	471 766.12	0.01
ユーロ合計		7 301 439.34	0.18
GBP			
GBP LEGAL & GENERAL GROUP PLC-REG-S-SUB COCO 5.625%/VAR 20-PRP	1 800 000.00	2 527 290.25	0.06
GBP LLOYDS BANKING GROUP PLC-REG-S-SUB 5.125%/VAR 20-PRP	1 350 000.00	1 843 170.31	0.05
GBP NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S-SUB COCO 5.750%/VAR 20-PRP	550 000.00	773 149.96	0.02
英ポンド合計		5 143 610.52	0.13
USD			
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S-SUB COCO 7.250%/VAR 18-PRP	1 025 000.00	1 095 468.75	0.03
USD DEUTSCHE BANK AG-SUB COCO 6.000%/VAR 20-PRP	400 000.00	403 000.00	0.01
USD UBS GROUP AG-REG-S-SUB 7.000%/VAR 19-PRP	1 200 000.00	1 268 256.00	0.03
米ドル合計		2 766 724.75	0.07
転換社債型新株予約権付社債、変動利付債合計		15 211 774.61	0.38
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		2 044 546 738.15	51.15
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 BCP V MODULAR SERVICES FINANCE-REG-S 6.75000% 21-30.11.29	200 000.00	207 497.10	0.01
ユーロ合計		207 497.10	0.01
USD			
USD 1011778 BC ULC/NEW RED FINANCE INC-144A 3.87500% 19-15.01.28	1 030 000.00	1 004 095.50	0.03
USD 1011778 BC ULC/NEW RED FINANCE INC-144A 5.75000% 20-15.04.25	2 395 000.00	2 475 831.25	0.06
USD 1011778 BC ULC/NEW RED FINANCE INC-144A 4.00000% 20-15.10.30	676 000.00	625 752.92	0.02
USD ACI WORLDWIDE INC-144A 5.75000% 18-15.08.26	4 647 000.00	4 831 137.38	0.12
USD ADT CORP-144A 4.87500% 16-15.07.32	6 967 000.00	6 688 320.00	0.17
USD ADT SECURITY CORP/THE-144A 4.12500% 21-01.08.29	403 000.00	379 069.86	0.01
USD AG ISSUER LLC-144A 6.25000% 20-01.03.28	1 575 000.00	1 636 157.25	0.04
USD AHEAD DB HOLDINGS LLC-144A 6.62500% 21-01.05.28	2 139 000.00	2 070 894.24	0.05
USD AHERN RENTALS INC-144A 7.37500% 15-15.05.23	1 445 000.00	1 354 687.50	0.03
USD ALBERTSONS COS INC / SAFEWAY INC-144A 5.87500% 19-15.02.28	1 933 000.00	2 015 326.47	0.05
USD ALBERTSONS COS LLC / SAFEWAY INC-144A 4.87500% 20-15.02.30	925 000.00	942 343.75	0.02
USD ALBERTSONS COS LLC / SAFEWAY INC-144A 3.50000% 20-15.03.29	740 000.00	698 678.40	0.02
USD ALLEN MEDIA CO-ISS INC-144A 10.50000% 20-15.02.28	2 309 000.00	2 307 452.97	0.06
USD ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP-144A 4.75000% 19-15.12.24	4 846 000.00	4 905 315.04	0.12
USD ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP-144A 7.00000% 20-15.01.26	3 312 000.00	3 452 760.00	0.09
USD ALLIANT HLDG INTER LLC/CO ISSUER-144A 6.75000% 19-15.10.27	7 299 000.00	7 214 185.62	0.18
USD ALLIED UNIVERSAL HOLDCO/FIN CORP-144A 6.62500% 19-15.07.26	6 757 000.00	6 938 526.81	0.17
USD ALLIED UNIVERSAL HOLDCO LLC-144A 9.75000% 19-15.07.27	5 815 000.00	6 134 825.00	0.15
USD ALLISON TRANSMISSION INC-144A 4.75000% 17-01.10.27	4 305 000.00	4 369 575.00	0.11
USD ALTICE FRANCE SA/FRANCE-144A 5.12500% 20-15.01.29	2 906 000.00	2 702 580.00	0.07
USD AMERICAN AIRLINES GROUP INC-144A 3.75000% 20-01.03.25	3 115 000.00	2 882 402.95	0.07
USD AMERICAN AIRLINES INC-144A 5.50000% 21-20.04.26	1 460 000.00	1 494 675.00	0.04
USD AMERICAN AIRLINES INC-144A 11.75000% 20-15.07.25	2 100 000.00	2 541 903.00	0.06
USD AMKOR TECHNOLOGY INC-144A 6.62500% 19-15.09.27	605 000.00	636 006.25	0.02
USD AMN HEALTHCARE INC-144A 4.62500% 19-01.10.27	180 000.00	181 756.80	0.00
USD ANGI GROUP LLC-144A 3.87500% 20-15.08.28	1 220 000.00	1 116 800.20	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

2022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 UBER TECHNOLOGIES INC-144A 4.50000% 21-15.08.29	1 215 000.00	1 178 550.00	0.03
USD UNITED AIRLINES INC-144A 4.37500% 21-15.04.26	567 000.00	562 804.20	0.01
USD UNITED SHORE FINANCIAL SERVICE LLC-144A 5.50000% 20-15.11.25	550 000.00	532 688.75	0.01
USD UNIVAR SOLUTIONS USA-144A 5.12500% 19-01.12.27	4 497 000.00	4 575 697.50	0.11
USD UNIVISION COMMUNICATIONS INC-144A 6.62500% 20-01.06.27	2 150 000.00	2 267 959.75	0.06
USD US ACUTE CARE SOLUTIONS LLC-144A 6.37500% 21-01.03.26	2 447 000.00	2 459 235.00	0.06
USD US FOODS INC-144A 6.25000% 20-15.04.25	2 569 000.00	2 655 472.54	0.07
USD USA COMPRESSION PARTNERS LLC 6.87500% 19-01.04.26	3 620 000.00	3 675 675.60	0.09
USD USI INC/NY-144A 6.87500% 17-01.05.25	810 000.00	810 000.00	0.02
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 5.50000% 17-01.11.25	3 560 000.00	3 587 910.40	0.09
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 9.25000% 18-01.04.26	5 114 000.00	5 266 397.20	0.13
USD VALVOLINE INC-144A 4.25000% 20-15.02.30	2 937 000.00	2 836 936.41	0.07
USD VAREX IMAGING CORP-144A 7.87500% 20-15.10.27	2 153 000.00	2 357 298.17	0.06
USD VERSCEND ESCROW CORP-144A 9.75000% 18-15.08.26	5 825 000.00	6 117 356.75	0.15
USD VIAVI SOLUTIONS INC-144A 3.75000% 21-01.10.29	1 050 000.00	1 018 500.00	0.03
USD VIKING CRUISES LTD-144A 5.87500% 17-15.09.27	2 342 000.00	2 131 220.00	0.05
USD VIKING OCEAN CRUISES SHIP VII LTD-144A 5.62500% 21-15.02.29	233 000.00	223 971.25	0.01
USD VISTRA OPERATIONS CO LLC-144A 5.62500% 19-15.02.27	811 000.00	827 244.33	0.02
USD VISTRA OPERATIONS CO LLC-144A 5.00000% 19-31.07.27	1 320 000.00	1 330 428.00	0.03
USD VIZIENT INC-144A 6.25000% 19-15.05.27	1 643 000.00	1 684 075.00	0.04
USD W&T OFFSHORE INC-144A 9.75000% 18-01.11.23	3 135 000.00	3 056 625.00	0.08
USD WABASH NATIONAL CORP-144A 4.50000% 21-15.10.28	1 380 000.00	1 337 606.40	0.03
USD WATCO COS LLC / WATCO FINANCE CORP-144A 6.50000% 20-15.06.27	8 070 000.00	8 352 450.00	0.21
USD WEEKLEY HOMES LLC / WEEKLEY FIN-144A 4.87500% 20-15.09.28	2 242 000.00	2 205 163.94	0.06
USD WESCO DISTRIBUTION INC-144A 7.12500% 20-15.06.25	670 000.00	701 624.00	0.02
USD WESCO DISTRIBUTION INC-144A 7.25000% 20-15.06.28	2 621 000.00	2 811 022.50	0.07
USD WHEEL PROS INC-144A 6.50000% 21-15.05.29	1 075 000.00	999 750.00	0.03
USD WHITE CAP BUYER LLC-144A 6.87500% 20-15.10.28	3 079 000.00	3 159 115.58	0.08
USD WILLIAMS SCOTSMAN INTL INC-144A 4.62500% 20-15.08.28	1 128 000.00	1 137 870.00	0.03
USD WINDSTREAM ESCROW LLC/FINANCE CORP-144A 7.75000% 20-15.08.28	2 251 000.00	2 270 020.95	0.06
USD WMG ACQUISITION CORP-144A 3.00000% 20-15.02.31	2 223 000.00	2 017 372.50	0.05
USD WOLVERINE ESCROW LLC-144A 8.50000% 19-15.11.24	601 000.00	522 912.07	0.01
USD WR GRACE HOLDINGS SA DE CV-144A 5.62500% 21-15.08.29	4 216 000.00	4 068 440.00	0.10
USD WYNDHAM DESTINATIONS INC-144A 6.62500% 20-31.07.26	702 000.00	749 385.00	0.02
USD WYNN LAS VEGAS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.50000% 15-01.03.25	1 475 000.00	1 482 802.61	0.04
USD XEROX HOLDINGS CORP-144A 5.00000% 20-15.08.25	5 300 000.00	5 369 377.00	0.13
USD XEROX HOLDINGS CORP-144A 5.50000% 20-15.08.28	1 000 000.00	1 005 580.00	0.03
USD YUM BRANDS INC-144A 4.75000% 19-15.01.30	3 820 000.00	3 925 298.30	0.10
USD ZAYO GROUP HOLDINGS INC-144A 4.00000% 20-01.03.27	3 751 000.00	3 541 731.71	0.09
USD ZAYO GROUP HOLDINGS INC-144A 6.12500% 20-01.03.28	3 703 000.00	3 493 410.20	0.09
米ドル合計		1 041 105 648.22	26.04
ノート、固定利付債合計		1 041 313 145.32	26.05
中期債券、固定利付債			
USD			
USD INTESA SANPAOLO SPA-144A-SUB 5.01700% 14-26.06.24	11 220 000.00	11 679 883.35	0.29
米ドル合計		11 679 883.35	0.29
中期債券、固定利付債合計		11 679 883.35	0.29
中期債券、変動利付債			
USD			
USD UNICREDIT SPA-144A-SUB 5.459%/VAR 20-30.06.35	620 000.00	646 968.81	0.02
米ドル合計		646 968.81	0.02
中期債券、変動利付債合計		646 968.81	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

2022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 PANTHER BF AGGR 2/PANTHER FIN CO-REG-S 4.37500% 19-15.05.26	1 700 000.00	1 931 739.48	0.05
ユーロ合計		1 931 739.48	0.05
GBP			
GBP PINWOOD FINANCE-REG-S 3.62500% 21-15.11.27	1 645 000.00	2 163 315.36	0.05
GBP VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC-REG-S 4.12500% 20-15.08.30	2 225 000.00	2 799 583.15	0.07
英ポンド合計		4 962 898.51	0.12
USD			
USD CVR ENERGY INC-144A 5.25000% 20-15.02.25	2 000 000.00	1 930 000.00	0.05
USD CVR ENERGY INC-144A 5.75000% 20-15.02.28	2 200 000.00	2 112 000.00	0.05
USD HUSBAY MINERALS INC-144A 6.12500% 20-01.04.29	1 440 000.00	1 494 000.00	0.04
USD PACTIV CORP 8.75000% 99-15.04.27	305 000.00	326 350.00	0.01
USD TEGNA INC 4.62500% 20-15.03.28	645 000.00	632 100.00	0.02
USD WARRIOR MET COAL INC-144A 7.87500% 21-01.12.28	1 862 000.00	1 959 810.86	0.05
米ドル合計		8 454 260.86	0.22
債券、固定利付債合計		15 348 898.85	0.39
債券、変動利付債			
USD			
USD CITIGROUP INC-SUB 6.300%/VAR 14-PRP	1 490 000.00	1 532 167.00	0.04
米ドル合計		1 532 167.00	0.04
債券、変動利付債合計		1 532 167.00	0.04
転換社債型新株予約権付社債、固定利付債			
USD			
USD BURLINGTON STORES INC-144A 2.25000% 21-15.04.25	368 000.00	478 238.08	0.01
米ドル合計		478 238.08	0.01
転換社債型新株予約権付社債、固定利付債合計		478 238.08	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		1 070 999 301.41	26.80
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			
株式			
ケイマン諸島			
USD NOBLE CORP NEW NPV 144A	833.00	20 566.77	0.00
ケイマン諸島合計		20 566.77	0.00
株式合計		20 566.77	0.00
ノート、固定利付債			
USD			
USD ACADIA HEALTHCARE CO INC-144A 5.50000% 20-01.07.28	2 982 000.00	3 009 941.34	0.08
USD ACCO BRANDS CORP-144A 4.25000% 21-15.03.29	882 000.00	842 120.37	0.02
USD ADAPTHEALTH LLC-144A 6.12500% 20-01.08.28	2 566 000.00	2 681 470.00	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

2022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 VALVOLINE INC-144A 3.62500% 20-15.06.31	2 755 000.00	2 524 819.75	0.06
USD VIASAT INC-144A 6.50000% 20-15.07.28	4 760 000.00	4 712 400.00	0.12
USD VIKING CRUISES LTD-144A 7.00000% 21-15.02.29	363 000.00	346 665.00	0.01
USD WORLD ACCEPTANCE CORP-144A 7.00000% 21-01.11.26	1 725 000.00	1 656 345.00	0.04
USD WYNDHAM HOTELS & RESORTS INC-144A 4.37500% 20-15.08.28	2 457 000.00	2 437 835.40	0.06
USD XPO LOGISTICS INC-144A 6.25000% 20-01.05.25	3 564 000.00	3 688 989.48	0.09
USD ZOOMINFO TECHNOLOGIES LLC-144A 3.87500% 21-01.02.29	5 220 000.00	4 913 325.00	0.12
米ドル合計		279 517 227.45	6.99
ノート、固定利付債合計		279 517 227.45	6.99
債券、固定利付債			
USD			
USD DELEK LOGISTICS PARTNERS LP 6.75000% 18-15.05.25	4 078 000.00	4 094 352.78	0.10
USD DIEBOLD NIXDORF INC-144A 9.37500% 20-15.07.25	1 092 000.00	1 147 014.96	0.03
USD JB POINDEXTER & CO INC-144A 7.12500% 18-15.04.26	1 628 000.00	1 692 826.96	0.04
USD NOBLE FINANCE CO 11.00000% 21-15.02.28	320 185.00	353 804.43	0.01
米ドル合計		7 287 999.13	0.18
債券、固定利付債合計		7 287 999.13	0.18
転換社債型新株予約権付社債、固定利付債			
USD			
USD INTELSAT SA * DEFAULTED * 4.50000% 18-15.06.25	1 600 000.00	240 000.00	0.01
米ドル合計		240 000.00	0.01
転換社債型新株予約権付社債、固定利付債合計		240 000.00	0.01
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されて いない譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		287 065 793.35	7.18
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 ACRISURE LLC / FINANCE INC-144A 4.25000% 21-15.02.29	1 295 000.00	1 222 635.40	0.03
USD ACRISURE LLC /ACRISURE FINANCE INC-144A 6.00000% 21-01.08.29	815 000.00	774 250.00	0.02
USD ADAPTHEALTH LLC-144A 5.12500% 21-01.03.30	3 056 000.00	2 991 243.36	0.07
USD AETHON UNITED/AETHON UNITED FIN C-144A-8.25000% 21-15.02.26	2 159 000.00	2 273 707.67	0.06
USD AIR CANADA-144A 3.87500% 21-15.08.26	2 189 000.00	2 135 128.71	0.05
USD ALLIED UNIVERSAL HOLDCO/FIN CORP-144A 6.00000% 21-01.06.29	2 515 000.00	2 383 981.08	0.06
USD ALLIED UNIVERSAL HOLDCO LLC-144A 4.62500% 21-01.06.28	1 369 000.00	1 314 500.11	0.03
USD AMERICAN BUILDERS & CONTRAC SUPPLY-144A 3.87500% 21-15.11.29	1 669 000.00	1 568 459.44	0.04
USD AMWINS-144A 4.87500% 21-30.06.29	2 175 000.00	2 128 781.25	0.05
USD ANTERO RESOURCES CORP-144A 5.37500% 21-01.03.30	4 961 000.00	5 133 642.80	0.13
USD API ESCROW CORP-144A 4.75000% 21-15.10.29	59 000.00	57 967.50	0.00
USD API GROUP DE INC-144A 4.12500% 21-15.07.29	1 494 000.00	1 437 975.00	0.04
USD APOLLO COMMERCIAL REAL ESTATE FINA-144A 4.62500% 21-15.06.29	2 010 000.00	1 914 525.00	0.05
USD ARDAGH METAL PACKAGING FINANCE PLC-144A 4.00000% 21-01.09.29	3 223 000.00	3 069 907.50	0.08
USD ARKO CORP-144A 5.12500% 21-15.11.29	1 653 000.00	1 572 581.55	0.04
USD ASBURY AUTOMOTIVE GROUP INC-144A 4.62500% 21-15.11.29	2 875 000.00	2 829 057.50	0.07
USD ASBURY AUTOMOTIVE GROUP INC-144A 5.00000% 21-15.02.32	2 910 000.00	2 887 214.70	0.07
USD ASHLAND INC-144A 3.37500% 21-01.09.31	2 940 000.00	2 778 300.00	0.07
USD ASTEROID PRIVATE MERGER SUB INC-144A 8.50000% 21-15.11.29	1 994 000.00	2 028 556.02	0.05
USD ATHABASCA OIL CORP-144A 9.75000% 21-01.11.26	1 960 000.00	1 960 000.37	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

2022年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されていない派生商品			
新株予約権			
ケイマン諸島			
USD NOBLE CORP CALL WARRANT 0.000001 21-05.02.28	462.00	3 696.00	0.00
USD NOBLE CORP CALL WARRANT 0.000001 21-05.02.28	462.00	3 469.62	0.00
ケイマン諸島合計		7 165.62	0.00
新株予約権合計		7 165.62	0.00
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されていない派生商品合計			
		7 165.62	0.00
投資有価証券合計		3 847 800 571.81	96.27

派生商品

公認の証券取引所に上場されている派生商品

債券に係る金融先物

EUR EURO-BUND FUTURE 08.03.22	5.00	-24 740.47	0.00
EUR EURO-BOBL FUTURE 08.03.22	-136.00	39 638.56	0.00
EUR EURO-SCHATZ FUTURE 08.03.22	195.00	-76 508.25	0.00
EUR EURO-BUXL FUTURE 08.03.22	4.00	-64 121.20	0.00
EUR EURO-OAT FUTURE 08.03.22	-84.00	515 077.08	0.01
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 22.03.22	-75.00	173 543.75	0.00
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 22.03.22	59.00	28 664.01	0.00
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.22	-390.00	229 394.46	0.01
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.22	216.00	-218 776.10	-0.01
USD US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 22.03.22	-57.00	285 981.21	0.01
USD US LONG BOND FUTURE 22.03.22	-26.00	55 196.56	0.00
債券に係る金融先物合計		943 349.61	0.02
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		943 349.61	0.02

他の規制ある市場で取引されている派生商品

指数に係るスワップおよびフォワード・スワップ

USD BARCLAYS/IBOXX USD LIQUID HY TR EQS PAY PERF 22-20.06.22	-8 500 000.00	73 123.80	0.00
USD BARCLAYS/IBOXX USD LIQUID HY TR EQS REC 3ML 22-20.06.22			
指数に係るスワップおよびフォワード・スワップ合計		73 123.80	0.00
他の規制ある市場で取引されている派生商品合計		73 123.80	0.00

公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されていない派生商品

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 TR EQS PAY PERF 21-20.06.22	-21 500 000.00	380 820.09	0.01
EUR BNP/IBOXX CORP OVERALL PERF TR EQS REC FLR 21-20.06.22			
EUR BARCLAYS/IBOXX CORP OVERALL TR EQS PAY PERF 22-20.12.22	-11 250 000.00	57 253.44	0.00
EUR BARCLAYS/IBOXX CORP OVERALL PERF TR EQS REC FLR 22-20.12.22			
指数に係るスワップおよびフォワード・スワップ合計		438 073.53	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

2022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 (%)			
クレジット・デフォルト・スワップ*						
EUR BARCLAYS/CELLNEX TELECOM TP CREDIT DEFAULT SWAP REC 5.00000% 21-20.12.27	-1 275 000.00	253 603.06	0.01			
EUR BARCLAYS/FAURECIA SA CREDIT DEFAULT SWAP REC 5.00000% 21-20.12.26	-500 000.00	66 745.51	0.00			
EUR BARCLAYS/CELLNEX TELECOM TP CREDIT DEFAULT SWAP REC 5.00000% 21-20.12.28	-700 000.00	145 347.03	0.01			
クレジット・デフォルト・スワップ合計		465 695.60	0.02			
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されて いない派生商品合計		903 769.13	0.03			
派生商品合計		1 920 242.54	0.05			
先渡為替契約						
購入通貨	購入額	売却通貨	売却額	満期日(日-月-年)		
USD	11 482 072.00	GBP	8 500 000.00	9.2.2022	78 557.00	0.00
USD	42 125 666.60	EUR	36 325 000.00	9.2.2022	1 399 674.90	0.04
USD	1 636 897.50	EUR	1 425 000.00	9.2.2022	39 250.20	0.00
USD	1 117 823.85	EUR	975 000.00	9.2.2022	24 696.75	0.00
USD	626 750.85	EUR	550 000.00	9.2.2022	10 115.05	0.00
USD	19 233 099.60	GBP	14 300 000.00	23.2.2022	50 212.15	0.00
USD	264 263 254.42	EUR	234 204 510.70	10.2.2022	1 678 211.29	0.04
USD	396 016.95	EUR	350 000.00	9.2.2022	3 612.35	0.00
USD	47 377 003.95	EUR	41 850 000.00	23.2.2022	443 486.35	0.01
USD	10 889 883.57	GBP	8 210 000.00	9.3.2022	-122 613.85	0.00
USD	4 132 993.55	EUR	3 650 000.00	9.2.2022	40 774.15	0.00
USD	2 687 075.00	EUR	2 375 000.00	23.2.2022	23 583.86	0.00
EUR	4 357 752.53	USD	4 941 116.15	10.2.2022	-55 298.06	0.00
USD	1 431 557.60	EUR	1 267 500.00	10.2.2022	10 463.95	0.00
USD	59 023 744.00	EUR	52 000 000.00	9.3.2022	687 872.83	0.02
USD	1 134 816.00	EUR	1 000 000.00	9.3.2022	12 972.32	0.00
EUR	269 569.31	USD	304 198.72	10.2.2022	-1 963.43	0.00
USD	1 301 793.10	EUR	1 150 000.00	9.3.2022	11 672.87	0.00
USD	400 897.62	EUR	355 016.68	10.2.2022	2 860.58	0.00
CHF	672 538 683.96	USD	730 455 000.00	18.2.2022	-7 814 294.26	-0.20
EUR	1 220 241 607.38	USD	1 383 538 000.00	18.2.2022	-15 210 546.21	-0.38
JPY	1 273 440 420.00	USD	11 025 000.00	18.2.2022	28 106.57	0.00
GBP	65 462 935.14	USD	88 895 000.00	18.2.2022	-1 076 024.03	-0.03
SGD	9 844 197.95	USD	7 267 000.00	18.2.2022	12 788.47	0.00
USD	514 395.36	GBP	380 000.00	6.4.2022	4 749.05	0.00
USD	69 596 954.05	EUR	61 475 000.00	6.4.2022	578 281.97	0.01
EUR	827 490.84	USD	949 261.08	10.2.2022	-21 496.21	0.00
USD	959 772.76	EUR	835 987.29	10.2.2022	22 481.85	0.00
USD	889 125.83	EUR	776 303.34	10.2.2022	18 751.28	0.00
USD	1 336 953.78	EUR	1 175 000.00	9.3.2022	18 787.46	0.00
EUR	562 653.98	USD	639 128.78	10.2.2022	-8 293.28	0.00
USD	3 261 934.75	EUR	2 875 000.00	10.2.2022	38 546.79	0.00
USD	765 396.61	CHF	697 000.00	23.3.2022	15 723.87	0.00
USD	71 142 429.60	EUR	62 700 000.00	27.4.2022	707 584.92	0.02
USD	4 816 490.49	GBP	3 570 000.00	27.4.2022	28 971.84	0.00
EUR	2 515 000.00	USD	2 845 123.93	10.2.2022	-25 360.21	0.00
USD	400 000.00	SGD	538 003.20	18.2.2022	2 146.41	0.00
USD	3 039 039.00	GBP	2 250 000.00	27.4.2022	21 695.31	0.00
USD	2 684 242.40	GBP	2 000 000.00	25.2.2022	1 358.03	0.00
USD	28 754 331.90	GBP	21 486 405.00	28.2.2022	-68 239.72	0.00

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2022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 223 983 438.88	EUR 199 999 999.00	25.2.2022	-319 523.93	-0.01
USD 134 394 984.00	EUR 120 000 000.00	25.2.2022	-186 794.36	0.00
USD 518 529 973.97	EUR 464 567 279.00	28.2.2022	-2 499 536.19	-0.06
EUR 1 553 000.00	USD 1 729 341.60	10.2.2022	11 848.49	0.00
USD 5 587 942.00	EUR 5 000 000.00	25.2.2022	-19 632.10	0.00
USD 1 915 243.40	EUR 1 715 000.00	10.2.2022	-7 577.59	0.00
USD 1 400 000.00	GBP 1 043 968.21	18.2.2022	-490.51	0.00
USD 160 000.00	JPY 18 470 880.00	18.2.2022	-322.07	0.00
USD 110 000.00	SGD 149 058.47	18.2.2022	-228.80	0.00
CHF 6 719 400.00	USD 7 200 000.00	3.2.2022	17 013.05	0.00
USD 21 000 000.00	EUR 18 828 187.41	18.2.2022	-113 134.96	0.00
USD 17 900 000.00	CHF 16 699 447.00	18.2.2022	-43 503.40	0.00
USD 1 095 005.93	EUR 975 000.00	27.4.2022	-272.76	0.00
USD 107 544.56	GBP 80 000.00	27.4.2022	261.23	0.00
EUR 2 200 000.00	USD 2 471 583.18	25.2.2022	-4 250.58	0.00
先渡為替契約合計			-21 552 283.32	-0.54
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			156 303 381.00**	3.91
当座借越およびその他の短期負債			-1 378 792.79	-0.03
その他の資産および負債			13 589 131.77	0.34
純資産総額			3 996 682 251.01	100.00

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

** 2022年1月31日現在、シティバンクに対する30,000.00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。

[次へ](#)

5 販売及び買戻しの実績

2022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2022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
3,086,857.9040 (28,041)	2,476,816.9170 (41,178)	15,293,318.5360 (235,760)

(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
58,037 (51,537)	27,449.1180 (27,449.1180)	155,047 (148,547)

(US マルチ・クレジット・サステナブル)

(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
11,089,287.1250 (70,989)	2,719,808.5470 (91,588)	21,730,642.5000 (470,765)

(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
144,293 (131,329)	76,511 (76,511)	369,933 (356,833)

(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
6,616,228.6750 (16,134)	4,725,554.0040 (33,562)	12,499,386.8290 (182,804)

(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
44,000 (39,200)	20,525 (20,525)	119,211 (114,411)

(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。