

【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】 2023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】 チェアマン・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ
アンドレアス・エバーソルド (Andreas Aebersold)
メンバー・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ
ジェーン・ウィルキンソン (Jane Wilkinson)

【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：10億9,430万米ドル(約1,520億円)を上限とする。

クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券

808億5,000万円を上限とする。

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：14億4,030万米ドル(約2,000億円)を上限とする。

クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券

930億5,000万円を上限とする。

ハイ・イールド

クラスF - a c c 投資証券：12億8,680万米ドル(約1,787億円)を上限とする。

クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券

991億8,000万円を上限とする。

(注1) 上限見込額は、便宜上、各サブ・ファンドの投資証券の2022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109.43米ドル(約15,197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8,085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144.03米ドル(約20,001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9,305円、ハイ・イールドのクラスF - a c c 投資証券については128.68米ドル(約17,870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9,918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、2022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=138.87円)による。

【縦覧に供する場所】

該当事項なし

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出しましたので、2023年1月31日付をもって提出した有価証券届出書(以下「原届出書」といいます。)の関係情報を新たな情報により訂正するため、また、2023年1月1日付でファンドの設立地における目論見書が更新され、投資方針に関する記載が更新されましたので、これに関する記載を訂正するため、また、別紙を追加および変更するため、本訂正届出書を提出するものです。

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

2【訂正箇所および訂正事項】

(1) 半期報告書に係る訂正

半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正内容は、以下のとおりです。

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

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

(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)

	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	2022年7月末日 に終了する 会計年度末	2023年1月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	419,923,653.21	373,448,972.32	- 423,368,854.95	- 1,451,243,355.90	255,651,585.00
(b) 経常利益金額 または 経常損失金額	419,923,653.21	373,448,972.32	- 423,368,854.95	- 1,451,243,355.90	255,651,585.00
(c) 当期純利益金額 または 当期純損失金額	419,923,653.21	373,448,972.32	- 423,368,854.95	- 1,451,243,355.90	255,651,585.00
(d) 出資総額 ⁽²⁾	7,088,189,524.66	5,915,111,579.13	5,474,543,845.01	4,272,773,950.34	5,282,694,000.34
(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)	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	14,827,856.4230口 175,872口	16,620,187.5280口 174,790口
(f) 純資産額	7,088,189,524.66	5,915,111,579.13	5,474,543,845.01	4,272,773,950.34	5,282,694,000.34
(g) 資産総額	7,262,997,802.48	5,960,493,070.97	5,567,728,095.87	4,293,043,311.85	5,381,893,801.19
(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)	144.28 10,883円	145.38 10,937円	138.75 10,417円	117.95 8,792円	123.67 9,023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)	6.71 5.95	9.05 1.32	- 6.60 - 9.13	- 28.32 - 30.50	4.42 3.73
(j) 分配総額	15,638,449.34	15,638,449.34	21,530,436.66	- 21,530,436.66	19,938,288.93
(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	97.59%	99.24%	98.33%	99.53%	98.16%
(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)	3.95% 2.56%	5.78% 5.18%	- 3.83% - 4.28%	- 18.87% - 19.61%	- 10.87% - 13.38%

(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)

	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	2022年7月末日 に終了する 会計年度末	2023年1月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	155,668,842.68	110,134,972.72	- 445,326,175.61	- 1,083,623,750.29	92,486,595.60
(b) 経常利益金額 または 経常損失金額	155,668,842.68	110,134,972.72	- 445,326,175.61	- 1,083,623,750.29	92,486,595.60
(c) 当期純利益金額 または 当期純損失金額	155,668,842.68	110,134,972.72	- 445,326,175.61	- 1,083,623,750.29	92,486,595.60
(d) 出資総額 ⁽²⁾	5,586,016,054.14	5,573,488,091.35	7,937,453,531.49	5,627,315,310.44	5,784,314,883.80
(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)	13,261,111.2100口 309,435口	13,589,831.6990口 358,650口	21,629,552.5740口 353,863口	16,641,190.1710口 234,272口	16,218,834.9710口 230,890口
(f) 純資産額	5,586,016,054.14	5,573,488,091.35	7,937,453,531.49	5,627,315,310.44	5,784,314,883.80
(g) 資産総額	5,674,469,422.74	5,795,505,353.28	8,108,933,139.57	5,673,090,289.14	5,865,504,144.57
(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)	165.92 10,934円	167.01 10,981円	161.68 10,605円	152.95 9,972円	152.34 9,721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)	2.73 2.46	3.76 - 1.36	- 5.13 - 7.85	- 17.59 - 33.14	- 0.63 0.39
(j) 分配総額	9,503,304.77	9,503,304.77	8,731,326.71	- 8,731,326.71	12,537,420.51
(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	98.44%	96.17%	97.89%	99.19%	98.62%
(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)	6.02% 4.52%	2.33% 1.79%	- 2.56% - 3.01%	- 8.42% - 9.19%	- 5.78% - 8.34%

(ハイ・イールド)

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	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	2022年7月末日 に終了する 会計年度末	2023年1月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	300,321,786.73	397,458,480.04	- 160,689,477.07	- 613,779,365.02	51,149,636.78
(b) 経常利益金額 または 経常損失金額	300,321,786.73	397,458,480.04	- 160,689,477.07	- 613,779,365.02	51,149,636.78
(c) 当期純利益金額 または 当期純損失金額	300,321,786.73	397,458,480.04	- 160,689,477.07	- 613,779,365.02	51,149,636.78
(d) 出資総額 ⁽²⁾	3,978,703,842.70	5,180,776,616.51	3,996,682,251.01	3,357,096,459.47	2,124,623,475.45
(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)	10,543,921.530口 97,986口	14,749,235.0260口 118,296口	12,357,772.1670口 113,331口	11,763,361.9210口 159,141口	6,793,133.9670口 154,978口
(f) 純資産額	3,978,703,842.70	5,180,776,616.51	3,996,682,251.01	3,357,096,459.47	2,124,623,475.45
(g) 資産総額	4,079,272,705.52	5,212,922,698.70	4,077,429,685.42	3,385,565,821.46	2,163,476,789.64
(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)	139.45 10,962円	143.96 11,293円	142.12 11,125円	132.13 10,275円	136.78 10,415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)	8.74 7.49	10.29 4.78	- 1.35 - 6.50	- 12.67 - 22.15	1.39 3.28
(j) 分配総額	8,742,699.34	8,742,699.34	11,344,013.45	- 11,344,013.45	8,878,614.73
(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	97.53%	99.38%	98.02%	99.16%	98.20%
(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)	6.31% 4.80%	9.84% 9.29%	1.91% 1.49%	- 8.22% - 9.01%	- 3.76% - 6.38%

(2) 外国投資法人の出資総額

2023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		
2023年2月末日現在	5,046,243,890.07	687,954	クラスF - a c c 投資証券	16,548,935.4840
			クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券	152,952

(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		
2023年2月末日現在	5,557,954,016.44	757,716	クラスF - a c c 投資証券	16,130,824.2820
			クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券	200,665

(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		
2023年2月末日現在	2,027,728,429.46	276,440	クラスF - a c c 投資証券	6,700,760.4030
			クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券	136,262

(注) 米ドルの円貨換算は、特に記載がない限り、2023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米ドル=136.33円)による。

(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

(2023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	該当なし
トーマス・ウベール (Thomas Huber)	メンバー・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、マネージング・ディレクター	該当なし

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

(5) その他

a. 定款の変更

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

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

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

b. 事業譲渡または事業譲受

投資法人、サブ・ファンドおよび投資証券クラスの解散および合併

本投資法人、サブ・ファンドおよび投資証券クラスの解散

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

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

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

る金額と見積もられている。)未滿に落ち込んだ場合、または政治もしくは経済の状況の変化がある場合、取締役会は、一もしくは複数のサブ・ファンドの投資証券クラスの清算を要求することができる。

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

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

サブ・ファンド同士またはサブ・ファンドとその他のUCIの合併

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

合併の決定は、ルクセンブルグの日刊紙に公告するか書留郵便により、投資主に通知される。かかる決定の公告から30日以内に投資主は保有する投資証券の一部または全部を、「有価証券報告書 第二部 外国投資法人の詳細情報 第2 手続等 2 買戻し手続等 海外における買戻し手続等」に記載するガイドラインに従って、無料で純資産価額で買い戻す権限を有する。買戻しのために提出されなかった投資証券は、かかる決定が効力を生じた日において計算された関連するサブ・ファンドの投資証券の純資産額に基づいて交換される。

投資主総会

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

c. 出資の状況その他の重要事項

該当事項なし。

d. 訴訟事件その他の重要事項

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

[次へ](#)

2 外国投資法人の運用状況

(1) 投資状況

資産別および地域別の投資状況

(エマージング・マーケット・デッド)

(2023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	361,611,754.90	7.12
	コロンビア	182,681,274.33	3.60
	ケイマン諸島	180,137,713.61	3.55
	インドネシア	176,240,576.42	3.47
	チリ	175,515,518.30	3.46
	サウジアラビア	150,043,277.24	2.96
	アラブ首長国連邦	135,508,784.69	2.67
	ペルー	128,026,269.77	2.52
	ドミニカ共和国	123,984,499.71	2.44
	トルコ	122,027,608.33	2.40
	オランダ	119,765,289.49	2.36
	ルーマニア	109,464,454.71	2.16
	オマーン	109,043,845.70	2.15
	ルクセンブルグ	108,647,791.08	2.14
	ハンガリー	98,770,365.35	1.95
	南アフリカ	97,793,903.62	1.93
	エジプト	94,057,860.09	1.85
	ブラジル	90,330,481.91	1.78
	英領ヴァージン諸島	86,544,623.17	1.70
	香港	85,565,090.31	1.69
	パナマ	79,023,333.33	1.56
	カタール	75,816,947.13	1.49
	韓国	74,013,007.43	1.46
	米国	70,782,038.02	1.39
	アルゼンチン	69,462,850.07	1.37
	インド	68,316,317.10	1.35
	パラグアイ	64,476,969.57	1.27
	アンゴラ	63,835,453.75	1.26
	ナイジェリア	63,175,080.00	1.24
	カザフスタン	56,877,414.37	1.12
	シンガポール	54,826,914.12	1.08
	アゼルバイジャン	52,016,239.75	1.02
モーリシャス	51,207,078.81	1.01	
イギリス	48,957,881.46	0.96	
イスラエル	45,479,660.74	0.90	

グアテマラ	44,421,955.13	0.88
パーレーン	44,380,791.25	0.87
コートジボワール	40,908,474.30	0.81
モーリシャス	36,403,840.70	0.72
フィリピン	36,218,280.36	0.71
マレーシア	35,507,968.93	0.70
クロアチア	35,478,622.78	0.70
エクアドル	34,831,891.17	0.69
スリランカ	33,744,484.62	0.66
バミューダ	32,048,952.96	0.63
中国	31,940,230.62	0.63
モンゴル	28,582,848.79	0.56
ガボン	26,682,201.95	0.53
ウクライナ	26,235,413.81	0.52
ガーナ	25,742,768.75	0.51
コスタリカ	25,651,781.56	0.51
マン島	24,765,251.37	0.49
ブルガリア	24,679,276.34	0.49
タイ	24,072,744.00	0.47
ポーランド	23,187,503.79	0.46
セルビア	22,783,518.33	0.45
ロシア連邦	20,107,132.90	0.40
パキスタン	18,705,121.66	0.37
スペイン	18,591,894.28	0.37
エルサルバドル	17,549,585.62	0.35
ヨルダン	17,195,132.64	0.34
マケドニア(旧ユーゴスラビア)	16,947,800.13	0.33
ウルグアイ	16,065,617.72	0.32
カナダ	14,728,318.72	0.29
ウズベキスタン	13,133,066.56	0.26
ベニン	12,745,898.43	0.25
ベネズエラ	12,231,026.36	0.24
アイルランド	11,952,911.00	0.24
トーゴ	11,815,206.57	0.23
イラク	11,162,132.51	0.22
マカオ	10,838,270.43	0.21
ケニヤ	10,777,331.25	0.21
オーストリア	10,219,528.54	0.20
ザンビア	9,248,830.38	0.18
ジャージー	8,691,079.89	0.17
多国籍	8,152,243.09	0.16
セネガル	7,842,329.20	0.15

レバノン	7,259,744.72	0.14
チュニジア	6,654,346.17	0.13
ノルウェー	6,146,564.40	0.12
ジャマイカ	5,982,930.38	0.12
エチオピア	5,812,342.25	0.11
トリニダード・アンド・トバゴ	4,699,008.75	0.09
ゲルジア	4,401,537.42	0.09
ベトナム	3,876,788.13	0.08
ブルンディ	3,816,160.82	0.08
アルメニア	3,714,174.01	0.07
マーシャル諸島	2,811,622.77	0.06
カメルーン	2,663,577.39	0.05
ホンデュラス	2,346,172.57	0.05
ナミビア	2,256,000.00	0.04
バハマ	2,241,250.00	0.04
クウェート	2,027,326.00	0.04
国際機関	1,947,184.27	0.04
パプアニューギニア	1,672,867.63	0.03
小計	4,681,327,025.45	92.22
ポートフォリオ合計	4,681,327,025.45	92.22
現金・その他資産(負債控除後)	395,015,744.05	7.78
資産総額	5,076,342,769.50	100.00
負債総額	30,098,879.43	0.59
合計 (純資産総額)	5,046,243,890.07 (約687,954百万円)	99.41

(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)

(2023年 2 月末日現在)

資産の種類	国・地域名	時価合計 (米ドル)	投資比率 (%)
債券	米国	4,126,605,912.43	73.35
	イギリス	273,867,565.77	4.87
	カナダ	193,894,270.19	3.45
	日本	193,390,915.45	3.44
	オランダ	123,625,335.72	2.20
	フランス	82,548,716.35	1.47
	アイルランド	81,940,129.82	1.46
	オーストラリア	81,779,494.54	1.45
	スイス	43,576,638.06	0.77
	ノルウェー	36,680,958.12	0.65
	スペイン	27,612,796.33	0.49
	ルクセンブルグ	26,955,441.05	0.48
	ニュージーランド	26,120,419.11	0.46
	イタリア	22,329,248.24	0.40
	フィンランド	11,690,920.51	0.21
	スウェーデン	8,652,710.05	0.15
	デンマーク	8,344,160.55	0.15
	メキシコ	7,085,385.63	0.13
	ブラジル	6,782,677.00	0.12
	チリ	6,540,011.62	0.12
	ペルー	6,353,461.38	0.11
	中国	5,757,392.07	0.10
	ケイマン諸島	5,659,126.09	0.10
	韓国	5,574,033.40	0.10
	英領ヴァージン諸島	5,461,546.20	0.10
	ガーンジー	5,133,926.20	0.09
	ジャージー	4,264,007.62	0.08
	多国籍	3,937,603.13	0.07
	アラブ首長国連邦	3,459,799.00	0.06
	香港	2,968,773.75	0.05
	バミューダ	2,730,591.25	0.05
	ドイツ	2,381,856.78	0.04
	コロンビア	2,200,019.25	0.04
カタール	852,673.50	0.02	
カザフスタン	797,250.00	0.01	
ベルギー	723,341.47	0.01	
小計	5,448,279,107.63	96.85	

モーゲージ 担保証券/ 資産担保証券/ その他割引債	米国	12,088,879.59	0.21
	ケイマン諸島	9,755,487.97	0.17
	アイルランド	6,893,309.28	0.12
	小計	28,737,676.84	0.51
短期金融商品	米国	31,963,676.89	0.57
株式	米国	2,220,025.24	0.04
	バミューダ	1,622,730.45	0.03
	小計	3,842,755.69	0.07
ポートフォリオ合計		5,512,823,217.05	98.00
現金・その他資産(負債控除後)		112,733,229.83	2.00
資産総額		5,625,556,446.88	100.00
負債総額		67,602,430.44	1.20
合計 (純資産総額)		5,557,954,016.44 (約757,716百万円)	98.80

(ハイ・イールド)

(2023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	1,044,820,494.23	51.10
	フランス	134,373,184.94	6.57
	オランダ	130,926,364.59	6.40
	ドイツ	94,434,748.09	4.62
	イギリス	86,174,207.55	4.21
	ルクセンブルグ	83,891,518.84	4.10
	イタリア	83,595,878.48	4.09
	スペイン	59,629,003.75	2.92
	カナダ	58,812,672.26	2.88
	スウェーデン	26,605,772.60	1.30
	アイルランド	17,082,836.11	0.84
	オーストラリア	15,999,263.05	0.78
	イスラエル	13,218,749.42	0.65
	リベリア	9,833,446.43	0.48
	ケイマン諸島	9,418,324.02	0.46
	パナマ	7,907,337.60	0.39
	メキシコ	7,353,722.79	0.36
	スイス	6,212,727.94	0.30
	日本	5,559,233.11	0.27
	ポルトガル	4,969,726.55	0.24
	フィンランド	4,794,321.74	0.23
	ベルギー	4,727,475.15	0.23
	多国籍	4,656,034.61	0.23
	ジャージー	4,342,994.74	0.21
	オーストリア	4,303,882.29	0.21
	デンマーク	3,065,555.68	0.15
	ノルウェー	2,968,804.73	0.15
	ルーマニア	2,845,540.22	0.14
	ポーランド	2,419,017.73	0.12
	マン島	2,032,694.01	0.10
	ジブラルタル	1,813,455.00	0.09
	バミューダ	1,611,678.58	0.08
	チェコ共和国	1,568,877.18	0.08
アラブ首長国連邦	1,365,653.25	0.07	
ハンガリー	1,291,451.71	0.06	
マルタ	707,741.46	0.03	

	シンガポール	527,500.49	0.03
	小計	1,945,861,890.92	95.18
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	465,622.02	0.02
短期金融商品	米国	7,818,254.56	0.38
株式	ルクセンブルグ	1,741,193.96	0.09
	イギリス	544,137.88	0.03
	米国	387,600.00	0.02
	小計	2,672,931.84	0.13
ワラント	イギリス	27,387.41	0.00
	ルクセンブルグ	2,736.00	0.00
	小計	30,123.41	0.00
ポートフォリオ合計		1,956,848,822.75	95.71
現金・その他資産(負債控除後)		87,620,113.99	4.29
資産総額		2,044,468,936.74	100.00
負債総額		16,740,507.28	0.82
合計 (純資産総額)		2,027,728,429.46 (約276,440百万円)	99.18

(2) 運用実績

純資産等の推移

2023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
2022年3月末日	5,221,323	711,823	5,166,100	704,294	129.77	17,692	9,732
4月末日	4,804,518	655,000	4,731,377	645,029	123.95	16,898	9,288
5月末日	4,708,416	641,898	4,639,728	632,534	123.26	16,804	9,232
6月末日	4,315,274	588,301	4,250,529	579,475	115.66	15,768	8,649
7月末日	4,293,043	585,271	4,272,774	582,507	117.95	16,080	8,792
8月末日	4,215,690	574,725	4,184,912	570,529	118.05	16,094	8,779
9月末日	3,812,297	519,730	3,768,860	513,809	110.28	15,034	8,174
10月末日	3,700,228	504,452	3,666,226	499,817	109.43	14,919	8,085
11月末日	4,054,977	552,815	4,005,778	546,108	117.94	16,079	8,675
12月末日	4,062,959	553,903	4,027,126	549,018	119.27	16,260	8,738
2023年1月末日	5,381,894	733,714	5,282,694	720,190	123.67	16,860	9,023
2月末日	5,076,343	692,058	5,046,244	687,954	120.55	16,435	8,764

(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
2022年3月末日	6,373,276	868,869	6,333,251	863,412	156.18	21,292	10,237
4月末日	6,115,699	833,753	5,927,572	808,106	151.53	20,658	9,919
5月末日	5,937,297	809,432	5,885,498	802,370	152.70	20,818	9,986
6月末日	5,624,553	766,795	5,597,933	763,166	149.42	20,370	9,761
7月末日	5,673,090	773,412	5,627,315	767,172	152.95	20,852	9,972
8月末日	5,449,162	742,884	5,395,660	735,590	149.79	20,421	9,740
9月末日	5,095,305	694,643	5,048,642	688,281	144.61	19,715	9,373
10月末日	5,395,901	735,623	5,343,623	728,496	144.03	19,636	9,305
11月末日	5,710,446	778,505	5,616,336	765,675	148.42	20,234	9,555
12月末日	5,693,547	776,201	5,653,911	770,798	148.23	20,208	9,501
2023年1月末日	5,865,504	799,644	5,784,315	788,576	152.34	20,769	9,721
2月末日	5,625,556	766,932	5,557,954	757,716	149.27	20,350	9,489

(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
2022年3月末日	4,028,313	549,180	3,959,074	539,741	139.27	18,987	10,888
4月末日	3,759,340	512,511	3,665,161	499,671	134.66	18,358	10,519
5月末日	3,609,043	492,021	3,577,399	487,707	134.14	18,287	10,474
6月末日	3,285,599	447,926	3,239,178	441,597	124.89	17,026	9,735
7月末日	3,385,566	461,554	3,357,096	457,673	132.13	18,013	10,275
8月末日	3,235,230	441,059	3,207,814	437,321	130.00	17,723	10,084
9月末日	2,980,509	406,333	2,932,716	399,817	124.56	16,981	9,630
10月末日	2,211,985	301,560	2,098,340	286,067	128.68	17,543	9,918
11月末日	2,160,198	294,500	2,138,311	291,516	132.38	18,047	10,163

12月末日	2,097,469	285,948	2,085,431	284,307	131.67	17,951	10,070
2023年1月末日	2,163,477	294,947	2,124,623	289,650	136.78	18,647	10,415
2月末日	2,044,469	278,722	2,027,728	276,440	135.40	18,459	10,275

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

2023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)
- 7.43	- 10.33

- (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)
- 6.54	- 9.40

- (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)
- 3.03	- 5.98

(注) 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$

a = 2023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 = 2022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、2023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

2023年2月末日現在の株主資本総額は、13,000,000ユーロ(約19億円)

(注)ユーロの円貨換算は、便宜上、2023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=144.61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

2023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15億円)

(注)スイスフランの円貨換算は、便宜上、2023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=145.68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

(2023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

(2023年2月末日現在)

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

(3) 役員状況

UBSファンド・マネジメント(ルクセンブルグ) エス・エイ

(2023年2月末日現在)

氏名	役職名	就任	略歴	所有株式
マイケル・ケール (Michael Kehl)	チェアマン	2022年1月1日	UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー、チューリッヒ、スイス 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	2019年12月5日	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
ウジェーヌ・デル・シオッポ (Eugène Del Cioppo)	ディレクター/ ボード・メンバー	2022年9月2日	UBSファンド・マネジメント(スイス) エイ・ジー、バーゼル、スイス 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	2022年1月1日	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	2022年3月8日	UBSアセット・マネジメント(ドイツランド) ゲーエムベーハー、 フランクフルト、ドイツ インスティテューショナル・クライアント・カバレッジ	該当なし

ユービーエス・スイス・エイ・ジー

(2023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 (2021年12月31日現在)
マーカス・ロナー (Markus Ronner)	チェアマン	2022年4月5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
バーバラ・ランバート (Barbara Lambert)	ディレクター/ ボード・メンバー	2022年4月5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・エッケハート・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	非公開
ガブリエラ・フーパー (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。

2023年2月末日現在、管理会社は以下のとおり、441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	403	466,253,095.64オーストラリア・ドル
			2,858,492,639.23カナダ・ドル
			13,732,504,469.69スイス・フラン
			5,427,007,368.01中国元
			485,019,908.93デンマーク・クローネ
			54,588,939,711.56ユーロ
			2,012,079,494.26英ポンド
			309,713,095.51香港ドル
			461,587,916,627.03日本円
			30,438,500.52シンガポール・ドル
114,702,487,834.31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	38	1,057,958,740.71オーストラリア・ドル
			191,591,624.68スイス・フラン
			510,788,416.88ユーロ
			975,470,948.51英ポンド
			19,428,534,373日本円
			18,500,696,777.26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。

2023年2月末日現在、ユービーエス・スイス・エイ・ジーは42本のサブ・ファンドを運用しており、そのうち運用資産額上位10位のサブ・ファンドは、以下のとおりである。

	名称	基本的性格	設定日	純資産総額 (ユーロ)
1	UBS(Lux)Equity Sicav - Long Term Themes(USD)	変動資本を有する 投資法人	2016年1月28日	4,587,901,703
2	UBS(Lux)Strategy Fund - Balanced Sustainable(CHF)	契約型投資信託	1994年7月1日	1,162,401,799
3	UBS(Lux)Strategy Fund - Yield Sustainable(CHF)	契約型投資信託	1991年9月10日	1,159,125,718
4	Global Opportunities Access - Sustainable Equities	変動資本を有する 投資法人	2019年5月13日	1,140,645,269
5	Global Opportunities Access - Sustainable Bonds	変動資本を有する 投資法人	2019年5月13日	1,113,028,961
6	Global Opportunities Access - High Yield and EM Bonds	変動資本を有する 投資法人	2014年11月3日	838,871,487
7	UBS(Lux)Strategy Fund - Yield Sustainable(USD)	契約型投資信託	1991年9月10日	690,511,843
8	UBS(Lux)Strategy Fund - Balanced Sustainable(USD)	契約型投資信託	1994年7月1日	649,679,680
9	UBS(Lux)Strategy Fund - Yield Sustainable(EUR)	契約型投資信託	1991年9月10日	617,813,599
10	Global Opportunities Access - Corporate Bonds	変動資本を有する 投資法人	2015年2月18日	609,247,424

(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
 - 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
- 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 . ファンドの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、2023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 = 136.33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

	2023年1月31日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	5,614,455,719.79	765,418,748
投資有価証券、未実現評価(損)益	(815,520,941.57)	(111,179,970)
投資有価証券合計(注1)	4,798,934,778.22	654,238,778
現金預金、要求払預金および預託金勘定	433,302,677.96 *	59,072,154
その他の流動資産(委託証拠金)	16,247,640.23	2,215,041
投資有価証券売却未収金(注1)	33,517,191.54	4,569,399
発行未収金	2,913,807.12	397,239
有価証券に係る未収利息	73,202,960.93	9,979,760
前払費用	38,365.51	5,230
その他の未収金	15,672,956.94	2,136,694
金融先物に係る未実現利益(注1)	7,711,459.73	1,051,303
先渡為替契約に係る未実現利益(注1)	351,963.01	47,983
資産合計	5,381,893,801.19	733,713,582
負 債		
スワップに係る未実現損失(注1)	(1,128,790.13)	(153,888)
当座借越	(3,511,170.83)	(478,678)
投資有価証券購入未払金(注1)	(83,365,927.54)	(11,365,277)
買戻未払金	(7,424,415.06)	(1,012,171)
その他の未払金	(97,724.34)	(13,323)
報酬引当金(注2)	(3,334,805.25)	(454,634)
年次税引当金(注3)	(146,166.00)	(19,927)
その他の手数料および報酬に係る引当金(注2)	(190,801.70)	(26,012)
引当金合計	(3,671,772.95)	(500,573)
負債合計	(99,199,800.85)	(13,523,909)
期末現在純資産	5,282,694,000.34	720,189,673

* 2023年1月31日現在、1,610,000.00米ドルの現金が取引相手方であるモルガン・スタンレーに対する担保および2,899,424.16米ドルの現金が取引相手方であるUBSヨーロッパSEに対する担保となっている。

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - U S マルチ・クレジット・サステナブル

純資産計算書

	2023年1月31日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	6,163,243,445.20	840,234,979
投資有価証券、未実現評価(損)益	(480,717,801.17)	(65,536,258)
投資有価証券合計(注1)	5,682,525,644.03	774,698,721
現金預金、要求払預金および預託金勘定	79,399,986.49 *	10,824,600
その他の流動資産(委託証拠金)	3,331,630.61	454,201
投資有価証券売却未収金(注1)	38,660,838.05	5,270,632
発行未収金	1,583,038.86	215,816
有価証券に係る未収利息	49,665,120.42	6,770,846
前払費用	37,853.88	5,161
金融先物に係る未実現利益(注1)	2,547,056.17	347,240
先渡為替契約に係る未実現利益(注1)	7,752,976.06	1,056,963
資産合計	5,865,504,144.57	799,644,180
負 債		
当座借越	(1,381,781.28)	(188,378)
投資有価証券購入未払金(注1)	(71,647,488.94)	(9,767,702)
買戻未払金	(5,027,173.47)	(685,355)
その他の未払金	(77,008.83)	(10,499)
報酬引当金(注2)	(2,693,662.37)	(367,227)
年次税引当金(注3)	(191,153.63)	(26,060)
その他の手数料および報酬に係る引当金(注2)	(170,992.25)	(23,311)
引当金合計	(3,055,808.25)	(416,598)
負債合計	(81,189,260.77)	(11,068,532)
期末現在純資産	5,784,314,883.80	788,575,648

* 2023年1月31日現在、220,000.00米ドルの現金が取引相手方であるパークレイズ・ロンドン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 - ハイ・イールド

純資産計算書

2023年1月31日現在

	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	2,298,089,614.83	313,298,557
投資有価証券、未実現評価(損)益	(241,531,456.37)	(32,927,983)
投資有価証券合計(注1)	2,056,558,158.46	280,370,574
現金預金、要求払預金および預託金勘定	53,351,018.24 *	7,273,344
その他の流動資産(委託証拠金)	2,075,514.54	282,955
投資有価証券売却未収金(注1)	18,391,382.47	2,507,297
発行未収金	750,263.38	102,283
有価証券に係る未収利息	32,068,200.28	4,371,858
分配に係る未収金	3,828.13	522
前払費用	22,291.60	3,039
スワップに係る未実現利益(注1)	256,132.54	34,919
資産合計	2,163,476,789.64	294,946,791
負 債		
金融先物に係る未実現損失(注1)	(255,389.73)	(34,817)
先渡為替契約に係る未実現損失に係る未実現損失(注1)	(6,614,043.11)	(901,692)
当座借越	(310,902.45)	(42,385)
当座借越に係る未払利息	(1,384.20)	(189)
投資有価証券購入未払金(注1)	(24,480,399.47)	(3,337,413)
買戻未払金	(5,157,081.68)	(703,065)
その他の未払金	(43,604.65)	(5,945)
報酬引当金(注2)	(1,645,951.11)	(224,393)
年次税引当金(注3)	(70,429.31)	(9,602)
その他の手数料および報酬に係る引当金(注2)	(274,128.48)	(37,372)
引当金合計	(1,990,508.90)	(271,366)
負債合計	(38,853,314.19)	(5,296,872)
期末現在純資産	2,124,623,475.45	289,649,918

* 2023年1月31日現在、3,260,000.00米ドルの現金が取引相手方であるモルガン・スタンレー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2022年8月1日 至2023年1月31日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	3,668,231.86	500,090
有価証券に係る利息	110,728,722.11	15,095,647
スワップに係る受取利息(注1)	64,873.07	8,844
貸付有価証券に係る純収益(注9)	1,660,571.55	226,386
その他の収益	9,160,751.89	1,248,885
収益合計	<u>125,283,150.48</u>	<u>17,079,852</u>
費 用		
スワップに係る支払利息(注1)	(9,037.78)	(1,232)
定率報酬(注2)	(15,537,199.70)	(2,118,186)
年次税(注3)	(207,111.31)	(28,235)
当座借越に係る利息	(354,660.49)	(48,351)
その他の手数料および報酬(注2)	(101,378.08)	(13,821)
その他の費用	(918.75)	(125)
費用合計	<u>(16,210,306.11)</u>	<u>(2,209,951)</u>
投資純(損)益	<u>109,072,844.37</u>	<u>14,869,901</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	(185,530,070.14)	(25,293,314)
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	(2,109,082.49)	(287,531)
金融先物に係る実現(損)益	(14,788,759.30)	(2,016,152)
先渡為替契約に係る実現(損)益	96,554,197.82	13,163,234
スワップに係る実現(損)益	104,216.16	14,208
外国為替に係る実現(損)益	1,558,755.12	212,505
実現(損)益合計	<u>(104,210,742.83)</u>	<u>(14,207,051)</u>
当期実現純(損)益	<u>4,862,101.54</u>	<u>662,850</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	279,337,706.69	38,082,110
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	(897,659.00)	(122,378)
金融先物に係る未実現評価(損)益	10,317,258.70	1,406,552
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	(38,564,249.91)	(5,257,464)
スワップに係る未実現評価(損)益	596,427.81	81,311
未実現評価(損)益の変動合計	<u>250,789,484.29</u>	<u>34,190,130</u>
運用の結果による純資産の純増(減)	<u>255,651,585.83</u>	<u>34,852,981</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 - U S マルチ・クレジット・サステナブル
運用計算書

自2022年8月1日 至2023年1月31日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	1,246,497.27	169,935
有価証券に係る利息	94,350,346.04	12,862,783
分配金	143,521.92	19,566
貸付有価証券に係る純収益(注9)	139,083.61	18,961
その他の収益	715,502.90	97,545
収益合計	96,594,951.74	13,168,790
費 用		
定率報酬(注2)	(13,689,060.78)	(1,866,230)
年次税(注3)	(273,553.26)	(37,294)
当座借越に係る利息	(26,161.64)	(3,567)
その他の手数料および報酬(注2)	(83,384.80)	(11,368)
その他の費用	(626.07)	(85)
費用合計	(14,072,786.55)	(1,918,543)
投資純(損)益	82,522,165.19	11,250,247
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	(80,468,307.20)	(10,970,244)
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	840,284.88	114,556
金融先物に係る実現(損)益	(2,196,103.89)	(299,395)
先渡為替契約に係る実現(損)益	138,583,790.97	18,893,128
外国為替に係る実現(損)益	2,518,243.23	343,312
実現(損)益合計	59,277,907.99	8,081,357
当期実現純(損)益	141,800,073.18	19,331,604
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	(6,403,660.93)	(873,011)
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	53,666.58	7,316
金融先物に係る未実現評価(損)益	1,677,121.29	228,642
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	(44,640,604.52)	(6,085,854)
未実現評価(損)益の変動合計	(49,313,477.58)	(6,722,906)
運用の結果による純資産の純増(減)	92,486,595.60	12,608,698

添付の注記は当財務書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2022年8月1日 至2023年1月31日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	821,253.68	111,962
有価証券に係る利息	74,146,986.57	10,108,459
スワップに係る受取利息(注1)	65,770.95	8,967
分配金	7,656.26	1,044
貸付有価証券に係る純収益(注9)	1,020,574.99	139,135
その他の収益	2,734,536.82	372,799
収益合計	78,796,779.27	10,742,365
費 用		
スワップに係る支払利息(注1)	(23,319.62)	(3,179)
定率報酬(注2)	(8,506,267.15)	(1,159,659)
年次税(注3)	(117,599.29)	(16,032)
当座借越に係る利息	(147,486.18)	(20,107)
その他の手数料および報酬(注2)	(93,014.88)	(12,681)
その他の費用	(801.30)	(109)
費用合計	(8,888,488.42)	(1,211,768)
投資純(損)益	69,908,290.85	9,530,597
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	(304,758,736.40)	(41,547,759)
金融先物に係る実現(損)益	4,826,288.56	657,968
先渡為替契約に係る実現(損)益	13,563,748.65	1,849,146
スワップに係る実現(損)益	30,468.35	4,154
外国為替に係る実現(損)益	20,888,308.79	2,847,703
実現(損)益合計	(265,449,922.05)	(36,188,788)
当期実現純(損)益	(195,541,631.20)	(26,658,191)
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	279,596,053.91	38,117,330
金融先物に係る未実現評価(損)益	1,319,183.11	179,844
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	(34,771,746.81)	(4,740,432)
スワップに係る未実現評価(損)益	547,777.77	74,679
未実現評価(損)益の変動合計	246,691,267.98	33,631,421
運用の結果による純資産の純増(減)	51,149,636.78	6,973,230

添付の注記は当財務書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2022年8月1日 至2023年1月31日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	4,272,773,950.34	582,507,273
発行額	1,362,031,723.28	185,685,785
買戻額	(587,824,970.18)	(80,138,178)
純発行(買戻)合計	774,206,753.10	105,547,607
支払分配金	(19,938,288.93)	(2,718,187)
投資純(損)益	109,072,844.37	14,869,901
実現(損)益合計	(104,210,742.83)	(14,207,051)
未実現評価(損)益の変動合計	250,789,484.29	34,190,130
運用の結果による純資産の純増(減)	255,651,585.83	34,852,981
期末現在純資産	5,282,694,000.34	720,189,673

発行済投資証券数の変動表

	自2022年8月1日 至2023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	14,827,856.4230	
期中発行投資証券数	3,695,229.2640	
期中買戻投資証券数	(1,902,898.1590)	
期末現在発行済投資証券数	<u>16,620,187.5280</u>	
クラスF - a c c円ヘッジ		
期首現在発行済投資証券数	175,872.0000	
期中発行投資証券数	8,900.0000	
期中買戻投資証券数	(9,982.0000)	
期末現在発行済投資証券数	<u>174,790.0000</u>	

最重要数値

日付	ISIN	2023年1月31日	2022年7月31日	2021年7月31日
純資産額(米ドル)		5,282,694,000.34	4,272,773,950.34	5,915,111,579.13
クラスF - a c c	LU0985399996			
発行済投資証券数(口)		16,620,187.5280	14,827,856.4230	14,882,210.4190
1口当たり純資産価格(米ドル)		123.67	117.95	145.38
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) ¹		123.67	117.95	145.38
クラスF - a c c円ヘッジ	LU1749433899			
発行済投資証券数(口)		174,790.0000	175,872.0000	152,362.1180
1口当たり純資産価格(日本円)		9,023	8,792	10,937
1口当たり発行・買戻価格(日本円) ¹		9,023	8,792	10,937

¹ 注記1を参照

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

組入証券の構造

地域別分類	純資産割合%	地域別分類	純資産割合%
メキシコ	7.19	イラク	0.21
コロンビア	3.73	ベネズエラ	0.21
チリ	3.48	オーストリア	0.20
インドネシア	3.44	マカオ	0.20
ケイマン諸島	3.33	ザンビア	0.18
アラブ首長国連邦	2.85	セネガル	0.17
サウジアラビア	2.74	多国籍	0.15
トルコ	2.50	トリニダード・トバゴ共和国	0.14
ペルー	2.38	レバノン	0.13
オランダ	2.36	ノルウェー	0.12
ドミニカ共和国	2.24	ジャマイカ	0.11
オマーン	2.15	エチオピア	0.11
ルクセンブルグ	2.06	ジョージア	0.08
ルーマニア	1.97	ブルンジ	0.07
カタール	1.84	ベトナム	0.07
南アフリカ	1.84	アルメニア	0.07
エジプト	1.78	チュニジア	0.07
ハンガリー	1.72	カメルーン	0.06
英領ヴァージン諸島	1.66	マーシャル諸島	0.05
ブラジル	1.64	ホンジュラス	0.05
香港	1.56	ナミビア	0.04
韓国	1.48	バハマ	0.04
パナマ	1.48	クウェート	0.04
アルゼンチン	1.43	国際機関	0.04
インド	1.43	バプアニューギニア	0.03
米国	1.27	合計	90.84
アンゴラ	1.27		
パラグアイ	1.26		
ナイジェリア	1.13	業種別分類	純資産割合%
カザフスタン	1.06	国債および中央政府債	40.39
シンガポール	1.04	金融および持株会社	12.62
アゼルバイジャン	1.01	石油	10.00
モーリシャス	0.98	銀行および金融機関	6.94
イギリス	0.97	エネルギー・水道	3.41
エクアドル	0.91	通信	2.11
イスラエル	0.89	交通・運輸	1.88
グアテマラ	0.89	化学	1.63
パーレーン	0.84	モーゲージおよび貸付機関	1.33
クロアチア	0.77	鉱業・石炭・鋼鉄	0.89
コートジボワール	0.75	不動産	0.83
モロッコ	0.74	食品・清涼飲料	0.75
フィリピン	0.72	宿泊・仕出し・レジャー	0.69
マレーシア	0.67	各種サービス	0.62
バミューダ	0.64	電気装置・部品	0.55
中国	0.63	医薬品・化粧品・医療品	0.51
スリランカ	0.59	建築業・資材	0.50
ウクライナ	0.57	非分類会社	0.48
モンゴル	0.55	保険	0.46
ガボン	0.52	国際機関	0.44
コスタリカ	0.49	インターネット、ソフトウェア・ITサービス	0.43
マン島	0.48	貴金属および宝石	0.41
タイ	0.48	航空宇宙産業	0.34
ガーナ	0.46	林業、紙・パルプ製品	0.31
セルビア	0.45	非鉄金属	0.31
ブルガリア	0.44	州、連邦州	0.30
スペイン	0.39	電子工学・半導体	0.27
ロシア連邦 (CIS)	0.37	投資信託	0.23
ヨルダン	0.35	市および地方自治体	0.19
エルサルバドル	0.34	たばこ・アルコール	0.19
マケドニア	0.34	機械工学・産業機器	0.15
パキスタン	0.32	小売り・百貨店	0.14
ウルグアイ	0.31	自動車	0.14
ポーランド	0.31	各種貿易会社	0.13
カナダ	0.30	包装業	0.10
ケニア	0.25	コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置プロバイダー	0.06
ベナン共和国	0.25	農業・漁業	0.04
アイルランド	0.24	その他消費財	0.04
ウズベキスタン	0.23	グラフィックデザイン・出版・メディア	0.02
トーゴ	0.23	写真および光学	0.01
ジャージー	0.22	合計	90.84

マルチ・マネージャー・アクセス - U S マルチ・クレジット・サステナブル

純資産変動計算書

	自2022年8月1日 至2023年1月31日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	5,627,315,310.44	767,171,896
発行額	725,736,492.47	98,939,656
買戻額	(648,686,094.20)	(88,435,375)
純発行(買戻)合計	77,050,398.27	10,504,281
支払分配金	(12,537,420.51)	(1,709,227)
投資純(損)益	82,522,165.19	11,250,247
実現(損)益合計	59,277,907.99	8,081,357
未実現評価(損)益の変動合計	(49,313,477.58)	(6,722,906)
運用の結果による純資産の純増(減)	92,486,595.60	12,608,698
期末現在純資産	5,784,314,883.80	788,575,648

発行済投資証券数の変動表

	自2022年8月1日 至2023年1月31日	
	(口)	
クラスF - a c c		
期首現在発行済投資証券数	16,641,190.1710	
期中発行投資証券数	1,492,715.2200	
期中買戻投資証券数	(1,915,070.4200)	
期末現在発行済投資証券数	16,218,834.9710	
クラスF - a c c円ヘッジ		
期首現在発行済投資証券数	234,272.0000	
期中発行投資証券数	15,500.0000	
期中買戻投資証券数	(18,882.0000)	
期末現在発行済投資証券数	230,890.0000	

最重要数値

日付	ISIN	2023年1月31日	2022年7月31日	2021年7月31日
純資産額(米ドル)		5,784,314,883.80	5,627,315,310.44	5,573,488,091.35
クラスF - a c c	LU0313364738			
発行済投資証券数(口)		16,218,834.9710	16,641,190.1710	13,589,831.6990
1口当たり純資産価格(米ドル)		152.34	152.95	167.01
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) ¹		152.34	152.95	167.01
クラスF - a c c円ヘッジ	LU1749433972			
発行済投資証券数(口)		230,890.0000	234,272.0000	358,650.0000
1口当たり純資産価格(日本円)		9,721	9,972	10,981
1口当たり発行・買戻価格(日本円) ¹		9,721	9,972	10,981

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・サステナブル

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%
米国	74.62	銀行および金融機関	29.18
イギリス	4.88	金融および持株会社	20.89
カナダ	3.62	国債および中央政府債	3.96
日本	3.24	不動産	3.87
オランダ	2.11	医薬品・化粧品・医療品	3.68
アイルランド	1.49	インターネット、ソフトウェア・ITサービス	3.59
フランス	1.45	通信	3.25
オーストラリア	1.36	エネルギー・水道	3.18
スイス	0.78	ヘルスケア、社会事業	2.73
ノルウェー	0.65	保険	2.04
ルクセンブルグ	0.50	石油	1.95
スペイン	0.49	コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置プロバイダー	1.94
ケイマン諸島	0.44	電子工学・半導体	1.61
イタリア	0.39	小売り・百貨店	1.57
ニュージーランド	0.39	交通・運輸	1.56
フィンランド	0.20	食品・清涼飲料	1.54
スウェーデン	0.15	グラフィックデザイン・出版・メディア	1.29
デンマーク	0.15	その他消費財	1.10
メキシコ	0.13	電気装置・部品	0.99
ブラジル	0.12	バイオテクノロジー	0.98
チリ	0.12	自動車	0.71
ベルー	0.11	公的、非営利機関	0.63
中国	0.10	モーゲージおよび貸付機関	0.60
英領ヴァージン諸島	0.10	建築業・資材	0.58
韓国	0.10	機械工学・産業機器	0.53
ガーンジー	0.09	宿泊・仕出し・レジャー	0.53
ジャージー	0.08	化学	0.48
バミューダ	0.08	各種貿易会社	0.44
多国籍	0.07	包装業	0.43
アラブ首長国連邦	0.06	各種サービス	0.37
香港	0.05	鉱業・石炭・鋼鉄	0.30
ドイツ	0.04	農業・漁業	0.29
コロンビア	0.04	繊維・衣服・革製品	0.26
カタール	0.02	非分類会社	0.23
カザフスタン	0.01	投資信託	0.19
ベルギー	0.01	環境サービスおよびリサイクル	0.18
合計	98.24	市および地方自治体	0.17
		各種資本財	0.12
		林業、紙・パルプ製品	0.11
		貴金属および宝石	0.09
		州、連邦州	0.07
		ゴム・タイヤ	0.03
		合計	98.24

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2022年8月1日 至2023年1月31日

	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	3,357,096,459.47	457,672,960
発行額	79,375,025.44	10,821,197
買戻額	(1,354,119,031.51)	(184,607,048)
純発行(買戻)合計	(1,274,744,006.07)	(173,785,850)
支払分配金	(8,878,614.73)	(1,210,422)
投資純(損)益	69,908,290.85	9,530,597
実現(損)益合計	(265,449,922.05)	(36,188,788)
未実現評価(損)益の変動合計	246,691,267.98	33,631,421
運用の結果による純資産の純増(減)	51,149,636.78	6,973,230
期末現在純資産	2,124,623,475.45	289,649,918

発行済投資証券数の変動表

自2022年8月1日 至2023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	11,763,361.9210
期中発行投資証券数	204,425.1880
期中買戻投資証券数	(5,174,653.1420)
期末現在発行済投資証券数	<u>6,793,133.9670</u>
クラスF - a c c円ヘッジ	
期首現在発行済投資証券数	159,141.0000
期中発行投資証券数	7,300.0000
期中買戻投資証券数	(11,463.0000)
期末現在発行済投資証券数	<u>154,978.0000</u>

最重要数値

日付	ISIN	2023年1月31日	2022年7月31日	2021年7月31日
純資産額(米ドル)		2,124,623,475.45	3,357,096,459.47	5,180,776,616.51
クラスF - a c c	LU1344275315			
発行済投資証券数(口)		6,793,133.9670	11,763,361.9210	14,749,235.0260
1口当たり純資産価格(米ドル)		136.78	132.13	143.96
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) ¹		136.78	132.13	143.96
クラスF - a c c円ヘッジ	LU1749434194			
発行済投資証券数(口)		154,978.0000	159,141.0000	118,296.0000
1口当たり純資産価格(日本円)		10,415	10,275	11,293
1口当たり発行・買戻価格(日本円) ¹		10,415	10,275	11,293

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%
米国	51.85	金融および持株会社	35.37
オランダ	6.49	通信	6.97
フランス	6.49	銀行および金融機関	5.15
ドイツ	4.74	石油	4.99
イギリス	4.40	宿泊・仕出し・レジャー	4.50
ルクセンブルグ	4.17	インターネット、ソフトウェア・ITサービス	3.48
イタリア	4.12	エネルギー・水道	3.24
カナダ	2.85	交通・運輸	2.55
スペイン	2.85	各種サービス	2.43
スウェーデン	1.31	ヘルスケア、社会事業	2.37
アイルランド	0.83	自動車	2.31
オーストラリア	0.78	建築業・資材	2.24
イスラエル	0.67	不動産	2.09
リベリア	0.63	化学	2.05
デンマーク	0.56	医薬品・化粧品・医療品	1.99
ケイマン諸島	0.44	包装業	1.37
パナマ	0.36	その他消費財	1.36
メキシコ	0.36	機械工学・産業機器	1.22
スイス	0.32	食品・清涼飲料	1.12
日本	0.24	小売り・百貨店	1.12
フィンランド	0.24	航空宇宙産業	1.10
ジャージー	0.24	コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置プロバイダー	0.89
オーストリア	0.23	グラフィックデザイン・出版・メディア	0.89
多国籍	0.22	バイオテクノロジー	0.77
ベルギー	0.22	電子工学・半導体	0.72
ポルトガル	0.22	鉱業・石炭・鋼鉄	0.69
ルーマニア	0.18	電気装置・部品	0.52
ノルウェー	0.14	繊維・衣服・革製品	0.48
ポーランド	0.12	林業、紙・パルプ製品	0.47
バミューダ	0.11	非分類会社	0.37
マン島	0.10	環境サービスおよびリサイクル	0.35
ジブラルタル	0.09	農業・漁業	0.35
ハンガリー	0.06	非鉄金属	0.34
チェコ共和国	0.05	各種資本財	0.30
アラブ首長国連邦	0.05	モーゲージおよび貸付機関	0.23
マルタ共和国	0.04	保険	0.18
シンガポール	0.03	貴金属および宝石	0.10
合計	96.80	たばこ・アルコール	0.06
		ゴム・タイヤ	0.04
		各種貿易会社	0.03
		合計	96.80

マルチ・マネージャー・アクセス

財務書類に対する注記

2023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UCIの投資証券は、その最終純資産価額で評価される。
- 短期金融商品に関して、評価は、純取得価格をベースに以後の利回りを確保しつつ、買戻価格に向けて漸進的に調整される。市場環境に重大な変動が生じた場合、異なる投資対象の評価基準は、新たな市場利回りに沿ってもたらされる。

主に短期金融商品に投資するサブ・ファンドに関して、残存する満期までの期間が12か月を超えない証券は、短期金融商品に関する指針に従って評価される。

- 関連するサブ・ファンドの会計通貨以外の通貨で表示され、為替取引によるヘッジを行わない証券およびその他の投資対象は、外部の価格提供会社から入手した為替相場の仲値(売買相場の仲値)で評価される。
- 定期預金および信託投資資産は、額面価額に累積利息を付して評価される。
- スワップ取引の価値は、外部のサービス提供会社によって計算され、また別の外部サービス提供会社より入手可能な第二の独立した評価も利用される。かかる計算は、流入および流出の両方のすべてのキャッシュ・フローの正味現在価値に基づいている。特定の場合に、ブルームバーグより入手可能なモデルと市場データに基づいた、内部での算出額、および/またはブローカー・ステイトメントの評価を利用することもできる。評価方法は、各有価証券によって異なり、UBS評価方針に従って決定される。
- 主に短期金融商品に投資するサブ・ファンドに関して、該当する評価日以降、第二評価日まで(同日を含む)にサブ・ファンドが稼得する受取利息は、当該サブ・ファンドの資産の評価に含まれる。したがって、特定の評価日における投資証券1口当たり純資産価格には、二評価日現在の期待利子収益が含まれる。

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

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

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

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

適用する場合、スウィング・プライシングの収益は、損益計算書の「その他の収益」として開示される。

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、運用計算書に記帳される。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 категория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2023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、2023年1月31日現在の結合財務書類の換算に用いられた。

為替レート

1ユーロ = 1.086050米ドル

j) 有価証券売却未収金、有価証券購入未払金

「有価証券売却未収金」のポジションには、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

2023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・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・サステナブル 米ドル F - a c c	92,763,939.18
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	8,635,166.55
合計	101,399,105.73

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・サステナブル 米ドル F - a c c	153,884,422.92
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	27,041,840.37
合計	180,926,263.29

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・サステナブル 米ドル F - a c c	15,829,040.04
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	10,431,561.15
合計	26,260,601.19

2023年1月31日現在、クロス・サブ・ファンド投資の総額は284,136,062.05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19,997,520,411.06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）	実効定率報酬（年率）
- エマージング・マーケット・デッド		
F - a c c 円ヘッジ	1.25%	0.75%
- エマージング・マーケット・デッド F - a c c	1.25%	0.72%
- ハイ・イールド F - a c c 円ヘッジ	1.25%	0.65%
- ハイ・イールド F - a c c	1.25%	0.61%
- U S マルチ・クレジット・サステナブル		
F - a c c 円ヘッジ	0.85%	0.51%
- U S マルチ・クレジット・サステナブル		
F - a c c	0.85%	0.48%

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

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

本投資法人の運用費用および管理事務費用

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

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

- ついて管轄権を有するあらゆる機関(各国の証券業協会を含む。)に対する登録届出書、目論見書および説明書等)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 - 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5 - ソフト・コミッション・アレンジメント

2022年8月1日から2023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6 - 金融先物およびスワップ契約

2023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	798,894,775.53米ドル	492,163,977.84米ドル
- ハイ・イールド	77,899,294.11米ドル	123,485,125.82米ドル
- US マルチ・クレジット・サステナブル	361,602,273.97米ドル	111,369,399.24米ドル
<hr/>		
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)
- US マルチ・クレジット・サステナブル	- 米ドル	18,789,562.50米ドル
<hr/>		
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)
- エマージング・マーケット・デッド	- 米ドル	6,640,000.00米ドル

マルチ・マネージャー・アクセス	指数に係るスワップ	指数に係るスワップ
	およびフォワード・スワップ (購入)	およびフォワード・スワップ (売却)
- ハイ・イールド	- 米ドル	9,212,690.52米ドル

注7 - 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	0.74%
- エマージング・マーケット・デッド F - a c c 円ヘッジ	0.80%
- ハイ・イールド F - a c c	0.63%
- ハイ・イールド F - a c c 円ヘッジ	0.69%
- US マルチ・クレジット・サステナブル F - a c c	0.50%
- US マルチ・クレジット・サステナブル 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、金利コスト、貸付証券コストおよび為替ヘッジに関連して発生したその他の費用は、TERに含まれない。

注8 - 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) に自ら拘束されるものと認めることができる。

注9 - 貸付有価証券

本投資法人は第三者に組入証券の一部を貸付けることができる。一般的に、貸付はクリアストリーム・インターナショナルもしくはユーロクリアのような公認の決済機関、または同種の業務を専門とする第一級の金融機関の仲介により、それらの機関が設定した方法に従ってのみ行われる。担保は、貸付有価証券に関連して受領される。担保は、一般的に借入れられた有価証券の少なくとも時価に相当する金額の高格付け証券から構成される。

UBSヨーロッパSE ルクセンブルグ支店は、有価証券貸付代理人としての役割を担う。

貸付有価証券

	2023年1月31日現在の貸付有価証券 からの取引相手方エクスポージャー*		2023年1月31日現在の 担保の内訳(%)		
	貸付有価証券の 時価	担保 (ユービーエス・ スイス・エイ・ジー)	株式	債券	現金
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	1,146,922,491.84米ドル	1,243,621,045.41米ドル	21.27	78.73	0.00
- ハイ・イールド	304,845,928.94米ドル	330,658,949.19米ドル	20.26	79.74	0.00
- US マルチ・クレジット・サステナブル	190,830,606.09米ドル	205,103,361.08米ドル	20.84	79.16	0.00

* 取引相手方エクスポージャーの価格および為替レートの情報は、2023年1月31日に証券貸付業者から直接入手されるため、2023年1月31日現在の財務書類の作成に使用された終値および為替レートとは異なる場合がある。

	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 (米ドル)	マルチ・マネージャー・ アクセス - ハイ・イールド (米ドル)	マルチ・マネージャー・ アクセス - US マルチ・クレジット・ サステナブル (米ドル)
貸付証券収益	2,767,619.25	1,700,958.32	231,806.02
貸付証券コスト*			
ユービーエス・ スイス・エイ・ジー	830,285.78米ドル	510,287.50米ドル	69,541.81米ドル
UBSヨーロッパSE ルクセンブルグ支店	276,761.92米ドル	170,095.83米ドル	23,180.60米ドル
純貸付証券収益	1,660,571.55米ドル	1,020,574.99米ドル	139,083.61米ドル

* 2022年6月1日より、総収益の30%は証券貸付サービス提供者を務めるユービーエス・スイス・エイ・ジーが費用/報酬として受領し、10%は証券貸付業者を務めるUBSヨーロッパSE ルクセンブルグ支店が受領する。

[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

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
ノート、固定利付債			
EUR			
EUR ARGENTINA, REPUBLIC OF 0.12500% 20-09.07.30	1 008 800.00	317 931.53	0.01
EUR ARGENTINA, REPUBLIC OF 0.50000% 20-09.07.29	34 392.00	10 442.06	0.00
EUR BANQUE OUEST AFRICAINE DE DEV-REG-S 2.75000% 21-22.01.33	4 717 000.00	3 942 582.19	0.07
EUR BENIN GOVT INTERNATIONAL BD-REG-S 4.87500% 21-19.01.32	4 936 000.00	4 221 584.96	0.08
EUR BULGARIA, REPUBLIC OF-REG-S 1.37500% 20-23.09.50	820 000.00	498 714.16	0.01
EUR BULGARIA, REPUBLIC OF-REG-S 4.12500% 22-23.09.29	4 525 000.00	4 847 725.03	0.09
EUR BULGARIA, REPUBLIC OF-REG-S 4.62500% 22-23.09.34	2 550 000.00	2 762 503.92	0.05
EUR BULGARIA, REPUBLIC OF-REG-S 4.50000% 23-27.01.33	7 835 000.00	8 381 563.72	0.16
EUR BULGARIAN ENERGY HOLDING EAD-REG-S 2.45000% 21-22.07.28	7 442 000.00	6 563 401.04	0.12
EUR CENTRAL BANK OF TUNISIA-REG-S 6.37500% 19-15.07.26	1 271 000.00	824 166.89	0.02
EUR CHILE, REPUBLIC OF 1.87500% 15-27.05.30	850 000.00	808 903.62	0.02
EUR CROATIA, REPUBLIC OF-REG-S 1.12500% 19-19.06.29	13 825 000.00	12 915 406.73	0.24
EUR GOVERNMENT OF BENIN-REG-S 6.87500% 21-19.01.52	1 330 000.00	1 051 105.66	0.02
EUR GTC AURORA LUXEMBOURG SA-REG-S 2.25000% 21-23.06.26	2 105 000.00	1 704 313.83	0.03
EUR HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 5.00000% 22-22.02.27	2 430 000.00	2 681 986.90	0.05
EUR INDONESIA GOVERNMENT INTERNATIONAL 1.10000% 21-12.03.33	3 304 000.00	2 657 142.97	0.05
EUR INDONESIA, REPUBLIC OF 1.40000% 19-30.10.31	5 880 000.00	5 050 108.08	0.10
EUR INDONESIA, REPUBLIC OF 0.90000% 20-14.02.27	599 000.00	578 902.81	0.01
EUR IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 5.87500% 19-17.10.31	5 370 000.00	4 884 374.12	0.09
EUR IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 4.87500% 20-30.01.32	7 557 000.00	6 411 937.38	0.12
EUR MACEDONIA GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.62500% 16-26.07.23	855 000.00	926 715.61	0.02
EUR MACEDONIA GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 2.75000% 18-18.01.25	2 404 000.00	2 438 383.98	0.05
EUR MACEDONIA GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 3.67500% 20-03.06.26	4 807 000.00	4 818 652.89	0.09
EUR MACEDONIA GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 1.62500% 21-10.03.28	11 054 000.00	9 591 401.83	0.18
EUR MEXICO, UNITED STATES OF 1.35000% 20-18.09.27	2 980 000.00	2 931 597.84	0.06
EUR MEXICO, UNITED STATES OF 2.12500% 21-25.10.51	780 000.00	486 722.81	0.01
EUR MEXICO, UNITED STATES OF 2.25000% 21-12.08.36	2 300 000.00	1 814 110.77	0.03
EUR MEXICO, UNITED STATES OF 2.37500% 22-11.02.30	1 817 000.00	1 739 017.20	0.03
EUR MOROCCO GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 2.00000% 20-30.09.30	3 420 000.00	3 022 504.30	0.06
EUR MOROCCO, KINGDOM OF-REG-S 1.50000% 19-27.11.31	1 210 000.00	979 019.77	0.02
EUR NE PROPERTY BV-REG-S 3.37500% 20-14.07.27	2 800 000.00	2 663 293.26	0.05
EUR PERU, REPUBLIC OF 0.12500% 21-11.03.33	10 855 000.00	8 501 395.08	0.16
EUR PERU, REPUBLIC OF 1.95000% 21-17.11.36	3 079 000.00	2 373 785.07	0.05
EUR PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 1.87500% 19-05.11.31	4 013 000.00	3 197 371.53	0.06
EUR PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 0.70000% 20-03.02.29	1 610 000.00	1 461 452.00	0.03
EUR PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 1.75000% 21-28.04.41	3 184 000.00	2 321 819.60	0.04
EUR REPUBLIC OF CAMEROON INTRNTNL BOND-REG-S 5.95000% 21-07.07.32	4 072 000.00	3 357 703.87	0.06
EUR ROMANIA-REG-S 2.62500% 20-02.12.40	1 544 000.00	993 540.26	0.02
EUR SENEGAL, REPUBLIC OF-REG-S 5.37500% 21-08.06.37	1 040 000.00	790 644.40	0.02
EUR SERBIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 1.50000% 19-26.06.29	8 996 000.00	7 369 102.30	0.14
EUR SERBIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 3.12500% 20-15.05.27	584 000.00	565 397.09	0.01
EUR SERBIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 1.65000% 21-03.03.33	2 773 000.00	1 976 938.10	0.04
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 3.75000% 21-09.05.27	650 000.00	635 912.82	0.01
EUR UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 4.37500% 20-27.01.32	2 310 000.00	464 123.47	0.01
EUR UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 6.75000% 19-20.06.28	3 230 000.00	659 493.00	0.01
ユーロ合計		137 194 896.45	2.60
USD			
USD ABENGOA TRANSMISION SUR SA-REG-S 6.87500% 14-30.04.43	3 165 000.00	2 751 172.29	0.05
USD ABJA INVESTMENT CO PTE LTD-REG-S 5.45000% 18-24.01.28	3 780 000.00	3 673 687.50	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

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD ABU DHABI COMMERCIAL BANK-REG-S 3.50000% 22-31.03.27	7 816 000.00	7 441 320.50	0.14
USD ABU DHABI CRUDE OIL PIPELINE LLC-REG-S 3.65000% 17-02.11.29	3 169 000.00	2 978 463.87	0.06
USD ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO PJSC-REG-S 4.87500% 18-23.04.30	1 589 000.00	1 643 919.81	0.03
USD ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO PJSC-REG-S 2.00000% 21-29.04.28	902 000.00	805 486.00	0.02
USD ABU DHABI, GOVERNMENT OF-REG-S 3.12500% 17-11.10.27	6 810 000.00	6 578 034.37	0.12
USD ACCESS BANK PLC-REG-S 6.12500% 21-21.09.26	6 965 000.00	6 129 200.00	0.12
USD ADANI ELECTRICITY MUMBAI LTD-REG-S 3.94900% 20-12.02.30	5 310 000.00	3 908 823.76	0.07
USD ADANI GREEN ENERGY LTD-REG-S 4.37500% 21-08.09.24	700 000.00	519 662.50	0.01
USD ADANI INTERNATIONAL CONTAINER TER-REG-S 3.00000% 20-16.02.31	2 140 000.00	1 515 094.92	0.03
USD ADANI PORTS & SPECIAL ECO ZONE-REG-S 4.20000% 20-04.08.27	6 715 000.00	5 366 963.75	0.10
USD ADANI PORTS & SPECIAL ECO ZONE-REG-S 3.10000% 21-02.02.31	1 608 000.00	1 140 976.50	0.02
USD ADANI PORTS & SPL ECO ZONE LTD-REG-S 3.82800% 21-02.02.32	200 000.00	141 100.00	0.00
USD ADANI PORTS AND SPECIAL ECO ZONE-REG-S 4.37500% 19-03.07.29	8 417 000.00	6 649 430.00	0.13
USD ADANI TRANSMISSION LTD-REG-S 4.25000% 19-21.05.36	790 000.00	481 595.60	0.01
USD AEGEA FINANCE SARL-REG-S 6.75000% 22-20.05.29	6 843 000.00	6 769 095.60	0.13
USD AEROPUERTO INTERNACIONAL DE TOCUM-REG-S 4.00000% 21-11.08.41	1 930 000.00	1 599 246.25	0.03
USD AEROPUERTO INTERNACIONAL DE TOCU-REG-S 5.12500% 21-11.08.61	15 140 000.00	12 280 432.49	0.23
USD AEROPUERTOS DOMINICANOS-REG-S 6.75000% 17-30.03.29	6 760 000.00	6 671 275.00	0.13
USD AES PANAMA GENERATION HOLDING SRL-REG-S 4.37500% 20-31.05.30	17 374 000.00	15 466 117.63	0.29
USD AFRICA FINANCE CORP-REG-S 2.87500% 21-28.04.28	724 000.00	621 525.04	0.01
USD AFRICAN EXPORT-BANK/THE-REG-S 2.63400% 21-17.05.26	2 178 000.00	1 973 812.50	0.04
USD AI CANDELARIA SPAIN SLU-REG-S 7.50000% 18-15.12.28	5 480 000.00	4 902 316.69	0.09
USD AI CANDELARIA SPAIN SLU-REG-S 5.75000% 21-15.06.33	11 037 000.00	8 581 267.50	0.16
USD AIA GROUP LTD-REG-S 3.60000% 19-09.04.29	1 050 000.00	985 365.91	0.02
USD AIA GROUP LTD-REG-S 3.37500% 20-07.04.30	550 000.00	506 936.35	0.01
USD AIA GROUP LTD-REG-S-SUB 3.20000% 20-16.09.40	2 913 000.00	2 223 379.29	0.04
USD AIRPORT AUTHORITY-REG-S 3.25000% 22-12.01.52	2 965 000.00	2 254 571.17	0.04
USD AKBANK TAS-REG-S 6.80000% 20-06.02.26	908 000.00	867 877.75	0.02
USD ALIBABA GROUP HOLDING LTD 4.00000% 17-06.12.37	400 000.00	347 848.00	0.01
USD ALIBABA GROUP HOLDING LTD 4.20000% 17-06.12.47	400 000.00	329 825.00	0.01
USD ALIBABA GROUP HOLDING LTD 3.25000% 21-09.02.61	208 000.00	137 117.76	0.00
USD ALPEK SA DE CV-REG-S 4.25000% 19-18.09.29	6 237 000.00	5 719 329.00	0.11
USD ALPEK SA DE CV-REG-S 3.25000% 21-25.02.31	4 466 000.00	3 720 178.00	0.07
USD ALSEA SAB DE CV-REG-S 7.75000% 21-14.12.26	2 702 000.00	2 725 304.75	0.05
USD ALTICE FINANCING SA-144A 5.00000% 20-15.01.28	2 300 000.00	1 955 667.00	0.04
USD ALTICE FINANCING SA-REG-S 5.00000% 20-15.01.28	400 000.00	340 116.00	0.01
USD AMERICA MOVIL SAB DE CV 6.12500% 10-30.03.40	1 900 000.00	2 069 062.00	0.04
USD AMERICA MOVIL SAB DE CV 4.70000% 22-21.07.32	1 409 000.00	1 384 131.15	0.03
USD AMERICA MOVIL SAB DE CV-REG-S 5.37500% 22-04.04.32	8 383 000.00	7 785 711.25	0.15
USD ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT S-REG-S 3.37500% 21-29.06.28	6 100 000.00	4 735 125.00	0.09
USD ANGLOGOLD ASHANTI HOLDINGS PLC 3.75000% 20-01.10.30	2 292 000.00	2 028 419.99	0.04
USD ANGLOGOLD ASHANTI HOLDINGS PLC 3.37500% 21-01.11.28	6 655 000.00	5 962 880.00	0.11
USD ANGOLAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 8.75000% 22-14.04.32	13 276 000.00	12 280 300.00	0.23
USD ANGOLAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 9.37500% 18-08.05.48	22 212 000.00	19 768 680.00	0.37
USD ANTOFAGASTA PLC-REG-S 2.37500% 20-14.10.30	400 000.00	328 075.00	0.01
USD ANTOFAGASTA PLC-REG-S 5.62500% 22-13.05.32	1 169 000.00	1 171 922.50	0.02
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF STEP-UP 20-09.07.30	29 408 369.00	10 410 562.63	0.20
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF STEP-UP 20-09.07.35	129 036 652.00	39 743 288.82	0.75
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF STEP-UP 20-09.01.38	6 453 069.00	2 358 596.72	0.04
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF 1.00000% 20-09.07.29	2 741 550.00	934 868.55	0.02
USD ARMENIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 3.60000% 21-02.02.31	4 848 000.00	3 785 379.00	0.07
USD ATP TOWER HOLDINGS LLC-REG-S 4.05000% 21-27.04.26	3 944 000.00	3 546 642.00	0.07
USD AXTEL SAB DE CV-REG-S 6.37500% 17-14.11.24	9 768 000.00	8 327 220.00	0.16
USD AZUL INVESTMENTS LLP-REG-S 5.87500% 17-26.10.24	300 000.00	225 712.50	0.00
USD AZUL INVESTMENTS LLP-REG-S 7.25000% 21-15.06.26	977 000.00	588 825.68	0.01
USD BAHAMAS GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 6.00000% 17-21.11.28	2 750 000.00	2 227 500.00	0.04
USD BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.75000% 17-20.09.29	6 267 000.00	6 290 501.25	0.12
USD BANCO BRADESCO SA/CAYMAN ISLANDS-REG-S 4.37500% 22-18.03.27	1 409 000.00	1 356 867.00	0.03

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD BANCO BTG PACTUAL SA/CAYMAN-REG-S 4.50000% 19-10.01.25	911 000.00	877 293.00	0.02
USD BANCO BTG PACTUAL SA/CAY IS-REG-S 2.75000% 21-11.01.26	1 400 000.00	1 268 137.50	0.02
USD BANCO CONTINENTAL SAECA-REG-S 2.75000% 20-10.12.25	4 914 000.00	4 386 666.38	0.08
USD BANCO DE BOGOTA SA-REG-S-SUB 6.25000% 16-12.05.26	16 699 000.00	16 503 830.44	0.31
USD BANCO DE CHILE-REG-S 2.99000% 21-09.12.31	570 000.00	485 070.00	0.01
USD BANCO INBURSA SA-REG-S 4.37500% 17-11.04.27	2 375 000.00	2 273 765.63	0.04
USD BANCO INTL PERU-REG-S 3.25000% 19-04.10.26	749 000.00	692 113.45	0.01
USD BANCO NACIONAL DE COM EXTER SNC-REG-S 4.37500% 15-14.10.25	850 000.00	825 721.88	0.02
USD BANCO NACIONAL DE PANAMA-REG-S 2.50000% 20-11.08.30	3 212 000.00	2 629 022.00	0.05
USD BANCO SANTANDER CHILE SA-REG-S 3.17700% 21-26.10.31	920 000.00	794 247.50	0.01
USD BANCO SANTANDER SA-REG-S 5.37500% 20-17.04.25	995 000.00	993 756.25	0.02
USD BANCOLOMBIA SA 3.00000% 20-29.01.25	710 000.00	671 083.12	0.01
USD BANQUE OUEST AFRICAINE DE DEV-REG-S 5.00000% 17-27.07.27	4 141 000.00	3 947 284.02	0.07
USD BANQUE OUEST AFRICAINE DE DEV-REG-S 4.70000% 19-22.10.31	4 879 000.00	4 305 717.50	0.08
USD BECLE SAB DE CV-REG-S 2.50000% 21-14.10.31	900 000.00	711 731.25	0.01
USD BERMUDA GOVERNMENT OF-REG-S 5.00000% 22-15.07.32	10 230 000.00	10 270 280.63	0.19
USD BERMUDA, GOVERNMENT OF-REG-S 3.71700% 16-25.01.27	4 562 000.00	4 394 631.63	0.08
USD BERMUDA, GOVERNMENT OF-REG-S 2.37500% 20-20.08.30	1 653 000.00	1 407 426.19	0.03
USD BERMUDA, GOVERNMENT OF-REG-S 4.75000% 18-15.02.29	1 407 000.00	1 408 582.88	0.03
USD BERMUDA, GOVERNMENT OF-REG-S 3.37500% 20-20.08.50	2 475 000.00	1 784 010.94	0.03
USD BHARTI AIRTEL LTD-REG-S 4.37500% 15-10.06.25	1 249 000.00	1 217 618.87	0.02
USD BHARTI AIRTEL LTD-REG-S 3.25000% 21-03.06.31	2 602 000.00	2 233 921.08	0.04
USD BIDVEST GROUP UK PLC/THE-REG-S 3.62500% 21-23.09.26	7 311 000.00	6 690 935.82	0.13
USD BMF BOVESPA SA-REG-S 4.12500% 21-20.09.31	3 460 000.00	3 001 550.00	0.06
USD BRASKEM IDESA SAPI-REG-S 7.45000% 19-15.11.29	500 000.00	410 437.50	0.01
USD BRASKEM IDESA SAPI-REG-S 6.99000% 21-20.02.32	14 892 000.00	10 954 555.20	0.21
USD BRASKEM NETHERLANDS FINANCE BV-144A 4.50000% 19-31.01.30	2 655 000.00	2 328 966.00	0.04
USD BRASKEM NETHERLANDS FINANCE BV-REG-S 4.50000% 17-10.01.28	1 285 000.00	1 209 345.63	0.02
USD BRASKEM NETHERLANDS FINANCE BV-REG-S 4.50000% 19-31.01.30	10 397 000.00	9 120 248.40	0.17
USD BRAZIL LOAN TRUST 1-REG-S 5.47700% 13-24.07.23	2 920 000.00	467 931.17	0.01
USD BRAZIL, FEDERAL REPUBLIC OF 3.87500% 20-12.06.30	420 000.00	371 122.50	0.01
USD BRAZIL, FEDERAL REPUBLIC OF 2.87500% 20-06.06.25	1 336 000.00	1 269 868.00	0.02
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 4.25000% 13-07.01.25	10 233 000.00	10 097 412.75	0.19
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 4.62500% 17-13.01.28	5 861 000.00	5 688 100.50	0.11
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 4.75000% 19-14.01.50	2 420 000.00	1 775 372.50	0.03
USD BRAZIL, REPUBLIC OF 3.75000% 21-12.09.31	4 100 000.00	3 521 900.00	0.07
USD BRF SA-REG-S 4.87500% 19-24.01.30	730 000.00	615 161.87	0.01
USD BRF SA-REG-S 5.75000% 20-21.09.50	1 115 000.00	777 573.13	0.01
USD BUKIT MAKMUR MANDIRI UTAMA-REG-S 7.75000% 21-10.02.26	230 000.00	208 911.88	0.00
USD CA MAGNUM HOLDINGS-REG-S 5.37500% 21-31.10.26	800 000.00	736 000.00	0.01
USD CABLE ONDA SA-REG-S 4.50000% 19-30.01.30	4 460 000.00	3 927 587.50	0.07
USD CANACOL ENERGY LTD-REG-S 5.75000% 21-24.11.28	2 714 000.00	2 402 398.89	0.05
USD CBQ FINANCE LTD-REG-S 2.00000% 20-15.09.25	1 423 000.00	1 316 097.13	0.02
USD CELULOSA ARAUCO Y CONSTITUCION SA-REG-S 4.25000% 19-30.04.29	800 000.00	756 900.00	0.01
USD CELULOSA ARAUCO Y CONSTITUCION SA-REG-S 4.20000% 19-29.01.30	1 570 000.00	1 465 300.62	0.03
USD CEMEX SAB DE CV-REG-S 5.45000% 19-19.11.29	700 000.00	672 752.50	0.01
USD CEMEX SAB DE CV-REG-S 7.37500% 20-05.06.27	700 000.00	718 725.00	0.01
USD CENCOSUD SA-144A 6.62500% 15-12.02.45	400 000.00	396 825.00	0.01
USD CENCOSUD SA-REG-S 4.37500% 17-17.07.27	2 950 000.00	2 824 256.25	0.05
USD CENCOSUD SA-REG-S 6.62500% 15-12.02.45	1 686 000.00	1 672 617.38	0.03
USD CENTRAL AMERICAN BOTTLING CORP-REG-S 5.25000% 22-27.04.29	19 149 000.00	18 268 911.96	0.35
USD CENTRAL CHINA REAL ESTATE-REG-S 7.25000% 19-24.04.23	530 000.00	235 850.00	0.00
USD CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD-REG-S 7.25000% 20-13.08.24	875 000.00	275 625.00	0.01
USD CERRO DEL AGUILA SA-REG-S 4.12500% 17-16.08.27	4 661 000.00	4 355 995.82	0.08
USD CHAMPION PATH HOLDINGS-REG-S 4.85000% 21-27.01.28	1 975 000.00	1 707 387.50	0.03
USD CHILE, REPUBLIC OF 2.55000% 20-27.01.32	1 415 000.00	1 195 055.94	0.02
USD CHILE, REPUBLIC OF 2.55000% 21-27.07.33	22 476 000.00	18 287 035.50	0.35
USD CHILE, REPUBLIC OF 2.75000% 22-31.01.27	19 027 000.00	17 793 812.58	0.34

添付の注記は当財務書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

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD CHILE, REPUBLIC OF 3.12500% 14-27.03.25	3 721 000.00	3 606 579.25	0.07
USD CHILE, REPUBLIC OF 3.24000% 18-06.02.28	353 000.00	333 871.81	0.01
USD CHILE, REPUBLIC OF 3.50000% 19-25.01.50	7 174 000.00	5 390 812.63	0.10
USD CHILE, REPUBLIC OF 3.10000% 21-22.01.61	1 991 000.00	1 309 455.81	0.02
USD CHILE, REPUBLIC OF 3.10000% 21-07.05.41	1 437 000.00	1 084 755.37	0.02
USD CHILE, REPUBLIC OF 3.25000% 21-21.09.71	7 060 000.00	4 603 561.25	0.09
USD CHILE, REPUBLIC OF 3.50000% 22-31.01.34	4 709 000.00	4 162 461.69	0.08
USD CHILE, REPUBLIC OF 4.00000% 22-31.01.52	1 990 000.00	1 614 760.62	0.03
USD CHILE, REPUBLIC OF 4.34000% 22-07.03.42	3 528 000.00	3 127 351.50	0.06
USD CHINA AOYUAN GRP LTD-REG-S *DEFAULTED* 5.98000% 20-18.08.25	770 000.00	78 925.00	0.00
USD CHINA EVERGRANDE GROUP *DEFAULTED* 9.50000% 19-11.04.22	6 070 000.00	622 175.00	0.01
USD CHINA HONGQIAO GROUP LTD-REG-S 6.25000% 21-08.06.24	667 000.00	651 909.13	0.01
USD CIA DE MINAS BUENAVENTURA SAA-REG-S 5.50000% 21-23.07.26	1 505 000.00	1 316 875.00	0.02
USD CIA GENERAL DE COMBUSTIBLES SA-REG-S 9.50000% 20-08.03.25	894 000.00	785 755.60	0.01
USD CIBANCO SA INST DE BANCA MUTI TRS-REG-S 4.37500% 21-22.07.31	2 595 000.00	1 978 687.50	0.04
USD CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD-REG-S 6.45000% 19-07.11.24	240 000.00	74 400.00	0.00
USD CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD-REG-S 6.00000% 20-16.07.25	2 182 000.00	678 471.08	0.01
USD CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD-REG-S 5.95000% 20-20.10.25	2 624 000.00	815 959.04	0.02
USD CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD REG-S 4.37500% 21-12.04.27	1 980 000.00	603 900.00	0.01
USD CIKARANG LISTRINDO TBK PT-REG-S 4.95000% 16-14.09.26	1 000 000.00	943 937.50	0.02
USD CIMPOR FINANCIAL OPERATIONS BV-REG-S 5.75000% 14-17.07.24	1 860 000.00	1 492 650.00	0.03
USD CK HUTCHISON INTERNATIONAL-REG-S 2.50000% 21-15.04.31	500 000.00	425 725.00	0.01
USD CLEAN RENEWABLE POWER MAURITIUS-REG-S 4.25000% 21-25.03.27	1 390 000.00	1 181 264.58	0.02
USD CLIFFTON LTD-REG-S 6.25000% 21-25.10.25	1 080 000.00	1 026 810.00	0.02
USD CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 5.12500% 18-14.03.28	1 080 000.00	1 066 702.50	0.02
USD CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 3.87500% 19-19.06.29	1 030 000.00	948 547.60	0.02
USD CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 3.00000% 20-22.09.30	940 000.00	801 472.20	0.02
USD COCA-COLA ICECEK AS-REG-S 4.21500% 17-19.09.24	3 630 000.00	3 513 840.00	0.07
USD COCA-COLA ICECEK AS-REG-S 4.50000% 22-20.01.29	4 000 000.00	3 486 200.00	0.07
USD COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.25000% 21-22.04.32	9 640 000.00	7 099 860.00	0.13
USD COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.12500% 21-22.02.42	2 870 000.00	1 854 020.00	0.04
USD COLOMBIA TELECOMUNICACIONES SA-REG-S 4.95000% 20-17.07.30	5 371 000.00	4 643 565.18	0.09
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 3.87500% 17-25.04.27	4 059 000.00	3 674 156.06	0.07
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 4.50000% 18-15.03.29	13 322 000.00	11 754 999.75	0.22
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 5.20000% 19-15.05.49	18 178 000.00	12 807 537.11	0.24
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 3.00000% 20-30.01.30	14 304 000.00	11 121 360.00	0.21
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 3.12500% 20-15.04.31	16 026 000.00	12 112 651.13	0.23
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 4.12500% 20-15.05.51	8 454 000.00	5 219 288.24	0.10
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 3.87500% 21-15.02.61	2 450 000.00	1 408 443.75	0.03
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 7.50000% 23-02.02.34	12 386 000.00	12 255 947.00	0.23
USD COMETA ENERGIA SA DE CV-REG-S 6.37500% 18-24.04.35	8 162 000.00	6 869 364.16	0.13
USD COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD-REG-S 4.75000% 16-23.02.27	320 000.00	308 160.00	0.01
USD COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD-REG-S 3.34800% 21-09.02.31	6 125 000.00	5 012 164.07	0.09
USD COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD-REG-S 4.67700% 21-09.02.51	2 873 000.00	2 019 719.00	0.04
USD COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD-REG-S 3.87500% 21-26.07.33	448 000.00	353 024.00	0.01
USD COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD-REG-S 4.68800% 22-15.05.29	2 453 000.00	2 251 087.44	0.04
USD COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD-REG-S 6.26400% 22-15.02.52	701 000.00	606 934.56	0.01
USD CONSORCIO TRANSMANTARO-REG-S 4.70000% 19-16.04.34	2 510 000.00	2 331 476.25	0.04
USD CONSORCIO TRANSMANTARO SA-REG-S 5.20000% 22-11.04.38	4 763 000.00	4 392 676.75	0.08
USD CONTINUUM ENERGY LEVAN PTE LTD-REG-S 4.50000% 21-09.02.27	1 330 000.00	1 151 663.63	0.02
USD CORP FINANCIERA DE DESARROLLO SA-REG-S 4.75000% 15-15.07.25	1 545 000.00	1 497 491.25	0.03
USD CORP FINANCIERA DE DESARROLLO SA-REG-S 2.40000% 20-28.09.27	2 830 000.00	2 425 310.00	0.05
USD CORP INMOBILIARIA VESTA SAB DE-REG-S 3.62500% 21-13.05.31	500 000.00	421 625.00	0.01
USD CORP LINDLEY SA-REG-S 4.62500% 13-12.04.23	1 943 000.00	479 465.61	0.01
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 4.50000% 17-01.08.47	247 000.00	215 754.50	0.00
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 4.37500% 19-05.02.49	707 000.00	611 024.75	0.01
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 3.70000% 19-30.01.50	1 267 000.00	972 422.50	0.02
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 3.15000% 20-14.01.30	4 561 000.00	4 094 352.69	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

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / 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 3.75000% 20-15.01.31	864 000.00	795 852.00	0.02
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 3.15000% 20-15.01.51	311 000.00	226 505.19	0.00
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 4.37500% 13-30.04.25	2 660 000.00	2 565 736.25	0.05
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 5.62500% 13-30.04.43	3 317 000.00	2 778 609.43	0.05
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 7.00000% 14-04.04.44	4 608 000.00	4 457 664.00	0.08
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 7.15800% 15-12.03.45	7 966 000.00	7 798 216.13	0.15
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 6.12500% 19-19.02.31	6 576 000.00	6 437 493.01	0.12
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 7.25000% 19-08.04.26	550 000.00	413 875.00	0.01
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 3.30000% 21-12.01.31	1 469 000.00	840 818.88	0.02
USD CREDICORP LTD-REG-S 2.75000% 20-17.06.25	2 860 000.00	2 688 042.50	0.05
USD CROATIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.50000% 13-04.04.23	10 925 000.00	10 892 907.81	0.21
USD CSN ISLANDS XI CORP-REG-S 6.75000% 20-28.01.28	1 025 000.00	1 023 975.00	0.02
USD CSN RESOURCES SA-REG-S 4.62500% 21-10.06.31	5 455 000.00	4 594 201.00	0.09
USD CT TRUST-REG-S 5.12500% 22-03.02.32	12 645 000.00	11 032 762.50	0.21
USD DAE FUNDING LLC-REG-S 2.62500% 21-20.03.25	3 157 000.00	2 963 633.75	0.06
USD DAE FUNDING LLC-REG-S 3.37500% 21-20.03.28	3 385 000.00	3 052 423.75	0.06
USD DEBT AND ASSET TRADING CORP-REG-S 1.00000% 13-10.10.25	4 570 000.00	3 836 800.62	0.07
USD DNO ASA-144A-REG-S 7.87500% 21-09.09.26	4 228 000.00	4 012 372.00	0.08
USD DOMINICAN REPUBLIC INT BOND-REG-S 4.87500% 20-23.09.32	33 191 000.00	28 218 573.32	0.53
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 5.50000% 15-27.01.25	535 000.00	532 258.12	0.01
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.85000% 15-27.01.45	4 428 000.00	4 049 682.75	0.08
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.87500% 16-29.01.26	5 962 000.00	6 127 072.88	0.12
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 5.95000% 17-25.01.27	2 300 000.00	2 291 806.25	0.04
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.50000% 18-15.02.48	1 675 000.00	1 445 001.56	0.03
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.00000% 18-19.07.28	5 286 000.00	5 179 619.26	0.10
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.40000% 19-05.06.49	4 038 000.00	3 439 366.50	0.07
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 4.50000% 20-30.01.30	22 272 000.00	19 359 936.00	0.37
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 5.87500% 20-30.01.60	24 734 000.00	18 972 523.88	0.36
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 5.30000% 21-21.01.41	890 000.00	712 723.13	0.01
USD DUBAI, GOVERNMENT OF-REG-S 5.25000% 13-30.01.43	2 425 000.00	2 326 939.06	0.04
USD EASY TACTIC LTD (PIK) 6.50000% 22-11.07.28	612 216.00	186 840.67	0.00
USD ECOPETROL SA 4.62500% 21-02.11.31	8 879 000.00	6 992 656.45	0.13
USD ECOPETROL SA 5.37500% 15-26.06.26	460 000.00	443 060.50	0.01
USD ECOPETROL SA 5.87500% 13-18.09.23	3 450 000.00	3 441 375.00	0.07
USD ECOPETROL SA 5.87500% 14-28.05.45	10 178 000.00	7 288 720.25	0.14
USD ECOPETROL SA 5.87500% 21-02.11.51	610 000.00	421 662.50	0.01
USD ECOPETROL SA 6.87500% 20-29.04.30	5 506 000.00	5 132 858.38	0.10
USD ECOPETROL SA 7.37500% 13-18.09.43	1 790 000.00	1 555 062.50	0.03
USD ECOPETROL SA 8.87500% 23-13.01.33	14 772 000.00	15 123 573.60	0.29
USD ECUADOR GOVT INTERNATIONAL BD-REG-S STEP-UP/DOWN 20-31.07.35	68 356 201.00	33 186 935.59	0.63
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S STEP-UP 0.50000% 20-31.07.30	10 989 929.00	7 293 191.63	0.14
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S STEP-UP 20-31.07.40	14 320 432.00	5 999 365.99	0.11
USD EGYPT, REPUBLIC OF-144A 8.87500% 20-29.05.50	3 828 000.00	2 722 665.00	0.05
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.90300% 18-21.02.48	21 514 000.00	14 306 810.00	0.27
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 6.58800% 18-21.02.28	1 433 000.00	1 185 807.50	0.02
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 5.75000% 20-29.05.24	1 100 000.00	1 034 000.00	0.02
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.62500% 20-29.05.32	8 893 000.00	6 763 126.50	0.13
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 8.87500% 20-29.05.50	9 720 000.00	6 913 350.00	0.13
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 20-06.10.25	4 685 000.00	4 193 075.00	0.08
USD EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 7.62500% 11-01.02.41	4 984 000.00	2 340 299.51	0.04
USD EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 5.87500% 12-30.01.25	1 290 000.00	927 832.50	0.02
USD EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 6.37500% 14-18.01.27	4 210 000.00	2 307 080.00	0.04
USD EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 8.62500% 17-28.02.29	5 323 000.00	2 815 534.31	0.05
USD EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 7.12460% 19-20.01.50	582 000.00	268 192.88	0.01
USD EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 9.50000% 20-15.07.52	17 206 000.00	8 966 476.75	0.17
USD EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 8.25000% 02-10.04.32	470 000.00	239 935.00	0.00
USD ELECTRICIDAD FIRME DE MEXICO-REG-S 4.90000% 21-20.11.26	4 027 000.00	3 611 212.25	0.07
USD EMBRAER NETHERLANDS FINANCE BV-REG-S 6.95000% 20-17.01.28	1 409 000.00	1 441 407.00	0.03

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD EMPRESA DE L FERROCARRILE DEL EST-REG-S 3.06800% 20-18.08.50	1 694 000.00	1 076 007.64	0.02
USD EMPRESA DE LOS FERROCARRILES DEL-REG-S 3.83000% 21-14.09.61	1 710 000.00	1 202 664.38	0.02
USD EMPRESA DE TRANSMISION ELECTRICA-REG-S 5.12500% 19-02.05.49	3 890 000.00	3 240 370.00	0.06
USD EMPRESA DE TRANSPORTE DE PASA MET-REG-S 5.00000% 17-25.01.47	200 000.00	182 037.50	0.00
USD EMPRESA DE TRANSPORTE DE PASA MET-REG-S 3.65000% 20-07.05.30	2 370 000.00	2 185 288.12	0.04
USD EMPRESA DE TRANSPORTE DE PASA MET-REG-S 4.70000% 20-07.05.50	2 624 000.00	2 356 024.00	0.04
USD EMPRESA GENERADORA DE ELECTRICID-REG-S 5.62500% 21-08.11.28	4 033 000.00	3 602 073.95	0.07
USD EMPRESA NACIONAL DE TELECOM-REG-S 4.75000% 14-01.08.26	7 101 000.00	6 938 120.81	0.13
USD EMPRESA NACIONAL DE TELECOM SA-REG-S 3.05000% 21-14.09.32	980 000.00	788 471.25	0.01
USD EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO-REG-S 3.75000% 16-05.08.26	3 157 000.00	2 968 171.94	0.06
USD EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO-REG-S 4.50000% 17-14.09.47	1 158 000.00	922 057.50	0.02
USD EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO-REG-S 5.25000% 18-06.11.29	14 944 000.00	14 521 832.00	0.27
USD EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO-REG-S 3.45000% 21-16.09.31	1 974 000.00	1 677 036.37	0.03
USD EMPRESAS PUBLICAS DE MEDELLIN ESP-REG-S 4.25000% 19-18.07.29	7 498 000.00	6 145 079.63	0.12
USD EMPRESAS PUBLICAS DE MEDELLIN ESP-REG-S 4.37500% 20-15.02.31	340 000.00	269 088.75	0.01
USD ENDEAVOUR MINING PLC-REG-S 5.00000% 21-14.10.26	2 494 000.00	2 213 892.62	0.04
USD ENEL CHILE SA 4.87500% 18-12.06.28	1 632 000.00	1 600 686.00	0.03
USD ENERGEAN PLC-REG-S 6.50000% 21-30.04.27	6 845 000.00	6 391 108.05	0.12
USD ENERGUATE TRUST-REG-S 5.87500% 17-03.05.27	5 415 000.00	5 163 879.38	0.10
USD ENERSIS AMERICAS SA 4.00000% 16-25.10.26	2 770 000.00	2 690 016.25	0.05
USD ENFRAGEN ENERGIA SUR SA-REG-S 5.37500% 20-30.12.30	2 980 000.00	2 127 652.80	0.04
USD ENGIE ENERGIA CHILE SA-REG-S 3.40000% 20-28.01.30	1 237 000.00	1 032 740.38	0.02
USD ENN CLEAN ENERGY INTERNAT INVEST-REG-S 3.37500% 21-12.05.26	5 254 000.00	4 751 927.76	0.09
USD ENN ENERGY HOLDINGS LTD-REG-S 4.62500% 22-17.05.27	700 000.00	686 350.00	0.01
USD ENN ENERGY HOLDINGS LTD-REG-S 2.62500% 20-17.09.30	2 385 000.00	1 990 431.56	0.04
USD ESKOM HOLDINGS SOC LTD-REG-S 6.75000% 13-06.08.23	4 900 000.00	4 800 162.50	0.09
USD ESKOM HOLDINGS SOC LTD-REG-S 7.12500% 15-11.02.25	9 255 000.00	8 831 583.75	0.17
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 5.12500% 23-11.01.33	244 000.00	255 712.00	0.00
USD EXPORT-IMPORT BANK OF INDIA-REG-S 5.50000% 23-18.01.33	676 000.00	683 875.40	0.01
USD FALABELLA SA-REG-S 3.37500% 21-15.01.32	3 259 000.00	2 647 937.50	0.05
USD FANTASIA HOLDING GRP-REG-S* DEFAULTED* 10.87500% 20-09.01.23	870 000.00	148 082.70	0.00
USD FANTASIA HOLDINGS GRP-REG-S* DEFAULTED* 11.87500% 20-01.06.23	3 955 000.00	682 237.50	0.01
USD FBN VIA FINANCE CO BV-REG-S 8.62500% 20-27.10.25	3 040 000.00	2 857 220.00	0.05
USD FEL ENERGY VI SARL-REG-S 5.75000% 20-01.12.40	9 816 000.00	7 863 816.25	0.15
USD FENIX POWER PERU SA-REG-S 4.31700% 17-20.09.27	3 245 000.00	2 290 874.56	0.04
USD FONDO MIVIVIENDA SA-REG-S 4.62500% 22-12.04.27	2 610 000.00	2 526 480.00	0.05
USD FORTUNE STAR BVI LTD-REG-S 5.00000% 21-18.05.26	360 000.00	293 176.80	0.01
USD FRANSION BRILLIANT LTD-REG-S 4.25000% 19-23.07.29	1 886 000.00	1 571 627.37	0.03
USD FREEPORT INDONESIA-REG-S 6.20000% 22-14.04.52	2 300 000.00	2 104 753.00	0.04
USD FS LUXEMBOURG SARL-REG-S 10.00000% 20-15.12.25	2 129 000.00	2 148 027.94	0.04
USD FUTURE RETAIL LTD-REG-S* DEFAULTED* 5.60000% 20-22.01.25	350 000.00	2 690.63	0.00
USD FWD GROUP LTD-REG-S-SUB 5.75000% 19-09.07.24	900 000.00	872 989.20	0.02
USD GABON, REPUBLIC OF-REG-S 6.62500% 20-06.02.31	9 191 000.00	7 679 080.49	0.15
USD GABON, REPUBLIC OF-REG-S 7.00000% 21-24.11.31	13 683 000.00	11 527 927.50	0.22
USD GACI FIRST INVESTMENT CO-REG-S 5.25000% 22-13.10.32	5 417 000.00	5 587 635.50	0.11
USD GACI FIRST INVESTMENT CO-REG-S 5.00000% 22-13.10.27	2 590 000.00	2 628 850.00	0.05
USD GALAXY PIPELINE ASSETS BIDCO LTD-REG-S 1.75000% 20-30.09.27	880 000.00	663 639.42	0.01
USD GALAXY PIPELINE ASSETS BIDCO LTD-REG-S 2.16000% 21-31.03.34	3 910 000.00	3 122 819.54	0.06
USD GALAXY PIPELINE ASSETS BIDCO LTD-REG-S 2.94000% 21-30.09.40	7 153 000.00	5 656 180.07	0.11
USD GENM CAPITAL LABUAN LTD-REG-S 3.88200% 21-19.04.31	5 210 000.00	4 199 989.40	0.08
USD GEOPARK LTD-REG-S 5.50000% 20-17.01.27	3 230 000.00	2 865 211.87	0.05
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 7.62500% 18-16.05.29	12 489 000.00	4 620 930.00	0.09
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 8.62700% 18-16.06.49	1 595 000.00	572 206.25	0.01
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 6.37500% 20-11.02.27	5 001 000.00	1 887 127.35	0.04
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 8.62500% 21-07.04.34	5 027 000.00	1 847 422.50	0.03
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 8.87500% 21-07.05.42	5 273 000.00	1 885 097.50	0.04
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 7.75000% 21-07.04.29	3 250 000.00	1 202 500.00	0.02
USD GLOBO COMUNICACAO E PARTICIPACOES-REG-S 5.50000% 22-14.01.32	300 000.00	258 712.50	0.00

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD GMR HYDERABAD INTNATL AIRPORT LTD-REG-S 4.25000% 17-27.10.27	430 000.00	373 777.50	0.01
USD GNL QUINTERO SA-REG-S 4.63400% 14-31.07.29	6 233 000.00	5 024 411.95	0.10
USD GOL FINANCE SA-REG-S 7.00000% 17-31.01.25	2 360 000.00	1 215 842.52	0.02
USD GOLD FIELDS OROGEN HOLDINGS-REG-S 6.12500% 19-15.05.29	4 954 000.00	5 080 327.00	0.10
USD GREENKO MAURITIUS LTD-REG-S 6.25000% 19-21.02.23	3 214 000.00	3 204 358.00	0.06
USD GRUMA SA DE CV-REG-S 4.87500% 14-01.12.24	5 127 000.00	5 084 702.25	0.10
USD GRUPO AVAL LTD-REG-S 4.37500% 20-04.02.30	2 846 000.00	2 344 250.20	0.04
USD GRUPO BIMBO SA DE CV-REG-S 4.00000% 19-06.09.49	490 000.00	395 920.00	0.01
USD GRUPO BIMBO SAB DE CV-REG-S 4.70000% 17-10.11.47	200 000.00	179 162.50	0.00
USD GTLK EUROPE CAPITAL DAC-REG-S 4.34900% 21-27.02.29	2 160 000.00	108 000.00	0.00
USD GUARA NORTE SARL-REG-S 5.19800% 21-15.06.34	8 329 000.00	6 849 424.21	0.13
USD GUATEMALA GOVERNMENT BOND-REG-S 4.65000% 21-07.10.41	1 162 000.00	965 767.25	0.02
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 4.50000% 16-03.05.26	3 641 000.00	3 519 936.75	0.07
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 4.37500% 17-05.06.27	4 168 000.00	3 966 894.00	0.08
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 4.90000% 19-01.06.30	6 740 000.00	6 421 113.76	0.12
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 6.12500% 19-01.06.50	2 612 000.00	2 537 394.75	0.05
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 5.37500% 20-24.04.32	5 240 000.00	5 113 257.52	0.10
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 3.70000% 21-07.10.33	1 826 000.00	1 533 611.75	0.03
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 22-10.08.29	2 140 000.00	2 074 863.75	0.04
USD GUSAP III-REG-S 4.25000% 19-21.01.30	2 849 000.00	2 682 155.44	0.05
USD HANA BANK-REG-S 3.25000% 22-30.03.27	6 346 000.00	5 964 446.75	0.11
USD HEALTH AND HAPPINESS H&H INTL HLD-REG-S 5.62500% 19-24.10.24	600 000.00	545 550.00	0.01
USD HIKMA FINANCE USA LLC-REG-S 3.25000% 20-09.07.25	375 000.00	352 522.50	0.01
USD HKT CAPITAL NO 6 LTD-REG-S 3.00000% 22-18.01.32	500 000.00	413 255.00	0.01
USD HONDURAS, REPUBLIC OF-REG-S 6.25000% 17-19.01.27	1 355 000.00	1 196 888.44	0.02
USD HONDURAS, REPUBLIC OF-REG-S 5.62500% 20-24.06.30	1 467 000.00	1 194 963.19	0.02
USD HONG KONG AIRPORT AUTHORITY-REG-S 2.50000% 22-12.01.32	4 495 000.00	3 852 972.41	0.07
USD HPHT FINANCE 21 LTD-REG-S 2.00000% 21-19.03.26	448 000.00	409 149.42	0.01
USD HTA GROUP LTD/MAURITIUS-REG-S 7.00000% 20-18.12.25	5 320 000.00	4 998 472.50	0.09
USD HUARONG FINANCE 2017 CO-REG-S 4.75000% 17-27.04.27	1 310 000.00	1 184 976.88	0.02
USD HUNGARY, REPUBLIC OF 7.62500% 11-29.03.41	7 090 000.00	8 002 837.50	0.15
USD HUNGARY, REPUBLIC OF 5.37500% 14-25.03.24	972 000.00	973 701.00	0.02
USD HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 22-16.06.29	14 435 000.00	14 272 606.25	0.27
USD HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 5.50000% 22-16.06.34	18 740 000.00	18 458 900.00	0.35
USD HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 2.12500% 21-22.09.31	26 848 000.00	20 941 440.00	0.40
USD HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 3.12500% 21-21.09.51	5 188 000.00	3 281 410.00	0.06
USD HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 6.12500% 23-22.05.28	930 000.00	963 015.00	0.02
USD HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 6.25000% 22-22.09.32	9 210 000.00	9 543 862.50	0.18
USD HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 6.75000% 22-25.09.52	7 468 000.00	7 888 075.00	0.15
USD HUNT OIL CO OF PERU LLC SUCUAL DL-REG-S 6.37500% 18-01.06.28	7 041 000.00	5 903 065.27	0.11
USD HYUNDAI ASSAN OTOMOTIV SANAYI VE-REG-S 1.62500% 21-12.07.26	860 000.00	737 342.50	0.01
USD HYUNDAI CAPITAL AMERICA-REG-S 2.75000% 16-27.09.26	854 000.00	785 932.18	0.01
USD HYUNDAI CAPITAL AMERICA-REG-S 3.50000% 19-02.11.26	4 354 000.00	4 103 235.89	0.08
USD ICL GROUP LTD-144A-REG-S 6.37500% 18-31.05.38	1 265 000.00	1 277 650.00	0.02
USD IHS NETHERLANDS HOLDCO BV-REG-S 8.00000% 19-18.09.27	5 682 000.00	5 104 211.63	0.10
USD INDIA GREEN POWER HOLDINGS-REG-S 4.00000% 21-22.02.27	5 949 000.00	5 187 230.55	0.10
USD INDIKA ENERGY CAPITAL IV PTE LTD-REG-S 8.25000% 20-22.10.25	990 000.00	985 050.00	0.02
USD INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT-REG-S 3.39800% 21-09.06.31	2 164 000.00	1 828 580.00	0.03
USD INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT-REG-S 3.54100% 21-27.04.32	2 170 000.00	1 817 613.70	0.03
USD INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM TBK PT-REG-S 6.53000% 18-15.11.28	2 189 000.00	2 281 074.81	0.04
USD INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM TBK PT-REG-S 6.75700% 18-15.11.48	1 933 000.00	1 923 547.63	0.04
USD INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM TBK PT-REG-S 4.75000% 20-15.05.25	423 000.00	418 770.00	0.01
USD INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM TBK PT-REG-S 5.45000% 20-15.05.30	768 000.00	764 304.00	0.01
USD INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM TBK PT-REG-S 5.80000% 20-15.05.50	4 260 000.00	3 870 742.50	0.07
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 3.50000% 20-14.02.50	565 000.00	433 037.19	0.01
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 3.85000% 20-15.10.30	4 831 000.00	4 596 394.56	0.09
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 4.20000% 20-15.10.50	620 000.00	531 718.20	0.01
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 3.05000% 21-12.03.51	1 381 000.00	1 028 996.91	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

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 3.35000% 21-12.03.71	390 000.00	273 042.90	0.01
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 3.20000% 21-23.09.61	3 625 000.00	2 501 648.75	0.05
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 4.15000% 22-20.09.27	264 000.00	260 069.04	0.00
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 4.55000% 23-11.01.28	1 095 000.00	1 092 382.95	0.02
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 4.85000% 23-11.01.33	5 265 000.00	5 291 904.15	0.10
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 5.65000% 23-11.01.53	2 132 000.00	2 228 174.52	0.04
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 7.75000% 08-17.01.38	2 163 000.00	2 679 145.87	0.05
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 12-17.01.42	3 561 000.00	3 600 616.12	0.07
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 16-08.01.47	432 000.00	433 127.52	0.01
USD INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV-REG-S 4.75000% 20-06.08.50	944 000.00	809 362.00	0.02
USD INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA-REG-S 4.75000% 20-15.01.51	745 000.00	583 102.19	0.01
USD INKIA ENERGY LTD-REG-S 5.87500% 17-09.11.27	988 000.00	916 987.50	0.02
USD INRETAIL SHOPPING MALLS-REG-S 5.75000% 18-03.04.28	1 040 000.00	986 570.00	0.02
USD INSTITUTO COSTARRICENSE DE ELEC-REG-S 6.37500% 13-15.05.43	540 000.00	432 843.75	0.01
USD INSTITUTO COSTARRICENSE DE ELECT-REG-S 6.75000% 21-07.10.31	1 270 000.00	1 215 469.38	0.02
USD INTERCHILE SA-REG-S 4.50000% 21-30.06.56	3 540 000.00	3 006 787.50	0.06
USD INTERCORP PERU LTD-REG-S 3.87500% 19-15.08.29	930 000.00	781 781.25	0.01
USD INTERNATIONAL AIRPORT FINANCE SA-REG-S 12.00000% 19-15.03.33	5 235 000.00	5 103 087.78	0.10
USD INVERSIONES CMPC SA-REG-S 3.00000% 21-06.04.31	1 300 000.00	1 119 868.75	0.02
USD INVESTMENT ENERGY RESOURCES LTD-REG-S 6.25000% 21-26.04.29	2 259 000.00	2 152 121.06	0.04
USD IPOTEKA-BANK ATIB-REG-S 5.50000% 20-19.11.25	1 200 000.00	1 115 850.00	0.02
USD IRSA INVERSION Y REPRESENTACIONES-REG-S 8.75000% 22-22.06.28	885 832.00	869 776.30	0.02
USD ISRAEL ELECTRIC CORP LTD-144A-REG-S 5.00000% 14-12.11.24	1 642 000.00	1 633 790.00	0.03
USD ISRAEL ELECTRIC CORP LTD-REG-S 6.87500% 13-21.06.23	3 522 000.00	3 532 566.00	0.07
USD IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S STEP-UP 10-31.12.32	2 677 000.00	1 460 991.38	0.03
USD JAMAICA, GOVERNMENT OF 6.75000% 15-28.04.28	950 000.00	1 010 443.75	0.02
USD JAMAICA, GOVERNMENT OF 7.87500% 15-28.07.45	3 836 000.00	4 464 145.00	0.08
USD JBS USA LUX SA / JBS USA FOOD CO-REG-S 5.75000% 22-01.04.33	400 000.00	392 224.00	0.01
USD JD.COM INC 4.12500% 20-14.01.50	550 000.00	440 275.00	0.01
USD JMH CO LTD-REG-S 2.50000% 21-09.04.31	1 500 000.00	1 261 815.00	0.02
USD JORDAN GOVERNMENT INTERNATIONAL B-REG-S 7.75000% 22-15.01.28	1 070 000.00	1 102 100.00	0.02
USD JORDAN, KINGDOM OF-REG-S 5.75000% 16-31.01.27	3 634 000.00	3 549 509.50	0.07
USD JORDAN, KINGDOM OF-REG-S 5.85000% 20-07.07.30	8 378 000.00	7 686 815.00	0.15
USD JORDAN, KINGDOM OF-REG-S 4.95000% 20-07.07.25	2 870 000.00	2 779 953.75	0.05
USD JSC GEORGIAN RAILWAY-REG-S 4.00000% 21-17.06.28	2 011 000.00	1 763 144.25	0.03
USD JSL EUROPE SA-REG-S 5.20000% 21-26.01.31	4 332 000.00	3 148 497.60	0.06
USD JSW STEEL LTD-REG-S 3.95000% 21-05.04.27	2 387 000.00	2 100 560.00	0.04
USD JSW STEEL LTD-REG-S 5.05000% 21-05.04.32	1 644 000.00	1 377 158.25	0.03
USD KAISA GROUP HOLDINGS-REG-S *DEFAULTED* 11.50000% 19-30.01.23	1 345 000.00	242 100.00	0.00
USD KAISA GROUP HOLDINGS-REG-S *DEFAULTED* 11.25000% 20-16.04.25	800 000.00	144 000.00	0.00
USD KALLPA GENERACION SA-REG-S 4.87500% 16-24.05.26	1 135 000.00	1 096 551.88	0.02
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO-REG-S 4.75000% 17-19.04.27	10 755 000.00	10 002 150.00	0.19
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO-REG-S 5.75000% 17-19.04.47	9 210 000.00	7 300 490.70	0.14
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO-REG-S 6.37500% 18-24.10.48	7 004 000.00	5 988 420.00	0.11
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO-REG-S 5.37500% 18-24.04.30	17 564 000.00	16 202 790.00	0.31
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO JSC-REG-S 3.50000% 20-14.04.33	5 831 000.00	4 406 311.77	0.08
USD KB KOOKMIN CRD CO LTD-REG-S 4.00000% 22-09.06.25	2 353 000.00	2 267 139.03	0.04
USD KENBOURNE INVEST SA-REG-S 6.87500% 19-26.11.24	2 164 000.00	2 009 815.00	0.04
USD KENBOURNE INVEST SA-REG-S 4.70000% 21-22.01.28	4 318 000.00	3 260 090.00	0.06
USD KENYA, REPUBLIC OF-REG-S 7.25000% 18-28.02.28	640 000.00	561 600.00	0.01
USD KENYA, REPUBLIC OF-REG-S 8.25000% 18-28.02.48	2 600 000.00	2 028 000.00	0.04
USD KENYA, REPUBLIC OF-REG-S 8.00000% 19-22.05.32	8 997 000.00	7 782 405.00	0.15
USD KENYA, REPUBLIC OF-REG-S 7.00000% 19-22.05.27	700 000.00	630 000.00	0.01
USD KENYA, REPUBLIC OF-REG-S 6.30000% 21-23.01.34	3 133 000.00	2 412 410.00	0.05
USD KIA CORP-REG-S 2.75000% 22-14.02.27	4 350 000.00	3 937 620.00	0.07
USD KLABIN AUSTRIA GMBH-REG-S 5.75000% 19-03.04.29	2 000 000.00	1 996 250.00	0.04
USD KLABIN AUSTRIA GMBH-REG-S 7.00000% 19-03.04.49	1 502 000.00	1 512 514.00	0.03
USD KLABIN AUSTRIA GMBH-REG-S 3.20000% 21-12.01.31	1 850 000.00	1 507 750.00	0.03

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD KOC HOLDING AS-REG-S 5.25000% 16-15.03.23	1 000 000.00	994 250.00	0.02
USD KOREA EXPRESSWAY CORP-REG-S 3.62500% 22-18.05.25	1 519 000.00	1 472 290.75	0.03
USD KOREA HYDRO & NUCLEAR POWE CO LTD-REG-S 4.25000% 22-27.07.27	3 120 000.00	3 043 560.00	0.06
USD KOSMOS ENERGY LTD-144A 7.12500% 19-04.04.26	910 000.00	818 877.15	0.02
USD KOSMOS ENERGY LTD-REG-S 7.12500% 19-04.04.26	4 752 000.00	4 276 158.48	0.08
USD KOSMOS ENERGY LTD-REG-S 7.50000% 21-01.03.28	5 895 000.00	5 035 066.87	0.10
USD KOSMOS ENERGY LTD-REG-S 7.75000% 21-01.05.27	3 018 000.00	2 668 741.95	0.05
USD KSA SUKUK LTD-REG-S 5.26800% 22-25.10.28	1 840 000.00	1 927 400.00	0.04
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.65000% 15-26.02.30	9 630 000.00	601 875.00	0.01
USD LENOVO GROUP LTD-REG-S 3.42100% 20-02.11.30	2 349 000.00	1 986 079.50	0.04
USD LENOVO GROUP LTD-REG-S 5.83100% 22-27.01.28	983 000.00	992 495.78	0.02
USD LEVIATHAN BOND LTD-144A-REG-S 5.75000% 20-30.06.23	3 600 000.00	3 583 800.00	0.07
USD LEVIATHAN BOND LTD-144A-REG-S 6.75000% 20-30.06.30	5 475 000.00	5 308 354.68	0.10
USD LG CHEM LTD-REG-S 2.37500% 21-07.07.31	1 365 000.00	1 104 199.70	0.02
USD LIGHT SERVICOS DE ELETRICIDADE SA-REG-S 4.37500% 21-18.06.26	750 000.00	426 937.50	0.01
USD LIQUID TELECOMMUNICATIONS FIN-REG-S 5.50000% 21-04.09.26	3 146 000.00	2 380 735.50	0.05
USD LLPL CAPITAL PTE LTD-REG-S 6.87500% 19-04.02.39	8 700 000.00	6 863 380.55	0.13
USD MALDIVES SUKUK ISSUANCE LTD-REG-S 9.87500% 21-08.04.2026	400 000.00	339 904.00	0.01
USD MC BRAZIL DOWNSTREAM TRADING SARL-REG-S 7.25000% 21-30.06.31	2 128 000.00	1 793 413.09	0.03
USD MDGH GMTN RSC LTD-REG-S 5.50000% 22-28.04.33	2 669 000.00	2 850 492.00	0.05
USD MEDCO BELL PTE LTD-REG-S 6.37500% 20-30.01.27	2 389 000.00	2 287 921.41	0.04
USD MEDCO LAUREL TREE PTE LTD-REG-S 6.95000% 21-12.11.28	3 020 000.00	2 866 735.00	0.05
USD MEDCO OAK TREE PTE LTD-REG-S 7.37500% 19-14.05.26	5 855 000.00	5 825 139.50	0.11
USD MEGAWORLD CORP-REG-S 4.12500% 20-30.07.27	1 030 000.00	947 793.13	0.02
USD MEITUAN DIANPING-REG-S 2.12500% 20-28.10.25	1 840 000.00	1 664 970.00	0.03
USD MEITUAN DIANPING-REG-S 3.05000% 20-28.10.30	5 615 000.00	4 515 863.75	0.09
USD MELCO RESORTS FINANCE LTD-REG-S 5.62500% 19-17.07.27	3 000 000.00	2 739 920.39	0.05
USD MELCO RESORTS FINANCE LTD-REG-S 5.37500% 19-04.12.29	700 000.00	603 954.19	0.01
USD MELCO RESORTS FINANCE LTD-REG-S 5.75000% 20-21.07.28	2 606 000.00	2 344 015.69	0.04
USD MERSIN ULUSLARARASI LIMAN-REG-S 5.37500% 19-15.11.24	5 868 000.00	5 623 377.75	0.11
USD METINVEST BV-REG-S 8.50000% 18-23.04.26	440 000.00	237 600.00	0.00
USD MEXICAN, UNITED STATES OF 4.60000% 15-23.01.46	200 000.00	165 500.00	0.00
USD MEXICHEM SAB DE CV-REG-S 6.75000% 12-19.09.42	970 000.00	976 850.62	0.02
USD MEXICHEM SAB DE CV-REG-S 5.87500% 14-17.09.44	4 360 000.00	3 991 580.00	0.08
USD MEXICHEM SAB DE CV-REG-S 4.00000% 17-04.10.27	675 000.00	629 100.00	0.01
USD MEXICHEM SAB DE CV-REG-S 5.50000% 17-15.01.48	850 000.00	742 581.25	0.01
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-REG-S 4.25000% 16-31.10.26	5 925 000.00	5 718 735.92	0.11
USD MEXICO GEN DE ENERGIA S DE RL-REG-S 5.50000% 12-06.12.32	2 350 000.00	1 554 323.85	0.03
USD MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.65900% 20-24.05.31	9 637 000.00	8 080 624.49	0.15
USD MEXICO, UNITED STATES OF 6.05000% 08-11.01.40	444 000.00	452 325.00	0.01
USD MEXICO, UNITED STATES OF 5.75000% 10-12.10.110	9 112 000.00	8 156 948.51	0.15
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.35000% 16-15.01.47	1 470 000.00	1 168 650.00	0.02
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.60000% 17-10.02.48	210 000.00	172 200.00	0.00
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.50000% 19-22.04.29	1 000 000.00	981 500.00	0.02
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.50000% 19-31.01.50	3 400 000.00	2 740 825.00	0.05
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.75000% 20-27.04.32	5 070 000.00	4 880 825.62	0.09
USD MEXICO, UNITED STATES OF 5.00000% 20-27.04.51	1 850 000.00	1 593 312.50	0.03
USD MEXICO, UNITED STATES OF 3.77100% 20-24.05.61	6 077 000.00	4 132 360.00	0.08
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.28000% 21-14.08.41	540 000.00	444 150.00	0.01
USD MEXICO, UNITED STATES OF 3.50000% 22-12.02.34	2 100 000.00	1 766 100.00	0.03
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.40000% 22-12.02.52	5 204 000.00	4 072 130.00	0.08
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.87500% 22-19.05.33	6 498 000.00	6 238 080.00	0.12
USD MEXICO, UNITED STATES OF 5.40000% 23-09.02.28	6 965 000.00	7 163 502.50	0.14
USD MEXICO, UNITED STATES OF 6.35000% 23-09.02.35	16 294 000.00	17 296 081.00	0.33
USD MGM CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 5.87500% 19-15.05.26	200 000.00	190 500.00	0.00
USD MGM CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 5.25000% 20-18.06.25	300 000.00	286 668.45	0.01
USD MGM CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 4.75000% 21-01.02.27	1 890 000.00	1 710 450.00	0.03
USD MHP SA-REG-S *DEFAULTED* 7.75000% 17-10.05.24	5 580 000.00	2 817 900.00	0.05

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-REG-S 5.12500% 17-15.01.28	3 701 000.00	2 974 493.70	0.06
USD MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-REG-S 6.25000% 19-25.03.29	873 000.00	722 844.00	0.01
USD MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-REG-S 4.50000% 20-27.04.31	7 810 000.00	6 611 165.00	0.13
USD MINERVA LUXEMBOURG SA-REG-S 4.37500% 21-18.03.31	4 497 000.00	3 789 621.90	0.07
USD MINSUR SA-REG-S 4.50000% 21-28.10.31	6 892 000.00	6 125 265.00	0.12
USD MODERNLAND OVERSEAS PTE LTD-REG-S (PIK) 6.95000% 21-30.04.27	23 198.00	6 243.61	0.00
USD MONG DUONG FINANCE HOLDINGS BV-REG-S 5.12500% 19-07.05.29	2 820 000.00	2 507 685.00	0.05
USD MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 5.62500% 17-01.05.23	2 923 000.00	2 908 706.53	0.06
USD MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 8.65000% 23-19.01.28	5 657 000.00	5 912 187.27	0.11
USD MONGOLIAN MIN CORP/ENRGY RES LLC-REG-S 9.25000% 19-15.04.24	580 000.00	482 052.50	0.01
USD MOROCCO GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 4.00000% 20-15.12.50	2 715 000.00	1 852 987.50	0.04
USD MOROCCO, KINGDOM OF-REG-S 2.37500% 20-15.12.27	5 829 000.00	5 114 947.50	0.10
USD MOROCCO, KINGDOM OF-REG-S 3.00000% 20-15.12.32	2 287 000.00	1 826 741.25	0.03
USD MOVIDA EUROPE SA-REG-S 5.25000% 21-08.02.31	1 337 000.00	970 929.40	0.02
USD MTN MAURITIUS INVESTMENTS LTD-REG-S 4.75500% 14-11.11.24	2 047 000.00	1 993 010.38	0.04
USD MTN MAURITIUS INVESTMENTS LTD-REG-S 6.50000% 16-13.10.26	11 174 000.00	11 315 770.14	0.21
USD NAMIBIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 15-29.10.25	2 400 000.00	2 266 200.00	0.04
USD NATIONAL BANK OF UZBEKISTAN-REG-S 4.85000% 20-21.10.25	1 620 000.00	1 520 775.00	0.03
USD NATIONAL CENTRAL COOLING CO-REG-S 2.50000% 20-21.10.27	5 830 000.00	5 255 380.63	0.10
USD NBM US HOLDINGS INC-REG-S 7.00000% 19-14.05.26	600 000.00	597 276.00	0.01
USD NEMAK SAB DE CV-REG-S 3.62500% 21-28.06.31	2 094 000.00	1 682 005.50	0.03
USD NEXA RESOURCES SA-REG-S 6.50000% 20-18.01.28	3 139 000.00	3 098 585.37	0.06
USD NG PET R&P LATIN AMERICA SA-REG-S 3.50000% 21-02.08.28	7 530 000.00	6 400 500.00	0.12
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.87500% 17-16.02.32	2 351 000.00	1 775 005.00	0.03
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.14300% 18-23.02.30	7 760 000.00	5 897 600.00	0.11
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.69600% 18-23.02.38	1 982 000.00	1 364 854.75	0.03
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.62500% 18-21.11.25	1 500 000.00	1 368 749.99	0.03
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 8.74700% 18-21.01.31	2 168 000.00	1 758 790.00	0.03
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 9.24800% 18-21.01.49	2 110 000.00	1 598 325.00	0.03
USD NPC UKRENERGO-REG-S 6.87500% 21-09.11.28	3 196 000.00	556 903.00	0.01
USD OCP SA-REG-S 3.75000% 21-23.06.31	7 845 000.00	6 609 412.50	0.13
USD OCP SA-REG-S 5.12500% 21-23.06.51	9 483 000.00	7 349 325.00	0.14
USD OCP SA-REG-S 6.87500% 14-25.04.44	7 003 000.00	6 740 387.50	0.13
USD OIL AND GAS HOLDING CO BSCC/THE-REG-S 7.62500% 18-07.11.24	3 390 000.00	3 474 326.25	0.07
USD OIL AND GAS HOLDING CO BSCC/THE-REG-S 8.37500% 18-07.11.28	5 441 000.00	5 814 388.63	0.11
USD OLEODUCTO CENTRAL SA-REG-S 4.00000% 20-14.07.27	2 880 000.00	2 547 540.00	0.05
USD OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 7.00000% 21-25.01.51	21 623 000.00	21 866 258.75	0.41
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 4.75000% 16-15.06.26	10 899 000.00	10 649 004.19	0.20
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.37500% 17-08.03.27	16 997 000.00	16 941 759.75	0.32
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.50000% 17-08.03.47	1 366 000.00	1 302 822.50	0.02
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.62500% 18-17.01.28	4 650 000.00	4 669 762.50	0.09
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.75000% 18-17.01.48	18 775 000.00	18 422 968.75	0.35
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.25000% 21-25.01.31	18 150 000.00	18 760 293.76	0.36
USD ORAZUL ENERGY EGENOR SCA-REG-S 5.62500% 17-28.04.27	2 832 000.00	2 567 031.00	0.05
USD ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV-REG-S 2.87500% 21-11.05.31	1 232 000.00	990 528.00	0.02
USD ORYX FUNDING LTD-REG-S 5.80000% 21-03.02.31	2 798 000.00	2 753 931.50	0.05
USD OZTEL HOLDINGS SPC-REG-S 5.62500% 18-24.10.23	485 000.00	483 423.75	0.01
USD PAKISTAN WATER & POWER DEVEL AUTH-REG-S 7.50000% 21-04.06.31	1 540 000.00	490 682.50	0.01
USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 8.25000% 14-15.04.24	4 991 000.00	2 807 986.51	0.05
USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 8.25000% 15-30.09.25	1 617 000.00	824 847.87	0.02
USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 6.87500% 17-05.12.27	15 827 000.00	6 569 945.97	0.12
USD PANAMA, REPUBLIC OF 4.50000% 17-15.05.47	270 000.00	215 628.75	0.00
USD PANAMA, REPUBLIC OF 3.16000% 19-23.01.30	1 070 000.00	939 125.62	0.02
USD PANAMA, REPUBLIC OF 3.87000% 19-23.07.60	11 940 000.00	7 960 995.00	0.15
USD PANAMA, REPUBLIC OF 4.50000% 22-19.01.63	1 380 000.00	1 025 771.25	0.02
USD PANAMA, REPUBLIC OF 6.40000% 22-14.02.35	10 056 000.00	10 607 823.00	0.20
USD PAPUA NEW GUINEA GOVT INTL BOND-REG-S 8.37500% 18-04.10.28	1 859 000.00	1 677 515.12	0.03
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 6.10000% 14-11.08.44	5 140 000.00	5 081 532.49	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

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 4.70000% 17-27.03.27	617 000.00	608 516.25	0.01
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 5.60000% 18-13.03.48	4 730 000.00	4 269 711.88	0.08
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 5.40000% 19-30.03.50	5 049 000.00	4 494 556.69	0.09
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 4.95000% 20-28.04.31	15 616 000.00	15 126 048.00	0.29
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 2.73900% 21-29.01.33	17 419 000.00	13 998 343.88	0.26
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 3.84900% 22-28.06.33	5 270 000.00	4 610 591.25	0.09
USD PERIAMA HOLDINGS LLC/DE-REG-S 5.95000% 20-19.04.26	1 800 000.00	1 727 212.50	0.03
USD PERTAMINA PT-REG-S 5.62500% 13-20.05.43	2 611 000.00	2 505 417.68	0.05
USD PERTAMINA PT-REG-S 6.00000% 12-03.05.42	790 000.00	788 025.00	0.01
USD PERU LNG SRL-REG-S 5.37500% 18-22.03.30	4 460 000.00	3 662 775.00	0.07
USD PERU, REPUBLIC OF 2.84400% 19-20.06.30	4 618 000.00	3 979 561.50	0.08
USD PERU, REPUBLIC OF 3.30000% 21-11.03.41	255 000.00	191 616.56	0.00
USD PERU, REPUBLIC OF 3.00000% 21-15.01.34	4 454 000.00	3 608 575.13	0.07
USD PERU, REPUBLIC OF 3.60000% 21-15.01.72	360 000.00	241 380.00	0.00
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 5.25000% 12-24.10.42	394 000.00	349 379.50	0.01
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 4.87500% 19-17.07.49	2 980 000.00	2 432 052.50	0.05
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 4.32500% 15-28.05.25	200 000.00	198 772.00	0.00
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 4.55000% 16-29.03.26	5 890 000.00	5 898 010.40	0.11
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 4.40000% 18-01.03.28	15 290 000.00	15 177 006.90	0.29
USD PERUSAHAAN SBSN INDONESIA III-REG-S 4.70000% 22-06.06.32	1 975 000.00	1 975 217.25	0.04
USD PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.78000% 20-01.12.60	2 061 000.00	1 242 783.00	0.02
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 6.85000% 15-05.06.115	764 000.00	658 950.00	0.01
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 5.50000% 21-10.06.51	1 342 000.00	1 044 243.75	0.02
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 12.75000% 11-17.02.22	560 000.00	25 200.00	0.00
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 8.50000% 16-27.10.20	34 620 000.00	3 548 550.00	0.07
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 5.37500% 07-12.04.27	23 369 600.00	1 051 632.00	0.02
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 5.50000% 07-12.04.37	370 000.00	16 650.00	0.00
USD PETROLEOS DEL PERU SA-REG-S 4.75000% 17-19.06.32	9 488 000.00	7 234 599.99	0.14
USD PETROLEOS DEL PERU SA-REG-S 5.62500% 17-19.06.47	12 093 000.00	8 096 263.50	0.15
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.70000% 22-16.02.32	3 940 000.00	3 260 350.00	0.06
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.50000% 18-13.03.27	13 950 000.00	13 144 736.25	0.25
USD PETROLEOS MEXICANOS 5.35000% 18-12.02.28	7 250 000.00	6 307 500.00	0.12
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.35000% 18-12.02.48	8 831 000.00	5 761 344.40	0.11
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.50000% 18-23.01.29	1 111 000.00	1 003 288.55	0.02
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.49000% 20-23.01.27	1 610 000.00	1 506 074.50	0.03
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.84000% 20-23.01.30	985 000.00	854 093.50	0.02
USD PETROLEOS MEXICANOS 7.69000% 20-23.01.50	38 905 000.00	29 052 308.75	0.55
USD PETROLEOS MEXICANOS 5.95000% 20-28.01.31	25 230 000.00	20 143 632.00	0.38
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.95000% 20-28.01.60	7 081 000.00	4 845 882.35	0.09
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.87500% 22-16.10.25	2 625 000.00	2 624 015.63	0.05
USD PETRORIO LUXEMBOURG SARL-REG-S 6.12500% 21-09.06.26	1 000 000.00	962 062.50	0.02
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 9.50000% 05-02.02.30	1 023 000.00	1 304 437.53	0.02
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 2.95000% 20-05.05.45	684 000.00	501 960.24	0.01
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 3.20000% 21-06.07.46	250 000.00	186 590.00	0.00
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 5.60900% 22-13.04.33	4 850 000.00	5 159 721.00	0.10
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 5.95000% 22-13.10.47	4 570 000.00	4 998 940.20	0.09
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 5.00000% 23-17.07.33	217 000.00	220 821.37	0.00
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 5.50000% 23-17.01.48	1 226 000.00	1 270 577.36	0.02
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 4.20000% 22-29.03.47	289 000.00	253 561.38	0.00
USD PHOSAGRO BOND FUNDING LTD-REG-S 3.05000% 20-23.01.25	5 300 000.00	3 948 500.00	0.07
USD POLAND, REPUBLIC OF 3.00000% 12-17.03.23	2 549 000.00	2 538 326.06	0.05
USD POLAND, REPUBLIC OF 3.25000% 16-06.04.26	3 135 000.00	3 020 964.37	0.06
USD POSCO-REG-S 5.62500% 23-17.01.26	1 460 000.00	1 477 476.20	0.03
USD POSCO-REG-S 5.75000% 23-17.01.28	560 000.00	575 915.20	0.01
USD POSCO-REG-S 5.87500% 23-17.01.33	2 170 000.00	2 277 979.20	0.04
USD PROMIGAS SA ESP/GASES DEL PACIFIC-REG-S 3.75000% 19-16.10.29	2 060 000.00	1 708 049.00	0.03
USD PROSUS NV-144A 3.68000% 20-21.01.30	200 000.00	171 100.00	0.00
USD PROSUS NV-REG S 3.83200% 20-08.02.51	1 000 000.00	645 000.00	0.01

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)	
USD	PROSUS NV-REG-S 3.25700% 22-19.01.27	2 498 000.00	2 260 690.00	0.04
USD	PROSUS NV-REG-S 3.68000% 20-21.01.30	9 905 000.00	8 473 727.50	0.16
USD	PROSUS NV-REG-S 4.98700% 22-19.01.52	2 578 000.00	1 972 170.00	0.04
USD	PROVINCE OF CORDOBA-REG-S *DEFAULTED* 7.12500% 16-10.12.25	982 676.00	850 014.74	0.02
USD	PUMA INTL FINANCING-REG-S 5.12500% 17-06.10.24	400 000.00	386 000.00	0.01
USD	PUMA INTL FINANCING-REG-S 5.00000% 18-24.01.26	1 410 000.00	1 294 380.00	0.02
USD	QATAR PETROLEUM-REG-S 1.37500% 21-12.09.26	13 830 000.00	12 389 086.88	0.23
USD	QATAR PETROLEUM-REG-S 2.25000% 21-12.07.31	6 290 000.00	5 331 954.38	0.10
USD	QATAR PETROLEUM-REG-S 3.30000% 21-12.07.51	9 514 000.00	7 229 450.76	0.14
USD	QATAR PETROLEUM-REG-S 3.12500% 21-12.07.41	13 040 000.00	10 304 044.99	0.20
USD	QATAR, STATE OF-REG-S 4.50000% 18-23.04.28	6 400 000.00	6 520 000.00	0.12
USD	QATAR, STATE OF-REG-S 5.10300% 18-23.04.48	532 000.00	547 960.00	0.01
USD	QATAR, STATE OF-REG-S 4.00000% 19-14.03.29	2 200 000.00	2 188 725.00	0.04
USD	QATAR, STATE OF-REG-S 4.81700% 19-14.03.49	16 018 000.00	15 937 910.00	0.30
USD	QATAR, STATE OF-REG-S 3.40000% 20-16.04.25	11 063 000.00	10 764 299.00	0.20
USD	QATAR, STATE OF-REG-S 3.75000% 20-16.04.30	2 270 000.00	2 222 897.50	0.04
USD	QATAR, STATE OF-REG-S 4.40000% 20-16.04.50	20 007 000.00	18 856 597.50	0.36
USD	REC LTD-REG-S 3.50000% 19-12.12.24	900 000.00	863 887.50	0.02
USD	REDE D'OR FINANCE SARL-REG-S 4.50000% 20-22.01.30	4 364 000.00	3 825 318.75	0.07
USD	REDSUN PROPERTIES GRP-REG-S *DEFAULTED* 9.70000% 20-16.04.23	480 000.00	90 000.00	0.00
USD	RELIANCE INDUSTRIES LTD-REG-S 2.87500% 22-12.01.32	8 163 000.00	6 773 739.03	0.13
USD	RELIANCE INDUSTRIES LTD-REG-S 3.62500% 22-12.01.52	1 394 000.00	992 653.46	0.02
USD	RENEW WIND ENER AP2 / RENEW POWER-REG-S 4.50000% 21-14.07.28	400 000.00	337 500.00	0.01
USD	REPUBLIC OF AZERBAIJAN-REG-S 4.75000% 14-18.03.24	771 000.00	761 748.00	0.01
USD	RIO ENERGY SA/UGEN SA/UENSA SA-REG-S 6.87500% 18-01.02.25	1 526 000.00	1 154 323.63	0.02
USD	ROMANIA-REG-S 3.00000% 20-14.02.31	7 504 000.00	6 200 180.00	0.12
USD	ROMANIA-REG-S 3.00000% 22-27.02.27	3 028 000.00	2 740 340.00	0.05
USD	ROMANIA-REG-S 3.62500% 22-27.03.32	2 100 000.00	1 774 500.00	0.03
USD	ROMANIA-REG-S 4.00000% 20-14.02.51	3 456 000.00	2 425 006.08	0.05
USD	ROMANIA-REG-S 6.62500% 23-17.02.28	5 808 000.00	6 018 540.00	0.11
USD	ROMANIA-REG-S 7.12500% 23-17.01.33	4 728 000.00	5 011 680.00	0.09
USD	ROMANIA-REG-S 7.62500% 23-17.01.53	5 926 000.00	6 435 265.63	0.12
USD	ROMANIAN GOVT INT BND-REG-S 5.25000% 22-25.11.27	10 770 000.00	10 594 987.50	0.20
USD	RUSSIA, FEDERATION OF-REG-S 5.62500% 12-04.04.42	9 200 000.00	5 727 000.00	0.11
USD	SA GLOBAL SUKUK LTD-REG-S 1.60200% 21-17.06.26	915 000.00	839 356.95	0.02
USD	SA GLOBAL SUKUK LTD-REG-S 2.69400% 21-17.06.31	1 185 000.00	1 048 725.00	0.02
USD	SAGICOR FINANCIAL CO LTD-REG-S 5.30000% 21-13.05.28	2 457 000.00	2 358 646.29	0.04
USD	SAKA ENERGI INDONESIA PT-REG-S 4.45000% 17-05.05.24	230 000.00	221 662.50	0.00
USD	SAMARCO MINERACAO SA-REG-S 5.37500% 14-26.09.24	1 280 000.00	480 240.00	0.01
USD	SAMBA FUNDING LTD-REG-S 2.75000% 19-02.10.24	784 000.00	751 072.00	0.01
USD	SANDS CHINA LTD 2.55000% 22-08.03.27	2 910 000.00	2 561 818.50	0.05
USD	SANDS CHINA LTD 3.80000% 21-08.01.26	930 000.00	877 015.57	0.02
USD	SANDS CHINA LTD 4.37500% 21-18.06.30	300 000.00	273 303.15	0.01
USD	SANDS CHINA LTD 5.40000% 19-08.08.28	6 080 000.00	6 002 609.52	0.11
USD	SASOL FINANCING USA LLC 5.87500% 18-27.03.24	10 852 000.00	10 699 529.40	0.20
USD	SASOL FINANCING USA LLC 6.50000% 18-27.09.28	5 359 000.00	5 144 639.99	0.10
USD	SASOL FINANCING USA LLC 4.37500% 21-18.09.26	781 000.00	718 598.10	0.01
USD	SASOL FINANCING USA LLC 5.50000% 21-18.03.31	480 000.00	417 552.00	0.01
USD	SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 1.62500% 20-24.11.25	28 510 000.00	26 237 753.00	0.50
USD	SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 2.25000% 20-24.11.30	8 057 000.00	6 820 854.77	0.13
USD	SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 3.25000% 20-24.11.50	1 093 000.00	789 009.38	0.01
USD	SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 3.50000% 20-24.11.70	3 823 000.00	2 661 285.87	0.05
USD	SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 5.50000% 22-25.10.32	3 010 000.00	3 220 700.00	0.06
USD	SCENERY JOURNEY LTD-REG-S *DEFAULTED* 11.50000% 20-24.10.22	3 090 000.00	200 571.90	0.00
USD	SCENERY JOURNEY LTD-REG-S *DEFAULTED* 12.00000% 20-24.10.23	900 000.00	60 750.00	0.00
USD	SENEGAL, REPUBLIC OF-REG-S 6.75000% 18-13.03.48	2 641 000.00	1 974 147.50	0.04
USD	SERBIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 2.12500% 20-01.12.30	1 240 000.00	942 245.00	0.02
USD	SERBIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.25000% 23-26.05.28	980 000.00	997 150.00	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

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)	
USD	SERBIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.50000% 23-26.09.33	8 503 000.00	8 566 772.50	0.16
USD	SF HOLDING INVESTMENT-REG-S 2.37500% 21-17.11.26	830 000.00	753 357.80	0.01
USD	SF HOLDING INVESTMENT-REG-S 3.12500% 21-17.11.31	3 429 000.00	2 958 815.52	0.06
USD	SHAMARAN PETROLEUM-144A-REG-S 12.00000% 21-30.07.25	1 510 000.00	1 445 825.00	0.03
USD	SHELF DRILLING HOLDINGS LTD-REG-S 8.25000% 18-15.02.25	940 000.00	885 950.00	0.02
USD	SHIMAO PRPTY HLDG LTD-REG-S *DEFAULTED* 3.45000% 21-11.01.31	4 058 000.00	862 325.00	0.02
USD	SHINHAN CARD CO LTD-REG-S 1.37500% 20-19.10.25	650 000.00	582 237.50	0.01
USD	SHINHAN CARD CO LTD-REG-S 2.50000% 22-27.01.27	1 680 000.00	1 501 046.40	0.03
USD	SIGMA FINANCE NETHERLANDS BV-REG-S 4.87500% 18-27.03.28	882 000.00	859 288.50	0.02
USD	SILKNET JSC-REG-S 8.37500% 22-31.01.27	1 065 000.00	1 042 568.44	0.02
USD	SINO-OCEAN LAND TREASURE IV-REG-S 2.70000% 21-13.01.25	600 000.00	486 300.00	0.01
USD	SINOPEC GROUP OVERSEAS DEV12 LTD-REG-S 4.87500% 12-17.05.42	604 000.00	590 416.04	0.01
USD	SINOPEC GRP OVERSEAS DEV LTD-REG-S 2.15000% 20-13.05.25	940 000.00	886 138.00	0.02
USD	SINOPEC GRP OVERSEAS DEV LTD-REG-S 2.70000% 20-13.05.30	3 653 000.00	3 274 403.08	0.06
USD	SINOPEC GRP OVERSEAS DEV LTD-REG-S 3.35000% 20-13.05.50	273 000.00	204 384.18	0.00
USD	SINOPEC GUP OVERSEAS DEVPT-REG-S 2.30000% 21-08.01.31	600 000.00	517 212.00	0.01
USD	SK BATTERY AMERICA INC-REG-S 2.12500% 21-26.01.26	1 647 000.00	1 433 713.50	0.03
USD	SK HYNIX INC-REG-S 2.37500% 21-19.01.31	1 354 000.00	1 020 408.25	0.02
USD	SK HYNIX INC-REG-S 6.37500% 23-17.01.28	9 739 000.00	9 862 685.30	0.19
USD	SK HYNIX INC-REG-S 6.50000% 23-17.01.33	2 780 000.00	2 809 857.20	0.05
USD	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHIL-REG-S 4.37500% 14-28.01.25	940 000.00	931 352.00	0.02
USD	SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.37500% 14-24.07.44	3 240 000.00	2 515 050.00	0.05
USD	SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 4.87500% 16-14.04.26	2 350 000.00	2 291 250.00	0.04
USD	SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 4.85000% 17-27.09.27	500 000.00	480 625.00	0.01
USD	SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.65000% 17-27.09.47	1 134 000.00	867 510.00	0.02
USD	SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 4.85000% 19-30.09.29	7 810 000.00	7 107 100.00	0.13
USD	SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.75000% 19-30.09.49	10 176 000.00	7 733 760.00	0.15
USD	SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.87500% 22-20.04.32	2 987 000.00	2 766 708.75	0.05
USD	SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 7.30000% 22-20.04.52	14 964 000.00	13 467 600.00	0.25
USD	SOUTHERN COPPER CORP 6.75000% 10-16.04.40	1 060 000.00	1 208 267.50	0.02
USD	SOVEREIGN WEALTH SAMRUK-KAZYNA-REG-S 2.00000% 21-28.10.26	1 658 000.00	1 454 169.63	0.03
USD	SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULT* 5.87500% 12-25.07.22	1 669 000.00	605 012.50	0.01
USD	SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULT* 6.12500% 15-03.06.25	2 650 000.00	914 746.88	0.02
USD	SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULT* 6.82500% 16-18.07.26	10 993 000.00	3 760 293.07	0.07
USD	SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULT* 6.20000% 17-11.05.27	8 715 000.00	2 926 605.94	0.06
USD	SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULT* 5.75000% 18-18.04.23	1 260 000.00	429 423.75	0.01
USD	SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULT* 6.75000% 18-18.04.28	23 167 000.00	7 705 575.87	0.15
USD	SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULT* 6.85000% 19-14.03.24	8 787 000.00	2 980 989.75	0.06
USD	SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULT* 7.85000% 19-14.03.29	28 223 000.00	9 387 252.03	0.18
USD	SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULT* 6.35000% 19-28.06.24	2 340 000.00	794 576.25	0.01
USD	SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULT* 7.55000% 19-28.03.30	4 815 000.00	1 622 955.94	0.03
USD	SRI REJEKI ISMAN TBK PT-REG-S *DEFAULTED* 7.25000% 19-16.01.25	200 000.00	3 600.00	0.00
USD	ST MARYS CEMENT INC CANADA-REG-S 5.75000% 16-28.01.27	550 000.00	555 431.25	0.01
USD	STAR ENERGY GEOTHERMAL WAYANG-REG-S 6.75000% 18-24.04.33	850 000.00	670 356.77	0.01
USD	STATE AGENCY OF ROADS OF UKRAINE-REG-S 6.25000% 21-24.06.30	1 069 000.00	190 616.06	0.00
USD	STILLWATER MINING CO-REG-S 4.00000% 21-16.11.26	3 393 000.00	3 138 525.00	0.06
USD	STUDIO CITY FINANCE LTD-REG-S 6.00000% 20-15.07.25	5 660 000.00	5 318 702.00	0.10
USD	STUDIO CITY FINANCE LTD-REG-S 6.50000% 20-15.01.28	4 256 000.00	3 809 120.00	0.07
USD	STUDIO CITY FINANCE LTD-REG-S 5.00000% 21-15.01.29	2 330 000.00	1 860 650.62	0.04
USD	SUNAC CHINA HOLDINGS-REG-S *DEFAULTED* 8.35000% 18-19.04.23	1 365 000.00	392 437.50	0.01
USD	SUNAC CHINA HOLDINGS-REG-S *DEFAULTED* 6.50000% 20-09.07.23	1 270 000.00	365 125.00	0.01
USD	SUNAC CHINA HOLDINGS-REG-S *DEFAULTED* 7.00000% 20-09.07.25	410 000.00	116 850.00	0.00
USD	SUNAC CHINA HOLDINGS-REG-S *DEFAULTED* 6.65000% 20-03.08.24	530 000.00	151 050.00	0.00
USD	SUNAC CHINA HOLDINGS-REG-S *DEFAULTED* 5.95000% 21-26.04.24	1 055 000.00	300 675.00	0.01
USD	SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP-REG-S 5.95000% 23-17.07.26	340 000.00	341 227.40	0.01

USD	SUZANO AUSTRIA GMBH	6.00000%	19-15.01.29	7 590 000.00	7 587 723.00	0.14
USD	SUZANO AUSTRIA GMBH	5.00000%	19-15.01.30	750 000.00	709 687.50	0.01
USD	SUZANO AUSTRIA GMBH	3.75000%	20-15.01.31	1 530 000.00	1 305 166.50	0.02

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD SUZANO AUSTRIA GMBH 3.12500% 19-15.01.32	3 851 000.00	3 061 545.00	0.06
USD SUZANO AUSTRIA GMBH-REG-S 7.00000% 17-16.03.47	2 454 000.00	2 553 693.74	0.05
USD TELECOM ARGENTINA SA-REG-S 8.00000% 19-18.07.26	814 000.00	761 293.50	0.01
USD TELEFONICA CELULAR DEL PARAGUAY-REG-S 5.87500% 19-15.04.27	5 975 000.00	5 565 339.06	0.11
USD TELEFONICA MOVILES CHILE SA-REG-S 3.53700% 21-18.11.31	650 000.00	539 418.75	0.01
USD TERMOCANDELARIA POWER LTD-REG-S 7.87500% 19-30.01.29	11 552 000.00	8 348 486.00	0.16
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 2.80000% 16-21.07.23	980 000.00	961 012.50	0.02
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 3.15000% 16-01.10.26	12 551 000.00	11 260 506.18	0.21
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 4.10000% 16-01.10.46	6 724 000.00	4 613 504.50	0.09
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 6.75000% 18-01.03.28	3 615 000.00	3 627 182.55	0.07
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 6.00000% 18-15.04.24	1 070 000.00	1 059 968.75	0.02
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 4.75000% 21-09.05.27	910 000.00	840 043.75	0.02
USD TML HOLDINGS PTE LTD-REG-S 5.50000% 20-03.06.24	665 000.00	648 095.70	0.01
USD TOTAL PLAY TELECOMUNICACIONES SA-REG-S 6.37500% 21-20.09.28	1 082 000.00	909 707.73	0.02
USD TOWER BERSAMA INFRA TBK PT-REG-S 4.25000% 20-21.01.25	960 000.00	930 480.00	0.02
USD TOWER BERSAMA INFRA TBK PT-REG-S 2.75000% 21-20.01.26	400 000.00	367 950.00	0.01
USD TRANSNET SOC LTD-REG-S 8.25000% 23-06.02.28	8 283 000.00	8 303 707.50	0.16
USD TRANSPORTADORA DE GAS DEL SUR SA-REG-S 6.75000% 18-02.05.25	1 063 000.00	994 436.50	0.02
USD TRINIDAD & TOBAGO, REPUBLIC OF-REG-S 4.50000% 20-26.06.30	2 930 000.00	2 789 543.13	0.05
USD TRINIDAD GENERATION UNLTD-REG-S 5.25000% 16-04.11.27	4 944 000.00	4 767 252.00	0.09
USD TRUST F/1401-REG-S 4.86900% 19-15.01.30	2 657 000.00	2 436 269.73	0.05
USD TRUST F/1401-REG-S 5.25000% 14-15.12.24	2 801 000.00	2 758 634.87	0.05
USD TRUST F/1401-REG-S 5.25000% 15-30.01.26	850 000.00	827 156.25	0.02
USD TRUST F/1401-REG-S 6.39000% 19-15.01.50	5 732 000.00	4 981 537.90	0.09
USD TRUST F/1401-REG-S 6.95000% 14-30.01.44	1 169 000.00	1 073 142.00	0.02
USD TSMC ARIZONA CORP 2.50000% 21-25.10.31	802 000.00	679 277.96	0.01
USD TSMC ARIZONA CORP 4.25000% 22-22.04.32	2 408 000.00	2 362 416.56	0.04
USD TSMC GLOBAL LTD-REG-S 2.25000% 21-23.04.31	220 000.00	184 214.80	0.00
USD TULLOW OIL PLC-REG-S 10.25000% 21-15.05.26	2 452 000.00	2 102 590.00	0.04
USD TUPRAS TURKIYE PETROL-REG-S 4.50000% 17-18.10.24	3 114 000.00	2 962 776.38	0.06
USD TUPY OVERSEAS SA-REG-S 4.50000% 21-16.02.31	520 000.00	432 997.50	0.01
USD TURK SISE VE CAM FABRIKA-REG-S 6.95000% 19-14.03.26	900 000.00	871 200.00	0.02
USD TURK TELEKOMUNIKASYON AS-REG-S 4.87500% 14-19.06.24	400 000.00	376 000.00	0.01
USD TURK TELEKOMUNIKASYON AS-REG-S 6.87500% 19-28.02.25	526 000.00	498 154.88	0.01
USD TURKCELL ILETISIM HIZMETLERI AS-REG-S 5.80000% 18-11.04.28	500 000.00	432 862.50	0.01
USD TURKEY, REPUBLIC OF 6.00000% 11-14.01.41	3 280 000.00	2 349 300.00	0.04
USD TURKEY, REPUBLIC OF 3.25000% 13-23.03.23	500 000.00	498 750.00	0.01
USD TURKEY, REPUBLIC OF 4.87500% 13-16.04.43	1 501 000.00	947 506.25	0.02
USD TURKEY, REPUBLIC OF 4.87500% 16-09.10.26	3 320 000.00	2 929 900.00	0.06
USD TURKEY, REPUBLIC OF 6.00000% 17-25.03.27	1 920 000.00	1 742 400.00	0.03
USD TURKEY, REPUBLIC OF 5.75000% 17-11.05.47	15 549 000.00	10 378 957.50	0.20
USD TURKEY, REPUBLIC OF 6.35000% 19-10.08.24	3 330 000.00	3 262 983.75	0.06
USD TURKEY, REPUBLIC OF 5.60000% 19-14.11.24	4 740 000.00	4 550 400.00	0.09
USD TURKEY, REPUBLIC OF 4.25000% 20-13.03.25	1 075 000.00	999 750.00	0.02
USD TURKEY, REPUBLIC OF 5.25000% 20-13.03.30	6 160 000.00	4 920 300.00	0.09
USD TURKEY, REPUBLIC OF 5.95000% 20-15.01.31	3 190 000.00	2 623 775.00	0.05
USD TURKEY, REPUBLIC OF 6.50000% 21-20.09.33	1 790 000.00	1 463 325.00	0.03
USD TURKEY, REPUBLIC OF 9.87500% 22-15.01.28	20 680 000.00	21 222 850.00	0.40
USD TURKEY, REPUBLIC OF 9.37500% 23-19.01.33	7 228 000.00	7 092 474.99	0.13
USD TURKIYE GARANTI BANKASI AS-REG-S 5.87500% 17-16.03.23	1 869 000.00	1 865 262.00	0.04
USD TURKIYE IHRACAT KREDI BANKASI AS-REG-S 9.37500% 23-31.01.26	4 879 000.00	4 879 000.00	0.09
USD TURKIYE IS BANKASI -REG-S 6.12500% 17-25.04.24	2 103 000.00	2 060 019.94	0.04
USD TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO-REG-S 5.50000% 21-01.10.26	1 100 000.00	975 425.00	0.02
USD UKRAINE RAILWAYS VIA RL CPTL MKTS-REG-S 8.25000% 19-09.07.24	400 000.00	82 000.00	0.00
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S STEP-UP/DOWN 15-01.09.25	4 600 000.00	1 050 237.50	0.02
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S STEP UP/DOWN 15-01.09.26	3 330 000.00	715 533.75	0.01
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S STEP UP/DOWN 15-01.09.27	10 264 000.00	2 189 439.51	0.04
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.28	12 674 000.00	2 750 258.00	0.05

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.29	7 323 000.00	1 610 144.63	0.03
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S STEP UP/DOWN 17-25.09.34	17 768 000.00	3 509 180.00	0.07
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S STEP UP/DOWN 18-01.02.26	633 000.00	142 543.69	0.00
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 9.75000% 18-01.11.30	8 444 000.00	1 832 875.76	0.03
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 6.87600% 21-21.05.31	21 193 000.00	4 164 424.50	0.08
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.25300% 20-15.03.35	18 970 000.00	3 696 778.75	0.07
USD UNIGEL LUXEMBOURG SA-REG-S 8.75000% 19-01.10.26	2 695 000.00	2 716 560.00	0.05
USD UPL CORP LTD-REG-S 4.50000% 18-08.03.28	1 520 000.00	1 324 585.00	0.03
USD URUGUAY, REPUBLIC OF 4.12500% 12-20.11.45	615 000.00	577 177.50	0.01
USD URUGUAY, REPUBLIC OF 5.75000% 22-28.10.34	2 907 000.00	3 222 409.50	0.06
USD UZBEKNEFTGAZ JSC-REG-S 4.75000% 21-16.11.28	6 445 000.00	5 389 631.25	0.10
USD VALE OVERSEAS LTD 3.75000% 20-08.07.30	666 000.00	592 939.80	0.01
USD VALE OVERSEAS LTD 6.87500% 06-21.11.36	1 173 000.00	1 281 590.48	0.02
USD VEB FINANCE PLC-REG-S LPN 5.94200% 13-21.11.23	2 800 000.00	134 750.00	0.00
USD VEDANTA RESOURCES PLC-REG-S 7.12500% 13-31.05.23	500 000.00	469 937.50	0.01
USD VENEZUELA, REP. OF REG-S *DEFAULTED* 8.25000% 09-13.10.24	16 419 700.00	1 313 576.00	0.02
USD VENEZUELA, REP. OF-REG-S *DEFAULTED* 7.75000% 09-13.10.19	4 923 700.00	393 896.00	0.01
USD VEON HOLDINGS BV-REG-S 4.00000% 19-09.04.25	3 285 000.00	2 644 425.00	0.05
USD VIVO ENERGY INVEST BV-REG-S 5.12500% 20-24.09.27	890 000.00	829 257.50	0.02
USD VM HOLDING SA-REG-S 5.37500% 17-04.05.27	3 931 000.00	3 801 277.00	0.07
USD VOLCAN CIA MINERA SAA-REG-S 4.37500% 21-11.02.26	760 000.00	669 085.00	0.01
USD VTR COMUNICACION SPA-REG-S 5.12500% 20-15.01.28	3 334 000.00	2 315 046.24	0.04
USD VTR FINANCE NV-REG-S 6.37500% 20-15.07.28	4 934 000.00	2 039 616.92	0.04
USD WOORI BANK-REG-S 2.00000% 22-20.01.27	5 895 000.00	5 293 710.00	0.10
USD WYNN MACAU LTD-REG-S 5.12500% 19-15.12.29	726 000.00	607 734.60	0.01
USD WYNN MACAU LTD-REG-S 5.50000% 20-15.01.26	2 990 000.00	2 776 962.50	0.05
USD WYNN MACAU LTD-REG-S 5.62500% 20-26.08.28	7 726 000.00	6 836 130.13	0.13
USD XP INC-REG-S 3.25000% 21-01.07.26	400 000.00	358 325.00	0.01
USD YANLORD LAND HK CO LTD-REG-S 5.12500% 21-20.05.26	1 160 000.00	1 055 600.00	0.02
USD YPF SA-144A 8.50000% 20-23.03.25	700 000.00	412 425.78	0.01
USD YPF SA-REG-S 6.95000% 17-21.07.27	1 413 000.00	1 123 599.94	0.02
USD YPF SA-REG-S 7.00000% 17-15.12.47	1 958 000.00	1 368 152.50	0.03
USD YPF SA-REG-S 8.50000% 15-28.07.25	1 777 000.00	1 619 424.52	0.03
USD YPF SA-REG-S 8.50000% 19-27.06.29	1 725 000.00	1 373 315.62	0.03
USD YPF SA-REG-S 8.50000% 20-23.03.25	80 000.00	47 134.37	0.00
USD YPF SA-REG-S 8.75000% 14-04.04.24	170 000.00	114 002.00	0.00
USD YPF SA-REG-S STEP-UP 21-12.02.26	410 000.00	402 650.75	0.01
USD YPF SA-REG-S STEP-UP 21-30.06.29	1 018 970.00	879 052.69	0.02
USD YPF SA-REG-S STEP-UP 21-30.09.33	1 127 142.00	853 810.06	0.02
USD YUZHOU GROUP HOLDINGS-REG-S *DEFAULTED* 7.85000% 20-12.08.26	2 045 000.00	306 750.00	0.01
USD YUZHOU PROPERTIES-REG-S *DEFAULTED* 6.00000% 16-25.10.23	695 000.00	104 250.00	0.00
USD YUZHOU PROPERTIES-REG-S *DEFAULTED* 8.37500% 19-30.10.24	3 544 000.00	549 461.76	0.01
USD YUZHOU PROPERTIES-REG-S *DEFAULTED* 7.37500% 20-13.01.26	2 520 000.00	378 000.00	0.01
USD YUZHOU PROPERTIES-REG-S *DEFAULTED* 7.70000% 20-20.02.25	1 050 000.00	157 500.00	0.00
USD ZAMBIA, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 8.50000% 14-14.04.24	3 235 000.00	1 629 631.25	0.03
USD ZAMBIA, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 8.97000% 15-30.07.27	14 351 000.00	7 175 500.00	0.14
USD ZHENRO PROP GROUP *DEFAULTED* 8.00000% 22-06.03.23	150 000.00	10 950.00	0.00
USD ZHENRO PROP GROUP-REG-S *DEFAULTED* 7.87500% 20-14.04.24	3 718 000.00	325 325.00	0.01
USD ZHENRO PROP GROUP-REG-S *DEFAULTED* 8.35000% 20-10.03.24	680 000.00	59 500.00	0.00
USD ZHENRO PROP GROUP-REG-S *DEFAULTED* 8.30000% 20-15.09.23	200 000.00	17 500.00	0.00
USD ZHENRO PROP GROUP-REG-S *DEFAULTED* 7.35000% 20-05.02.25	2 800 000.00	245 000.00	0.00
USD ZORLU YENILENEBILIR ENERJI AS-REG-S 9.00000% 21-01.06.26	3 135 000.00	2 594 212.50	0.05
米ドル合計		2 770 908 949.45	52.45
ノート、固定利付債合計		2 908 103 845.90	55.05

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

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / 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	BIOCEANICO SOVEREIGN CERTIFICATE-REG-S 0.00000% 19-05.06.34	9 700 000.00	0.12
USD	ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 20-31.07.30	4 204 026.00	0.03
USD	RUTAS 2 AND 7 FINANCE LTD-REG-S 0.00000% 19-30.09.36	7 000 000.00	0.08
米ドル合計		12 219 708.51	0.23
ノート、ゼロ・クーポン合計		12 219 708.51	0.23
ノート、変動利付債			
USD			
USD	ABSA GROUP LTD-REG-S-SUB 6.375%/VAR 21-PRP	5 787 000.00	0.10
USD	ACCESS BANK PLC-SUB-REG-S 9.125%/VAR 21-PRP	310 000.00	0.01
USD	AES GENER SA-REG-S-SUB 7.125%/VAR 19-26.03.79	2 433 000.00	0.04
USD	ALFA BD ISS OJSC ALFA BK-REG-S-SUB 5.950%/VAR 19-15.04.30	4 650 000.00	0.01
USD	BANCO DE CREDITO DEL PERU-REG-S-SUB 3.125%/VAR 20-01.07.30	6 730 000.00	0.12
USD	BANCO DE CREDITO DEL PERU-REG-S-SUB 3.250%/VAR 21-30.09.31	1 140 000.00	0.02
USD	BANCO DO BRASIL CAYMAN-REG-S-SUB 6.250%/VAR 13-PRP	10 845 000.00	0.19
USD	BANCO DO BRASIL CAYMAN-REG-S-SUB 9.000%/VAR 14-PRP	1 605 000.00	0.03
USD	BANCO INTL PERU-REG-S 6.625%/3M LIBOR+576BP 14-19.03.29	490 000.00	0.01
USD	BANCO MER DEL NORTE SA/GRAND CY-REG-S-SUB 7.625%/VAR 17-PRP	3 370 000.00	0.06
USD	BANCO MERCANTIL DEL NORTE SA-REG-S-SUB 8.375%/VAR 20-PRP	1 397 000.00	0.03
USD	BANCO NACIONAL DE COM-REG-S-SUB 2.720%/VAR 21-11.08.31	2 680 000.00	0.04
USD	BANCO SANTANDER SA-REG-S-SUB 5.950%/VAR 18-01.10.28	1 860 000.00	0.04
USD	BANCOLOMBIA SA-SUB 4.875%/VAR 17-18.10.27	500 000.00	0.01
USD	BANGKOK BANK -REG-S-SUB 3.466%/VAR 21-23.09.36	2 330 000.00	0.04
USD	BANK HAPOALIM BM-144A-REG-S-SUB 3.255%/VAR 21-21.01.32	1 879 000.00	0.03
USD	BANK LEUMI ISRAEL BM-144A-REG-S-SUB 3.275%/VAR 20-29.01.31	12 871 000.00	0.22
USD	BBVA BANCOMER SA/TEXAS-REG-S-SUB 5.125%/VAR 18-18.01.33	17 209 000.00	0.31
USD	BLOSSOM JOY LTD-REG-S-SUB 3.100%/VAR 20-PRP	568 000.00	0.01
USD	BRASKEM NETHERLANDS FINANCE-REG-S-SUB 8.500%/VAR 20-23.01.81	1 758 000.00	0.03
USD	BURGAN BANK SAK-REG-S-SUB 2.750%/VAR 20-15.12.31	2 047 000.00	0.03
USD	CEMEX SAB DE CV-REG-S-SUB 5.125%/VAR 21-PRP	2 432 000.00	0.04
USD	CHINA DEV BANK FIN LEASING-REG-S-SUB 2.875%/VAR 20-28.09.30	2 114 000.00	0.04
USD	CHINA HUADIAN OVERSEAS DEVP MANG-REG-S 4.000%/VAR 19-PRP	222 000.00	0.00
USD	COMMERCIAL BK PS-REG-S-SUB 4.500%/VAR 21-PRP	1 644 000.00	0.03
USD	CORP FINANCIERA DE DESARROL-REG-S-SUB 5.250%/VAR 14-15.07.29	880 000.00	0.02
USD	CREDIT BK MOSCOW/CBOM FIN-REG-S-SUB 7.500%/VAR 17-05.10.27	7 380 000.00	0.02
USD	DP WORLD SALAAM-REG-S-SUB 6.000%/VAR 20-PRP	4 651 000.00	0.09
USD	EMIRATES NBD BANK PJSC-REG-S-SUB 4.250%/VAR 21-PRP	1 644 000.00	0.03
USD	GRUPO BIMBO SA DE CV-REG-S-SUB 5.950%/VAR 18-PRP	1 880 000.00	0.04
USD	HANWHA LIFE INSURANCE CO LT-REG-S-SUB 3.379%/VAR 22-04.02.32	6 629 000.00	0.11
USD	KYOBO LF INSURANCE CO LTD REG-S-SUB 5.900%/VAR 22-15.06.52	4 573 000.00	0.08
USD	MAF GLOBAL SECURITIES LTD-REG-S-SUB 7.875%/VAR 22-PRP	1 217 000.00	0.02
USD	MASHREQBANK PSC-REG-S-SUB 7.875%/VAR 22-24.02.33	500 000.00	0.01
USD	MINMETALS BOUNTIOUS FIN BVI LTD-REG-S 3.375%/VAR 20-PRP	2 278 000.00	0.04
USD	MODERN LAND CHINA CO LTD-REG-S (PIK) 9.000%/VAR 22-30.12.25	210 654.00	0.00
USD	MODERN LAND CHINA CO LTD (PIK) 9.000%/VAR 22-30.12.26	280 873.00	0.00
USD	NANYANG COMMERCIAL BANK LTD-REG-S-SUB 3.800%/VAR 19-20.11.29	6 190 000.00	0.11
USD	NBK SPC LTD-REG-S 1.625%/VAR 21-15.09.27	1 172 000.00	0.02
USD	NBK TIER 2 LTD-REG-S-SUB 2.500%/VAR 20-24.11.30	1 245 000.00	0.02
USD	OVERSEA-CHINESE BKNG-REG-S-SUB 1.832%/VAR 20-10.09.30	291 000.00	0.01
USD	PRUDENTIAL PLC-SUB-REG-S 2.950%/VAR 21-03.11.33	5 260 000.00	0.09
USD	STANDARD CHARTERED PLC-144A 7.767%/VAR 22-16.11.28	575 000.00	0.01
USD	STANDARD CHARTERED PLC-REG-S 7.767%/VAR 22-16.11.28	6 555 000.00	0.14
USD	STANDARD CHARTERED PLC-REG-S 6.170%/VAR 23-09.01.27	3 820 000.00	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 - エマージング・マーケット・デッド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD STANDARD CHARTERED PLC-REG-S 6.301%/VAR 23-09.01.29	3 240 000.00	3 378 031.81	0.06
USD TINKOFF BK JSC VIA TCS FIN-144A-REG-S-SUB 6.000%/VAR 21-PRP	1 800 000.00	770 400.00	0.02
USD TURKIYE GARANTI BANK AS-REG-S-SUB 6.125%/VAR 17-24.05.27	1 270 000.00	1 163 875.63	0.02
USD YAPI VE KREDI BANKASI AS-REG-S-SUB 7.875%/VAR 21-22.01.31	710 000.00	667 533.13	0.01
米ドル合計		133 582 397.61	2.53
ノート、変動利付債合計		133 582 397.61	2.53
中期債券、固定利付債			
EUR CETIN GROUP BV-REG-S 3.12500% 22-14.04.27	900 000.00	914 066.97	0.02
EUR EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 5.62500% 18-16.04.30	2 916 000.00	2 216 845.26	0.04
EUR EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 4.75000% 18-16.04.26	1 870 000.00	1 685 658.20	0.03
EUR EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 4.75000% 19-11.04.25	992 000.00	953 465.01	0.02
EUR EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 6.37500% 19-11.04.31	6 047 000.00	4 597 141.05	0.09
EUR INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 3.75000% 16-14.06.28	5 571 000.00	5 939 965.04	0.11
EUR KAZAKHSTAN, REPUBLIC OF-REG-S 1.50000% 19-30.09.34	1 890 000.00	1 502 656.75	0.03
EUR NE PROPERTY BV-REG-S 1.87500% 19-09.10.26	3 855 000.00	3 545 107.49	0.07
EUR NE PROPERTY BV-REG-S 2.00000% 22-20.01.30	965 000.00	734 433.76	0.01
EUR PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 5.12500% 16-15.03.23	3 520 000.00	3 822 513.71	0.07
EUR PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 0.87500% 19-17.05.27	5 080 000.00	4 900 939.10	0.09
EUR ROMANIA-REG-S 1.37500% 20-02.12.29	1 116 000.00	918 114.09	0.02
EUR ROMANIA-REG-S 1.75000% 21-13.07.30	2 700 000.00	2 158 931.64	0.04
EUR ROMANIA-REG-S 2.00000% 20-28.01.32	8 988 000.00	6 967 211.68	0.13
EUR ROMANIA-REG-S 2.12400% 19-16.07.31	220 000.00	175 016.96	0.00
EUR ROMANIA-REG-S 2.50000% 18-08.02.30	620 000.00	540 364.18	0.01
EUR ROMANIA-REG-S 2.75000% 21-14.04.41	40 000.00	25 902.30	0.00
EUR ROMANIA-REG-S 2.87500% 18-11.03.29	510 000.00	472 637.42	0.01
EUR ROMANIA-REG-S 2.87500% 21-13.04.42	861 000.00	558 715.71	0.01
EUR ROMANIA-REG-S 3.37500% 20-28.01.50	10 166 000.00	6 762 480.38	0.13
EUR ROMANIA-REG-S 3.50000% 19-03.04.34	500 000.00	420 165.60	0.01
EUR ROMANIA-REG-S 4.62500% 19-03.04.49	5 198 000.00	4 205 739.49	0.08
EUR ROMANIA-REG-S 6.62500% 22-27.09.29	1 080 000.00	1 205 776.16	0.02
EUR ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 2.00000% 21-14.04.33	7 520 000.00	5 594 460.77	0.11
EUR ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 3.75000% 22-07.02.34	8 597 000.00	7 387 720.72	0.14
EUR SERBIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 1.00000% 21-23.09.28	2 350 000.00	1 952 924.93	0.04
EUR SERBIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 2.05000% 21-23.09.36	2 001 000.00	1 316 543.28	0.02
ユーロ合計		71 475 497.65	1.35
USD ABQ FINANCE LTD-REG-S 3.12500% 19-24.09.24	1 988 000.00	1 916 307.76	0.04
USD ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC-REG-S 4.50000% 22-14.09.27	537 000.00	532 972.50	0.01
USD ABU DHABI GOVERNMENT INTERNAT-REG-S 3.00000% 21-15.09.51	6 010 000.00	4 401 573.75	0.08
USD ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO PJSC-REG-S 3.40000% 21-29.04.51	1 300 000.00	1 023 587.50	0.02
USD ABU DHABI PORTS CO PJSC-REG-S 2.50000% 21-06.05.31	901 000.00	766 300.50	0.01
USD ABU DHABI, EMIRATE OF-REG-S 3.87500% 20-16.04.50	2 317 000.00	1 986 827.50	0.04
USD ADANI REN KODSOPAR WARSOM-REG-S 4.62500% 19-15.10.39	650 000.00	425 268.03	0.01
USD ADCB FINANCE CAYMAN LTD-REG-S-SUB 4.50000% 13-06.03.23	360 000.00	358 605.00	0.01
USD AFRICA FINANCE CORP-REG-S 4.37500% 19-17.04.26	2 075 000.00	1 971 042.50	0.04
USD ALDAR SUKUK NO 2 LTD-REG-S 3.87500% 19-22.10.29	1 420 000.00	1 354 147.50	0.03
USD ANGOLAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 8.00000% 19-26.11.29	10 225 000.00	9 483 687.50	0.18
USD ANGOLAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 9.12500% 19-26.11.49	9 677 000.00	8 467 375.00	0.16
USD ARAB REPUBLIC OF EGYPT-REG-S 5.87500% 21-16.02.31	14 140 000.00	10 033 213.75	0.19
USD AXIATA SPV5 LABUAN LTD-REG-S 3.06400% 20-19.08.50	1 630 000.00	1 165 026.20	0.02
USD BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.25000% 21-25.01.33	1 780 000.00	1 568 625.00	0.03
USD BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.62500% 21-18.05.34	3 450 000.00	3 036 000.00	0.06
USD BAHRAIN, KINGDOM OF-REG-S 4.25000% 21-25.01.28	1 230 000.00	1 145 283.75	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 - エマージング・マーケット・デッド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD BANCO DE CREDITO E INVERSIONES SA-REG-S 2.87500% 21-14.10.31	2 055 000.00	1 729 154.06	0.03
USD BANGKOK BANK PCL/HONG KONG-REG-S 4.30000% 22-15.06.27	898 000.00	880 318.38	0.02
USD BANK MANDIRI PERSERO TBK PT-REG-S 3.75000% 19-11.04.24	1 409 000.00	1 384 342.50	0.03
USD BANK MANDIRI PERSERO TBK PT-REG-S 4.75000% 20-13.05.25	2 236 000.00	2 216 155.50	0.04
USD BANK MUSCAT SAOG-REG-S 4.75000% 21-17.03.26	1 616 000.00	1 562 773.00	0.03
USD BANK NEGARA INDONESIA PERSERO-REG-S-SUB 3.75000% 21-30.03.26	2 790 000.00	2 615 931.90	0.05
USD BANK OF CHINA LTD-REG-S-SUB 5.00000% 14-13.11.24	1 000 000.00	999 880.00	0.02
USD BOC AVIATION LTD-REG-S 3.50000% 17-18.09.27	391 000.00	365 565.45	0.01
USD BOC AVIATION LTD-REG-S 3.00000% 19-11.09.29	2 774 000.00	2 458 263.32	0.05
USD BSF FINANCE-REG-S 5.50000% 22-23.11.27	1 662 000.00	1 699 395.00	0.03
USD CATHAY PACIFIC MTN FINANCING HK LT-REG-S 4.87500% 21-17.0.26	300 000.00	289 650.00	0.01
USD CBQ FINANCE LTD-REG-S 2.00000% 21-12.05.26	1 243 000.00	1 132 916.82	0.02
USD CHINA CINDA FINANCE 2017 I LTD-REG-S 4.75000% 18-08.02.28	700 000.00	676 725.00	0.01
USD CMB INTERNATIONAL LEASING MGT LTD-REG-S 1.87500% 20-12.08.25	960 000.00	875 580.00	0.02
USD CMB INTERNATIONAL LEASING MGT LTD-REG-S 2.75000% 20-12.08.30	830 000.00	679 458.75	0.01
USD DIB SUKUK LTD-REG-S 1.95900% 21-22.06.26	1 134 000.00	1 030 026.37	0.02
USD DOHA FINANCE LTD-REG-S 2.37500% 21-31.03.26	475 000.00	435 010.93	0.01
USD DP WORLD CRESCENT LTD-REG-S 4.84800% 18-26.09.28	1 060 000.00	1 068 811.25	0.02
USD DP WORLD CRESCENT LTD-REG-S 3.87500% 19-18.07.29	1 069 000.00	1 024 770.12	0.02
USD DP WORLD CRESCENT LTD-REG-S 3.75000% 19-30.01.30	391 000.00	369 812.69	0.01
USD DP WORLD PLC-144A 6.85000% 07-02.07.37	330 000.00	371 724.37	0.01
USD DP WORLD PLC-REG-S 5.62500% 18-25.09.48	1 320 000.00	1 312 822.51	0.02
USD DP WORLD PLC-REG-S 6.85000% 07-02.07.37	3 900 000.00	4 393 106.24	0.08
USD DUBAI, GOVERNMENT OF-REG-S 3.90000% 20-09.09.50	5 051 000.00	3 827 079.56	0.07
USD EASTERN AND SOUTHERN AFRICAN TRAD-REG-S 4.87500% 19-23.05.24	1 883 000.00	1 833 816.04	0.03
USD EASTERN AND SOUTHERN AFRICAN TRAD-REG-S 4.12500% 21-30.06.28	2 344 000.00	2 018 605.92	0.04
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 8.50000% 17-31.01.47	10 349 000.00	7 296 045.00	0.14
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.50000% 17-31.01.27	1 000 000.00	900 000.00	0.02
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.60030% 19-01.03.29	6 587 000.00	5 467 210.00	0.10
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 8.70020% 19-01.03.49	7 206 000.00	5 080 230.00	0.10
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.05290% 19-15.01.32	5 640 000.00	4 229 295.00	0.08
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 8.15000% 19-20.11.59	10 865 000.00	7 361 037.50	0.14
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.50000% 21-16.02.61	6 200 000.00	4 014 500.00	0.08
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.30000% 21-30.09.33	2 730 000.00	1 992 900.00	0.04
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 8.75000% 21-30.09.51	1 701 000.00	1 203 457.50	0.02
USD EMAAR SUKUK LTD-REG-S 3.87500% 19-17.09.29	998 000.00	950 470.25	0.02
USD EMIRATES DEVELOPMENT BANK PJSC-REG-S 3.51600% 19-06.03.24	800 000.00	781 900.00	0.01
USD EMIRATES NBD BANK PJSC-REG-S 2.62500% 20-18.02.25	765 000.00	728 327.82	0.01
USD EMIRATES NBD PJSC-REG-S 5.62500% 22-21.10.27	1 928 000.00	2 000 300.00	0.04
USD EQUATE PETROCHEMICAL BV-REG-S 2.62500% 21-28.04.28	389 000.00	345 675.13	0.01
USD ESKOM HOLDINGS SOC LTD-REG-S 8.45000% 18-10.08.28	2 979 000.00	2 852 392.50	0.05
USD ESKOM HOLDINGS SOC LTD-REG-S 6.35000% 18-10.08.28	7 015 000.00	6 708 093.75	0.13
USD EXPORT-IMPORT BANK OF INDIA-REG-S 2.25000% 21-13.01.31	638 000.00	518 298.44	0.01
USD FAR EAST HORIZON LTD-REG-S 4.25000% 21-26.10.26	5 265 000.00	4 619 379.37	0.09
USD FINANCE DEPTMT GOVT OF SHARJAH-REG-S 4.00000% 20-28.07.50	4 430 000.00	2 899 711.88	0.05
USD FINANCE DEPTMT GOVT OF SHARJAH-REG-S 3.62500% 21-10.03.33	2 010 000.00	1 676 214.37	0.03
USD FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 5.12500% 22-13.10.27	1 835 000.00	1 873 993.75	0.04
USD FREEPORT INDONESIA-REG-S PT 4.76300% 22-14.04.27	1 100 000.00	1 067 121.00	0.02
USD FREEPORT INDONESIA-REG-S 5.31500% 22-14.04.32	6 413 000.00	6 077 022.93	0.11
USD GC TREASURY CENTER CO LTD-144A 4.40000% 22-30.03.32	4 990 000.00	4 573 023.13	0.09
USD GC TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 2.98000% 21-18.03.31	3 071 000.00	2 560 062.37	0.05
USD GC TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 4.30000% 21-18.03.51	1 830 000.00	1 380 277.50	0.03
USD GC TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 4.40000% 22-30.03.32	2 829 000.00	2 592 601.69	0.05
USD GLP CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 2.95000% 21-29.03.26	4 726 000.00	3 724 088.00	0.07
USD GOL FINANCE SA-REG-S 8.00000% 20-30.06.26	2 895 000.00	1 980 903.75	0.04
USD GOODMAN HK FINANCE-REG-S 3.00000% 20-22.07.30	825 000.00	705 802.32	0.01
USD GREENKO POWER II LTD-REG-S 4.30000% 21-13.12.28	8 371 000.00	6 895 088.06	0.13
USD GULF INTERNATIONAL BANK BSC-REG-S 2.37500% 20-23.09.25	400 000.00	368 575.00	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

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD HONG KONG GOVERNMENT INTERNATIONA-REG-S 5.25000% 23-11.01.53	284 000.00	317 040.50	0.01
USD HONGKONG ELECTRIC FINANCE LTD-REG-S 1.87500% 20-27.08.30	1 006 000.00	816 942.42	0.02
USD HPCL MITTAL ENERGY LTD-REG-S 5.45000% 19-22.10.26	1 394 000.00	1 337 194.50	0.03
USD HUARONG FINANCE 2017 CO-REG-S 4.25000% 17-07.11.27	1 070 000.00	937 587.50	0.02
USD HUARONG FINANCE II CO LTD-REG-S 5.50000% 15-16.01.25	5 965 000.00	5 772 255.95	0.11
USD HUARONG FINANCE-REG-S 3.75000% 19-29.05.24	3 812 000.00	3 642 366.00	0.07
USD HUARONG FINANCE-REG-S 4.50000% 19-29.05.29	800 000.00	681 150.00	0.01
USD HUARONG FINANCE-REG-S 3.25000% 19-13.11.24	520 000.00	483 600.00	0.01
USD HUARONG FINANCE-REG-S 3.87500% 19-13.11.29	4 480 000.00	3 626 022.40	0.07
USD HUARONG FINANCE-REG-S 3.37500% 20-24.02.30	910 000.00	705 989.38	0.01
USD HUARONG FINANCE-REG-S 2.12500% 20-30.09.23	2 453 000.00	2 368 371.50	0.04
USD HUARONG FINANCE-REG-S 3.62500% 20-30.09.30	1 330 000.00	1 032 661.88	0.02
USD HUTAMA KARYA PERSERO PT-REG-S 3.75000% 20-11.05.30	3 664 000.00	3 354 392.00	0.06
USD HYUNDAI CAPITAL SERVICES INC-REG-S 1.25000% 21-08.02.26	709 000.00	623 166.69	0.01
USD INDIAN RAILWAY FINANCE CORP LTD-REG-S 3.24900% 20-13.02.30	2 100 000.00	1 839 206.25	0.03
USD INDIAN RAILWAY FINANCE CORP LTD-REG-S 3.95000% 20-13.02.50	1 160 000.00	883 267.50	0.02
USD INDIAN RAILWAY FINANCE CORP LTD-REG-S 3.57000% 22-21.01.32	3 118 000.00	2 727 189.88	0.05
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 6.75000% 14-15.01.44	4 270 000.00	4 964 344.70	0.09
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 5.95000% 15-08.01.46	725 000.00	789 479.69	0.01
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 4.75000% 17-18.07.47	533 000.00	506 408.63	0.01
USD IOI INVESTMENT L BHD-REG-S 3.37500% 21-02.11.31	2 460 000.00	1 898 505.00	0.04
USD ISRAEL ELECTRIC CORP LTD-144A-REG-S 4.25000% 18-14.08.28	14 785 000.00	14 113 206.56	0.27
USD KAZAKHSTAN, REPUBLIC OF-REG-S 6.50000% 15-21.07.45	960 000.00	1 017 600.00	0.02
USD KINGDOM OF SAUDI ARABIA-REG-S 2.25000% 21-02.02.33	2 594 000.00	2 118 649.50	0.04
USD KSA SUKUK LTD-REG-S 4.30300% 18-19.01.29	6 090 000.00	6 085 432.50	0.11
USD KSA SUKUK LTD-REG-S 2.96900% 19-29.10.29	10 820 000.00	9 954 400.00	0.19
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 8.25000% 06-12.04.21	5 777 000.00	367 561.63	0.01
USD LEBANON, REPUBLIC OF *DEFAULT* 6.37500% 10-09.03.20	26 577 000.00	1 707 572.25	0.03
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.10000% 10-04.10.22	3 222 000.00	201 375.00	0.00
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.60000% 11-27.11.26	6 260 000.00	391 250.00	0.01
USD LEBANON, REPUBLIC OF *DEFAULTED* 6.15000% 13-19.06.20	8 277 000.00	531 797.25	0.01
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 5.80000% 14-14.04.20	2 179 000.00	140 000.75	0.00
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 7.00000% 17-20.03.28	270 000.00	17 178.75	0.00
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 7.15000% 17-20.11.31	180 000.00	11 565.00	0.00
USD LI & FUNG LTD-REG-S 4.50000% 20-18.08.25	970 000.00	909 253.75	0.02
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 2.87500% 19-07.11.29	5 110 000.00	4 609 539.38	0.09
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 3.70000% 19-07.11.49	3 326 000.00	2 741 455.50	0.05
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 3.95000% 20-21.05.50	2 910 000.00	2 480 775.00	0.05
USD MDGH GMTN RSC LTD-REG-S 3.00000% 22-28.03.27	3 640 000.00	3 406 357.50	0.06
USD MEGLOBAL CANADA INC-REG-S 5.87500% 20-18.05.30	2 185 000.00	2 263 250.31	0.04
USD MEGLOBAL CANADA INC-REG-S 5.00000% 20-18.05.25	4 662 000.00	4 636 359.00	0.09
USD METROPOLITAN BANK & TRUST CO-REG-S 2.12500% 20-15.01.26	1 885 000.00	1 724 539.37	0.03
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.75000% 12-08.03.44	556 000.00	477 465.00	0.01
USD MEXICO, UNITED STATES OF 5.55000% 14-21.01.45	620 000.00	586 675.00	0.01
USD MEXICO, UNITED STATES OF 3.75000% 21-19.04.71	9 942 000.00	6 685 995.00	0.13
USD MISC CAPITAL TWO LABUAN LTD-REG-S 3.75000% 22-06.04.27	900 000.00	837 168.75	0.02
USD MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 8.75000% 17-09.03.24	6 728 000.00	6 746 081.50	0.13
USD MTR CORP LTD-REG-S 1.62500% 20-19.08.30	1 000 000.00	819 283.91	0.02
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 6.50000% 17-28.11.27	11 041 000.00	9 053 620.00	0.17
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.62500% 17-28.11.47	6 377 000.00	4 168 963.75	0.08
USD NIGERIA, FEDERAL REP OF-REG-S 6.12500% 21-28.09.28	1 100 000.00	852 500.00	0.02
USD NIGERIA, FEDERAL REP OF-REG-S 7.37500% 21-28.09.33	11 086 000.00	7 912 632.50	0.15
USD NIGERIA, FEDERAL REP OF-REG-S 8.25000% 21-28.09.51	5 558 000.00	3 737 755.00	0.07
USD NIGERIA, FEDERAL REP OF-REG-S 8.37500% 22-24.03.29	4 906 000.00	4 084 245.00	0.08
USD NTPC LTD-REG-S 4.50000% 18-19.03.28	360 000.00	347 580.00	0.01
USD NWD MTN LTD-REG-S 4.50000% 20-19.05.30	206 000.00	180 721.02	0.00
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 4.87500% 19-01.02.25	4 930 000.00	4 870 840.00	0.09
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.00000% 19-01.08.29	3 292 000.00	3 361 543.50	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

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD OVERSEA-CHINESE BANKING CORP-REG-S-SUB 4.25000% 14-19.06.24	1 300 000.00	1 288 148.55	0.02
USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 6.00000% 21-08.04.26	7 424 000.00	3 193 136.64	0.06
USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 7.37500% 21-08.04.31	3 716 000.00	1 523 968.76	0.03
USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 8.87500% 21-08.04.51	3 934 000.00	1 612 940.00	0.03
USD PANAMA, REPUBLIC OF 9.37500% 99-01.04.29	7 270 000.00	8 759 441.25	0.17
USD PERTAMINA PERSERO PT-REG-S 4.70000% 19-30.07.49	1 300 000.00	1 102 806.25	0.02
USD PERTAMINA PERSERO PT-REG-S 4.17500% 20-21.01.50	3 523 000.00	2 804 748.38	0.05
USD PERTAMINA PERSERO PT-REG-S 4.15000% 20-25.02.60	3 170 000.00	2 356 300.63	0.04
USD PERTAMINA PT-REG-S 6.45000% 14-30.05.44	1 678 000.00	1 743 861.50	0.03
USD PERTAMINA PT-REG-S 6.50000% 18-07.11.48	1 806 000.00	1 870 113.00	0.04
USD PERU PERS PT PERSUSAHAAN LIST NEG-REG-S 4.00000% 20-30.06.50	3 130 000.00	2 301 136.88	0.04
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 4.12500% 17-15.05.27	1 700 000.00	1 643 475.00	0.03
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 5.25000% 17-15.05.47	7 863 000.00	6 810 340.89	0.13
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 5.45000% 18-21.05.28	1 253 000.00	1 263 415.56	0.02
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 6.15000% 18-21.05.48	7 067 000.00	6 840 856.00	0.13
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 3.37500% 19-05.02.30	3 991 000.00	3 490 378.94	0.07
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 4.37500% 19-05.02.50	823 000.00	635 407.43	0.01
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 4.45000% 19-20.02.29	13 380 000.00	13 252 890.00	0.25
USD PETROLEOS MEXICANOS 4.50000% 16-23.01.26	2 066 000.00	1 921 896.50	0.04
USD PETROLEOS MEXICANOS 5.62500% 16-23.01.46	100 000.00	63 375.00	0.00
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.87500% 17-04.08.26	14 790 000.00	14 392 078.02	0.27
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.75000% 17-21.09.47	7 391 000.00	5 109 028.75	0.10
USD PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 4.50000% 15-18.03.45	900 000.00	836 016.12	0.02
USD PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 4.55000% 20-21.04.50	4 824 000.00	4 481 194.49	0.08
USD PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 4.80000% 20-21.04.60	3 199 000.00	3 075 638.56	0.06
USD PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 3.40400% 21-28.04.61	1 143 000.00	834 604.32	0.02
USD PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 2.48000% 21-28.01.32	968 000.00	818 473.04	0.02
USD PHILIPPINE NATIONAL BANK-REG-S 3.28000% 19-27.09.24	3 512 000.00	3 353 521.00	0.06
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 10.62500% 00-16.03.25	470 000.00	528 801.70	0.01
USD POLAND, REPUBLIC OF 5.50000% 22-16.11.27	1 458 000.00	1 504 962.18	0.03
USD POLAND, REPUBLIC OF 5.75000% 22-16.11.32	8 415 000.00	9 046 040.85	0.17
USD POWER FINANCE CORP LTD-REG-S 6.15000% 18-06.12.28	300 000.00	306 999.00	0.01
USD PROSUS NV-REG-S 3.06100% 21-13.07.31	985 000.00	782 336.25	0.01
USD PTT TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 3.70000% 20-16.07.70	3 650 000.00	2 451 887.50	0.05
USD PTTEP TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 2.99300% 20-15.01.30	1 490 000.00	1 319 860.63	0.02
USD QNB FINANCE LTD-REG-S 3.50000% 19-28.03.24	4 663 000.00	4 567 699.94	0.09
USD QNB FINANCE LTD-REG-S 2.75000% 20-12.02.27	1 200 000.00	1 117 350.00	0.02
USD QNB FINANCE LTD-REG-S 2.62500% 20-12.05.25	9 315 000.00	8 848 085.62	0.17
USD QNB FINANCE LTD-REG-S 1.62500% 20-22.09.25	760 000.00	698 392.50	0.01
USD QNB FINANCE LTD-REG-S 1.37500% 21-26.01.26	3 965 000.00	3 564 287.19	0.07
USD QTEL INTERNATIONAL FINANCE LTD-REG-S 2.62500% 21-08.04.31	5 671 000.00	4 976 302.50	0.09
USD REC LTD-REG-S 2.25000% 21-01.09.26	1 574 000.00	1 392 793.25	0.03
USD REPUBLIC OF UZBEKISTAN BOND-REG-S 5.37500% 19-20.02.29	2 395 000.00	2 233 786.56	0.04
USD REPUBLIC OF UZBEKISTAN BOND-REG-S 4.75000% 19-20.02.24	1 500 000.00	1 464 656.25	0.03
USD REPUBLIC OF UZBEKISTAN BOND-REG-S 3.70000% 20-25.11.30	760 000.00	626 667.50	0.01
USD RIZAL COMMERCIAL BANKING CORP-REG-S 3.00000% 19-11.09.24	833 000.00	793 068.06	0.01
USD ROMANIA -REG-S 6.00000% 22-25.05.34	23 098 000.00	22 780 402.50	0.43
USD ROMANIA-REG-S 6.12500% 14-22.01.44	244 000.00	234 545.00	0.00
USD SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 2.87500% 19-16.04.24	2 895 000.00	2 819 006.25	0.05
USD SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 3.50000% 19-16.04.29	19 470 000.00	18 238 522.50	0.35
USD SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 4.25000% 19-16.04.39	8 966 000.00	8 222 046.15	0.16
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-144A 3.25000% 21-17.11.51	4 760 000.00	3 480 155.00	0.07
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 4.62500% 17-04.10.47	5 539 000.00	5 029 412.00	0.09
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 5.00000% 18-17.04.49	1 501 000.00	1 433 736.43	0.03
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 2.75000% 20-03.02.32	4 480 000.00	3 953 040.00	0.07
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 3.75000% 20-21.01.55	10 788 000.00	8 544 770.25	0.16
USD SAUDI GOVERNMENT INTER-REG-S 4.50000% 20-22.04.60	3 416 000.00	3 063 298.00	0.06
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 3.45000% 21-02.02.61	6 767 000.00	4 900 999.75	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

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 4.75000% 23-18.01.28	12 575 000.00	12 719 612.50	0.24
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 4.87500% 23-18.07.33	5 186 000.00	5 277 727.37	0.10
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 5.00000% 23-18.01.53	12 688 000.00	12 085 320.00	0.23
USD SHARJAH SUKUK PROGRAM LTD-REG-S 4.22600% 18-14.03.28	2 260 000.00	2 151 661.25	0.04
USD SHARJAH SUKUK PROGRAM LTD-REG-S 3.85400% 19-03.04.26	1 330 000.00	1 269 568.12	0.02
USD SHINHAN BANK CO LTD-REG-S-SUB 4.37500% 22-13.04.32	8 882 000.00	8 145 349.13	0.15
USD SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD-REG-S 4.40000% 21-13.03.24	6 580 000.00	6 344 765.00	0.12
USD SINGAPORE AIRLINES-REG-S 3.37500% 22-19.01.29	1 100 000.00	1 006 489.00	0.02
USD ST ENGINEERING URBAN SOLUTIONS US-REG-S 3.37500% 22-05.05.27	4 350 000.00	4 159 992.00	0.08
USD STATE OIL OF THE AZERBAIJAN REP-REG-S 4.75000% 13-13.03.23	2 020 000.00	2 009 647.50	0.04
USD SUN HUNG KAI PROP CAP MRKT LTD-REG-S 2.87500% 20-21.01.30	200 000.00	176 598.00	0.00
USD SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD-REG-S 3.75000% 19-25.02.29	1 801 000.00	1 698 557.36	0.03
USD TBC BANK JSC-REG-S 5.75000% 19-19.06.24	1 637 000.00	1 599 962.87	0.03
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.97500% 19-11.04.29	690 000.00	649 807.50	0.01
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.24000% 20-03.06.50	536 000.00	366 925.50	0.01
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.29000% 20-03.06.60	238 000.00	154 742.84	0.00
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.68000% 21-22.04.41	750 000.00	593 497.50	0.01
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.84000% 21-22.04.51	200 000.00	152 482.00	0.00
USD THAI OIL TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 4.62500% 18-20.11.28	370 000.00	351 338.13	0.01
USD THAI OIL TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 5.37500% 18-20.11.48	1 157 000.00	983 253.31	0.02
USD THAI OIL TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 3.75000% 20-18.06.50	2 708 000.00	1 798 789.00	0.03
USD UAE INTERNATIONAL GOVNT BOND-REG-S 4.05000% 22-07.07.32	2 184 000.00	2 159 839.51	0.04
USD UAE INTERNATIONAL GOVNT BOND-REG-S 4.95100% 22-07.07.52	8 147 000.00	8 201 992.25	0.16
USD UNION BANK OF THE PHILIPPINES-REG-S 2.12500% 20-22.10.25	832 000.00	759 616.00	0.01
USD VEON HOLDINGS BV-REG-S 3.37500% 20-25.11.27	760 000.00	516 800.00	0.01
USD WHARF REIC FIN BV1-REG-S 3.50000% 18-17.01.28	600 000.00	563 496.00	0.01
USD WOORI BANK-REG-S 4.87500% 23-26.01.28	200 000.00	201 328.00	0.00
USD YAPI VE KREDI BANKASI AS-REG-S 8.25000% 19-15.10.24	5 730 000.00	5 757 933.75	0.11
USD YES BANK IFSC BANKING UNIT BR-REG-S 3.75000% 18-06.02.23	1 325 000.00	1 317 447.50	0.02
米ドル合計		645 248 510.39	12.21
中期債券、固定利付債合計		716 724 008.04	13.56
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	3 576 771.27	0.07
ユーロ合計		3 576 771.27	0.07
USD			
USD AIA GROUP LTD-REG-S-SUB 2.700%/VAR 21-PRP	6 308 000.00	5 709 757.47	0.11
USD AXIS BANK LTD/GIFT CITY-REG-S-SUB 4.100%/VAR 21-PRP	650 000.00	572 578.50	0.01
USD BANGKOK BANK PCL/HONG KONG-REG-S-SUB 3.733%/VAR 19-25.09.34	7 973 000.00	6 987 836.18	0.13
USD BANK OF EAST ASIA LTD-REG-S-SUB 5.825%/VAR 20-PRP	2 373 000.00	2 258 977.35	0.04
USD CENTRAL PLAZA DEVELOPMENT LTD-REG-S-SUB 5.750%/VAR 19-PRP	500 000.00	417 450.00	0.01
USD DBS GROUP HOLDINGS LTD-REG-S-SUB 4.520%/VAR 18-11.12.28	1 284 000.00	1 273 008.96	0.02
USD DBS GROUP HOLDINGS LTD-REG-S-SUB 3.300%/VAR 20-PRP	2 665 000.00	2 518 007.01	0.05
USD HUARONG FINANCE 2017 CO-REG-S 3M LIBOR+132.5BP 18-03.07.23	619 000.00	613 893.25	0.01
USD HUARONG FINANCE 2019 CO LTD-REG-S 3M LIBOR+112BP 20-24.02.23	670 000.00	667 487.50	0.01
USD KOOKMIN BANK-REG-S-SUB 4.350%/VAR 19-PRP	509 000.00	491 280.43	0.01
USD QIB SUKUK LTD-REG-S 3M LIBOR+135BP 20-07.02.25	2 120 000.00	2 119 735.00	0.04
USD SHINHAN FIN GROUP CO LTD-REG-S-SUB 3.340%/VAR 19-05.02.30	955 000.00	900 863.43	0.02
USD UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S-SUB 3.750%/VAR 19-15.04.29	1 200 000.00	1 176 358.08	0.02
USD UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S-SUB 2.000%/VAR 21-14.10.31	1 300 000.00	1 152 892.52	0.02
USD UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S-SUB 3.863%/VAR 22-07.10.32	4 745 000.00	4 493 049.99	0.09
USD UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S-SUB 3.875%/VAR 17-PRP	870 000.00	855 291.61	0.02
米ドル合計		32 208 467.28	0.61
中期債券、変動利付債合計		35 785 238.55	0.68

添付の注記は当財務書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

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)	
債券、固定利付債				
EUR				
EUR	ALTICE FINANCING SA-REG-S 4.25000% 21-15.08.29	4 640 000.00	4 062 298.26	0.08
EUR	BENIN GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 4.95000% 21-22.01.35	10 054 000.00	7 938 902.14	0.15
EUR	CENTRAL BANK OF TUNISIA-REG-S 5.62500% 17-17.02.24	3 540 000.00	2 868 564.86	0.05
EUR	CROATIA, REPUBLIC OF-REG-S 1.50000% 20-17.06.31	2 030 000.00	1 860 613.40	0.03
EUR	CROATIA, REPUBLIC OF-REG-S 1.12500% 21-04.03.33	4 395 000.00	3 744 865.67	0.07
EUR	CROATIA, REPUBLIC OF-REG-S 1.75000% 21-04.03.41	3 860 000.00	3 013 896.01	0.06
EUR	CROATIA, REPUBLIC OF-REG-S 2.87500% 22-22.04.32	5 280 000.00	5 362 686.82	0.10
EUR	IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 18-22.03.30	9 833 000.00	9 010 515.64	0.17
EUR	IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 6.62500% 18-22.03.48	8 086 000.00	6 333 873.46	0.12
EUR	IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 6.87500% 19-17.10.40	8 775 000.00	7 290 517.90	0.14
EUR	METINVEST BV-REG-S 5.62500% 19-17.06.25	1 460 000.00	864 169.98	0.02
EUR	NAK NAFTOGAZ UKRAINE VIA KONDOR-REG-S 7.12500% 19-19.07.24	1 343 000.00	291 713.03	0.00
EUR	ROMANIAN GOVERNMENT INTERN BDS-REG-S 3.62400% 20-26.05.30	1 539 000.00	1 420 716.31	0.03
EUR	RUSSIA, FEDERATION OF-REG-S 2.87500% 18-04.12.25	4 700 000.00	2 067 296.17	0.04
EUR	SENEGAL, REPUBLIC OF-REG-S 4.75000% 18-13.03.28	3 770 000.00	3 603 079.48	0.07
EUR	TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV-REG-S 1.25000% 15-31.03.23	1 270 000.00	1 372 645.70	0.03
EUR	TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV-REG-S 1.12500% 16-15.10.24	510 000.00	523 179.47	0.01
ユーロ合計			61 629 534.30	1.17
USD				
USD	ABJA INVESTMENT CO PTE LTD-REG-S 5.95000% 14-31.07.24	2 142 000.00	2 133 410.58	0.04
USD	ABU DHABI CRUDE OIL PIPELINE LLC-REG-S 4.60000% 17-02.11.47	7 512 000.00	7 133 113.51	0.14
USD	ABU DHABI, GOVERNMENT OF-REG-S 3.12500% 19-30.09.49	8 868 000.00	6 684 255.00	0.13
USD	ACWA POWER MGMT & INVEST ONE LTD-REG-S 5.95000% 17-15.12.39	2 499 000.00	2 344 561.40	0.04
USD	ADANI GREEN ENERGY UP LTD-REG-S 6.25000% 19-10.12.24	800 000.00	728 150.00	0.01
USD	ADCB FINANCE CAYMAN LTD-REG-S 4.00000% 18-29.03.23	1 201 000.00	1 194 844.87	0.02
USD	AGILE GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 5.50000% 21-21.04.25	200 000.00	120 912.50	0.00
USD	AKBANK TAS-REG-S 5.12500% 15-31.03.25	1 409 000.00	1 335 291.69	0.03
USD	ALAM SUTERA REALTY TBK PT (PAY IN KIND) STEP UP 20-02.11.25	615 000.00	516 138.75	0.01
USD	ALDAR SUKUK LTD-REG-S 4.75000% 18-29.09.25	550 000.00	547 009.38	0.01
USD	ALFA DESARROLLO SPA-REG-S 4.55000% 21-27.09.51	13 241 000.00	10 610 914.29	0.20
USD	ALTICE FINANCING SA-REG-S 5.75000% 21-15.08.29	4 236 000.00	3 557 839.86	0.07
USD	ANGOLAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 9.50000% 15-12.11.25	2 525 000.00	2 635 468.75	0.05
USD	ANGOLAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 8.25000% 18-09.05.28	15 173 000.00	14 300 552.50	0.27
USD	ARABIAN CENTRES SUKUK II LTD-REG-S 5.62500% 21-07.10.26	1 890 000.00	1 791 720.00	0.03
USD	ARGENTINA, REPUBLIC OF STEP-UP 20-09.07.41	23 826 439.00	8 089 076.04	0.15
USD	ATENTO LUXCO 1 SA-REG-S 8.00000% 21-10.02.26	2 319 000.00	1 261 304.10	0.02
USD	AXIAN TELECOM-REG-S 7.37500% 22-16.02.27	1 830 000.00	1 672 505.62	0.03
USD	AZURE POWER ENERGY LTD-REG-S 3.57500% 21-19.08.26	2 975 000.00	2 055 416.34	0.04
USD	BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 7.00000% 16-12.10.28	9 880 000.00	10 190 602.50	0.19
USD	BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 7.50000% 17-20.09.47	1 196 000.00	1 107 795.00	0.02
USD	BAHRAIN, KINGDOM OF-REG-S 5.62500% 19-30.09.31	1 950 000.00	1 811 062.50	0.03
USD	BAHRAIN, KINGDOM OF-REG-S 7.37500% 20-14.05.30	5 020 000.00	5 201 975.00	0.10
USD	BAHRAIN, KINGDOM OF-REG-S 5.45000% 20-16.09.32	1 080 000.00	977 400.00	0.02
USD	BANK OF BAHRAIN & KUWAIT-REG-S 5.50000% 19-09.07.24	1 315 000.00	1 296 343.44	0.02
USD	BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO-REG-S-SUB 4.20000% 20-23.01.25	1 182 000.00	1 099 260.00	0.02
USD	BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 8.25000% 04-20.01.34	4 963 000.00	5 739 399.30	0.11
USD	BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 5.00000% 14-27.01.45	1 838 000.00	1 439 728.37	0.03
USD	BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 6.00000% 16-07.04.26	545 000.00	566 050.62	0.01
USD	BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 5.62500% 16-21.02.47	3 020 000.00	2 509 997.50	0.05
USD	BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 4.50000% 19-30.05.29	12 094 000.00	11 438 656.38	0.22
USD	CBB INTERNATIONAL SUKUK PROGRAMME-REG-S 3.95000% 20-16.09.27	2 170 000.00	2 097 169.37	0.04
USD	CFLD CAYMAN INVEST-REG-S *DEFAULTED* 6.90000% 20-13.01.23	220 000.00	25 792.80	0.00
USD	CHILE, REPUBLIC OF 3.12500% 16-21.01.26	5 290 000.00	5 081 045.00	0.10
USD	CHINA CONSTRUCTION BANK CORP-REG-S-SUB 4.25000% 19-27.02.29	1 384 000.00	1 371 544.00	0.03

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD CHINA EVERGRANDE GRO-REG-S *DEFAULTED* 7.50000% 17-28.06.23	1 551 000.00	158 977.50	0.00
USD CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN-REG-S 5.95000% 14-08.05.24	200 000.00	200 225.00	0.00
USD CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN-REG-S 6.45000% 14-11.06.34	550 000.00	553 140.50	0.01
USD CHINA SCE GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 7.00000% 20-02.05.25	200 000.00	107 432.00	0.00
USD CHINA SCE GROUP HOLDINGS LTD-REG-S- 6.00000% 21-04.02.26	420 000.00	208 824.00	0.00
USD CHINA SCE PROPERTY HOLDINGS LTD-REG-S 7.37500% 19-09.04.24	325 000.00	203 125.00	0.00
USD CHINA SCE PROPERTY HOLDINGS LTD-REG-S 5.95000% 21-29.09.24	1 625 000.00	906 246.25	0.02
USD CHINALCO CAPITAL HOLDINGS LTD-REG-S 2.12500% 21-03.06.26	132 000.00	119 792.64	0.00
USD CIA CERVECERIAS UNIDAS SA-REG-S 3.35000% 22-19.01.32	3 194 000.00	2 724 482.00	0.05
USD CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD-REG-S 5.25000% 20-13.05.26	665 000.00	202 825.00	0.00
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 10.37500% 03-28.01.33	660 000.00	744 480.00	0.01
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 7.37500% 06-18.09.37	2 753 000.00	2 671 786.50	0.05
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 5.62500% 14-26.02.44	8 014 000.00	6 082 626.00	0.12
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 5.00000% 15-15.06.45	11 610 000.00	8 140 061.26	0.15
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 8.00000% 22-20.04.33	7 158 000.00	7 347 239.63	0.14
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 6.15000% 06-24.10.36	550 000.00	588 431.25	0.01
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 5.62500% 13-18.10.43	957 000.00	964 057.87	0.02
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 4.87500% 14-04.11.44	384 000.00	359 952.00	0.01
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 5.62500% 16-15.12.26	330 000.00	224 565.00	0.00
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 6.15000% 19-17.09.25	3 365 000.00	2 548 987.50	0.05
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 5.62500% 20-14.01.30	400 000.00	257 000.00	0.01
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 4.80000% 20-06.08.30	1 023 000.00	621 472.50	0.01
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 3.12500% 20-22.10.25	2 470 000.00	1 700 471.50	0.03
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 3.87500% 20-22.10.30	2 350 000.00	1 374 750.00	0.03
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 2.70000% 21-12.07.26	4 182 000.00	2 707 845.00	0.05
USD CROATIA, REPUBLIC OF-REG-S 6.00000% 13-26.01.24	2 620 000.00	2 618 853.75	0.05
USD DAR AL-ARKAN SUKUK CO LTD-REG-S 6.75000% 19-15.02.25	325 000.00	320 490.62	0.01
USD DAR AL-ARKAN SUKUK CO LTD-REG-S 6.87500% 20-26.02.27	796 000.00	777 095.00	0.02
USD DEVELOPMENT BANK OF MONGOLIA LLC-REG-S 7.25000% 18-23.10.23	3 368 000.00	3 237 068.99	0.06
USD DIB SUKUK LTD-REG-S 2.95000% 20-16.01.26	1 680 000.00	1 587 818.40	0.03
USD DIB SUKUK LTD-REG-S 5.49300% 22-30.11.27	969 000.00	998 070.00	0.02
USD DNO ASA-144A-REG-S 8.37500% 19-29.05.24	2 130 810.00	2 128 679.19	0.04
USD DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL-REG-S 6.00000% 22-22.02.33	10 089 000.00	9 332 325.00	0.18
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 5.50000% 22-22.02.29	9 024 000.00	8 470 152.00	0.16
USD EA PARTNERS I BV-REG-S *DEFAULTED* 6.87500% 15-28.09.20	4 113 000.00	25 911.90	0.00
USD EA PARTNERS II BV-REG-S *DEFAULTED* 6.75000% 16-01.06.21	1 710 000.00	10 482.30	0.00
USD ECOPETROL SA 4.12500% 14-16.01.25	2 870 000.00	2 773 137.50	0.05
USD EIG PEARL HOLDINGS SARL-REG-S 3.54500% 22-31.08.36	9 430 000.00	8 156 950.00	0.15
USD EIG PEARL HOLDINGS SARL-REG-S 4.38700% 22-30.11.46	17 447 000.00	13 786 401.32	0.26
USD EL SUKUK CO LTD-REG-S 1.82700% 20-23.09.25	1 350 000.00	1 246 050.00	0.02
USD EMG SUKUK LTD-REG-S 4.56400% 14-18.06.24	710 000.00	700 814.38	0.01
USD ENERGEAN ISRAEL FINANCE LTD-144A-REG-S 5.87500% 21-30.03.31	1 408 676.00	1 263 230.20	0.02
USD ESKOM HOLDINGS SOC LTD-REG-S 4.13400% 21-23.07.27	1 410 000.00	1 269 705.00	0.02
USD ETHIOPIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.62500% 14-11.12.24	8 899 000.00	5 941 751.07	0.11
USD EXPORT-IMPORT BANK OF INDIA-REG-S 3.37500% 16-05.08.26	380 000.00	357 644.60	0.01
USD FAB SUKUK CO LTD-REG-S 1.41100% 21-14.01.26	790 000.00	718 554.37	0.01
USD FANTASIA HOLDING GRP REG-S *DEFAULTED* 10.87500% 21-02.03.24	330 000.00	56 925.00	0.00
USD FORMOSA GROUP CAYMAN LTD-REG-S 3.37500% 15-22.04.25	1 458 000.00	1 392 663.39	0.03
USD FOXCONN FAR EAST LTD-REG-S 2.50000% 20-28.10.30	670 000.00	560 831.87	0.01
USD GABON, REPUBLIC OF-REG-S 6.37500% 13-12.12.24	590 014.00	371 045.06	0.01
USD GABON, REPUBLIC OF-REG-S 6.95000% 15-16.06.25	8 121 000.00	7 857 067.50	0.15
USD GALAXY PIPELINE ASSETS BIDCO LTD-REG-S 2.62500% 20-31.03.36	18 653 000.00	15 188 205.25	0.29
USD GALAXY PIPELINE ASSETS BIDCO LTD-REG-S 3.25000% 20-30.09.40	3 120 000.00	2 461 485.00	0.05
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 10.75000% 15-14.10.30	9 841 000.00	6 864 097.50	0.13
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 8.12500% 19-26.03.32	4 155 000.00	1 526 962.50	0.03
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 8.95000% 19-26.03.51	3 066 000.00	1 111 425.00	0.02
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 7.87500% 20-11.02.35	3 226 000.00	1 185 555.00	0.02
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 8.75000% 20-11.03.61	3 984 000.00	1 439 220.00	0.03

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD-REG-S 3.87500% 15-04.06.25	5 122 000.00	4 507 360.00	0.09
USD GOHL CAPITAL LTD-REG-S 4.25000% 17-24.01.27	19 192 000.00	17 552 283.49	0.33
USD GREENKO DUTCH BV-144A 3.85000% 21-29.03.26	1 800 000.00	1 527 761.25	0.03
USD GREENKO DUTCH BV-REG-S 3.85000% 21-29.03.26	10 643 000.00	9 033 312.77	0.17
USD GREENKO SOLAR MAURITIUS LTD-REG-S 5.55000% 19-29.01.25	2 811 000.00	2 689 255.59	0.05
USD GREENKO SOLAR MAURITIUS LTD-REG-S 5.95000% 19-29.07.26	2 055 000.00	1 911 150.00	0.04
USD GREENKO WIND PROJECTS MAURITIUS-REG-S 5.50000% 22-06.04.25	380 000.00	357 508.75	0.01
USD GRUPO TELEVISA SAB 6.62500% 09-15.01.40	700 000.00	750 050.00	0.01
USD GRUPOSURA FINANCE-REG-S 5.50000% 16-29.04.26	1 200 000.00	1 165 350.00	0.02
USD GTLK EUROPE CAPITAL-REG-S *DEFAULTED* 5.95000% 19-17.04.25	2 175 000.00	108 750.00	0.00
USD HKT CAPITAL NO 5 LTD-REG-S 3.25000% 19-30.09.29	1 620 000.00	1 436 049.58	0.03
USD ICD FUNDING LTD-REG-S 3.22300% 20-28.04.26	1 700 000.00	1 589 818.75	0.03
USD IHS HOLDING LTD-REG-S 5.62500% 21-29.11.26	4 042 000.00	3 388 610.70	0.06
USD IHS HOLDING LTD-REG-S 6.25000% 21-29.11.28	6 404 000.00	5 242 090.25	0.10
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 8.50000% 05-12.10.35	4 703 000.00	6 108 903.06	0.12
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 6.62500% 07-17.02.37	1 193 000.00	1 372 081.23	0.03
USD IRAQ INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.80000% 06-15.01.28	14 731 000.00	8 509 454.22	0.16
USD IRAQ INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.75200% 17-09.03.23	2 735 000.00	2 710 726.87	0.05
USD ISRAEL, STATE OF 3.87500% 20-03.07.50	1 709 000.00	1 448 377.50	0.03
USD IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 6.12500% 17-15.06.33	4 904 000.00	4 352 300.00	0.08
USD JAMAICA, GOVERNMENT OF 9.25000% 05-17.10.25	496 000.00	527 558.00	0.01
USD JORDAN, KINGDOM OF-REG-S 7.37500% 17-10.10.47	3 900 000.00	3 509 512.50	0.07
USD KAISA GROUP HOLDINGS-REG-S *DEFAULTED* 9.37500% 17-30.06.24	775 000.00	141 437.50	0.00
USD KAISA GROUP HOLDINGS-REG-S *DEFAULT* 11.70000% 21-11.11.25	200 000.00	36 000.00	0.00
USD KOOKMIN BANK-REG-S-SUB 2.50000% 20-04.11.30	8 189 000.00	6 696 554.75	0.13
USD LAMAR FUNDING LTD-REG-S 3.95800% 15-07.05.25	8 553 000.00	8 169 718.69	0.15
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.75000% 12-29.11.27	825 000.00	51 562.50	0.00
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.00000% 12-27.01.23	564 000.00	36 237.00	0.00
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.20000% 15-26.02.25	4 600 000.00	287 500.00	0.01
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 7.05000% 15-02.11.35	523 000.00	32 687.50	0.00
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.65000% 15-03.11.28	5 549 000.00	346 812.50	0.01
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.65000% 16-22.04.24	390 000.00	25 057.50	0.00
USD LEBANON, REPUBLIC OF *DEFAULTED* 6.85000% 16-25.05.29	5 109 000.00	323 463.56	0.01
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.85000% 17-23.03.27	7 906 000.00	494 125.00	0.01
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 7.25000% 17-23.03.37	693 000.00	44 525.25	0.00
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 7.00000% 17-23.03.32	1 098 000.00	68 625.00	0.00
USD LEBANON, REPUBLIC OF *DEFAULTED* 8.25000% 18-17.05.34	17 049 000.00	1 095 398.25	0.02
USD LEBANON, REPUBLIC OF *DEFAULTED* 8.20000% 18-17.05.33	180 000.00	11 565.00	0.00
USD LIMA METRO LINE 2 FINANCE LTD-REG-S 4.35000% 19-05.04.36	1 806 000.00	1 477 209.88	0.03
USD LIMAK ISKENDERUN ULUSLARARASI-REG-S 9.50000% 21-10.07.36	2 020 000.00	1 756 854.33	0.03
USD LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 3.95000% 19-16.09.29	5 512 000.00	4 517 428.50	0.09
USD LONGFOR PROPERTIES CO LTD-REG-S 4.50000% 18-16.01.28	658 000.00	577 473.96	0.01
USD MAF SUKUK LTD-REG-S 4.63800% 19-14.05.29	600 000.00	596 362.50	0.01
USD MARB BONDCO PLC-REG S-3.95000% 21-29.01.31	4 535 000.00	3 558 863.92	0.07
USD MASHREQBANK PSC-REG-S 4.25000% 19-26.02.24	1 101 000.00	1 085 861.25	0.02
USD METINVEST BV-REG-S 7.75000% 18-23.04.23	3 166 000.00	2 534 778.75	0.05
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-144A 5.50000% 16-31.10.46	1 300 000.00	1 048 950.50	0.02
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-144A 3.87500% 17-30.04.28	2 830 000.00	2 689 943.30	0.05
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-REG-S 5.50000% 16-31.10.46	3 331 000.00	2 687 733.94	0.05
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-REG-S 3.87500% 17-30.04.28	4 240 000.00	4 030 162.40	0.08
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-REG-S 5.50000% 17-31.07.47	8 535 000.00	6 877 503.00	0.13
USD MINEJESA CAPITAL BV-REG-S 4.62500% 17-10.08.30	4 875 000.00	4 473 348.75	0.09
USD MINEJESA CAPITAL BV-REG-S 5.62500% 17-10.08.37	3 404 000.00	2 935 524.50	0.06
USD MINERA Y METALURGICA DEL BOLEO-REG-S 3.25000% 19-17.04.24	357 000.00	347 807.25	0.01
USD MODERNLA OVE PTE LTD-REG-S 6.95000% 17-30.04.27	883 749.00	378 288.76	0.01
USD MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 5.12500% 20-07.04.26	4 784 000.00	4 473 566.24	0.09

USD	MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S	4.45000%	21-07.07.31	3 400 000.00	2 796 874.00	0.05
USD	MOROCCO, KINGDOM OF THE-REG-S	5.50000%	12-11.12.42	6 613 000.00	5 703 712.50	0.11

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD NAKILAT INC-REG-S 6.06700% 06-31.12.33	2 665 000.00	2 495 210.25	0.05
USD NWD MTN LTD-REG-S 4.12500% 19-18.07.29	1 232 000.00	1 062 353.60	0.02
USD OI SA (PIK) 10.00000% 18-27.07.25	3 699 000.00	371 749.50	0.01
USD OIL INDIA INTERNATIONAL PTE LTD-REG-S 4.00000% 17-21.04.27	1 580 000.00	1 492 902.50	0.03
USD OIL INDIA LTD-REG-S 5.12500% 19-04.02.29	1 410 000.00	1 375 455.00	0.03
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.75000% 20-28.10.27	6 668 000.00	7 052 660.26	0.13
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 7.37500% 20-28.10.32	3 858 000.00	4 297 570.88	0.08
USD OMGRID FUNDING LTD-REG-S 5.19600% 17-16.05.27	400 000.00	389 575.00	0.01
USD OZTEL HOLDINGS SPC-REG-S 6.62500% 18-24.04.28	800 000.00	829 150.00	0.02
USD PANAMA, REPUBLIC OF 8.87500% 97-30.09.27	493 000.00	572 896.82	0.01
USD PANAMA, REPUBLIC OF 7.12500% 05-29.01.26	171 000.00	181 078.32	0.00
USD PANAMA, REPUBLIC OF 6.70000% 06-26.01.36	2 615 000.00	2 823 055.94	0.05
USD PANAMA, REPUBLIC OF 4.30000% 13-29.04.53	1 072 000.00	807 886.00	0.02
USD PANAMA, REPUBLIC OF 3.75000% 15-16.03.25	3 900 000.00	3 783 731.25	0.07
USD PANAMA, REPUBLIC OF 3.87500% 16-17.03.28	202 000.00	192 695.38	0.00
USD PANAMA, REPUBLIC OF 4.50000% 18-16.04.50	1 208 000.00	943 976.51	0.02
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 5.00000% 16-15.04.26	8 692 000.00	8 636 588.50	0.16
USD PELABUHAN INDONESIA II PT-REG-S 4.25000% 15-05.05.25	2 400 000.00	2 344 224.00	0.04
USD PERU, REPUBLIC OF 2.39200% 20-23.01.26	2 380 000.00	2 212 358.75	0.04
USD PERU, REPUBLIC OF 2.78300% 20-23.01.31	9 160 000.00	7 736 192.50	0.15
USD PERU, REPUBLIC OF 7.35000% 05-21.07.25	3 489 000.00	3 670 646.06	0.07
USD PERU, REPUBLIC OF 8.75000% 03-21.11.33	1 702 000.00	2 113 458.50	0.04
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 5.37500% 18-25.01.29	740 000.00	742 856.40	0.01
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 3.87500% 19-17.07.29	2 160 000.00	1 971 000.00	0.04
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 3.80000% 20-23.06.50	305 000.00	244 033.55	0.00
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 2.55000% 21-09.06.31	2 040 000.00	1 754 624.40	0.03
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 9.75000% 12-17.05.35	1 493 000.00	67 185.00	0.00
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 6.00000% 14-16.05.24	33 023 021.00	1 486 035.95	0.03
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 7.75000% 06-14.01.31	814 000.00	972 819.54	0.02
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 6.37500% 09-23.10.34	785 000.00	887 136.35	0.02
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 3.95000% 15-20.01.40	1 578 000.00	1 375 006.08	0.03
USD PHOENIX LEAD LTD-REG-S-SUB 4.85000% 17-PRP	1 580 000.00	1 406 990.00	0.03
USD POWER FINANCE CORP LTD-REG-S 4.50000% 19-18.06.29	2 407 000.00	2 234 448.19	0.04
USD PTTEP CANADA INTERNATIONAL FIN-REG-S 6.35000% 12-12.06.42	1 020 000.00	1 076 610.00	0.02
USD QATAR, STATE OF-REG-S 3.25000% 16-02.06.26	1 635 000.00	1 586 767.50	0.03
USD QIB SUKUK LTD-REG-S 1.950000% 20-27.10.25	2 360 000.00	2 175 330.00	0.04
USD QIIB SENIOR SUKUK LTD-REG-S 4.26400% 19-05.03.24	492 000.00	485 327.25	0.01
USD REDSUN PROPERTIES GRP-REG-S *DEFAULTED* 7.30000% 21-13.01.25	1 150 000.00	218 500.00	0.00
USD REPUBLIC OF AZERBAIJAN-REG-S 3.50000% 17-01.09.32	6 630 000.00	5 719 618.13	0.11
USD RUSSIA, FEDERATION OF-REG-S 4.75000% 16-27.05.26	17 400 000.00	7 482 000.00	0.14
USD RUSSIA, FEDERATION OF-REG-S 4.25000% 17-23.06.27	8 000 000.00	3 360 000.00	0.06
USD RZD CAP /RUS RAIL LPN-REG-S *DEFAULTED* 5.70000% 12-05.04.22	2 850 000.00	1 710 000.00	0.03
USD SABIC CAPTIAL BV-REG-S 2.15000% 20-14.09.30	965 000.00	816 812.19	0.02
USD SAMBA FUNDING LTD-REG-S 2.90000% 20-29.01.27	1 100 000.00	1 034 893.75	0.02
USD SANDS CHINA LTD 5.12500% 19-08.08.25	500 000.00	497 047.35	0.01
USD SAUDI ELECTRICITY GLOBAL SUKIK CO REG-S 5.50000% 14-08.04.44	2 056 000.00	2 168 823.00	0.04
USD SAUDI ELECTRICITY GLOBAL SUKUK CO-REG-S 4.72300% 18-27.09.28	1 643 000.00	1 680 789.00	0.03
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 5.25000% 19-16.01.50	4 142 000.00	4 116 112.50	0.08
USD SENEGAL, REPUBLIC OF-REG-S 6.25000% 17-23.05.33	2 698 000.00	2 333 770.00	0.04
USD SEPLAT PETROLEUM DEVELOPMENT CO-REG-S 7.75000% 21-01.04.26	8 257 000.00	7 167 076.00	0.14
USD SHANDONG IRON AND STEEL XINHENG-REG-S 4.80000% 21-28.07.24	2 408 000.00	2 285 041.50	0.04
USD SHANGHAI PORT GROUP BVI DEVELOP-REG-S 2.85000% 19-11.09.29	300 000.00	267 141.00	0.01
USD SHANGHAI PORT GRP BVI DEP 2 CO LTD-REG-S 20-13.07.30	671 000.00	574 778.60	0.01
USD SHARJAH SUKUK PROGRAM LTD-REG-S 3.23400% 19-23.10.29	1 390 000.00	1 239 966.87	0.02
USD SHIMAO PRPRTY LTD-REG-S *DEFAULTED* 4.75000% 17-03.07.22	200 000.00	46 000.00	0.00
USD SHINHAN CARD CO LTD-REG-S 1.37500% 21-23.06.26	2 870 000.00	2 510 274.20	0.05
USD SNB SUKUK LTD-REG-S 2.34200% 22-19.01.27	1 094 000.00	1 011 129.50	0.02
USD SOCOMBANK CAP DAC-REG-S-SUB *DEFAULTED* 8.00000% 19-07.04.30	3 730 000.00	212 843.13	0.00

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 4.30000% 16-12.10.28	10 495 000.00	9 563 568.75	0.18
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.00000% 16-12.10.46	11 726 000.00	8 530 665.00	0.16
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.87500% 18-22.06.30	575 000.00	547 687.50	0.01
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 6.30000% 18-22.06.48	2 060 000.00	1 686 625.00	0.03
USD SOUTHERN GAS CORRIDOR CJSC-REG-S 6.87500% 16-24.03.26	29 228 000.00	30 064 651.50	0.57
USD SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULT* 6.85000% 15-03.11.25	610 000.00	210 183.13	0.00
USD STAR ENERGY GEOTHERMAL DARAJAT II-REG-S 4.85000% 20-14.10.38	3 720 000.00	3 232 447.50	0.06
USD STATE OIL OF THE AZERBAIJAN REP-REG-S 6.95000% 15-18.03.30	13 088 000.00	13 634 424.00	0.26
USD SUNAC CHINA HOLDINGS-REG-S *DEFAULTED* 7.95000% 19-11.10.23	2 035 000.00	585 062.50	0.01
USD SUNAC CHINA HOLDINGS-REG-S *DEFAULTED* 7.50000% 19-01.02.24	1 420 000.00	404 700.00	0.01
USD THETA CAPITAL PTE LTD-REG-S 8.12500% 20-22.01.25	240 000.00	208 020.00	0.00
USD TIGER HOLDCO PTE LTD-REG-S-144A 13.00000% 21-10.06.23	1 011 387.00	1 001 905.25	0.02
USD TIMES CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 6.20000% 20-22.03.26	3 365 000.00	641 032.50	0.01
USD TINGYI CAYMAN ISLANDS HOLD CORP-REG-S 1.62500% 20-24.09.25	340 000.00	306 945.20	0.01
USD TML HOLDINGS PTE LTD-REG-S 4.34000% 21-09.06.26	930 000.00	853 449.37	0.02
USD TNB GLOBAL VENTURES CAPITAL-REG-S 4.85100% 18-01.11.28	1 997 000.00	1 970 539.75	0.04
USD TULLOW OIL PLC-REG-S 7.00000% 18-01.03.25	4 620 000.00	3 280 200.00	0.06
USD TURKEY, REPUBLIC OF 4.25000% 15-14.04.26	7 300 000.00	6 442 250.00	0.12
USD TURKEY, REPUBLIC OF 6.12500% 18-24.10.28	3 049 000.00	2 686 931.25	0.05
USD TURKEY, REPUBLIC OF 5.87500% 21-26.06.31	5 570 000.00	4 511 700.00	0.09
USD UPL CORP LTD-REG-S 4.62500% 20-16.06.30	2 560 000.00	2 118 080.00	0.04
USD URUGUAY, REPUBLIC OF 7.62500% 06-21.03.36	731 715.00	936 229.34	0.02
USD URUGUAY, REPUBLIC OF 5.10000% 14-18.06.50	1 266 915.00	1 278 950.69	0.02
USD URUGUAY, REPUBLIC OF 4.97500% 18-20.04.55	7 069 506.00	6 995 276.19	0.13
USD VALE OVERSEAS LTD 6.87500% 09-10.11.39	575 000.00	629 685.38	0.01
USD VALE OVERSEAS LTD 8.25000% 04-17.01.34	1 625 000.00	1 957 921.87	0.04
USD VEDANTA RESOURCES FINANCE II PLC-REG-S 8.95000% 21-11.03.25	1 160 000.00	910 600.00	0.02
USD VEDANTA RESOURCES FINANCE II PLC-REG-S 13.87500% 20-21.01.24	1 879 000.00	1 662 092.94	0.03
USD VENEZUELA, REP. OF REG-S *DEFAULTED* 11.75000% 11-21.10.26	4 098 600.00	327 888.00	0.01
USD VENEZUELA, REP. OF-REG-S *DEFAULTED* 9.00000% 08-07.05.23	378 000.00	30 240.00	0.00
USD VENEZUELA, REP. OF-REG-S *DEFAULTED* 9.25000% 08-07.05.28	2 977 000.00	238 160.00	0.00
USD VENEZUELA, REP. OF-REG-S *DEFAULTED* 12.75000% 10-23.08.22	2 305 600.00	201 740.00	0.00
USD VENEZUELA, REP. OF-REG-S *DEFAULTED* 11.95000% 11-05.08.31	6 682 000.00	534 560.00	0.01
USD VENEZUELA, REPUBLIC OF *DEFAULTED* 9.25000% 97-15.09.27	1 002 000.00	80 160.00	0.00
USD WEST CHINA CEMENT LTD-REG-S 4.95000% 21-08.07.26	310 000.00	269 564.38	0.01
USD WOORI BANK-REG-S-SUB 4.75000% 14-30.04.24	1 000 000.00	987 375.00	0.02
USD XIAOMI BEST TIME INTER LTD-REG-S 4.10000% 21-14.07.51	2 279 000.00	1 513 028.10	0.03
USD YUNDA HOLDING INVESTMENT LTD-REG-S 2.25000% 20-19.08.25	2 248 000.00	2 010 836.00	0.04
USD YUZHOU PROPERTIES-REG-S *DEFAULTED* 8.50000% 19-04.02.23	200 000.00	31 000.00	0.00
USD YUZHOU PROPERTIES-REG-S *DEFAULTED* 8.50000% 19-26.02.24	430 000.00	64 500.00	0.00
USD ZAMBIA, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 5.37500% 12-20.09.22	1 472 000.00	668 196.00	0.01
USD ZHENRO PROP GROUP-REG-S *DEFAULTED* 6.63000% 21-07.01.26	735 000.00	64 312.50	0.00
USD ZHENRO PROP GROUP-REG-S *DEFAULTED* 6.70000% 21-04.08.26	1 800 000.00	157 500.00	0.00
米ドル合計		654 664 641.30	12.39
債券、固定利付債合計		716 294 175.60	13.56
債券、ゼロ・クーポン債			
USD ECUADOR SOCIAL BOND SARL-REG-S 0.00000% 20-30.01.35	6 810 000.00	3 224 112.19	0.06
債券、ゼロ・クーポン債合計		3 224 112.19	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

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
債券、変動利付債			
USD			
USD AIRPORT AUTHORITY-REG-S 2.100%/VAR 20-PRP	2 356 000.00	2 157 646.94	0.04
USD BANCO DAVIVIENDA SA-REG-S-SUB 6.650%/VAR 21-PRP	5 109 000.00	4 016 951.25	0.08
USD BANCOLOMBIA SA-SUB 4.625%/VAR 19-18.12.29	5 927 000.00	5 377 567.10	0.10
USD BANK NEGARA INDONESIA PERSERO-REG-S-SUB 4.300%/VAR 21-PRP	4 646 000.00	3 984 456.06	0.07
USD BURGAN BANK SAK-REG-S-SUB 5.749%/VAR 19-PRP	500 000.00	461 031.25	0.01
USD CASHLD FLR REG-S-SUB 4.000%/VAR 21-PRP	7 831 000.00	6 946 707.82	0.13
USD CELESTIAL MILES LTD-REG-S 5.750%/VAR 19-PRP	1 905 000.00	1 865 185.50	0.03
USD CHINA CONSTRUCTION BK CORP-REG-S-SUB 2.450%/VAR 20-24.06.30	1 458 000.00	1 375 273.08	0.03
USD CHINALCO CAPITAL HOLDINGS LTD-REG-S 4.100%/VAR 19-PRP	558 000.00	545 785.38	0.01
USD CLP POWER HK FINANCE LTD-REG-S-SUB 3.550%/VAR 19-PRP	400 000.00	384 887.84	0.01
USD DIANJIANG INTERNATIONAL FINANCE LTD-REG-S 4.600%/VAR 18-PRP	2 044 000.00	2 039 360.12	0.04
USD DIB TIER 1 SUKUK 3 LTD-REG-S-SUB 6.250%/VAR 19-PRP	1 330 000.00	1 339 975.00	0.02
USD ELECT GLOBAL INVESTMENTS LTD-REG-S-SUB 4.100%/VAR 20-PRP	6 470 000.00	6 128 384.00	0.12
USD EMIRATES NBD PJSC-REG-S-SUB 6.125%/VAR 19-PRP	3 792 000.00	3 790 341.01	0.07
USD FIRST ABU DHABI BANK-REG-S-SUB 4.500%/VAR 20-PRP	1 605 000.00	1 544 611.87	0.03
USD GLOBE TELECOM INC-REG-S 4.200%/VAR 21-PRP	2 640 000.00	2 425 170.00	0.05
USD HONG KONG AIRPORT AUTHORITY 2.400%/VAR 20-PRP	1 980 000.00	1 759 326.07	0.03
USD KAISA GROUP HOLDINGS-REG-S* DEFAULTED* 10.875%/VAR 20-PRP	920 000.00	94 300.00	0.00
USD MAF GLOBAL SECURITIES LTD-REG-S-SUB 6.375%/VAR 18-PRP	2 180 000.00	2 149 752.50	0.04
USD MODERN LAND CHINA CO LTD-REG-S (PIK) 9.000%/VAR 22-30.12.27	409 918.00	31 589.30	0.00
USD NBK TIER 1 FINANCING 2 LTD-REG-S-SUB 4.500%/VAR 19-PRP	12 597 000.00	11 819 922.55	0.22
USD NBK TIER 1 FINANCING LTD-REG-S-SUB 3.625%/VAR 21-PRP	2 810 000.00	2 493 875.00	0.05
USD NETWORK I2I LTD-REG-S-SUB 5.650%/VAR 19-PRP	7 641 000.00	7 348 731.75	0.14
USD NETWORK I2I LTD-REG-S-SUB VAR 21-PRP	1 795 000.00	1 617 519.37	0.03
USD NWD FINANCE BVI LTD-REG-S 5.250%/VAR 20-PRP	870 000.00	811 884.00	0.02
USD NWD FINANCE BVI LTD-REG-S 4.125%/VAR 21-PRP	200 000.00	159 700.00	0.00
USD OVERSEA-CHINESE BNKNG CORP-REG-S-SUB 4.602%/VAR 22-15.06.32	3 404 000.00	3 333 571.29	0.06
USD PEAK RE BVI HOLDING LTD-REG-S-SUB 5.350%/VAR 20-PRP	200 000.00	173 500.00	0.00
USD POWERCHINA ROADBRIDGE GRP BRITISH-REG-S 3.080%/VAR 21-PRP	794 000.00	742 290.75	0.01
USD RIYAD BANK 3.174%/VAR 20-25.02.30	230 000.00	219 836.88	0.00
USD RIZAL COMMERCIAL BANKING CORP-REG-S-SUB 6.500%/VAR 20-PRP	1 090 000.00	972 688.75	0.02
USD ROYAL CAPITAL BV-REG-S 5.000%/VAR 20-PRP	440 000.00	418 357.50	0.01
USD SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD-REG-S-SUB 2.875%/VAR 21-PRP	1 660 000.00	1 484 973.75	0.03
USD SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD-REG-S-SUB 5.875%/VAR 18-PRP	2 428 000.00	2 409 085.88	0.05
USD SMC GLOBAL POWER HOLDINGS CORP-REG-S 6.500%/VAR 19-PRP	470 000.00	432 635.00	0.01
USD STANDARD BANK GROUP LTD-REG-S-SUB 5.950%/VAR 19-31.05.29	1 380 000.00	1 353 952.50	0.03
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S VAR 15-01.08.41	11 367 000.00	3 568 527.56	0.07
USD UPL CORP LTD-REG-S-SUB 5.250%/VAR 20-PRP	560 000.00	409 430.00	0.01
USD URUGUAY, REPUBLIC OF (PIK) 7.87500% 03-15.01.33	2 834 423.00	3 565 704.13	0.07
USD YUZHOU PROPERTIES-REG-S* DEFAULTED* 5.375%/VAR 17-PRP	810 000.00	81 000.00	0.00
米ドル合計		91 835 488.75	1.74
債券、変動利付債合計		91 835 488.75	1.74
財務省証券 (T-note)、固定利付債			
USD			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.00000% 22-15.08.52	1 210 000.00	1 070 660.94	0.02
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.00000% 22-15.11.52	4 567 000.00	4 883 835.62	0.09
米ドル合計		5 954 496.56	0.11
財務省証券 (T-note)、固定利付債合計		5 954 496.56	0.11

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / 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	5 790 000.00	5 554 347.00	0.11
USD BANCO MERCANTIL DEL NOR-REG-S-SUB 6.750%/VAR 19-PRP	5 260 000.00	5 148 119.80	0.10
USD EMIRATES NBD PJSC-REG-S-SUB COCO 6.125%/VAR 20-PRP	1 766 000.00	1 765 540.84	0.03
USD HDFC BANK LTD-REG-S-SUB COCO 3.700%/VAR 21-PRP	5 824 000.00	5 070 257.92	0.10
USD KRUNG THAI/CAYMAN ISLANDS-REG-S-SUB COCO 4.400%/VAR 21-PRP	5 807 000.00	5 336 865.28	0.10
USD YAPI VE KREDI BANKASI AS-REG-S-SUB 13.875%/VAR 19-PRP	5 250 000.00	5 465 197.50	0.10
米ドル合計		28 340 328.34	0.54
転換社債型新株予約権付社債、変動利付債合計		28 340 328.34	0.54
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		4 652 063 800.05	88.06
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	3 360 000.00	3 125 086.52	0.06
USD AGROSUPER SA-REG-S 4.60000% 22-20.01.32	650 000.00	579 434.38	0.01
USD ALFA SAB DE CV-REG-S 6.87500% 14-25.03.44	4 369 000.00	4 444 092.19	0.08
USD BANGKOK BANK PUBLIC CO LTD HK-REG-S-SUB 9.02500% 97-15.03.29	1 625 000.00	1 841 823.75	0.03
USD BRAZIL MINAS SPE-REG-S 5.33300% 13-15.02.28	11 266 000.00	6 608 776.42	0.13
USD C&W SENIOR FIN DESIGNATD ACT V CO-REG-S 6.87500% 17-15.09.27	5 346 000.00	5 085 542.88	0.10
USD CAP SA-REG-S 3.90000% 21-27.04.31	1 500 000.00	1 231 875.00	0.02
USD CELULOSA ARAUCO Y CONSTITUCION SA-REG-S 5.15000% 19-29.01.50	5 323 000.00	4 734 143.12	0.09
USD CIBANCO SA INSTITUCION DE BANCA M-144A 4.37500% 21-22.07.31	2 970 000.00	2 264 625.00	0.04
USD CSN RESOURCES SA REG-S 5.87500% 22-08.04.32	2 225 000.00	2 019 187.50	0.04
USD DIGICEL INTL FINANCE LTD-144A (PIK) 13.00000% 20-31.12.25	299 390.00	149 695.00	0.00
USD DIGICEL INTL FINANCE LTD-REG-S (PIK) 13.00000% 20-31.12.25	694 769.00	347 384.50	0.01
USD INDIA GREEN ENERGY HOLDINGS-REG-S 5.37500% 20-29.04.24	750 000.00	726 637.50	0.01
USD INRETAIL CONSUMER-REG-S 3.25000% 21-22.03.28	8 110 000.00	6 979 668.75	0.13
USD INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP-REG-S 3.82500% 21-26.11.33	495 000.00	409 365.00	0.01
USD INVERSIONES CMPC SA-REG-S 4.75000% 14-15.09.24	440 000.00	434 984.00	0.01
USD INVERSIONES CMPC SA-REG-S 3.85000% 20-13.01.30	2 680 000.00	2 480 340.00	0.05
USD JBS USA LUX SA / JBS USA FOOD-REG-S 3.62500% 22-15.01.32	250 000.00	208 850.00	0.00
USD KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV-144A 3.80000% 14-08.04.24	140 000.00	136 920.00	0.00
USD KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV-144A 3.25000% 15-12.03.25	307 000.00	295 353.19	0.01
USD METALSA SA DE CV-REG-S 3.75000% 21-04.05.31	1 045 000.00	839 461.56	0.02
USD MINERA MEXICO SA DE CV-144A 4.50000% 19-26.01.50	810 000.00	645 991.20	0.01
USD MINERA MEXICO SA DE CV-REG-S 4.50000% 19-26.01.50	5 042 000.00	4 021 095.84	0.08
USD MV24 CAPITAL BV-REG-S 6.74800% 19-01.06.34	21 593 000.00	17 551 189.87	0.33
USD PERU, REPUBLIC OF 5.62500% 10-18.11.50	2 179 000.00	2 205 284.19	0.04
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 6.00000% 13-15.11.26	22 988 469.00	1 034 481.11	0.02
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 6.00000% 14-28.10.22	31 450 000.00	419 417.20	0.01
USD SAMARCO MINERACAO SA-REG-S *DEFAULT* 5.75000% 13-24.10.23	2 210 000.00	860 242.50	0.02
USD SIERRACOL ENERGY ANDINA LLC-REG-S 6.00000% 21-15.06.28	1 761 000.00	1 452 604.88	0.03
米ドル合計		73 133 553.05	1.39
ノート、固定利付債合計		73 133 553.05	1.39

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / 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 CHILE ELECTRICITY PEC SPA-REG-S 0.00000% 21-25.01.28	3 570 000.00	2 635 775.63	0.05
USD DELTA MERLIN DUNIA TE 0.00000% 21-26.06.32	1 055 000.00	53 815.55	0.00
米ドル合計		2 689 591.18	0.05
ノート、ゼロ・クーポン合計			0.05
ノート、変動利付債			
USD			
USD BANCO INDUSTRIAL SA/GUATE-REG-S-SUB 4.875%/VAR 21-29.01.31	4 770 000.00	4 456 372.50	0.08
USD BANCO MERCANTILE-REG-S-SUB 6.625%/VAR 21-PRP	1 351 000.00	1 190 822.06	0.02
USD CEMEX SAB DE CV-144A-SUB 5.125%/VAR 21-PRP	900 000.00	825 750.00	0.02
米ドル合計		6 472 944.56	0.12
ノート、変動利付債合計			0.12
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	439 156.25	0.01
米ドル合計		439 156.25	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	11 769 750.00	0.22
USD MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 3.50000% 21-07.07.27	3 041 000.00	2 638 402.01	0.05
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 9.00000% 11-17.11.21	2 611 961.00	117 538.25	0.00
USD PETROLIAM NASIONALBERHAD-144A 7.62500% 96-28.10.26	3 230 000.00	3 526 449.40	0.07
USD REPUBLIC OF AZERBAIJAN-REG-S 5.12500% 17-01.09.29	1 200 000.00	1 151 850.00	0.02
USD TENGIZCHEVROIL FINANCE CO INT-REG-S 4.00000% 16-15.08.26	2 988 000.00	2 644 940.25	0.05
米ドル合計		21 848 929.91	0.41
債券、固定利付債合計			0.41
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			1.98
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	2 050 290.00	0.04
USD COLBUN SA-REG-S 3.15000% 20-06.03.30	1 035 000.00	903 037.50	0.02
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE-REG-S 5.12500% 23-02.02.33	2 960 000.00	2 963 552.00	0.06
USD DIGICEL INTERNATIONAL FINANCE LTD-REG-S 8.75000% 20-25.05.24	3 906 100.00	3 357 537.08	0.06
USD FIRST QUANTUM MINERALS LTD-REG-S 6.87500% 20-15.10.27	3 351 000.00	3 231 955.73	0.06
USD GCC SAB DE CV-REG-S 3.61400% 22-20.04.32	6 365 000.00	5 389 563.75	0.10
USD INTERCHILE SA-144A 4.50000% 21-30.06.56	1 670 000.00	1 418 456.25	0.03
USD JBS USA LUX SA/JB CO/JB USA FN INC-144A 2.50000% 22-15.01.27	1 000 000.00	890 880.00	0.02
USD JBS USA LUX SA/JBS CO/JB USA FIN-144A 3.62500% 22-15.01.32	1 250 000.00	1 044 250.00	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

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD PRUMO PARTICIPACOES E INVESTIMENT-REG-S 7.50000% 19-31.12.31	5 580 000.00	4 412 650.81	0.08
USD SABLE INTERNATIONAL FINANCE LTD-REG-S 5.75000% 19-07.09.27	2 000 000.00	1 890 000.00	0.03
USD TENGIZCHEVROIL FINANCE CO INTL-REG-S 3.25000% 20-15.08.30	4 308 000.00	3 241 231.50	0.06
USD TENGIZCHEVROIL FINANCE CO INTL-REG-S 2.62500% 20-15.08.25	5 470 000.00	4 881 975.00	0.09
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NETHERLANDS 7.12500% 20-31.01.25	3 593 000.00	3 625 965.78	0.07
USD VTR COMUNICACIONES SPA-REG-S 4.37500% 21-15.04.29	565 000.00	372 900.00	0.01
米ドル合計		39 674 245.40	0.75
ノート、固定利付債合計		39 674 245.40	0.75
ノート、変動利付債			
USD MODERN LAND CHINA CO LTD-REG-S (PIK) 8.000%/VAR 22-30.12.24	182 567.00	14 069.07	0.00
米ドル合計		14 069.07	0.00
ノート、変動利付債合計		14 069.07	0.00
債券、固定利付債			
USD ARABIAN CENTRES SUKUK LTD-REG-S 5.37500% 19-26.11.24	905 000.00	883 958.75	0.02
USD CIA CERVECERIAS UNIDAS SA-144A 3.35000% 22-19.01.32	2 010 000.00	1 714 530.00	0.03
米ドル合計		2 598 488.75	0.05
債券、固定利付債合計		2 598 488.75	0.05
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		42 286 803.22	0.80
投資有価証券合計		4 798 934 778.22	90.84

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 08.03.23	-726.00	3 007 413.64	0.06
EUR EURO-BOBL FUTURE 08.03.23	-705.00	1 113 233.83	0.02
EUR EURO-SCHATZ FUTURE 08.03.23	-119.00	115 023.56	0.00
EUR EURO-BUXL FUTURE 08.03.23	-132.00	1 839 290.85	0.03
USD US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 22.03.23	729.00	1 268 532.02	0.02
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 22.03.23	-677.00	4 968.13	0.00
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 22.03.23	-1 269.00	-543 417.72	-0.01
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.23	1 356.00	-88 582.54	0.00
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.23	2 587.00	687 038.25	0.01
USD US LONG BOND FUTURE 22.03.23	780.00	307 959.71	0.01
債券に係る金融先物合計		7 711 459.73	0.14
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		7 711 459.73	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

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されていない派生商品			
クレジット・デフォルト・スワップ*			
USD ICE/TURKEY CREDIT DEFAULT SWAP REC TP 1.00000% 22-20.12.27	6 640 000.00	-1 128 790.13	-0.02
クレジット・デフォルト・スワップ合計		-1 128 790.13	-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			
		-1 128 790.13	-0.02
派生商品合計		6 582 669.60	0.12

先渡為替契約

購入通貨	購入額	売却通貨	売却額	満期日		
USD	77 657 235.14	EUR	73 981 466.00	3.3.2023	-2 840 860.26	-0.05
USD	2 558 986.64	EUR	2 408 087.00	3.3.2023	-61 215.79	0.00
USD	61 834 293.43	EUR	58 437 000.00	15.3.2023	-1 795 457.84	-0.03
USD	585 016.06	EUR	552 000.00	15.3.2023	-16 035.03	0.00
EUR	129 000.00	USD	137 371.79	15.3.2023	3 091.24	0.00
EUR	68 000.00	USD	72 823.74	15.3.2023	1 218.79	0.00
EUR	199 000.00	USD	212 743.34	15.3.2023	3 939.93	0.00
EUR	543 000.00	USD	580 778.52	15.3.2023	10 472.83	0.00
EUR	68 000.00	USD	72 442.28	15.3.2023	1 600.25	0.00
USD	459 316.18	EUR	431 000.00	15.3.2023	-9 982.77	0.00
EUR	795 000.00	USD	849 345.25	15.3.2023	16 298.99	0.00
EUR	320 000.00	USD	342 925.44	15.3.2023	5 509.98	0.00
USD	2 019 183.62	EUR	1 910 000.00	3.3.2023	-59 058.01	0.00
EUR	2 015 000.00	USD	2 135 546.17	15.3.2023	58 508.09	0.00
EUR	156 000.00	USD	165 313.14	15.3.2023	4 549.13	0.00
USD	69 805 312.57	EUR	65 494 712.57	3.4.2023	-1 581 434.14	-0.03
USD	867 139.98	EUR	822 395.11	15.2.2023	-26 806.72	0.00
EUR	4 341 778.49	USD	4 692 442.23	3.4.2023	39 931.26	0.00
USD	827 227.45	EUR	767 000.00	15.3.2023	-7 928.69	0.00
EUR	2 004 945.55	USD	2 168 988.19	3.4.2023	16 326.23	0.00
JPY	1 409 790 290.00	USD	10 991 000.00	24.2.2023	-118 113.14	0.00
SGD	12 292 538.78	USD	9 293 000.00	24.2.2023	63 889.53	0.00
CHF	614 574 803.69	USD	668 767 000.00	24.2.2023	1 741 319.89	0.03
GBP	58 522 737.49	USD	71 576 000.00	24.2.2023	505 950.93	0.01
EUR	1 283 974 900.18	USD	1 393 046 000.00	24.2.2023	3 422 222.30	0.06
EUR	26 658 430.13	USD	29 000 000.00	24.2.2023	-5 935.92	0.00
EUR	815 000.00	USD	884 951.94	15.3.2023	2 469.51	0.00
USD	2 323 991.77	EUR	2 137 000.00	15.3.2023	-2 903.49	0.00
USD	1 819 834.15	EUR	1 673 255.00	3.3.2023	-808.88	0.00
USD	7 050 159.82	EUR	6 445 023.66	28.2.2023	39 592.71	0.00
CHF	254 632 804.00	USD	277 000 000.00	24.2.2023	807 376.05	0.02
EUR	139 507 135.97	USD	152 000 000.00	24.2.2023	-270 178.69	-0.01
GBP	1 373 665.22	USD	1 700 000.00	24.2.2023	-8 068.40	0.00
JPY	33 732 400.00	USD	260 000.00	24.2.2023	158.25	0.00
SGD	4 266 775.44	USD	3 240 000.00	24.2.2023	7 803.17	0.00
USD	893 377.37	EUR	820 000.00	15.3.2023	511.62	0.00
EUR	98 010.00	USD	106 922.15	3.4.2023	-94.98	0.00
USD	12 299 455.01	EUR	11 283 000.00	15.3.2023	13 840.01	0.00
USD	3 636 531.23	EUR	3 336 000.00	15.3.2023	4 092.02	0.00

* 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」

添付の注記は当財務書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

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄			数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / 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 (続き)						
購入通貨	購入額	売却通貨	売却額	満期日		
EUR	191 087 249.70	USD	208 000 000.00	24.2.2023	-170 959.22	0.00
CHF	84 812 408.00	USD	92 000 000.00	24.2.2023	531 331.99	0.01
USD	17 508 948.55	EUR	16 075 039.00	3.3.2023	17 945.83	0.00
USD	1 982 545.02	EUR	1 819 000.00	15.3.2023	1 907.45	0.00
USD	684 719.75	EUR	627 368.83	15.2.2023	2 767.38	0.00
USD	731 847.70	EUR	670 000.00	28.2.2023	3 055.97	0.00
USD	1 278 512.87	EUR	1 174 154.06	28.2.2023	1 328.14	0.00
USD	2 183 001.60	EUR	2 000 000.00	3.3.2023	6 832.36	0.00
USD	4 562 655.44	EUR	4 186 000.00	15.3.2023	4 684.65	0.00
USD	485 587.60	EUR	445 000.00	15.3.2023	1 044.60	0.00
USD	3 700 167.98	EUR	3 397 000.00	15.3.2023	1 308.27	0.00
USD	4 240 073.05	EUR	3 910 491.00	3.3.2023	-14 872.07	0.00
USD	170 809.58	EUR	157 000.00	15.3.2023	-141.55	0.00
USD	171 979.24	EUR	158 000.00	15.3.2023	-60.75	0.00
先渡為替契約合計					351 963.01	0.01
現金預金、要求払預金および預託金勘定ならびにその他の流動資産					449 550 318.19*	8.51
当座借越およびその他の短期負債					-3 511 170.83	-0.07
その他の資産および負債					30 785 442.15	0.59
純資産総額					5 282 694 000.34	100.00

* 2023年1月31日現在、1,610,000.00米ドルの現金が取引相手方であるモルガン・スタンレーに対する担保および2,899,424.16米ドルの現金が取引相手方であるUBSヨーロッパSE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・サステナブル

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / 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	1 201 000.00	1 188 689.75	0.02
アメリカ合衆国合計		1 188 689.75	0.02
株式合計		1 188 689.75	0.02
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	2 927 245.34	0.05
米ドル合計		2 927 245.34	0.05
アセット・バック証券、変動利付債合計		2 927 245.34	0.05
ノート、固定利付債			
EUR			
EUR DIGITAL DUTCH FINCO BV-REG-S 1.50000% 20-15.03.30	2 046 000.00	1 814 643.91	0.03
EUR DIGITAL DUTCH FINCO BV-REG-S 1.25000% 20-01.02.31	4 750 000.00	3 998 166.01	0.07
EUR PROLOGIS EURO FINANCE LLC 0.37500% 20-06.02.28	5 565 000.00	5 093 554.58	0.09
ユーロ合計		10 906 364.50	0.19
USD			
USD ABBVIE INC 2.60000% 20-21.11.24	11 825 000.00	11 395 850.53	0.20
USD ABBVIE INC 2.95000% 20-21.11.26	12 209 000.00	11 553 744.44	0.20
USD ABBVIE INC 3.20000% 16-14.05.26	2 130 000.00	2 045 021.15	0.04
USD ABBVIE INC 3.20000% 20-21.11.29	2 800 000.00	2 603 537.02	0.04
USD ABBVIE INC 4.05000% 20-21.11.39	1 730 000.00	1 558 721.26	0.03
USD ABN AMRO BANK NV-144A-SUB 4.75000% 15-28.07.25	2 464 000.00	2 415 705.60	0.04
USD AEP TEXAS INC 4.70000% 22-15.05.32	3 225 000.00	3 212 165.98	0.06
USD AERCAP IRE CAP LTD/GLB AVIA TRUST 4.45000% 18-01.10.25	1 075 000.00	1 048 726.98	0.02
USD AERCAP IRE CAP LTD/GLB AVIA TRUST 1.75000% 21-30.01.26	4 600 000.00	4 134 702.41	0.07
USD AERCAP IRELAND CAP/ GLBL AVIATION TRUST 6.50000% 20-15.07.25	640 000.00	651 712.16	0.01
USD AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP GLO 3.00000% 21-29.10.28	9 860 000.00	8 692 002.16	0.15
USD AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP GLO 3.30000% 21-30.01.32	2 675 000.00	2 245 954.37	0.04
USD AETNA INC 3.50000% 14-15.11.24	1 000 000.00	977 548.50	0.02
USD AGILENT TECHNOLOGIES INC 2.10000% 20-04.06.30	3 150 000.00	2 637 682.74	0.05
USD AGILENT TECHNOLOGIES INC 2.30000% 21-12.02.31	3 000 000.00	2 516 645.85	0.04
USD AIR LEASE CORP 1.87500% 21-15.08.26	2 570 000.00	2 290 343.40	0.04
USD AIR LEASE CORP 2.10000% 21-01.09.28	2 599 000.00	2 219 730.63	0.04
USD AIR LEASE CORP 2.20000% 22-15.01.27	1 270 000.00	1 138 702.69	0.02
USD AIR LEASE CORP 3.00000% 16-15.09.23	150 000.00	148 157.41	0.00
USD AIR LEASE CORP 3.25000% 18-01.03.25	2 265 000.00	2 172 301.90	0.04
USD AIR LEASE CORP 3.62500% 17-01.12.27	1 604 000.00	1 501 400.26	0.03
USD AIR LEASE CORP 4.62500% 18-01.10.28	4 422 000.00	4 271 891.23	0.07
USD AIRCASTLE LTD 4.25000% 19-15.06.26	72 000.00	69 477.12	0.00
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC 3.45000% 17-30.04.25	1 015 000.00	986 199.96	0.02
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC 2.75000% 19-15.12.29	1 600 000.00	1 402 249.11	0.02
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITY INC 1.87500% 20-01.02.33	3 500 000.00	2 705 680.74	0.05
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC 2.95000% 22-15.03.34	9 330 000.00	7 875 267.33	0.14
USD ALIBABA GROUP HOLDING LTD 2.12500% 21-09.02.31	2 571 000.00	2 113 516.26	0.04
USD ALLY FINANCIAL INC 1.45000% 20-02.10.23	4 850 000.00	4 735 715.86	0.08
USD ALLY FINANCIAL INC 3.87500% 19-21.05.24	4 585 000.00	4 493 125.63	0.08
USD ALLY FINANCIAL INC 5.80000% 20-01.05.25	7 500 000.00	7 584 619.95	0.13

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット・サステナブル

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD ALLY FINANCIAL INC 8.0000% 08-01.11.31	1 564 000.00	1 722 505.89	0.03
USD ALPHABET INC 1.1000% 20-15.08.30	4 000 000.00	3 247 491.04	0.06
USD AMAZON.COM INC 3.1500% 18-22.08.27	6 550 000.00	6 262 363.03	0.11
USD AMAZON.COM INC 4.5500% 22-01.12.27	4 213 000.00	4 266 486.73	0.07
USD AMCOR FINANCE USA INC 3.6250% 20-28.04.26	2 950 000.00	2 835 102.72	0.05
USD AMERICAN ASSETS TRUST LP 3.3750% 21-01.02.31	1 340 000.00	1 093 403.99	0.02
USD AMERICAN EXPRESS CO 3.7000% 18-03.08.23	11 500 000.00	11 434 180.90	0.20
USD AMERICAN EXPRESS CO 3.1250% 19-20.05.26	11 485 000.00	10 976 345.08	0.19
USD AMERICAN EXPRESS CO 2.5000% 19-30.07.24	1 750 000.00	1 690 923.31	0.03
USD AMERICAN EXPRESS CO 2.5500% 22-04.03.27	3 165 000.00	2 935 567.79	0.05
USD AMERICAN EXPRESS CO 4.0500% 22-03.05.29	1 950 000.00	1 904 570.52	0.03
USD AMERICAN HOMES 4 RENT LP 2.3750% 21-15.07.31	665 000.00	542 757.38	0.01
USD AMERICAN HOMES 4 RENT LP 3.6250% 22-15.04.32	5 400 000.00	4 801 443.21	0.08
USD AMERICAN HONDA FINANCE CORP 4.7000% 23-12.01.28	2 750 000.00	2 777 027.66	0.05
USD AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC 3.9000% 16-01.04.26	730 000.00	715 076.22	0.01
USD AMERICAN TOWER CORP 5.0000% 13-15.02.24	2 958 000.00	2 956 533.46	0.05
USD AMERICAN TOWER CORP 3.3750% 16-15.10.26	1 990 000.00	1 888 600.30	0.03
USD AMERICAN TOWER CORP 3.5500% 17-15.07.27	4 000 000.00	3 777 687.12	0.07
USD AMERICAN TOWER CORP 3.0000% 17-15.06.23	2 150 000.00	2 133 229.74	0.04
USD AMERICAN TOWER CORP 3.8000% 19-15.08.29	4 048 000.00	3 783 219.80	0.07
USD AMERICAN TOWER CORP 1.4500% 21-15.09.26	3 765 000.00	3 335 817.68	0.06
USD AMERICAN TOWER CORP 4.0500% 22-15.03.32	5 452 000.00	5 051 614.17	0.09
USD AMERICAN WATER CAPITAL CORP 2.9500% 17-01.09.27	2 505 000.00	2 357 531.72	0.04
USD AMERICAN WATER CAPITAL CORP 3.4500% 19-01.06.29	5 670 000.00	5 311 647.15	0.09
USD AMERISOURCEBERGEN CORP 2.8000% 20-15.05.30	3 403 000.00	2 989 886.11	0.05
USD AMERISOURCEBERGEN CORP 0.7370% 21-15.03.23	1 442 000.00	1 434 969.95	0.02
USD AMGEN INC 1.6500% 21-15.08.28	7 550 000.00	6 498 901.15	0.11
USD AMGEN INC 2.2000% 20-21.02.27	5 845 000.00	5 361 884.57	0.09
USD AMGEN INC 2.3000% 20-25.02.31	1 443 000.00	1 214 182.88	0.02
USD AMGEN INC 2.6000% 16-19.08.26	7 000 000.00	6 580 596.12	0.11
USD AMGEN INC 3.0000% 22-22.02.29	8 854 000.00	8 130 530.63	0.14
USD AMGEN INC 3.1500% 20-21.02.40	3 820 000.00	2 986 827.71	0.05
USD AMGEN INC 3.2000% 17-02.11.27	1 464 000.00	1 386 015.60	0.02
USD AMGEN INC 4.2000% 22-01.03.33	5 069 000.00	4 863 441.31	0.08
USD ANALOG DEVICES INC 1.7000% 21-01.10.28	5 145 000.00	4 479 774.50	0.08
USD ANTHEM INC 2.8750% 19-15.09.29	4 065 000.00	3 670 991.62	0.06
USD ANTHEM INC 3.6500% 17-01.12.27	2 000 000.00	1 928 963.40	0.03
USD AON CORP / AON GLOBAL HOLDINGS PLC 2.0500% 21-23.08.31	3 430 000.00	2 807 448.25	0.05
USD APPLE INC 1.2000% 21-08.02.28	1 275 000.00	1 109 011.01	0.02
USD APPLE INC 1.6500% 20-11.05.30	7 951 000.00	6 695 329.10	0.12
USD APPLE INC 2.0500% 19-11.09.26	11 700 000.00	10 852 121.59	0.19
USD APPLE INC 2.4500% 16-04.08.26	6 005 000.00	5 660 633.73	0.10
USD APPLE INC 3.0000% 17-20.06.27	1 085 000.00	1 039 952.45	0.02
USD APPLE INC 3.0000% 17-13.11.27	5 230 000.00	4 985 426.63	0.09
USD APPLE INC 3.2500% 16-23.02.26	3 525 000.00	3 426 742.07	0.06
USD APPLE INC 3.2500% 22-08.08.29	6 252 000.00	5 938 258.39	0.10
USD APPLIED MATERIALS INC 1.7500% 20-01.06.30	6 067 000.00	5 093 945.17	0.09
USD APTIV PLC 3.2500% 22-01.03.32	5 110 000.00	4 411 574.96	0.08
USD AQUA AMERICA INC 3.5660% 19-01.05.29	5 070 000.00	4 715 182.24	0.08
USD ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO 3.2500% 20-27.03.30	3 993 000.00	3 725 772.90	0.06
USD ASHTAD CAPITAL INC-144A 4.3750% 17-15.08.27	2 000 000.00	1 918 073.36	0.03
USD ASTRAZENECA FINANCE LLC 2.2500% 21-28.05.31	7 387 000.00	6 387 853.15	0.11
USD ASTRAZENECA FINANCE LLC 1.7500% 21-28.05.28	3 130 000.00	2 753 365.28	0.05
USD ASTRAZENECA PLC 0.7000% 20-08.04.26	6 335 000.00	5 652 522.28	0.10
USD ASTRAZENECA PLC 1.3750% 20-06.08.30	5 700 000.00	4 678 787.88	0.08
USD ASTRAZENECA PLC 3.5000% 18-17.08.23	3 870 000.00	3 841 931.28	0.07
USD AT&T INC 1.6500% 20-01.02.28	3 875 000.00	3 396 881.58	0.06
USD AT&T INC 1.7000% 21-25.03.26	5 050 000.00	4 634 972.87	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・サステナブル

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD AT&T INC 2.30000% 20-01.06.27	645 000.00	589 487.85	0.01
USD AT&T INC 2.55000% 21-01.12.33	13 031 000.00	10 536 507.07	0.18
USD AT&T INC 3.50000% 20-01.06.41	1 935 000.00	1 553 457.71	0.03
USD AT&T INC 3.50000% 21-15.09.53	2 275 000.00	1 678 826.24	0.03
USD AT&T INC 4.30000% 18-15.02.30	7 430 000.00	7 253 901.57	0.13
USD AT&T INC 4.35000% 19-01.03.29	7 860 000.00	7 725 567.97	0.13
USD AT&T INC 4.50000% 15-15.05.35	1 015 000.00	964 733.38	0.02
USD ATMOS ENERGY CORP 5.45000% 22-15.10.32	825 000.00	884 827.69	0.02
USD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK-REG-S-SUB-4.40000% 16-19.05.26	1 800 000.00	1 757 942.82	0.03
USD AUTODESK INC 4.37500% 15-15.06.25	3 900 000.00	3 873 637.06	0.07
USD AUTOZONE INC 4.75000% 22-01.08.32	2 121 000.00	2 121 012.62	0.04
USD AUTOZONE INC 4.75000% 23-01.02.33	4 925 000.00	4 897 402.36	0.08
USD AVANGRID INC 3.15000% 17-01.12.24	2 190 000.00	2 115 186.91	0.04
USD AVANGRID INC 3.20000% 20-15.04.25	15 570 000.00	14 971 125.01	0.26
USD AVANGRID INC 3.80000% 19-01.06.29	2 953 000.00	2 778 647.53	0.05
USD AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD-144A 3.25000% 20-15.02.27	850 000.00	767 152.67	0.01
USD BAIDU INC 3.07500% 20-07.04.25	406 000.00	386 946.42	0.01
USD BALL CORP 2.87500% 20-15.08.30	2 945 000.00	2 414 295.57	0.04
USD BALTIMORE GAS & ELECTRIC CO 2.40000% 16-15.08.26	3 705 000.00	3 455 400.04	0.06
USD BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 1.12500% 20-18.09.25	5 600 000.00	5 067 078.63	0.09
USD BANCO SANTANDER SA 1.84900% 21-25.03.26	2 600 000.00	2 346 368.57	0.04
USD BANCO SANTANDER SA 2.70600% 19-27.06.24	1 800 000.00	1 744 104.20	0.03
USD BANCO SANTANDER SA 4.25000% 17-11.04.27	800 000.00	778 004.01	0.01
USD BANCO SANTANDER SA 5.29400% 22-18.08.27	4 200 000.00	4 216 806.64	0.07
USD BANCO SANTANDER SA-SUB 5.17900% 15-19.11.25	3 600 000.00	3 588 487.09	0.06
USD BANCO SANTANDER SA-SUB 2.74900% 20-03.12.30	800 000.00	645 046.38	0.01
USD BANK OF NOVA SCOTIA 1.05000% 21-02.03.26	5 325 000.00	4 761 340.66	0.08
USD BANK OF NOVA SCOTIA 5.25000% 22-06.12.24	11 454 000.00	11 544 277.78	0.20
USD BANK OF NOVA SCOTIA-SUB COCO 4.50000% 15-16.12.25	6 000 000.00	5 928 668.88	0.10
USD BANK OF NOVA SCOTIA/THE 0.65000% 21-31.07.24	10 255 000.00	9 635 370.34	0.17
USD BANK OF NOVA SCOTIA/THE 4.75000% 23-02.02.26	3 740 000.00	3 737 578.87	0.06
USD BARCLAYS PLC 3.65000% 15-16.03.25	8 000 000.00	7 777 606.56	0.13
USD BARCLAYS PLC 4.37500% 16-12.01.26	5 040 000.00	4 938 259.08	0.09
USD BARCLAYS PLC 5.50100% 22-09.08.28	730 000.00	734 935.66	0.01
USD BARCLAYS PLC-SUB 4.83600% 17-09.05.28	590 000.00	569 958.48	0.01
USD BARCLAYS PLC-SUB 5.20000% 16-12.05.26	5 350 000.00	5 328 463.58	0.09
USD BAXALTA INC 4.00000% 16-23.06.25	893 000.00	876 991.33	0.02
USD BECTON DICKINSON AND CO 3.73400% 14-15.12.24	1 910 000.00	1 875 840.48	0.03
USD BECTON DICKINSON AND CO 3.36300% 17-06.06.24	427 000.00	418 462.27	0.01
USD BECTON DICKINSON AND CO 1.95700% 21-11.02.31	2 650 000.00	2 181 716.01	0.04
USD BEMIS CO INC 2.63000% 20-19.06.30	5 670 000.00	4 832 237.65	0.08
USD BIDVEST GROUP UK PLC/THE-144A 3.625000% 21-23.09.26	951 000.00	870 343.32	0.01
USD BIOGEN INC 2.25000% 20-01.05.30	5 138 000.00	4 356 156.04	0.08
USD BLOCK FINANCIAL CORP 2.50000% 21-15.07.28	3 020 000.00	2 652 204.01	0.05
USD BNP PARIBAS-REG-S 3.37500% 18-09.01.25	1 185 000.00	1 148 960.87	0.02
USD BOARDWALK PIPELINES LP 5.95000% 16-01.06.26	2 850 000.00	2 923 172.78	0.05
USD BOOKING HOLDINGS INC 4.62500% 20-13.04.30	6 926 000.00	6 953 379.45	0.12
USD BOSTON PROPERTIES LP 3.25000% 20-30.01.31	127 000.00	109 183.19	0.00
USD BOSTON PROPERTIES LP 2.55000% 21-01.04.32	2 155 000.00	1 701 026.43	0.03
USD BP CAPITAL MARKETS AMERICA INC 3.41000% 19-11.02.26	5 450 000.00	5 303 247.85	0.09
USD BPCE SA-144A-SUB 5.15000% 14-21.07.24	2 685 000.00	2 656 385.31	0.05
USD BRASKEM NETHERLANDS FINANCE BV-144A 4.50000% 19-31.01.30	5 000 000.00	4 386 000.00	0.08
USD BRISTOL MYERS SQUIBB CO 3.55000% 22-15.03.42	3 150 000.00	2 728 664.00	0.05
USD BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 3.20000% 20-15.06.26	2 274 000.00	2 202 123.07	0.04
USD BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 2.95000% 22-15.03.32	1 865 000.00	1 689 881.12	0.03
USD BRITISH AIRW CL AA PASS THR TRUST-144A 3.80000% 18-20.09.31	1 500 000.00	991 352.51	0.02
USD BRITISH TELECOMMUNICATIONS PLC-144A 3.25000% 19-08.11.29	3 730 000.00	3 333 315.21	0.06
USD BROADCOM CORP/CAYMAN FIN LTD 3.87500% 18-15.01.27	3 200 000.00	3 083 340.00	0.05

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット・サステナブル

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD BROADCOM CORP/CAYMAN FIN LTD 3.50000% 18-15.01.28	618 000.00	579 057.39	0.01
USD BROADCOM INC 5.00000% 20-15.04.30	4 298 000.00	4 251 015.30	0.07
USD BROADSTONE NET LEASE 2.60000% 21-15.09.31	3 580 000.00	2 732 686.49	0.05
USD BUCKEYE PARTNERS LP 4.12500% 17-01.12.27	2 055 000.00	1 859 055.75	0.03
USD BUNGE LTD FINANCE CORP 3.25000% 16-15.08.26	3 140 000.00	2 978 890.90	0.05
USD BUNGE LTD FINANCE CORP 3.75000% 17-25.09.27	3 035 000.00	2 915 170.70	0.05
USD BUNGE LTD FINANCE CORP 2.75000% 21-14.05.31	3 582 000.00	3 067 661.08	0.05
USD CAMPBELL SOUP CO 3.95000% 18-15.03.25	2 745 000.00	2 703 546.19	0.05
USD CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO 6.25000% 04-01.08.34	1 150 000.00	1 307 476.64	0.02
USD CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD 2.05000% 20-15.07.25	2 600 000.00	2 432 691.48	0.04
USD CANADIAN PACIFIC RAILWAY 1.35000% 21-02.12.24	6 300 000.00	5 920 317.96	0.10
USD CARLISLE COS INC 2.20000% 21-01.03.32	4 270 000.00	3 408 022.01	0.06
USD CCO LLC/CAPITAL 2.25000% 21-15.01.29	2 200 000.00	1 844 098.10	0.03
USD CCO LLC/CAPITAL 2.30000% 20-01.02.32	3 000 000.00	2 307 130.50	0.04
USD CCO LLC/CAPITAL 3.75000% 17-15.02.28	2 265 000.00	2 110 766.45	0.04
USD CCO LLC/CAPITAL 4.20000% 17-15.03.28	1 450 000.00	1 379 209.42	0.02
USD CCO LLC/CAPITAL 6.38400% 16-23.10.35	4 390 000.00	4 489 769.42	0.08
USD CELANESE US HOLDINGS LLC 6.05000% 22-15.03.25	1 200 000.00	1 209 214.14	0.02
USD CELANESE US HOLDINGS LLC 5.90000% 22-05.07.24	1 200 000.00	1 206 892.18	0.02
USD CENTENE CORP 2.45000% 21-15.07.28	2 480 000.00	2 148 296.16	0.04
USD CENTENE CORP 2.62500% 21-01.08.31	470 000.00	384 909.52	0.01
USD CENTENE CORP 3.00000% 20-15.10.30	5 712 000.00	4 883 760.00	0.08
USD CERRO DEL AGUILA SA-144A 4.12500% 17-16.08.27	1 018 000.00	951 384.62	0.02
USD CHARLES SCHWAB CORP/THE 2.45000% 22-03.03.27	3 535 000.00	3 289 080.44	0.06
USD CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING 3.50000% 21-01.06.41	4 800 000.00	3 373 403.47	0.06
USD CHEVRON USA INC 3.25000% 21-15.10.29	435 000.00	410 496.21	0.01
USD CHURCH & DWIGHT CO INC 3.15000% 17-01.08.27	1 880 000.00	1 790 068.21	0.03
USD CHURCH & DWIGHT CO INC 5.60000% 22-15.11.32	2 495 000.00	2 681 388.12	0.05
USD CIGNA CORP 2.40000% 20-15.03.30	4 845 000.00	4 185 750.06	0.07
USD CIGNA CORP 4.12500% 19-15.11.25	8 087 000.00	7 995 471.82	0.14
USD CIGNA CORP 4.37500% 19-15.10.28	12 077 000.00	11 976 799.67	0.21
USD CITIGROUP INC 3.20000% 16-21.10.26	2 005 000.00	1 899 676.65	0.03
USD CITIGROUP INC 3.40000% 16-01.05.26	1 800 000.00	1 733 643.36	0.03
USD CITIGROUP INC 3.70000% 16-12.01.26	2 481 000.00	2 423 457.62	0.04
USD CITIGROUP INC-SUB 4.40000% 15-10.06.25	3 120 000.00	3 095 612.74	0.05
USD CITIGROUP INC-SUB 4.45000% 15-29.09.27	15 510 000.00	15 217 064.34	0.26
USD CITIGROUP INC-SUB 4.60000% 16-09.03.26	4 250 000.00	4 225 151.65	0.07
USD CITIZENS BANK NA/PROVIDENCE RI 2.25000% 20-28.04.25	3 200 000.00	3 007 326.66	0.05
USD CITIZENS FINANCIAL GROUP INC-SUB 4.30000% 15-03.12.25	7 323 000.00	7 141 987.15	0.12
USD CLOROX CO 1.80000% 20-15.05.30	3 665 000.00	3 024 477.66	0.05
USD COACH INC 3.05000% 21-15.03.32	685 000.00	561 486.25	0.01
USD COACH INC 4.12500% 17-15.07.27	904 000.00	869 249.25	0.01
USD COCA-COLA CO/THE 2.00000% 21-05.03.31	5 155 000.00	4 398 500.19	0.08
USD COLORADO INTERSTATE GAS/ ISSUING-REG-S 4.15000% 16-15.08.26	3 030 000.00	2 923 069.33	0.05
USD COMCAST CORP 2.65000% 19-01.02.30	1 945 000.00	1 738 982.53	0.03
USD COMCAST CORP 3.55000% 18-01.05.28	2 926 000.00	2 814 858.90	0.05
USD COMCAST CORP 3.95000% 18-15.10.25	2 616 000.00	2 578 322.28	0.04
USD COMCAST CORP 4.25000% 13-15.01.33	4 440 000.00	4 349 033.85	0.08
USD COMCAST CORP 4.25000% 18-15.10.30	3 775 000.00	3 732 141.26	0.06
USD COMCAST CORP 4.40000% 15-15.08.35	2 930 000.00	2 869 446.98	0.05
USD CONAGRA BRANDS INC 4.30000% 18-01.05.24	2 110 000.00	2 088 146.60	0.04
USD CONAGRA BRANDS INC 4.85000% 18-01.11.28	2 720 000.00	2 724 882.73	0.05
USD CONAGRA INC 4.60000% 18-01.11.25	6 795 000.00	6 748 332.68	0.12
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-144A 3.00000% 19-30.09.29	3 711 000.00	3 310 443.94	0.06
USD CREDIT SUISSE FIRST BOSTON NY 1.25000% 21-07.08.26	5 720 000.00	4 809 621.73	0.08
USD CREDIT SUISSE GROUP AG 3.75000% 16-26.03.25	5 620 000.00	5 273 968.85	0.09
USD CREDIT SUISSE-REG-S-SUB 6.50000% 13-08.08.23	2 400 000.00	2 361 360.00	0.04
USD CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 3.70000% 16-15.05.26	4 150 000.00	4 003 856.34	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・サステナブル

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 3.30000% 20-01.07.30	2 530 000.00	2 299 804.23	0.04
USD CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 1.35000% 20-15.07.25	3 150 000.00	2 893 910.52	0.05
USD CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 1.05000% 21-15.07.26	12 415 000.00	10 954 448.74	0.19
USD CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 2.50000% 21-15.07.31	3 740 000.00	3 146 855.56	0.05
USD CSX CORP 2.60000% 16-01.11.26	2 000 000.00	1 870 148.94	0.03
USD CSX CORP 3.25000% 17-01.06.27	3 145 000.00	3 007 403.67	0.05
USD CUBESMART LP 2.25000% 21-15.12.28	980 000.00	840 768.18	0.01
USD CUBESMART LP 4.37500% 19-15.02.29	1 315 000.00	1 246 906.20	0.02
USD CVS HEALTH CORP 1.30000% 20-21.08.27	6 400 000.00	5 551 403.13	0.10
USD CVS HEALTH CORP 2.12500% 21-15.09.31	4 390 000.00	3 602 013.44	0.06
USD CVS HEALTH CORP 2.62500% 19-15.08.24	1 700 000.00	1 646 606.44	0.03
USD CVS HEALTH CORP 3.75000% 20-01.04.30	6 000 000.00	5 621 730.36	0.10
USD CVS HEALTH CORP 3.87500% 15-20.07.25	5 359 000.00	5 249 889.37	0.09
USD CVS HEALTH CORP 4.30000% 18-25.03.28	7 082 000.00	6 962 085.67	0.12
USD CVS HEALTH CORP 4.87500% 15-20.07.35	1 020 000.00	1 014 509.67	0.02
USD CVS HEALTH CORP 5.00000% 16-01.12.24	1 830 000.00	1 823 503.28	0.03
USD CVS HEALTH CORP 5.05000% 18-25.03.48	1 830 000.00	1 739 813.13	0.03
USD DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA-REG-S 1.75000% 20-10.03.23	3 860 000.00	3 847 869.22	0.07
USD DANSKE BANK AS-144A 5.37500% 19-12.01.24	1 590 000.00	1 590 480.32	0.03
USD DDR CORP 4.25000% 15-01.02.26	125 000.00	120 393.93	0.00
USD DDR CORP 4.70000% 17-01.06.27	2 850 000.00	2 724 827.69	0.05
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 5.75000% 23-01.02.33	1 122 000.00	1 121 117.83	0.02
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 6.20000% 21-15.07.30	3 750 000.00	3 958 435.80	0.07
USD DENTSPLY INTERNATIONAL INC 3.25000% 20-01.06.30	3 650 000.00	3 208 301.42	0.06
USD DH EUROPE FINANCE II SARL 2.20000% 19-15.11.24	5 265 000.00	5 054 922.71	0.09
USD DICK ' S SPORTING GOODS INC 3.15000% 22-15.01.32	5 250 000.00	4 295 655.42	0.07
USD DISCOVER BANK 4.65000% 18-13.09.28	3 310 000.00	3 217 171.55	0.06
USD DISCOVER FINANCIAL SERVICES 6.70000% 22-29.11.32	4 934 000.00	5 266 961.18	0.09
USD DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC 3.95000% 17-20.03.28	5 750 000.00	5 374 022.68	0.09
USD DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC 4.12500% 19-15.05.29	10 134 000.00	9 316 102.69	0.16
USD DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC 3.62500% 20-15.05.30	2 295 000.00	2 018 747.13	0.03
USD DOLLAR GENERAL CORP 4.25000% 22-20.09.24	2 280 000.00	2 259 193.29	0.04
USD DOLLAR TREE INC 2.65000% 21-01.12.31	2 340 000.00	1 971 483.98	0.03
USD DOLLAR TREE INC 4.00000% 18-15.05.25	7 510 000.00	7 370 874.56	0.13
USD DOW CHEMICAL CO/THE 6.30000% 22-15.03.33	3 746 000.00	4 127 071.92	0.07
USD DR HORTON INC 1.30000% 21-15.10.26	4 967 000.00	4 366 665.78	0.08
USD DR HORTON INC 1.40000% 20-15.10.27	3 453 000.00	2 950 121.00	0.05
USD DR HORTON INC 2.50000% 19-15.10.24	4 470 000.00	4 299 181.54	0.07
USD DUPONT DE NEMOURS INC 4.49300% 18-15.11.25	6 438 000.00	6 429 992.80	0.11
USD EATON CORP 4.15000% 22-15.03.33	6 235 000.00	6 029 605.07	0.10
USD EBAY INC 2.70000% 20-11.03.30	1 550 000.00	1 362 307.51	0.02
USD ECOPETROL SA 8.87500% 23-13.01.33	1 404 000.00	1 437 415.20	0.02
USD EMPRESA DE TRANSPORTE DE PASA MET-144A 3.65000% 20-07.05.30	200 000.00	184 412.50	0.00
USD EMPRESAS PUBLICAS DE MEDELLIN ESP-144A 4.25000% 19-18.07.29	1 131 000.00	926 925.19	0.02
USD ENBRIDGE INC 1.60000% 21-04.10.26	4 485 000.00	4 007 870.99	0.07
USD ENBRIDGE INC 3.12500% 19-15.11.29	3 025 000.00	2 727 017.23	0.05
USD ENERGY TRANSFER LP 5.75000% 22-15.02.33	5 490 000.00	5 642 072.99	0.10
USD ENERSIS AMERICAS SA 4.00000% 16-25.10.26	686 000.00	666 191.75	0.01
USD ENI SPA-144A 4.00000% 18-12.09.23	1 885 000.00	1 871 617.31	0.03
USD EOG RESOURCES INC 4.37500% 20-15.04.30	1 124 000.00	1 120 574.43	0.02
USD EQT CORP 5.70000% 22-01.04.28	935 000.00	946 042.35	0.02
USD EQT CORP STEP-UP/DOWN 20-01.02.30	2 757 000.00	2 932 372.77	0.05
USD EQUIFAX INC 2.35000% 21-15.09.31	1 860 000.00	1 532 120.09	0.03
USD EQUIFAX INC 3.10000% 20-15.05.30	2 000 000.00	1 754 829.28	0.03
USD EQUINIX INC 1.00000% 20-15.09.25	6 425 000.00	5 803 993.94	0.10
USD EQUINIX INC 1.45000% 21-15.05.26	3 245 000.00	2 911 360.42	0.05
USD EQUINIX INC 2.00000% 21-15.05.28	4 845 000.00	4 210 750.30	0.07
USD EQUINIX INC 2.62500% 19-18.11.24	1 667 000.00	1 600 821.09	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・サステナブル

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD EQUINIX INC 3.90000% 22-15.04.32	6 096 000.00	5 605 218.61	0.10
USD ERAC USA FINANCE LLC-REG-S 2.70000% 16-01.11.23	3 500 000.00	3 429 630.86	0.06
USD ERP OPERATING LP 3.25000% 17-01.08.27	1 460 000.00	1 374 606.94	0.02
USD ESSENTIAL UTILITIES INC 2.70400% 20-15.04.30	2 120 000.00	1 840 515.29	0.03
USD EVERSOURCE ENERGY 1.65000% 20-15.08.30	7 700 000.00	6 186 050.94	0.11
USD EVERSOURCE ENERGY 1.40000% 21-15.08.26	10 000 000.00	8 957 035.90	0.15
USD EVERSOURCE ENERGY 2.90000% 17-01.10.24	2 400 000.00	2 330 321.90	0.04
USD EVERSOURCE ENERGY 2.90000% 22-01.03.27	5 145 000.00	4 828 846.59	0.08
USD EVERSOURCE ENERGY 4.20000% 22-27.06.24	2 900 000.00	2 870 685.76	0.05
USD EXTRA SPACE STORAGE LP 3.90000% 22-01.04.29	2 560 000.00	2 372 616.06	0.04
USD FEDEX CORP 3.10000% 19-05.08.29	5 025 000.00	4 589 904.99	0.08
USD FIDELITY NATIONAL INFO SERVICES 1.65000% 21-01.03.28	7 850 000.00	6 760 234.82	0.12
USD FIDELITY NTL INFO SER INC 5.10000% 22-15.07.32	735 000.00	736 971.03	0.01
USD FIFTH THIRD BANCORP 2.55000% 20-05.05.27	2 255 000.00	2 079 810.27	0.04
USD FISERV INC 2.25000% 20-01.06.27	3 150 000.00	2 866 209.66	0.05
USD FISERV INC 3.20000% 19-01.07.26	4 214 000.00	4 005 149.40	0.07
USD FISERV INC 3.50000% 19-01.07.29	11 155 000.00	10 389 278.74	0.18
USD FLOWSERVE CORP 2.80000% 21-15.01.32	4 251 000.00	3 390 668.51	0.06
USD FMC CORP 3.45000% 19-01.10.29	1 847 000.00	1 698 385.32	0.03
USD FNB CORP/PA 2.20000% 20-24.02.23	1 890 000.00	1 885 831.70	0.03
USD FORD MOTOR CO 3.25000% 21-12.02.32	7 875 000.00	6 250 128.33	0.11
USD FORD MOTOR CO 5.29100% 16-08.12.46	570 000.00	470 096.10	0.01
USD FORD MOTOR CO 6.10000% 22-19.08.32	1 802 000.00	1 768 218.54	0.03
USD FORD MOTOR CREDIT CO 2.90000% 21-16.02.28	4 085 000.00	3 513 491.10	0.06
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.62500% 21-17.06.31	1 025 000.00	852 555.06	0.01
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.30000% 22-10.02.25	8 700 000.00	8 067 184.27	0.14
USD FORD MOTOR CREDIT CO 4.95000% 22-28.05.27	1 049 000.00	1 001 026.85	0.02
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 7.35000% 22-04.11.27	2 400 000.00	2 517 000.00	0.04
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 6.95000% 23-06.03.26	1 515 000.00	1 549 208.70	0.03
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.81000% 17-09.01.24	2 605 000.00	2 551 363.05	0.04
USD FORTIS INC 3.05500% 17-04.10.26	1 154 000.00	1 083 493.79	0.02
USD FOX CORP 4.03000% 20-25.01.24	2 500 000.00	2 473 692.80	0.04
USD FREEPORT-MCMORAN INC 4.37500% 20-01.08.28	5 700 000.00	5 430 823.77	0.09
USD GENERAL MILLS INC 2.25000% 21-14.10.31	9 620 000.00	8 055 130.86	0.14
USD GENERAL MOTORS CO 5.00000% 14-01.04.35	925 000.00	853 226.83	0.01
USD GENERAL MOTORS CO 5.60000% 22-15.10.32	7 463 000.00	7 372 737.10	0.13
USD GENERAL MOTORS CO 6.12500% 20-01.10.25	1 485 000.00	1 522 874.08	0.03
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 2.90000% 20-26.02.25	818 000.00	780 986.86	0.01
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO LTD 3.60000% 20-21.06.30	7 285 000.00	6 411 728.26	0.11
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 2.70000% 20-20.08.27	8 200 000.00	7 362 636.83	0.13
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 1.25000% 21-08.01.26	2 775 000.00	2 488 023.68	0.04
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 2.70000% 21-10.06.31	1 130 000.00	910 846.38	0.02
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 3.10000% 22-12.01.32	995 000.00	824 699.50	0.01
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 6.05000% 22-10.10.25	2 181 000.00	2 221 987.25	0.04
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 6.00000% 23-09.01.28	1 430 000.00	1 471 697.16	0.03
USD GENPACT LUXEMBOURG SARL 3.37500% 19-01.12.24	2 355 000.00	2 269 417.67	0.04
USD GILEAD SCIENCES INC 3.65000% 15-01.03.26	814 000.00	792 909.90	0.01
USD GILEAD SCIENCES INC 2.95000% 16-01.03.27	4 645 000.00	4 402 474.47	0.08
USD GILEAD SCIENCES INC 1.20000% 20-01.10.27	6 565 000.00	5 699 682.06	0.10
USD GILEAD SCIENCES INC 1.65000% 20-01.10.30	3 200 000.00	2 639 911.81	0.05
USD GLENORE FUNDING LLC-144A 1.62500% 20-01.09.25	5 650 000.00	5 179 688.24	0.09
USD GLOBAL PAYMENTS INC 2.65000% 19-15.02.25	4 157 000.00	3 965 127.26	0.07
USD GLOBAL PAYMENTS INC 3.20000% 19-15.08.29	4 130 000.00	3 667 972.65	0.06
USD GLOBAL PAYMENTS INC 5.40000% 22-15.08.32	6 240 000.00	6 260 274.19	0.11
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC-SUB 4.25000% 15-21.10.25	8 100 000.00	7 973 706.83	0.14
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.62500% 19-20.02.24	5 200 000.00	5 126 436.17	0.09
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.60000% 20-07.02.30	6 000 000.00	5 218 553.34	0.09
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.50000% 20-01.04.25	3 090 000.00	2 999 535.12	0.05

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット・サステナブル

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 1.21700% 21-06.12.23	6 500 000.00	6 299 504.64	0.11
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.00000% 22-15.03.24	8 170 000.00	8 007 750.57	0.14
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 3.50000% 16-16.11.26	1 805 000.00	1 733 702.30	0.03
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.75000% 15-22.05.25	15 965 000.00	15 592 510.05	0.27
USD GRAPHIC PACKAGING INTERNATIONAL INC 4.12500% 16-15.08.24	416 000.00	409 319.04	0.01
USD GSK CONSUMER HEALTHCARE CAPITAL US 3.37500% 22-24.03.27	3 640 000.00	3 445 537.88	0.06
USD GSK CONSUMER HEALTHCARE CAPITAL US LLC 3.62500% 22-24.03.32	4 875 000.00	4 462 865.79	0.08
USD GUARDIAN LIFE GLOBAL FUNDING-144A 1.62500% 21-16.09.28	1 419 000.00	1 210 262.90	0.02
USD HARLEY DAVIDSON FUNDING CORP 3.50000% 15-28.07.25	1 779 000.00	1 703 520.89	0.03
USD HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP 2.80000% 19-19.08.29	3 000 000.00	2 678 243.43	0.05
USD HCA INC 2.37500% 21-15.07.31	8 870 000.00	7 204 505.11	0.12
USD HCA INC 3.50000% 20-01.09.30	3 315 000.00	2 971 326.92	0.05
USD HCA INC 4.12500% 19-15.06.29	2 745 000.00	2 609 188.35	0.04
USD HCA INC 5.25000% 14-15.04.25	1 700 000.00	1 701 742.12	0.03
USD HCA INC 5.87500% 19-01.02.29	2 100 000.00	2 159 999.60	0.04
USD HCP INC 3.40000% 15-01.02.25	209 000.00	202 351.30	0.00
USD HEALTHCARE TRUST OF AMERICA HOLDINGS LP 2.00000% 20-15.03.31	5 906 000.00	4 660 517.86	0.08
USD HEALTHPEAK PROPERTIES INC 3.00000% 19-15.01.30	4 375 000.00	3 886 745.62	0.07
USD HEALTHPEAK PROPERTIES INC 2.87500% 20-15.01.31	910 000.00	790 729.33	0.01
USD HEALTHPEAK PROPERTIES INC 1.35000% 21-01.02.27	4 060 000.00	3 611 165.78	0.06
USD HEALTHPEAK PROPERTIES INC 2.12500% 21-01.12.28	8 100 000.00	7 030 090.85	0.12
USD HESS CORP 4.30000% 16-01.04.27	5 850 000.00	5 730 056.22	0.10
USD HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO STEP-UP/DOWN 16-15.10.25	5 750 000.00	5 744 750.88	0.10
USD HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO 4.45000% 20-02.10.23	3 105 000.00	3 092 988.80	0.05
USD HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO 1.45000% 20-01.04.24	2 490 000.00	2 392 737.64	0.04
USD HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO 1.75000% 20-01.04.26	8 500 000.00	7 750 518.20	0.13
USD HILLENBRAND INC 5.00000% 19-15.09.26	1 725 000.00	1 664 569.77	0.03
USD HOME DEPOT INC 2.70000% 20-15.04.30	3 905 000.00	3 518 984.03	0.06
USD HOST HOTELS & RESORTS LP 3.87500% 17-01.04.24	2 175 000.00	2 134 685.94	0.04
USD HOST HOTELS & RESORTS LP 3.37500% 19-15.12.29	4 500 000.00	3 918 697.92	0.07
USD HOST HOTELS & RESORTS LP 3.50000% 20-15.09.30	5 804 000.00	4 964 467.94	0.09
USD HP INC 1.45000% 22-17.06.26	8 800 000.00	7 851 917.56	0.14
USD HP INC 4.20000% 22-15.04.32	2 735 000.00	2 440 328.61	0.04
USD HP INC 4.75000% 22-15.01.28	3 051 000.00	3 033 554.47	0.05
USD HUDSON PACIFIC PROPERTIES LP 3.95000% 17-01.11.27	2 560 000.00	2 248 231.81	0.04
USD HUDSON PACIFIC PROPERTIES LP 4.65000% 19-01.04.29	1 620 000.00	1 411 142.42	0.02
USD HUMANA INC 3.12500% 19-15.08.29	2 750 000.00	2 480 831.62	0.04
USD HUMANA INC 4.50000% 20-01.04.25	2 960 000.00	2 949 946.39	0.05
USD HUMANA INC 5.75000% 22-01.03.28	10 009 000.00	10 448 825.38	0.18
USD HUMANA INC 5.87500% 22-01.03.33	4 155 000.00	4 446 592.71	0.08
USD HUNTINGTON BANCSHARES INC/OH 2.62500% 19-06.08.24	3 100 000.00	2 998 366.90	0.05
USD HYATT HOTELS CORP 1.80000% 21-01.10.24	3 475 000.00	3 297 122.99	0.06
USD ICAHN ENTERPRISES LP/FINANCE CORP 6.25000% 19-15.05.26	3 000 000.00	2 959 515.00	0.05
USD ILLUMINA INC 2.55000% 21-23.03.31	5 565 000.00	4 612 756.38	0.08
USD ILLUMINA INC 5.75000% 22-13.12.27	4 362 000.00	4 507 605.44	0.08
USD ING GROEP NV 3.55000% 19-09.04.24	1 550 000.00	1 523 791.10	0.03
USD ING GROEP NV 3.95000% 17-29.03.27	5 400 000.00	5 208 552.50	0.09
USD INTEL CORP 2.87500% 17-11.05.24	1 600 000.00	1 565 906.34	0.03
USD INTEL CORP 3.90000% 20-25.03.30	6 087 000.00	5 849 266.61	0.10
USD INTEL CORP 4.15000% 22-05.08.32	2 415 000.00	2 306 889.84	0.04
USD INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC 2.10000% 20-15.06.30	1 385 000.00	1 172 419.81	0.02
USD INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC 1.85000% 20-15.09.32	2 750 000.00	2 166 175.55	0.04
USD INTERCONTINENTAL EXCH INC 3.65000% 22-23.05.25	1 763 000.00	1 738 754.16	0.03
USD INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC 4.60000% 22-15.03.33	3 802 000.00	3 772 045.56	0.07
USD INTERPUBLIC GROUP OF COS INC 4.65000% 18-01.10.28	562 000.00	554 127.40	0.01
USD INTERPUBLIC GROUP OF COS INC 4.75000% 20-30.03.30	3 173 000.00	3 099 934.28	0.05
USD INVESTMENT ENERGY RESOURCES LTD-144A 6.25000% 21-26.04.29	354 000.00	337 251.38	0.01
USD INVITATION HOMES OPERATING PARTNERSHIP 2.30000% 21-15.11.28	2 524 000.00	2 152 404.55	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・サステナブル

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD ISTAR INC 5.50000% 20-15.02.26	3 250 000.00	3 271 775.00	0.06
USD ITC HOLDINGS CORP 3.65000% 14-15.06.24	1 833 000.00	1 795 007.76	0.03
USD ITC HOLDINGS CORP 3.25000% 16-30.06.26	1 350 000.00	1 281 589.21	0.02
USD ITC HOLDINGS CORP 4.05000% 13-01.07.23	675 000.00	670 612.50	0.01
USD JABIL INC 3.60000% 20-15.01.30	2 615 000.00	2 362 190.85	0.04
USD JEFFERIES GROUP LLC 2.62500% 21-15.10.31	2 330 000.00	1 913 566.93	0.03
USD JM SMUCKER CO/THE 3.37500% 17-15.12.27	5 000 000.00	4 738 198.90	0.08
USD JOHN CON INTER PLC / TY FI & SEC FI SCA 4.90000% 22-01.12-32	4 906 000.00	5 046 823.00	0.09
USD JOHN DEERE CAPITAL CORP 4.05000% 22-08.09.25	5 500 000.00	5 450 116.60	0.09
USD JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC STEP-UP 16-02.07.24	6 182 000.00	6 075 813.45	0.10
USD JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC 3.90000% 16-14.02.26	7 606 000.00	7 444 846.89	0.13
USD JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC 1.75000% 20-15.09.30	7 264 000.00	6 015 399.90	0.10
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.30000% 16-01.04.26	4 150 000.00	4 004 278.98	0.07
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 3.37500% 13-01.05.23	3 550 000.00	3 537 733.72	0.06
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 3.87500% 14-10.09.24	13 010 000.00	12 814 119.61	0.22
USD JUNIPER NETWORKS INC 2.00000% 20-10.12.30	4 900 000.00	3 886 359.25	0.07
USD KAISER FOUNDATION HOSPITALS 3.15000% 17-01.05.27	2 820 000.00	2 698 991.83	0.05
USD KB HOME 4.00000% 21-15.06.31	2 200 000.00	1 834 445.34	0.03
USD KEURIG DR PEPPER INC 0.75000% 21-15.03.24	2 800 000.00	2 675 331.24	0.05
USD KILROY REALTY LP 2.50000% 20-15.11.32	1 500 000.00	1 108 944.34	0.02
USD KILROY REALTY LP 2.65000% 21-15.11.33	1 408 000.00	1 017 093.44	0.02
USD KILROY REALTY LP 3.45000% 17-15.12.24	446 000.00	430 745.46	0.01
USD KIMCO REALTY CORP 2.80000% 16-01.10.26	1 650 000.00	1 534 409.23	0.03
USD KIMCO REALTY CORP 2.25000% 21-01.12.31	4 505 000.00	3 618 159.17	0.06
USD KINDER MORGAN ENERGY PARTNERS LP 4.30000% 14-01.05.24	3 645 000.00	3 618 287.69	0.06
USD KINDER MORGAN ENERGY PARTNERS LP 7.75000% 02-15.03.32	1 000 000.00	1 147 805.76	0.02
USD KINDER MORGAN ENERGY PARTNERS LP 5.80000% 05-15.03.35	1 653 000.00	1 695 002.43	0.03
USD KINDER MORGAN ENERGY PARTNERS LP 3.45000% 12-15.02.23	2 320 000.00	2 318 661.83	0.04
USD KINDER MORGAN INC 2.00000% 20-15.02.31	5 000 000.00	4 036 801.05	0.07
USD KINDER MORGAN INC 4.80000% 22-01.02.33	3 300 000.00	3 191 016.58	0.06
USD KLA CORP 4.65000% 22-15.07.32	1 300 000.00	1 320 304.72	0.02
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 5.00000% 13-04.06.42	555 000.00	534 157.62	0.01
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 4.37500% 16-01.06.46	370 000.00	323 082.04	0.01
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 3.00000% 16-01.06.26	925 000.00	880 439.92	0.02
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 5.20000% 16-15.07.45	655 000.00	640 463.31	0.01
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 3.87500% 21-15.05.27	7 615 000.00	7 418 566.51	0.13
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 4.25000% 21-01.03.31	2 773 000.00	2 677 117.56	0.05
USD KYNDRYL HOLDINGS INC 3.15000% 22-15.10.31	6 028 000.00	4 427 085.09	0.08
USD LABORATORY CORP AMERICA HOLDINGS 3.60000% 15-01.02.25	529 000.00	515 078.12	0.01
USD LABORATORY CORP AMERICA HOLDINGS 2.95000% 19-01.12.29	430 000.00	385 314.21	0.01
USD LAM RESEARCH CORP 1.90000% 20-15.06.30	7 496 000.00	6 302 808.16	0.11
USD LEGGETT & PLATT INC 4.40000% 19-15.03.29	4 111 000.00	3 981 582.97	0.07
USD LENNAR CORP 4.75000% 18-29.11.27	2 625 000.00	2 589 376.91	0.04
USD LENOVO GROUP LTD-144A 6.53600% 22-27.07.32	3 060 000.00	3 147 393.60	0.05
USD LEXINGTON REALTY TRUST 2.70000% 20-15.09.30	1 000 000.00	825 900.74	0.01
USD LEXINGTON REALTY TRUST 2.37500% 21-01.10.31	905 000.00	712 165.70	0.01
USD LIFE STORAGE LP 3.87500% 17-15.12.27	535 000.00	506 764.99	0.01
USD LIFE STORAGE LP 4.00000% 19-15.06.29	625 000.00	578 323.09	0.01
USD LINCOLN NATIONAL CORP 4.00000% 13-01.09.23	2 075 000.00	2 062 845.92	0.04
USD LINCOLN NATIONAL CORP 3.80000% 18-01.03.28	4 810 000.00	4 539 071.64	0.08
USD LINCOLN NATIONAL CORP 3.05000% 19-15.01.30	1 890 000.00	1 643 008.49	0.03
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC-SUB 4.58200% 16-10.12.25	5 400 000.00	5 271 707.23	0.09
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.37500% 18-22.03.28	3 000 000.00	2 911 798.98	0.05
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC-SUB 4.50000% 14-04.11.24	1 885 000.00	1 866 516.48	0.03
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC-SUB 4.65000% 16-24.03.26	4 275 000.00	4 204 762.86	0.07
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 3.75000% 17-11.01.27	2 200 000.00	2 095 484.60	0.04
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 3.90000% 19-12.03.24	5 955 000.00	5 885 283.86	0.10
USD LOWE ' S COS INC 1.30000% 20-15.04.28	10 850 000.00	9 258 483.27	0.16

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット・サステナブル

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD LOWE ' S COS INC 1.70000% 21-15.09.28	1 068 000.00	920 619.96	0.02
USD LOWE ' S COS INC 3.12500% 14-15.09.24	7 000 000.00	6 812 041.53	0.12
USD LOWE ' S COS INC 3.65000% 19-05.04.29	1 660 000.00	1 570 702.05	0.03
USD LOWE ' S COS INC 4.00000% 20-15.04.25	2 691 000.00	2 651 602.17	0.05
USD LSEGA FINANCING PLC-144A 1.37500% 21-06.04.26	5 650 000.00	5 058 599.92	0.09
USD LSEGA FINANCING PLC-144A 2.00000% 21-06.04.28	2 900 000.00	2 537 324.89	0.04
USD LSEGA FINANCING PLC-144A 2.50000% 21-06.04.31	389 000.00	335 279.17	0.01
USD MARATHON OIL CORP 6.80000% 02-15.03.32	1 080 000.00	1 157 695.11	0.02
USD MARATHON PETROLEUM CORP 5.12500% 19-15.12.26	1 990 000.00	2 010 443.39	0.03
USD MARKEL CORP 3.35000% 19-17.09.29	1 420 000.00	1 286 866.06	0.02
USD MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD 3.12500% 16-15.06.26	5 000 000.00	4 751 724.05	0.08
USD MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD 4.65000% 18-01.12.28	2 580 000.00	2 559 250.30	0.04
USD MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD 5.75000% 20-01.05.25	266 000.00	270 518.42	0.00
USD MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD 3.50000% 20-15.10.32	1 240 000.00	1 095 608.36	0.02
USD MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD 2.85000% 21-15.04.31	2 000 000.00	1 702 242.40	0.03
USD MARSH & MCLENNAN COS INC 3.87500% 19-15.03.24	6 130 000.00	6 062 204.41	0.10
USD MARSH & MCLENNAN COS INC 4.37500% 19-15.03.29	2 785 000.00	2 754 443.34	0.05
USD MARSH & MCLENNAN COS INC 2.25000% 20-15.11.30	3 260 000.00	2 756 043.28	0.05
USD MARSH & MCLENNAN COS INC 5.70000% 22-01.11.32	1 894 000.00	2 053 589.27	0.04
USD MARTIN MARIETTA MATERIALS INC 3.50000% 17-15.12.27	1 205 000.00	1 150 821.50	0.02
USD MARTIN MARIETTA MATERIALS INC 2.50000% 20-15.03.30	1 275 000.00	1 090 107.50	0.02
USD MASCO CORP 3.50000% 17-15.11.27	1 500 000.00	1 430 436.21	0.02
USD MERCEDES-BENZ FIN LLC-144A 5.50000% 22-27.11.24	2 800 000.00	2 838 328.58	0.05
USD MERCK & CO INC 1.90000% 21-10.12.28	4 000 000.00	3 530 241.80	0.06
USD MERCK & CO INC 2.15000% 21-10.12.31	1 070 000.00	907 466.30	0.02
USD MERCK & CO INC 3.40000% 19-07.03.29	5 840 000.00	5 613 611.23	0.10
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 3.45000% 16-18.12.26	2 200 000.00	2 095 157.71	0.04
USD MICRON TECHNOLOGY INC 2.70300% 21-15.04.32	5 421 000.00	4 326 317.42	0.07
USD MICRON TECHNOLOGY INC 6.75000% 22-01.11.29	2 720 000.00	2 901 143.46	0.05
USD MICROSOFT CORP 4.20000% 15-03.11.35	3 725 000.00	3 762 452.76	0.06
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 3.76100% 18-26.07.23	15 000 000.00	14 966 412.00	0.26
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 2.80100% 19-18.07.24	4 110 000.00	3 986 988.40	0.07
USD MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 3.17000% 17-11.09.27	1 088 000.00	1 014 775.86	0.02
USD MIZUHO FINANCIAL GROUP INC-SUB 2.56400% 21-13.09.31	3 405 000.00	2 730 403.44	0.05
USD MONDELEZ INTERNATIONAL INC 2.75000% 20-13.04.30	2 939 000.00	2 616 974.80	0.05
USD MONDELEZ INTERNATIONAL INC 3.00000% 22-17.03.32	2 600 000.00	2 305 175.53	0.04
USD MOODY ' S CORP 2.00000% 21-19.08.31	3 400 000.00	2 800 275.80	0.05
USD MOODY ' S CORP 3.75000% 20-24.03.25	2 315 000.00	2 267 510.25	0.04
USD MOODY ' S CORP 4.25000% 18-01.02.29	3 195 000.00	3 136 789.24	0.05
USD MOODY ' S CORP 4.25000% 22-08.08.32	3 205 000.00	3 111 133.49	0.05
USD MORGAN STANLEY 3.62500% 17-20.01.27	2 200 000.00	2 132 433.66	0.04
USD MORGAN STANLEY 3.70000% 14-23.10.24	2 500 000.00	2 457 198.20	0.04
USD MORGAN STANLEY-SUB 5.00000% 13-24.11.25	8 460 000.00	8 506 883.12	0.15
USD MPLX LP 4.12500% 17-01.03.27	2 125 000.00	2 060 226.30	0.04
USD MPLX LP 4.87500% 16-01.12.24	6 530 000.00	6 517 411.92	0.11
USD MPLX LP 4.95000% 22-01.09.32	2 395 000.00	2 358 243.83	0.04
USD NATIONAL FUEL GAS CO 5.50000% 20-15.01.26	5 025 000.00	5 047 276.13	0.09
USD NATIONAL OILWELL VARCO INC 3.60000% 19-01.12.29	4 280 000.00	3 921 312.85	0.07
USD NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-144A 1.50000% 21-13.10.26	1 990 000.00	1 758 544.08	0.03
USD NATURA&CO LUXEMBOURG HOLDINGS SARL-144A 6.00000% 22-19.04.29	608 000.00	532 197.60	0.01
USD NATWEST MARKETS PLC-144A 0.80000% 21-12.08.24	4 000 000.00	3 745 940.20	0.06
USD NATWEST MARKETS PLC-144A 3.47900% 22-22.03.25	2 000 000.00	1 930 970.70	0.03
USD NEC ELECTRONICS CORP-144A 1.54300% 21-26.11.24	9 450 000.00	8 741 181.01	0.15
USD NETFLIX INC 5.87500% 18-15.11.28	2 880 000.00	2 987 795.03	0.05
USD NEWELL BRANDS INC 4.20000% 16-01.04.26	6 571 000.00	6 242 712.84	0.11
USD NEWFIELD EXPLORATION CO 5.37500% 15-01.01.26	1 936 000.00	1 947 863.77	0.03
USD NOMURA HOLDINGS INC 1.85100% 20-16.07.25	3 660 000.00	3 365 909.11	0.06
USD NOMURA HOLDINGS INC 2.60800% 21-14.07.31	1 360 000.00	1 098 601.60	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・サステナブル

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD NOMURA HOLDINGS INC 2.32900% 22-22.01.27	6 165 000.00	5 524 610.01	0.10
USD NOMURA HOLDINGS INC 5.09900% 22-03.07.25	3 595 000.00	3 583 119.60	0.06
USD NOMURA HOLDINGS INC 5.70900% 23-09.01.26	1 579 000.00	1 597 233.35	0.03
USD NOMURA HOLDINGS INC 5.84200% 23-18.01.28	2 650 000.00	2 724 535.76	0.05
USD NORDEA BANK ABP-REG-S 3.75000% 18-30.08.23	2 774 000.00	2 752 867.09	0.05
USD NORDSTROM INC 4.37500% 19-01.04.30	4 700 000.00	3 770 951.00	0.07
USD NORFOLK SOUTHERN CORP 3.80000% 18-01.08.28	2 645 000.00	2 584 207.30	0.04
USD NORFOLK SOUTHERN CORP 3.65000% 18-01.08.25	1 730 000.00	1 686 428.67	0.03
USD NORFOLK SOUTHERN CORP 3.00000% 22-15.03.32	3 500 000.00	3 118 593.18	0.05
USD NTT FINANCE CORP-144A 1.59100% 21-03.04.28	6 325 000.00	5 495 421.23	0.09
USD NUCOR CORP 4.30000% 22-23.05.27	2 727 000.00	2 701 087.56	0.05
USD NUTRIEN LTD 5.90000% 22-07.11.24	10 784 000.00	10 955 068.32	0.19
USD NUTRIEN LTD 5.95000% 22-07.11.25	2 730 000.00	2 811 898.75	0.05
USD O' REILLY AUTOMOTIVE INC 4.70000% 22-15.06.32	2 481 000.00	2 475 861.43	0.04
USD OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST 3.45000% 21-15.10.31	2 361 000.00	1 656 266.88	0.03
USD OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC 5.25000% 16-15.01.26	2 916 000.00	2 898 563.63	0.05
USD OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC 3.37500% 20-01.02.31	1 543 000.00	1 248 440.23	0.02
USD ONCOR ELECTRIC DELIVERY CO 4.10000% 19-15.11.48	1 475 000.00	1 326 250.19	0.02
USD ONE GAS INC 4.25000% 22-01.09.32	2 088 000.00	2 036 951.85	0.04
USD ONEOK INC 2.20000% 20-15.09.25	2 325 000.00	2 160 892.04	0.04
USD ONEOK INC 2.75000% 19-01.09.24	3 520 000.00	3 396 205.76	0.06
USD ONEOK INC 3.40000% 19-01.09.29	8 000 000.00	7 172 618.08	0.12
USD ONEOK INC 4.00000% 17-13.07.27	536 000.00	515 321.63	0.01
USD ONEOK INC 4.35000% 19-15.03.29	2 296 000.00	2 190 694.57	0.04
USD ONEOK INC 4.55000% 18-15.07.28	3 115 000.00	3 043 710.13	0.05
USD ONEOK INC 6.10000% 22-15.11.32	6 000 000.00	6 309 170.88	0.11
USD ONEOK INC 6.35000% 20-15.01.31	1 220 000.00	1 296 197.39	0.02
USD ONEOK PARTNERS LP 4.90000% 15-15.03.25	1 850 000.00	1 842 467.11	0.03
USD ORACLE CORP 2.30000% 21-25.03.28	10 550 000.00	9 421 617.68	0.16
USD ORACLE CORP 2.80000% 20-01.04.27	2 950 000.00	2 730 456.22	0.05
USD ORACLE CORP 2.87500% 21-25.03.31	12 985 000.00	11 184 228.11	0.19
USD ORACLE CORP 2.95000% 15-15.05.25	5 583 000.00	5 363 192.77	0.09
USD ORACLE CORP 3.85000% 16-15.07.36	2 000 000.00	1 726 018.76	0.03
USD ORACLE CORP 5.80000% 22-10.11.25	7 000 000.00	7 195 725.74	0.12
USD ORACLE CORP 6.25000% 22-09.11.32	2 000 000.00	2 173 912.54	0.04
USD ORIX CORP 4.00000% 22-13.04.32	2 660 000.00	2 469 344.77	0.04
USD ORIX CORP 5.00000% 22-13.09.27	950 000.00	969 668.52	0.02
USD OWENS CORNING 3.40000% 16-15.08.26	1 975 000.00	1 869 094.36	0.03
USD OWENS CORNING 3.95000% 19-15.08.29	2 475 000.00	2 346 658.20	0.04
USD OWL ROCK CAPITAL CORP 3.75000% 20-22.07.25	5 900 000.00	5 533 339.31	0.10
USD PANASONIC CORP-144A 2.67900% 19-19.07.24	5 855 000.00	5 638 899.56	0.10
USD PARK AEROSPACE HOLDINGS LTD-144A 5.50000% 17-15.02.24	75 000.00	74 434.26	0.00
USD PAYPAL HOLDINGS INC 2.30000% 20-01.06.30	5 140 000.00	4 378 146.22	0.08
USD PENTAIR FINANCE SARL 4.50000% 19-01.07.29	5 335 000.00	5 057 430.03	0.09
USD PEPSICO INC 3.60000% 22-18.02.28	11 800 000.00	11 530 445.40	0.20
USD PEPSICO INC 3.90000% 22-18.07.32	8 570 000.00	8 373 141.18	0.14
USD PERKINELMER INC 1.90000% 21-15.09.28	3 500 000.00	2 992 573.64	0.05
USD PERKINELMER INC 2.25000% 21-15.09.31	1 765 000.00	1 429 428.97	0.02
USD PERKINELMER INC 2.55000% 21-15.03.31	1 195 000.00	994 393.90	0.02
USD PERRIGO FINANCE UNLIMITED CO 3.15000% 20-15.06.30	3 200 000.00	2 808 384.00	0.05
USD PFIZER INC 2.62500% 20-01.04.30	6 500 000.00	5 884 888.49	0.10
USD PHILLIPS 66 1.30000% 20-15.02.26	4 500 000.00	4 090 641.34	0.07
USD PHYSICIANS REALTY LP 4.30000% 17-15.03.27	2 500 000.00	2 420 385.25	0.04
USD PIONEER NATURAL RESOURCES CO 2.15000% 21-15.01.31	1 813 000.00	1 503 417.91	0.03
USD PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP 3.85000% 13-15.10.23	850 000.00	841 464.73	0.01
USD PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP 3.55000% 19-15.12.29	1 391 000.00	1 251 059.51	0.02
USD PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP 3.80000% 20-15.09.30	2 120 000.00	1 925 936.62	0.03
USD PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE 3.45000% 19-23.04.29	4 400 000.00	4 169 737.44	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・サステナブル

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD PNC FINANCIAL SERVICES GROUP 2.20000% 19-01.11.24	2 885 000.00	2 776 198.66	0.05
USD PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE 1.15000% 21-13.08.26	4 300 000.00	3 827 863.48	0.07
USD PRINCIPAL FINANCIAL GROUP 3.10000% 16-15.11.26	4 215 000.00	3 979 914.32	0.07
USD PROCTER & GAMBLE CO/THE 1.90000% 22-01.02.27	7 500 000.00	6 951 569.70	0.12
USD PROCTER & GAMBLE CO/THE 2.30000% 22-01.02.32	5 700 000.00	5 000 818.39	0.09
USD PROLOGIS LP 4.62500% 22-15.01.33	5 000 000.00	5 040 819.80	0.09
USD PROSUS NV-144A 3.25700% 22-19.01.27	1 079 000.00	976 495.00	0.02
USD PROSUS NV-144A 3.68000% 20-21.01.30	552 000.00	472 236.00	0.01
USD PROTECTIVE LIVE CORP-REG-S 4.30000% 18-30.09.28	3 700 000.00	3 546 153.86	0.06
USD PVH CORP 4.62500% 20-10.07.25	5 148 000.00	5 060 792.72	0.09
USD QATAR, STATE OF-144A 4.00000% 19-14.03.29	882 000.00	877 479.75	0.02
USD QUALCOMM INC 1.65000% 21-20.05.32	2 140 000.00	1 723 137.46	0.03
USD QUALCOMM INC 5.40000% 22-20.05.33	9 950 000.00	10 692 763.52	0.18
USD QUEST DIAGNOSTICS INC 2.95000% 19-30.06.30	3 170 000.00	2 826 923.67	0.05
USD RABOBANK NEDERLAND NV-SUB 3.75000% 16-21.07.26	1 544 000.00	1 475 968.07	0.03
USD RAYMOND JAMES FINANCIAL INC 4.65000% 20-01.04.30	3 580 000.00	3 560 219.46	0.06
USD REALTY INCOME CORP 3.00000% 16-15.01.27	790 000.00	744 266.62	0.01
USD REALTY INCOME CORP 4.12500% 14-15.10.26	3 765 000.00	3 702 323.26	0.06
USD REALTY INCOME CORP 4.62500% 21-01.11.25	815 000.00	811 921.43	0.01
USD REGENCY CENTERS LP 3.75000% 14-15.06.24	1 110 000.00	1 080 338.61	0.02
USD REGENCY CENTERS LP 4.12500% 18-15.03.28	3 790 000.00	3 605 554.65	0.06
USD RELX CAPITAL INC 3.00000% 20-22.05.30	3 200 000.00	2 841 962.43	0.05
USD RELX CAPITAL INC 4.00000% 19-18.03.29	3 635 000.00	3 468 405.63	0.06
USD RELX CAPITAL INC 4.75000% 22-20.05.32	411 000.00	408 692.27	0.01
USD REPUBLIC SERVICES INC 2.90000% 16-01.07.26	1 845 000.00	1 746 043.22	0.03
USD REPUBLIC SERVICES INC 2.50000% 19-15.08.24	2 500 000.00	2 412 321.60	0.04
USD ROGERS COMMUNICATIONS INC 3.62500% 15-15.12.25	5 920 000.00	5 712 939.47	0.10
USD ROGERS COMMUNICATIONS INC 2.90000% 16-15.11.26	2 000 000.00	1 861 946.32	0.03
USD ROSS STORES INC 4.60000% 20-15.04.25	4 273 000.00	4 257 554.86	0.07
USD ROSS STORES INC 4.70000% 20-15.04.27	1 830 000.00	1 816 569.46	0.03
USD ROSS STORES INC 4.80000% 20-15.04.30	2 185 000.00	2 121 034.04	0.04
USD ROYAL BANK OF CANADA 6.00000% 22-01.11.27	8 500 000.00	8 979 028.47	0.16
USD S&P GLOBAL INC 1.25000% 20-15.08.30	6 548 000.00	5 221 996.94	0.09
USD SABINE PASS LIQUEFACTION LLC 5.75000% 14-15.05.24	5 800 000.00	5 833 312.41	0.10
USD SABINE PASS LIQUEFACTION LLC 5.62500% 16-01.03.25	1 045 000.00	1 054 319.13	0.02
USD SANTANDER HOLDINGS USA INC 4.40000% 18-13.07.27	9 523 000.00	9 263 306.84	0.16
USD SCHLUMBERGER INVESTMENT SA 2.65000% 20-26.06.30	10 000 000.00	8 894 319.80	0.15
USD SEALED AIR CORP-144A 5.12500% 14-01.12.24	2 470 000.00	2 451 475.00	0.04
USD SEMPRA ENERGY 3.40000% 18-01.02.28	3 877 000.00	3 675 709.65	0.06
USD SERVICENOW INC 1.40000% 20-01.09.30	6 215 000.00	4 911 989.01	0.08
USD SHERWIN-WILLIAMS CO 3.45000% 17-01.06.27	2 825 000.00	2 712 916.63	0.05
USD SHERWIN-WILLIAMS CO 2.30000% 20-15.05.30	2 340 000.00	2 000 151.13	0.03
USD SHIRE ACQUISITIONS INVT IRELAND DAC 2.87500% 16-23.09.23	2 707 000.00	2 666 534.14	0.05
USD SHIRE ACQUISITIONS INVT IRELAND DAC 3.20000% 16-23.09.26	8 500 000.00	8 123 655.96	0.14
USD SIMON PROPERTY GROUP LP 2.20000% 21-01.02.31	5 000 000.00	4 124 103.55	0.07
USD SK HYNIX INC-144A 2.37500% 21-19.01.31	658 000.00	495 885.25	0.01
USD SK TELECOM CO LTD-144A 3.75000% 18-16.04.23	3 165 000.00	3 155 948.10	0.05
USD SKYWORKS SOLUTIONS INC 0.90000% 21-01.06.23	1 170 000.00	1 151 931.05	0.02
USD SKYWORKS SOLUTIONS INC 1.80000% 21-01.06.26	13 625 000.00	12 180 184.97	0.21
USD SKYWORKS SOLUTIONS INC 3.00000% 21-01.06.31	4 181 000.00	3 456 469.62	0.06
USD SMITH&NEWPHEW PLC 2.03200% 20-14.10.30	2 550 000.00	2 082 854.02	0.04
USD SOCIETE GENERALE SA-144A-SUB 4.75000% 15-24.11.25	1 980 000.00	1 926 574.41	0.03
USD SONOCO PRODUCTS CO 1.80000% 22-01.02.25	4 725 000.00	4 427 330.29	0.08
USD SONOCO PRODUCTS CO 3.12500% 20-01.05.30	2 900 000.00	2 583 089.74	0.04
USD SOUTHWEST AIRLINES CO 2.62500% 20-10.02.30	876 000.00	766 277.07	0.01
USD SOUTHWEST AIRLINES CO 5.12500% 20-15.06.27	1 330 000.00	1 342 187.71	0.02
USD SOUTHWEST GAS CORP 3.70000% 18-01.04.28	1 250 000.00	1 166 764.70	0.02
USD SOUTHWESTERN ENERGY CO 5.37500% 21-15.03.30	4 925 000.00	4 586 406.25	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・サステナブル

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD SPECTRA ENERGY PARTNERS LP 3.50000% 15-15.03.25	900 000.00	871 727.66	0.01
USD SPECTRA ENERGY PARTNERS LP 3.37500% 16-15.10.26	6 331 000.00	6 018 968.31	0.10
USD SPIRE INC 3.54300% 17-27.02.24	1 500 000.00	1 472 369.73	0.03
USD SPIRIT REALTY LP 3.40000% 19-15.01.30	1 300 000.00	1 125 244.97	0.02
USD SPIRIT REALTY LP 4.00000% 19-15.07.29	2 675 000.00	2 410 661.98	0.04
USD SPRINT CORP 7.62500% 18-01.03.26	3 715 000.00	3 929 231.08	0.07
USD STANDARD CHARTERED PLS-144A 1.82200% 21-23.11.25	3 760 000.00	3 494 404.84	0.06
USD STERIS IRISH FINCO UNLTD CO 2.70000% 21-15.03.31	8 250 000.00	7 065 649.30	0.12
USD STIFEL FINANCIAL CORP 4.00000% 20-15.05.30	1 720 000.00	1 537 954.81	0.03
USD STORE CAPITAL CORP 4.62500% 19-15.03.29	772 000.00	706 271.63	0.01
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 3.74800% 18-19.07.23	2 740 000.00	2 725 000.34	0.05
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 2.69600% 19-16.07.24	2 925 000.00	2 825 449.38	0.05
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 3.04000% 19-16.07.29	8 434 000.00	7 523 844.89	0.13
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 2.44800% 19-27.09.24	8 415 000.00	8 063 470.95	0.14
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 2.34800% 20-15.01.25	12 275 000.00	11 668 220.97	0.20
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 2.47200% 22-14.01.29	4 000 000.00	3 481 971.60	0.06
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC5.52000% 23-13.01.28	2 460 000.00	2 527 318.88	0.04
USD SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 0.50800% 21-12.01.24	350 000.00	335 904.73	0.01
USD SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 5.46400% 23-13.01.26	11 197 000.00	11 350 884.85	0.20
USD SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD-144A 1.05000% 20-12.09.25	5 240 000.00	4 723 462.81	0.08
USD SUZANO AUSTRIA GMBH 3.75000% 20-15.01.31	5 000 000.00	4 265 250.00	0.07
USD SYNCHRONY FINANCIAL 3.95000% 17-01.12.27	4 639 000.00	4 284 974.53	0.07
USD SYNCHRONY FINANCIAL 5.15000% 19-19.03.29	885 000.00	844 847.13	0.01
USD SYNCHRONY FINANCIAL 2.87500% 21-28.10.31	7 760 000.00	6 035 450.42	0.10
USD SYSCO CORP 2.45000% 21-14.12.31	6 020 000.00	5 050 241.51	0.09
USD T-MOBILE USA INC 2.55000% 21-15.02.31	5 814 000.00	4 935 759.83	0.09
USD T-MOBILE USA INC 2.62500% 21-15.02.29	4 122 000.00	3 602 627.59	0.06
USD T-MOBILE USA INC 2.62500% 21-15.04.26	4 263 000.00	3 958 356.21	0.07
USD T-MOBILE USA INC 3.37500% 21-15.04.29	1 268 000.00	1 155 694.37	0.02
USD T-MOBILE USA INC 3.50000% 21-15.04.31	4 250 000.00	3 803 111.44	0.07
USD T-MOBILE USA INC 3.75000% 21-15.04.27	2 962 000.00	2 849 079.97	0.05
USD T-MOBILE USA INC 3.87500% 21-15.04.30	6 875 000.00	6 438 996.64	0.11
USD T-MOBILE USA INC 4.37500% 21-15.04.40	3 510 000.00	3 175 966.45	0.05
USD TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC 3.30000% 22-28.03.24	1 830 000.00	1 793 515.16	0.03
USD TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC 3.70000% 22-14.04.27	2 600 000.00	2 491 762.91	0.04
USD TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE 4.00000% 22-14.04.32	7 355 000.00	6 896 630.81	0.12
USD TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 5.00000% 19-26.11.28	2 150 000.00	2 181 345.07	0.04
USD TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 2.05000% 20-31.03.30	11 394 000.00	9 579 373.33	0.17
USD TARGET CORP 4.40000% 23-15.01.33	2 985 000.00	2 984 268.50	0.05
USD TENET HEALTHCARE CORP 4.62500% 17-15.07.24	74 000.00	72 982.50	0.00
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 3.15000% 16-01.10.26	6 750 000.00	6 055 965.00	0.10
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 6.00000% 18-15.04.24	4 300 000.00	4 259 687.50	0.07
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 5.12500% 21-09.05.29	669 000.00	618 691.20	0.01
USD THE HERSHEY CO 2.45000% 19-15.11.29	4 589 000.00	4 089 988.65	0.07
USD TIME WARNER CABLE LLC 5.50000% 11-01.09.41	200 000.00	179 735.86	0.00
USD TOLL BROTHERS FINANCE CORP 4.87500% 15-15.11.25	965 000.00	947 946.70	0.02
USD TORONTO-DOMINION BANK/THE 5.10300% 23-09.01.26	3 656 000.00	3 703 741.73	0.06
USD TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.75000% 14-10.04.24	1 200 000.00	1 188 013.78	0.02
USD TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.45500% 19-19.02.29	1 040 000.00	990 479.28	0.02
USD TOTAL CAPITAL SA 3.88300% 18-11.10.28	4 405 000.00	4 356 926.60	0.08
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 5.45000% 22-10.11.27	13 420 000.00	14 000 958.24	0.24
USD TRANSOCEAN PHOENIX 2 LTD-144A 7.75000% 16-15.10.24	249 000.00	100 840.02	0.00
USD TRANSOCEAN PROTEUS LTD-144A 6.25000% 16-01.12.24	150 000.00	60 601.82	0.00
USD TRINITY ACQUISITION PLC 4.40000% 16-15.03.26	700 000.00	689 234.34	0.01
USD TSMC ARIZONA CORP 3.87500% 22-22.04.27	565 000.00	550 980.93	0.01
USD TSMC ARIZONA CORP 4.12500% 22-22.04.29	1 340 000.00	1 307 330.80	0.02
USD TSMC GLOBAL LTD-REG-S 2.25000% 21-23.04.31	6 735 000.00	5 639 484.90	0.10
USD TYCO ELECTRONICS GROUP SA 3.45000% 14-01.08.24	870 000.00	853 095.15	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・サステナブル

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD UBS GROUP AG-REG-S 4.12500% 15-24.09.25	2 100 000.00	2 056 944.81	0.04
USD UNION PACIFIC CORP 2.15000% 20-05.02.27	5 000 000.00	4 607 046.20	0.08
USD UNITED AIRLINES 2014-2 CLAS A PAS THR 3.75000% 14-03.09.26	4 500 000.00	2 553 022.77	0.04
USD UNITED AIRLINES INC-144A 4.62500% 21-15.04.29	1 565 000.00	1 427 452.49	0.02
USD UNITED RENTALS NORTH AMERICA INC 5.50000% 16-15.05.27	1 800 000.00	1 788 750.00	0.03
USD UNITED RENTALS NORTH AMERICA INC 3.87500% 19-15.11.27	5 145 000.00	4 887 750.00	0.08
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 3.37500% 17-15.04.27	2 315 000.00	2 238 174.97	0.04
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 3.85000% 18-15.06.28	2 861 000.00	2 794 133.19	0.05
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 3.87500% 18-15.12.28	2 500 000.00	2 436 040.33	0.04
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 2.37500% 19-15.08.24	1 640 000.00	1 585 915.49	0.03
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 2.30000% 21-15.05.31	4 785 000.00	4 116 192.66	0.07
USD US BANCORP 2.40000% 19-30.07.24	2 915 000.00	2 821 891.05	0.05
USD VAR ENERGI ASA-144A 8.00000% 22-15.11.32	1 769 000.00	1 900 208.61	0.03
USD VENTAS REALITY LP 3.75000% 14-01.05.24	535 000.00	524 453.51	0.01
USD VENTAS REALTY LP 3.85000% 17-01.04.27	1 246 000.00	1 201 309.31	0.02
USD VERISIGN INC 5.25000% 15-01.04.25	6 648 000.00	6 667 006.37	0.12
USD VERISK ANALYTICS INC 4.12500% 19-15.03.29	2 190 000.00	2 090 605.10	0.04
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 4.01600% 19-03.12.29	3 756 000.00	3 601 135.17	0.06
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.15000% 20-22.03.30	4 450 000.00	4 041 357.96	0.07
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.50000% 20-18.09.30	4 585 000.00	3 706 430.19	0.06
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.65000% 20-20.11.40	1 555 000.00	1 123 136.49	0.02
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.10000% 21-22.03.28	6 339 000.00	5 653 160.51	0.10
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.55000% 21-21.03.31	11 375 000.00	9 709 090.97	0.17
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.40000% 21-22.03.41	3 000 000.00	2 414 787.48	0.04
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.85000% 21-03.09.41	950 000.00	703 441.69	0.01
USD VF CORP 2.95000% 20-23.04.30	2 313 000.00	2 008 083.91	0.03
USD VIACOMCBS INC 4.20000% 20-19.05.32	290 000.00	248 946.28	0.00
USD VIACOMCBS INC 4.75000% 20-15.05.25	1 832 000.00	1 817 791.68	0.03
USD VIACOMCBS INC 4.95000% 20-15.01.31	4 751 000.00	4 381 334.81	0.08
USD VICI PROPERTIES LP 5.12500% 22-15.05.32	3 510 000.00	3 357 666.00	0.06
USD VMWARE INC 1.00000% 21-15.08.24	3 750 000.00	3 525 856.23	0.06
USD VMWARE INC 1.40000% 21-15.08.26	6 120 000.00	5 419 342.01	0.09
USD VMWARE INC 1.80000% 21-15.08.28	3 900 000.00	3 288 481.17	0.06
USD VMWARE INC 2.20000% 21-15.08.31	4 050 000.00	3 209 801.90	0.06
USD VODAFONE GROUP PLC 4.37500% 18-30.05.28	1 725 000.00	1 731 589.55	0.03
USD WABTEC CORP/DE 3.45000% 17-15.11.26	4 065 000.00	3 842 166.82	0.07
USD WALT DISNEY CO 3.70000% 19-15.09.24	1 600 000.00	1 574 417.06	0.03
USD WASTE MANAGEMENT INC 4.15000% 22-15.04.32	2 625 000.00	2 581 008.89	0.04
USD WELLTOWER INC 2.75000% 20-15.01.31	825 000.00	692 023.05	0.01
USD WELLTOWER INC 2.75000% 21-15.01.32	3 000 000.00	2 450 864.10	0.04
USD WELLTOWER INC 3.10000% 19-15.01.30	5 040 000.00	4 402 857.66	0.08
USD WELLTOWER INC 3.62500% 19-15.03.24	1 250 000.00	1 229 424.22	0.02
USD WELLTOWER INC 4.00000% 15-01.06.25	8 690 000.00	8 496 143.39	0.15
USD WELLTOWER INC 4.25000% 16-01.04.26	1 230 000.00	1 205 277.46	0.02
USD WESTERN DIGITAL CORP 2.85000% 21-01.02.29	729 000.00	594 193.32	0.01
USD WESTERN DIGITAL CORP 3.10000% 21-01.02.32	2 260 000.00	1 731 124.29	0.03
USD WESTERN GAS PARTNERS LP 4.65000% 16-01.07.26	3 845 000.00	3 700 812.50	0.06
USD WESTERN GAS PARTNERS LP 4.50000% 18-01.03.28	1 005 000.00	949 725.00	0.02
USD WESTERN MIDSTREAM OPERATING LP 4.05000% 20-01.02.30	3 210 000.00	2 939 589.60	0.05
USD WESTERN UNION CO 2.85000% 19-10.01.25	6 358 000.00	6 109 521.73	0.11
USD WESTERN UNION CO/THE 1.35000% 21-15.03.26	6 255 000.00	5 565 090.64	0.10
USD WILLIAMS COMPANIES INC 4.55000% 14-24.06.24	8 150 000.00	8 134 306.52	0.14
USD WILLIAMS COS INC/THE 3.75000% 17-15.06.27	9 770 000.00	9 445 868.44	0.16
USD WILLIAMS COS INC/THE 4.50000% 13-15.11.23	2 300 000.00	2 292 011.69	0.04
USD WILLIAMS COS INC/THE 4.30000% 14-04.03.24	2 620 000.00	2 596 162.17	0.04
USD WILLIS NORTH AMERICA INC 3.60000% 17-15.05.24	1 215 000.00	1 189 465.78	0.02
USD WORKDAY INC 3.50000% 22-01.04.27	1 365 000.00	1 306 364.55	0.02
USD WORKDAY INC 3.70000% 22-01.04.29	10 951 000.00	10 306 769.42	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・サステナブル

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD WP CAREY INC 2.25000% 21-01.04.33	1 615 000.00	1 261 619.09	0.02
USD WP CAREY INC 2.40000% 20-01.02.31	950 000.00	796 566.75	0.01
USD WP CAREY INC 2.45000% 21-01.02.32	7 005 000.00	5 717 423.00	0.10
USD WP CAREY INC 3.85000% 19-15.07.29	3 658 000.00	3 420 685.06	0.06
USD WRKCO INC 4.65000% 19-15.03.26	730 000.00	727 417.29	0.01
USD XYLEM INC/NY 1.95000% 20-30.01.28	4 464 000.00	3 948 423.45	0.07
USD XYLEM INC/NY 2.25000% 20-30.01.31	2 970 000.00	2 493 630.27	0.04
USD ZOETIS INC 2.00000% 20-15.05.30	3 150 000.00	2 666 860.65	0.05
USD ZOETIS INC 5.40000% 22-14.11.25	1 569 000.00	1 604 033.15	0.03
USD ZOETIS INC 5.60000% 22-16.11.32	3 325 000.00	3 578 809.25	0.06
米ドル合計		2 543 040 093.80	43.96
ノート、固定利付債合計		2 553 946 458.30	44.15
ノート、ゼロ・クーポン			
USD			
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 0.00000% 19-10.10.36	689 000.00	347 719.88	0.01
米ドル合計		347 719.88	0.01
ノート、ゼロ・クーポン合計		347 719.88	0.01
ノート、変動利付債			
USD			
USD ABN AMRO BANK NV-144A 2.470%/VAR 21-13.12.29	5 800 000.00	4 897 386.89	0.08
USD AT&T INC 3M LIBOR+118 BP 18-12.06.24	3 000 000.00	3 031 842.00	0.05
USD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING-REG-S-SUB 6.750%/VAR 16-PRP	1 275 000.00	1 284 904.71	0.02
USD BANCO SANTANDER SA 1.722%/VAR 21-14.09.27	4 200 000.00	3 688 235.84	0.06
USD BANCO SANTANDER SA 3M LIBOR+112BP 18-12.04.23	400 000.00	400 039.04	0.01
USD BANCO SANTANDER SA 4.175%/VAR 22-24.03.28	1 000 000.00	952 784.95	0.02
USD BANK OF AMERICA CORP 3.366%/VAR 18-23.01.26	6 650 000.00	6 421 375.46	0.11
USD BANK OF AMERICA CORP 3.419%/VAR 18-20.12.28	3 803 000.00	3 556 887.34	0.06
USD BANK OF AMERICA CORP 3.550%/3M LIBOR+78BP 18-05.03.24	2 720 000.00	2 715 779.35	0.05
USD BANK OF AMERICA CORP 2.651%/VAR 21-11.03.32	6 905 000.00	5 820 675.47	0.10
USD BANK OF AMERICA CORP 1.658%/VAR 21-11.03.27	11 805 000.00	10 660 777.24	0.18
USD BANK OF AMERICA CORP 1.734%/VAR 21-22.07.27	25 098 000.00	22 488 128.50	0.39
USD BANK OF AMERICA CORP 2.299%/VAR 21-21.07.32	4 000 000.00	3 256 061.28	0.06
USD BANK OF AMERICA CORP 4.571%/VAR 22-27.04.33	9 590 000.00	9 266 526.04	0.16
USD BANK OF AMERICA CORP 3.841%/VAR 22-25.04.25	5 475 000.00	5 376 734.32	0.09
USD BANK OF AMERICA CORP 4.827%/VAR 22-22.07.26	3 555 000.00	3 546 048.58	0.06
USD BANK OF IRELAND GROUP-144A 2.029%/VAR 21-30.09.27	13 755 000.00	12 007 234.68	0.21
USD BANK OF MONTREAL-SUB 3.088%/VAR 22-10.01.37	8 000 000.00	6 505 092.56	0.11
USD BANK OF NOVA SCOTIA/THE SOFRIX+99 22-11.04.25	4 500 000.00	4 495 029.07	0.08
USD BARCLAYS PLC 3.932%/VAR 19-07.05.25	5 557 000.00	5 445 257.51	0.09
USD BARCLAYS PLC 5.304%/VAR 22-09.08.26	2 617 000.00	2 617 170.99	0.05
USD BARCLAYS PLC 7.325%/VAR 22-02.11.26	5 175 000.00	5 432 930.59	0.09
USD BARCLAYS PLC 7.385%/VAR 22-02.11.28	4 893 000.00	5 306 962.92	0.09
USD BARCLAYS PLC-SUB COCO 8.000%/VAR 22-PRP	2 412 000.00	2 422 009.80	0.04
USD BBVA BANCOMER SA/TEXAS-144A-SUB 5.875%/VAR 19-13.09.34	2 020 000.00	1 938 947.50	0.03
USD BBVA BANCOMER SA/TEXAS-REG-S-SUB 5.125%/VAR 18-18.01.33	2 270 000.00	2 146 285.00	0.04
USD BNP PARIBAS SA-REG-S-SUB COCO 7.750%/VAR 22-PRP	854 000.00	883 890.00	0.02
USD BNP PARIBAS SA-REG-S 4.625%/VAR 21-PRP	902 000.00	737 843.81	0.01
USD CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 2.636%/VAR 22-03.03.26	8 740 000.00	8 276 626.00	0.14
USD CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 5.468%/VAR 23-01.02.29	4 680 000.00	4 709 790.17	0.08
USD CHARLES SCHWAB CORP-SUB 5.375%/VAR 20-PRP	1 412 000.00	1 400 986.40	0.02
USD CHARLES SCHWAB CORP-SUB 4.000%/VAR 21-PRP	2 570 000.00	2 367 998.00	0.04
USD CITIGROUP INC 0.776%/VAR 20-30.10.24	6 180 000.00	5 974 809.48	0.10

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット・サステナブル

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD CITIGROUP INC 0.981%/VAR 21-01.05.25	4 695 000.00	4 446 261.62	0.08
USD CITIGROUP INC 1.122%/VAR 21-28.01.27	2 550 000.00	2 271 948.76	0.04
USD CITIGROUP INC 1.462%/VAR 21-09.06.27	13 275 000.00	11 821 599.37	0.20
USD CITIGROUP INC 1.678%/VAR 20-15.05.24	8 385 000.00	8 302 179.42	0.14
USD CITIGROUP INC 2.014%/VAR 22-25.01.26	435 000.00	409 146.48	0.01
USD CITIGROUP INC 2.520%/VAR 21-03.11.32	805 000.00	659 009.07	0.01
USD CITIGROUP INC 2.572%/VAR 20-03.06.31	4 285 000.00	3 636 303.74	0.06
USD CITIGROUP INC 2.666%/VAR 20-29.01.31	8 635 000.00	7 432 187.41	0.13
USD CITIGROUP INC 2.976%/VAR 19-05.11.30	15 865 000.00	13 952 104.43	0.24
USD CITIGROUP INC 3.057%/VAR 22-25.01.33	3 200 000.00	2 741 225.75	0.05
USD CITIGROUP INC 3.070%/VAR 22-24.02.28	535 000.00	497 310.58	0.01
USD CITIGROUP INC 3.106%/VAR 20-08.04.26	1 370 000.00	1 313 744.19	0.02
USD CITIGROUP INC 3.290%/VAR 22-17.03.26	4 760 000.00	4 582 042.92	0.08
USD CITIGROUP INC 3.352%/VAR 19-24.04.25	2 750 000.00	2 690 591.78	0.05
USD CITIGROUP INC 3.520%/VAR 17-27.10.28	6 500 000.00	6 088 620.40	0.11
USD CITIGROUP INC 3.668%/VAR 17-24.07.28	3 500 000.00	3 315 165.84	0.06
USD CITIGROUP INC 3.980%/3M LIBOR+133.8BP 19-20.03.30	7 070 000.00	6 648 800.51	0.12
USD CITIGROUP INC 4.075%/VAR 18-23.04.29	3 095 000.00	2 957 376.09	0.05
USD CITIGROUP INC 4.140%/VAR 22-24.05.25	2 550 000.00	2 521 177.22	0.04
USD CITIGROUP INC 6.270%/VAR 22-17.11.33	2 200 000.00	2 395 853.79	0.04
USD CITIGROUP INC-SUB 3.875%/VAR 21-PRP	1 161 000.00	1 059 876.90	0.02
USD CITIGROUP INC-SUB 4.000%/VAR 20-PRP	3 647 000.00	3 373 990.46	0.06
USD CITIGROUP INC-SUB 4.150%/VAR 21-PRP	2 621 000.00	2 332 690.00	0.04
USD CREDIT AGRICOLE SA-REG-S-SUB 8.125%/VAR 16-PRP	2 465 000.00	2 540 897.35	0.04
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-144A 3.869%/VAR 18-12.01.29	2 320 000.00	1 968 261.13	0.03
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-144A-SUB 6.375%/VAR 19-PRP	1 763 000.00	1 428 030.00	0.03
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-144A 4.194%/VAR 20-01.04.31	927 000.00	785 336.76	0.01
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-144A 2.193%/VAR 20-05.06.26	1 699 000.00	1 492 865.99	0.03
USD CREDIT SUISSE GROUP AG -144A 1.305%/VAR 21-02.02.27	7 190 000.00	5 953 635.57	0.10
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-144A 6.373%/VAR 22-15.07.26	858 000.00	833 068.28	0.01
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-144A 6.537%/VAR 22-12.08.33	5 330 000.00	5 115 244.39	0.09
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-144A 9.016%/VAR 22-15.11.33	1 090 000.00	1 224 256.36	0.02
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S 2.593%/VAR 19-11.09.25	2 375 000.00	2 171 913.87	0.04
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S-SUB 5.250%/VAR 20-PRP	340 000.00	255 000.00	0.00
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S-SUB 6.250%/VAR 14-PRP	2 020 000.00	1 772 752.00	0.03
USD CREDIT SUISSE GRP AG-144A 6M SORF+173BP 21-14.05.32	6 057 000.00	4 579 127.50	0.08
USD DANSKE BANK AS-144A 4.298%/VAR 22-01.04.28	1 710 000.00	1 647 731.05	0.03
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 3.961%/VAR 19-26.11.25	2 150 000.00	2 082 518.45	0.04
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 2.311%/VAR 21-16.11.27	6 050 000.00	5 347 117.35	0.09
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 6.720%/VAR 23-18.01.29	1 830 000.00	1 925 588.68	0.03
USD DISCOVER BANK-SUB 4.682%/VAR 18-09.08.28	2 728 000.00	2 622 077.00	0.05
USD ENTERPRISE PRODUCTS-SUB 5.375%/VAR 18-15.02.78	2 450 000.00	2 049 404.91	0.04
USD FIFTH THIRD BANCORP 6.361%/VAR 22-27.10.28	10 000 000.00	10 581 109.90	0.18
USD GENERAL MILLS INC 3M LIBOR+101BP 18-17.10.23	865 000.00	868 622.35	0.02
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.814%/VAR 18-23.04.29	6 330 000.00	5 977 977.49	0.10
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 1.093%/VAR 20-09.12.26	10 210 000.00	9 126 677.34	0.16
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 1.431%/VAR 21-09.03.27	25 460 000.00	22 812 860.66	0.39
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.615%/VAR 21-22.04.32	7 675 000.00	6 412 896.22	0.11
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 1.542%/VAR 21-10.09.27	18 410 000.00	16 255 777.23	0.28
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.383%/VAR 21-21.07.32	5 140 000.00	4 208 621.11	0.07
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 1.948%/VAR 21-21.10.27	4 230 000.00	3 786 399.18	0.07
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.650%/VAR 21-21.10.32	570 000.00	470 189.74	0.01
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 1.757%/VAR 22-24.01.25	1 493 000.00	1 437 385.75	0.03
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 2.640%/VAR 22-24.02.28	5 940 000.00	5 446 462.03	0.09
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 3.102%/VAR 22-24.02.33	2 080 000.00	1 782 480.52	0.03
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 4.482%/VAR 22-23.08.28	4 620 000.00	4 539 921.40	0.08
USD HASBRO INC 3.900%/RATING LINKED 19-19.11.29	5 693 000.00	5 203 865.52	0.09
USD HSBC HOLDINGS PLC 0.732%/VAR 21-17.08.24	4 900 000.00	4 768 703.03	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・サステナブル

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD HSBC HOLDINGS PLC 1.589%/VAR 20-24.05.27	7 000 000.00	6 201 817.86	0.11
USD HSBC HOLDINGS PLC 2.013%/VAR 20-22.09.28	4 460 000.00	3 857 700.28	0.07
USD HSBC HOLDINGS PLC 2.804%/VAR 21-24.05.32	3 260 000.00	2 682 584.73	0.05
USD HSBC HOLDINGS PLC 2.206%/VAR 21-17.08.29	15 665 000.00	13 287 712.81	0.23
USD HSBC HOLDINGS PLC 2.251%/VAR 21-22.11.27	3 770 000.00	3 383 912.08	0.06
USD HSBC HOLDINGS PLC 2.999%/VAR 22-10.03.26	3 665 000.00	3 490 653.35	0.06
USD HSBC HOLDINGS PLC 3.803%/VAR 19-11.03.25	2 400 000.00	2 355 011.14	0.04
USD HSBC HOLDINGS PLC 3.973%/VAR 19-22.05.30	6 585 000.00	6 072 701.61	0.10
USD HSBC HOLDINGS PLC 4.041%/VAR 17-13.03.28	3 490 000.00	3 345 814.80	0.06
USD HSBC HOLDINGS PLC 4.583%/VAR 18-19.06.29	15 093 000.00	14 623 582.79	0.25
USD HSBC HOLDINGS PLC 4.292%/VAR 18-12.09.26	2 120 000.00	2 064 528.51	0.04
USD HSBC HOLDINGS PLC 4.755%/VAR 22.09.06.28	765 000.00	753 347.44	0.01
USD HSBC HOLDINGS PLC 7.336%/VAR 22-03.11.26	8 155 000.00	8 607 601.78	0.15
USD HSBC HOLDINGS PLC 7.390%/VAR 22-03.11.28	6 325 000.00	6 894 954.10	0.12
USD HSBC HOLDINGS PLC-SUB 4.6000%/VAR 20-PRP	844 000.00	715 501.00	0.01
USD HSBC HOLDINGS PLC-SUB 4.762%/VAR 22-29.03.33	1 536 000.00	1 417 349.86	0.03
USD ING GROEP NV 4.017%/VAR 22-28.03.28	2 475 000.00	2 375 366.27	0.04
USD JP MORGAN CHASE & CO 4.005%/VAR 18-23.04.29	4 750 000.00	4 554 133.51	0.08
USD JP MORGAN CHASE & CO 2.580%/VAR 21-22.04.32	5 030 000.00	4 233 774.84	0.07
USD JP MORGAN CHASE & CO 1.470%/VAR 21-22.09.27	45 930 000.00	40 689 410.88	0.70
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.782%/VAR 17-01.02.28	6 885 000.00	6 617 904.69	0.11
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.220%/VAR 17-01.03.25	6 810 000.00	6 662 904.27	0.12
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.509%/3M LIBOR+94.5BP 18-23.01.29	6 130 000.00	5 743 979.07	0.10
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.559%/VAR 18-23.04.24	7 201 000.00	7 174 383.45	0.12
USD JPMORGAN CHASE & CO 4.452%/3M LIBOR+133BP 18-05.12.29	9 705 000.00	9 465 223.91	0.16
USD JPMORGAN CHASE & CO 2.739%/VAR 19-15.10.30	3 870 000.00	3 382 428.56	0.06
USD JPMORGAN CHASE & CO 2.301%/VAR 19-15.10.25	5 175 000.00	4 926 041.05	0.09
USD JPMORGAN CHASE & CO 2.083%/VAR 20-22.04.26	7 010 000.00	6 583 452.16	0.11
USD JPMORGAN CHASE & CO 2.522%/VAR 20-22.04.31	7 960 000.00	6 802 847.16	0.12
USD JPMORGAN CHASE & CO 1.764%/VAR 20-19.11.31	725 000.00	576 847.09	0.01
USD JPMORGAN CHASE & CO 1.040%/VAR 21-04.02.27	2 775 000.00	2 471 073.73	0.04
USD JPMORGAN CHASE & CO 1.578%/VAR 21-22.04.27	42 700 000.00	38 376 252.23	0.66
USD JPMORGAN CHASE & CO 2.069%/VAR 21-01.06.29	4 805 000.00	4 163 545.28	0.07
USD JPMORGAN CHASE & CO 0.768%/VAR 21-09.08.25	4 500 000.00	4 191 946.38	0.07
USD JPMORGAN CHASE & CO 2.963%/VAR 22-25.01.33	950 000.00	814 356.91	0.01
USD JPMORGAN CHASE & CO 2.947%/VAR 22-24.02.28	8 441 000.00	7 832 448.39	0.14
USD JPMORGAN CHASE & CO 4.565%/VAR 22-14.06.30	1 732 000.00	1 696 554.43	0.03
USD JPMORGAN CHASE & CO 4.851%/VAR 22-25.07.28	3 560 000.00	3 559 098.39	0.06
USD JPMORGAN CHASE & CO 5.546%/VAR 22-15.12.25	3 405 000.00	3 432 472.67	0.06
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 2.956%/VAR 20-13.05.31	7 295 000.00	6 328 789.43	0.11
USD JPMORGAN CHASE 4.323%/VAR 22-26.04.28	2 680 000.00	2 626 687.29	0.05
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 2.438%/VAR 20-05.02.26	3 150 000.00	2 968 777.44	0.05
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 3.870%/VAR 20-09.07.25	9 810 000.00	9 607 878.29	0.17
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 0.695%/VAR 21-11.05.24	3 200 000.00	3 154 447.23	0.06
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 3.511%/VAR 22-18.03.26	2 880 000.00	2 771 207.11	0.05
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.716%/VAR 22-11.08.26	2 405 000.00	2 371 230.43	0.04
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GP INC 1.538%/VAR 21-20.07.27	8 070 000.00	7 138 630.00	0.12
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 1.640%/VAR 21-13.10.27	4 773 000.00	4 203 914.73	0.07
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 0.962%/VAR 21-11.10.25	19 484 000.00	18 094 510.23	0.31
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 4.788%/VAR 22-18.07.25	8 085 000.00	8 030 837.77	0.14
USD MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 3.922%/VAR 18-11.09.24	9 385 000.00	9 293 930.77	0.16
USD MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 1.554%/VAR 21-09.07.27	1 875 000.00	1 659 286.12	0.03
USD MORGAN STANLEY 0.731%/VAR 21-05.04.24	4 876 000.00	4 833 734.39	0.08
USD MORGAN STANLEY 0.985%/VAR 20-10.12.26	6 330 000.00	5 632 719.93	0.10
USD MORGAN STANLEY 1.593%/VAR 21-04.05.27	3 665 000.00	3 291 206.43	0.06
USD MORGAN STANLEY 1.928%/VAR 21-28.04.32	12 025 000.00	9 552 342.78	0.17
USD MORGAN STANLEY 2.630%/VAR 22-18.02.26	3 660 000.00	3 477 931.95	0.06
USD MORGAN STANLEY 3.217%/VAR 21-22.04.42	95 000.00	75 882.32	0.00

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット・サステナブル

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD MORGAN STANLEY 3.591%/VAR 17-22.07.28	6 110 000.00	5 779 938.23	0.10
USD MORGAN STANLEY 4.210%/VAR 22-20.04.28	2 110 000.00	2 048 727.88	0.04
USD MORGAN STANLEY 5.123%/VAR 23-01.02.29	2 219 000.00	2 243 729.34	0.04
USD MORGAN STANLEY-SUB 2.484%/VAR 21-16.09.36	660 000.00	511 608.73	0.01
USD NATIONWIDE BUIL SOC-144A 3.766%/3M LIBOR+106.4BP 18-08.03.24	4 400 000.00	4 389 220.00	0.08
USD NATWEST GROUP PLC 1.642%/VAR 21-14.06.27	7 825 000.00	6 955 562.38	0.12
USD NATWEST GROUP PLC 2.359%/VAR 20-22.05.24	1 090 000.00	1 078 242.94	0.02
USD NATWEST GROUP PLC 4.892%/VAR 18-18.05.29	12 175 000.00	12 014 694.82	0.21
USD NATWEST GROUP PLC 4.269%/VAR 19-22.03.25	9 250 000.00	9 130 659.73	0.16
USD NATWEST GROUP PLC 5.516%/VAR 22-30.09.28	800 000.00	815 906.37	0.01
USD NATWEST GROUP PLC 7.472%/VAR 22-10.11.26	3 691 000.00	3 904 436.25	0.07
USD NIPPON LIFE INSURANCE CO-144A-SUB 2.750%/VAR 21-21.01.51	3 840 000.00	3 229 913.09	0.06
USD NORDEA BANK ABP-REG-S-SUB 6.625%/VAR 19-PRP	2 590 000.00	2 554 387.50	0.04
USD PNC FINANCIAL SERVICES GRP-SUB 6.750%/3M LIBOR+367.8BP 11-PRP	322 000.00	322 804.72	0.01
USD PRINCIPAL FINANCIAL GROUP-SUB 4.700%/VAR 15-15.05.55	3 386 000.00	3 318 280.00	0.06
USD PRUDENTIAL FINANCIAL INC-SUB 5.625%/VAR 12-15.06.43	11 987 000.00	11 927 065.00	0.21
USD PRUDENTIAL FINANCIAL-SUB 5.200%/3M LIBOR+304BP 13-15.03.44	1 589 000.00	1 559 492.27	0.03
USD PRUDENTIAL FINANCIAL INC-SUB 5.375%/VAR 15-15.05.45	2 735 000.00	2 681 847.24	0.05
USD PRUDENTIAL FINANCIAL INC-SUB 5.125%/VAR 22-01.03.52	2 311 000.00	2 155 931.90	0.04
USD SANTANDER HOLDINGS USA INC 2.490%/VAR 21-06.01.28	2 887 000.00	2 546 390.44	0.04
USD SANTANDER HOLDINGS USA INC 4.260%/VAR 22-09.06.25	1 449 000.00	1 417 631.12	0.03
USD SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC 1.089%/VAR 21-15.03.25	860 000.00	816 098.19	0.01
USD SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC 1.673%/VAR 21-14.06.27	2 235 000.00	1 961 315.69	0.03
USD SANTANDER UK GROUP HOLD PLC 2.469%/VAR 22-11.01.28	7 000 000.00	6 215 212.43	0.11
USD SANTANDER UK GROUP HOLDINGS 6.833%/VAR 22-21.11.26	4 983 000.00	5 157 707.02	0.09
USD SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-REG-SUB 6.875%/VAR 22-PRP	600 000.00	599 250.00	0.01
USD SOCIETE GENERALE SA-REG-S-SUB 8.000%/VAR 15-PRP	1 270 000.00	1 285 875.00	0.02
USD STANDARD CHARTERED PLC-144A-SUB 6.409%/3M LIBOR+151BP 06-PRP	200 000.00	174 570.25	0.00
USD STANDARD CHARTERED PLC-144A 3.785%/VAR 19-21.05.25	2 256 000.00	2 208 553.88	0.04
USD STANDARD CHARTERED PLC-144A 1.456%/VAR 21-14.01.27	1 223 000.00	1 088 883.37	0.02
USD STANDARD CHARTERED PLC-144A 2.608%/VAR 22-12.01.28	2 573 000.00	2 316 045.53	0.04
USD SWEDBANK AB-REG-S-SUB 4.000%/VAR 21-PRP	800 000.00	645 800.00	0.01
USD SWISS RE FINANCE LUXEMBOURG-144A-SUB 5.000%/VAR 19-02.04.49	3 424 000.00	3 308 645.44	0.06
USD SWISS RE FINANCE LUXEMBOURG-REG-S-SUB 5.000%/VAR 19-02.04.49	2 600 000.00	2 512 406.00	0.04
USD TRUIST FINANCIAL CORP-SUB 5.100%/VAR 20-PRP	3 696 000.00	3 581 412.73	0.06
USD UBS GROUP AG-144A 1.494%/VAR 21-10.08.27	9 115 000.00	8 026 414.41	0.14
USD UBS GROUP AG-144A 4.703%/VAR 22-05.08.27	2 240 000.00	2 210 935.69	0.04
USD VODAFONE GROUP PLC-SUB 3.250%/VAR 21-04.06.81	1 365 000.00	1 184 137.50	0.02
USD WABTEC CORP STEP-UP/RATING LINKED 18-15.09.28	1 850 000.00	1 837 671.30	0.03
USD WABTEC CORP/DE STEP-UP/RATING LINKED 18-15.03.24	8 251 000.00	8 146 247.11	0.14
USD WELLS FARGO & CO 2.188%/VAR 20-30.04.26	15 036 000.00	14 145 157.45	0.24
USD WELLS FARGO & CO-SUB 3.900%/VAR 21-PRP	5 120 000.00	4 720 000.00	0.08
USD WESTPAC BANKING CORP-SUB 4.110%/VAR 19-24.07.34	3 350 000.00	3 018 928.54	0.05
USD WESTPAC BANKING CORP-SUB 2.668%/VAR 20-15.11.35	7 700 000.00	6 013 880.95	0.10
米ドル合計		927 913 816.86	16.04

ノート、変動利付債合計

927 913 816.86 16.04

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	961 773.32	0.02
USD AIR LEASE CORP 0.70000% 21-15.02.24	1 900 000.00	1 812 244.58	0.03
USD AIR LEASE CORP 2.87500% 20-15.01.26	5 272 000.00	4 946 296.12	0.09
USD AMERICAN HONDA FINANCE CORP 1.20000% 20-08.07.25	2 550 000.00	2 348 857.91	0.04
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 3.95000% 15-21.04.25	9 520 000.00	9 361 297.31	0.16
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 4.18300% 16-25.11.27	4 650 000.00	4 566 075.82	0.08
USD BB&T CORP 2.50000% 19-01.08.24	2 950 000.00	2 853 455.23	0.05

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット・サステナブル

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 3.70000% 18-30.05.24	4 200 000.00	4 103 559.01	0.07
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 3.85000% 14-08.07.24	9 380 000.00	9 246 778.20	0.16
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 4.00000% 14-03.03.24	3 180 000.00	3 149 488.44	0.05
USD JOHN DEERE CAPITAL CORP 4.85000% 22-11.10.29	1 603 000.00	1 648 960.05	0.03
USD JOHN DEERE CAPITAL CORP 4.75000% 23-20.01.28	6 094 000.00	6 223 088.65	0.11
USD MCDONALD ' S CORP 3.60000% 20-01.07.30	3 322 000.00	3 137 733.31	0.05
USD MORGAN STANLEY 3.12500% 16-27.07.26	2 200 000.00	2 085 066.89	0.04
USD MORGAN STANLEY 3.87500% 16-27.01.26	6 715 000.00	6 557 483.02	0.11
USD MORGAN STANLEY 4.00000% 15-23.07.25	1 635 000.00	1 608 998.76	0.03
USD MORGAN STANLEY-SUB 3.95000% 15-23.04.27	8 560 000.00	8 274 515.27	0.14
USD MORGAN STANLEY-SUB 4.35000% 14-08.09.26	7 510 000.00	7 362 195.47	0.13
USD MORGAN STANLEY-SUB 4.10000% 13-22.05.23	500 000.00	498 750.38	0.01
USD NORDEA BANK ABP-144A 1.50000% 21-30.09.26	4 575 000.00	4 043 016.12	0.07
USD PUBLIC SERVICE ELECTRIC & GAS CO 3.00000% 17-15.05.27	455 000.00	432 587.62	0.01
USD PUBLIC SERVICE ELECTRIC & GAS CO 3.70000% 18-01.05.28	835 000.00	813 168.53	0.01
USD PUBLIC SERVICE ELECTRIC & GAS CO 3.65000% 18-01.09.28	1 530 000.00	1 475 457.41	0.03
USD PUBLIC SERVICE ELECTRIC & GAS CO 3.20000% 19-15.05.29	1 685 000.00	1 571 360.80	0.03
USD ROYAL BANK OF CANADA-SUB COCO 4.65000% 16-27.01.26	4 225 000.00	4 199 017.35	0.07
USD ROYAL BANK OF CANADA 2.55000% 19-16.07.24	2 985 000.00	2 890 076.73	0.05
USD ROYAL BANK OF CANADA 1.15000% 21-14.07.26	9 400 000.00	8 399 185.85	0.15
USD ROYAL BANK OF CANADA 1.40000% 21-02.11.26	5 160 000.00	4 591 451.75	0.08
USD RYDER SYSTEM INC 1.75000% 21-01.09.26	7 870 000.00	7 039 556.57	0.12
USD RYDER SYSTEM INC 3.65000% 19-18.03.24	3 165 000.00	3 109 440.83	0.05
USD RYDER SYSTEM INC 4.30000% 22-15.06.27	1 948 000.00	1 906 205.99	0.03
USD RYDER SYSTEM INC 4.62500% 20-01.06.25	675 000.00	668 995.24	0.01
USD SHINHAN FIN GROUP CO LTD-144A 1.35000% 20-10.01.26	2 170 000.00	1 949 354.40	0.03
USD SOCIETE GENERALE SA-144A 3.87500% 19-28.03.24	1 665 000.00	1 633 530.28	0.03
USD SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD-144A 2.80000% 22-10.03.27	2 770 000.00	2 569 607.68	0.04
USD TENCENT HOLDINGS LTD-144A 3.97500% 19-11.04.29	3 575 000.00	3 366 756.25	0.06
USD TENCENT HOLDINGS LTD-144A 2.88000% 21-22.04.31	3 545 000.00	3 048 168.25	0.05
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.57500% 19-11.04.26	480 000.00	457 140.00	0.01
USD TORONTO-DOMINION BANK 1.95000% 22-12.01.27	7 570 000.00	6 885 530.14	0.12
USD TORONTO-DOMINION BANK 3.76600% 22-06.06.25	6 700 000.00	6 559 244.46	0.11
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 0.80000% 21-09.01.26	7 400 000.00	6 693 170.42	0.12
米ドル合計		155 048 640.41	2.68

中期債券、固定利付債合計		155 048 640.41	2.68
--------------	--	----------------	------

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	3 230 000.00	2 967 449.45	0.05
USD BANK OF AMERICA CORP 3.824%/VAR 17-20.01.28	4 460 000.00	4 293 627.02	0.07
USD BANK OF AMERICA CORP 3.593%/VAR 17-21.07.28	5 980 000.00	5 649 926.78	0.10
USD BANK OF AMERICA CORP 3M LIBOR+79BP 18-05.03.24	3 370 000.00	3 371 349.69	0.06
USD BANK OF AMERICA CORP 3.970%/3M LIBOR+107BP 18-05.03.29	860 000.00	820 862.97	0.01
USD BANK OF AMERICA CORP 3.974%/VAR 19-07.02.30	4 500 000.00	4 255 823.61	0.07
USD BANK OF AMERICA CORP 3.458%/3M LIBOR+97BP 19-15.03.25	13 270 000.00	13 013 016.89	0.22
USD BANK OF AMERICA CORP 3.559%/VAR 19-23.04.27	7 170 000.00	6 865 459.99	0.12
USD BANK OF AMERICA CORP 3.194%/VAR 19-23.07.30	14 525 000.00	13 026 498.02	0.23
USD BANK OF AMERICA CORP 2.456%/VAR 19-22.10.25	2 500 000.00	2 390 007.07	0.04
USD BANK OF AMERICA CORP 2.884%/VAR 19-22.10.30	14 450 000.00	12 665 981.47	0.22
USD BANK OF AMERICA CORP 2.496%/3M LIBOR+99BP 20-13.02.31	6 120 000.00	5 205 827.20	0.09
USD BANK OF AMERICA CORP 1.319%/VAR 20-19.06.26	9 265 000.00	8 485 964.52	0.15
USD BANK OF AMERICA CORP 1.898%/VAR 20-23.07.31	5 695 000.00	4 603 559.41	0.08
USD BANK OF AMERICA CORP 2.087%/VAR 21-14.06.29	24 061 000.00	20 969 098.46	0.36
USD BANK OF AMERICA CORP 3.384%/VAR 22-02.04.26	2 810 000.00	2 718 148.74	0.05
USD MORGAN STANLEY 0.864%/VAR 20-21.10.25	2 075 000.00	1 923 011.62	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・サステナブル

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD MORGAN STANLEY 1.164%/VAR 21-21.10.25	2 500 000.00	2 329 700.28	0.04
USD MORGAN STANLEY 1.512%/VAR 21-20.07.27	32 570 000.00	29 059 889.41	0.50
USD MORGAN STANLEY 2.188%/VAR 20-28.04.26	10 597 000.00	9 958 659.81	0.17
USD MORGAN STANLEY 2.239%/VAR 21-21.07.32	35 000.00	28 467.95	0.00
USD MORGAN STANLEY 2.475%/VAR 22-21.01.28	10 626 000.00	9 688 217.25	0.17
USD MORGAN STANLEY 2.699%/VAR 20-22.01.31	17 545 000.00	15 225 092.02	0.26
USD MORGAN STANLEY 2.720%/VAR 19-22.07.25	5 965 000.00	5 759 592.42	0.10
USD MORGAN STANLEY 3.622%/VAR 20-01.04.31	11 238 000.00	10 336 936.71	0.18
USD MORGAN STANLEY 4.431%/VAR 19-23.01.30	1 185 000.00	1 154 760.87	0.02
USD MORGAN STANLEY 4.679%/VAR 22-17.07.26	4 743 000.00	4 703 359.19	0.08
USD NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-144A 2.972%/VAR 22-16.02.28	2 440 000.00	2 218 954.81	0.04
USD WELLS FARGO & CO 1.654%/VAR 20-02.06.24	5 070 000.00	5 010 378.32	0.09
USD WELLS FARGO & CO 2.572%/VAR 20-11.02.31	7 050 000.00	6 075 560.07	0.11
USD WELLS FARGO & CO 2.879%/VAR 19-30.10.30	8 985 000.00	7 951 660.31	0.14
USD WELLS FARGO & CO 3.350%/VAR 22-02.03.33	7 505 000.00	6 617 921.31	0.11
USD WELLS FARGO & CO 3.908%/VAR 22-25.04.26	4 022 000.00	3 929 372.98	0.07
米ドル合計		233 274 136.62	4.03
中期債券、変動利付債合計		233 274 136.62	4.03
債券、固定利付債			
EUR			
EUR DIGITAL INTREPID HOLDING BV-REG-S 0.62500% 21-15.07.31	5 783 000.00	4 563 503.69	0.08
EUR MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 2.25000% 19-07.03.39	200 000.00	174 684.63	0.00
EUR THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 0.50000% 19-01.03.28	1 100 000.00	1 036 721.61	0.02
ユーロ合計		5 774 909.93	0.10
USD			
USD ABU DHABI, GOVERNMENT OF-144A 2.50000% 19-30.09.29	2 840 000.00	2 578 720.00	0.05
USD ACE CAPITAL TRUST II-SUB 9.70000% 00-01.04.30	3 784 000.00	4 757 999.79	0.08
USD ARES CAPITAL CORP 3.50000% 17-10.02.23	4 165 000.00	4 162 994.80	0.07
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 8.05000% 97-15.06.27	281 000.00	309 472.98	0.01
USD BRANCH BANKING & TRUST CO-SUB 3.80000% 14-30.10.26	6 200 000.00	5 980 718.71	0.10
USD BRITISH TELECOMMUNICATIONS PLC STEP-UP/DOWN 00-15.12.30	3 935 000.00	4 962 587.04	0.09
USD CITIGROUP INC-SUB 4.30000% 14-20.11.26	1 542 000.00	1 515 041.66	0.03
USD COMCAST CORP 3.15000% 17-15.02.28	2 285 000.00	2 162 912.26	0.04
USD COMMONSPIRIT HEALTH 2.76000% 19-01.10.24	509 000.00	491 804.58	0.01
USD COMMONWEALTH EDISON CO 3.70000% 18-15.08.28	520 000.00	501 379.28	0.01
USD CONSOLIDATED EDISON CO OF NEW YORK 2.90000% 21-01.12.26	1 585 000.00	1 473 439.91	0.03
USD CONSOLIDATED EDISON CO OF NEW YORK INC 4.00000% 18-01.12.28	2 580 000.00	2 528 689.22	0.04
USD CONSOLIDATED EDISON CO OF NEW YORK INC 3.35000% 20-01.04.30	10 000 000.00	9 282 387.70	0.16
USD CVS CAREMARK CORP 6.25000% 07-01.06.27	1 100 000.00	1 171 750.88	0.02
USD DISCOVER BANK 3.45000% 16-27.07.26	6 058 000.00	5 729 324.12	0.10
USD DOW CHEMICAL CO 4.25000% 14-01.10.34	674 000.00	632 197.59	0.01
USD ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC 3.75000% 14-15.02.25	4 390 000.00	4 319 276.21	0.07
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 4.35000% 17-17.01.27	2 035 000.00	1 975 993.39	0.03
USD HCA INC 5.37500% 15-01.02.25	4 645 000.00	4 662 545.83	0.08
USD IBERDROLA INTERNATIONAL BV 5.81000% 05-15.03.25	2 290 000.00	2 331 863.97	0.04
USD JP MORGAN CHASE & CO-SUB 4.25000% 15-01.10.27	4 200 000.00	4 158 638.82	0.07
USD MICROSOFT CORP 2.00000% 16-08.08.23	8 016 000.00	7 903 079.33	0.14
USD MIZUHO FINANCE GROUP CAYMAN 3-144A-SUB 4.60000% 14-27.03.24	9 677 000.00	9 566 154.03	0.17
USD MMI CAPITAL TRUST I-SUB 7.62500% 98-15.12.27	3 050 000.00	3 347 337.42	0.06
USD NBD BANK NA MICHIGAN-SUB 8.25000% 94-01.11.24	1 110 000.00	1 167 198.43	0.02
USD PERU, REPUBLIC OF 2.39200% 20-23.01.26	288 000.00	267 714.00	0.00
USD PERU, REPUBLIC OF 2.78300% 20-23.01.31	900 000.00	760 106.25	0.01
USD PUBLIC SERVICE ELECTRIC & GAS CO 4.90000% 22-15.12.32	3 035 000.00	3 156 323.06	0.05
USD STATOIL ASA 7.15000% 95-15.11.25	3 000 000.00	3 195 766.38	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・サステナブル

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 6.87500% 08-15.02.38	1 500 000.00	1 832 648.73	0.03
USD UNIVERSITY OF NOTRE DAME DU LAC 3.39400% 17-15.02.48	1 826 000.00	1 524 222.35	0.03
USD WALT DISNEY CO/THE 3.00000% 16-13.02.26	6 860 000.00	6 592 450.81	0.11
USD WILLIAMS COMPANIES INC 7.50000% 01-15.01.31	150 000.00	170 441.53	0.00
USD WYETH 6.50000% 03-01.02.34	2 000 000.00	2 336 216.62	0.04
米ドル合計		107 509 397.68	1.86
債券、固定利付債合計		113 284 307.61	1.96
債券、変動利付債			
USD			
USD CITIGROUP INC-SUB 4.700%/VAR 20-PRP	485 000.00	443 132.33	0.01
USD CLOVERIE PLC VIA SWISS RE-REG-S-SUB 4.500%/VAR 14-11.09.44	3 815 000.00	3 683 764.00	0.06
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S-SUB 7.500%/VAR 18-PRP	1 106 000.00	1 023 887.32	0.02
USD DEMETER INVESTMENTS BV-REG-S-SUB 5.125%/VAR 18-01.06.48	4 020 000.00	3 803 000.40	0.07
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 1.44700%/VAR 21-01.04.25	2 575 000.00	2 432 118.69	0.04
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 2.552%/VAR 22-07.01.28	612 000.00	546 389.85	0.01
USD DEUTSCHE TELEKOM INTL FIN 8.250%/RATING LINKED 00-15.06.30	3 450 000.00	4 214 780.95	0.07
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 4.223%/VAR 18-01.05.29	3 080 000.00	2 969 924.77	0.05
USD JP MORGAN CHASE & CO 2.005%/VAR 20-13.03.26	6 710 000.00	6 312 218.39	0.11
USD NIPPON LIFE INSURANCE CO-144A-SUB 2.900%/VAR 21-16.09.51	2 750 000.00	2 314 500.11	0.04
USD QBE INSURANCE GROUP LTD-REG-S-SUB 6.750%/VAR 14-02.12.44	3 540 000.00	3 540 768.53	0.06
USD WESTPAC BANKING CORP-SUB 4.322%/VAR 16-23.11.31	3 015 000.00	2 885 937.50	0.05
米ドル合計		34 170 422.84	0.59
債券、変動利付債合計		34 170 422.84	0.59
財務省証券(T-note)、固定利付債			
USD			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.75000% 21-31.12.23	3 300 000.00	3 182 179.70	0.06
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.75000% 22-15.08.32	20 321 000.00	19 120 790.93	0.33
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.87500% 22-30.11.27	3 414 000.00	3 452 940.94	0.06
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.87500% 23-31.12.27	20 290 000.00	20 519 847.55	0.35
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.25000% 23-31.12.24	22 100 000.00	22 100 000.00	0.38
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.12500% 23-31.01.25	19 320 000.00	19 298 114.11	0.33
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.50000% 23-31.01.28	20 885 000.00	20 791 996.59	0.36
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.12500% 22-15.11.32	41 074 000.00	43 211 131.57	0.75
米ドル合計		151 677 001.39	2.62
財務省証券(T-note)、固定利付債合計		151 677 001.39	2.62
地方債、固定利付債			
USD			
USD OREGON, STATE OF 5.76200% 03-01.06.23	3 000 000.00	601 153.08	0.02
米ドル合計		601 153.08	0.02
地方債、固定利付債合計		601 153.08	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・サステナブル

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / 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 BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA-SUB COCO 6.500%/VAR 19-PRP	4 800 000.00	4 698 048.00	0.08
USD BANK OF MONTREAL-SUB COCO 3.803%/VAR 17-15.12.32	3 450 000.00	3 140 845.50	0.05
USD BANK OF MONTREAL-SUB COCO 4.338%/VAR 18-05.10.28	4 865 000.00	4 805 475.17	0.08
USD SVENSKA HANDELSBANKEN AB-REG-S-SUB COCO 4.750%/VAR 20-PRP	1 800 000.00	1 541 286.00	0.03
USD SWEDBANK AB-REG-S-SUB COCO 5.625%/VAR 19-PRP	2 800 000.00	2 714 852.00	0.05
米ドル合計		16 900 506.67	0.29
転換社債型新株予約権付社債、変動利付債合計		16 900 506.67	0.29
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		4 191 280 098.75	72.46
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	1 137 000.00	1 146 312.03	0.02
アメリカ合衆国合計		1 146 312.03	0.02
株式合計		1 146 312.03	0.02
財務省証券 (T-bill)、ゼロ・クーポン			
USD			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 01.11.22-28.02.23	15 000 000.00	14 949 993.75	0.26
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 08.09.22-09.03.23	21 800 000.00	21 702 608.50	0.37
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 19.01.23-20.07.23	13 430 000.00	13 140 669.59	0.23
米ドル合計		49 793 271.84	0.86
財務省証券 (T-bill)、ゼロ・クーポン合計		49 793 271.84	0.86
アセット・バック証券、変動利付債			
USD			
USD CIFC FUNDING LTD-144A 3M LIBOR+105BP 18-24.04.30	1 500 000.00	1 389 918.08	0.03
USD ROMARK CLO II-144A 3M LIBOR+117.5BP 18-25.07.31	5 500 000.00	5 433 728.30	0.09
米ドル合計		6 823 646.38	0.12
アセット・バック証券、変動利付債合計		6 823 646.38	0.12
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	4 322 950.66	0.07
USD MORGAN STANLEY BK OF AMERICA MERRI TRT 3.29500% 17-01.05.50	5 000 000.00	4 064 222.02	0.07
USD MORGAN STANLEY CAPITAL I TRUST 3.15300% 17-01.06.50	2 800 000.00	2 706 798.36	0.05
米ドル合計		11 093 971.04	0.19
モーゲージ・バック証券、固定利付債合計		11 093 971.04	0.19

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット・サステナブル

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
モーゲージ・バック証券、変動利付債			
USD			
USD AMERICAN HOME MORTGAGE INVESTMENT 6M LIBOR+200BP 05-01.06.45	29 470 000.00	439 433.35	0.01
USD BANC OF AMERICA FUND TRUST 1M LIBOR+30BP 05-20.05.35	16 952 000.00	153 469.57	0.00
USD WAMU MORTGAGE PASS-TH TRUST 1M LIBOR+54BP 05-25.12.45	12 000 000.00	572 979.95	0.01
米ドル合計		1 165 882.87	0.02
モーゲージ・バック証券、変動利付債合計			
		1 165 882.87	0.02
ノート、固定利付債			
EUR			
EUR NETFLIX INC-144A 3.62500% 19-15.06.30	2 584 000.00	2 682 593.02	0.05
ユーロ合計		2 682 593.02	0.05
USD			
USD 1011778 BC ULC/NEW RED FINANCE INC-144A 3.87500% 19-15.01.28	690 000.00	630 646.20	0.01
USD 1011778 BC ULC/NEW RED FINANCE INC-144A 3.50000% 20-15.02.29	1 772 000.00	1 550 395.24	0.03
USD ABBVIE INC 4.55000% 20-15.03.35	2 900 000.00	2 845 553.81	0.05
USD ADT SECURITY CORP/THE-144A 4.12500% 21-01.08.29	2 180 000.00	1 940 745.00	0.03
USD ADVOCATE HEALTH & HOSPITALS CORP 2.21100% 20-15.06.30	2 000 000.00	1 691 108.18	0.03
USD AIG GLOBAL FUNDING-144A 0.65000% 21-17.06.24	1 750 000.00	1 652 500.87	0.03
USD AIR CANADA CLASS AA PASS THR TRT-144A 3.30000% 17-15.01.30	1 750 000.00	1 178 556.79	0.02
USD AIRCASTLE LTD-144A 2.85000% 21-26.01.28	2 993 000.00	2 606 154.75	0.05
USD AIRCASTLE LTD-144A 5.25000% 20-11.08.25	2 470 000.00	2 413 264.10	0.04
USD ALBERTSONS COS LLC / SAFEWAY INC-144A 3.50000% 20-15.03.29	3 635 000.00	3 135 187.50	0.05
USD ALCON FINANCE CORP-144A 2.75000% 19-23.09.26	4 375 000.00	4 066 647.24	0.07
USD AMERICAN EXPRESS CO 3.30000% 22-03.05.27	3 705 000.00	3 527 961.65	0.06
USD AMERICAN TRANSMISSION SYSTEMS INC-144A 2.65000% 21-15.01.32	4 745 000.00	4 039 213.38	0.07
USD ANTHEM INC 5.35000% 22-15.10.25	1 726 000.00	1 753 676.31	0.03
USD ANTHEM INC 5.50000% 22-15.10.32	3 420 000.00	3 633 072.98	0.06
USD ARCH CAPITAL FINANCE LLC 4.01100% 16-15.12.26	1 615 000.00	1 601 008.11	0.03
USD ASB BANK LTD-144A 1.62500% 21-22.10.26	12 000 000.00	10 676 280.00	0.18
USD ASB BANK LTD-144A 3.12500% 19-23.05.24	2 985 000.00	2 909 990.80	0.05
USD ATHENE GLOBAL FUNDING-144A 1.60800% 21-29.06.26	2 365 000.00	2 071 082.79	0.04
USD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BK GROUP LTD 5.08800% 22-08.12.25	4 200 000.00	4 240 871.04	0.07
USD AUTODESK INC 2.40000% 21-15.12.31	19 538 000.00	16 380 056.85	0.28
USD AVIATION CAPITAL GROUP-144A 3.50000% 17-01.11.27	741 000.00	663 511.33	0.01
USD AVIATION CAPITAL GROUP-144A 4.12500% 18-01.08.25	4 390 000.00	4 143 962.89	0.07
USD AVIATION CAPITAL GROUP-144A 1.95000% 21-30.01.26	4 783 000.00	4 254 550.10	0.07
USD AVIATION CAPITAL GROUP-144A 1.95000% 21-20.09.26	2 198 000.00	1 908 471.38	0.03
USD AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD-144A 2.52800% 21-18.11.27	2 275 000.00	1 950 789.75	0.03
USD BANK OF NOVA SCOTIA/THE 4.85000% 23-01.02.30	5 976 000.00	5 987 592.66	0.10
USD BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL-144A 1.60400% 21-04.10.26	6 365 000.00	5 657 765.94	0.10
USD BAXTER INTERNATIONAL INC 0.86800% 22-01.12.23	2 700 000.00	2 610 047.58	0.05
USD BAXTER INTERNATIONAL INC 1.91500% 22-01.02.27	4 270 000.00	3 854 052.85	0.07
USD BAXTER INTERNATIONAL INC 2.27200% 22-01.12.28	4 800 000.00	4 198 365.17	0.07
USD BBVA BANCOMER SA/TEXAS-144A 1.87500% 20-18.09.25	3 500 000.00	3 217 375.00	0.06
USD BERRY GLOBAL INC 0.95000% 21-15.02.24	1 250 000.00	1 193 543.29	0.02
USD BERRY GLOBAL INC 1.57000% 21-15.01.26	1 650 000.00	1 491 556.11	0.03
USD BERRY GLOBAL INC 1.65000% 21-15.01.27	1 500 000.00	1 312 215.18	0.02
USD BERRY GLOBAL INC-144A 4.87500% 19-15.07.26	1 500 000.00	1 461 000.00	0.03
USD BERRY GLOBAL INC-REG-S 4.87500% 19-15.07.26	1 250 000.00	1 217 500.00	0.02
USD BLACKSTONE GSO SECURED LEND FUND 3.62500% 21-15.01.26	4 250 000.00	3 963 077.57	0.07
USD BLOCK INC 2.75000% 21-01.06.26	4 034 000.00	3 666 260.56	0.06
USD BOSTON PROPERTIES LP 6.75000% 22-01.12.27	2 241 000.00	2 372 734.11	0.04
USD BPCE SA-144A 2.37500% 20-14.01.25	1 250 000.00	1 178 350.94	0.02
USD BPCE SA-144A 4.00000% 18-12.09.23	490 000.00	485 198.00	0.01

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット・サステナブル

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD BPCE SA-144A 5.02900% 23-15.01.25	1 262 000.00	1 261 584.27	0.02
USD BROADCOM INC-144A 1.95000% 21-15.02.28	4 675 000.00	4 058 415.28	0.07
USD BROADCOM INC-144A 2.60000% 21-15.02.33	2 610 000.00	2 050 358.03	0.04
USD BROADCOM INC-144A 2.45000% 21-15.02.31	1 604 000.00	1 316 703.01	0.02
USD BROADCOM INC-144A 3.41900% 21-15.04.33	5 386 000.00	4 518 572.09	0.08
USD BROADCOM INC-144A 3.13700% 21-15.11.35	6 872 000.00	5 335 120.15	0.09
USD BROADCOM INC-144A 4.00000% 22-15.04.29	301 000.00	282 211.20	0.01
USD CARGILL INC-144A 3.62500% 22-22.04.27	4 015 000.00	3 903 926.43	0.07
USD CARGILL INC-144A 5.12500% 22-11.10.32	1 277 000.00	1 331 351.66	0.02
USD CARRIER GLOBAL CORP 2.24200% 20-15.02.25	4 667 000.00	4 430 535.20	0.08
USD CARRIER GLOBAL CORP 2.72200% 20-15.02.30	3 500 000.00	3 057 259.90	0.05
USD CBOE GLOBAL MARKETS INC 3.00000% 22-16.03.32	1 990 000.00	1 735 852.26	0.03
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 4.00000% 17-01.03.23	1 098 000.00	1 096 353.00	0.02
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 4.50000% 20-15.08.30	2 435 000.00	2 080 610.10	0.04
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-REG-S 4.50000% 20-15.08.30	1 585 000.00	1 354 319.10	0.02
USD CCO LLC/CAPITAL 5.37500% 17-01.05.47	700 000.00	597 565.42	0.01
USD CDW LLC / CDW FINANCE CORP 2.67000% 21-01.12.26	4 635 000.00	4 167 235.80	0.07
USD CELULOSA ARAUCO Y CONSTITUCION SA 4.50000% 14-01.08.24	650 000.00	642 200.00	0.01
USD CELULOSA ARAUCO Y CONSTITUCION SA-144A 4.20000% 19-29.01.30	511 000.00	476 922.68	0.01
USD CENTENE CORP 3.37500% 20-15.02.30	3 620 000.00	3 182 414.40	0.06
USD CHENIERE CORPUS CHRISTI HLDGS LLC 5.87500% 17-31.03.25	6 410 000.00	6 471 772.15	0.11
USD CHENIERE ENERGY PARTNERS LP 4.50000% 20-01.10.29	1 890 000.00	1 773 046.80	0.03
USD CHENIERE ENERGY PARTNERS LP 4.00000% 21-01.03.31	925 000.00	829 873.00	0.01
USD CIGNA CORP 3.00000% 20-15.07.23	2 656 000.00	2 632 375.52	0.05
USD CIGNA CORP 3.25000% 20-15.04.25	4 550 000.00	4 419 593.45	0.08
USD CIGNA CORP 3.50000% 20-15.06.24	1 563 000.00	1 535 750.96	0.03
USD CITIZENS FINANCIAL GROUP INC-SUB 2.63800% 21-30.09.32	3 960 000.00	3 081 398.28	0.05
USD CLEAN HARBORS INC-144A 5.12500% 19-15.07.29	528 000.00	506 985.60	0.01
USD CLECO CORPORATE HOLDINGS LLC STEP-UP/DOWN 17-01.05.26	2 400 000.00	2 289 494.90	0.04
USD CLEVELAND ELECTRIC ILLUMINATING CO-144A 3.50000% 17-01.04.28	530 000.00	495 397.01	0.01
USD CNH INDUSTRIAL CAPITAL LLC 5.45000% 22-14.10.25	2 680 000.00	2 723 963.63	0.05
USD COMMONWEALTH BANK OF AUS-144A-SUB 2.68800% 21-11.03.31	3 275 000.00	2 662 018.58	0.05
USD CONTINENTAL AIRLINES 4.00000% 12-29.10.24	2 170 000.00	1 149 744.16	0.02
USD COOPERATIEVE RADOBANK UA-144A 1.00400% 20-24.09.26	14 000 000.00	12 492 277.14	0.22
USD CORP FINANCIERA DE DESARROLLO SA-144A 2.40000% 20-28.09.27	1 744 000.00	1 494 608.00	0.03
USD COX COMMUNICATIONS INC-144A 3.15000% 17-15.08.24	256 000.00	248 361.27	0.00
USD COX COMMUNICATIONS INC-144A 3.50000% 17-15.08.27	6 165 000.00	5 868 295.07	0.10
USD COX COMMUNICATIONS INC-144A 2.60000% 21-15.06.31	6 535 000.00	5 424 340.49	0.09
USD CSC HOLDINGS INC-144A 5.37500% 18-01.02.28	300 000.00	253 125.00	0.00
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 6.50000% 19-01.02.29	1 624 000.00	1 405 052.32	0.02
USD DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC-144A 3.70000% 18-04.05.23	3 215 000.00	3 204 887.73	0.06
USD DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC-144A 3.65000% 19-22.02.24	3 965 000.00	3 909 986.90	0.07
USD DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC-144A 2.45000% 21-02.03.31	2 460 000.00	2 100 756.12	0.04
USD DANSKE BANK A/S-144A 1.62100% 20-11.09.26	1 635 000.00	1 469 389.82	0.03
USD DANSKE BANK A/S-144A 1.54900% 21-10.09.27	3 410 000.00	2 998 636.80	0.05
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 5.45000% 21-15.06.23	1 803 000.00	1 805 188.25	0.03
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 5.85000% 21-15.07.25	6 865 000.00	6 995 095.59	0.12
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 5.30000% 21-01.10.29	2 500 000.00	2 523 747.82	0.04
USD DELTA AIR LINES INC / SKYMILES LTD-144A 4.50000% 20-20.10.25	1 036 578.00	938 852.36	0.02
USD DELTA AIR LN 2020-1 CLS AA PAS THRU TRT 2.00000% 20-10.06.28	2 015 000.00	1 500 736.34	0.03
USD DEUTSCHE TELEKOM INTL FINANCE BV-144A 2.48500% 16-19.09.23	730 000.00	718 776.44	0.01
USD DEVON ENERGY CORP 5.25000% 21-15.10.27	2 855 000.00	2 876 577.75	0.05
USD DIGITAL REALTY TRUST LP 5.55000% 22-15.01.28	5 800 000.00	5 926 493.53	0.10
USD DISCOVER BANK 2.70000% 20-06.02.30	2 900 000.00	2 423 776.09	0.04
USD DOLLAR GENERAL CORP 4.62500% 22-01.11.27	4 185 000.00	4 183 651.72	0.07
USD ELEVANCE HEALTH INC 4.75000% 23-15.02.33	8 860 000.00	8 888 671.58	0.15
USD ENEL FINANCE AMERICA LLC-144A 7.10000% 22-14.10.27	6 664 000.00	7 142 287.61	0.12
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-144A 3.50000% 17-06.04.28	1 070 000.00	979 690.85	0.02

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット・サステナブル

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL SA-144A 2.65000% 19-10.09.24	4 300 000.00	4 131 532.58	0.07
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-144A 1.37500% 21-12.07.26	4 155 000.00	3 671 366.64	0.06
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-144A 7.50000% 22-14.10.32	1 395 000.00	1 571 153.26	0.03
USD ENI SPA-144A 4.25000% 19-09.05.29	1 277 000.00	1 213 343.19	0.02
USD ENTEGRIS ESCROW CORP-144A 4.75000% 22-15.04.29	2 735 000.00	2 563 347.49	0.04
USD EQUITABLE FINANCIAL LIFE GLOBAL FU-144A 1.80000% 21-08.03.28	931 000.00	800 745.90	0.01
USD EQUITABLE FINANCIAL LIFE GLOBAL-144A 0.80000% 21-12.08.24	740 000.00	695 308.57	0.01
USD EXELON CORP 3.35000% 22-15.03.32	1 535 000.00	1 386 956.60	0.02
USD EXPERIAN FINANCE PLC-144A 2.75000% 19-08.03.30	3 865 000.00	3 315 254.00	0.06
USD F&G GLOBAL FUNDING-144A 0.90000% 21-20.09.24	5 050 000.00	4 668 755.50	0.08
USD FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS LTD 4.85000% 19-17.04.28	3 000 000.00	2 913 906.81	0.05
USD FARMERS EXCHANGE CAPITAL-144A-SUB 7.05000% 98-15.07.28	1 915 000.00	1 998 944.40	0.03
USD FEDERATION DES CAIS DESJD DU QEBEC-144A 4.40000% 22-23.08.25	2 405 000.00	2 371 264.56	0.04
USD FEDERATION DES CAISSES DESJARDINS-144A 2.05000% 20-10.02.25	5 300 000.00	4 979 837.12	0.09
USD FLORIDA GAS TRANSMISSION CO-144A 2.55000% 20-01.07.30	2 165 000.00	1 829 524.61	0.03
USD FMG RESOURCES AUGUST 2006 PTY LTD-144A 5.12500% 17-15.05.24	1 305 000.00	1 290 645.00	0.02
USD FOX CORP 4.70900% 20-25.01.29	1 835 000.00	1 813 589.84	0.03
USD FRESENIUS MED CAR US FIN III INC-144A 1.87500% 21-01.12.26	1 890 000.00	1 642 989.74	0.03
USD FS INVESTMENT CORP II-144A 4.25000% 20-14.02.25	9 975 000.00	9 421 602.36	0.16
USD GEORGIA-PACIFIC LLC-144A 2.30000% 20-30.04.30	250 000.00	214 264.69	0.00
USD GLP CAPTIAL/GLP FINANCING II INC 4.00000% 20-15.01.31	806 000.00	711 719.83	0.01
USD GRAY ESCROW II INC-144A 5.37500% 21-15.11.31	2 375 000.00	1 826 434.38	0.03
USD HCA INC-144A 3.12500% 22-15.03.27	2 475 000.00	2 300 893.03	0.04
USD HCA INC-144A 3.62500% 22-15.03.32	1 197 000.00	1 062 909.34	0.02
USD HIGH STREET FUNDING TRUST-144A 4.11100% 18-15.02.28	2 485 000.00	2 383 245.71	0.04
USD HILTON DOMESTIC OPERATING CO INC-144A 3.62500% 21-15.02.32	2 442 000.00	2 050 669.50	0.04
USD ICAHN ENTERPRISES LP / ICAHN ENTER FIN 4.37500% 21-01.02.29	5 740 000.00	4 998 463.75	0.09
USD INDEPENDENCE ENERGY FINANCE LLC-144A 7.25000% 21-01.05.26	2 025 000.00	1 944 000.00	0.03
USD INFOR INC-144A 1.45000% 20-15.07.23	1 015 000.00	993 372.53	0.02
USD INFOR INC-144A 1.75000% 20-15.07.25	6 203 000.00	5 646 887.53	0.10
USD INTERNATIONAL FLAVORS & FRAG INC-144A 1.23000% 21-01.10.25	13 185 000.00	11 856 401.48	0.20
USD INTERNATIONAL FLAVORS & FRAG INC-144A 1.83200% 21-15.10.27	9 295 000.00	8 043 797.26	0.14
USD INTESA SANPAOLO SPA-144A 3.25000% 19-23.09.24	2 975 000.00	2 844 075.10	0.05
USD INTESA SANPAOLO SPA-144A-SUB 4.19800% 21-01.06.32	2 350 000.00	1 869 798.11	0.03
USD INTESA SANPAOLO SPA-144A 7.00000% 22-21.11.25	330 000.00	340 783.23	0.01
USD INVERSIONES CMPC SA-144A 4.37500% 17-04.04.27	1 464 000.00	1 422 184.50	0.02
USD IRON MOUNTAIN INC-144A 4.87500% 19-15.09.29	977 000.00	882 362.90	0.02
USD ITC HOLDINGS CORP-144A 2.95000% 20-14.05.30	500 000.00	439 380.93	0.01
USD ITC HOLDINGS CORP-144A 4.95000% 22-22.09.27	3 200 000.00	3 233 982.30	0.06
USD JACKSON FINANCIAL INC 1.12500% 22-22.11.23	3 950 000.00	3 823 022.74	0.07
USD JACKSON FINANCIAL INC 3.12500% 22-23.11.31	6 729 000.00	5 487 518.48	0.09
USD JDE PEET ' S NV-144A 0.80000% 21-24.09.24	4 240 000.00	3 916 667.56	0.07
USD JDE PEET ' S NV-144A 1.37500% 21-15.01.27	8 200 000.00	7 114 265.22	0.12
USD JERSEY CENTRAL POWER & LIGHT CO-144A 4.70000% 13-01.04.24	1 573 000.00	1 559 964.18	0.03
USD JERSEY CENTRAL POWER & LIGHT CO-144A 4.30000% 15-15.01.26	2 026 000.00	1 974 378.19	0.03
USD JOHNS HOPKINS UNIVERSITY 4.70500% 22-01.07.32	3 550 000.00	3 672 748.60	0.06
USD KEYSpan GAS EAST CORP-144A 2.74200% 16-15.08.26	2 500 000.00	2 273 575.65	0.04
USD KYNDRYL HOLDINGS INC 2.05000% 22-15.10.26	7 000 000.00	6 035 149.33	0.10
USD LEVEL 3 FINANCING INC-144A 4.62500% 19-15.09.27	171 000.00	144 855.38	0.00
USD LEVEL 3 FINANCING INC-144A 3.87500% 19-15.11.29	3 000 000.00	2 432 760.00	0.04
USD LEVI STRAUSS & CO-144A 3.50000% 21-01.03.31	4 900 000.00	4 091 500.00	0.07
USD LOWE ' S COS INC 5.00000% 22-15.04.33	1 939 000.00	1 964 198.09	0.03
USD LUNDIN ENERGY FINANCE BV-144A 2.00000% 21-15.07.26	10 650 000.00	9 648 989.04	0.17
USD LUNDIN ENERGY FINANCE BV-144A 3.10000% 21-15.07.31	19 150 000.00	16 265 284.22	0.28
USD MACY ' S RETAIL HOLDINGS-144A 5.87500% 22-15.03.30	1 726 000.00	1 575 441.02	0.03
USD MANUFACTURERS & TRADERS TRUST CO 5.40000% 22-21.11.25	7 175 000.00	7 297 088.37	0.13
USD MERITAGE HOMES CORP-144A 3.87500% 21-15.04.29	4 000 000.00	3 545 000.00	0.06
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-144A 3.45000% 16-18.12.26	12 000 000.00	11 428 132.92	0.20

添付の注記は当財務書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・サステナブル

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I-144A 1.55000% 21-07.01.31	10 000 000.00	8 076 474.20	0.14
USD MICHAEL KORS USA INC-144A 4.00000% 17-01.11.24	2 286 000.00	2 223 112.14	0.04
USD MICROCHIP TECHNOLOGY INC 4.25000% 20-01.09.25	5 980 000.00	5 867 113.75	0.10
USD MID-ATLANTIC INTERSTATE TRANS-144A 4.10000% 18-15.05.28	2 030 000.00	1 958 271.59	0.03
USD MIDWEST CONNECTOR CAPITAL CO LLC-144A 3.90000% 19-01.04.24	7 020 000.00	6 859 644.67	0.12
USD MOLINA HEALTHCARE INC-144A 3.87500% 20-15.11.30	493 000.00	424 044.09	0.01
USD MONDELEZ INTERNATIONAL HOLDING NET-144A 0.75000% 21-24.09.24	6 785 000.00	6 339 141.02	0.11
USD MONDELEZ INTERNATIONAL HOLDING NET-144A 1.25000% 21-24.09.26	5 620 000.00	4 961 986.68	0.09
USD MPLX LP 4.25000% 20-01.12.27	525 000.00	510 364.04	0.01
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD/NEW YORK 4.94400% 23-12.01.28	7 675 000.00	7 827 387.13	0.14
USD NATIONAL SECURITIES CLEARING CORP-144A 1.50000% 20-23.04.25	3 450 000.00	3 220 258.05	0.06
USD NATIONAL SECURITIES CLEARING CORP-144A 5.05000% 22-21.11.24	9 000 000.00	9 044 172.36	0.16
USD NATURA COSMETICOS SA-144A 4.12500% 21-03.05.28	3 318 000.00	2 738 013.60	0.05
USD NETAPP INC 1.87500% 20-22.06.25	3 825 000.00	3 558 484.29	0.06
USD NETFLIX INC 5.75000% 14-01.03.24	1 290 000.00	1 296 450.00	0.02
USD NEWELL BRANDS INC 4.87500% 20-01.06.25	276 000.00	269 859.00	0.00
USD NEWELL BRANDS INC 6.37500% 22-15.09.27	4 385 000.00	4 407 758.15	0.08
USD NEWELL BRANDS INC 6.62500% 22-15.09.29	1 900 000.00	1 920 704.93	0.03
USD NGPL PIPECO LLC-144A 3.25000% 21-15.07.31	2 250 000.00	1 904 040.97	0.03
USD NIAGARA MOHAWK POWER CORP-144A 3.50800% 14-01.10.24	1 139 000.00	1 100 481.72	0.02
USD NIAGARA MOHAWK POWER CORP-144A 2.75900% 22-10.01.32	3 500 000.00	2 953 393.62	0.05
USD NORDEA BANK ABP-144A 3.75000% 18-30.08.23	1 065 000.00	1 056 886.60	0.02
USD NORDEA BANK ABP-144A 5.37500% 22-22.09.27	1 400 000.00	1 431 255.85	0.02
USD NXP BV / NXP FUNDING LLC 5.55000% 22-01.12.28	3 945 000.00	4 058 418.75	0.07
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 6.95000% 19-01.07.24	315 000.00	320 710.95	0.01
USD OHIO NATIONAL FINANCIAL SRVCS INC-144A 5.55000% 20-24.01.30	2 500 000.00	2 378 594.20	0.04
USD OHIO NATIONAL LIFE INSURANC C0144A-SUB 6.87500% 12-15.06.42	2 500 000.00	2 400 799.50	0.04
USD OLD NATIONAL BANCORP/IN-SUB 5.87500% 16-29.09.26	6 695 000.00	6 837 534.88	0.12
USD ONTARIO TEACHERS CADILLAC FAIRVIEW-144A 3.87500% 17-20.03.27	5 075 000.00	4 752 907.57	0.08
USD ONTARIO TEACHERS CADILLAC FAIRVIEW-144A 4.12500% 19-01.02.29	1 467 000.00	1 355 532.33	0.02
USD ONTARIO TEACHERS CADILLAC FAIRVIEW-144A 2.50000% 21-15.10.31	7 035 000.00	5 523 415.66	0.10
USD ORGANON FINANCE 1 LLC-144A 4.12500% 21-30.04.28	3 500 000.00	3 165 575.00	0.05
USD OTIS WORLDWIDE CORP 2.56500% 20-15.02.30	1 140 000.00	995 033.21	0.02
USD PANTHER BF AGGR 2/PANTHER FIN CO-144A 6.25000% 19-15.05.26	326 000.00	323 848.40	0.01
USD PARK AEROSPACE HOLDINGS LTD-144A 4.50000% 17-15.03.23	470 000.00	469 523.99	0.01
USD PARKLAND CORP-144A 4.50000% 21-01.10.29	2 500 000.00	2 144 479.23	0.04
USD PARSLEY ENERGY LLC/FINANCE CORP-144A 4.12500% 20-15.02.28	1 080 000.00	1 003 221.95	0.02
USD PDC ENERGY INC 5.75000% 18-15.05.26	2 890 000.00	2 795 005.70	0.05
USD PEIDMONT OPERATING PARTNERSHIP LP 2.75000% 21-01.04.32	1 650 000.00	1 218 041.07	0.02
USD PENNSYLVANIA ELECTRIC CO-144A 3.25000% 17-15.03.28	305 000.00	282 506.68	0.00
USD PENSKE TRUCK LEASING/PTL FIN CORP-144A 3.90000% 18-01.02.24	2 760 000.00	2 714 377.20	0.05
USD PENSKE TRUCK LEASING/PTL FIN CORP-144A 4.45000% 19-29.01.26	2 680 000.00	2 615 550.71	0.05
USD PENSKE TRUCK LEASING/PTL FIN CORP-144A 3.45000% 19-01.07.24	2 865 000.00	2 782 854.60	0.05
USD PHILLIPS EDISON GROCERY CENTER 2.62500% 21-15.11.31	7 950 000.00	6 102 883.88	0.11
USD PHYSICIANS REALTY LP 2.62500% 21-01.11.31	4 895 000.00	4 078 277.18	0.07
USD PRINCIPAL FINANCIAL GROUP INC 2.12500% 20-15.06.30	435 000.00	365 944.51	0.01
USD PRINCIPAL LIFE GLOBAL FUNDING II-144A 1.37500% 21-10.01.25	10 558 000.00	9 867 335.44	0.17
USD PROLOGIS LP 1.75000% 22-01.02.31	3 450 000.00	2 821 003.76	0.05
USD PROTECTIVE LIFE GLOBAL FUNDING-144A 1.61800% 21-15.04.26	1 135 000.00	1 031 030.70	0.02
USD PROTECTIVE LIFE GLOBAL FUNDING-144A 1.90000% 21-06.07.28	2 880 000.00	2 463 679.70	0.04
USD PROTECTIVE LIFE GLOBAL FUNDING-144A 5.36600% 23-06.01.26	4 665 000.00	4 750 808.76	0.08
USD PROVIDENCE HEALTH & SERV OBLIG 4.37900% 13-01.10.23	2 500 000.00	2 485 683.87	0.04
USD REALTY INCOME CORP 2.85000% 21-15.12.32	2 639 000.00	2 256 104.03	0.04
USD REALTY INCOME CORP 4.85000% 23-15.03.30	1 065 000.00	1 066 863.23	0.02
USD REALTY INCOME CORP 5.05000% 23-13.01.26	1 334 000.00	1 337 663.72	0.02
USD REGAL REXNORD CORP-144A 6.05000% 23-15.04.28	6 550 000.00	6 649 661.92	0.11
USD REGAL REXNORD CORP-144A 6.30000% 23-15.02.30	679 000.00	692 351.17	0.01
USD REGAL REXNORD CORP-144A 6.40000% 23-15.04.33	803 000.00	823 336.45	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・サステナブル

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / 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	2 885 000.00	2 328 249.15	0.04
USD ROCHE HOLDINGS INC-144A 2.07600% 21-13.12.31	6 150 000.00	5 191 700.30	0.09
USD ROCKIES EXPRESS PIPELINE LLC-144A 4.95000% 19-15.07.29	975 000.00	881 280.56	0.02
USD ROCKIES EXPRESS PIPELINE LLC-144A 3.60000% 20-15.05.25	1 260 000.00	1 191 130.98	0.02
USD ROCKIES EXPRESS PIPELINE LLC-144A 4.80000% 20-15.05.30	900 000.00	801 000.00	0.01
USD ROSS STORES INC 1.87500% 20-15.04.31	1 545 000.00	1 252 487.48	0.02
USD RUBY PIPELINE LLC-144A *DEFAULTED* 6.00000% 12-01.04.22	1 041 000.00	650 159.70	0.01
USD S&P GLOBAL INC-144A 2.45000% 22-01.03.27	4 175 000.00	3 882 669.80	0.07
USD S&P GLOBAL INC-144A 2.70000% 22-01.03.29	10 858 000.00	9 841 362.53	0.17
USD SEALED AIR CORP-144A 4.00000% 19-01.12.27	1 677 000.00	1 551 308.85	0.03
USD SEALED AIR CORP-144A 1.57300% 21-15.10.26	7 090 000.00	6 237 341.21	0.11
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 5.00000% 17-01.08.27	650 000.00	615 062.50	0.01
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 4.00000% 21-15.07.28	1 667 000.00	1 483 796.70	0.03
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 3.12500% 21-01.09.26	1 688 000.00	1 519 242.80	0.03
USD SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-144A 1.20000% 21-09.09.26	3 715 000.00	3 273 333.90	0.06
USD SLM CORP 4.20000% 20-29.10.25	1 422 000.00	1 326 086.47	0.02
USD SMITHFIELD FOODS INC-144A 5.20000% 19-01.04.29	2 760 000.00	2 578 234.96	0.04
USD SMITHFIELD FOODS INC-144A 3.00000% 20-15.10.30	1 350 000.00	1 063 935.00	0.02
USD SMITHFIELD FOODS INC-144A 2.62500% 21-13.09.31	7 194 000.00	5 381 730.69	0.09
USD SPRINT SPECTRUM CO III LLC-144A 4.73800% 18-20.03.25	2 820 000.00	1 573 593.00	0.03
USD SPRINT SPECTRUM CO III LLC-144A 5.15200% 18-20.03.28	6 130 000.00	6 119 357.21	0.11
USD STATE STREET CORP 2.90100% 20-30.03.26	3 220 000.00	3 098 500.55	0.05
USD STELLANTIS FINANCE US INC-144A 1.71100% 21-29.01.27	5 228 000.00	4 609 635.87	0.08
USD STELLANTIS FINANCE US INC-144A 2.69100% 21-15.09.31	4 980 000.00	4 013 717.35	0.07
USD STELLANTIS FINANCE US INC-144A 6.37500% 22-12.09.32	2 500 000.00	2 608 614.85	0.05
USD SYDNEY AIRPORT FINANCE CO PTY LTD-144A 3.90000% 12-22.03.23	3 340 000.00	3 335 875.10	0.06
USD SYNCHRONY FINANCIAL-SUB 7.25000% 23-02.02.33	4 250 000.00	4 255 445.06	0.07
USD TARGA RESOURCES PARTNERS 4.00000% 21-15.01.32	1 600 000.00	1 397 129.44	0.02
USD TECK RESOURCES LTD 3.90000% 20-15.07.30	6 965 000.00	6 455 562.77	0.11
USD TELEFLEX INC-144A 4.25000% 20-01.06.28	600 000.00	553 470.43	0.01
USD TENGIZCHEVROIL FINANCE CO INTL-144A 3.25000% 20-15.08.30	1 063 000.00	799 774.63	0.01
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 4.70000% 23-12.01.33	1 900 000.00	1 931 311.86	0.03
USD TRACTOR SUPPLY CO 1.75000% 20-01.11.30	3 250 000.00	2 588 542.71	0.04
USD TRANSCONTINENTAL GAS PIPE LINE 4.60000% 18-15.03.48	1 955 000.00	1 766 108.76	0.03
USD TRANSOCEAN POSEIDON LTD-144A 6.87500% 19-01.02.27	479 000.00	418 140.06	0.01
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 5.15000% 22-15.10.25	3 071 000.00	3 130 866.50	0.05
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 5.25000% 22-15.02.28	3 500 000.00	3 648 849.40	0.06
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 5.35000% 22-15.02.33	12 330 000.00	13 140 501.08	0.23
USD USAA CAPITAL CORP-144A 2.12500% 20-01.05.30	5 000 000.00	4 253 900.90	0.07
USD VAR ENERGI ASA-144A 7.50000% 22-15.01.28	4 530 000.00	4 728 309.66	0.08
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.35500% 22-15.03.32	5 292 000.00	4 359 574.47	0.08
USD VERMILION ENERGY INC-144A 6.87500% 22-01.05.30	2 150 000.00	1 983 375.00	0.03
USD VIATRIS INC 1.65000% 21-22.06.25	1 680 000.00	1 544 145.19	0.03
USD VIATRIS INC 2.30000% 21-22.06.27	3 500 000.00	3 086 062.91	0.05
USD WALT DISNEY CO 7.75000% 19-20.01.24	478 000.00	490 720.46	0.01
USD WEA FIN LLC/ WESTF UK&EUR FIN PLC-144A 3.75000% 14-17.09.24	3 809 000.00	3 632 700.32	0.06
USD WEA FINANCE LLC-144A 4.12500% 18-20.09.28	2 620 000.00	2 304 844.32	0.04
USD WEIR GROUP PLC/THE-144A 2.20000% 21-13.05.26	2 565 000.00	2 298 935.99	0.04
USD WEYERHAEUSER CO 3.37500% 22-09.03.33	2 570 000.00	2 259 290.93	0.04
USD WILLIS NORTH AMERICA INC 4.50000% 18-15.09.28	500 000.00	486 857.54	0.01
USD WILLIS NORTH AMERICA INC 2.95000% 19-15.09.29	7 035 000.00	6 225 191.10	0.11
USD WRKCO INC 3.75000% 19-15.03.25	2 795 000.00	2 722 132.34	0.05
USD YARA INTERNATIONAL ASA-144A 3.14800% 20-04.06.30	2 475 000.00	2 061 675.00	0.04
米ドル合計		831 964 998.56	14.38
ノート、固定利付債合計		834 647 591.58	14.43

添付の注記は当財務書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・サステナブル

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
ノート、変動利付債			
USD			
USD AIB GROUP PLC-144A 7.583%/VAR 22-14.10.26	3 271 000.00	3 385 196.79	0.06
USD ANALOG DEVICES INC O/N SOFR +25BP 21-01.10.24	5 000 000.00	4 938 875.40	0.08
USD ASB BANK LTD-144A-SUB 5.284%/VAR 22-17.06.32	4 800 000.00	4 632 916.32	0.08
USD ATHENE GLOBAL FUNDING-144A 3M SOFRRATE+70BP 21-24.02.24	2 210 000.00	2 191 109.20	0.04
USD BANK OF AMERICA CORP 6.204%/VAR 22-10.11.28	6 095 000.00	6 427 422.57	0.11
USD BANK OF IRELAND GROUP-144A 6.253%/VAR 22-16.09.26	856 000.00	862 721.05	0.01
USD BANK OF NEW YORK MELLON CORP/THE 4.543%/VAR 23-01.02.29	3 300 000.00	3 297 371.65	0.06
USD BNP PARIBAS SA-144A 1.323%/VAR 21-13.01.27	2 550 000.00	2 286 609.15	0.04
USD BNP PARIBAS SA-144A 1.675%/VAR 21-30.06.27	5 280 000.00	4 693 617.24	0.08
USD BNP PARIBAS SA-144A 2.159%/VAR 21-15.09.29	7 155 000.00	6 068 192.56	0.10
USD BNP PARIBAS-144A 3.052%/VAR 20-13.01.31	2 020 000.00	1 753 123.17	0.03
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 6.119%/VAR 22-14.07.26	1 512 000.00	1 528 645.42	0.03
USD DNB BANK ASA-144A 0.856%/VAR 21-30.09.25	3 690 000.00	3 422 652.71	0.06
USD DNB BANK ASA-144A 1.605%/VAR 21-30.03.28	3 265 000.00	2 837 619.96	0.05
USD DUPONT DE NEMOURS INC 3M LIBOR+111BP 18-15.11.23	3 000 000.00	3 014 351.06	0.05
USD FARMERS EXCHANGE CAPITAL II-144A-SUB 6.151%/VAR 13-01.11.53	1 000 000.00	999 926.56	0.02
USD FARMERS INSURANCE EXCHANGE-144A-SUB 4.747%/VAR 17-01.11.57	1 000 000.00	840 274.99	0.01
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC-SUB 4.125%/VAR 21-PRP	866 000.00	770 288.90	0.01
USD HARTFORD FINANCIAL-144A-SUB 3M LIBOR+212.5BP 17-12.02.47	5 055 000.00	4 323 288.75	0.07
USD HUNTINGTON NATIONAL BANK 5.699%/VAR 22-18.11.25	10 000 000.00	10 113 418.50	0.17
USD MACQUARIE GROUP LTD-144A 1.340%/VAR 21-12.01.27	4 924 000.00	4 376 303.48	0.08
USD MORGAN STANLEY 6.296%/VAR 22-18.10.28	4 280 000.00	4 524 855.63	0.08
USD NATIONAL BANK OF CANADA 3.750%/VAR 22-09.06.25	4 975 000.00	4 886 171.42	0.08
USD PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE 6.037%/VAR 22-28.10.33	5 815 000.00	6 284 770.65	0.11
USD PNC FINANCIAL SERVICES GROUP 4.758%/VAR 23-26.01.27	16 500 000.00	16 526 900.78	0.29
USD PNC FINANCIAL SERVICES GROUP 5.068%/VAR 23-24.01.34	2 190 000.00	2 209 046.24	0.04
USD RABOBANK NEDERLAND NV-144A 3.649%/VAR 22-06.04.28	6 504 000.00	6 167 136.97	0.11
USD SOCIETE GENERALE SA-144A O/N SOFR+105BP 22-21.01.26	1 670 000.00	1 639 650.65	0.03
USD SOCIETE GENERALE SA-144A 2.226%/VAR 22-21.01.26	7 243 000.00	6 766 420.60	0.12
USD SOCIETE GENERALE SA-144A-SUB 6.221%/VAR 22-15.06.33	4 000 000.00	3 971 629.84	0.07
USD SOCIETE GENERALE-144A 2.797%/VAR 22-19.01.28	3 085 000.00	2 779 941.90	0.05
USD STATE STREET CORP 4.857%/VAR 23-26.01.26	2 347 000.00	2 355 587.93	0.04
USD TEACHER INS&AN-144A-SUB 4.375%/3M LIBOR+266.1BP 14-15.09.54	4 900 000.00	4 720 262.12	0.08
USD UBS GROUP AG-144A 4.751%/VAR 22-12.05.28	2 000 000.00	1 966 090.76	0.03
USD UNICREDIT SPA-144A 1.982%/VAR 21-03.06.27	4 910 000.00	4 329 000.24	0.07
USD UNICREDIT SPA-144A 2.56900% 20-22.09.26	3 171 000.00	2 876 756.63	0.05
USD UNICREDIT SPA-144A 3.127%/VAR 21-03.06.32	900 000.00	729 841.90	0.01
USD US BANCORP 4.653%/VAR 23-01.02.29	2 750 000.00	2 747 663.46	0.05
USD US BANCORP 5.727%/VAR 22-21.10.26	7 050 000.00	7 243 780.04	0.13
USD US BANCORP 5.850%/VAR 22-21.10.33	2 500 000.00	2 684 500.20	0.05
USD US BANCORP VAR 23-01.02.34	2 800 000.00	2 783 419.21	0.05
USD VOYA FINANCIAL INC-SUB 5.650%/VAR 13-15.05.53	6 135 000.00	6 107 392.50	0.11
米ドル合計		167 064 745.10	2.89
ノート、変動利付債合計		167 064 745.10	2.89
中期債券、固定利付債			
USD			
USD BPCE SA-144A-SUB 4.62500% 14-11.07.24	6 170 000.00	6 060 843.56	0.10
USD BRIGHHOUSE FINANCIAL GLOBAL FUND-144A 1.75000% 22-13.01.25	3 100 000.00	2 879 179.90	0.05
USD INTESA SANPAOLO SPA-144A-SUB 5.01700% 14-26.06.24	2 186 000.00	2 132 664.72	0.04
USD INTESA SANPAOLO SPA-144A-SUB 5.71000% 16-15.01.26	4 582 000.00	4 502 553.34	0.08
USD KEYBANK NA/CLEVELAND OH 5.00000% 23-26.01.33	980 000.00	982 486.78	0.02
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-144A 4.15000% 22-26.08.25	3 100 000.00	3 060 531.64	0.05

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット・サステナブル

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING 144A I 5.05000% 23-06.01.28	8 500 000.00	8 673 485.09	0.15
USD NBN CO LTD-144A 0.87500% 21-08.10.24	6 700 000.00	6 228 399.06	0.11
USD NBN CO LTD-144A 1.62500% 21-08.01.27	12 425 000.00	11 005 103.30	0.19
USD NORTHWESTERN MUTUAL GLOBAL FUNDING-144A 4.00000% 22-01.07.25	3 750 000.00	3 697 824.97	0.06
USD PRINCIPAL LIFE GLOBAL FUNDING-144A 1.25000% 21-16.08.26	3 000 000.00	2 649 730.23	0.05
USD RELIANCE STANDARD LIFE GLOBAL-144A 1.51200% 21-28.09.26	2 258 000.00	1 987 115.64	0.03
USD ROYAL BANK OF CANADA 5.00000% 23-01.02.33	3 420 000.00	3 471 682.05	0.06
USD SOCIETE GENERALE SA-144A 2.62500% 20-22.01.25	5 360 000.00	5 087 551.46	0.09
米ドル合計		62 419 151.74	1.08
中期債券、固定利付債合計		62 419 151.74	1.08
中期債券、変動利付債			
USD			
USD BANK OF NEW YORK MELLON/THE 5.224%/VAR 22-21.11.25	3 500 000.00	3 525 506.36	0.06
USD MACQUARIE GROUP LTD-144A 1.629%/VAR 21-23.09.27	1 320 000.00	1 145 627.21	0.02
USD MACQUARIE GROUP LTD-144A 2.691%/VAR 21-23.06.32	4 615 000.00	3 730 010.98	0.07
USD MACQUARIE GRP LTD-144A 4.150%/VAR 18-27.03.24	2 555 000.00	2 549 386.15	0.05
USD SOCIETE GENERALE SA-144A 1.792%/VAR 21-09.06.27	2 385 000.00	2 113 527.47	0.04
USD TORONTO-DOMINION BANK/THE 3M SOFRRATE+59BP 21-10.09.26	5 395 000.00	5 283 772.47	0.09
USD TRUIST FINANCIAL CORP 4.12300%/VAR 22-06.06.28	4 925 000.00	4 816 975.15	0.08
USD TRUIST FINANCIAL CORP 5.900%/VAR 22-28.10.26	4 997 000.00	5 144 145.91	0.09
USD TRUIST FINANCIAL CORP 4.873%/VAR 23-26.01.29	5 250 000.00	5 279 669.43	0.09
USD TRUIST FINANCIAL CORP 5.122%/VAR 23-26.01.34	4 725 000.00	4 788 313.21	0.08
USD WELLS FARGO & CO 4.897%/VAR 22-25.07.33	795 000.00	791 917.68	0.01
米ドル合計		39 168 852.02	0.68
中期債券、変動利付債合計		39 168 852.02	0.68
債券、固定利付債			
EUR			
EUR ARDAGH METAL PACKAGING FINANCE-144A 2.00000% 21-01.09.28	2 236 000.00	2 019 099.66	0.03
ユーロ合計		2 019 099.66	0.03
USD			
USD ADVOCATE HEALTH & HOSPITALS CORP 3.82900% 18-15.08.28	1 215 000.00	1 162 463.52	0.02
USD AMERICAN AIRLINES 2019-1 CLASS AA 3.15000% 19-15.02.32	4 500 000.00	3 293 760.29	0.06
USD AMERICAN AIRLINES 3.20000% 16-15.06.28	2 000 000.00	1 281 912.14	0.02
USD ASCENSION HEALTH 2.53200% 19-15.11.29	1 495 000.00	1 313 596.21	0.02
USD ATLANTIC CITY ELECTRIC CO 2.30000% 21-15.03.31	710 000.00	599 059.72	0.01
USD BANNER HEALTH 2.33800% 20-01.01.30	1 130 000.00	978 472.12	0.02
USD BARNABAS HEALTH INC 4.00000% 12-01.07.28	2 000 000.00	1 916 445.06	0.03
USD BON SECOURS MERCY HEALTH INC 2.09500% 20-01.06.31	925 000.00	743 682.55	0.01
USD CEDARS-SINAI HEALTH SYSTEM 2.28800% 21-15.08.31	1 870 000.00	1 563 974.12	0.03
USD COMMONSPIRIT HEALTH 3.34700% 19-01.10.29	1 250 000.00	1 122 048.64	0.02
USD COMMONSPIRIT HEALTH 2.78200% 20-01.10.30	1 250 000.00	1 065 839.83	0.02
USD COMMONWEALTH EDISON CO 4.90000% 23-01.02.33	715 000.00	736 807.35	0.01
USD FARMERS INSURANCE EXCHANGE-144A-SUB 8.62500% 94-01.05.24	700 000.00	734 645.64	0.01
USD INTERSTATE POWER & LIGHT CO 3.60000% 19-01.04.29	2 245 000.00	2 100 534.45	0.04
USD M&T BANK CORP-SUB 4.00000% 14-15.07.24	1 700 000.00	1 674 795.19	0.03
USD METROPOLITAN EDISON CO-144A 4.00000% 14-15.04.25	2 650 000.00	2 555 728.24	0.04
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I-144A 2.95000% 20-09.04.30	3 060 000.00	2 761 196.32	0.05
USD NGPL PIPECO LLC-144A 4.87500% 17-15.08.27	1 000 000.00	975 962.83	0.02
USD NORTHWELL HEALTHCARE INC 3.39100% 17-01.11.27	8 000 000.00	7 400 568.08	0.13
USD OHIOHEALTH CORP 2.29700% 21-15.11.31	3 530 000.00	2 957 427.86	0.05
USD PACIFIC LIFE CORP-144A 6.60000% 03-15.09.33	4 500 000.00	4 991 670.76	0.09

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット・サステナブル

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD PEACEHEALTH OBLIGATED GROUP 1.37500% 20-15.11.25	6 455 000.00	5 865 875.51	0.10
USD PRINCIPAL LIFE GLOBAL FUNDING II-144A 0.75000% 21-12.04.24	1 565 000.00	1 486 850.57	0.03
USD ROCHESTER GAS & ELECTRIC CORP-144A 3.10000% 17-01.06.27	2 000 000.00	1 875 658.74	0.03
USD STANFORD HEALTH CARE 3.31000% 20-15.08.30	990 000.00	918 477.83	0.02
USD SUTTER HEALTH 3.69500% 18-15.08.28	2 015 000.00	1 904 289.47	0.03
USD SYDNEY AIRPORT FINANCE CO PTY LTD-144A 3.62500% 16-28.04.26	7 547 000.00	7 179 678.45	0.12
USD UNITED AIRLINES PASS THRU TRUST 4.30000% 13-15.08.25	4 000 000.00	2 296 498.29	0.04
USD US AIRWAYS 2012-1 CLASS A PAS THRO TRST 5.90000% 12-01.10.24	1 220 000.00	469 963.32	0.01
USD YALE UNIVERSITY 0.87300% 20-15.04.25	4 500 000.00	4 170 722.90	0.07
米ドル合計		68 098 606.00	1.18
債券、固定利付債合計		70 117 705.66	1.21
債券、変動利付債			
USD			
USD BPCE SA-144A 2.045%/VAR 21-19.10.27	1 815 000.00	1 605 977.14	0.03
USD HSBC HOLDINGS PLC-SUB 6.375%/VAR 15-PRP	224 000.00	221 088.00	0.00
USD METLIFE CAPITAL TRUST IV-144A-SUB 7.875%/VAR 07-15.12.37	1 510 000.00	1 660 996.99	0.03
米ドル合計		3 488 062.13	0.06
債券、変動利付債合計		3 488 062.13	0.06
地方債、固定利付債			
USD			
USD CAMPBELL UNION SCHOOL DISTRICT 5.40600% 11-01.08.27	3 470 000.00	3 565 573.17	0.06
USD CITY OF BALTIMORE MD 5.00000% 10-15.10.25	3 160 000.00	3 197 084.50	0.06
USD COUNTY OF MIAMI-DADE FL AVIATION REV 3.50400% 17-01.10.31	865 000.00	786 452.29	0.01
USD HOUSTON TEXAS WATER & SEWER SYSTEM 3.82800% 14-15.05.28	800 000.00	782 145.20	0.01
USD LOS ANGELES DEPARTMENT OF POWER 5.51600% 10-01.07.27	1 520 000.00	1 587 905.70	0.03
USD LOS ANGELES UNIFIED SCHOOL DISTRICT A-1 5.75000% 09-01.07.34	3 750 000.00	4 109 914.13	0.07
USD MASSACHUSETTS, STATE OF-SUB-S 2.96600% 19-15.10.32	850 000.00	749 668.72	0.01
USD NEW YORK CITY 2.80000% 19-01.08.30	1 325 000.00	1 179 483.47	0.02
USD NEW YORK CITY TRANS FINANCE AUTH REV 5.26700% 10-01.05.27	1 400 000.00	1 434 462.96	0.02
USD NEW YORK CITY TRANS FINANCE AUTH REV 5.76700% 09-01.08.36	1 075 000.00	1 144 569.16	0.02
USD NEW YORK CITY TRANS FIN AUTH REV-SUB 3.95000% 18-01.08.32	1 000 000.00	944 494.80	0.02
USD NEW YORK CITY TRANSITIONAL FIN AUTH-SUB 1.25000% 20-01.26	2 000 000.00	1 804 983.00	0.03
USD NEW YORK CITY TRANSITIONAL FINANCE 1.97000% 21-01.02.33	1 615 000.00	1 266 452.64	0.02
USD NEW YORK N Y, CITY OF 1.92300% 21-01.08.31	340 000.00	275 388.58	0.00
USD NEW YORK STATE DORMITORY AUTHORITY 5.50000% 10-15.03.30	4 755 000.00	4 957 336.67	0.09
USD NEW YORK STATE DORMITORY AUTHORITY 1.92500% 21-15.03.29	2 300 000.00	2 017 963.65	0.04
USD NEW YORK STATE URBAN DEVELOPMENT CORP 2.54000% 21-15.03.34	1 930 000.00	1 575 257.32	0.03
USD NEW YORK STATE URBAN DEV CORP 3.37000% 17-15.03.30	1 295 000.00	1 199 040.24	0.02
USD SANTA CLARA VALLEY TRANSPORTATION AUTH 5.87600% 10-01.04.32	2 205 000.00	2 324 903.49	0.04
USD UNIVERSITY OF CALIFORNIA 4.60100% 13-15.05.31	1 385 000.00	1 396 928.04	0.02
USD UNIVERSITY OF CALIFORNIA REVS 0.88300% 20-15.05.25	3 000 000.00	2 779 811.40	0.05
USD UNIVERSITY OF CALIFORNIA REVS 1.31600% 20-15.05.27	3 650 000.00	3 222 113.42	0.06
米ドル合計		42 301 932.55	0.73
地方債、固定利付債合計		42 301 932.55	0.73
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		1 289 231 124.94	22.29

添付の注記は当財務書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・サステナブル

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / 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			
パミューダ			
USD AIRCASTLE LIMITED 5.25%-FRN JNR PERP USD ' 144A	2 003 000.00	1 629 300.29	0.03
パミューダ合計		1 629 300.29	0.03
株式合計		1 629 300.29	0.03
財務省証券 (T-bill)、ゼロ・クーポン			
USD			
USD UNITED STATES TREASURY BILL 0.00000% 04.08.22-02.02.23	25 800 000.00	25 797 139.04	0.45
米ドル合計		25 797 139.04	0.45
財務省証券 (T-bill)、ゼロ・クーポン合計		25 797 139.04	0.45
アセット・バック証券、変動利付債			
EUR			
EUR HAYFIN EMERALD CLO 3M EURIBOR+169.5BP 22-15.04.35	6 500 000.00	7 069 808.10	0.12
ユーロ合計		7 069 808.10	0.12
アセット・バック証券、変動利付債合計		7 069 808.10	0.12
ノート、固定利付債			
USD			
USD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING-144A 4.82900% 23-03.02.25	4 120 000.00	4 124 068.09	0.07
USD BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUT-144A 3.75000% 18-20.07.23	2 730 000.00	2 714 169.08	0.05
USD BBVA USA 2.50000% 19-27.08.24	3 650 000.00	3 525 554.06	0.06
USD BMW US CAPITAL LLC-144A 3.90000% 20-09.04.25	9 890 000.00	9 745 066.50	0.17
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.00000% 17-01.02.28	1 190 000.00	1 111 162.50	0.02
USD CCO HOLDINGS LLC/CCO HOLDINGS CAP-144A 4.50000% 21-01.06.33	1 635 000.00	1 328 437.50	0.02
USD CDW LLC/CDW FINANCE CORP 4.12500% 20-01.05.25	2 195 000.00	2 124 167.35	0.04
USD CHARLES RIVER LABORATORIES INTL-144A 3.75000% 21-15.03.29	2 120 000.00	1 888 251.67	0.03
USD CHENIERE ENERGY INC 4.62500% 21-15.10.28	850 000.00	809 327.50	0.01
USD DELTA AIR LINES INC / SKYMILES LTD-144A 4.75000% 20-20.10.28	4 500 000.00	4 384 399.95	0.07
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-144A 2.25000% 21-12.07.31	1 310 000.00	1 022 204.04	0.02
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-144A 5.00000% 22-15.06.32	2 968 000.00	2 828 094.36	0.05
USD FMG RESOURCES AUGUST 2006 PTY LTD-144A 4.37500% 21-01.04.31	530 000.00	466 078.02	0.01
USD GFL ENVIRONMENTAL INC-144A 3.50000% 20-01.09.28	3 373 000.00	3 007 602.91	0.05
USD HEALTH CARE SER CORP A MUT LGL RES-144A 2.20000% 20-01.06.30	1 425 000.00	1 186 754.46	0.02
USD HEALTHCARE REALTY HOLDINGS LP 2.05000% 22-15.03.31	81 000.00	61 754.10	0.00
USD INGEVITY CORP-144A 3.87500% 20-01.11.28	1 211 000.00	1 061 427.38	0.02
USD MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD 5.00000% 22-15.10.27	1 983 000.00	2 001 275.49	0.03
USD MATTEL INC-144A 3.37500% 21-01.04.26	1 678 000.00	1 564 743.02	0.03
USD NORDSTROM INC 2.30000% 21-08.04.24	4 800 000.00	4 555 776.00	0.08
USD PILGRIM ' S PRIDE CORP-144A 3.50000% 21-01.03.32	6 510 000.00	5 304 999.00	0.09
USD VALVOLINE INC-144A 3.62500% 20-15.06.31	2 790 000.00	2 347 533.90	0.04
USD VAR ENERGI ASA-144A 5.00000% 22-18.05.27	3 330 000.00	3 194 615.85	0.06
米ドル合計		60 357 462.73	1.04
ノート、固定利付債合計		60 357 462.73	1.04

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・サステナブル

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
ノート、変動利付債			
USD			
USD CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 4.985%/VAR 22-24.07.26	2 395 000.00	2 373 763.53	0.04
米ドル合計		2 373 763.53	0.04
ノート、変動利付債合計		2 373 763.53	0.04
中期債券、固定利付債			
USD			
USD NATIONAL RURAL UTILITIES COOP FIN CORP 3.45000% 22-15.06.25	2 630 000.00	2 551 703.79	0.04
USD NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-144A 4.85000% 23-09.01.28	6 500 000.00	6 618 440.27	0.12
米ドル合計		9 170 144.06	0.16
中期債券、固定利付債合計		9 170 144.06	0.16
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	2 225 000.00	2 176 789.63	0.04
米ドル合計		2 176 789.63	0.04
中期債券、変動利付債合計		2 176 789.63	0.04
債券、固定利付債			
USD			
USD AMERICAN AIRLINES 2019-1 CLASS A 3.50000% 19-15.02.32	4 200 000.00	2 835 362.64	0.05
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-144A 5.05000% 22-07.12.27	4 900 000.00	4 999 813.15	0.09
USD PIEDMONT HEALTHCARE 2.04400% 21-01.01.32	1 605 000.00	1 288 092.86	0.02
米ドル合計		9 123 268.65	0.16
債券、固定利付債合計		9 123 268.65	0.16
地方債、固定利付債			
USD			
USD CALIFORNIA STATE UNIVERSITY 1.99400% 21-01.11.32	910 000.00	727 582.13	0.01
USD CALIFORNIA STATE UNIVERSITY 2.37400% 21-01.11.35	980 000.00	762 068.78	0.01
USD REGENTS OF THE UNIV OF CALIFOR MED CPR 4.13200% 22-15.05.32	1 090 000.00	1 065 959.83	0.02
USD UNIVERSITY OF CALIFORNIA 1.61400% 20-15.05.30	2 255 000.00	1 871 506.35	0.03
米ドル合計		4 427 117.09	0.07
地方債、固定利付債合計		4 427 117.09	0.07
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		122 124 793.12	2.11

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・サステナブル

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
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 ALCON FINANCE CORP-144A 5.37500% 22-06.12.32	6 508 000.00	6 810 271.99	0.12
USD BANK OF NEW ZEALAND-144A 4.84600% 23-07.02.28	4 225 000.00	4 245 393.23	0.07
USD BOSTON GAS CO-144A 3.75700% 22-16.03.32	3 700 000.00	3 382 610.37	0.06
USD BROADCOM INC-144A 4.15000% 22-15.04.32	1 448 000.00	1 321 062.00	0.02
USD BUILDERS FIRSTSOURCE INC-144A 6.37500% 22-15.06.32	1 531 000.00	1 498 896.34	0.03
USD COREBRIDGE FINANCIAL INC-144A 3.85000% 22-05.04.29	1 650 000.00	1 540 012.07	0.03
USD COREBRIDGE FINANCIAL INC-144A 3.90000% 22-05.04.32	3 420 000.00	3 115 069.07	0.05
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL N.V 144A 4.25000% 22-15.06.25	1 365 000.00	1 336 444.52	0.02
USD GE HEALTHCARE HOLDINGS LLC-144A 5.85700% 22-15.03.30	3 000 000.00	3 183 766.95	0.05
USD HARLEY-DAVIDSON FINANCIAL SERVICES-144A 3.05000% 22-14.02.27	5 657 000.00	5 195 271.02	0.09
USD MAGALLANES INC-144A 3.63800% 22-15.03.25	5 021 000.00	4 841 703.86	0.08
USD MAGALLANES INC-144A 3.75500% 22-15.03.27	5 000 000.00	4 686 085.00	0.08
USD MAGALLANES INC-144A 4.05400% 22-15.03.29	6 448 000.00	5 918 041.65	0.10
USD MAGALLANES INC-144A 4.27900% 22-15.03.32	10 985 000.00	9 776 153.82	0.17
USD MAGALLANES INC-144A 5.05000% 22-15.03.42	510 000.00	435 455.07	0.01
USD MAGALLANES INC-144A 5.14100% 22-15.03.52	730 000.00	606 309.18	0.01
USD ROGERS COMMUNI INC-144A 3.80000% 22-15.03.32	8 841 000.00	7 958 003.09	0.14
USD ROGERS COMMUNICATIONS INC-144A 3.20000% 22-15.03.27	3 475 000.00	3 268 067.74	0.06
USD S&P GLOBAL INC-144A 4.75000% 22-01.08.28	96 000.00	97 401.84	0.00
USD S&P GLOBAL INC-144A 4.25000% 22-01.05.29	483 000.00	475 199.42	0.01
USD VICI PROPERTIES LP /VCI NTE CO INC-144A 4.62500% 22-15.06.25	350 000.00	338 729.55	0.01
USD VICI PROPERTIES LP /VCI NTE CO INC-144A 5.75000% 22-01.02.27	30 000.00	29 842.50	0.00
米ドル合計		70 059 790.28	1.21
ノート、固定利付債合計		70 059 790.28	1.21
ノート、変動利付債			
USD			
USD BNP PARIBAS SA-144A 5.125%/VAR 23-13.01.29	5 275 000.00	5 318 989.23	0.10
USD DANSKE BANK A/S-144A 6.466%/VAR 23-09.01.26	712 000.00	722 906.67	0.01
USD KBC GROUP NV-144A 5.796%/VAR 23-19.01.29	733 000.00	743 816.63	0.01
米ドル合計		6 785 712.53	0.12
ノート、変動利付債合計		6 785 712.53	0.12
債券、変動利付債			
USD			
USD BPCE SA-144A 5.975%/VAR 23-18.01.27	3 006 000.00	3 044 124.41	0.05
米ドル合計		3 044 124.41	0.05
債券、変動利付債合計		3 044 124.41	0.05
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		79 889 627.22	1.38
投資有価証券合計		5 682 525 644.03	98.24

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット・サステナブル

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)				
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 08.03.23	-80.00	431 843.89	0.01			
EUR	EURO-BOBL FUTURE 08.03.23	-49.00	129 363.83	0.00			
USD	US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 22.03.23	-50.00	-289 734.44	-0.01			
USD	US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 22.03.23	769.00	1 632 789.09	0.03			
USD	US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 22.03.23	850.00	1 361 959.89	0.02			
USD	US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.23	467.00	367 043.54	0.01			
USD	US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.23	294.00	316 160.45	0.01			
USD	US LONG BOND FUTURE 22.03.23	-333.00	-1 111 362.58	-0.02			
債券に係る金融先物合計			2 838 063.67	0.05			
通貨に係る金融先物							
USD	EURO FX CURRENCY FUTURE 13.03.23	-138.00	-291 007.50	-0.01			
通貨に係る金融先物合計			-291 007.50	-0.01			
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計			2 547 056.17	0.04			
派生商品合計			2 547 056.17	0.04			
先渡為替契約							
購入通貨	購入額	売却通貨	売却額	満期日			
USD	8 666 451.41	EUR	8 158 609.00	2.2.2023		-194 205.89	0.00
CHF	1 521 658 641.41	USD	1 655 836 000.00	24.2.2023		4 311 427.08	0.07
JPY	1 904 775 345.00	USD	14 850 000.00	24.2.2023		-159 583.30	0.00
GBP	126 387 723.77	USD	154 578 000.00	24.2.2023		1 092 669.10	0.02
EUR	1 115 965 926.48	USD	1 210 765 000.00	24.2.2023		2 974 422.23	0.05
GBP	2 097 806.18	USD	2 600 000.00	24.2.2023		-16 150.22	0.00
CHF	39 165 045.00	USD	43 000 000.00	24.2.2023		-270 476.49	0.00
EUR	34 973 691.50	USD	38 000 000.00	24.2.2023		37 853.22	0.00
JPY	292 562 532.00	USD	2 280 000.00	24.2.2023		-23 636.53	0.00
USD	7 000 000.00	EUR	6 435 834.73	24.2.2023		300.33	0.00
USD	8 911 604.55	EUR	8 158 609.00	2.3.2023		34 874.79	0.00
EUR	8 158 609.00	USD	8 895 175.56	2.2.2023		-34 518.26	0.00
先渡為替契約合計						7 752 976.06	0.14
現金預金、要求払預金および預託金勘定ならびにその他の流動資産						82 731 617.10*	1.43
当座借越およびその他の短期負債						-1 381 781.28	-0.02
その他の資産および負債						10 139 371.72	0.17
純資産総額						5 784 314 883.80	100.00

*2023年1月31日現在、220,000.00米ドルの現金が取引相手方であるパークレイズ・ロンドン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 - ハイ・イールド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / 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			
イギリス			
USD NOBLE CORPORATION COM USD0.0001 CL A	13 052.00	531 085.88	0.02
イギリス合計		531 085.88	0.02
アメリカ合衆国			
USD BK OF AMERICA CORP 4.375% DP SH RP 1/1000TH IN	20 000.00	400 000.00	0.02
アメリカ合衆国合計		400 000.00	0.02
株式合計		931 085.88	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	360 617.13	0.02
EUR CRC BREEZE FINANCE SA 6.11000% 06-08.05.26	550 000.00	116 205.54	0.00
ユーロ合計		476 822.67	0.02
アセット・バック証券、固定利付債合計		476 822.67	0.02
ノート、固定利付債			
EUR			
EUR ACCOR SA-REG-S 2.37500% 21-29.11.28	700 000.00	665 762.12	0.03
EUR ADIENT GLOBAL HOLDINGS LTD-REG-S 3.50000% 16-15.08.24	2 664 000.00	2 814 136.10	0.13
EUR ADLER GROUP SA-REG-S 1.87500% 21-14.01.26	1 400 000.00	621 933.05	0.03
EUR ADLER GROUP SA-REG-S 2.25000% 21-14.01.29	2 300 000.00	945 460.83	0.04
EUR ADLER GROUP SA-REG-S 2.25000% 21-27.04.27	1 100 000.00	471 840.94	0.02
EUR ALTICE FINCO SA-REG-S 4.75000% 17-15.01.28	1 960 000.00	1 633 638.58	0.08
EUR ALTICE FRANCE HOLDING SA-REG-S 8.00000% 19-15.05.27	5 532 000.00	4 888 696.82	0.23
EUR ALTICE FRANCE SA/FRANCE-REG-S 4.25000% 21-15.10.29	600 000.00	501 755.10	0.02
EUR ALTICE FRANCE-REG-S 5.87500% 18-01.02.27	2 350 000.00	2 309 756.83	0.11
EUR AMS AG-REG-S 6.00000% 20-31.07.25	2 400 000.00	2 509 192.54	0.12
EUR APCOA PARKING HOLDINGS GMBH-REG-S 4.62500% 21-15.01.27	1 550 000.00	1 457 555.78	0.07
EUR ARD FINANCE SA-REG-S (PIK) 5.00000% 19-30.06.27	1 668 400.00	1 368 287.88	0.06
EUR ARDAGH METAL PACKAGING FINANCE -REG-S 3.00000% 21-01.09.29	6 525 000.00	5 502 436.23	0.26
EUR ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-REG-S 2.12500% 19-15.08.26	1 090 000.00	1 021 166.71	0.05
EUR ARENA LUXEMBOURG FINANCE SARL-REG-S 1.87500% 20-01.02.28	2 967 000.00	2 661 306.11	0.13
EUR ASHLAND SERVICES BV-REG-S 2.00000% 20-30.01.28	1 310 000.00	1 244 765.31	0.06
EUR AUTOSTRADA PER L'ITALIA SPA-REG-S 2.00000% 20-04.12.28	1 668 000.00	1 562 083.52	0.07
EUR AVANTOR FUNDING INC-REG-S 3.87500% 20-15.07.28	230 000.00	230 464.64	0.01
EUR BELDEN INC-REG-S 3.37500% 21-15.07.31	325 000.00	299 604.10	0.01
EUR BLITZ F18-674 GMBH-REG-S 6.00000% 18-30.07.26	1 375 000.00	1 250 296.26	0.06
EUR BOXER PARENT CO INC-REG-S 6.50000% 20-02.10.25	2 350 000.00	2 519 293.89	0.12
EUR BRITISH AIRWAYS PLC-REG-S 2.75000% 21-25.03.25	2 600 000.00	2 641 549.53	0.12
EUR CANPACK SA AND EASTERN PA-REG-S 2.37500% 20-01.11.27	933 000.00	843 559.48	0.04
EUR CASINO GUICHARD PERRACHON SA-REG-S 6.62500% 20-15.01.26	1 005 000.00	668 531.66	0.03
EUR CATALENT PHARMA SOLUTIONS INC-REG-S 2.37500% 20-01.03.28	4 835 000.00	4 345 245.33	0.20
EUR CECOMY AG-REG-S 1.75000% 21-24.06.26	1 000 000.00	739 165.63	0.02
EUR CELLNEX TELECOM SA 1.87500% 20-26.06.29	3 700 000.00	3 397 745.43	0.16
EUR CHROME HOLDCO REG-S-SUB 5.00000% 21-31.05.29	1 211 000.00	1 016 983.47	0.05
EUR CMA CGM SA-REG-S 7.50000% 20-15.01.26	1 400 000.00	1 577 791.72	0.07
EUR CONSOLIDATED ENERGY FINANCE SA-REG-S 5.00000% 21-15.10.28	3 000 000.00	2 886 525.41	0.14
EUR CONSTELLUM SE-REG-S 4.25000% 17-15.02.26	1 500 000.00	1 587 615.04	0.06
EUR CONSTELLUM SE-REG-S 3.12500% 21-15.07.29	1 750 000.00	1 567 984.69	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

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / 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 2.87500% 18-01.02.26	500 000.00	518 453.12	0.02
EUR DANA FINANCING LUXEMBOURG SARL-REG-S 3.00000% 21-15.07.29	875 000.00	769 167.76	0.04
EUR DEMIRE DUTCH MITSTND REL EST AG-REG-S 1.87500% 19-15.10.24	1 800 000.00	1 431 174.97	0.07
EUR DKT FINANCE APS-REG-S 7.00000% 18-17.06.23	4 725 000.00	5 129 738.89	0.24
EUR DOUGLAS GMBH-REG-S 6.00000% 21-08.04.26	3 075 000.00	2 881 243.13	0.14
EUR DOVALUE SPA-REG-S 5.00000% 20-04.08.25	1 500 000.00	1 600 272.95	0.08
EUR DUFFRY ONE BV-REG-S 2.00000% 19-15.02.27	3 900 000.00	3 621 433.73	0.17
EUR EDREAMS ODIGEO SA-REG-S 5.50000% 22-15.07.27	1 100 000.00	1 021 728.69	0.05
EUR EG GLOBAL FINANCE PLC-REG-S 4.37500% 19-07.02.25	1 840 000.00	1 773 519.65	0.08
EUR ELIOR GROUP SA-REG-S 3.75000% 21-15.07.26	1 750 000.00	1 583 835.59	0.07
EUR FAURECIA SE-REG-S 3.75000% 20-15.06.28	1 516 000.00	1 451 182.62	0.07
EUR FAURECIA-REG-S 2.75000% 21-15.02.27	4 000 000.00	3 845 485.84	0.18
EUR FLAMINGO LUX II SCA-REG-S 5.00000% 21-31.03.29	2 598 000.00	2 266 444.59	0.11
EUR GARFUNKELUX HOLDCO 3 SA-REG-S 6.75000% 20-01.11.25	330 000.00	272 381.34	0.01
EUR GRIFOLS ESCROW ISSUER SA-REG-S 3.87500% 21-15.10.28	9 596 000.00	8 827 960.60	0.42
EUR GRIFOLS SA-REG-S 1.62500% 19-15.02.25	1 050 000.00	1 071 874.34	0.05
EUR IHO VERWALTUNGS GMBH-REG-S (PIK) 3.62500% 19-15.05.25	1 000 000.00	1 021 386.58	0.05
EUR IHO VERWALTUNGS GMBH-REG-S (PIK) 3.87500% 19-15.05.27	3 325 000.00	3 168 754.51	0.15
EUR ILIAD HOLDING SASU-REG-S 5.12500% 21-15.10.26	1 832 000.00	1 893 066.29	0.09
EUR ILIAD HOLDING SASU-REG-S 5.62500% 21-15.10.28	1 250 000.00	1 262 533.13	0.06
EUR ILIAD SA-REG-S 0.75000% 21-11.02.24	4 400 000.00	4 611 368.30	0.22
EUR ILIAD SA-REG-S 2.37500% 20-17.06.26	1 000 000.00	993 735.75	0.05
EUR INTERMEDIATE CAPITAL GROUP-REG-S 2.50000% 22-28.01.30	889 000.00	688 303.84	0.03
EUR INTERNATIONAL DESIGN GROUP SPA-REG-S 6.50000% 18-15.11.25	3 450 000.00	3 459 862.06	0.16
EUR INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC-REG-S 3.50000% 19-15.06.26	280 000.00	286 988.71	0.01
EUR INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC-REG-S 2.37500% 19-15.04.28	1 000 000.00	939 433.25	0.04
EUR INTL CONSOLIDATED AIRLINES GP-REG-S 3.75000% 21-25.03.29	2 100 000.00	1 910 090.43	0.09
EUR INTRUM AB-REG-S 3.00000% 19-15.09.27	582 000.00	526 207.52	0.02
EUR INTRUM AB-REG-S 4.87500% 20-15.08.25	1 500 000.00	1 529 294.16	0.07
EUR INTRUM AB-REG-S 9.25000% 22-15.03.28	520 000.00	581 688.38	0.03
EUR IQVIA INC-REG-S 2.25000% 19-15.01.28	3 275 000.00	3 090 337.63	0.15
EUR IQVIA INC-REG-S 2.87500% 20-15.06.28	3 235 000.00	3 126 416.01	0.15
EUR JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-REG-S 4.50000% 18-15.01.26	700 000.00	699 993.98	0.03
EUR JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-REG-S 6.87500% 19-15.11.26	150 000.00	154 775.16	0.01
EUR JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-REG-S 5.87500% 19-15.11.24	1 110 000.00	1 199 333.61	0.06
EUR JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-REG-S 4.50000% 21-15.07.28	1 230 000.00	1 081 291.55	0.05
EUR JAMES HARDIE INTERNATIONAL LTD-REG-S 3.62500% 18-01.10.26	1 000 000.00	1 023 623.84	0.05
EUR KAIXO BONDCO TELECOM SA-REG-S 5.12500% 21-30.09.29	1 075 000.00	1 006 037.98	0.05
EUR KLEOPATRA HOLDINGS 2 SCA-REG-S-SUB 6.50000% 21-01.09.26	1 925 000.00	1 184 351.11	0.06
EUR KRONOS INTERNATIONAL INC-REG-S 3.75000% 17-15.09.25	1 500 000.00	1 466 506.35	0.07
EUR LA FINANCIERE ATALIAN SA-REG-S 5.12500% 18-15.05.25	2 925 000.00	2 122 033.10	0.10
EUR LABORATOIRE EIMER SELARL-REG-S 5.00000% 21-01.02.29	725 000.00	604 192.97	0.03
EUR LHMC FINCO SARL-REG-S 6.25000% 18-20.12.23	2 250 000.00	586 761.14	0.03
EUR LOTTOMATICA SPA/ROMA-REG-S 5.12500% 21-15.07.25	1 090 000.00	1 143 734.89	0.05
EUR LOXAM SAS-REG-S 4.50000% 22-15.02.27	655 000.00	673 101.39	0.03
EUR LOXAM SAS-REG-S-SUB 5.75000% 19-15.07.27	625 000.00	609 226.54	0.03
EUR LUNE HOLDINGS SARL-REG-S 5.62500% 21-15.11.28	1 000 000.00	920 427.37	0.04
EUR MATTERHORN TELECOM SA-REG-S 4.00000% 17-15.11.27	1 250 000.00	1 250 654.46	0.06
EUR MAXEDA DIY HOLDING BV-REG-S 5.87500% 20-01.10.26	1 450 000.00	1 209 598.50	0.06
EUR MONITCHEM HOLDCO 2 SA-REG-S-SUB 9.50000% 19-15.09.26	750 000.00	771 774.28	0.04
EUR MONITCHEM HOLDCO 3 SA-REG-S 5.25000% 19-15.03.25	1 825 000.00	1 921 577.10	0.09
EUR MOTION BONDCO DAC-REG-S 4.50000% 19-15.11.27	450 000.00	425 970.53	0.02
EUR MYTILINEOS FINANCIAL PARTNERS SA-REG-S 2.50000% 19-01.12.24	300 000.00	319 543.06	0.02
EUR NEMAK SAB DE CV-REG-S 2.25000% 21-20.07.28	700 000.00	620 921.93	0.03
EUR NETFLIX INC-REG-S 3.87500% 19-15.11.29	800 000.00	848 074.73	0.04
EUR NIDDA HEALTHCARE HOLDING GMBH-REG-S 7.50000% 22-21.08.26	4 451 000.00	4 707 840.92	0.22
EUR NITROGENMUVEK RT-REG-S 7.00000% 18-14.05.25	700 000.00	570 651.40	0.03
EUR OLYMPUS WATER US HOLDING CORP-REG-S 3.87500% 21-01.10.28	1 500 000.00	1 394 803.22	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

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR ONTEX GROUP N.V-REG-S 3.50000% 21-15.07.26	3 400 000.00	3 230 481.79	0.15
EUR ORGANON FINANCE 1 LLC-REG-S 2.87500% 21-30.04.28	3 154 000.00	2 984 552.50	0.14
EUR PICARD BONDCO SA-REG-S 5.37500% 21-01.07.27	1 125 000.00	1 042 005.24	0.05
EUR PLAYTECH PLC-REG-S 3.75000% 18-12.10.23	3 250 000.00	1 321 958.50	0.06
EUR PLAYTECH PLC-REG-S 4.25000% 19-07.03.26	725 000.00	755 890.80	0.04
EUR PREEM HOLDINGS AB-REG-S 12.00000% 22-30.06.27	600 000.00	685 084.68	0.03
EUR PROGROUP AG-REG-S 3.00000% 18-31.03.26	1 725 000.00	1 749 358.57	0.08
EUR REXEL SA-REG-S 2.12500% 21-15.12.28	500 000.00	465 573.34	0.02
EUR SAZKA GROUP AS-REG-S 4.12500% 19-20.11.24	1 000 000.00	1 074 233.78	0.05
EUR SECHE ENVIRONNEMENT SA-REG-S 2.25000% 04.11.21-28	1 300 000.00	1 212 170.81	0.06
EUR SELECTA GROUP BV-REG-S (PAY IN KIND) 8.00000% 20-01.04.26	2 435 275.00	2 275 876.57	0.11
EUR SIG PLC-REG-S 5.25000% 21-30.11.26	500 000.00	495 640.64	0.02
EUR SILGAN HOLDINGS INC 2.25000% 20-01.06.28	4 246 000.00	3 967 990.18	0.19
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 5.00000% 18-15.04.28	500 000.00	493 842.46	0.02
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 2.12500% 21-06.07.24	2 000 000.00	2 060 779.87	0.10
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 2.87500% 21-06.01.27	1 300 000.00	1 231 852.21	0.06
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 3.37500% 21-06.07.29	943 000.00	825 850.16	0.04
EUR STANDARD INDUSTRIES INC/NJ-REG-S 2.25000% 19-21.11.26	4 142 000.00	3 887 308.87	0.18
EUR SYNTHOMER PLC-REG-S 3.87500% 20-01.07.25	950 000.00	980 160.12	0.05
EUR TELE COLUMBUS AG-REG-S 3.87500% 18-02.05.25	700 000.00	607 823.08	0.03
EUR TELECOM ITALIA SPA/MILANO-REG-S 6.87500% 23-15.02.28	1 260 000.00	1 368 423.00	0.06
EUR TELENET FINANCE LUXEMBOURG-REG-S 3.50000% 17-01.03.28	1 000 000.00	979 108.83	0.05
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 4.50000% 18-01.03.25	450 000.00	477 817.88	0.02
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FIN 6.00000% 20-31.01.25	690 000.00	753 964.42	0.04
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 3.75000% 21-09.05.27	2 500 000.00	2 445 818.54	0.12
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 4.37500% 21-09.05.30	11 841 000.00	11 049 884.58	0.52
EUR TI AUTOMOTIVE FINANCE PLC-REG-S 3.75000% 21-15.04.29	3 394 000.00	2 838 261.36	0.13
EUR TITAN HOLDINGS II BV-REG-S 5.12500% 21-15.07.29	3 970 000.00	3 492 410.99	0.16
EUR TUI CRUISES GMBH-REG-S 6.50000% 21-15.05.26	1 550 000.00	1 514 945.47	0.07
EUR UGI INTERNATIONAL LLC-REG-S 2.50000% 21-01.12.29	1 500 000.00	1 321 349.25	0.06
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 4.87500% 17-01.07.24	375 000.00	393 046.92	0.02
EUR VERALLIA SA-REG-S 1.62500% 21-14.05.28	400 000.00	380 312.99	0.02
EUR VERALLIA SA-REG-S 1.87500% 21-10.11.31	2 000 000.00	1 736 159.53	0.08
EUR VERISURE HOLDING AB-REG-S 7.12500% 23-01.02.28	4 415 000.00	4 801 096.19	0.23
EUR VERISURE MIDHOLDING AB-REG-S 5.25000% 21-15.02.29	6 525 000.00	5 850 297.15	0.28
EUR VERTICAL HOLDCO GMBH-REG-S 6.62500% 20-15.07.28	2 659 000.00	2 291 769.37	0.11
EUR VIRGIN MEDIA FINANCE PLC-REG-S 3.75000% 20-15.07.30	3 200 000.00	2 790 032.91	0.13
EUR VIRIDIAN GROUP FIN/ POWER & ENER-REG-S 4.00000% 17-15.09.25	500 000.00	532 571.76	0.03
EUR VOLVO CAR REG-S 4.25000% 22-31.05.28	1 245 000.00	1 273 708.58	0.06
EUR WEBUILD SPA-REG-S 3.87500% 22-28.07.26	1 900 000.00	1 790 003.50	0.08
EUR WEBUILD SPA-REG-S 5.87500% 20-15.12.25	1 000 000.00	1 028 621.84	0.05
EUR WMG ACQUISITION CORP-REG-S 2.25000% 21-15.08.31	2 032 000.00	1 721 906.35	0.08
EUR WP/AP TELECOM HOLDINGS III BV-REG-S 5.50000% 21-15.01.30	8 242 000.00	7 479 374.31	0.35
EUR ZF EUROPE FINANCE BV-REG-S 3.00000% 19-23.10.29	1 900 000.00	1 694 748.44	0.08
EUR ZIGGO BOND CO BV-REG-S 3.37500% 20-28.02.30	1 769 000.00	1 483 621.76	0.07
ユーロ合計		246 261 986.29	11.59
GBP			
GBP AA BOND CO LTD-REG-S 6.50000% 21-31.01.26	340 000.00	349 392.93	0.01
GBP ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-REG-S 4.75000% 17-15.07.27	450 000.00	432 151.62	0.02
GBP B&M EUROPEAN VALUE RETAIL SA-REG-S 3.62500% 20-15.07.25	500 000.00	586 311.37	0.03
GBP CONSTELLATION AUTOMOTIVE FINANCI-REG-S 4.87500% 21-15.07.27	1 225 000.00	1 054 914.20	0.05
GBP INSPIRED ENTERTAINMENT FINANCING-REG-S 7.87500% 21-01.06.26	500 000.00	574 462.04	0.03
GBP MPT OPERATING PARTNERSHIP LP/FIN CORP 3.69200% 19-05.06.28	450 000.00	396 028.86	0.02
GBP MPT OPERATING PARTNERSHIP LP/FIN CORP 2.50000% 21-24.03.26	600 000.00	583 541.40	0.03
GBP OCADO GROUP PLC-REG-S 3.87500% 21-08.10.26	500 000.00	481 052.32	0.02
GBP PINNACLE BIDCO PLC-REG-S 6.37500% 18-15.02.25	1 325 000.00	1 480 320.80	0.07
GBP TALKTALK TELECOM GROUP PLC-REG-S 3.87500% 20-20.02.25	1 125 000.00	1 142 614.69	0.05

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
GBP VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC-REG-S 5.25000% 19-15.05.29	575 000.00	617 684.11	0.03
GBP VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC-REG-S 4.25000% 19-15.01.30	1 000 000.00	995 344.35	0.05
GBP VIRIDIAN GROUP FIN/ POWER & ENER-REG-S 4.75000% 17-15.09.24	1 575 000.00	1 866 076.75	0.09
英債券合計		10 559 895.44	0.50
USD			
USD AECOM TECHNOLOGY CORP 5.12500% 17-15.03.27	656 000.00	644 585.60	0.03
USD ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC 4.87500% 21-01.10.29	4 298 000.00	3 933 228.74	0.18
USD ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC 5.12500% 21-01.10.31	1 195 000.00	1 085 956.25	0.05
USD ALTICE FINANCING SA-144A 5.00000% 20-15.01.28	2 982 000.00	2 535 564.78	0.12
USD ALTICE FRANCE SA/FRANCE-144A 5.50000% 19-15.01.28	1 840 000.00	1 528 156.80	0.07
USD ALTICE FRANCE SA/FRANCE-144A 5.50000% 21-15.10.29	1 762 000.00	1 393 205.90	0.07
USD ALTICE FRANCE-144A 8.12500% 18-01.02.27	1 253 000.00	1 174 612.32	0.06
USD AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC-144A 7.50000% 22-15.02.29	1 497 000.00	869 682.15	0.04
USD AMERICAN AXLE & MANUFACTURING INC 6.25000% 18-15.03.26	766 000.00	718 017.89	0.03
USD AMERIGAS PARTNERS LP/FINANCE CORP 5.75000% 17-20.05.27	900 000.00	848 268.00	0.04
USD APACHE CORP 4.37500% 18-15.10.28	276 000.00	255 216.61	0.01
USD APACHE CORP 4.75000% 12-15.04.43	1 157 000.00	915 915.91	0.04
USD APACHE CORP 5.35000% 19-01.07.49	1 140 000.00	943 121.76	0.04
USD ARCONIC INC 5.95000% 07-01.02.37	1 450 000.00	1 463 630.00	0.07
USD ARD FINANCE SA-144A (PIK) 6.50000% 19-30.06.27	2 978 000.00	2 336 062.32	0.11
USD ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-144A 4.12500% 19-15.08.26	1 460 000.00	1 332 250.00	0.06
USD ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-144A 5.25000% 19-15.08.27	1 816 000.00	1 487 095.16	0.07
USD BALL CORP 2.87500% 20-15.08.30	1 302 000.00	1 067 372.78	0.05
USD BALL CORP 5.25000% 15-01.07.25	312 000.00	310 474.32	0.01
USD BALL CORP 6.87500% 22-15.03.28	2 254 000.00	2 324 662.90	0.11
USD BANCO SANTANDER SA-SUB 2.74900% 20-03.12.30	600 000.00	483 784.78	0.02
USD BANIJAY ENTERTAINMENT SASU-144A 5.37500% 20-01.03.25	1 261 000.00	1 216 865.00	0.06
USD BOMBARDIER INC-144A 7.12500% 21-15.06.26	1 700 000.00	1 695 937.00	0.08
USD BOMBARDIER INC-144A 6.00000% 21-15.02.28	2 250 000.00	2 133 862.63	0.10
USD BRUNDAGE-BONE CON HOLD INC-144A 6.00000% 21-01.02.26	1 491 000.00	1 421 057.19	0.07
USD BUCKEYE PARTNERS LP 3.95000% 16-01.12.26	860 000.00	787 106.40	0.04
USD CALPINE CORP-144A 3.75000% 20-01.03.31	465 000.00	387 650.87	0.02
USD CARNIVAL CORP-144A 10.50000% 22-01.06.30	1 080 000.00	1 027 544.40	0.05
USD CARNIVAL CORP-144A 5.75000% 21-01.03.27	4 156 000.00	3 411 660.40	0.16
USD CARNIVAL CORP-144A 7.62500% 20-01.03.26	2 925 000.00	2 626 825.50	0.12
USD CATALENT PHARMA SOLUTIONS INC-144A 3.50000% 21-01.04.30	2 772 000.00	2 290 365.00	0.11
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 7.37500% 23-03.03.31	412 000.00	413 030.00	0.02
USD CENTENE CORP 2.50000% 21-01.03.31	800 000.00	654 017.65	0.03
USD CENTRAL GARDEN & PET CO 4.12500% 20-15.10.30	1 463 000.00	1 243 988.90	0.06
USD CHEPLAPHARM ARZNEIMITTEL GMBH-144A 5.50000% 20-15.01.28	3 033 000.00	2 707 134.48	0.13
USD CIMPRESS PLC-144A 7.00000% 18-15.06.26	1 446 000.00	1 003 949.34	0.05
USD CLEVELAND-CLIFFS INC 6.25000% 10-01.10.40	766 000.00	690 089.41	0.03
USD COMMERCIAL METALS CO 3.87500% 21-15.02.31	2 659 000.00	2 301 543.37	0.11
USD COMMERCIAL METALS CO 4.37500% 22-15.03.32	2 030 000.00	1 780 796.04	0.08
USD CONSOLIDATED ENERGY FINANCE SA-144A 5.62500% 21-15.10.28	1 537 000.00	1 337 190.00	0.06
USD CONTINENTAL RESOURCES INC 4.37500% 18-15.01.28	580 000.00	551 854.35	0.03
USD COVANTA HOLDING CORP 5.00000% 20-01.09.30	1 324 000.00	1 126 472.02	0.05
USD CROWDSTRIKE HOLDINGS INC 3.00000% 21-15.02.29	473 000.00	405 871.55	0.02
USD DANA INC 4.25000% 21-01.09.30	590 000.00	499 319.43	0.02
USD DANA INC 5.37500% 19-15.11.27	445 000.00	422 845.69	0.02
USD DPL INC 4.12500% 21-01.07.25	2 000 000.00	1 904 225.78	0.09
USD ENCOMPASS HEALTH CORP 4.50000% 19-01.02.28	1 610 000.00	1 502 854.50	0.07
USD ENCOMPASS HEALTH CORP 4.75000% 19-01.02.30	1 900 000.00	1 741 654.00	0.08
USD ENCOMPASS HEALTH CORP 4.62500% 20-01.04.31	250 000.00	220 048.81	0.01
USD ENLINK MIDSTREAM LLC 5.37500% 19-01.06.29	650 000.00	626 473.25	0.03
USD ENLINK MIDSTREAM PARTNERS LP 5.60000% 14-01.04.44	640 000.00	536 057.60	0.03
USD ENLINK MIDSTREAM PARTNERS LP 5.05000% 14-01.04.45	1 950 000.00	1 532 987.16	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

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD ENLINK MIDSTREAM PARTNERS LP 5.45000% 17-01.06.47	1 475 000.00	1 226 964.98	0.06
USD FORD MOTOR CO 4.75000% 13-15.01.43	717 000.00	559 699.59	0.03
USD FORD MOTOR CREDIT CO 4.12500% 20-17.08.27	970 000.00	894 611.60	0.04
USD FORD MOTOR CREDIT CO 4.00000% 20-13.11.30	6 951 000.00	6 069 196.14	0.29
USD FORD MOTOR CREDIT CO 2.90000% 21-16.02.28	280 000.00	240 826.80	0.01
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.62500% 21-17.06.31	578 000.00	480 757.88	0.02
USD FORD MOTOR CREDIT CO 4.95000% 22-28.05.27	2 540 000.00	2 423 840.04	0.11
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 7.35000% 23-06.03.30	1 713 000.00	1 797 964.80	0.08
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.81500% 17-02.11.27	1 438 000.00	1 297 795.00	0.06
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 5.11300% 19-03.05.29	3 325 000.00	3 151 127.44	0.15
USD GEMS MENASA CAYMAN LTD/GEDL-144A 7.12500% 19-31.07.26	1 004 000.00	987 559.50	0.05
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 2.35000% 21-08.01.31	700 000.00	559 231.34	0.03
USD GENESIS ENERGY LP 6.50000% 17-01.10.25	1 120 000.00	1 100 400.00	0.05
USD GENESIS ENERGY LP 6.25000% 17-15.05.26	162 000.00	154 810.57	0.01
USD GENESIS ENERGY LP 7.75000% 20-01.02.28	2 949 000.00	2 849 854.62	0.13
USD GENESIS ENERGY LP 8.00000% 20-15.01.27	2 516 000.00	2 483 795.20	0.12
USD GLOBAL PARTNERS LP 7.00000% 20-01.08.27	435 000.00	417 655.38	0.02
USD GOODYEAR TIRE & RUBBER CO 9.50000% 20-31.05.25	2 000.00	2 064.35	0.00
USD GOODYEAR TIRE & RUBBER CO 5.00000% 22-15.07.29	556 000.00	489 797.08	0.02
USD GRIFOLS ESCROW ISSUER SA-144A 4.75000% 21-15.10.28	2 581 000.00	2 244 489.22	0.11
USD HB FULLER CO 4.25000% 20-15.10.28	290 000.00	256 650.00	0.01
USD HCA INC 3.50000% 20-01.09.30	616 000.00	552 137.98	0.03
USD HCA INC 5.37500% 18-01.09.26	756 000.00	760 452.85	0.04
USD HCA INC 5.62500% 18-01.09.28	870 000.00	885 401.35	0.04
USD HERENS HOLDCO SARL-144A 4.75000% 21-15.05.28	1 661 000.00	1 351 940.82	0.06
USD HILLENBRAND INC 3.75000% 21-01.03.31	951 000.00	798 840.00	0.04
USD HOWMET AEROSPACE INC 3.00000% 21-15.01.29	2 020 000.00	1 762 450.00	0.08
USD ICAHN ENTERPRISES FINANCE CORP 5.25000% 20-15.05.27	1 950 000.00	1 815 635.13	0.09
USD IHEARTCOMMUNICATIONS INC-144A 4.75000% 19-15.01.28	601 000.00	513 886.55	0.02
USD IHO VERWALTUNGS GMBH-144A (PIK) 6.37500% 19-15.05.29	573 000.00	501 345.91	0.02
USD JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-144A 7.75000% 20-15.10.25	1 000 000.00	985 000.00	0.05
USD JAMES HARDIE INTERNATIONAL FIN LTD-144A 5.00000% 17-15.01.28	578 000.00	548 797.53	0.03
USD L BRANDS INC 6.75000% 16-01.07.36	1 550 000.00	1 401 866.50	0.07
USD L BRANDS INC 6.87500% 15-01.11.35	780 000.00	710 862.77	0.03
USD LAS VEGAS SANDS CORP 3.90000% 19-08.08.29	3 887 000.00	3 483 277.95	0.16
USD LAS VEGAS SANDS CORP 3.20000% 19-08.08.24	905 000.00	870 955.18	0.04
USD MACYS RETAIL HOLDINGS INC 4.50000% 14-15.12.34	750 000.00	550 725.00	0.03
USD METHANEX CORP 5.12500% 20-15.10.27	1 212 000.00	1 154 430.00	0.05
USD METHANEX CORP 5.25000% 19-15.12.29	850 000.00	781 583.50	0.04
USD MGIC INVESTMENT CORP 5.25000% 20-15.08.28	2 550 000.00	2 403 885.00	0.11
USD MGM RESORTS INTL 5.50000% 19-15.04.27	565 000.00	544 838.65	0.03
USD MGM RESORTS INTL 5.75000% 18-15.06.25	368 000.00	363 353.37	0.02
USD MICRON TECHNOLOGY INC 2.70300% 21-15.04.32	685 000.00	546 675.42	0.03
USD MOTION BONDCO DAC-144A 6.62500% 19-15.11.27	200 000.00	180 996.15	0.01
USD MPT OPERATING PARTNERSHIP LP/FIN CORP 5.00000% 17-15.10.27	600 000.00	507 201.00	0.02
USD MPT OPERATING PARTNERSHIP LP/FIN CORP 4.62500% 19-01.08.29	1 705 000.00	1 325 637.50	0.06
USD MURPHY OIL CORP 6.37500% 21-15.07.28	410 000.00	405 476.78	0.02
USD MURPHY OIL USA INC 4.75000% 19-15.09.29	909 000.00	832 871.25	0.04
USD NAVIENT CORP 4.87500% 21-15.03.28	2 155 000.00	1 904 395.05	0.09
USD NAVIENT CORP 5.00000% 20-15.03.27	1 225 000.00	1 117 913.44	0.05
USD NAVIENT CORP 5.50000% 21-15.03.29	564 000.00	499 140.00	0.02
USD NEWELL BRANDS INC 4.20000% 16-01.04.26	393 000.00	373 365.72	0.02
USD NEWELL BRANDS INC 5.50000% 16-01.04.46	240 000.00	199 485.60	0.01
USD NGL ENRGY PARTNRS LP/ FINANCE CORP 6.12500% 17-01.03.25	1 101 000.00	977 137.50	0.05
USD NRG ENERGY INC 5.75000% 18-15.01.28	1 272 000.00	1 218 951.24	0.06
USD NUSTAR LOGISTICS LP 5.62500% 17-28.04.27	2 095 000.00	2 010 734.05	0.09
USD NUSTAR LOGISTICS LP 5.75000% 20-01.10.25	3 045 000.00	3 013 057.95	0.14
USD NUSTAR LOGISTICS LP 6.37500% 20-01.10.30	2 371 000.00	2 283 865.75	0.11

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 4.40000% 16-15.04.46	3 116 000.00	2 553 172.50	0.12
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 8.50000% 20-15.07.27	334 000.00	369 487.50	0.02
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 8.87500% 20-15.07.30	558 000.00	657 045.00	0.03
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 6.62500% 20-01.09.30	2 524 000.00	2 679 598.29	0.13
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 6.12500% 20-01.01.31	740 000.00	772 330.60	0.04
USD OCEANEERING INTERNATIONAL INC 6.00000% 18-01.02.28	1 310 000.00	1 252 756.93	0.06
USD OLIN CORP 5.62500% 19-01.08.29	1 404 000.00	1 366 283.93	0.06
USD ONEMAIN FINANCE CORP 3.50000% 21-15.01.27	1 631 000.00	1 418 507.03	0.07
USD ONEMAIN FINANCE CORP 3.87500% 21-15.09.28	195 000.00	163 800.00	0.01
USD ORACLE CORP 3.60000% 20-01.04.40	725 000.00	574 441.90	0.03
USD PBF HOLDING CO LLC/FIN CORP 6.00000% 20-15.02.28	1 850 000.00	1 744 254.00	0.08
USD PENSKE AUTOMOTIVE GROUP INC-SUB 3.75000% 21-15.06.29	943 000.00	797 430.19	0.04
USD PERRIGO FINANCE UNLIMITED CO 3.15000% 20-15.06.30	1 032 000.00	905 703.84	0.04
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.70000% 22-16.02.32	677 000.00	560 217.50	0.03
USD PETROLEOS MEXICANOS 5.35000% 18-12.02.28	2 950 000.00	2 566 500.00	0.12
USD PITNEY BOWES INC-144A 7.25000% 21-15.03.29	600 000.00	472 500.00	0.02
USD PRIMO WATER HOLDINGS INC-144A 4.37500% 21-30.04.29	4 132 000.00	3 604 095.68	0.17
USD RAKUTEN GROUP INC-REG-S 10.25000% 22-30.11.24	570 000.00	577 108.70	0.03
USD ROLLS-ROYCE PLC-144A 5.75000% 20-15.10.27	3 592 000.00	3 493 220.00	0.16
USD ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD 7.50000% 97-15.10.27	800 000.00	743 088.00	0.03
USD ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD-144A 5.50000% 21-01.04.28	2 995 000.00	2 575 700.00	0.12
USD SEAGATE HDD CAYMAN-144A 9.62500% 22-01.12.32	350 370.00	396 737.96	0.02
USD SERVICE CORP 3.37500% 20-15.08.30	3 020 000.00	2 537 826.80	0.12
USD SERVICE CORP INTERNATIONAL/US 4.00000% 21-15.05.31	849 000.00	742 433.52	0.03
USD SERVICE PROPERTIES TRUST 5.25000% 16-15.02.26	2 500 000.00	2 164 625.42	0.10
USD SERVICE PROPERTIES TRUST 4.95000% 17-15.02.27	800 000.00	654 479.77	0.03
USD SERVICE PROPERTIES TRUST 4.75000% 19-01.10.26	3 600 000.00	2 972 628.00	0.14
USD SIGMA HOLDCO BV-144A 7.87500% 18-15.05.26	2 959 000.00	2 278 430.00	0.11
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 3.87500% 21-01.09.31	5 115 000.00	4 216 703.68	0.20
USD SM ENERGY CO 6.50000% 21-15.07.28	165 000.00	156 951.22	0.01
USD SOUTHWESTERN ENERGY CO 7.75000% 17-01.10.27	355 000.00	370 222.40	0.02
USD SOUTHWESTERN ENERGY CO 5.37500% 21-15.03.30	2 230 000.00	2 076 687.50	0.10
USD SOUTHWESTERN ENERGY CO 4.75000% 21-01.02.32	1 413 000.00	1 245 587.76	0.06
USD SPCM SA-144A 3.37500% 21-15.03.30	740 000.00	626 410.00	0.03
USD SPIRIT AEROSYSTEMS INC 4.60000% 18-15.06.28	1 315 000.00	1 105 274.19	0.05
USD SPRINGLEAF FINANCE CORP 6.62500% 19-15.01.28	490 000.00	477 392.30	0.02
USD SPRINGLEAF FINANCE CORP 5.37500% 19-15.11.29	815 000.00	713 614.00	0.03
USD SPRINT CORP 7.62500% 18-01.03.26	1 242 000.00	1 313 621.80	0.06
USD SYMANTEC CORP-144A 5.00000% 17-15.04.25	2 282 000.00	2 236 360.00	0.11
USD T-MOBILE USA INC 3.37500% 21-15.04.29	976 000.00	889 556.56	0.04
USD TELECOM ITALIA CAPITAL 6.37500% 04-15.11.33	200 000.00	170 046.00	0.01
USD TELECOM ITALIA CAPITAL 7.20000% 06-18.07.36	1 282 000.00	1 089 110.28	0.05
USD TELECOM ITALIA CAPITAL 7.72100% 08-06.04.38	371 000.00	319 942.98	0.02
USD TELENET FINANCE LUXEMBOURG-144A 5.50000% 17-01.03.28	400 000.00	371 600.00	0.02
USD TENET HEALTHCARE CORP-144A 4.25000% 21-01.06.29	650 000.00	578 763.25	0.03
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 4.75000% 21-09.05.27	800 000.00	738 500.00	0.03
USD TRANSDIGM INC-SUB 4.62500% 21-15.01.29	2 205 000.00	1 989 262.80	0.09
USD TRANSDIGM INC-SUB 4.87500% 21-01.05.29	3 290 000.00	2 968 584.23	0.14
USD TRANSDIGM INC-SUB 5.50000% 20-15.11.27	2 095 000.00	2 000 674.38	0.09
USD TRANSOCEAN LTD 7.50000% 01-15.04.31	600 000.00	465 000.00	0.02
USD TRI POINTE GROUP INC 5.70000% 20-15.06.28	1 365 000.00	1 280 615.70	0.06
USD TRIUMPH GROUP INC 7.75000% 18-15.08.25	740 000.00	628 570.80	0.03
USD TRIVIUM PACKAGING FINANCE BV-144A 5.50000% 19-15.08.26	2 095 000.00	2 011 074.30	0.09
USD TRIVIUM PACKAGING FINANCE BV-144A 8.50000% 19-15.08.27	1 076 000.00	1 034 832.24	0.05
USD UNITED AIRLINES INC-144A 4.62500% 21-15.04.29	1 948 000.00	1 776 790.71	0.08
USD UNITED RENTALS NORTH AMERICA INC-144A 6.00000% 22-15.12.29	435 000.00	441 525.00	0.02
USD VERITAS US INC / BERMUDA LTD-144A 7.50000% 20-01.09.25	1 600 000.00	1 055 526.86	0.05
USD VIRGIN MEDIA VENDOR FINANC-144A 5.00000% 20-15.07.28	1 165 000.00	1 057 354.00	0.05

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD WESTERN GAS PARTNERS LP 5.45000% 14-01.04.44	440 000.00	387 292.40	0.02
USD WESTERN GAS PARTNERS LP 5.30000% 18-01.03.48	1 500 000.00	1 312 500.00	0.06
USD WESTERN MIDSTREAM OPERATING LP 4.05000% 20-01.02.30	640 000.00	586 086.40	0.03
USD YUM BRANDS INC 3.62500% 20-15.03.31	2 583 000.00	2 201 821.36	0.10
USD YUM BRANDS INC 4.62500% 21-31.01.32	700 000.00	636 888.00	0.03
USD YUM BRANDS 5.37500% 22-01.04.32	2 506 000.00	2 377 642.68	0.11
USD ZIGGO BOND CO BV-144A 6.00000% 16-15.01.27	2 320 000.00	2 194 209.60	0.10
USD ZIGGO BV-144A 4.87500% 19-15.01.30	396 000.00	344 931.84	0.02
米ドル合計		224 721 734.94	10.57
ノート、固定利付債合計		481 543 616.67	22.66
ノート、変動利付債			
EUR			
EUR ABERTIS INFRA FINANCE BV-REG-S-SUB 3.248%/VAR 20-PRP	4 400 000.00	4 300 318.36	0.20
EUR ABERTIS INFRA FINANCE BV-REG-S-SUB 2.625%/VAR 20-PRP	1 000 000.00	906 200.12	0.04
EUR AIB GROUP PLC-REG-S-SUB 6.250%/VAR 19-PRP	500 000.00	521 982.79	0.02
EUR ALLIANZ SE-REG-S-SUB 2.625%/VAR 20-PRP	600 000.00	489 547.46	0.02
EUR BANCO BPM SPA-REG-S-SUB 5.000%/VAR 20-14.09.30	1 120 000.00	1 191 425.70	0.06
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 2.000%/VAR 20-17.01.30	1 000 000.00	982 875.25	0.05
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 5.750%/VAR 21-PRP	600 000.00	596 345.72	0.03
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB COCO 9.375%/VAR 23-PRP	400 000.00	451 688.20	0.02
EUR BANCO SANTANDER SA SUB-REG-S 3.625%/VAR 21-PRP	600 000.00	476 504.44	0.02
EUR BAYER AG-REG-S-SUB 5.375%/VAR 22-25.03.82	4 000 000.00	3 996 664.00	0.19
EUR BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC-REG-S-SUB 3.000%/VAR 21-PRP	1 000 000.00	894 690.16	0.04
EUR BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC-REG-S -SUB 3.750%/VAR 21-PRP	500 000.00	421 588.32	0.02
EUR CASTELLUM AB-REG-S 3.125%/VAR 21-PRP	250 000.00	179 099.96	0.01
EUR COMMERZBANK AG-REG-S-SUB 6.125%/VAR 20-PRP	1 400 000.00	1 455 850.02	0.07
EUR EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA-REG-S-SUB 1.875%/VAR 21-14.03.82	1 500 000.00	1 254 387.75	0.06
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 3.000%/VAR 19-PRP	200 000.00	183 542.45	0.01
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 3.375%/VAR 20-PRP	4 600 000.00	3 946 705.70	0.18
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 2.875%/VAR 20-PRP	3 200 000.00	2 971 432.80	0.14
EUR ELECTRICITE DE FRANCE-REG-S-SUB 2.625%/VAR 21-PRP	4 800 000.00	4 271 043.67	0.20
EUR ELM BV FOR FIRMENICH INTL SA-REG-S-SUB 3.750%/VAR 20-PRP	2 820 000.00	2 951 118.89	0.14
EUR ENERGIAS DE PORTUGAL SA-REG-S-SUB 1.875%/VAR 21-02.08.81	1 000 000.00	947 578.62	0.04
EUR FASTIGHETS AB BALDER-REG-S-SUB 2.873%/VAR 21-02.06.81	348 000.00	289 506.18	0.01
EUR GALAPAGO SA/LUX-REG-S *DEFAULT* 3M EURIBOR+475BP 14-15.06.21	1 066 000.00	578.86	0.00
EUR HEIMSTADEN BOSTAD AB-REG-S-SUB 3.248%/VAR 19-PRP	500 000.00	401 932.98	0.02
EUR HEIMSTADEN BOSTAD AB-REG-S-SUB 3.000%/VAR 21-PRP	3 496 000.00	2 316 066.78	0.11
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S COCO 6.375%/VAR 20-PRP	1 050 000.00	1 023 270.23	0.05
EUR ITALMATCH CHEMICALS SPA-REG-S 3M EURIBOR+475BP 18-30.09.24	1 000 000.00	1 086 050.00	0.05
EUR KONINKLIJKE KPN NV-REG-S-SUB 2.000%/VAR 19-PRP	1 000 000.00	1 020 887.00	0.05
EUR LENZING AG-REG-S-SUB 5.750%/VAR 20-PRP	1 600 000.00	1 456 870.92	0.07
EUR PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 3M EURIBOR+240BP 18-24.08.23	1 000 000.00	1 079 126.43	0.05
EUR REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S-SUB 3.750%/VAR 20-PRP	3 050 000.00	3 109 366.04	0.15
EUR REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV-SUB 4.247%/VAR 20-PRP	1 997 000.00	1 973 646.08	0.09
EUR REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S-SUB 2.500%/VAR 21-PRP	2 600 000.00	2 460 174.76	0.12
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 2.376%/VAR 21-PRP	1 400 000.00	1 208 773.65	0.06
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 2.880%/VAR 21-PRP	3 500 000.00	3 211 992.87	0.15
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 7.125%/VAR 22-PRP	300 000.00	340 069.40	0.02
EUR UNICREDIT SPA-REG-S-SUB 2.731%/VAR 20-15.01.32	2 700 000.00	2 558 081.08	0.12
EUR VEOLIA ENVIRONNEMENT SA-REG-S-SUB 2.500%/VAR 20-PRP	2 700 000.00	2 382 275.87	0.11
EUR VODAFONE GROUP PLC-REG-S-SUB 3.000%/VAR 20-27.08.80	1 000 000.00	891 918.56	0.04
EUR WINTERSHALL DEA FINANCE 2BV-REG-S-SUB 3.000%/VAR 21-PRP	4 200 000.00	3 624 040.24	0.17
ユーロ合計		63 825 218.31	3.00

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

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
GBP			
GBP LLOYDS BANKING GROUP-SUB 8.500%/VAR 22-PRP	780 000.00	985 464.77	0.05
GBP NATWEST GROUP PLC-SUB 5.125%/VAR 20-PRP	1 550 000.00	1 697 653.66	0.08
GBP NATWEST GROUP PLC-SUB 4.500%/VAR 21-PRP	1 225 000.00	1 240 410.19	0.06
GBP TVL FINANCE PLC-REG-S O/N SONIA+537.5BP 19-15.07.25	1 350 000.00	1 578 885.75	0.07
GBP UTMOST GROUP PLC-REG-S-SUB 6.125%/VAR 22-PRP	2 100 000.00	2 136 112.39	0.10
英債券合計		7 638 526.76	0.36
USD			
USD AERCAP GLOBAL AVIATION TRUST-144A-SUB 6.500%/VAR 15-15.06.45	971 000.00	949 472.93	0.04
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 2.482%/VAR 21-21.09.36	705 000.00	550 020.00	0.03
USD BNP PARIBAS SA-REG-S-SUB COCO 9.250%/VAR 22-PRP	400 000.00	434 400.00	0.02
USD BNP PARIBAS SA-REG-S-SUB 6.625%/VAR 19-PRP	460 000.00	453 675.00	0.02
USD CAPITAL ONE FINANCIAL CORP-SUB 3.950%/VAR 21-PRP	860 000.00	746 427.24	0.03
USD CITIGROUP INC-SUB 4.000%/VAR 20-PRP	430 000.00	397 810.78	0.02
USD COMMERZBANK AG-REG-S-SUB 7.000%/VAR 19-PRP	600 000.00	590 832.00	0.03
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-144A-SUB 4.500%/VAR 20-PRP	708 000.00	474 360.00	0.02
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S-SUB 6.375%/VAR 19-PRP	2 860 000.00	2 316 600.00	0.11
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S-SUB 5.250%/VAR 20-PRP	475 000.00	356 250.00	0.02
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S-SUB 6.250%/VAR 14-PRP	1 033 000.00	906 560.80	0.04
USD DANSKE BANK A/S-REG-S-SUB 4.375%/VAR 21-PRP	500 000.00	439 375.00	0.02
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY-SUB 3.729%/VAR 21-14.01.32	700 000.00	562 542.65	0.03
USD ING GROEP NV-SUB 3.875%/VAR 21-PRP	700 000.00	567 980.00	0.03
USD MORGAN STANLEY-SUB 2.484%/VAR 21-16.09.36	710 000.00	550 366.97	0.03
USD PARAMOUNT GLOBAL-SUB 6.375%/VAR 22-30.03.62	927 000.00	808 779.69	0.04
USD PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE-SUB 6.200%/VAR 22-PRP	855 000.00	855 256.50	0.04
USD SOCIETE GENERAL SA-REG-S-SUB 7.375%/VAR 18-PRP	1 100 000.00	1 094 071.00	0.05
USD STANDARD CHARTERED PLC-REG-S-SUB 6.000%/VAR 20-PRP	1 210 000.00	1 188 825.00	0.06
USD UBS GROUP AG-REG-S-SUB 3.875%/VAR 21-PRP	2 325 000.00	2 006 560.45	0.09
USD VODAFONE GROUP PLC-SUB 5.125%/VAR 21-04.06.81	600 000.00	461 250.00	0.02
USD WYNDHAM WORLDWIDE CORP STEP UP/RATING LINKED 17-01.04.27	1 876 000.00	1 840 825.00	0.09
米ドル合計		18 552 241.01	0.88
ノート、変動利付債合計		90 015 986.08	4.24
中期債券、固定利付債			
EUR			
EUR ASSICURAZIONI GENERALI SPA-REG-S-SUB 5.80000% 22-06.07.32	500 000.00	583 073.10	0.03
EUR AUTOSTRADE PER L'ITALIA SPA-REG-S 1.87500% 17-26.09.29	1 000 000.00	909 664.31	0.04
EUR AUTOSTRADE PER L'ITALIA SPA-REG-S 1.62500% 22-25.01.28	4 522 000.00	4 264 991.76	0.20
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 2.50000% 21-15.04.31	800 000.00	772 138.11	0.04
EUR CASINO GUICHARD PERRACHON SA-REG-S STEP-UP 14-07.03.24	2 600 000.00	2 412 877.30	0.11
EUR CASINO GUICHARD PERRACHON SA-REG-S STEP-UP 14-07.02.25	300 000.00	231 328.65	0.01
EUR CELLNEX FINANCE CO SA -REG-S 1.25000% 21-15.01.29	600 000.00	540 527.09	0.03
EUR CELLNEX FINANCE CO SA-REG-S 2.00000% 21-15.02.33	1 500 000.00	1 269 701.05	0.06
EUR CELLNEX FINANCE CO SA-REG-S 1.50000% 21-08.06.28	3 700 000.00	3 456 558.52	0.16
EUR CELLNEX FINANCE CO SA-REG-S 1.00000% 21-15.09.27	2 500 000.00	2 327 540.91	0.11
EUR CELLNEX FINANCE CO SA-REG-S 2.25000% 22-12.04.26	300 000.00	306 075.83	0.01
EUR CELLNEX TELECOM SA-REG-S 1.75000% 20-23.10.30	1 000 000.00	880 330.41	0.04
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA AG-REG-S 3.75000% 21-11.02.28	4 000 000.00	3 936 036.34	0.19
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA AG-REG-S 3.50000% 21-14.07.29	1 000 000.00	944 972.10	0.04
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA AG-REG-S 2.87500% 21-16.05.27	3 200 000.00	3 075 964.68	0.14
EUR DOMETIC GROUP AB-REG-S 3.00000% 19-08.05.26	700 000.00	671 910.90	0.03
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S 4.37500% 22-12.10.29	1 500 000.00	1 649 901.09	0.08
EUR ELIS SA-REG-S 1.00000% 19-03.04.25	1 500 000.00	1 518 884.37	0.07
EUR ELIS SA-REG-S 1.62500% 19-03.04.28	800 000.00	748 288.46	0.04
EUR ELIS SA-REG-S 4.12500% 22-24.05.27	400 000.00	425 362.35	0.02
EUR FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.25000% 20-15.09.25	1 150 000.00	1 202 016.68	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

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)	
EUR	INFRASTRUTTURA WIRELESS ITALI SPA-REG-S 1.87500% 20-08.07.26	500 000.00	501 966.88	0.02
EUR	INTRUM JUSTITIA AB-REG-S 3.50000% 19-15.07.26	3 215 000.00	3 063 923.52	0.14
EUR	MAHLE GMBH-REG-S 2.37500% 21-14.05.28	1 900 000.00	1 563 097.47	0.07
EUR	MAX TWO LTD *DEFAULTED* 5.70000% 04-02.04.24	350 000.00	66 214.07	0.00
EUR	NOVELIS SHEET INGOT GMBH-REG-S 3.37500% 21-15.04.29	4 875 000.00	4 600 067.96	0.22
EUR	ORANO SA-REG-S 2.75000% 20-08.03.28	4 300 000.00	4 344 757.80	0.20
EUR	PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 2.75000% 15-21.04.27	1 500 000.00	1 357 019.47	0.06
EUR	PPF ARENA 1 BV-REG-S 2.12500% 19-31.01.25	700 000.00	719 372.37	0.03
EUR	PPF TELECOM GROUP BV-REG-S 3.50000% 20-20.05.24	300 000.00	320 927.78	0.02
EUR	PPF TELECOM GROUP BV-REG-S 3.25000% 20-29.09.27	1 433 000.00	1 423 948.63	0.07
EUR	RCI BANQUE SA-REG-S 4.75000% 22-06.07.27	2 017 000.00	2 222 759.74	0.10
EUR	RCI BANQUE SA-REG-S 4.87500% 22-21.09.28	4 764 000.00	5 203 526.80	0.25
EUR	RENAULT SA-REG-S 2.00000% 18-28.09.26	600 000.00	584 772.77	0.03
EUR	RENAULT SA-REG-S 2.37500% 20-25.05.26	1 200 000.00	1 196 624.66	0.06
EUR	RENAULT SA-REG-S 2.50000% 21-01.04.28	1 400 000.00	1 326 762.12	0.06
EUR	RENAULT SA-REG-S 2.50000% 21-02.06.27	500 000.00	487 935.12	0.02
EUR	SAIPEM FINANCE INTERNATIONAL BV-REG-S 3.12500% 21-31.03.28	500 000.00	471 291.39	0.02
EUR	SHAEFFLER AG-REG-S 3.37500% 20-12.10.28	1 900 000.00	1 858 107.09	0.09
EUR	TDC NET A/S-REG-S 5.05600% 22-31.05.28	725 000.00	777 570.69	0.04
EUR	TELECOM ITALIA FINANCE SA 7.75000% 03-24.01.33	2 375 000.00	2 682 254.62	0.13
EUR	TELECOM ITALIA SPA-REG-S 3.00000% 16-30.09.25	100 000.00	101 035.23	0.01
EUR	TELECOM ITALIA SPA-REG-S 2.37500% 17-12.10.27	944 000.00	857 380.35	0.04
EUR	TELECOM ITALIA SPA-REG-S 2.87500% 18-28.01.26	725 000.00	717 505.72	0.03
EUR	TELECOM ITALIA SPA-REG-S 4.00000% 19-11.04.24	1 500 000.00	1 597 796.76	0.08
EUR	TELECOM ITALIA SPA-REG-S 2.75000% 19-15.04.25	100 000.00	101 545.68	0.01
EUR	TELECOM ITALIA SPA/MILANO-REG-S 1.62500% 21-18.01.29	1 500 000.00	1 232 786.22	0.06
EUR	TEOLLISUUDEN VOIMA OYJ-REG-S 1.37500% 21-23.06.28	1 000 000.00	922 121.61	0.04
EUR	THYSSENKRUPP AG-REG-S 2.87500% 19-22.02.24	581 000.00	622 323.92	0.03
EUR	TRAFIGURA FUNDING SA-REG-S 3.87500% 21-02.02.26	960 000.00	985 264.56	0.05
EUR	VALEO SA-REG-S 5.37500% 22-28.05.27	1 000 000.00	1 091 914.67	0.05
EUR	ZF FINANCE GMBH-REG-S 3.75000% 20-21.09.28	6 600 000.00	6 307 778.40	0.30
EUR	ZF FINANCE GMBH-REG-S 3.00000% 20-21.09.25	1 500 000.00	1 544 001.44	0.07
EUR	ZF FINANCE GMBH-REG-S 2.75000% 20-25.05.27	900 000.00	858 325.73	0.04
EUR	ZF FINANCE GMBH-REG-S 2.00000% 21-06.05.27	1 900 000.00	1 766 929.51	0.08
EUR	ZF FINANCE GMBH-REG-S 2.25000% 21-03.05.28	1 000 000.00	900 087.83	0.04
EUR	ZF FINANCE GMBH-REG-S 5.75000% 23-03.08.26	1 800 000.00	1 964 664.46	0.09
ユーロ合計			88 472 507.05	4.16
GBP				
GBP	TELECOM ITALIA SPA 5.87500% 06-19.05.23	3 500 000.00	4 298 077.88	0.20
英ポンド合計			4 298 077.88	0.20
USD				
USD	NAVIENT CORP 5.62500% 03-01.08.33	2 545 000.00	1 972 646.27	0.09
USD	PETROLEOS MEXICANOS 6.87500% 17-04.08.26	1 500 000.00	1 459 642.80	0.07
USD	SPRINT CAPITAL CORPORATION 8.75000% 02-15.03.32	1 648 000.00	2 035 280.00	0.10
米ドル合計			5 467 569.07	0.26
中期債券、固定利付債合計			98 238 154.00	4.62
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	614 748.61	0.03
EUR	BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 5.375%/VAR 18-12.12.28	1 300 000.00	1 406 570.51	0.07
EUR	BANK OF IRELAND GROUP PLC-REG-S-SUB 6.750%/VAR 22-01.03.33	565 000.00	642 258.27	0.03
EUR	BPER BANCA-REG-S-SUB 3.875%/VAR 22-25.07.32	2 119 000.00	1 949 695.21	0.09
EUR	CAIXABANK SA-REG-S-SUB 6.250%/VAR 22-23.02.33	600 000.00	675 564.37	0.03
EUR	COMMERZBANK AG-REG-S-SUB 4.000%/VAR 20-05.12.30	300 000.00	313 744.85	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

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR COMMERZBANK AG-REG-S-SUB 1.375%/VAR 21-29.12.31	2 800 000.00	2 565 762.71	0.12
EUR CREDIT AGRICOLE SA-SUB-REG-S 7.250%/VAR 23-PRP	400 000.00	449 016.52	0.02
EUR DEUTSCHE BANK AG-REG-S 4.000%/VAR 22-24.06.32	700 000.00	701 779.01	0.03
EUR EDP - ENERGIAS DE PORT SA-REG-S-SUB 5.943%/VAR 23-23.04.83	2 200 000.00	2 384 889.78	0.11
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 5.000%/VAR 14-PRP	3 500 000.00	3 581 353.06	0.17
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 7.500%/VAR 22-PRP	3 200 000.00	3 558 212.58	0.17
EUR ENEL SPA-REG-S-SUB 6.375%/VAR 23-PRP	345 000.00	382 222.96	0.02
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB 5.875%/VAR 19-04.03.29	1 000 000.00	1 099 625.63	0.05
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB 4.375%/VAR 19-12.07.29	625 000.00	676 982.48	0.03
EUR JYSKE BANK A/S-REG-S-SUB 3.625%/VAR 21-PRP	1 375 000.00	1 179 721.81	0.06
EUR MEDIOBANCA SPA-REG-S-SUB 2.300%/VAR 20-23.11.30	870 000.00	856 560.34	0.04
EUR OTP BANK NYRT-REG-S-SUB 2.875%/VAR 19-15.07.29	715 000.00	712 365.31	0.03
EUR TRAFIGURA GROUP PTE LTD-REG-S-SUB 7.500%/VAR 19-PRP	499 000.00	541 215.09	0.03
EUR UNICREDIT SPA-REG-S-SUB 4.875%/VAR 19-20.02.29	400 000.00	431 513.73	0.02
ユーロ合計		24 723 802.83	1.16
GBP			
GBP BANK OF IRELAND-REG-S-SUB 7.594%/VAR 22-06.12.32	1 280 000.00	1 620 261.55	0.08
GBP ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 6.000%/VAR 13-PRP	2 200 000.00	2 501 025.44	0.12
GBP QUILTER PLC-REG-S-SUB 8.625%/VAR 23-18.04.33	600 000.00	749 314.43	0.03
英ポンド合計		4 870 601.42	0.23
USD			
USD NATWEST GROUP PLC-SUB 8.000%/VAR 15-PRP	600 000.00	606 750.00	0.03
USD NORDEA BANK ABP-REG-S 3.750%/VAR 21-PRP	2 000 000.00	1 582 013.40	0.08
米ドル合計		2 188 763.40	0.11
中期債券、変動利付債合計		31 783 167.65	1.50
債券、固定利付債			
CHF			
CHF DUFFRY ONE BV-REG-S 3.62500% 21-15.04.26	175 000.00	175 132.19	0.01
スイスフラン合計		175 132.19	0.01
EUR			
EUR 888 ACQUISITIONS LTD-REG-S 7.5580% 22-15.07.27	2 000 000.00	1 878 805.69	0.09
EUR ADEVINTA ASA-REG-S 2.62500% 20-15.11.25	1 370 000.00	1 413 494.08	0.07
EUR ADEVINTA ASA-REG-S 3.00000% 20-15.11.27	1 255 000.00	1 233 508.43	0.06
EUR ADLER REAL ESTATE AG-REG-S 3.00000% 18-27.04.26	300 000.00	240 620.89	0.01
EUR ADO PROPERTIES SA-REG-S 1.50000% 17-26.07.24	900 000.00	681 240.07	0.03
EUR AFFLELOU SAS-REG-S 4.25000% 21-19.05.26	1 425 000.00	1 421 768.69	0.07
EUR ALBION FINANCING-REG-S 5.25000% 21-15.10.26	1 290 000.00	1 253 927.04	0.06
EUR ALLIED UNIVERSAL HOLDCO/FIN/ATLAS-REG-S 3.62500% 21-01.06.28	2 392 000.00	2 156 200.23	0.10
EUR ALMAVIVA-THE ITALIAN INNOVATION-REG-S 4.87500% 21-30.10.26	500 000.00	512 183.01	0.02
EUR ALTICE FINANCING SA-REG-S 2.25000% 20-15.01.25	1 000 000.00	1 013 862.43	0.05
EUR ALTICE FINANCING SA-REG-S 3.00000% 20-15.01.28	6 648 000.00	5 787 600.43	0.27
EUR ALTICE FINANCING SA-REG-S 4.25000% 21-15.08.29	2 526 000.00	2 211 501.17	0.10
EUR ALTICE FRANCE-REG-S 3.37500% 19-15.01.28	2 510 000.00	2 132 931.00	0.10
EUR ALTICE FRANCE-REG-S 2.50000% 19-15.01.25	945 000.00	955 663.51	0.04
EUR ALTICE FRANCE-REG-S 2.12500% 20-15.02.25	1 200 000.00	1 200 901.96	0.06
EUR ALTICE FRANCE-REG-S 4.12500% 20-15.01.29	2 660 000.00	2 264 088.99	0.11
EUR ARDAGH METAL PACKAGING FIN PLC-REG-S 2.00000% 21-01.09.28	1 268 000.00	1 144 999.27	0.05
EUR ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-REG-S 2.12500% 20-15.08.26	1 600 000.00	1 500 216.36	0.07
EUR AUTOSTRADA PER L'ITALIA SPA REG-S 2.00000% 21-15.01.30	1 300 000.00	1 176 625.71	0.06
EUR AVANTOR FUNDING INC-REG-S 2.62500% 20-01.11.25	1 919 000.00	2 000 764.75	0.09
EUR BANIJAY ENTERTAINMENT SASU-REG-S 3.50000% 20-01.03.25	2 150 000.00	2 250 713.73	0.11
EUR BANIJAY GROUP SAS-REG-S 6.50000% 20-01.03.26	3 242 000.00	3 398 796.28	0.16
EUR BCP V MODULAR SERVICES-REG-S 4.75000% 21-30.11.28	1 272 000.00	1 205 320.01	0.06

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR BELDEN INC-REG-S-SUB 3.37500% 17-15.07.27	200 000.00	198 245.40	0.01
EUR BELDEN INC-REG-S-SUB 3.87500% 18-15.03.28	982 000.00	978 514.76	0.05
EUR BERRY GLOBAL INC-REG-S 1.50000% 20-15.01.27	450 000.00	436 575.81	0.02
EUR BK LC LUX FINCO1 SARL-REG-S 5.25000% 21-30.04.29	1 000 000.00	953 226.08	0.05
EUR BWAY HOLDING CO-REG-S 4.75000% 18-15.04.24	1 612 000.00	1 741 911.05	0.08
EUR CAB SELAS-REG-S 3.37500% 21-01.02.28	3 038 000.00	2 750 680.18	0.13
EUR CARNIVAL CORP-REG-S 10.12500% 20-01.02.26	1 325 000.00	1 495 641.54	0.07
EUR CARNIVAL CORP-REG-S 7.62500% 20-01.03.26	525 000.00	511 830.11	0.02
EUR CASTOR SPA-REG-S 6.00000% 22-15.02.29	2 350 000.00	2 390 662.13	0.11
EUR CENTURION BIDCO SPA-REG-S 5.87500% 20-30.09.26	1 828 000.00	1 811 574.07	0.09
EUR CHEMOURS CO/THE 4.00000% 18-15.05.26	3 375 000.00	3 336 080.88	0.16
EUR CHEPLAPHARM ARZNEIMITTEL GMBH-REG-S 4.37500% 20-15.01.28	622 000.00	616 959.30	0.03
EUR CHROME BIDCO SASU-REG-S 3.50000% 21-31.05.28	1 454 000.00	1 308 614.01	0.06
EUR CIRSA FINANCE INTERNATIONAL-REG-S 4.75000% 19-22.05.25	1 625 000.00	1 675 707.27	0.08
EUR CIRSA FINANCE INTERNATIONAL SARL-REG-S 10.37500% 22-30.11.27	1 060 000.00	1 206 574.83	0.06
EUR CONTOURGLOBAL POWER HOLDINGS SA-REG-S 4.12500% 18-01.08.25	1 550 000.00	1 693 730.27	0.08
EUR COTY INC-REG-S 3.87500% 21-15.04.26	950 000.00	968 404.39	0.05
EUR CROWN EUROPEAN HOLDINGS SA-REG-S 3.37500% 15-15.05.25	500 000.00	530 576.69	0.02
EUR CROWN EUROPEAN HOLDINGS SA-REG-S 2.62500% 16-30.09.24	500 000.00	529 449.37	0.03
EUR CTEC II GMBH-REG-S 5.25000% 22-15.02.30	3 106 000.00	2 779 575.56	0.13
EUR CULLINAN HOLDCO SCSP REG-S 4.62500% 21-15.10.26	1 700 000.00	1 649 596.57	0.08
EUR DERICHEBOURG SA-REG-S 2.25000% 21-15.07.28	1 050 000.00	969 267.69	0.05
EUR DIC ASSET AG-REG-S 2.25000% 21-22.09.26	2 400 000.00	1 756 717.07	0.08
EUR DRAX FINCO PLC-REG-S 2.62500% 20-01.11.25	780 000.00	806 043.90	0.04
EUR DUFY ONE BV-REG-S 3.37500% 21-15.04.28	755 000.00	709 272.11	0.03
EUR ENERGIZER GAMMA ACQUISITION BV-REG-S 3.50000% 21-30.06.29	4 050 000.00	3 574 399.32	0.17
EUR EXPLORER II AS 3.37500% 20-24.02.25	400 000.00	371 303.12	0.02
EUR FAURECIA SA-REG-S 2.62500% 18-15.06.25	379 000.00	388 974.23	0.02
EUR FAURECIA SA-REG-S 3.12500% 19-15.06.26	1 025 000.00	1 023 777.79	0.05
EUR FAURECIA SE-REG-S 2.37500% 19-15.06.27	1 675 000.00	1 559 616.14	0.07
EUR FAURECIA SE-REG-S 7.25000% 22-15.06.26	870 000.00	972 663.28	0.05
EUR FAURECIA SE-REG-S 7.25000% 23-15.06.26	875 000.00	976 638.46	0.05
EUR FIS FABBRICA ITALIANA SINTETICI S-REG-S 5.62500% 22-01.08.27	887 000.00	814 058.93	0.04
EUR FONCIA MANAGEMENT SASU-REG-S 3.37500% 21-31.03.28	2 615 000.00	2 371 417.32	0.11
EUR FRIGOGLASS FINANCE BV-REG-S 6.87500% 20-12.02.25	3 000 000.00	821 053.80	0.04
EUR GALAPAGO SA/LUX-REG-S *DEFAULT* 5.37500% 14-15.06.21	1 680 000.00	912.28	0.00
EUR GAMMA BONDCO SARL-REG-S 8.12500% 21-15.11.26	1 600 000.00	1 653 256.55	0.08
EUR GETLINK SE-REG-S 3.50000% 20-30.10.25	1 420 000.00	1 503 636.22	0.07
EUR GRAPHIC PACKAGING INTERNATIONAL-REG-S 2.62500% 21-01.02.29	1 000 000.00	944 065.17	0.04
EUR GRIFOLS SA-REG-S 2.25000% 19-15.11.27	1 312 000.00	1 238 179.03	0.06
EUR GRIFOLS SA-REG-S 3.20000% 17-01.05.25	2 865 000.00	2 923 814.44	0.14
EUR GRUENENTHAL GMBH-REG-S 4.12500% 21-15.05.28	2 000 000.00	1 974 091.37	0.09
EUR GRUPO ANTOLIN-IRAUSA SA-REG-S 3.50000% 21-30.04.28	1 925 000.00	1 492 198.77	0.07
EUR GRUPO-ANTOLIN IRAUSA SA-REG-S 3.37500% 18-30.04.26	475 000.00	424 951.00	0.02
EUR GUALA CLOSURES SPA-REG-S 3.25000% 21-15.06.28	3 175 000.00	2 968 907.73	0.14
EUR HELIXH HOLDCO SA-SUB (PIK) 10.00000% 20-19.04.26	268 390.00	86 716.78	0.00
EUR HP PELZER HOLDING GMBH-REG-S 4.12500% 17-01.04.24	1 880 000.00	1 682 401.36	0.08
EUR HSE FINANCE SARL-REG-S 5.62500% 21-15.10.26	1 000 000.00	572 852.28	0.03
EUR HT TROPLAST GMBH-REG-S 9.25000% 20-15.07.25	700 000.00	733 626.77	0.03
EUR HUHTAMAKI OYJ-REG-S 4.25000% 22-09.06.27	1 500 000.00	1 597 356.91	0.08
EUR IHO VERWALTUNGS GMBH-REG-S (PIK) 3.75000% 16-15.09.26	975 000.00	950 361.63	0.04
EUR ILIAD SA-REG-S 1.87500% 18-25.04.25	1 000 000.00	1 020 022.50	0.05
EUR ILIAD SA-REG-S 5.37500% 22-14.06.27	3 100 000.00	3 366 755.00	0.16
EUR INEOS FINANCE PLC-REG-S 3.37500% 20-31.03.26	1 400 000.00	1 383 420.91	0.07
EUR INEOS QUATTRO FINANCE 2 PLC-REG-S 2.50000% 21-15.01.26	925 000.00	895 346.41	0.04
EUR INEOS STYROLUTION GROUP GMBH-REG-S 2.25000% 20-16.01.27	500 000.00	467 539.09	0.02
EUR INPOST SA-REG-S 2.25000% 21-15.07.27	1 725 000.00	1 623 163.90	0.08
EUR INTRALOT CAPITAL LUXEMBOURG SA-REG-S 5.25000% 17-15.09.24	1 000 000.00	992 519.38	0.05
EUR INTRUM JUSTITIA AB-REG-S 3.12500% 17-15.07.24	1 325 000.00	729 863.80	0.03

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR IPD 3 BV-REG-S 5.50000% 20-01.12.25	3 539 000.00	3 728 225.02	0.18
EUR IQVIA INC-REG-S 2.25000% 21-15.03.29	1 800 000.00	1 639 859.47	0.08
EUR ITALMATCH CHEMICALS SPA-REG-S 10.00000% 23-06.02.28	100 000.00	110 325.95	0.01
EUR KANE BIDCO LTD-REG-S 5.00000% 22-15.02.27	1 125 000.00	1 105 632.02	0.05
EUR KAPLA HOLDING SAS-REG-S 3.37500% 19-15.12.26	850 000.00	827 743.11	0.04
EUR KIRK BEAUTY SUN GMBH-REG-S (PIK) 8.25000% 21-01.10.26	418 000.00	313 238.54	0.01
EUR KLEOPATRA FINCO SARL-REG-S 4.25000% 21-01.03.26	975 000.00	885 800.56	0.04
EUR KONGSBERG ACTUATION SYSTEMS BV-REG-S 5.00000% 18-15.07.25	1 755 000.00	1 295 454.44	0.06
EUR LA FINANCIERE ATALIAN SA-REG-S 4.00000% 17-15.05.24	370 000.00	352 613.28	0.02
EUR LHMC FINCO 2 SARL-REG-S (PIK) 7.25000% 19-02.10.25	1 402 255.00	1 399 114.86	0.07
EUR LOARRE INVESTMENTS SARL-REG-S 6.50000% 22-15.05.29	700 000.00	718 005.88	0.03
EUR LORCA TELECOM BONDCO SAU-REG-S 4.00000% 20-18.09.27	13 292 000.00	13 225 567.70	0.62
EUR LOTTOMATICA SPA/ROMA-REG-S 6.25000% 20-15.07.25	1 300 000.00	1 397 746.35	0.07
EUR LOXAM SAS-REG-S 3.25000% 19-14.01.25	950 000.00	988 313.00	0.05
EUR LSF XI MAGPIE BIDCO SARL-REG-S 7.25000% 22-30.06.27	1 500 000.00	1 515 039.75	0.07
EUR MANGROVE LUXCO III-REG-S (PIK) 7.77500% 19-09.10.25	1 246 547.00	777 172.92	0.04
EUR MATTERHORN TELECOM SA-REG-S 3.12500% 19-15.09.26	1 500 000.00	1 486 530.94	0.07
EUR MOBILUX FINANCE SAS-REG-S 4.25000% 21-15.07.28	1 000 000.00	849 834.13	0.04
EUR MOTION FINCO SARL-REG-S 7.00000% 20-15.05.25	230 000.00	252 951.36	0.01
EUR MPT OPERATING PARTNERSHIP LP/FIN CORP 0.99300% 21-15.10.26	125 000.00	101 043.38	0.00
EUR NETFLIX INC 4.62500% 18-15.05.29	6 061 000.00	6 689 331.17	0.31
EUR NEXI SPA-REG-S 2.12500% 21-30.04.29	4 275 000.00	3 700 678.12	0.17
EUR NOMAD FOODS BONDCO PLC-REG-S 2.50000% 21-24.06.28	1 000 000.00	925 966.23	0.04
EUR NORICAN GROUP APS-REG-S 4.50000% 17-15.05.23	2 596 000.00	2 805 288.87	0.13
EUR OI EUROPEAN GROUP BV-REG-S 3.12500% 16-15.11.24	6 455 000.00	6 808 902.24	0.32
EUR OI EUROPEAN GROUP BV-REG-S 2.87500% 19-15.02.25	300 000.00	313 492.67	0.01
EUR PAPREC HOLDING-REG-S-3.50000% 21-01.07.28	300 000.00	281 626.01	0.01
EUR PAYSAFE FINANCE PLC-REG-S 3.00000% 21-15.06.29	2 400 000.00	2 137 346.40	0.10
EUR PFLEIDERER GMBH-REG-S 4.75000% 21-15.04.26	2 225 000.00	2 044 447.04	0.10
EUR PHM GROUP HOLDING OY-144A-REG-S 4.75000% 21-18.06.26	300 000.00	287 531.74	0.01
EUR PICARD GROUPE SAS-REG-S 3.87500% 21-01.07.26	4 173 000.00	4 101 810.35	0.19
EUR PINNACLE BIDCO PLC-REG-S 5.50000% 20-15.02.25	1 935 000.00	1 920 251.79	0.09
EUR PLT VII FINANCE SARL-REG-S 4.62500% 20-05.01.26	1 700 000.00	1 758 327.99	0.08
EUR PRIMO WATER HOLDINGS INC-REG-S 3.87500% 20-31.10.28	2 225 000.00	2 113 678.65	0.10
EUR PRO-GEST SPA-REG-S 3.25000% 17-15.12.24	3 500 000.00	2 714 388.73	0.13
EUR Q-PARK HOLDING I BV-REG-S 1.50000% 20-01.03.25	1 825 000.00	1 840 325.31	0.09
EUR Q-PARK HOLDING I BV-REG-S 2.00000% 20-01.03.27	1 000 000.00	920 427.38	0.04
EUR RCS & RDS SA-REG-S 2.50000% 20-05.02.25	700 000.00	707 873.81	0.03
EUR RCS & RDS SA-REG-S 3.25000% 20-05.02.28	3 400 000.00	3 137 069.01	0.15
EUR REBECCA BIDCO GMBH-REG-S 5.75000% 20-15.07.25	1 350 000.00	1 429 132.11	0.07
EUR REKEEP SPA-REG-S 7.25000% 21-01.02.26	1 400 000.00	1 292 399.50	0.06
EUR REXEL SA-REG-S 2.12500% 21-15.06.28	270 000.00	254 098.56	0.01
EUR ROSSINI SARL-REG-S 6.75000% 18-30.10.25	2 000 000.00	2 184 176.89	0.10
EUR SCHOELLER PACKAGING BV-REG-S 6.37500% 19-01.11.24	4 300 000.00	3 128 910.05	0.15
EUR SCIL IV LLC / SCIL USA HOLDINGS-REG-S 4.37500% 21-01.11.26	1 570 000.00	1 513 189.66	0.07
EUR SELECTA GROUP BV-REG-S (PAY IN KIND) 10.00000% 20-01.07.26	799 370.00	483 041.88	0.02
EUR SGL CARBON SE-REG-S 4.62500% 19-30.09.24	1 000 000.00	1 081 603.72	0.05
EUR SHERWOOD FINANCING PLC-REG-S 4.50000% 21-15.11.26	150 000.00	137 656.84	0.01
EUR SIGMA DEVELOPMENT FINANCE SCS-REG-S 5.50000% 21-23.07.26	1 500 000.00	1 148 497.87	0.05
EUR SOFIMA HOLDING SPA-REG-S 3.75000% 20-15.01.28	2 525 000.00	2 399 491.72	0.11
EUR SPA HOLDINGS 3 OY-REG-S 3.62500% 21-04.02.28	825 000.00	779 512.39	0.04
EUR SPCM SA-REG-S 2.62500% 20-01.02.29	3 350 000.00	3 119 814.37	0.15
EUR SPECTRUM BRANDS INC-REG-S 4.00000% 16-01.10.26	2 990 000.00	3 032 266.97	0.14
EUR STANDARD PROFIL AUTOMOTIVE GMBH-REG-S 6.25000% 21-30.04.26	973 000.00	649 041.50	0.03
EUR SUMMER BC HOLDCO B SARL-REG-S 5.75000% 19-31.10.26	3 250 000.00	3 181 108.32	0.15
EUR SUMMER BIDCO BV-REG-S (PIK) 9.00000% 19-15.11.25	375 000.00	351 814.61	0.02
EUR SUMMER BIDCO BV-REG-S (PIK) STEP-DOWN 20-15.11.25	800 000.00	732 112.39	0.03
EUR SUPERIOR INDUSTRIES INTERNATIONAL-REG-S 6.00000% 17-15.06.25	800 000.00	789 341.14	0.04
EUR SYNTHOS SA-REG-S 2.50000% 21-07.06.28	100 000.00	85 444.99	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

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR TEAMSYS SPA-REG-S 3.50000% 21-15.02.28	1 825 000.00	1 734 286.10	0.08
EUR TECHEM VERWALTUNGSGESELLSCHAF-REG-S 2.00000% 20-15.07.25	3 782 000.00	3 804 517.32	0.18
EUR TEREOS FINANCE GROUPE I SA-REG-S 7.50000% 20-30.10.25	500 000.00	555 243.06	0.03
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV-REG-S 1.87500% 15-31.03.27	4 918 000.00	4 460 898.40	0.21
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV-REG-S 1.62500% 16-15.10.28	625 000.00	522 576.71	0.02
EUR TRIVIUM PACKAGING FINANCE BV-REG-S 3.75000% 19-15.08.26	3 214 000.00	3 246 225.15	0.15
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 4.62500% 21-15.08.28	1 405 000.00	1 235 674.02	0.06
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 4.00000% 20-15.11.27	1 000 000.00	864 767.32	0.04
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 3.12500% 20-15.02.26	3 369 000.00	3 143 728.99	0.15
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 5.25000% 22-01.02.30	825 000.00	709 327.60	0.03
EUR UPC HOLDING BV-REG-S 3.87500% 17-15.06.29	500 000.00	474 468.10	0.02
EUR UPCB FINANCE VII LTD-REG-S 3.62500% 17-15.06.29	1 614 000.00	1 581 498.15	0.07
EUR VERDE BIDCO SPA-REG-S 4.62500% 21-01.10.26	1 800 000.00	1 752 926.40	0.08
EUR VERISURE HOLDING AB-REG-S 3.87500% 20-15.07.26	2 700 000.00	2 710 855.74	0.13
EUR VERISURE HOLDING AB-REG-S 3.25000% 21-15.02.27	600 000.00	575 089.53	0.03
EUR VERTICAL MIDCO GMBH-REG-S 4.37500% 20-15.07.27	6 139 000.00	6 021 203.36	0.28
EUR VIA CELERE DESARROLLOS INMOB-REG-S 5.25000% 21-01.04.26	500 000.00	502 298.13	0.02
EUR VICTORIA PLC-REG-S 3.62500% 21-24.08.26	1 475 000.00	1 296 116.51	0.06
EUR VICTORIA PLC-REG-S 3.75000% 21-15.03.28	500 000.00	417 909.86	0.02
EUR VILLA DUTCH BIDCO BV-REG-S 9.00000% 22-03.11.29	470 000.00	487 422.50	0.02
EUR VIVION INVESTMENTS SARL-REG-S 3.00000% 19-08.08.24	900 000.00	821 053.80	0.04
EUR VMED O2 UK FINANCING I PLC-REG-S 3.25000% 20-31.01.31	5 202 000.00	4 590 495.56	0.22
EUR VZ SECURED FINANCING BV-REG-S 3.50000% 22-15.01.32	3 437 000.00	2 967 539.31	0.14
EUR VZ VENDOR FINANCING II BV-REG-S 2.87500% 20-15.01.29	3 958 000.00	3 374 389.93	0.16
EUR WEPA HYGIENEPRODUKTE GMBH-REG-S 2.87500% 19-15.12.27	1 700 000.00	1 541 758.75	0.07
EUR WINTERSHALL DEA FINANCE BV-REG-S 1.33200% 19-25.09.28	2 400 000.00	2 192 338.76	0.10
EUR ZF NORTH AMERICA CAPITAL INC 2.75000% 15-27.04.23	700 000.00	757 841.78	0.04
ユーロ合計		275 235 108.93	12.95
GBP			
GBP ALLIED UNIVERSAL HOLDCO/FIN/ATLAS-REG-S 4.87500% 21-01.06.28	925 000.00	939 483.19	0.04
GBP GALAXY BIDCO LTD-REG-S 6.50000% 19-31.07.26	495 000.00	535 962.47	0.03
GBP HEATHROW FINANCE PLC-REG-S 4.12500% 19-01.09.29	1 650 000.00	1 625 052.00	0.08
GBP KANE BIDCO LTD-REG-S 6.50000% 22-15.02.27	625 000.00	669 730.71	0.03
GBP PINWOOD FINCO PLC-REG-S 3.25000% 19-30.09.25	250 000.00	286 187.66	0.01
GBP PREMIER FOODS FINANCE PLC-REG-S 3.50000% 21-15.10.26	790 000.00	870 313.10	0.04
GBP SHERWOOD FINANCING PLC-REG-S 6.00000% 21-15.11.26	300 000.00	295 464.00	0.01
GBP STONEGATE PUB CO FIN2019 PLC-REG-S 8.25000% 20-31.07.25	1 690 000.00	1 927 367.44	0.09
GBP VIRGIN MEDIA VENDOR FINANCING-REG-S 4.87500% 20-15.07.28	1 550 000.00	1 595 736.44	0.08
GBP VMED O2 UK FINANCING I PLC-REG-S 4.00000% 20-31.01.29	325 000.00	330 088.68	0.02
GBP VMED O2 UK FINANCING I PLC-REG-S 4.50000% 21-15.07.31	1 090 000.00	1 070 499.92	0.05
英ポンド合計		10 145 885.61	0.48
USD			
USD ALCATEL-LUCENT USA INC 6.45000% 99-15.03.29	1 230 000.00	1 171 575.00	0.05
USD BELO CORP 7.75000% 97-01.06.27	2 594 000.00	2 506 452.50	0.12
USD EDISON INTERNATIONAL 5.37500% 21-PRP	865 000.00	808 066.31	0.04
USD FORD MOTOR CO 6.62500% 98-01.10.28	708 000.00	737 438.64	0.03
USD IHO VERWALTUNGS GMBH-144A (PIK) 6.00000% 19-15.05.27	1 285 000.00	1 193 533.94	0.06
USD INEOS QUATTRO FINANCE 2 PLC-144A 3.37500% 21-15.01.26	1 366 000.00	1 253 769.44	0.06
USD NEW ALBERTSONS LP 7.45000% 99-01.08.29	633 000.00	645 660.00	0.03
USD TELECOM ITALIA CAPITAL 6.00000% 05-30.09.34	415 000.00	332 989.78	0.02
USD VZ SECURED FINANCING BV-144A 5.00000% 22-15.01.32	3 860 000.00	3 305 433.80	0.15
USD YUM BRANDS INC 6.87500% 07-15.11.37	1 310 000.00	1 402 662.85	0.07
米ドル合計		13 357 582.26	0.63
債券、固定利付債合計		298 913 708.99	14.07

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

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
債券、ゼロ・クーポン債			
USD NYRSTAR HOLDINGS PLC-REG-S 0.00000% 19-31.07.26	763 000.00	365 345.87	0.02
米ドル合計		365 345.87	0.02
債券、ゼロ・クーポン債合計			
		365 345.87	0.02
債券、変動利付債			
EUR			
EUR ABN AMRO BANK NV-REG-S-SUB 4.750%/VAR 17-PRP	2 200 000.00	2 114 405.55	0.10
EUR ABN AMRO BANK NV-REG-S-SUB 4.375%/VAR 20-PRP	500 000.00	511 559.96	0.02
EUR ACCOR SA-REG-S-SUB 4.375%/VAR 19-PRP	500 000.00	521 999.07	0.02
EUR APCOA PARKING HOLDINGS GM-REG-S 3M EURIBOR+500BP 21-15.01.27	1 350 000.00	1 392 859.12	0.07
EUR ASSEMBLIN FINANCING AB-REG-S 3M EURIBOR+500BP 19-15.05.25	800 000.00	863 844.17	0.04
EUR BACH BIDCO SPA-REG-S 3M EURIBOR+425BP 21-15.10.28	1 275 000.00	1 305 092.71	0.06
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 5.000%/VAR 21-PRP	1 000 000.00	914 193.45	0.04
EUR BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S 3.250%/VAR 20-PRP	700 000.00	707 018.55	0.03
EUR BURGER KING FRANCE SAS-REG-S 3M EURIBOR+475BP 21-01.11.26	1 500 000.00	1 609 689.01	0.08
EUR CAIXABANK SA-REG-S-SUB 6.750%/VAR 17-PRP	2 000 000.00	2 147 116.51	0.10
EUR HEIMSTADEN BOSTAD AB-REG-S-SUB 3.375%/VAR 20-PRP	277 000.00	184 997.20	0.01
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB 7.750%/VAR 17-PRP	1 500 000.00	1 612 738.63	0.08
EUR ITALMATCH CHEMICALS SPA-REG-S 3M EURIBOR+550BP 23-06.02.28	710 000.00	739 287.81	0.03
EUR KEPLER SPA-REG-S 3M EURIBOR+575BP 22-15.05.29	600 000.00	638 923.21	0.03
EUR LA POSTE SA-REG-S-SUB 3.125%/VAR 18-PRP	1 000 000.00	1 004 596.25	0.05
EUR LIMACORPORATE SPA-REG-S 3M EURIBOR+575BP 23-01.02.28	410 000.00	425 599.10	0.02
EUR PAGANINI BIDCO SPA-REG-S 3M EURIBOR+425BP 21-30.10.28	1 850 000.00	1 969 008.65	0.09
EUR PFLEIDERER GMBH-REG-S EUR003M+475BP 21-15.04.26	750 000.00	749 374.50	0.04
EUR RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S-SUB 3.250%/VAR 19-PRP	2 800 000.00	2 666 904.38	0.13
EUR RIMINI BIDCO SPA-REG-S 3M EURIBOR+525BP 21-14.12.26	1 300 000.00	1 348 331.08	0.06
EUR SCIL IV / SCIL USA REG-S 3M EURIBOR+437.5BP 21-01.11.26	425 000.00	450 031.96	0.02
EUR SES SA-REG-S-SUB 5.625%/VAR 16-PRP	1 000 000.00	1 074 201.20	0.05
EUR SOFIMA HOLDING SPA-REG-S 3M EURIBOR+400BP 20-15.01.28	490 000.00	512 208.34	0.02
EUR SOLVAY FINANCE SA-REG-S-SUB 5.869%/VAR 15-PRP	1 000 000.00	1 091 567.13	0.05
EUR TEAMSYSYSTEM SPA-REG-S 3M EURIBOR+371BP 21-15.02.28	450 000.00	468 196.16	0.02
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 5.875%/VAR 14-PRP	4 000 000.00	4 382 211.75	0.21
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 3.875%/VAR 18-PRP	4 700 000.00	4 761 243.42	0.22
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 4.375%/VAR 19-PRP	800 000.00	850 055.68	0.04
EUR TENDAM BRANDS SAU-REG-S 3M EURIBOR+750BP 22-31.03.28	1 000 000.00	1 058 355.73	0.05
EUR TRIVIMUM PACKAGING FIN BV-REG-S 3M EURIBOR+375BP 19-15.08.26	170 000.00	180 142.03	0.01
EUR UNICREDIT SPA-REG-S-SUB 6.625%/VAR 17-PRP	1 400 000.00	1 507 165.89	0.07
EUR UNICREDIT SPA-REG-S-SUB 5.375%/VAR 17-PRP	1 000 000.00	1 014 099.19	0.05
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 3M EURIBOR+487.5BP 22-01.02.29	200 000.00	193 686.15	0.01
EUR VERTICAL MIDCO GMBH-REG-S 3M EURIBOR+475BP 20-15.07.27	1 503 000.00	1 614 677.85	0.08
EUR VODAFONE GROUP PLC-REG-S-SUB 3.100%/VAR 18-03.01.79	9 297 000.00	9 975 842.76	0.47
EUR VODAFONE GROUP PLC-REG-S-SUB 4.200%/VAR 18-03.10.78	1 000 000.00	1 004 813.46	0.05
EUR WEPA HYGIENEPDUKTE-REG-S 3M EURIBOR+287.5BP 19-15.12.26	425 000.00	429 584.36	0.02
ユーロ合計		53 995 621.97	2.54
GBP			
GBP BARCLAYS PLC-REG-S-SUB 5.875%/VAR 17-PRP	1 300 000.00	1 516 407.43	0.07
英ポンド合計		1 516 407.43	0.07
USD			
USD ALLIANZ SE-REG-S-SUB 3.200%/VAR 21-PRP	200 000.00	161 020.00	0.01
USD ALLY FINANCIAL INC-SUB 4.700%/VAR 21-PRP	530 000.00	435 925.00	0.02
USD BARCLAYS PLC-SUB 7.750%/VAR 18-PRP	1 900 000.00	1 885 693.00	0.09
USD CITIGROUP INC-SUB 5.950%/VAR 15-PRP	365 000.00	355 701.36	0.02
USD DANSKE BANK AS-REG-S-SUB 6.125%/VAR 17-PRP	1 175 000.00	1 144 156.25	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

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD ING GROEP NV-SUB 5.750%/VAR 19-PRP	500 000.00	473 115.00	0.02
USD SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN-REG-S-SUB 5.125%/VAR 19-PRP	600 000.00	568 500.00	0.03
USD VODAFONE GROUP PLC-REG-S-SUB 6.250%/VAR 18-03.10.78	1 455 000.00	1 418 625.00	0.07
米ドル合計		6 442 735.61	0.31
債券、変動利付債合計		61 954 765.01	2.92
転換社債型新株予約権付社債、固定利付債			
CHF			
CHF DUFYR ONE BV-REG-S 0.75000% 21-30.03.26	1 000 000.00	968 235.10	0.05
スイスフラン合計		968 235.10	0.05
転換社債型新株予約権付社債、固定利付債合計		968 235.10	0.05
転換社債型新株予約権付社債、変動利付債			
EUR			
EUR BANCO BILBALO VIZCAYA ARGENT-REG-S-SUB 5.875%/VAR 18-PRP	800 000.00	856 094.11	0.04
EUR BANK OF IRELAND GROUP PLC-REG-S-SUB COCO 7.500%/VAR 20-PRP	260 000.00	281 229.38	0.01
EUR BANK OF IRELAND GROUP PLC-REG-S-SUB COCO 6.000%/VAR 20-PRP	300 000.00	312 547.81	0.02
EUR ERSTE GROUP BANK AG-REG-S-SUB COCO 5.125%/VAR 19-PRP	1 000 000.00	1 005 497.68	0.05
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB COCO 5.875%/VAR 20-PRP	2 125 000.00	2 204 879.70	0.10
ユーロ合計		4 660 248.68	0.22
GBP			
GBP BARCLAYS PLC-REG-S-SUB COCO 6.375%/VAR 19-PRP	500 000.00	576 659.55	0.03
GBP BARCLAYS PLC-SUB COCO 7.125%/VAR 19-PRP	400 000.00	478 385.77	0.02
GBP LEGAL & GENERAL GROUP PLC-REG-S-SUB COCO 5.625%/VAR 20-PRP	900 000.00	963 430.54	0.04
GBP LLOYDS BANKING GROUP PLC-REG-S-SUB 5.125%/VAR 20-PRP	1 350 000.00	1 567 634.12	0.07
GBP NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S-SUB COCO 5.750%/VAR 20-PRP	1 050 000.00	1 190 548.18	0.06
英ポンド合計		4 776 658.16	0.22
USD			
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S-SUB COCO 7.250%/VAR 18-PRP	1 025 000.00	840 500.00	0.04
米ドル合計		840 500.00	0.04
転換社債型新株予約権付社債、変動利付債合計		10 277 406.84	0.48
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		1 075 468 294.76	50.62
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 1011778 BC ULC/NEW RED FINANCE INC-144A 3.87500% 19-15.01.28	760 000.00	694 624.80	0.03
USD 1011778 BC ULC/NEW RED FINANCE IN-144A 4.37500% 19-15.01.28	2 335 000.00	2 148 684.79	0.10
USD 1011778 BC ULC/NEW RED FINANCE INC-144A 5.75000% 20-15.04.25	1 765 000.00	1 762 537.63	0.08
USD 1011778 BC ULC/NEW RED FINANCE INC-144A 4.00000% 20-15.10.30	4 696 000.00	3 997 470.00	0.19
USD 1011778 BC ULC/NEW RED FINANCE INC-144A 3.50000% 20-15.02.29	750 000.00	656 205.66	0.03
USD 1375209 BC LTD-144A 9.00000% 22-30.01.28	1 075 000.00	1 070 979.50	0.05
USD 7-ELEVEN INC-144A 2.80000% 21-10.02.51	835 000.00	550 863.69	0.03
USD ACADIA HEALTHCARE CO INC-144A 5.00000% 20-15.04.29	1 970 000.00	1 842 147.00	0.09
USD ACI WORLDWIDE INC-144A 5.75000% 18-15.08.26	3 377 000.00	3 334 787.50	0.16
USD ACRISURE LLC / FINANCE INC-144A 4.25000% 21-15.02.29	820 000.00	680 600.00	0.03
USD ADAPTHEALTH LLC-144A 5.12500% 21-01.03.30	1 821 000.00	1 620 749.18	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

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD ADT CORP-144A 4.87500% 16-15.07.32	1 767 000.00	1 576 800.58	0.07
USD ADT SECURITY CORP/THE-144A 4.12500% 21-01.08.29	283 000.00	251 940.75	0.01
USD ADTALEM GLOBAL EDUCATION INC-144A 5.50000% 21-01.03.28	900 000.00	837 702.00	0.04
USD AETHON UNITED/AETHON UNITED FIN C-144A-8.25000% 21-15.02.26	1 879 000.00	1 869 605.00	0.09
USD AG ISSUER LLC-144A 6.25000% 20-01.03.28	1 082 000.00	1 022 490.00	0.05
USD AHEAD DB HOLDINGS LLC-144A 6.62500% 21-01.05.28	3 625 000.00	3 063 125.00	0.14
USD AIR CANADA-144A 3.87500% 21-15.08.26	1 008 000.00	932 397.14	0.04
USD ALBERTSONS COS INC / SAFEWAY INC-144A 5.87500% 19-15.02.28	1 543 000.00	1 508 282.50	0.07
USD ALBERTSONS COS LLC / SAFEWAY INC-144A 4.87500% 20-15.02.30	491 000.00	451 639.55	0.02
USD ALBERTSONS COS LLC / SAFEWAY INC-144A 3.50000% 20-15.03.29	430 000.00	370 875.00	0.02
USD ALLEN MEDIA CO-ISS INC-144A 10.50000% 20-15.02.28	1 519 000.00	613 914.80	0.03
USD ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP-144A 4.75000% 19-15.12.24	3 864 000.00	3 506 580.00	0.17
USD ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP-144A 7.00000% 20-15.01.26	1 322 000.00	1 215 908.17	0.06
USD ALLIANT HLDG INTER LLC/CO ISSUER-144A 6.75000% 19-15.10.27	2 952 000.00	2 761 094.16	0.13
USD ALLIED UNIVERSAL HOLDCO/FIN CORP-144A 6.62500% 19-15.07.26	3 296 000.00	3 173 224.00	0.15
USD ALLIED UNIVERSAL HOLDCO LLC-144A 9.75000% 19-15.07.27	3 769 000.00	3 599 395.00	0.17
USD ALLIED UNIVERSAL HOLDCO/FIN CORP-144A 6.00000% 21-01.06.29	1 179 000.00	948 623.40	0.04
USD ALLIED UNIVERSAL HOLDCO LLC-144A 4.62500% 21-01.06.28	765 000.00	659 843.10	0.03
USD ALLISON TRANSMISSION INC-144A 5.87500% 19-01.06.29	1 527 000.00	1 470 149.79	0.07
USD ALTICE FRANCE SA/FRANCE-144A 5.12500% 20-15.01.29	200 000.00	156 752.00	0.01
USD AMERICAN AIRLINES INC-144A 11.75000% 20-15.07.25	1 569 000.00	1 746 383.29	0.08
USD AMERICAN BUILDERS & CONTRAC SUPPLY-144A 3.87500% 21-15.11.29	837 000.00	713 542.50	0.03
USD AMKOR TECHNOLOGY INC-144A 6.62500% 19-15.09.27	425 000.00	426 751.00	0.02
USD AMSTED INDUSTRIES INC-144A 5.62500% 19-01.07.27	703 000.00	690 859.19	0.03
USD AMWINS-144A 4.87500% 21-30.06.29	1 074 000.00	942 074.26	0.04
USD ANGI GROUP LLC-144A 3.87500% 20-15.08.28	770 000.00	590 228.10	0.03
USD ANTERO MIDSTREAM PARTNERS/FIN CORP-144A 5.75000% 19-01.03.27	516 000.00	500 520.00	0.02
USD ANTERO MIDSTREAM PARTNERS/FIN CORP-144A 5.75000% 19-15.01.28	840 000.00	803 250.00	0.04
USD ANTERO MIDSTREAM PARTNERS LP-144A 5.37500% 21-15.06.29	1 200 000.00	1 114 500.00	0.05
USD ANTERO RESOURCES CORP-144A 5.37500% 21-01.03.30	1 023 000.00	953 947.50	0.05
USD ANTERO RESOURCES FIN CORP-144A 7.62500% 21-01.02.29	784 000.00	801 718.59	0.04
USD API ESCROW CORP-144A 4.75000% 21-15.10.29	74 000.00	65 980.51	0.00
USD API GROUP DE INC-144A 4.12500% 21-15.07.29	1 455 000.00	1 259 520.75	0.06
USD APOLLO COMMERCIAL REAL ESTATE FINA-144A 4.62500% 21-15.06.29	3 049 000.00	2 496 368.75	0.12
USD ARAMARK SERVICES INC-144A 5.00000% 17-01.04.25	2 051 000.00	2 020 235.00	0.10
USD ARCHROCK PARTNERS LP/FIN CORP-144A 6.25000% 19-01.04.28	1 408 000.00	1 337 600.00	0.06
USD ARDAGH METAL PACKAGING FINANCE PLC-144A 3.25000% 21-01.09.28	1 083 000.00	950 364.99	0.04
USD ARDAGH METAL PACKAGING FINANCE PLC-144A 4.00000% 21-01.09.29	2 343 000.00	1 937 332.98	0.09
USD ARDAGH PACKAGING FINANCE PLC-144A 5.25000% 20-15.08.27	480 000.00	393 064.80	0.02
USD ARETEC ESCROW ISSUER INC-144A 7.50000% 21-01.04.29	2 623 000.00	2 327 912.50	0.11
USD ARKO CORP-144A 5.12500% 21-15.11.29	1 913 000.00	1 516 435.10	0.07
USD ASBURY AUTOMOTIVE GROUP INC-144A 4.62500% 21-15.11.29	1 834 000.00	1 618 394.96	0.08
USD ASBURY AUTOMOTIVE GROUP INC-144A 5.00000% 21-15.02.32	2 870 000.00	2 475 231.50	0.12
USD ASCENT RESOURCES UTICA HOLDINGS-144A 7.00000% 18-01.11.26	1 786 000.00	1 702 276.70	0.08
USD ASHLAND INC-144A 3.37500% 21-01.09.31	3 080 000.00	2 556 400.00	0.12
USD ASTEROID PRIVATE MERGER SUB INC-144A 8.50000% 21-15.11.29	1 434 000.00	1 222 485.00	0.06
USD ATKORE INC-144A 4.25000% 21-01.06.31	507 000.00	444 867.15	0.02
USD ATLANTICA SUSTAINABLE INFRASTRUCTU-144A 4.12500% 21-15.06.28	1 930 000.00	1 717 700.00	0.08
USD ATS AUTOMATION TOOLING SYSTEMS INC-144A 4.12500% 20-15.12.28	2 642 000.00	2 366 782.86	0.11
USD AXALTA COAT SYS LLC/AXALTA COAT-144A 4.75000% 20-15.06.27	2 080 000.00	1 965 600.00	0.09
USD AXALTA COATING SYSTEMS LLC-144A 3.37500% 20-15.02.29	360 000.00	309 600.00	0.01
USD BAUSCH HEALTH COS INC-144A 11.00000% 22-30.09.28	1 410 000.00	1 103 184.00	0.05
USD BEACON ROOFING SUPPLY INC-144A 4.12500% 21-15.05.29	895 000.00	771 563.39	0.04
USD BEAZER HOMES USA INC 7.25000% 20-15.10.29	1 200 000.00	1 108 500.00	0.05
USD BLOCK COMMUNICATIONS INC-144A 4.87500% 20-01.03.28	1 453 000.00	1 278 640.00	0.06
USD BLUE RACER MIDSTREAM / FINANC CORP-144A 6.62500% 18-15.07.26	2 155 000.00	2 122 675.00	0.10
USD BLUE RACER MIDSTREAM LLC-144A 7.62500% 20-15.12.25	705 000.00	716 015.63	0.03
USD BOMBARDIER INC-144A 7.50000% 23-01.02.29	2 582 000.00	2 579 495.46	0.12

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD BONANZA CREEK ENERGY INC-144A 5.00000% 21-15.10.26	1 782 000.00	1 661 715.00	0.08
USD BOOZ ALLEN HAMILTON INC-144A 4.00000% 21-01.07.29	1 229 000.00	1 101 491.25	0.05
USD BOXER PARENT CO INC-144A 7.12500% 20-02.10.25	2 421 000.00	2 396 853.48	0.11
USD BRINK ' S CO-144A 4.62500% 17-15.10.27	1 202 000.00	1 121 450.62	0.05
USD BRINKER INTERNATIONAL INC-144A 5.00000% 16-01.10.24	1 217 000.00	1 191 004.88	0.06
USD BROADCOM INC-144A 3.13700% 21-15.11.35	720 000.00	558 976.50	0.03
USD BUCKEYE PARTNERS LP-144A 4.50000% 20-01.03.28	1 467 000.00	1 339 000.97	0.06
USD BWAY HOLDING CO-144A 5.50000% 17-15.04.24	538 000.00	537 623.40	0.03
USD BWAY HOLDING CO-144A 7.25000% 17-15.04.25	4 608 000.00	4 498 560.00	0.21
USD BWX TECHNOLOGIES INC-144A 4.12500% 21-15.04.29	456 000.00	408 133.37	0.02
USD C&S GROUP ENTERPRISES LLC-144A 5.00000% 20-15.12.28	2 519 000.00	1 942 778.75	0.09
USD CAESARS ENTERTAINMENT INC-144A 4.62500% 21-15.10.29	1 295 000.00	1 107 225.00	0.05
USD CAESARS ENTERTAINMENT INC-144A 6.25000% 20-01.07.25	4 471 000.00	4 453 777.71	0.21
USD CALIFORNIA RESOURCES CORP-144A 7.12500% 21-01.02.26	1 807 000.00	1 758 662.75	0.08
USD CALPINE CORP-144A 4.50000% 19-15.02.28	617 000.00	569 343.04	0.03
USD CALPINE CORP-144A 5.12500% 19-15.03.28	2 137 000.00	1 934 862.39	0.09
USD CALUMET SPECIALTY PRODUCTS PARTNER-144A 8.12500% 22-15.01.27	1 734 000.00	1 672 992.90	0.08
USD CAMELOT FINANCE SA-144A 4.50000% 19-01.11.26	2 758 000.00	2 623 216.54	0.12
USD CARGO AIRCRAFT MANAGEMENT INC-144A 4.75000% 20-01.02.28	2 274 000.00	2 054 172.42	0.10
USD CARNIVAL CORP-144A 6.00000% 21-01.05.29	2 590 000.00	2 006 654.30	0.09
USD CARRIER GLOBAL CORP 3.37700% 20-05.04.40	695 000.00	559 962.83	0.03
USD CARROLS RESTAURANT GROUP INC-144A 5.87500% 21-01.07.29	300 000.00	230 498.78	0.01
USD CARVANA CO-144A 4.87500% 21-01.09.29	1 499 000.00	667 055.00	0.03
USD CASTLE US HOLDING CORP-144A 9.50000% 20-15.02.28	600 000.00	228 145.36	0.01
USD CASTLELAKE AVIATION FINANCE DAC-144A 5.00000% 21-15.04.27	350 000.00	313 250.00	0.01
USD CATALENT PHARMA SOLUTIONS INC-144A 5.00000% 19-15.07.27	2 762 000.00	2 612 241.35	0.12
USD CBS OUTDOOR AMERICAS CAPITAL LLC-144A 4.62500% 19-15.03.30	375 000.00	322 091.25	0.02
USD CCO HOLDINGS LLC-144A 4.25000% 20-01.02.31	1 150 000.00	958 007.50	0.05
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.50000% 16-01.05.26	1 102 000.00	1 082 781.12	0.05
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.37500% 19-01.06.29	2 015 000.00	1 863 875.00	0.09
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 4.75000% 19-01.03.30	1 178 000.00	1 029 324.62	0.05
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 4.50000% 20-15.08.30	2 872 000.00	2 454 009.12	0.12
USD CCO HOLDINGS LLC/CAP-144A 4.75000% 22-01.02.32	2 012 000.00	1 710 200.00	0.08
USD CD&R SMOKEY BUYER INC-144A 6.75000% 20-15.07.25	2 844 000.00	2 580 930.00	0.12
USD CDI-144A *ESCROW* 5.75000% 22-01.04.30	2 078 000.00	1 968 905.00	0.09
USD CEC ENTERTAINMENT INC-144A 6.75000% 21-01.05.26	2 556 000.00	2 364 300.00	0.11
USD CENTRAL GARDEN & PET CO-144A 4.12500% 21-30.04.31	1 800 000.00	1 509 939.00	0.07
USD CENTURY COMMUNITIES INC-144A 3.87500% 21-15.08.29	600 000.00	504 393.00	0.02
USD CENTURYLINK INC-144A 5.12500% 19-15.12.26	2 441 000.00	2 087 055.00	0.10
USD CHART INDUSTRIES INC-144A 7.50000% 22-01.01.30	1 883 000.00	1 925 367.50	0.09
USD CHART INDUSTRIES INC-144A 9.50000% 22-01.01.31	93 000.00	97 044.57	0.00
USD CHEMOURS CO/THE-144A 5.75000% 20-15.11.28	1 555 000.00	1 416 993.75	0.07
USD CHEMOURS CO/THE-144A 4.62500% 21-15.11.29	1 000 000.00	835 519.90	0.04
USD CHENIERE ENERGY PARTNERS LP 4.00000% 21-01.03.31	350 000.00	314 006.00	0.01
USD CHENIERE ENERGY PARTNERS LP 3.25000% 22-31.01.32	560 000.00	467 504.80	0.02
USD CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC-144A 8.00000% 19-15.03.26	160 000.00	154 456.53	0.01
USD CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC-144A 8.00000% 19-15.12.27	1 000 000.00	942 493.46	0.04
USD CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC-144A 6.87500% 21-15.04.29	1 570 000.00	993 025.00	0.05
USD CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC-144A 4.75000% 21-15.02.31	450 000.00	344 246.67	0.02
USD CHURCHILL DOWNS INC-144A 4.75000% 17-15.01.28	5 820 000.00	5 445 541.20	0.26
USD CHURCHILL DOWNS INC-144A 5.50000% 19-01.04.27	1 576 000.00	1 528 477.71	0.07
USD CINEMARK USA INC-144A 5.87500% 21-15.03.26	360 000.00	323 271.00	0.02
USD CINEMARK USA INC-144A 5.25000% 21-15.07.28	285 000.00	233 608.80	0.01
USD CLARIVATE SCIENCE HOLDINGS CORP-144A 4.87500% 21-01.07.2029	3 619 000.00	3 184 448.57	0.15
USD CLEAN HARBORS INC-144A 6.37500% 23-01.02.31	65 000.00	66 215.50	0.00
USD CLEAR CHANNEL WORLDWIDE HODGS INC-144A 7.50000% 21-01.06.29	350 000.00	285 250.00	0.01
USD CLEARWAY ENERGY OPERATING LLC-144A 3.75000% 21-15.01.32	818 000.00	674 335.44	0.03
USD CLYDESDALE ACQUISITION HOLDINGS-144A 8.75000% 22-15.04.30	2 363 000.00	2 088 378.05	0.10

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD CNX MIDSTREAM PARTNERS LP-144A 4.75000% 21-15.04.30	185 000.00	156 534.05	0.01
USD CNX RESOURCES CORP-144A 7.37500% 26-15.01.31	895 000.00	870 378.55	0.04
USD COBRA ACQUISITIONCO LLC-144A 6.37500% 21-01.11.29	2 412 000.00	1 471 320.00	0.07
USD COLGATE ENERGY PARTNERS III LLC-144A 5.87500% 21-01.07.29	1 057 000.00	990 728.74	0.05
USD COMMSCOPE INC-144A 4.75000% 21-01.09.29	3 206 000.00	2 668 546.16	0.13
USD COMMSCOPE INC-144A 6.00000% 19-01.03.26	3 278 000.00	3 138 193.30	0.15
USD COMMSCOPE INC-144A 8.25000% 19-01.03.27	2 045 000.00	1 739 374.75	0.08
USD COMSTOCK RESOURCES INC-144A 6.75000% 21-01.03.29	725 000.00	668 812.50	0.03
USD CONDUENT BUSINESS SERVICES LLC-144A 6.00000% 21-01.11.29	700 000.00	619 500.00	0.03
USD CONNECT FINCO SARL / US FINCO LLC-144A 6.75000% 19-01.10.26	1 939 000.00	1 854 168.75	0.09
USD CONSENSUS CLOUD SOLUTIONS INC-144A 6.00000% 21-15.10.26	650 000.00	621 167.93	0.03
USD CONSENSUS CLOUD SOLUTIONS INC-144A 6.50000% 21-15.10.28	2 056 000.00	1 924 847.76	0.09
USD COTY INC-144A 5.00000% 21-15.04.26	1 170 000.00	1 120 275.00	0.05
USD CP ATLAS BUYER INC-144A 7.00000% 20-01.12.28	2 701 000.00	2 086 522.50	0.10
USD CQP HOLDCO LP / BIP-V CHINOOK-144A 5.50000% 21-15.06.31	605 000.00	550 922.07	0.03
USD CRESTWOOD MIDSTREAM PART LP/FIN-144A 5.62500% 19-01.05.27	1 028 000.00	982 469.88	0.05
USD CROCS INC-144A 4.12500% 21-15.08.31	1 470 000.00	1 222 495.45	0.06
USD CROCS INC-144A 4.25000% 21-15.03.29	2 100 000.00	1 829 625.00	0.09
USD CROWN AMERICAS LLC 5.25000% 23-01.04.30	2 713 000.00	2 611 262.50	0.12
USD CROWNROCK LP / CROWNROCK FIN INC-144A 5.62500% 17-15.10.25	2 842 000.00	2 770 950.00	0.13
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 7.50000% 18-01.04.28	503 000.00	367 823.78	0.02
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 3.37500% 20-15.02.31	736 000.00	513 360.00	0.02
USD CTR PAR LP/CARETRUST CAP CORP-144A 3.87500% 21-30.06.28	426 000.00	381 444.66	0.02
USD CUSHMAN & WAKEFIELD US BORROWER-144A 6.75000% 20-15.05.28	3 841 000.00	3 707 832.53	0.17
USD DAVE & BUSTER ' S INC-144A 7.62500% 20-01.11.25	2 706 000.00	2 750 243.10	0.13
USD DAVITA INC-144A 4.62500% 20-01.06.30	1 446 000.00	1 218 255.00	0.06
USD DCP MIDSTREAM OPERATING LP-144A 6.75000% 07-15.09.37	750 000.00	821 587.50	0.04
USD DCP MIDSTREAM OPERATING LP 5.62500% 20-15.07.27	509 000.00	516 592.45	0.02
USD DEALER TIRE LLC / DT ISSUER LLC-144A 8.00000% 20-01.02.28	594 000.00	546 967.53	0.03
USD DELEK LOGISTICS PARTNERS LP-144A 7.12500% 21-01.06.28	1 573 000.00	1 442 819.40	0.07
USD DELUXE CORP-144A 8.00000% 21-01.06.29	1 612 000.00	1 380 275.00	0.06
USD DIAMOND SPORTS GROUP LLC-144A 6.62500% 19-15.08.27	570 000.00	10 260.00	0.00
USD DIAMOND SPORTS GROUP LLC-144A 5.37500% 22-15.08.26	910 000.00	67 112.50	0.00
USD DIRECTV FINANCING CO INC-144A 5.87500% 21-15.08.27	949 000.00	859 608.95	0.04
USD DISH DBS CORP 7.75000% 16-01.07.26	1 070 000.00	869 011.20	0.04
USD DISH DBS CORP-144A 5.25000% 21-01.12.26	585 000.00	504 196.88	0.02
USD DISH NETWORK CORP-144A 11.75000% 22-15.11.27	1 230 000.00	1 278 216.00	0.06
USD DKT FINANCE APS-144A 9.37500% 18-17.06.23	500 000.00	500 140.00	0.02
USD DPL INC 4.35000% 20-15.04.29	536 000.00	489 572.98	0.02
USD DUN & BRADSTREET CORP-144A 5.00000% 21-15.12.29	1 709 000.00	1 513 320.89	0.07
USD DYCOM INDUSTRIES INC-144A 4.50000% 21-15.04.29	2 292 000.00	2 051 913.00	0.10
USD EDGEWELL PERSONAL CARE CO-144A 5.50000% 20-01.06.28	1 085 000.00	1 027 505.85	0.05
USD EG GLOBAL FINANCE PLC-144A 6.75000% 19-07.02.25	1 421 000.00	1 319 753.75	0.06
USD EG GLOBAL FINANCE PLC-144A 8.50000% 19-30.10.25	995 000.00	937 787.50	0.04
USD ELASTIC NV-144A 4.12500% 21-15.07.29	445 000.00	380 816.54	0.02
USD ELDORADO GOLD CORP-144A 6.25000% 21-01.09.29	1 900 000.00	1 738 500.00	0.08
USD EMBECTA CORP 144A 5.00000% 22-15.02.30	1 298 000.00	1 069 227.50	0.05
USD ENCINO ACQUISITION PARTNERS HOLDIN-144A 8.50000% 21-01.05.28	1 789 000.00	1 667 902.97	0.08
USD ENERFLEX LTD-144A 9.00000% 22-15.10.27	1 986 000.00	2 022 780.72	0.10
USD ENERGEAN PLC-144A 6.50000% 21-30.04.27	613 000.00	572 351.97	0.03
USD ENERGIZER HOLDINGS INC-144A 4.12500% 21-01.04.29	1 238 000.00	1 078 607.50	0.05
USD ENERGIZER HOLDINGS INC-144A 4.75000% 20-15.06.28	2 678 000.00	2 396 810.00	0.11
USD ENERGIZER HOLDINGS INC-144A 4.37500% 20-31.03.29	400 000.00	347 368.00	0.02
USD ENERGIZER HOLDINGS INC-144A 6.50000% 22-31.12.27	2 900 000.00	2 828 225.00	0.13
USD ENERSYS-144A 4.37500% 19-15.12.27	1 455 000.00	1 344 056.25	0.06
USD ENOVA INTERNATIONAL INC-144A 8.50000% 17-01.09.24	425 000.00	412 781.25	0.02
USD ENTEGRIS ESCROW CORP-144A 4.75000% 22-15.04.29	1 135 000.00	1 063 765.77	0.05
USD ENTERCOM MEDIA CORP-144A 6.50000% 19-01.05.27	145 000.00	23 922.61	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

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD EQM MIDSTREAM PARTNERS LP-144A 7.50000% 22-01.06.27	725 000.00	724 983.84	0.03
USD EQT CORP-144A 3.62500% 21-15.05.31	600 000.00	525 168.00	0.02
USD EVERI HOLDINGS INC-144A 5.00000% 21-15.07.29	430 000.00	389 085.50	0.02
USD FAIR ISAAC CORP-144A 4.00000% 19-15.06.28	3 421 000.00	3 176 415.61	0.15
USD FERRELLGAS LP / FERRELLGAS FINANCE-144A 5.37500% 21-01.04.26	1 619 000.00	1 489 480.00	0.07
USD FIRSTCASH INC-144A 4.62500% 20-01.09.28	1 663 000.00	1 494 621.25	0.07
USD FIRSTCASH INC-144A 5.62500% 21-01.01.30	3 830 000.00	3 504 189.94	0.17
USD FMG RESOURCES AUGUST 2006 PTY LTD-144A 4.50000% 19-15.09.27	1 491 000.00	1 422 858.31	0.07
USD FMG RESOURCES AUGUST 2006 PTY-144A 5.87500% 22-15.04.30	218 000.00	212 005.00	0.01
USD FMG RESOURCES AUGUST 2006 PTY-144A 6.12500% 22-15.04.32	3 088 000.00	2 999 394.17	0.14
USD FOOT LOCKER INC-144A 4.00000% 21-01.10.29	900 000.00	760 932.00	0.04
USD FORESTAR GROUP INC-144A 3.85000% 21-15.05.26	700 000.00	623 766.45	0.03
USD FREEDOM MORTGAGE CORP-144A 8.25000% 18-15.04.25	3 372 000.00	3 206 209.01	0.15
USD FREEDOM MORTGAGE CORP-144A 6.62500% 21-15.01.27	2 164 000.00	1 800 707.68	0.09
USD FRONTIER COMMUNICATIONS CORP-144A 5.00000% 20-01.05.28	655 000.00	595 493.25	0.03
USD FRONTIER COMMUNICATIONS CORP-144A 6.75000% 20-01.05.29	4 000 000.00	3 430 000.00	0.16
USD FRONTIER COMMUNICATIONS HOLDINGS 5.87500% 21-01.11.29	640 000.00	521 766.40	0.02
USD FRONTIER COMMUNICATIONS HOLDINGS L-144A 6.00000% 21-15.01.30	1 260 000.00	1 035 001.80	0.05
USD FULL HOUSE RESORTS INC COM-144A 8.25000% 21-15.02.28	300 000.00	279 660.00	0.01
USD GARDA WORLD SECURITY CORP-144A 9.50000% 19-01.11.27	3 910 000.00	3 861 470.96	0.18
USD GARDA WORLD SECURITY CORP-144A 4.62500% 20-15.02.27	948 000.00	862 784.28	0.04
USD GARDA WORLD SECURITY CORP-144A 6.00000% 21-01.06.29	2 816 000.00	2 350 515.20	0.11
USD GARDA WORLD SECURITY CORP-144A 7.75000% 23-15.02.28	110 000.00	111 512.50	0.01
USD GARTNER INC-144A 3.62500% 21-15.06.29	5 001 000.00	4 490 898.00	0.21
USD GENESIS ENERGY LP / GENESI ERGY FINANCE 8.87500% 23-15.04.30	1 914 000.00	1 945 102.50	0.09
USD GENWORTH MORTGAGE HOLDINGS INC-144A 6.50000% 20-15.08.25	1 362 000.00	1 341 570.00	0.06
USD GETTY IMAGES INC-144A 9.75000% 19-01.03.27	4 835 000.00	4 786 650.00	0.23
USD GFL ENVIRONMENTAL INC-144A 5.12500% 19-15.12.26	1 712 000.00	1 665 348.00	0.08
USD GLATFELTER CORP-144A 4.75000% 21-15.11.29	1 217 000.00	851 900.00	0.04
USD GLOBAL AIRCRAFT LEASING CO-144A (PIK) 6.50000% 19-15.09.24	736 188.00	671 833.23	0.03
USD GLOBAL INFRASTRUCTURE SOLUTION INC-144A 5.62500% 21-01.06.29	893 000.00	732 260.00	0.03
USD GLOBAL MEDICAL RESPONSE INC-144A 6.50000% 20-01.10.25	510 000.00	358 642.20	0.02
USD GLOBAL PARTNERS LP / GLP FINANCE CORP 6.87500% 21-15.01.29	2 118 000.00	1 998 756.60	0.09
USD GO DADDY OPRTRNG CO LLC/GD FNE INC-144A-3.50000% 21-01.03.29	550 000.00	475 640.00	0.02
USD GOEASY LTD-144A 4.37500% 21-01.05.26	932 000.00	831 741.21	0.04
USD GOODYEAR TIRE & RUBBER CO 5.25000% 22-15.07.31	386 000.00	326 085.08	0.02
USD GREYSTAR REAL ESTATE PARTNERS LLC-144A 5.75000% 17-01.12.25	4 172 000.00	4 102 869.91	0.19
USD GRIFFON CORP 5.75000% 20-01.03.28	2 600 000.00	2 460 692.00	0.12
USD GROUP 1 AUTOMOTIVE INC-144A 4.00000% 20-15.08.28	2 200 000.00	1 934 812.00	0.09
USD GRUBHUB HOLDINGS INC-144A 5.50000% 19-01.07.27	1 139 000.00	911 012.75	0.04
USD GYP HOLDINGS III CORP-144A 4.62500% 21-01.05.29	861 000.00	725 973.80	0.03
USD H&E EQUIPMENT SERVICES INC-144A 3.87500% 20-15.12.28	459 000.00	403 947.54	0.02
USD HARSCO CORP-144A 5.75000% 19-31.07.27	1 582 000.00	1 338 767.50	0.06
USD HAT HOLDINGS I LLC / II LLC-144A 3.37500% 21-15.06.26	1 693 000.00	1 502 537.50	0.07
USD HAWAIIAN BRAND INTELLECTUAL PROP-144A 5.75000% 21-20.01.26	910 031.00	869 070.51	0.04
USD HEALTHEQUITY INC-144A 4.50000% 21-01.10.29	2 908 000.00	2 603 532.40	0.12
USD HERBALIFE NTRTON LTD/HLF FING INC-144A 7.87500% 20-01.09.25	823 000.00	771 835.30	0.04
USD HERC HOLDINGS INC-144A 5.50000% 19-15.07.27	418 000.00	400 235.00	0.02
USD HESS MIDSTREAM PARTNERS LP-144A 5.12500% 19-15.06.28	408 000.00	384 226.50	0.02
USD HILCORP ENERGY I LP/FINANCE CO-144A 5.75000% 21-01.02.29	1 667 000.00	1 550 310.00	0.07
USD HILTON DOMESTIC OPERATING CO INC-144A 3.75000% 20-01.05.29	4 220 000.00	3 747 824.20	0.18
USD HILTON DOMESTIC OPERATING CO INC-144A 3.62500% 21-15.02.32	1 736 000.00	1 457 806.00	0.07
USD HILTON GRAND VACATIONS BORROWER-144A 5.00000% 21-01.06.29	1 179 000.00	1 054 438.65	0.05
USD HILTON GRAND VACATIONS BORROWER-144A 4.87500% 21-01.07.31	1 856 000.00	1 609 486.08	0.08
USD HLF FIN SARL/HERBALIFE INTL INC-144A 4.87500% 21-01.06.29	2 574 000.00	1 882 237.50	0.09
USD HOLLY ENERGY PARTNERS LP FIN CORP-144A 5.00000% 20-01.02.28	4 262 000.00	3 968 987.50	0.19
USD HOLLY ENERGY PARTNERS LP / HOLLY E-144A 6.37500% 22-15.04.27	1 106 000.00	1 093 557.50	0.05
USD HOLOGIC INC-144A 3.25000% 20-15.02.29	680 000.00	598 270.80	0.03

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD HOSPITALITY PROPERTIES TRUST 4.50000% 14-15.03.25	1 400 000.00	1 267 098.00	0.06
USD HOWARD HUGHES CORP-144A 5.37500% 20-01.08.28	900 000.00	833 751.00	0.04
USD HOWARD HUGHES CORP/THE-144A 4.12500% 21-01.02.29	1 050 000.00	906 696.00	0.04
USD HOWARD HUGHES CORP/THE-144A 4.37500% 21-01.02.31	3 983 000.00	3 309 608.61	0.16
USD HOWARD MIDSTREAM ENERGY PARTNERS-144A 6.75000% 21-15.01.27	1 973 000.00	1 923 675.00	0.09
USD HUB INTERNATIONAL LTD-144A 7.00000% 18-01.05.26	2 904 000.00	2 875 047.12	0.14
USD HUDBAY MINERALS INC-144A 4.50000% 21-01.04.26	449 000.00	413 241.64	0.02
USD HUGHES SATELLITE SYSTEMS CORP 6.62500% 17-01.08.26	1 539 000.00	1 488 397.68	0.07
USD HUSKY III HOLDING LTD-144A (PIK) 13.00000% 20-15.02.25	378 000.00	350 330.40	0.02
USD ICAHN ENTERPRISES LP / ICAHN ENTER FIN 4.37500% 21-01.02.29	3 210 000.00	2 795 308.13	0.13
USD IHEARTCOMMUNICATIONS INC 8.37500% 19-01.05.27	1 250 000.00	1 120 312.50	0.05
USD II-VI INC-144A 5.00000% 21-15.12.29	1 036 000.00	940 847.28	0.04
USD ILIAD HOLDING SASU-144A 7.00000% 21-15.10.28	1 822 000.00	1 711 185.96	0.08
USD IMOLA MERGER CORP-144A 4.75000% 21-15.05.29	2 548 000.00	2 216 760.00	0.10
USD INDEPENDENCE ENERGY FINANCE LLC-144A 7.25000% 21-01.05.26	3 395 000.00	3 259 200.00	0.15
USD INDIGO MERGER SUB INC-144A 2.87500% 21-15.07.26	290 000.00	265 399.30	0.01
USD INGLES MARKETS INC-144A 4.00000% 21-15.06.31	1 350 000.00	1 163 199.15	0.05
USD INTELLIGENT PACKGING LTD FINCO INC-144A 6.00000% 20-15.09.28	2 123 000.00	1 875 305.22	0.09
USD INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC-144A 5.25000% 20-15.01.29	683 000.00	655 475.10	0.03
USD ION TRADING TECHNOLOGIES SARL-144A 5.75000% 21-15.05.28	3 296 000.00	2 822 200.00	0.13
USD IQVIA INC-144A 5.00000% 19-15.05.27	2 450 000.00	2 377 504.01	0.11
USD IRON MOUNTAIN INC-144A 4.87500% 19-15.09.29	370 000.00	334 159.95	0.02
USD IRON MOUNTAIN INC-144A 4.50000% 20-15.02.31	1 355 000.00	1 161 085.95	0.05
USD ITT HOLDINGS LLC-144A 6.50000% 21-01.08.29	1 884 000.00	1 636 725.00	0.08
USD JEFFERIES FINANCE LLC / JFIN CO-144A 5.00000% 21-15.08.28	620 000.00	525 850.29	0.03
USD JELD-WEN INC-144A 6.25000% 20-15.05.25	1 902 000.00	1 822 207.41	0.09
USD KAR AUCTION SERVICES INC-144A 5.12500% 17-01.06.25	801 000.00	787 366.98	0.04
USD KBR INC-144A 4.75000% 20-30.09.28	1 097 000.00	990 417.64	0.05
USD KEN GARFF AUTOMOTIVE LLC-144A 4.87500% 20-15.09.28	2 380 000.00	2 049 775.00	0.10
USD KENNEDY-WILSON INC 4.75000% 21-01.03.29	1 761 000.00	1 479 240.00	0.07
USD KORN FERRY-144A 4.62500% 19-15.12.27	796 000.00	748 240.00	0.04
USD KRONOS ACQUISITION HOLDINGS INC-144A 7.00000% 20-31.12.27	1 066 000.00	929 019.00	0.04
USD LABL ESCROW ISSUER LLC-144A 10.50000% 19-15.07.27	4 010 000.00	3 814 512.50	0.18
USD LABL ESCROW ISSUER LLC-144A 6.75000% 19-15.07.26	2 298 000.00	2 227 669.71	0.11
USD LABL INC-144A 5.87500% 21-01.11.28	2 674 000.00	2 416 627.50	0.11
USD LADDER CAPITAL FIN HLDG LLLP/CORP-144A 4.25000% 20-01.02.27	1 471 000.00	1 296 318.75	0.06
USD LAMAR MEDIA CORP 3.75000% 20-15.02.28	571 000.00	518 274.66	0.02
USD LAMB WESTON HOLDINGS INC-144A 4.87500% 20-15.05.28	2 000 000.00	1 934 335.00	0.09
USD LAMB WESTON HOLDINGS INC-144A 4.12500% 21-31.01.30	1 800 000.00	1 622 250.00	0.08
USD LAMB WESTON HOLDINGS INC-144A 4.37500% 21-31.01.32	1 170 000.00	1 047 816.90	0.05
USD LCM INVESTMENTS HOLDINGS II LLC-144A 4.87500% 21-01.05.29	2 539 000.00	2 095 309.75	0.10
USD LD HOLDINGS GROUP LLC-144A 6.50000% 20-01.11.25	2 030 000.00	1 557 558.10	0.07
USD LEVEL 3 FINANCING INC-144A 4.62500% 19-15.09.27	783 000.00	663 285.17	0.03
USD LEVEL 3 FINANCING INC-144A 3.87500% 19-15.11.29	285 000.00	231 112.20	0.01
USD LEVEL 3 FINANCING INC-144A 4.25000% 20-01.07.28	2 552 000.00	2 022 434.48	0.10
USD LEVEL 3 FINANCING INC-144A 3.62500% 20-15.01.29	342 000.00	254 448.00	0.01
USD LFS TOPCO LLC-144A 5.87500% 21-15.10.26	1 155 000.00	955 450.65	0.04
USD LGI HOMES INC-144A 4.00000% 21-15.07.29	1 719 000.00	1 392 390.00	0.07
USD LIFE TIME INC-144A 8.00000% 21-15.04.26	4 620 000.00	4 487 105.70	0.21
USD LIFEPOINT HEALTH INC-144A 4.37500% 20-15.02.27	1 398 000.00	1 223 250.00	0.06
USD LIONS GATE CAPITAL HOLDINGS LLC-144A 5.50000% 21-15.04.29	3 332 000.00	2 165 800.00	0.10
USD LITHIA MOTORS INC-144A 3.87500% 21-01.06.29	457 000.00	388 303.76	0.02
USD LIVE NATION ENTERTAINMENT INC-144A 4.87500% 16-01.11.24	1 709 000.00	1 659 700.77	0.08
USD LIVE NATION ENTERTAINMENT INC-144A 6.50000% 20-15.05.27	1 020 000.00	1 025 648.76	0.05
USD LIVE NATION ENTERTAINMENT INC-144A 3.75000% 21-15.01.28	680 000.00	604 987.50	0.03
USD LOGAN MERGER SUB INC-144A 5.50000% 20-01.09.27	2 309 000.00	1 189 135.00	0.06
USD LOUISIANA-PACIFIC CORP-144A 3.62500% 21-15.03.29	1 376 000.00	1 191 167.71	0.06
USD LPL HOLDINGS INC-144A 4.00000% 21-15.03.29	2 338 000.00	2 092 510.00	0.10

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD LPL HOLDINGS INC-144A 4.37500% 21-15.05.31	117 000.00	102 446.37	0.00
USD LSF11 A5 HOLDCO LLC-144A 6.62500% 21-15.10.29	1 655 000.00	1 358 085.09	0.06
USD LUMEN TECHNOLOGIES INC-144A 5.37500% 21-15.06.29	3 146 000.00	2 179 308.57	0.10
USD M/I HOMES INC 3.95000% 21-15.02.30	1 020 000.00	858 085.20	0.04
USD M/I HOMES INC 4.95000% 20-01.02.28	970 000.00	894 669.80	0.04
USD MACY ' S RETAIL HOLDINGS-144A 5.87500% 22-15.03.30	800 000.00	730 216.00	0.03
USD MADISON IAQ LLC-144A 5.87500% 21-30.06.29	1 280 000.00	1 015 347.20	0.05
USD MAGALLANES INC-144A 3.42800% 22-15.03.24	705 000.00	690 008.85	0.03
USD MAJORDRIVE HOLDINGS IV LLC-144A 6.37500% 21-01.06.29	2 940 000.00	2 323 041.00	0.11
USD MANITOWOC CO INC/THE-144A 9.00000% 19-01.04.26	615 000.00	605 006.25	0.03
USD MARRIOTT OWNERSHIP RESORTS INC 4.75000% 20-15.01.28	1 906 000.00	1 720 165.00	0.08
USD MARRIOTT OWNERSHIP RESORTS INC-144A 4.50000% 21-15.06.29	405 000.00	352 556.22	0.02
USD MASONITE INTERNATIONAL CORP-144A 5.37500% 19-01.02.28	725 000.00	678 614.50	0.03
USD MASONITE INTERNATIONAL CORP-144A 3.50000% 21-15.02.30	492 000.00	406 110.38	0.02
USD MATCH GROUP HOLDINGS II LLC-144A 4.62500% 20-01.06.28	424 000.00	389 982.48	0.02
USD MATCH GROUP HOLDINGS II LLC-144A 3.62500% 21-01.10.31	215 000.00	172 537.50	0.01
USD MATTAMY GROUP CORP-144A 5.25000% 19-15.12.27	1 207 000.00	1 104 405.00	0.05
USD MATTHEWS INTERNATIONAL CORP-144A 5.25000% 17-01.12.25	3 986 000.00	3 801 647.50	0.18
USD MAUSER PACKAGING SOLUTIONS HOLDING-144A 7.87500% 23-15.08.26	3 206 000.00	3 234 052.50	0.15
USD MAV ACQUISITION CORP-144A 8.00000% 21-01.08.29	2 316 000.00	1 985 970.00	0.09
USD MCAFEE CORP-144A 7.37500% 22-15.02.30	4 859 000.00	4 035 872.28	0.19
USD MERITAGE HOMES CORP-144A 3.87500% 21-15.04.29	2 850 000.00	2 525 812.50	0.12
USD METIS MERGER SUB LLC-144A 6.50000% 21-15.05.29	1 495 000.00	1 274 487.50	0.06
USD MIDAS OPCO HOLDINGS LLC-144A 5.62500% 21-15.08.29	2 482 000.00	2 174 852.50	0.10
USD MINERAL RESOURCES LTD-144A 8.12500% 19-01.05.27	175 000.00	176 312.50	0.01
USD MINERALS TECHNOLOGIES INC-144A 5.00000% 20-01.07.28	3 513 000.00	3 212 638.50	0.15
USD MOOG INC-144A 4.25000% 19-15.12.27	1 089 000.00	1 010 047.50	0.05
USD MOZART DEBT MERGER SUB INC-144A 3.87500% 21-01.04.29	3 705 000.00	3 167 830.58	0.15
USD MOZART DEBT MERGER SUB INC-144A 5.25000% 21-01.10.29	1 352 000.00	1 132 009.60	0.05
USD MPH ACQUISITION HOLDINGS LLC-144A 5.75000% 20-01.11.28	2 823 000.00	2 050 203.75	0.10
USD MSCI INC-144A 3.87500% 20-15.02.31	440 000.00	388 330.80	0.02
USD MSCI INC-144A 4.00000% 19-15.11.29	200 000.00	182 000.00	0.01
USD MUELLER WATER PRODUCTS INC-144A 4.00000% 21-15.06.29	616 000.00	546 343.74	0.03
USD MURPHY OIL USA INC-144A 3.75000% 21-15.02.31	1 370 000.00	1 146 243.05	0.05
USD NABORS INDUSTRIES INC-144A 9.00000% 20-01.02.25	872 000.00	887 000.47	0.04
USD NABORS INDUSTRIES INC-144A 7.37500% 21-15.05.27	1 754 000.00	1 756 280.20	0.08
USD NABORS INDUSTRIES LTD-144A 7.25000% 20-15.01.26	823 000.00	795 939.76	0.04
USD NABORS INDUSTRIES LTD-144A 7.50000% 20-15.01.28	2 632 000.00	2 516 850.00	0.12
USD NATIONAL FINANCIAL PARTNERS CORP-144A 4.87500% 21-15.08.28	879 000.00	767 129.67	0.04
USD NATIONSTAR MORTGAGE HOLDINGS INC-144A 5.50000% 20-15.08.28	2 580 000.00	2 254 171.80	0.11
USD NATIONSTAR MORTGAGE HOLDINGS INC-144A 5.12500% 20-15.12.30	1 000 000.00	810 000.00	0.04
USD NATIONSTAR MORTGAGE HOLDINGS INC-144A 5.75000% 21-15.11.31	690 000.00	555 450.00	0.03
USD NCL CORP LTD-144A 3.62500% 19-15.12.24	2 017 000.00	1 871 150.73	0.09
USD NCL CORP LTD-144A 5.87500% 20-15.03.26	2 445 000.00	2 107 687.80	0.10
USD NCL CORP LTD-144A 7.75000% 22-15.02.29	230 000.00	195 428.70	0.01
USD NCR CORP-144A 5.12500% 21-15.04.29	4 162 000.00	3 625 327.75	0.17
USD NCR ESCROW CORP-144A 5.00000% 20-01.10.28	2 329 000.00	2 051 522.94	0.10
USD NEPTUNE BIDCO UNITED STATE INCORP-144A 9.29000% 22-15.04.29	714 000.00	694 029.42	0.03
USD NESCO HOLDINGS II INC-144A 5.50000% 21-15.04.29	3 153 000.00	2 831 740.83	0.13
USD NEW ENTERPRISE STONE&LIME CO INC-144A 5.25000% 21-15.07.28	1 676 000.00	1 542 841.80	0.07
USD NEW GOLD INC-144A 7.50000% 20-15.07.27	500 000.00	463 900.61	0.02
USD NEW RESIDENTIAL INVESTMENT CORP-144A 6.25000% 20-15.10.25	2 130 000.00	1 983 562.50	0.09
USD NEWELL BRANDS INC 6.62500% 22-15.09.29	1 254 000.00	1 267 665.24	0.06
USD NEWS CORP-144A 3.87500% 21-15.05.29	1 245 000.00	1 114 001.10	0.05
USD NEXSTAR BROADCASTING INC-144A 5.62500% 19-15.07.27	2 492 000.00	2 373 804.44	0.11
USD NMI HOLDINGS INC-144A 7.37500% 20-01.06.25	1 026 000.00	1 037 593.80	0.05
USD NORTHERN OIL AND GAS INC-144A 8.12500% 21-01.03.28	2 051 000.00	2 042 960.08	0.10
USD NORTHWEST FIBER LLC / FINANCE-144A 6.00000% 21-15.02.28	1 786 000.00	1 474 396.58	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

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD NOVA CHEMICALS CORP-144A 4.87500% 17-01.06.24	175 000.00	172 375.00	0.01
USD NOVELIS CORP-144A 4.75000% 20-30.01.30	1 500 000.00	1 357 500.00	0.06
USD NUFARM AUSTRALIA LTD-144A 5.00000% 22-27.01.30	3 268 000.00	2 961 171.08	0.14
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 7.87500% 19-15.09.31	1 900 000.00	2 151 921.00	0.10
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 6.45000% 19-15.09.36	3 052 000.00	3 209 574.76	0.15
USD OLYMPUS WATER US HOLDING CORP-144A 4.25000% 21-01.10.28	3 072 000.00	2 576 832.01	0.12
USD OPEN TEXT CORP / OPEN TEXT-144A 3.87500% 21-01.12.29	1 408 000.00	1 170 963.33	0.06
USD OPEN TEXT CORP / OPEN TEXT-144A 4.12500% 21-01.12.31	2 345 000.00	1 905 171.80	0.09
USD OPEN TEXT CORP-144A 3.87500% 20-15.02.28	3 385 000.00	2 941 429.60	0.14
USD ORGANON FINANCE 1 LLC-144A 4.12500% 21-30.04.28	1 169 000.00	1 057 302.05	0.05
USD ORGANON FINANCE 1 LLC-144A 5.12500% 21-30.04.31	3 401 000.00	3 070 388.79	0.14
USD OUTFRONT MEDIA CAPITAL LLC/CORP-144A 5.00000% 19-15.08.27	1 925 000.00	1 770 736.09	0.08
USD OUTFRONT MEDIA CAPITAL LLC/CORP-144A 6.25000% 20-15.06.25	1 090 000.00	1 096 529.10	0.05
USD OWENS-BROCKWAY GLASS CONTAINER INC-144A 6.62500% 20-13.05.27	2 135 000.00	2 093 160.00	0.10
USD P&L DEVELOPMENT LLC / PLD FIN-144A 7.75000% 20-15.11.25	1 708 000.00	1 390 673.94	0.07
USD PARK INTERMEDIATE HOLDINGS/PK DOME-144A 5.87500% 20-01.10.28	1 866 000.00	1 726 740.42	0.08
USD PARK INTERMEDIATE HOLDINGS LLC-144A 4.87500% 21-15.05.29	2 669 000.00	2 307 352.21	0.11
USD PARK RIVER HOLDINGS INC-144A 6.75000% 21-01.08.29	1 459 000.00	1 035 890.00	0.05
USD PARKLAND CORP-144A 4.50000% 21-01.10.29	540 000.00	463 207.51	0.02
USD PARKLAND CORP-144A 4.62500% 21-01.05.30	320 000.00	275 072.58	0.01
USD PATRICK INDUSTRIES INC-144A 4.75000% 21-01.05.29	1 550 000.00	1 325 017.50	0.06
USD PATTERN ENERGY OPERATIONS LP/INC-144A 4.50000% 20-15.08.28	1 427 000.00	1 309 272.50	0.06
USD PATTERSON UTI ENERGY INC 5.15000% 19-15.11.29	2 067 000.00	1 931 087.00	0.09
USD PAYSAFE FINANCE PLC/HOLDINGS US-144A 4.00000% 21-15.06.29	1 399 000.00	1 112 205.00	0.05
USD PENNYMAC FINANCIAL SERVICES INC-144A 5.75000% 21-15.09.31	2 810 000.00	2 361 792.64	0.11
USD PERFORMANCE FOOD GROUP INC-144A 5.50000% 19-15.10.27	892 000.00	858 545.70	0.04
USD PERFORMANCE FOOD GROUP INC-144A 6.87500% 20-01.05.25	1 279 000.00	1 288 912.25	0.06
USD PERFORMANCE FOOD GROUP INC-144A 4.25000% 21-01.08.29	1 251 000.00	1 116 204.75	0.05
USD PGT ESCROW ISSUER INC-144A 4.37500% 21-01.10.29	2 523 000.00	2 176 667.79	0.10
USD PICARD MIDCO INC-144A 6.50000% 22-31.03.29	1 258 000.00	1 104 007.08	0.05
USD PICASSO FINANCE SUB INC-144A 6.12500% 20-15.06.25	824 000.00	828 054.08	0.04
USD PIKE CORP-144A 5.50000% 20-01.09.28	3 234 000.00	2 854 510.96	0.13
USD PITNEY BOWES INC-144A 6.87500% 21-15.03.27	400 000.00	335 366.00	0.02
USD PMHC II INC-144A 9.00000% 22-15.02.30	550 000.00	423 865.31	0.02
USD POLAR US BORROWER LLC-144A 6.75000% 21-15.05.26	546 000.00	245 700.00	0.01
USD POLYONE CORP -144A 5.75000% 20-15.05.25	448 000.00	443 365.70	0.02
USD POST HOLDINGS INC-144A 5.75000% 17-01.03.27	1 175 000.00	1 157 469.00	0.05
USD POST HOLDINGS INC-144A 5.50000% 19-15.12.29	1 750 000.00	1 622 903.54	0.08
USD POST HOLDINGS INC-144A 4.62500% 20-15.04.30	3 964 000.00	3 488 320.00	0.16
USD PRA GROUP INC-144A 5.00000% 21-01.10.29	2 990 000.00	2 566 431.16	0.12
USD PRECISION DRILLING CORP-144A 6.87500% 21-15.01.29	2 960 000.00	2 851 190.40	0.13
USD PREMIER ENTMT-144A 5.625000 21-01.09.29	435 000.00	312 656.73	0.01
USD PRESIDIO HOLDINGS INC-144A 8.25000% 20-01.02.28	1 162 000.00	1 116 972.50	0.05
USD PRIME SEC SER BORROWER LLC/FIN INC-144A 5.75000% 19-15.04.26	1 386 000.00	1 358 334.76	0.06
USD PRIME SEC SER BORROWER LLC/FIN INC-144A 6.25000% 20-15.01.28	434 000.00	411 605.60	0.02
USD PRIME SEC SER BORROWER LLC/FIN INC-144A 3.37500% 20-31.08.27	1 055 000.00	936 155.01	0.04
USD PROG HOLDINGS INC-144A 6.00000% 21-15.11.29	1 557 000.00	1 319 557.50	0.06
USD QUICKEN LOANS LLC-144A 3.62500% 20-01.03.29	1 179 000.00	994 710.51	0.05
USD RACKSPACE TECHNOLOGY GLOBAL INC-144A 5.37500% 20-01.12.28	1 784 000.00	657 296.96	0.03
USD RACKSPACE TECHNOLOGY GLOBAL INC-144A 3.50000% 21-15.02.28	1 406 000.00	845 357.50	0.04
USD RANGE RESOURCES CORP-144A 4.75000% 22-15.02.30	130 000.00	116 448.06	0.01
USD REGAL REXNORD CORP-144A 6.05000% 23-15.02.26	515 000.00	523 355.49	0.02
USD RENT-A-CENTER INC/TX-144A 6.37500% 21-15.02.29	1 461 000.00	1 241 850.00	0.06
USD ROCKCLIFF ENERGY II LLC-144A 5.50000% 21-15.10.29	568 000.00	540 304.41	0.03
USD ROCKET SOFTWARE INC-144A 6.50000% 21-15.02.29	2 596 000.00	2 164 270.30	0.10
USD ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD-144A 4.25000% 21-01.07.26	2 732 000.00	2 370 010.00	0.11
USD ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD-144A 5.50000% 21-31.08.26	1 450 000.00	1 297 694.17	0.06
USD ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD-144A 5.37500% 22-15.07.27	1 297 000.00	1 128 236.96	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

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD SABRE GBL INC-144A 11.25000% 22-15.12.27	393 000.00	416 580.00	0.02
USD SCIENTIFIC GAMES HOLDINGS LTD-144A 6.62500% 22-01.03.30	1 283 000.00	1 142 864.32	0.05
USD SCOTTS MIRACLE-GRO CO/THE 4.00000% 22-01.04.31	254 000.00	205 740.00	0.01
USD SEAGATE HDD CAYMAN 4.09100% 20-01.06.29	1 091 000.00	966 926.03	0.05
USD SEALED AIR CORP-144A 6.12500% 23-01.02.28	542 000.00	546 823.80	0.03
USD SEAWORLD PARKS & ENTERTAINMENT INC-144A 8.75000% 20-01.05.25	364 000.00	373 527.54	0.02
USD SELECT MEDICAL CORP-144A 6.25000% 19-15.08.26	1 830 000.00	1 787 324.40	0.08
USD SENSATA TECHNOLOGIES BV-144A 5.00000% 15-01.10.25	550 000.00	543 947.25	0.03
USD SENSATA TECHNOLOGIES BV-144A 5.87500% 22-01.09.30	1 642 000.00	1 611 212.50	0.08
USD SENSATA TECHNOLOGIES INC-144A 4.37500% 19-15.02.30	325 000.00	294 209.50	0.01
USD SERVICE PROPERTIES TRUST 3.95000% 17-15.01.28	2 734 000.00	2 082 105.04	0.10
USD SERVICE PROPERTIES TRUST 4.37500% 18-15.02.30	1 054 000.00	765 957.61	0.04
USD SHIFT4 PAYMENTS LLC / SHIFT4 PAY-144A 4.62500% 20-01.11.26	3 151 000.00	2 984 123.04	0.14
USD SILGAN HOLDINGS INC 4.12500% 20-01.02.28	1 229 000.00	1 147 492.72	0.05
USD SINCLAIR TELEVISION GROUP INC-144A 5.50000% 19-01.03.30	1 834 000.00	1 462 615.00	0.07
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 4.12500% 20-01.07.30	1 300 000.00	1 114 919.00	0.05
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 4.00000% 21-15.07.28	4 538 000.00	4 039 273.80	0.19
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 3.12500% 21-01.09.26	2 622 000.00	2 359 866.49	0.11
USD SOLARIS MIDSTREAM HOLDINGS LLC-144A 7.62500% 21-01.04.26	3 306 000.00	3 306 000.00	0.16
USD SONIC AUTOMOTIVE INC-144A 4.62500% 21-15.11.29	1 936 000.00	1 608 999.92	0.08
USD SONIC AUTOMOTIVE INC-144A 4.87500% 21-15.11.31	2 517 000.00	2 009 799.33	0.09
USD SOTHEBY BIDFAIR HOLDINGS INC-144A 5.87500% 21-01.06.29	2 136 000.00	1 826 771.28	0.09
USD SOUTHWESTERN ENERGY CO 5.37500% 21-01.02.29	770 000.00	723 526.65	0.03
USD SPECTRUM BRANDS INC-144A 5.00000% 19-01.10.29	600 000.00	528 696.50	0.03
USD SPECTRUM BRANDS INC-144A 3.87500% 21-15.03.31	1 000 000.00	806 230.00	0.04
USD SPEEDY GROUP HOLDINGS CORP-144A 7.50000% 21-01.08.28	4 205 000.00	1 908 018.75	0.09
USD SPIRIT AEROSYSTEMS INC-144A 7.50000% 20-15.04.25	2 144 000.00	2 151 375.36	0.10
USD SPIRIT AEROSYSTEMS INC-144A 9.37500% 22-30.11.29	250 000.00	271 692.50	0.01
USD SPIRIT LOYALTY CAYMAN/ SPIRIT IP-144A 8.00000% 20-20.09.25	549 000.00	559 980.00	0.03
USD SRM ESCROW ISSUER LLC-144A 6.00000% 20-01.11.28	938 000.00	856 412.76	0.04
USD SRS DISTRIBUTION INC-144A 4.62500% 21-01.07.28	1 302 000.00	1 189 429.98	0.06
USD SRS DISTRIBUTION INC-144A 6.12500% 21-01.07.29	449 000.00	386 099.59	0.02
USD SRS DISTRIBUTION INC-144A 6.00000% 21-01.12.29	1 726 000.00	1 474 452.76	0.07
USD SS&C TECHNOLOGIES INC-144A 5.50000% 19-30.09.27	3 544 000.00	3 408 421.45	0.16
USD STANDARD INDUSTRIES INC/NJ-144A 4.75000% 17-15.01.28	377 000.00	353 305.55	0.02
USD STANDARD INDUSTRIES INC/NJ-144A 4.37500% 20-15.07.30	3 295 000.00	2 816 799.55	0.13
USD STARWOOD PROPERTY TRUST INC-144A 3.62500% 21-15.07.26	2 076 000.00	1 863 189.24	0.09
USD STARWOOD PROPERTY TRUST INC-144A 4.37500% 22-15.01.27	2 615 000.00	2 346 962.50	0.11
USD STATION CASINOS LLC-144A 4.50000% 20-15.02.28	2 461 000.00	2 215 515.25	0.10
USD STATION CASINOS LLC-144A 4.62500% 21-01.12.31	1 013 000.00	853 873.91	0.04
USD STERICYCLE INC-144A 3.87500% 20-15.01.29	500 000.00	443 630.00	0.02
USD STRATHCONA RESOURCES LTD/CA-144A 6.87500% 21-01.08.26	1 795 000.00	1 530 237.50	0.07
USD SUBURBAN PROPANE PARTN/ENERGY FIN-144A 5.00000% 21-01.06.31	864 000.00	751 659.45	0.04
USD SUMMIT MATERIALS LLC/FIN CORP-144A 5.25000% 20-15.01.29	1 572 000.00	1 476 092.28	0.07
USD SUMMIT MIDSTREAM FINANCE CORP-144A 8.50000% 21-15.10.26	3 859 000.00	3 757 701.25	0.18
USD SUNCOKE ENERGY INC-144A 4.87500% 21-30.06.29	1 800 000.00	1 584 000.00	0.07
USD SUNOCO LP / SUNOCO FINANCE CORP 4.50000% 21-15.05.29	3 560 000.00	3 220 696.40	0.15
USD SUNOCO LP / SUNOCO FINANCE CORP 4.50000% 22-30.04.30	4 940 000.00	4 400 799.00	0.21
USD SUPERIOR PLUS/SUPE GEN PARTNER INC-144A 4.50000% 21-15.03.29	1 755 000.00	1 550 981.25	0.07
USD TALLGRASS ENERGY PARTNERS-144A 6.00000% 21-01.09.31	715 000.00	643 500.00	0.03
USD TALLGRASS ENRGY PART LP/FIN CORP-144A 7.50000% 20-01.10.25	614 000.00	621 574.32	0.03
USD TASEKO MINES LTD-144A 7.00000% 21-15.02.26	1 550 000.00	1 468 625.00	0.07
USD TAYLOR MORRISON COMMUNITIES INC-144A 5.12500% 20-01.08.30	1 100 000.00	1 005 950.00	0.05
USD TECHNIPFMC PLC-144A 6.50000% 21-01.02.26	310 000.00	301 531.77	0.01
USD TELESAT CANADA/TELESAT LLC-144A 4.87500% 19-01.06.27	1 682 000.00	769 515.00	0.04
USD TEMPUR SEALY INTERNATIONAL INC-144A 4.00000% 21-15.04.29	2 455 000.00	2 144 246.10	0.10
USD THOR INDUSTRIES INC-144A 4.00000% 21-15.10.29	665 000.00	552 960.80	0.03
USD TITAN INTERNATIONAL INC 7.00000% 21-30.04.28	1 339 000.00	1 289 818.53	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

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD TOPBUILD CORP-144A 3.62500% 21-15.03.29	489 000.00	416 799.15	0.02
USD TOWNSQUARE MEDIA INC-144A 6.87500% 21-01.02.26	380 000.00	355 486.03	0.02
USD TRANSOCEAN INC-144A 7.50000% 17-15.01.26	1 980 000.00	1 861 200.00	0.09
USD TRANSOCEAN INC-144A 8.00000% 20-01.02.27	2 900 000.00	2 660 750.00	0.13
USD TRANSOCEAN INC-144A 11.50000% 20-30.01.27	440 000.00	459 118.00	0.02
USD TRANSOCEAN INC-144A 8.75000% 23-15.02.30	1 133 000.00	1 168 123.00	0.05
USD TRAVEL + LEISURE CO-144A 4.50000% 21-01.12.29	761 000.00	654 540.79	0.03
USD TRIMAS CORP-144A 4.12500% 21-15.04.29	1 195 000.00	1 063 848.75	0.05
USD TRINET GROUP INC-144A 3.50000% 21-01.03.29	3 588 000.00	3 012 951.24	0.14
USD TRINSEO MATERIALS OPERATING/FIN-144A 5.37500% 17-01.09.25	525 000.00	459 375.00	0.02
USD TRINSEO MATERIALS OPERATING SCA-144A 5.12500% 21-01.04.29	1 834 000.00	1 321 222.69	0.06
USD TRIUMPH GROUP INC-144A 6.25000% 19-15.09.24	679 000.00	655 388.05	0.03
USD TRONOX INC-144A 4.62500% 21-15.03.29	1 635 000.00	1 397 925.00	0.07
USD TTM TECHNOLOGIES INC-144A 4.00000% 21-01.03.29	3 323 000.00	2 903 471.25	0.14
USD TUTOR PERINI CORP-144A 6.87500% 17-01.05.25	1 900 000.00	1 692 710.00	0.08
USD UBER TECHNOLOGIES INC-144A 4.50000% 21-15.08.29	995 000.00	885 860.94	0.04
USD UNIFRAX ESCROW ISSUER CORP-144A 7.50000% 21-30.09.29	477 000.00	343 488.09	0.02
USD UNITED AIRLINES INC-144A 4.37500% 21-15.04.26	576 000.00	546 816.90	0.03
USD UNIVAR SOLUTIONS USA-144A 5.12500% 19-01.12.27	1 677 000.00	1 621 539.35	0.08
USD UNIVISION COMMUNICATIONS INC-144A 6.62500% 20-01.06.27	1 800 000.00	1 764 000.00	0.08
USD UPC BROADBAND FINCO BV-144A 4.87500% 21-15.07.31	1 133 000.00	996 779.41	0.05
USD US ACUTE CARE SOLUTIONS LLC-144A 6.37500% 21-01.03.26	2 180 000.00	1 972 028.00	0.09
USD US FOODS INC-144A 4.75000% 21-15.02.29	986 000.00	901 987.22	0.04
USD US FOODS INC-144A 4.62500% 21-01.06.30	2 312 000.00	2 069 717.12	0.10
USD USA COMPRESSION PARTNERS LLC 6.87500% 19-01.04.26	2 322 000.00	2 278 926.90	0.11
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 5.50000% 17-01.11.25	2 560 000.00	2 177 356.80	0.10
USD VALVOLINE INC-144A 4.25000% 20-15.02.30	534 000.00	524 940.69	0.02
USD VAREX IMAGING CORP-144A 7.87500% 20-15.10.27	1 097 000.00	1 091 196.87	0.05
USD VENTURE GLOBAL CALCASIEU PASS LLC-144A 3.87500% 21-15.08.29	1 700 000.00	1 513 000.00	0.07
USD VERSCEND ESCROW CORP-144A 9.75000% 18-15.08.26	4 107 000.00	4 121 282.09	0.19
USD VERTIV GROUP CORP-144A 4.12500% 21-15.11.28	1 168 000.00	1 012 819.49	0.05
USD VIAVI SOLUTIONS INC-144A 3.75000% 21-01.10.29	950 000.00	828 875.00	0.04
USD VIDEOTRON LTD / VIDEOTRON LTEE-144A 3.62500% 21-15.06.29	1 648 000.00	1 433 850.83	0.07
USD VISTA OUTDOOR INC-144A 4.50000% 21-15.03.29	1 580 000.00	1 279 800.00	0.06
USD VISTAJET MALTA FINANCE-144A 7.87500% 22-01.05.27	385 000.00	373 450.00	0.02
USD VISTRA OPERATIONS CO LLC-144A 5.62500% 19-15.02.27	571 000.00	551 432.87	0.03
USD VISTRA OPERATIONS CO LLC-144A 5.00000% 19-31.07.27	1 320 000.00	1 242 225.60	0.06
USD VM CONSOLIDATED INC-144A 5.50000% 21-15.04.29	1 433 000.00	1 320 151.25	0.06
USD VMED O2 UK FINANCING I PLC-144A 4.75000% 21-15.07.31	2 205 000.00	1 874 307.92	0.09
USD WABASH NATIONAL CORP-144A 4.50000% 21-15.10.28	1 580 000.00	1 386 385.44	0.07
USD WATCO COS LLC / WATCO FINANCE CORP-144A 6.50000% 20-15.06.27	4 920 000.00	4 645 070.40	0.22
USD WEATHERFORD INTERNATIONAL LTD-144A 6.50000% 21-15.09.28	711 000.00	704 537.01	0.03
USD WEEKLEY HOMES LLC / WEEKLEY FIN-144A 4.87500% 20-15.09.28	1 352 000.00	1 176 578.00	0.06
USD WESCO DISTRIBUTION INC-144A 7.12500% 20-15.06.25	475 000.00	482 600.00	0.02
USD WESCO DISTRIBUTION INC-144A 7.25000% 20-15.06.28	2 101 000.00	2 152 844.93	0.10
USD WHITE CAP BUYER LLC-144A 6.87500% 20-15.10.28	1 749 000.00	1 591 980.63	0.08
USD WINDSTREAM ESCROW LLC/FINANCE CORP-144A 7.75000% 20-15.08.28	1 651 000.00	1 336 534.03	0.06
USD WMG ACQUISITION CORP-144A 3.00000% 20-15.02.31	1 568 000.00	1 300 389.44	0.06
USD WMG ACQUISITION CORP-144A 3.75000% 21-01.12.29	390 000.00	341 344.46	0.02
USD WR GRACE HOLDINGS LLC-144A 4.87500% 21-15.06.27	1 326 000.00	1 230 262.80	0.06
USD WR GRACE HOLDINGS SA DE CV-144A 5.62500% 21-15.08.29	3 295 000.00	2 746 382.50	0.13
USD WYNDHAM DESTINATIONS INC-144A 6.62500% 20-31.07.26	347 000.00	344 352.98	0.02
USD WYNN LAS VEGAS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.25000% 17-15.05.27	2 950 000.00	2 786 806.00	0.13
USD WYNN RESORTS FINANCE LLC / CAP CO-144A 5.12500% 19-01.10.29	3 205 000.00	2 860 462.50	0.13
USD XEROX HOLDINGS CORP-144A 5.00000% 20-15.08.25	955 000.00	888 341.82	0.04
USD XEROX HOLDINGS CORP-144A 5.50000% 20-15.08.28	3 800 000.00	3 222 875.00	0.15
USD XHR LP-144A 4.87500% 21-01.06.29	1 130 000.00	1 002 875.00	0.05
USD XHR LP-144A 6.37500% 20-15.08.25	1 830 000.00	1 802 688.76	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

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD YUM BRANDS INC-144A 4.75000% 19-15.01.30	1 440 000.00	1 346 760.00	0.06
USD ZAYO GROUP HOLDINGS INC-144A 4.00000% 20-01.03.27	2 669 000.00	2 122 121.90	0.10
USD ZAYO GROUP HOLDINGS INC-144A 6.12500% 20-01.03.28	2 680 000.00	1 842 500.00	0.09
USD ZIPRECRUITER INC 5.00000% 22-15.01.30	240 000.00	208 800.00	0.01
米ドル合計		772 835 546.95	36.38
ノート、固定利付債合計		772 835 546.95	36.38
中期債券、固定利付債			
USD			
USD INTESA SANPAOLO SPA-144A-SUB 5.01700% 14-26.06.24	3 350 000.00	3 268 264.79	0.15
USD INTESA SANPAOLO SPA-144A-SUB 5.71000% 16-15.01.26	6 300 000.00	6 190 765.18	0.29
USD MINERAL RESOURCES LTD-144A 8.50000% 22-01.05.30	6 591 000.00	6 809 293.92	0.33
米ドル合計		16 268 323.89	0.78
中期債券、固定利付債合計		16 268 323.89	0.78
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	542 414.27	0.03
米ドル合計		542 414.27	0.03
中期債券、変動利付債合計		542 414.27	0.03
債券、固定利付債			
EUR			
EUR PANTHER BF AGGR 2/PANTHER FIN CO-REG-S 4.37500% 19-15.05.26	1 120 000.00	1 157 685.85	0.05
ユーロ合計		1 157 685.85	0.05
GBP			
GBP VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC-REG-S 4.12500% 20-15.08.30	1 375 000.00	1 349 978.09	0.06
英ポンド合計		1 349 978.09	0.06
USD			
USD CAESARS ENTERTAINMENT INC-144A 7.00000% 23-15.02.30	995 000.00	1 012 412.50	0.05
USD CVR ENERGY INC-144A 5.75000% 20-15.02.28	2 540 000.00	2 324 100.00	0.11
USD HUSBAY MINERALS INC-144A 6.12500% 20-01.04.29	1 780 000.00	1 641 373.60	0.08
USD OI EUROPEAN GROUP BV-144A 4.75000% 21-15.02.30	2 785 000.00	2 500 233.75	0.12
USD TEGNA INC 4.62500% 20-15.03.28	455 000.00	427 039.11	0.01
USD WARRIOR MET COAL INC-144A 7.87500% 21-01.12.28	923 000.00	909 155.00	0.04
米ドル合計		8 814 313.96	0.41
債券、固定利付債合計		11 321 977.90	0.52
債券、変動利付債			
USD			
USD CITIGROUP INC-SUB 6.300%/VAR 14-PRP	888 000.00	873 570.00	0.04
米ドル合計		873 570.00	0.04
債券、変動利付債合計		873 570.00	0.04
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		801 841 833.01	37.75

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / 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			
ルクセンブルグ			
USD INTELSAT EMERGENCE NPV REG S	58 477.00	1 725 071.50	0.08
USD REORGANIZED ISA S.A.	1 600 000.00	16 000.00	0.00
ルクセンブルグ合計		1 741 071.50	0.08
株式合計		1 741 071.50	0.08
新株引受権			
ルクセンブルグ			
USD INTELSAT JACKSON HOLDINGS SA RIGHTS PRP	6 123.00	61.23	0.00
USD INTELSAT JACKSON HOLDINGS SA RIGHTS PRP	6 123.00	61.23	0.00
ルクセンブルグ合計		122.46	0.00
新株引受権合計		122.46	0.00
ノート、固定利付債			
USD			
USD ACADIA HEALTHCARE CO INC-144A 5.50000% 20-01.07.28	500 000.00	481 690.00	0.02
USD ACCO BRANDS CORP-144A 4.25000% 21-15.03.29	882 000.00	762 978.51	0.04
USD ADAPTHEALTH LLC-144A 6.12500% 20-01.08.28	1 876 000.00	1 774 703.50	0.08
USD ADAPTHEALTH LLC-144A 4.62500% 21-01.08.29	675 000.00	587 283.75	0.03
USD ALLISON TRANSMISSION INC-144A 3.75000% 20-30.01.31	3 579 000.00	3 026 509.77	0.14
USD AMERICAN AIRLINES INC-144A 5.75000% 21-20.04.29	1 072 000.00	1 036 862.17	0.05
USD ARAMARK SERVICES INC-144A 6.37500% 20-01.05.25	2 225 000.00	2 225 556.25	0.10
USD ARDAGH PACKAGING FINANCE PLC-144A 5.25000% 20-30.04.25	460 000.00	449 765.00	0.02
USD AVIENT CORP-144A 7.12500% 22-01.08.30	2 215 000.00	2 231 498.65	0.11
USD BCPE EMPIRE HOLDINGS INC-144A 7.62500% 21-01.05.27	420 000.00	393 447.60	0.02
USD BLOOMIN ' BRANDS INC-144A 5.12500% 21-15.04.29	1 034 000.00	923 517.10	0.04
USD BROADSTREET PARTNERS INC-144A 5.87500% 21-15.04.29	1 062 000.00	938 075.22	0.04
USD BUILDERS FIRSTSOURCE INC-144A 4.25000% 21-01.02.32	800 000.00	688 198.08	0.03
USD BURFORD CAPITAL GLOBAL FINANCE LLC-144A 6.25000% 21-15.04.28	1 648 000.00	1 472 900.00	0.07
USD CALLON PETROLEUM CO-144A 7.50000% 22-15.06.30	215 000.00	208 012.50	0.01
USD CAMELOT RETURN MERGER SUB INC-144A 8.75000% 22-01.08.28	1 177 000.00	1 106 674.25	0.05
USD CARNIVAL CORP-144A 9.87500% 20-01.08.27	140 000.00	142 794.40	0.01
USD CCO HOLD LLC / CCO HOLD CAP CORP-144A 6.37500% 22-01.09.29	2 940 000.00	2 837 100.00	0.13
USD CCO HOLDINGS LLC 4.50000% 21-01.05.32	2 835 000.00	2 345 962.50	0.11
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.00000% 17-01.02.28	786 000.00	733 927.50	0.03
USD CCO HOLDINGS LLC/CCO HOLDINGS CAP-144A 4.50000% 21-01.06.33	2 873 000.00	2 334 312.50	0.11
USD CHENIERE ENERGY INC 4.62500% 21-15.10.28	970 000.00	923 585.50	0.04
USD CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC-144A 5.62500% 20-15.03.27	2 301 000.00	2 036 845.20	0.10
USD CINEMARK USA INC-144A 8.75000% 20-01.05.25	553 000.00	563 204.55	0.03
USD CLEAR CHANNEL WORLDWIDE HODGS INC-144A 7.75000% 21-15.04.28	1 130 000.00	961 324.90	0.05
USD COEUR MINING INC-144A 5.12500% 21-15.02.29	499 000.00	401 796.67	0.02
USD CRESTWOOD MIDSTREAM PART LP/FIN-144A 6.00000% 21-01.02.29	2 239 000.00	2 124 066.53	0.10
USD CROWNROCK LP / CROWNROCK FINANCE-144A 5.00000% 21-01.05.29	150 000.00	137 392.40	0.01
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 5.75000% 19-15.01.30	4 276 000.00	2 693 880.00	0.13
USD DIAMOND BC BV-144A 4.62500% 21-01.10.29	908 000.00	763 800.52	0.04
USD DORNOCH DEBT MERGER SUB INC-144A 6.62500% 21-15.10.29	615 000.00	461 765.90	0.02
USD DT MIDSTREAM INC-144A 4.37500% 21-15.06.31	915 000.00	800 370.63	0.04
USD ENDURANCE ACQUISITION MERGER-144A 6.00000% 21-15.02.29	917 000.00	651 653.13	0.03
USD ENLINK MIDSTREAM LLC-144A 5.62500% 20-15.01.28	180 000.00	175 950.00	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

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD ENOVA INTERNATIONAL INC-144A 8.50000% 18-15.09.25	1 849 000.00	1 758 861.25	0.08
USD ENTEGRIS ESCROW CORP-144A 5.95000% 22-15.06.30	1 368 000.00	1 313 731.44	0.06
USD EQM MIDSTREAM PARTNERS LP-144A 7.50000% 22-01.06.30	1 023 000.00	1 021 721.25	0.05
USD FMG RESOURCES AUGUST 2006 PTY LTD-144A 4.37500% 21-01.04.31	1 365 000.00	1 200 370.76	0.06
USD GAP INC/THE-144A 3.62500% 21-01.10.29	1 850 000.00	1 419 875.00	0.07
USD GFL ENVIRONMENTAL INC-144A 3.50000% 20-01.09.28	529 000.00	471 693.43	0.02
USD GRAY TELEVISION INC-144A 4.75000% 20-15.10.30	2 519 000.00	1 857 762.50	0.09
USD HARVEST MIDSTREAM-144A 7.50000% 20-01.09.28	2 089 000.00	2 055 053.75	0.10
USD HELIOS SOFTWARE HOLDINGS INC-144A 4.62500% 21-01.05.28	3 506 000.00	2 817 912.44	0.13
USD HESS MIDSTREAM PARTNERS LP-144A 4.25000% 21-15.02.30	900 000.00	788 226.75	0.04
USD HILTON DOMESTIC OPERATING CO INC-144A 5.75000% 20-01.05.28	2 339 000.00	2 320 592.07	0.11
USD ILLUMINATE BUYER LLC / ILLUMI HOLD-144A 9.00000% 20-01.07.28	4 122 000.00	3 683 171.88	0.17
USD INGEVITY CORP-144A 3.87500% 20-01.11.28	2 290 000.00	2 007 158.30	0.09
USD INSTALLED BUILDING PRODUCTS INC-144A 5.75000% 19-01.02.28	1 209 000.00	1 112 092.70	0.05
USD INTELSAT JACKSON HOLDINGS *ESCROW* 8.50000% 18-PRP	2 635 000.00	263.50	0.00
USD INTELSAT JACKSON HOLDINGS SA *ESCROW* 9.75000% 17-PRP	3 475 000.00	347.50	0.00
USD INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES-144A 3.26800% 20-15.11.40	725 000.00	555 673.53	0.03
USD IRON MOUNTAIN INC-144A 5.00000% 20-15.07.28	2 158 000.00	1 984 309.61	0.09
USD IRON MOUNTAIN INC-144A 5.25000% 20-15.07.30	420 000.00	380 074.80	0.02
USD IRON MOUNTAIN INC-144A 5.62500% 20-15.07.32	2 660 000.00	2 393 826.25	0.11
USD J2 GLOBAL INC-144A 4.62500% 20-15.10.30	1 293 000.00	1 145 675.58	0.05
USD JAZZ SECURITIES DAC-144A 4.37500% 21-15.01.29	1 208 000.00	1 102 106.72	0.05
USD KAISER ALUMINUM CORP-144A 4.50000% 21-01.06.31	2 549 000.00	2 155 459.89	0.10
USD LBM ACQUISITION LLC-144A 6.25000% 20-15.01.29	4 675 000.00	3 553 000.00	0.17
USD LD HOLDINGS GROUP LLC-144A 6.12500% 21-01.04.28	500 000.00	326 140.00	0.02
USD LIFE TIME INC-144A 5.75000% 21-15.01.26	2 868 000.00	2 756 205.36	0.13
USD LIKEWISE CORP-144A 9.75000% 20-15.10.25	1 686 000.00	1 584 840.00	0.07
USD LITHIA MOTORS INC-144A 4.37500% 20-15.01.31	250 000.00	212 850.00	0.01
USD MACYS RETAIL HOLDINGS INC-144A 5.87500% 21-01.04.29	1 025 000.00	953 264.36	0.04
USD MATTEL INC-144A 3.75000% 21-01.04.29	270 000.00	242 568.00	0.01
USD MSCI INC-144A 3.62500% 20-01.09.30	3 245 000.00	2 824 498.56	0.13
USD NCL CORP LTD-144A 8.37500% 23-01.02.28	682 000.00	690 184.00	0.03
USD NGL ENERGY OPERATING LLC-144A 7.50000% 21-01.02.26	1 342 000.00	1 274 442.89	0.06
USD NOBLE FINANCE CO (PIK) 11.00000% 21-15.02.28	11 095.00	12 093.55	0.00
USD NORTONLIFELOCK INC-144A 6.75000% 22-30.09.27	1 091 000.00	1 106 328.55	0.05
USD NORTONLIFELOCK INC-144A 7.12500% 22-30.09.30	2 461 000.00	2 498 653.30	0.12
USD NRG ENERGY INC-144A 3.37500% 20-15.02.29	496 000.00	410 058.99	0.02
USD OASIS PETROLEUM INC-144A 6.37500% 21-01.06.26	1 631 000.00	1 606 535.00	0.08
USD OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST 2.65000% 21-15.06.26	1 050 000.00	843 477.03	0.04
USD OLYMPUS WATER US HOLDING CORP-144A 6.25000% 21-01.10.29	1 409 000.00	1 169 427.73	0.06
USD ON SEMICONDUCTOR CORP-144A 3.87500% 20-01.09.28	1 464 000.00	1 335 914.64	0.06
USD OUTFRONT MEDIA CAPITAL LLC / OUTFR-144A 4.25000% 21-15.01.29	600 000.00	515 785.50	0.02
USD PENNYMAC FINANCIAL SERVICES INC-144A 4.25000% 21-15.02.29	1 920 000.00	1 577 932.80	0.07
USD PHH MORTGAGE CORP-144A 7.87500% 21-15.03.26	2 421 000.00	2 208 617.78	0.10
USD PILGRIM ' S PRIDE CORP-144A 3.50000% 21-01.03.32	920 000.00	749 708.00	0.04
USD POST HOLDINGS INC-144A 4.50000% 21-15.09.31	4 187 000.00	3 611 287.50	0.17
USD PRECISION DRILLING CORP-144A 7.12500% 17-15.01.26	1 919 000.00	1 899 197.36	0.09
USD PRESTIGE BRANDS INC-144A 3.75000% 21-01.04.31	3 572 000.00	3 032 985.20	0.14
USD QUICKEN LOANS LLC-144A 2.87500% 21-15.10.26	1 410 000.00	1 257 106.65	0.06
USD RAYONIER AM PRODUCTS INC-144A 7.62500% 20-15.01.26	2 770 000.00	2 590 005.40	0.12
USD ROLLER BEARING CO OF AMERICA INC-144A 4.37500% 21-15.10.29	647 000.00	582 992.29	0.03
USD ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD-144A 11.62500% 22-15.08.27	4 971 000.00	5 275 200.34	0.25
USD SCIENCE APPLICATIONS INTRNTNL CORP-144A 4.87500% 20-01.04.28	2 922 000.00	2 739 375.00	0.13
USD SEAWORLD PARKS & ENTERTAINMENT INC-144A 5.25000% 21-15.08.29	645 000.00	582 959.08	0.03
USD SIMMONS FOODS INC-144A 4.62500% 21-01.03.29	4 063 000.00	3 444 753.61	0.16
USD SPECIALTY BUILDING PRODCTS HLD LLC-144A 6.37500% 20-30.09.26	4 461 000.00	4 013 026.38	0.19
USD TEGNA INC 5.00000% 19-15.09.29	1 725 000.00	1 624 967.25	0.08
USD TEMPUR SEALY INTERNATIONAL INC-144A 3.87500% 21-15.10.31	2 190 000.00	1 804 362.90	0.09

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD UNISYS CORP-144A 6.87500% 20-01.11.27	2 608 000.00	1 975 560.00	0.09
USD UNITED NATURAL FODDS INC-144A 6.75000% 20-15.10.28	1 266 000.00	1 221 690.00	0.06
USD UNIVISION COMMUNICATIONS INC-144A 7.37500% 22-30.06.30	1 578 000.00	1 547 470.67	0.07
USD URBAN ONE INC-144A 7.37500% 21-01.02.28	1 100 000.00	1 000 197.00	0.05
USD VALVOLINE INC-144A 3.62500% 20-15.06.31	3 210 000.00	2 700 926.10	0.13
USD VIASAT INC-144A 6.50000% 20-15.07.28	2 918 000.00	2 341 753.36	0.11
USD WYNDHAM HOTELS & RESORTS INC-144A 4.37500% 20-15.08.28	1 797 000.00	1 657 383.18	0.08
USD ZOOMINFO TECHNOLOGIES LLC-144A 3.87500% 21-01.02.29	4 670 000.00	4 027 875.00	0.19
米ドル合計		150 326 966.39	7.08
ノート、固定利付債合計		150 326 966.39	7.08
債券、固定利付債			
USD			
USD DELEK LOGISTICS PARTNERS LP 6.75000% 18-15.05.25	2 163 000.00	2 108 925.00	0.10
USD NOBLE FINANCE CO 11.00000% 21-15.02.28	320 185.00	348 796.73	0.02
USD TENET HEALTHCARE CORP 4.87500% 19-01.01.26	2 228 000.00	2 170 005.16	0.10
米ドル合計		4 627 726.89	0.22
債券、固定利付債合計		4 627 726.89	0.22
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			
		156 695 887.24	7.38
最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
ノート、固定利付債			
USD			
USD ADVANCED DRAINAGE SYSTEMS INC-144A 6.37500% 22-15.06.30	473 000.00	469 966.65	0.02
USD BAUSCH HEALTH COS INC-144A 14.00000% 22-15.10.30	291 000.00	181 647.86	0.01
USD CLYDESDALE ACQUISITION HOLDINGS-144A 6.62500% 22-15.04.29	1 548 000.00	1 521 862.81	0.07
USD CNTL PNT INC /CNTL MRG SBRDNAT INC 144A-7.25000% 22-15.06.29	2 366 000.00	2 359 832.08	0.11
USD COGENT COMMUNI GRP INC-144A 7.00000% 22-15.06.27	1 636 000.00	1 619 312.80	0.08
USD CRSTWOD MIDSTREM PATNR / FINAC CRP-144A 7.37500% 23-01.02.31	1 182 000.00	1 189 387.50	0.06
USD EARTHSTONE ENERGY HOLDINGS LLC-144A 8.00000% 22-15.04.27	1 335 000.00	1 301 625.00	0.06
USD GARDEN SPINCO CORP-144A 8.62500% 22-20.07.30	963 000.00	1 030 412.42	0.05
USD GLOBAL INFRASTRUCTURE SOLUTIONS-144A 7.50000% 22-15.04.32	840 000.00	714 126.50	0.03
USD KINETIK HOLDINGS INC-144A 5.87500% 22-15.06.30	3 730 000.00	3 543 500.00	0.17
USD MAGALLANES INC-144A 4.05400% 22-15.03.29	285 000.00	261 575.97	0.01
USD MINERVA MERGER SUB INC-144A 6.50000% 22-15.02.30	3 100 000.00	2 568 387.82	0.12
USD OPEN TEXT CORP-144A 6.90000% 22-01.12.27	555 000.00	568 181.25	0.03
USD SEALED AIR CORP-144A 5.00000% 22-15.04.29	31 000.00	29 750.08	0.00
USD TENET HEALTHCARE CORP-144A 6.12500% 22-15.06.30	1 481 000.00	1 437 621.51	0.07
USD VISTAJET MALTA FINANCE PLC-144A 6.37500% 22-01.02.30	855 000.00	754 024.50	0.03
USD XPO ESCROW SUB-144A 7.50000% 22-15.11.27	2 036 000.00	2 092 193.60	0.10
米ドル合計		21 643 408.35	1.02
ノート、固定利付債合計		21 643 408.35	1.02
中期債券、固定利付債			
USD			
USD MINERAL RESOURCES LTD-144A 8.00000% 22-01.11.27	670 000.00	687 928.80	0.03
米ドル合計		687 928.80	0.03
中期債券、固定利付債合計		687 928.80	0.03

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
債券、固定利付債			
USD			
USD HESS MIDSTREAM OPERATIONS-144A 5.50000% 22-15.10.30	210 000.00	195 848.10	0.01
米ドル合計		195 848.10	0.01
債券、固定利付債合計			195 848.10 0.01
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			22 527 185.25 1.06
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されていない派生商品			
株式に係るワラント債			
ルクセンブルグ			
USD INTELSAT EMERGENCE SA CALL WARRANT 77.220000 17.02.27	1 368.00	2 736.00	-0.01
ルクセンブルグ合計		2 736.00	-0.01
イギリス			
USD NOBLE CORP PLC CALL WARRANT 19.27000 23-04.02.28	462.00	11 550.00	0.00
USD NOBLE CORP PLC CALL WARRANT 23.13000 22-04.02.28	462.00	10 672.20	0.00
イギリス合計		22 222.20	0.00
株式に係るワラント債合計			24 958.20 -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 いない派生商品合計			24 958.20 -0.01
投資有価証券合計			2 056 558 158.46 96.80

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 SHORT EURO BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 08.03.23	-58.00	57 951.63	0.00
EUR EURO-BUND FUTURE 08.03.23	-3.00	14 238.12	0.00
EUR EURO-BOBL FUTURE 08.03.23	-205.00	152 275.07	0.00
EUR EURO-SCHATZ FUTURE 08.03.23	116.00	-72 548.14	0.00
EUR EURO-BUXL FUTURE 08.03.23	1.00	-18 202.20	0.00
USD US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 22.03.23	2.00	-28 687.21	0.00
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 22.03.23	-162.00	-81 062.50	0.00
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 22.03.23	-249.00	-207 645.57	-0.01
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.23	253.00	40 622.33	0.00
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.23	-240.00	-19 399.34	0.00
USD US LONG BOND FUTURE 22.03.23	-29.00	-92 931.92	0.00
債券に係る金融先物合計		-255 389.73	-0.01
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計			-255 389.73 -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

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / 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			
指数に係るスワップおよびフォワード・スワップ			
EUR BNP/IBOXX EUR LIQUID HY TR EQS REC PERF 22-20.03.23	2 000 000.00	82 026.34	0.00
EUR BNP/IBOXX EUR LIQUID HY TR EQS PAY 3ML 22-20.03.23			
EUR BNP/IBOXX EUR LIQUID HY TR EQS REC PERF 22-20.03.23	2 000 000.00	67 444.51	0.00
EUR BNP/IBOXX EUR LIQUID HY TR EQS PAY 3ML 22-20.03.23			
EUR BNP/IBOXX EUR LIQUID HY TR EQS REC PERF 22-20.03.23	4 250 000.00	106 661.69	0.01
EUR BNP/IBOXX EUR LIQUID HY TR EQS PAY 3ML 22-20.03.23			
指数に係るスワップおよびフォワード・スワップ合計		256 132.54	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派生商品合計			
		256 132.54	0.01
派生商品合計			
		742.81	0.00

先渡為替契約

購入通貨	購入額	売却通貨	売却額	満期日		
USD	34 511 122.00	EUR	34 250 000.00	8.2.2023	-2 701 730.02	-0.13
USD	1 209 267.60	EUR	1 200 000.00	8.2.2023	-94 540.35	0.00
USD	41 081 330.33	EUR	39 775 000.00	22.2.2023	-2 173 101.03	-0.10
USD	17 009 970.18	GBP	14 370 000.00	22.2.2023	-688 656.02	-0.03
USD	11 393 821.89	GBP	9 270 000.00	8.3.2023	-26 917.31	0.00
USD	49 403 801.95	EUR	46 450 000.00	8.3.2023	-1 152 742.33	-0.05
USD	122 073.20	GBP	100 000.00	8.3.2023	-1 127.87	0.00
USD	280 413.93	GBP	230 000.00	8.3.2023	-2 948.53	0.00
USD	86 207.17	GBP	70 000.00	22.2.2023	-7.43	0.00
USD	1 251 563.46	GBP	1 014 932.05	23.2.2023	1 507.91	0.00
USD	136 430.03	GBP	110 000.00	8.3.2023	908.85	0.00
USD	24 333.76	GBP	20 000.00	8.3.2023	-306.45	0.00
USD	169 354.22	GBP	140 000.00	8.3.2023	-3 127.28	0.00
USD	136 268 587.44	EUR	127 853 764.10	3.4.2023	-3 087 154.65	-0.15
USD	156 495.04	GBP	130 000.00	8.3.2023	-3 666.35	0.00
USD	106 787.97	GBP	90 000.00	8.3.2023	-4 092.99	0.00
USD	182 372.25	GBP	150 000.00	8.3.2023	-2 429.36	0.00
USD	1 097 415.84	CHF	1 006 000.00	23.2.2023	-3 165.86	0.00
USD	20 682 124.80	EUR	19 200 000.00	22.2.2023	-232 701.78	-0.01
EUR	546 440.56	USD	591 149.78	3.4.2023	4 449.66	0.00
USD	2 638 896.68	EUR	2 425 218.00	3.4.2023	-4 498.74	0.00
JPY	1 471 871 857.00	USD	11 475 000.00	24.2.2023	-123 314.37	-0.01
CHF	352 887 922.84	USD	384 005 000.00	24.2.2023	999 863.25	0.05
SGD	4 006 682.45	USD	3 029 000.00	24.2.2023	20 824.43	0.00
GBP	43 461 161.72	USD	53 155 000.00	24.2.2023	375 737.98	0.02
EUR	646 609 791.44	USD	701 538 000.00	24.2.2023	1 723 431.24	0.08
CHF	2 750 994.00	USD	3 000 000.00	24.2.2023	1 366.72	0.00
SGD	66 033.55	USD	50 000.00	24.2.2023	263.71	0.00
JPY	24 323 990.00	USD	190 000.00	24.2.2023	-2 403.31	0.00
GBP	661 141.37	USD	810 000.00	24.2.2023	4 322.12	0.00
EUR	16 730 463.05	USD	18 200 000.00	24.2.2023	-3 725.30	0.00
EUR	2 238 685.99	USD	2 450 917.90	3.4.2023	-10 835.28	0.00
USD	45 679.13	CHF	42 000.00	22.2.2023	-133.48	0.00
USD	7 363 163.25	EUR	6 750 000.00	13.4.2023	663.41	0.00
USD	9 918.73	EUR	9 083.74	3.4.2023	17.80	0.00
USD	6 000 000.00	EUR	5 514 351.10	24.2.2023	2 518.21	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

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面			米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / 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 (続き)						
購入通貨	購入額	売却通貨	売却額	満期日		
USD	7 000 000.00	CHF	6 452 768.00	24.2.2023	-40 045.58	0.00
USD	3 000 000.00	GBP	2 440 315.97	24.2.2023	-5 716.13	0.00
EUR	3 389 625.98	GBP	3 000 000.00	24.2.2023	-8 466.81	0.00
USD	201 511 305.50	EUR	185 000 000.00	24.2.2023	302 838.66	0.01
USD	2 726 403.00	EUR	2 500 000.00	24.2.2023	7 369.66	0.00
GBP	350 000.00	USD	433 129.20	22.2.2023	-2 056.19	0.00
USD	10 473 180.72	GBP	8 462 911.00	28.2.2023	49 027.53	0.00
USD	291 156 781.20	EUR	267 381 364.00	28.2.2023	313 008.53	0.01
EUR	386 760.66	USD	423 627.07	3.4.2023	-2 072.65	0.00
EUR	8 469 498.00	USD	9 253 332.25	28.2.2023	-40 645.49	0.00
USD	616 011.85	GBP	500 000.00	24.2.2023	166.16	0.00
先渡為替契約合計					-6 614 043.11	-0.31
現金預金、要求払預金および預託金勘定ならびにその他の流動資産					55 426 532.78*	2.61
当座借越およびその他の短期負債					-312 286.65	-0.01
その他の資産および負債					19 564 371.16	0.91
純資産総額					2 124 623 475.45	100.00

* 2023年1月31日現在、3,260,000.00米ドルの現金が取引相手方であるモルガン・スタンレー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

2023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2023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
4,956,645.1280	3,701,028.1800	16,548,935.4840
(15,100)	(109,829)	(141,031)

(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
39,445	41,540	152,952
(45,945)	(23,840)	(170,652)

(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
2,212,505.3190	7,812,323.5370	16,130,824.2820
(39,360)	(325,559)	(184,566)

(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
50,314	219,582	200,665
(63,414)	(193,557)	(226,690)

(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
1,037,874.0240	6,836,500.4500	6,700,760.4030
(52,182)	(106,972)	(128,014)

(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
55,884	38,833	136,262
(60,684)	(23,800)	(151,295)

(注) ()内の数字は本邦内における販売、買戻しおよび発行済口数であり、受渡日を基準として算出している。一方、()の上段の数字は約定日を基準として算出している。

[次へ](#)

(2) その他の訂正

(注) 下線部は訂正部分を示します。ただし、全文訂正の場合には下線を付していません。

2 投資方針

(1) 投資方針

<訂正前>

投資目的

本投資法人の主な目的は、元本の保全および資産の流動性に十分に配慮しつつ、高いキャピタル・ゲインおよび合理的な収益を実現することである。

各サブ・ファンドの投資方針

一般

各サブ・ファンドの投資方針は、本項および下記「各サブ・ファンドに固有の投資方針」の項に記載されている。各サブ・ファンドは、下記「各サブ・ファンドに固有の投資方針」の関連する項目に記載されるその他の制限に従い、さらに、下記「(4) 投資制限」に記載される投資制限に従う。

投資者は、個々のサブ・ファンドおよび/またはクラスの基準通貨が(それらが異なる場合)、それぞれのサブ・ファンドまたはクラスの純資産価額を算出する通貨のみを指し、かかるサブ・ファンドの投資が行われる通貨ではないことに留意すべきである。投資は、サブ・ファンドのパフォーマンスに最も資する通貨で行われる。各サブ・ファンドは、投資に用いるいずれの通貨においても、流動性資産を補助的に保有することができる。

各サブ・ファンドは先進国および新興市場国の双方に投資することができる。このような投資に伴うリスクは「3 投資リスク」の項に記載されている。

ESGインテグレーション

投資運用会社は、重大なサステナビリティおよび/または環境上の、社会的な、かつ企業のガバナンスとしての要因をリサーチおよび投資のプロセスに統合することをESGインテグレーションと定義している。ESGインテグレーションは、特定の倫理的な原則または規範に左右されるのではなく、投資リターンに影響を及ぼしかねない重大なESGリスクを考慮することにより行われる。重大なサステナビリティ/ESG問題の分析には、様々な側面(カーボン・フットプリント、従業員の健康および福祉、人権、サプライ・チェーンの管理、顧客の公平な取扱いならびにガバナンス等)の多数の異なる側面が含まれることがある。ESG統合型ファンドは、**投資ユニバースが制約を受けている、ESG特性を推進している投資信託またはサステナビリティもしくはインパクトにおける具体的な目標を有する投資信託とは異なり、財務パフォーマンスを最大化することを主に目指す投資信託であり、そのためESGの諸側面が投資プロセスにおけるインプット要因となっている。**

金融派生商品の利用

サブ・ファンドは、ヘッジもしくはポートフォリオの効率的運用を目的として、または下記「各サブ・ファンドに固有の投資方針」の関連する項目に記載される投資戦略の一環として、金融派生商品を利用する権限を有する。下記「各サブ・ファンドに固有の投資方針」の関連する項目に別段の記載がない限り、金融派生商品を利用するサブ・ファンドは、その利用目的をヘッジおよび/または効率的なポートフォリオ運用に限定し、かつ下記「(4) 投資制限」で定められる制限内で利用する。投資者は、金融派生商品に関して考慮すべき特別リスクについて下記のリスク要因を参照すべきである。サブ・ファンドは、店頭取引の相手を当該取引を専門とする金融機関に限定する。

本投資法人の年次報告書には、該当する報告期間内に金融派生商品を締結しているサブ・ファンドに関して、以下の詳細が含まれる。

- ・金融派生商品を通じた原資産に対するエクスポージャー
- ・これらの金融派生商品の取引相手方の身元
- ・取引相手方に対するリスクのエクスポージャーを低減するために受領する担保の種類および金額

レポ契約/リバース・レポ契約および証券貸付契約ならびに店頭取引(OTC)の金融派生商品取引および効率的なポートフォリオ運用の技法のための担保の運用

サブ・ファンドは、2010年法の条件および制限に従い、CSSFにより定められる要件に従う効率的なポートフォリオ運用のために、CSSFの要件に従い、かつ「(4)投資制限」の「2.金融派生商品およびポートフォリオの効率的運用技法の利用」に詳述される通り、レポ契約、リバース・レポ契約および/もしくは証券貸付契約を採用することができる。このような取引がデリバティブの利用に関連する場合、期間および制限が2010年法の規定を遵守しなければならない。技法は下記の「証券金融取引およびトータル・リターン・スワップのエクスポージャー」の項に記載される通り継続ベースで利用されるが、市況に応じて証券貸付取引のエクスポージャーの停止または低減を随時決定することがある。このような技法の利用は投資者の最大の利益に従い行われなければならない。

レポ契約とは、一方の当事者が、ある証券を相手方当事者に対して売却すると同時に、当該証券を指定された将来の日に、当該証券の表面利率とは無関係の市場金利を反映した指定価格で買い戻す取り決めを行う取引である。リバース・レポ契約とは、サブ・ファンドが、ある証券を相手方当事者から購入すると同時に、当該証券を合意された日にかかる価格で、相手方当事者に売却することを約束する取引である。証券貸付契約とは、「ローン」の対象である証券の権原を「貸主」から「借主」に移転し、借主が将来の日に貸主に「これに相当する証券」を交付することに合意する契約である。

一般的に、以下の要件がレポ契約/リバース・レポ契約および証券貸付契約に適用される。

- () レポ契約/リバース・レポ契約または証券貸付契約の取引相手方が、OECDの法域に基本的に所在する、法人格を有する事業体である。取引相手方は、信用査定に従う。取引相手方が、ESMAにより登録され、かつ監督を受ける機関から信用格付を付与されている場合、かかる格付を信用査定において考慮する。ある信用格付機関が、取引相手方の信用格付を(ムーディーズによる)A2またはそれを下回る格付(もしくはこれに相当する格付)に引き下げの場合、かかる取引相手方に関する新たな信用査定を遅延なく実施する。
- () 本投資法人が、いつでも、貸付された証券をリコールできるか、または締結した証券貸付契約を終了できなければならない。
- () 本投資法人がリバース・レポ契約を締結する場合、本投資法人が、発生ベースまたは時価評価ベースのいずれかにより、現金全額(リコールの実施時までに発生する利息を含む。)のリコールまたはリバース・レポ契約の終了をいつでも行えることを徹底しなければならない。現金のリコールをいつでも時価評価ベースで行える場合、該当するサブ・ファンドの純資産価額の算出のために、リバース・レポ契約の時価評価額を利用しなければならない。7日以内の固定期間のリバース・レポ契約は、本投資法人がいつでも資産をリコールできるという条件付の契約であるとみなすべきである。
- () 本投資法人がレポ契約を締結する場合、本投資法人が、レポ契約に従い証券をリコールするか、または締結済のレポ契約の終了をいつでも行えることを徹底させなければならない。7日以内の固定期間のレポ契約は、本投資法人がいつでも資産をリコールできるという条件付の契約であるとみなされるべきである。
- () レポ契約/リバース・レポ契約または証券貸付契約が、UCITS指令の目的上の借入または貸付を構成するものではない。

- () 効率的なポートフォリオ運用の技法から生じるすべての収益(直接および間接の運営コスト/費用控除後)が、該当するサブ・ファンドに返却される。
- () 効率的なポートフォリオ運用の技法から生じる直接および間接の運営コスト/費用のうち、該当するサブ・ファンドに配分される収益から控除される可能性があるものが、帳簿外収益を含んではない。このような直接および間接の運営コスト/費用は、本投資法人の年次報告書または半期報告書に記載される事業体に対して支払われ、かかる報告書において、各報酬の金額、および当該事業体が管理会社または保管受託銀行と関連があるかを示すものとする。

一般的に、トータル・リターン・スワップには以下の点が適用される。

- () トータル・リターン・スワップにより取得される純リターンの100%(直接および間接的な運営コスト/手数料を控除後)がサブ・ファンドに返却される。
- () トータル・リターン・スワップに関連して発生するすべての直接的および間接的な運営コスト/手数料がファンドの年次および半期報告書に記載される事業者を支払われる。
- () トータル・リターン・スワップに関連して手数料を分担する取決めは締結されていない。

本投資法人およびそのサブ・ファンドはいかなる状況下であってもこれらの取引のためにその投資方針を逸脱してはならない。同様に、これらの技法の利用により該当するサブ・ファンドのリスク水準を当初のリスク水準(これらの技法を利用しない場合の水準)から大幅に上昇させてはならない。本投資法人は、自身または任命を受けた自身のサービス提供者がこれらの技法の利用を通じて発生するリスク、特に相手方当事者リスクを、リスク管理手続きの一環として監視および管理することを徹底する。本投資法人、管理会社、投資運用会社および保管受託銀行の関連会社との取引から生じる潜在的な利益相反の監視は、主として契約およびこれに伴う手続きの継続的な検証を通じて実行される。

本投資法人に証券貸付業務を提供するサービス提供者は、その業務の対価として市場標準に沿った報酬を受領する権利を有する。これらの報酬の金額は該当する場合、年次ベースで検証および適用される。現在、アームス・レングスに交渉される証券貸付取引において受領する総収益の60%が該当するサブ・ファンドに貸方計上され、総収益の40%が証券貸付代理人として行為するUBSヨーロッパSE ルクセンブルグ支店および証券貸付業務を提供するユービーエス・スイス・エイ・ジーにより経費/手数料として受領される。証券貸付取引を行うためのすべての経費/手数料は、総収益に占める証券貸付代理人の取り分から支払われる。ここには証券貸付業務により発生するすべての直接的および間接的な経費/手数料が含まれる。UBSヨーロッパSE ルクセンブルグ支店およびユービーエス・スイス・エイ・ジーはUBSグループの一員である。

本投資法人がEPM技法において担保として受領することができる商品は、「(4)投資制限」の第2項、2.26に記載される。効率的なポートフォリオ運用の技法に関するさらに詳細な情報については、「3 投資リスク a. リスク要因」の「EPM技法の利用に関連するリスク」を参照のこと。

担保の運用

本投資法人が店頭取引を実行する場合、本投資法人は店頭取引相手の信用力に関連するリスクを負うことがある。本投資法人が先物契約およびオプション取引を行うかまたはその他の派生技法を利用する場合、本投資法人は店頭取引相手が特定または複数の契約に基づくその債務を履行しないことがある(または履行することができない)リスクを負うことがある。取引相手リスクは、担保を預託することにより軽減することができる。

担保は流動性の高い通貨、流動性の高い株式および高格付の政府債のような流動資産の形で提供される場合がある。本投資法人は、(客観的かつ適切な評価を行った後)適切な期間内に換金が可能であるとされる金融商品のみを、担保として認める。本投資法人または本投資法人が選任するサービス提供会社は、最低一日一回、担保の評価額を精査しなければならない。本投資法人は、当該担保に関

連するリスクを適切に考慮するために、要求される担保価値を引き上げるべきか、またはかかる評価額を慎重に算定される適切な金額に減額(元本減免 - ヘアカット)すべきかを判断する。担保の評価額の変動が大きいほど、引き下げ額は大きくなる。減額幅は株式が最大である。担保として預託される有価証券は、本投資法人に代わり保管受託銀行が保有し、本投資法人はかかる証券の売却、投資または担保権設定を行うことはできない。

本投資法人は、譲渡された担保を主に地理的分散、複数市場間での分散、集中リスクの分散により適切に分散することを徹底する。担保として保有され、かつ単一発行体が発行する証券および短期金融商品が、各サブ・ファンドの純資産価額の20%を超えない場合、十分に分散されているとみなされる。

本投資法人は、上記の項の免除条項を受け、かつCSSF指令14 / 592により施行されたETFおよびその他のUCITS銘柄に関するESMAガイドライン2014 / 937(随時修正済)の改正後の第43条(e)(以下「ESMAガイドライン」という。)に従い、EU加盟国、その一もしくは複数の現地当局、第三国または一もしくは複数のEU加盟国が属する公的国際機関が発行または保証する様々な譲渡性のある証券および短期金融商品により完全に担保されることができる。この場合、本投資法人は必ず、少なくとも6つの異なる銘柄の証券を受領しなければならないが、一銘柄の証券が各サブ・ファンドの純資産価額の30%を超えてはならない。

本投資法人の取締役会は、上記の免除条項を利用し、米国、日本、英国、ドイツおよびスイスの各サブ・ファンドの純資産価額の50%を上限として、EU加盟国、その一もしくは複数の現地当局、OECD加盟国、または一もしくは複数のEU加盟国が属する公的国際機関が発行または保証する譲渡性のある証券および短期金融商品による担保を受領する旨を決定した。

EPM技法の利用

サブ・ファンドは「(4)投資制限」に記載される制限内でEPM技法((リバース・)レポ契約または証券貸付取引等)を利用することを認められている。投資者はEPM技法に適用される特定のリスク要因について「3 投資リスク a. リスク要因」を参照すべきである。

本投資法人が効率的なポートフォリオ運用において担保として受領することができる商品は、利用可能な範囲において「(4)投資制限」の2.24項に定められている。

リスク管理

コミットメント・アプローチおよびバリュー・アット・リスク・アプローチに従うリスク管理は適用法令の規定に従い適用される。

レバレッジ

レバレッジは、適用あるESMAガイドラインおよびCSSF指令11 / 512に従い、各サブ・ファンドが利用する派生商品の「想定元本の総額」として確定される。この定義により、ヘッジ目的で利用される可能性がある派生商品を加えて算定する場合があり、レバレッジ額が人為的に高くなることがある。そのため、この算定結果は、投資者が負担する実際のレバレッジ・リスクを必ずしも正確には反映していない。

レバレッジがかけられる場合の予測レバレッジは、過去のデータに基づき、想定元本の総額と各サブ・ファンドの純資産価額との比率として以下の表に示されている。募集開始前のサブ・ファンドについては、予測レバレッジは、標準的ポートフォリオか、または類似するサブ・ファンドの投資に基づいて算定される。一定の状況下では、すべてのサブ・ファンドについてレバレッジ額がより大きくなる可能性がある。

サブ・ファンド	グローバル・リスク計算法
エマージング・マーケット・デッド	コミットメント・アプローチ

US マルチ・クレジット・サステナブル	コミットメント・アプローチ
ハイ・イールド	コミットメント・アプローチ

証券金融取引およびトータル・リターン・スワップのエクスポージャー

サブ・ファンドのトータル・リターン・スワップ、レポ契約/リバース・レポ契約および証券貸付取引のエクスポージャー（いずれの場合も、純資産価額に対する割合）は、以下のとおりである。

サブ・ ファンド	トータル・リター ン・スワップ		レポ契約		リバース・レポ契約		証券貸付取引	
	予想値	最大値	予想値	最大値	予想値	最大値	予想値	最大値
エマージン グ・マーケッ ト・デッド	0%～ 25%	25%	0%	0%	0%	0%	10%～ 20%	40%
U S マル チ・ クレジット・ サステナブル	0%～ 25%	25%	0%	0%	0%	0%	10%～ 20%	40%
ハイ・イール ド	0%～ 25%	25%	0%	0%	0%	0%	10%～ 20%	40%

各サブ・ファンドに固有の投資方針

各サブ・ファンドの投資方針および戦略は、以下の通りであり、下記「(4)投資制限」に記載される投資制限に常に従っている。疑義を避けるために付言すると、各サブ・ファンドは以下の制限に従うことを条件に、下記の資産クラスのエクスポージャーを取ることができる。

- () 資産担保証券：該当するサブ・ファンドの純資産の最大15%
- () モーゲージ・バック証券：該当するサブ・ファンドの純資産の最大15%
- () 偶発転換債券：該当するサブ・ファンドの純資産の最大15%
- () 破綻証券：該当するサブ・ファンドの純資産の最大10%

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

サブ・ファンドはアクティブな運用を行い、投資方針は長期的な実質利益を追求することであるが、この投資方針が達成される保証はない。

サブ・ファンドは、環境面、社会面またはガバナンス面（ESG）の特性を推進しているものではなく、サステナビリティまたはインパクトにおける目標を追求しているものでもない。投資戦略および投資先の投資対象の性質に基づいてサステナビリティ・リスクの検討を体系的に統合しているわけではない。現在のところ、サステナビリティ・リスクがサブ・ファンドのリターンの目標達成に大きな影響を及ぼすことは予想されていない。サブ・ファンドの投資対象は、環境的に持続可能な経済活動のためのEU基準を考慮したものではない。

ポートフォリオ・マネージャーは、エマージング市場における債券戦略を行う専用ポートフォリオを通じて米ドル建ての債券に主として投資することにより、サブ・ファンドの投資方針の達成に努める。専用ポートフォリオにおいては、投資制限を総額ベースで適用する。サブ・ファンドはハイイールド債券に投資することができる。ポートフォリオ・マネージャーは、サブ・ファンドの投資方針を達成するためにデリバティブを利用することもできる。

サブ・ファンドが専用ポートフォリオにおいて保有する確定利付投資対象の大半は、JPモルガンEMBIグローバル・ディバースファイド・インデックスの60%およびJPモルガンCEMBIディバースファイ

ド・インデックスの40%を合成した参考指標の構成銘柄内の発行体が発行している。投資戦略は、サブ・ファンドのデュレーション、セクターおよび国のエクスポージャーが参考指標から乖離することができる範囲に関して限定的な制限を課している。投資戦略は参考指標に対する確定利付の投資対象の組入比率に制限を設けていないが、これはサブ・ファンドのポートフォリオ構成が参考指標から大幅に乖離できることを意味している。投資運用会社は特定の投資機会を有効利用するために参考指標を構成していない確定利付の投資対象に投資する裁量を行使することができる。そのため、市場のボラティリティが高い期間においてサブ・ファンドの運用実績が参考指標から大幅に乖離することがある。

サブ・ファンドは、流動性の目的で短期金融商品、現金または現金等価物を保有することができる。

サブ・ファンドは、UCITSまたはその他のUCIの受益証券または投資証券にその純資産の10%を超えて投資しない。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット・サステナブル

サブ・ファンドは環境および社会的特性を推進し、金融サービスセクターにおけるサステナビリティ関連開示規則に関する欧州連合(EU)規則2019/2088第8条第1項に従い分類される。

サブ・ファンドはアクティブな運用を行い、投資方針は専用ポートフォリオを通じて主に米ドル建ての債券に主として投資することにより、長期的な実質利益を追求することである。この投資方針が達成される保証はない。

専用ポートフォリオにおいては、投資制限を総額ベースで適用する。ポートフォリオ・マネージャーは、サブ・ファンドの投資方針を達成するためにデリバティブを利用することもできる。

サブ・ファンドが専用ポートフォリオにおいて保有する確定利付投資対象の大半は、参考指標であるブルームバーグUSコーポレート・インターメディエイト・インデックスの構成銘柄内の発行体が発行している。サブ・ファンドの参考指標をサブ・ファンドが推進するESG特性に一致させることは意図していない。投資戦略は、サブ・ファンドのデュレーション、セクターおよび国のエクスポージャーが参考指標から乖離することができる範囲に関して限定的な制限を課している。投資戦略は参考指標に対する確定利付の投資対象の組入比率に制限を設けていないが、これはサブ・ファンドのポートフォリオ構成が参考指標から大幅に乖離できることを意味している。投資運用会社は特定の投資機会を有効利用するために参考指標を構成していない確定利付の投資対象に投資する裁量を行使することができる。そのため、市場のボラティリティが高い期間においてサブ・ファンドの運用実績が参考指標から大幅に乖離することがある。

投資プロセスの一部として、投資運用会社は各証券の発行体の環境、社会およびガバナンス(「ESG」)の特性を検討し、力強いESGの慣行を有していると考えられる企業または発行体への投資に努める。

評価のために利用されるESGの基準には、コーポレート・ガバナンス、透明性、二酸化炭素排出量ならびに業務上の生産性、採用基準およびサプライ・チェーンのモニター、取締役会の多様性、ならびに不正および腐敗を排除するガイドラインが含まれるがこれらに限られない。リサーチおよび投資決定を行うプロセスにおいて、投資妙味のあるリターンの機会を提供し、かつ力強いESGの慣行を促進している企業を判別するために、外部のデータ提供者のレーティングおよび投資運用会社の内部のリサーチを組み合わせて利用し、これらのESGの基準に対して各企業がシステマティックに評価される。ここには一般的に、発行体がサステナブルな業務から取得する収益(何を行っているか)の査定、およびその業務のサステナビリティ(どのように行っているか)の評価の双方が含まれる。

サブ・ファンドの投資対象は、参照指標のサステナビリティにおけるプロファイルを上回る、加重平均されたサステナビリティのプロファイルを有している。参照指標の算出のために利用される理論は、参考指標の提供者のサイト(www.bloomber.com)において閲覧できる。

サブ・ファンドはリサーチおよび投資意思決定を通じて、重大な悪影響を及ぼす社会リスクおよび環境リスクの存在が明らかになる商品の製造または事業活動を行っている企業およびセクターを除外する。サブ・ファンドはタバコ、風俗産業ならびに核燃料および燃料炭の製造から相当な利益を得ている企業にも、石炭発電を利用して相当な利益を得ている企業にも直接的に投資しない。さらに、サブ・ファンドの専門ポートフォリオは非人道的兵器および軍事兵器に関わっている企業のエクスポージャーを取得しないものとする。

サブ・ファンドは、流動性の目的で短期金融商品、現金または現金等価物を保有することができる。

サブ・ファンドは、UCITSまたはその他のUCIの受益証券または投資証券にその純資産の10%を超えて投資しない。

さらに、規則(EU)2020/852(以下「タクソノミー規則」という。)に基づき、SFDR第8第1項に従い環境的な特性を推進していると分類される金融商品は、2022年1月1日付で当該方針ならびにその投資が、どのように、また、どの程度、タクソノミー規則第3条に従い環境的に持続可能であるとの適格性を有する経済活動に対して行われているかに関する説明に関して追加的な情報開示を行わなければならない。ただし、必要とされる実施法がなく、特に十分に定義された計算方法と必要な分類学関連データが存在しないため、サブ・ファンドは2022年1月1日現在、義務付けられている情報開示(もし、あれば)を行うことができない。管理会社は、この状況を継続的に確認する。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

サブ・ファンドはアクティブな運用を行い、投資方針は長期的な実質利益を追求することであるが、この投資方針が達成される保証はない。

サブ・ファンドは、環境面、社会面またはガバナンス面(ESG)の特性を推進しているものではなく、サステナビリティまたはインパクトにおける目標を追求しているものでもない。投資戦略および投資先の投資対象の性質に基づいてサステナビリティ・リスクの検討を体系的に統合しているわけではない。現在のところ、サステナビリティ・リスクがサブ・ファンドのリターン目標達成に大きな影響を及ぼすことは予想されていない。サブ・ファンドの投資対象は、環境的に持続可能な経済活動のためのEU基準を考慮したものではない。

ポートフォリオ・マネージャーは、専用ポートフォリオを通じてハイ・イールド債券に主として投資することにより、サブ・ファンドの投資方針の達成に努める。専用ポートフォリオにおいては、投資制限を総額ベースで適用する。ポートフォリオ・マネージャーは、サブ・ファンドの投資方針を達成するためにデリバティブを利用することもできる。

サブ・ファンドが専用ポートフォリオにおいて保有する確定利付投資対象の大半は、ICE BofAメリルリンチUSハイ・イールド・コンストレインド・インデックスの60%およびICE BofAメリルリンチ・ユーロ・ハイ・イールド・コンストレインド・インデックスの40%を合成した参考指標の構成銘柄内の発行体が発行している。投資戦略は、サブ・ファンドのデュレーション、セクターおよび国のエクスポージャーが参考指標から乖離することができる範囲に関して限定的な制限を課している。投資戦略は参考指標に対する確定利付の投資対象の組入比率に制限を設けていないが、これはサブ・ファンドのポートフォリオ構成が参考指標から大幅に乖離できることを意味している。投資運用会社は特定の投資機会を有効利用するために参考指標を構成していない確定利付の投資対象に投資する裁量を使用することができる。そのため、市場のボラティリティが高い期間においてサブ・ファンドの運用実績が参考指標から大幅に乖離することがある。

サブ・ファンドは、流動性の目的で短期金融商品、現金または現金等価物を保有することができる。

サブ・ファンドは、UCITSまたはその他のUCIの受益証券または投資証券にその純資産の10%を超えて投資しない。

< 訂正後 >

投資目的

本投資法人の主な目的は、元本の保全および資産の流動性に十分に配慮しつつ、高いキャピタル・ゲインおよび合理的な収益を実現することである。

各サブ・ファンドの投資方針

一般

各サブ・ファンドの投資方針は、本項および下記「各サブ・ファンドに固有の投資方針」の項に記載されている。各サブ・ファンドは、下記「各サブ・ファンドに固有の投資方針」の関連する項目に記載されるその他の制限に従い、さらに、下記「(4)投資制限」に記載される投資制限に従う。

投資者は、個々のサブ・ファンドおよび/またはクラスの基準通貨が(それらが異なる場合)、それぞれのサブ・ファンドまたはクラスの純資産価額を算出する通貨のみを指し、かかるサブ・ファンドの投資が行われる通貨ではないことに留意すべきである。投資は、サブ・ファンドのパフォーマンスに最も資する通貨で行われる。

各サブ・ファンドは、その純資産の20%を上限として、流動性資産を付随的に保有することができる。例外的な市況の悪化を受けてそのように求められる場合および投資主の利益を考慮してそのような違反が正当化される場合に厳密に必要とされる期間に限り、上限の20%を一時的に超過することができるものとする。当該制限は金融派生商品のエクスポージャーをカバーするために保有される流動性資産には適用されない。2010年法第41条第1項の基準を満たす銀行預金、短期金融商品またはマネー・マーケット型投資信託は、2010年法第41条第2項に基づく付随的な流動性資産に含まれるとはみなされない。付随的な流動性資産は、当該時もしくは突発的な支払をカバーするためにいつでもアクセスできる銀行の当座預金で保有される現金等の要求払預金、または2010年法第41条第1項に基づく適格資産への再投資のために必要な期間もしくは市況の悪化時に厳密に必要となる期間に限定しなければならない。サブ・ファンドは同一の金融機関の要求払預金にその純資産価額の20%を超えて投資してはならない。

各サブ・ファンドは先進国および新興市場国の双方に投資することができる。このような投資に伴うリスクは「3 投資リスク」の項に記載されている。

ESGインテグレーション

投資運用会社は、重大なサステナビリティおよび/または環境上の、社会的な、かつ企業のガバナンスとしての要因をリサーチおよび投資のプロセスに統合することをESGインテグレーションと定義している。ESGインテグレーションは、特定の倫理的な原則または規範に左右されるのではなく、投資リターンに影響を及ぼしかねない重大なESGリスクを考慮することにより行われる。重大なサステナビリティ/ESG問題の分析には、様々な側面(カーボン・フットプリント、従業員の健康および福祉、人権、サプライ・チェーンの管理、顧客の公平な取扱いならびにガバナンス等)の多数の異なる側面が含まれることがある。ESG統合型ファンドは、投資ユニバースが制約を受けている、ESG特性を推進している投資信託またはサステナビリティもしくはインパクトにおける具体的な目標を有する投資信託とは異なり、財務パフォーマンスを最大化することを主に目指す投資信託であり、そのためESGの諸側面が投資プロセスにおけるインプット要因となっている。

金融派生商品の利用

サブ・ファンドは、ヘッジもしくはポートフォリオの効率的運用を目的として、または下記「各サブ・ファンドに固有の投資方針」の関連する項目に記載される投資戦略の一環として、金融派生商品を利用する権限を有する。下記「各サブ・ファンドに固有の投資方針」の関連する項目に別段の記載

がない限り、金融派生商品を利用するサブ・ファンドは、その利用目的をヘッジおよび/または効率的なポートフォリオ運用に限定し、かつ下記「(4)投資制限」で定められる制限内で利用する。投資者は、金融派生商品に関して考慮すべき特別リスクについて下記のリスク要因を参照すべきである。サブ・ファンドは、店頭取引の相手を当該取引を専門とする金融機関に限定する。

本投資法人の年次報告書には、該当する報告期間内に金融派生商品を締結しているサブ・ファンドに関して、以下の詳細が含まれる。

- ・金融派生商品を通じた原資産に対するエクスポージャー
- ・これらの金融派生商品の取引相手方の身元
- ・取引相手方に対するリスクのエクスポージャーを低減するために受領する担保の種類および金額

レポ契約/リバース・レポ契約および証券貸付契約ならびに店頭取引(OTC)の金融派生商品取引および効率的なポートフォリオ運用の技法のための担保の運用

サブ・ファンドは、2010年法の条件および制限に従い、CSSFにより定められる要件に従う効率的なポートフォリオ運用のために、CSSFの要件に従い、かつ「(4)投資制限」の「2.金融派生商品およびポートフォリオの効率的運用技法の利用」に詳述される通り、レポ契約、リバース・レポ契約および/もしくは証券貸付契約を採用することができる。このような取引がデリバティブの利用に関連する場合、期間および制限が2010年法の規定を遵守しなければならない。技法は下記の「証券金融取引およびトータル・リターン・スワップのエクスポージャー」の項に記載される通り継続ベースで利用されるが、市況に応じて証券貸付取引のエクスポージャーの停止または低減を随時決定することがある。このような技法の利用は投資者の最大の利益に従い行われなければならない。

レポ契約とは、一方の当事者が、ある証券を相手方当事者に対して売却すると同時に、当該証券を指定された将来の日に、当該証券の表面利率とは無関係の市場金利を反映した指定価格で買い戻す取り決めを行う取引である。リバース・レポ契約とは、サブ・ファンドが、ある証券を相手方当事者から購入すると同時に、当該証券を合意された日にかかる価格で、相手方当事者に売却することを約束する取引である。証券貸付契約とは、「ローン」の対象である証券の権原を「貸主」から「借主」に移転し、借主が将来の日に貸主に「これに相当する証券」を交付することに合意する契約である。

一般的に、以下の要件がレポ契約/リバース・レポ契約および証券貸付契約に適用される。

- () レポ契約/リバース・レポ契約または証券貸付契約の取引相手方が、OECDの法域に基本的に所在する、法人格を有する事業体である。取引相手方は、信用査定に従う。取引相手方が、ESMAにより登録され、かつ監督を受ける機関から信用格付を付与されている場合、かかる格付を信用査定において考慮する。ある信用格付機関が、取引相手方の信用格付を(ムーディーズによる)A2またはそれを下回る格付(もしくはこれに相当する格付)に引き下げの場合、かかる取引相手方に関する新たな信用査定を遅延なく実施する。
- () 本投資法人が、いつでも、貸付された証券をリコールできるか、または締結した証券貸付契約を終了できなければならない。
- () 本投資法人がリバース・レポ契約を締結する場合、本投資法人が、発生ベースまたは時価評価ベースのいずれかにより、現金全額(リコールの実施時までに発生する利息を含む。)のリコールまたはリバース・レポ契約の終了をいつでも行えることを徹底しなければならない。現金のリコールをいつでも時価評価ベースで行える場合、該当するサブ・ファンドの純資産価額の算出のために、リバース・レポ契約の時価評価額を利用しなければならない。7日以内の固定期間のリバース・レポ契約は、本投資法人がいつでも資産をリコールできるという条件付の契約であるとみなすべきである。
- () 本投資法人がレポ契約を締結する場合、本投資法人が、レポ契約に従い証券をリコールするか、または締結済のレポ契約の終了をいつでも行えることを徹底させなければならない。7日

以内の固定期間のレポ契約は、本投資法人がいつでも資産をリコールできるという条件付の契約であるとみなされるべきである。

- () レポ契約 / リバース・レポ契約または証券貸付契約が、UCITS指令の目的上の借入または貸付を構成するものではない。
- () 効率的なポートフォリオ運用の技法から生じるすべての収益(直接および間接の運営コスト / 費用控除後)が、該当するサブ・ファンドに返却される。
- () 効率的なポートフォリオ運用の技法から生じる直接および間接の運営コスト / 費用のうち、該当するサブ・ファンドに配分される収益から控除される可能性があるものが、帳簿外収益を含んではならない。このような直接および間接の運営コスト / 費用は、本投資法人の年次報告書または半期報告書に記載される事業体に対して支払われ、かかる報告書において、各報酬の金額、および当該事業体が管理会社または保管受託銀行と関連があるかを示すものとする。

一般的に、トータル・リターン・スワップには以下の点が適用される。

- () トータル・リターン・スワップにより取得される純リターンの100%(直接および間接的な運営コスト / 手数料を控除後)がサブ・ファンドに返却される。
- () トータル・リターン・スワップに関連して発生するすべての直接および間接的な運営コスト / 手数料がファンドの年次および半期報告書に記載される事業者を支払われる。
- () トータル・リターン・スワップに関連して手数料を分担する取決めは締結されていない。

本投資法人およびそのサブ・ファンドはいかなる状況下であってもこれらの取引のためにその投資方針を逸脱してはならない。同様に、これらの技法の利用により該当するサブ・ファンドのリスク水準を当初のリスク水準(これらの技法を利用しない場合の水準)から大幅に上昇させてはならない。本投資法人は、自身または任命を受けた自身のサービス提供者がこれらの技法の利用を通じて発生するリスク、特に相手方当事者リスクを、リスク管理手続きの一環として監視および管理することを徹底する。本投資法人、管理会社、投資運用会社および保管受託銀行の関連会社との取引から生じる潜在的な利益相反の監視は、主として契約およびこれに伴う手続きの継続的な検証を通じて実行される。

本投資法人に証券貸付業務を提供するサービス提供者は、その業務の対価として市場標準に沿った報酬を受領する権利を有する。これらの報酬の金額は該当する場合、年次ベースで検証および適用される。現在、アームス・レングスに交渉される証券貸付取引において受領する総収益の60%が該当するサブ・ファンドに貸方計上され、総収益の40%が証券貸付代理人として行為するUBSヨーロッパSE ルクセンブルグ支店および証券貸付業務を提供するユービーエス・スイス・エイ・ジーにより経費 / 手数料として受領される。証券貸付取引を行うためのすべての経費 / 手数料は、総収益に占める証券貸付代理人の取り分から支払われる。ここには証券貸付業務により発生するすべての直接および間接的な経費 / 手数料が含まれる。UBSヨーロッパSE ルクセンブルグ支店およびユービーエス・スイス・エイ・ジーはUBSグループの一員である。

本投資法人がEPM技法において担保として受領することができる商品は、「(4)投資制限」の第2項、2.26に記載される。効率的なポートフォリオ運用の技法に関するさらに詳細な情報については、「3 投資リスク a. リスク要因」の「EPM技法の利用に関連するリスク」を参照のこと。

担保の運用

本投資法人が店頭取引を実行する場合、本投資法人は店頭取引相手の信用力に関連するリスクを負うことがある。本投資法人が先物契約およびオプション取引を行うかまたはその他の派生技法を利用する場合、本投資法人は店頭取引相手が特定または複数の契約に基づくその債務を履行しないことがある(または履行することができない)リスクを負うことがある。取引相手リスクは、担保を預託することにより軽減することができる。

担保は流動性の高い通貨、流動性の高い株式および高格付の政府債のような流動資産の形で提供される場合がある。本投資法人は、(客観的かつ適切な評価を行った後)適切な期間内に換金が可能であるとされる金融商品のみを、担保として認める。本投資法人または本投資法人が選任するサービス提供会社は、最低一日一回、担保の評価額を精査しなければならない。本投資法人は、当該担保に関連するリスクを適切に考慮するために、要求される担保価値を引き上げるべきか、またはかかる評価額を慎重に算定される適切な金額に減額(元本減免 - ヘアカット)すべきかを判断する。担保の評価額の変動が大きいほど、引き下げ額は大きくなる。減額幅は株式が最大である。担保として預託される有価証券は、本投資法人に代わり保管受託銀行が保有し、本投資法人はかかる証券の売却、投資または担保権設定を行うことはできない。

本投資法人は、譲渡された担保を主に地理的分散、複数市場間での分散、集中リスクの分散により適切に分散することを徹底する。担保として保有され、かつ単一発行体が発行する証券および短期金融商品が、各サブ・ファンドの純資産価額の20%を超えない場合、十分に分散されているとみなされる。

本投資法人は、上記の項の免除条項を受け、かつCSSF指令14 / 592により施行されたETFおよびその他のUCITS銘柄に関するESMAガイドライン2014 / 937 (随時修正済)の改正後の第43条(e)(以下「ESMAガイドライン」という。)に従い、EU加盟国、その一もしくは複数の現地当局、第三国または一もしくは複数のEU加盟国が属する公的国際機関が発行または保証する様々な譲渡性のある証券および短期金融商品により完全に担保されることができる。この場合、本投資法人は必ず、少なくとも6つの異なる銘柄の証券を受領しなければならないが、一銘柄の証券が各サブ・ファンドの純資産価額の30%を超えてはならない。

本投資法人の取締役会は、上記の免除条項を利用し、米国、日本、英国、ドイツおよびスイスの各サブ・ファンドの純資産価額の50%を上限として、EU加盟国、その一もしくは複数の現地当局、OECD加盟国、または一もしくは複数のEU加盟国が属する公的国際機関が発行または保証する譲渡性のある証券および短期金融商品による担保を受領する旨を決定した。

EPM技法の利用

サブ・ファンドは「(4)投資制限」に記載される制限内でEPM技法((リバース・)レポ契約または証券貸付取引等)を利用することを認められている。投資者はEPM技法に適用される特定のリスク要因について「3 投資リスク a. リスク要因」を参照すべきである。

本投資法人が効率的なポートフォリオ運用において担保として受領することができる商品は、利用可能な範囲において「(4)投資制限」の2.24項に定められている。

リスク管理

コミットメント・アプローチおよびバリュー・アット・リスク・アプローチに従うリスク管理は適用法令の規定に従い適用される。

レバレッジ

レバレッジは、適用あるESMAガイドラインおよびCSSF指令11 / 512に従い、各サブ・ファンドが利用する派生商品の「想定元本の総額」として確定される。この定義により、ヘッジ目的で利用される可能性がある派生商品を加えて算定する場合があり、レバレッジ額が人為的に高くなることがある。そのため、この算定結果は、投資者が負担する実際のレバレッジ・リスクを必ずしも正確には反映していない。

レバレッジがかけられる場合の予測レバレッジは、過去のデータに基づき、想定元本の総額と各サブ・ファンドの純資産価額との比率として以下の表に示されている。募集開始前のサブ・ファンドについては、予測レバレッジは、標準的ポートフォリオか、または類似するサブ・ファンドの投資に基

づいて算定される。一定の状況下では、すべてのサブ・ファンドについてレバレッジ額がより大きくなることもある。

サブ・ファンド	グローバル・リスク計算法
エマージング・マーケット・デッド	コミットメント・アプローチ
U S マルチ・クレジット・サステナブル	コミットメント・アプローチ
ハイ・イールド	コミットメント・アプローチ

証券金融取引およびトータル・リターン・スワップのエクスポージャー

サブ・ファンドのトータル・リターン・スワップ、レポ契約/リバース・レポ契約および証券貸付取引のエクスポージャー（いずれの場合も、純資産価額に対する割合）は、以下のとおりである。

サブ・ファンド	トータル・リターン・スワップ		レポ契約		リバース・レポ契約		証券貸付取引	
	予想値	最大値	予想値	最大値	予想値	最大値	予想値	最大値
エマージング・マーケット・デッド	0%～25%	25%	0%	0%	0%	0%	10%～20%	40%
U S マルチ・クレジット・サステナブル	0%～25%	25%	0%	0%	0%	0%	10%～20%	40%
ハイ・イールド	0%～25%	25%	0%	0%	0%	0%	10%～20%	40%

各サブ・ファンドに固有の投資方針

各サブ・ファンドの投資方針および戦略は、以下の通りであり、下記「(4) 投資制限」に記載される投資制限に常に従っている。疑義を避けるために付言すると、各サブ・ファンドは以下の制限に従うことを条件に、下記の資産クラスのエクスポージャーを取ることができる。

- () 資産担保証券：該当するサブ・ファンドの純資産の最大15%
- () モーゲージ・バック証券：該当するサブ・ファンドの純資産の最大15%
- () 偶発転換債券：該当するサブ・ファンドの純資産の最大15%
- () 破綻証券：該当するサブ・ファンドの純資産の最大10%

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

サブ・ファンドはアクティブな運用を行い、投資方針は長期的な実質利益を追求することであるが、この投資方針が達成される保証はない。

サブ・ファンドは、環境面、社会面またはガバナンス面（ESG）の特性を推進しているものではなく、サステナビリティまたはインパクトにおける目標を追求しているものでもない。投資戦略および投資先の投資対象の性質に基づいてサステナビリティ・リスクの検討を体系的に統合しているわけではない。現在のところ、サステナビリティ・リスクがサブ・ファンドのリターンへの目標達成に大きな影響を及ぼすことは予想されていない。サブ・ファンドの投資対象は、環境的に持続可能な経済活動のためのEU基準（タクソノミー規則第7条）を考慮したものではない。サブ・ファンドは金融サービスセクターにおけるサステナビリティ関連開示規則に関する欧州連合（EU）規則（「SFDR」）第6条を遵守する。したがって、サブ・ファンドの投資方針および投資先の投資対象の性質に起因する、サステナビリティ要因に及ぼす主要な悪影響を考慮していない（SFDR第7条（2））。

ポートフォリオ・マネージャーは、エマージング市場における債券戦略を行う専用ポートフォリオを通じて米ドル建ての債券に主として投資することにより、サブ・ファンドの投資方針の達成に努める。専用ポートフォリオにおいては、投資制限を総額ベースで適用する。サブ・ファンドはハイイールド債券に投資することができる。ポートフォリオ・マネージャーは、サブ・ファンドの投資方針を達成するためにデリバティブを利用することもできる。

サブ・ファンドが専用ポートフォリオにおいて保有する確定利付投資対象の大半は、JPモルガンEMBIグローバル・ディバースファイド・インデックスの60%およびJPモルガンCEMBIディバースファイド・インデックスの40%を合成した参考指標の構成銘柄内の発行体が発行している。投資戦略は、サブ・ファンドのデュレーション、セクターおよび国のエクスポージャーが参考指標から乖離することができる範囲に関して限定的な制限を課している。投資戦略は参考指標に対する確定利付の投資対象の組入比率に制限を設けていないが、これはサブ・ファンドのポートフォリオ構成が参考指標から大幅に乖離できることを意味している。投資運用会社は特定の投資機会を有効利用するために参考指標を構成していない確定利付の投資対象に投資する裁量を行使することができる。そのため、市場のボラティリティが高い期間においてサブ・ファンドの運用実績が参考指標から大幅に乖離することがある。

サブ・ファンドは、流動性の目的で短期金融商品、現金または現金等価物を保有することができる。

サブ・ファンドは、UCITSまたはその他のUCIの受益証券または投資証券にその純資産の10%を超えて投資しない。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット・サステナブル

サブ・ファンドは環境的および/または社会的な特性を推進し、金融サービスセクターにおけるサステナビリティ関連開示規則に関する欧州連合(EU)規則(「SFDR」)第8条に従う。環境的および/または社会的な特性に関する詳細は本書の「別紙B」に記載される(SFDRの細則(RTS)第14条(2))。

サブ・ファンドはアクティブな運用を行い、投資方針は専用ポートフォリオを通じて主に米ドル建ての債券に主として投資することにより、長期的な実質利益を追求することである。この投資方針が達成される保証はない。

専用ポートフォリオにおいては、投資制限を総額ベースで適用する。ポートフォリオ・マネージャーは、サブ・ファンドの投資方針を達成するためにデリバティブを利用することもできる。

サブ・ファンドが専用ポートフォリオにおいて保有する確定利付投資対象の大半は、参考指標であるブルームバーグUSコーポレート・インターメディアイト・インデックスの構成銘柄内の発行体が発行している。サブ・ファンドの参考指標をサブ・ファンドが推進するESG特性に一致させることは意図していない。投資戦略は、サブ・ファンドのデュレーション、セクターおよび国のエクスポージャーが参考指標から乖離することができる範囲に関して限定的な制限を課している。投資戦略は参考指標に対する確定利付の投資対象の組入比率に制限を設けていないが、これはサブ・ファンドのポートフォリオ構成が参考指標から大幅に乖離できることを意味している。投資運用会社は特定の投資機会を有効利用するために参考指標を構成していない確定利付の投資対象に投資する裁量を行することができる。そのため、市場のボラティリティが高い期間においてサブ・ファンドの運用実績が参考指標から大幅に乖離することがある。

原則として、サブ・ファンドは一時的に、その純資産の20%を上限として流動性資産を付随的に保有することもできる。例外的な市況の悪化を受けてそのように求められる場合で、かつ投資主の利益を考慮してそのような違反が正当化される場合に厳密に必要とされる期間に限り、上限の20%を一時的に超過するものとする。サブ・ファンドは、流動性の目的で短期金融商品、現金または現金等価物を保有することもできる。

サブ・ファンドは、UCITSまたはその他のUCIの受益証券または投資証券にその純資産の10%を超えて投資しない。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

サブ・ファンドはアクティブな運用を行い、投資方針は長期的な実質利益を追求することであるが、この投資方針が達成される保証はない。

サブ・ファンドは、環境面、社会面またはガバナンス面（ESG）の特性を推進しているものではなく、サステナビリティまたはインパクトにおける目標を追求しているものでもない。投資戦略および投資先の投資対象の性質に基づいてサステナビリティ・リスクの検討を体系的に統合しているわけではない。現在のところ、サステナビリティ・リスクがサブ・ファンドのリターンの目標達成に大きな影響を及ぼすことは予想されていない。サブ・ファンドの投資対象は、環境的に持続可能な経済活動のためのEU基準を考慮したものではない（タクソノミー規則第7条）。サブ・ファンドは金融サービスセクターにおけるサステナビリティ関連開示規則に関する欧州連合（EU）規則（「SFDR」）第6条を遵守する。したがって、サブ・ファンドの投資方針および投資先の投資対象の性質に起因する、サステナビリティ要因に及ぼす主要な悪影響を考慮していない（SFDR第7条（2））。

ポートフォリオ・マネージャーは、専用ポートフォリオを通じてハイ・イールド債券に主として投資することにより、サブ・ファンドの投資方針の達成に努める。専用ポートフォリオにおいては、投資制限を総額ベースで適用する。ポートフォリオ・マネージャーは、サブ・ファンドの投資方針を達成するためにデリバティブを利用することもできる。

サブ・ファンドが専用ポートフォリオにおいて保有する確定利付投資対象の大半は、ICE BofAメリルリンチUSハイ・イールド・コンストレインド・インデックスの60%およびICE BofAメリルリンチ・ユーロ・ハイ・イールド・コンストレインド・インデックスの40%を合成した参考指標の構成銘柄内の発行体が発行している。投資戦略は、サブ・ファンドのデュレーション、セクターおよび国のエクスポージャーが参考指標から乖離することができる範囲に関して限定的な制限を課している。投資戦略は参考指標に対する確定利付の投資対象の組入比率に制限を設けていないが、これはサブ・ファンドのポートフォリオ構成が参考指標から大幅に乖離できることを意味している。投資運用会社は特定の投資機会を有効利用するために参考指標を構成していない確定利付の投資対象に投資する裁量行使することができる。そのため、市場のボラティリティが高い期間においてサブ・ファンドの運用実績が参考指標から大幅に乖離することがある。

原則として、サブ・ファンドは一時的に、その純資産の20%を上限として流動性資産を付随的に保有することもできる。例外的な市況の悪化を受けてそのように求められる場合で、かつ投資主の利益を考慮してそのような違反が正当化される場合に厳密に必要とされる期間に限り、上限の20%を一時的に超過するものとする。サブ・ファンドは、流動性の目的で短期金融商品、現金または現金等価物を保有することができる。

サブ・ファンドは、UCITSまたはその他のUCIの受益証券または投資証券にその純資産の10%を超えて投資しない。

第四部 特別情報

第3 その他

<訂正前>

- (1) 日本語版目論見書の表紙に図案を採用する。
- (2) 交付目論見書の概要として、別紙を使用する。

<訂正後>

- (1) 日本語版目論見書の表紙に図案を採用する。
- (2) 交付目論見書の概要として、別紙Cを使用する。

別紙 A として、以下の内容を追加する。

別紙 A

定義

本書において、以下の用語は以下の意味を有する。

関連当事者とは、UBS（その子会社、関連会社、代表者または代理人を含む。）をいう。

本投資法人とは、マルチ・マネージャー・アクセス をいう。

ヘッジあり投資証券クラスとはその名称に「ヘッジ」を含み、サブ・ファンドの基準通貨以外の通貨建ての投資証券のクラスをいう。

指令2013 / 34 / EUとは、特定の種類の投資信託の年次財務諸表、連結財務諸表および関連する報告書に関する2013年6月26日付理事会指令2013 / 34 / EUをいう。

EPM技法とは、効率的なポートフォリオ運用の技法（（リバース）レポ取引または証券貸付取引等）をいう。

FATCAとは、外国口座税務コンプライアンス法をいう。

一流金融機関とは、本投資法人が選定する一流の金融機関で、店頭派生商品取引に関して慎重な監督に服し、かつ、CSSFにより承認されたカテゴリーに属し、このような種類の取引を専門にしている機関をいう。

IGAとは、ルクセンブルグおよびアメリカ合衆国との間で締結された政府間協定をいう。

KIIDとは、各サブ・ファンドまたは投資証券クラス（場合による。）の主要な投資家向け情報文書をいう。

短期金融商品とは、金融市場で通常取引される商品で、流動性があり、かつ、常時正確に算定できる価額を有する商品をいう。

OECDとは、経済協力開発機構をいう。

OECD加盟国とは、OECDに加盟している国をいう。

店頭とは、店頭（over-the-counter）をいう。

店頭派生商品とは、店頭で取引される金融派生商品をいう。

プロスペクトスとは、本投資法人の設立地の目論見書をいう。

規制を受ける市場とは、金融商品における市場に関する2004年4月21日付理事会指令2004/39/EECで定義される規制を受ける市場、または規制を受け、定期的に運営され、認められ、かつ公開されている、EEA内に設立されたその他の市場をいう。

SFDRとは、金融サービスセクターにおけるサステナビリティ関連開示に関する2019年11月27日付欧州議会および欧州理事会の規則 (EU) 2019/2088をいう。

SFDR細則 (RTS)とは、「著しい害を与えない」という原則に関連する情報の内容および提示の詳細を規定する細則に関して欧州議会および欧州理事会の規則 (EU) 2019/2088を補完する2022年4月6日の欧州委員会委任規則 (EU) 2022/1288をいい、サステナビリティ指標およびサステナビリティに対する悪影響に関する内容、メソロジーおよび提示ならびに契約前締結文書、ウェブサイトおよび定期報告書における環境的または社会的な特性の推進および持続可能な投資目的に関する情報の内容および提示について定めている。

タクソノミー規則 / TRとは、持続可能な投資を促進するための枠組みの確立に関する、規則 (EU) 2019/2088を改正する、2020年6月18日の欧州議会および欧州理事会の規則 (EU) 2020/852をいう。

譲渡性のある証券とは、株式その他株式同様の証券、債券その他の債務証書、2010年法第42条に記載された技法および手段以外の引受けまたは交換による譲渡性のある証券の取得権が付帯する他の流通証券をいう。

UBSとは、ユービーエス・スイス・エイ・ジー (その支店またはその関連会社、承継者もしくは権利承継者) という。

UCIとは、EU加盟国に所在しているか否かを問わず、UCITS指令第1条(2)a)およびb)の意味における投資信託をいう。ただし、かかるUCIが、EU法に規定されるものと同等であるとCSSFがみなす監督に服する旨および政府機関との間の協力が十分に保証される旨が定められた法律に基づき認可されていること、かかるUCIの受益者の保護水準が、UCITSの受益者に提供されるものと同等であること、特に、資産の分別管理、借入れ、貸付けおよび譲渡性のある証券と短期金融商品の空売りに関する規則がUCITS指令の要件と同等であること、かかるUCIの業務が、報告期間中の資産と負債、収益および事業運営についての評価を行うことができるように半期報告書および年次報告書で報告されることを条件とする。

UCITSとは、UCITS指令に基づく譲渡性のある証券を投資対象とする投資信託をいう。

UCITS指令とは、譲渡性のある証券を投資対象とする投資信託 (UCITS) に関する法律、規則および行政規定の調整に関する2009年7月13日付の欧州議会および理事会の指令2009/65/EC (改正済) をいう。

別紙Bとして、以下の内容を追加する。

別紙B

SFDR関連情報

規則(EU)2019/2088 第8条第1項、第2項および第2a項ならびに 規則(EU)2020/852 第6条第1項において言及される 金融商品に関する契約前の情報開示

商品名:マルチ・マネージャー・アクセス II-US マルチ・クレジット・サステナブル
法人識別番号:549300NRY3I4EJ7ZVO25

持続可能な投資とは、環境目的または社会目的に貢献する経済活動への投資をいう。ただし、当該投資が環境目的または社会目的を著しく害するものではないことおよび投資先企業が良好なガバナンス慣行に従っていることを条件とする。

EUタクソミーとは、規則(EU)2020/852に定められる分類システムであり、環境的に持続可能な経済活動の一覧を定めたものである。当該規則は、社会的に持続可能な経済活動の一覧を定めていない。環境目的を有する持続可能な投資は、タクソミーに適合している場合もあれば、適合していない場合もある。

環境的および／または社会的特性

この金融商品は持続可能な投資目的を有しているか？

はい

いいえ

以下の経済活動に対して環境目的を有する持続可能な投資を行う比率(下限):__%

EUタクソミーに基づき環境的に持続可能なものとして適格である経済活動

EUタクソミーに基づき環境的に持続可能なものとして適格でない経済活動

社会目的を有する持続可能な投資を行う比率(下限):__%

環境的／社会的(E/S)特性を促進するものであり、持続可能な投資を目的とはしていないものの、少なくとも5%の比率で以下の持続可能な投資を行う

EUタクソミーに基づき環境的に持続可能なものとして適格である経済活動への環境目的を有する持続可能な投資

EUタクソミーに基づき環境的に持続可能なものとして適格でない経済活動への環境目的を有する持続可能な投資

社会目的を有する持続可能な投資

E/S特性を促進するものではあるが、持続可能な投資を行わない

この金融商品により、いかなる環境的および／または社会的特性が促進されるか？

当サブ・ファンドは、最も重大なマイナスの環境リスクおよび／もしくは社会リスクを低減している発行体ならびに／または環境的および／もしくは社会的にプラスの貢献をしている発行体の投資対象に高い比率で投資することを目指すことにより、環境的および／または社会的な特性を推進する。当サブ・ファンドは、プラスのESG属性を有する発行体を参照ベンチマーク指数の投資ユニバースに比べて測定可能な水準で高く組み入れたポートフォリオを維持するよう努めるため、参照ベンチマーク指数のサステナビリティ・プロファイルを加重平均ベースで上回るサステナビリティ・プロファイルを得ることを目指す。当サブ・ファンドは、主要業種の大半にわたり投資する広域市場戦略をとっている。したがって、最も重大なマイナスの環境リスクは、各発行体の業種および業務に応じて異なる。

参照ベンチマーク指数は、環境的および／または社会的な特性に応じた構成銘柄の評価または組入れを行っていない広範な市場指数であるため、当サブ・ファンドが推進する特性に一致することを意図しているわけではない。当サブ・ファンドが推進する特性を実現することを目的として指定されているESG参照ベンチマークはない。



サステナビリティ指標とは、金融商品により促進される環境的または社会的特性がどのように実現されるかを測定するものである。

● **この金融商品により促進される環境的または社会的特性それぞれの実現度を測定するためにどのようなサステナビリティ指標が用いられるか？**

当サブ・ファンドが推進する環境的および／または社会的な特性の実現度を測定するのは加重平均ベースのサステナビリティ・プロフィールで、MSCI ESGスコア(業種調整ベース)を用いて算出される。

MSCI ESGレーティング/スコアは、企業による財政面に関連するESGのリスクおよび機会の管理を測定することを目指している。MSCIは、同業他社と比べてESGリスクのエクスポージャーおよびかかるリスクをいかに上手く管理しているかに応じて業界の先進企業および後進企業を識別するためのルールに基づいた方法を利用している。ESGリスクおよびESG機会は業種および企業に応じて異なる可能性があるため、MSCI ESGレーティングのモデルは、GICS®のあるサブ・インダストリー(業種)またはサブ・セクターにとって最も重要なESGリスクを特定する。

MSCI ESGのスコアおよびレーティングの手法は、<https://www.msci.com/our-solutions/esg-investing/esg-ratings>で参照することができる。

● **この金融商品が一定程度行うことを予定している持続可能な投資の目的は何か、また持続可能な投資は当該目的にどのように貢献するか？**

当サブ・ファンドが一定程度行うことを予定している持続可能な投資の目的は、「この金融商品により、いかなる環境的および／または社会的特性が促進されるか？」という質問に対して上記に記載される一または複数の環境的および／または社会的な特性に貢献することである。

● **この金融商品が一定程度行うことを予定している持続可能な投資は、環境面または社会面での持続可能な投資の目的に著しい害を及ぼすことをいかにして避けるのか？**

当サブ・ファンドが一定程度行うことを予定している持続可能な投資について、ポートフォリオ・マネージャーは、サステナビリティ要因に対する主要な悪影響のための関連指標ならびにグローバル規範、すなわち国連グローバル・コンパクト(UNGC)原則、経済協力開発機構(OECD)多国籍企業行動指針、国連ビジネスと人権に関する指導原則(労働における基本的原則及び権利に関する国際労働機関(ILO)宣言ならびに国際人権章典において定める8つの基本条約に記載される原則および権利を含む。)の遵守を考慮する。

当サブ・ファンドはリサーチおよび投資意思決定プロセスを通じて、最も重大なマイナスの社会リスクおよび環境リスクの存在が明らかになる商品の製造または事業活動を行っている発行体またはセクターを除外する。当サブ・ファンドはタバコの製造、風俗産業、原子力発電または燃料炭から売上げのかなりの部分を得ている企業にも、石炭発電を利用して売上げのかなりの部分を得ている企業にも直接的に投資しない。さらに、当サブ・ファンドは非人道的兵器および軍需資材に関わっているのエクスポージャーを除外するものとする。

— **サステナビリティ要因への悪影響の指標はどのように考慮されているのか？**

当サブ・ファンドは、ポートフォリオ運用の決定または非人道的な活動もしくは業務に関わる発行体またはセクターの除外を組み合わせ、自らの投資対象が社会および環境に及ぼす悪影響を検討する。

当サブ・ファンドが重視するサステナビリティ要因に及ぼす悪影響のための指標には、非人道的兵器のエクスポージャーおよび国連グローバル・コンパクト原則への抵触等が含まれる(ただし、これらに限定されない)。

主要な悪影響とは、環境、社会および従業員に関する事項、人権の尊重、汚職防止および贈収賄防止に関する事項に関するサステナビリティ要因に投資決定が及ぼす最も重大なマイナスの影響である。

持続可能な投資はOECD多国籍企業行動指針および国連ビジネスと人権に関する指導原則にどのように適合しているか？(詳細)

OECD多国籍企業行動指針ならびに国連ビジネスと人権に関する指導原則に違反し、信頼に値する是正措置を取らない発行体は、ポートフォリオにおける持続可能な投資対象としての適格性を有していない。

EUタクソミーは、タクソミー適合投資はEUタクソミーの目的を著しく害するものであってはならないという「著しい害を及ぼさない」原則を定めており、具体的なEU基準が伴う。

「著しい害を及ぼさない」原則は、環境的に持続可能な経済活動に関するEU基準を考慮している当サブ・ファンドの原投資対象のみに適用される。当サブ・ファンドの残りの部分の原投資対象は、環境的に持続可能な経済活動に関するEU基準を考慮したものではない。

その他の持続可能な投資も、環境目的または社会目的を著しく害してはならない。



この金融商品はサステナビリティ要因への主要な悪影響を考慮するか？

- 考慮する。当サブ・ファンドは非人道的兵器および軍事兵器に関わる発行体のエクスポージャーを取得しない。国連グローバル・コンパクト(UNG)、OECD多国籍企業行動指針ならびに国連のビジネスおよび人権に関する指導原則等の国際規範に違反し、信頼に値する是正措置を取らない発行体は、ポートフォリオにおける持続可能な投資対象としての適格性を有していない。

考慮しない。

この金融商品が用いる投資戦略はどのようなものか？

ESGインテグレーション

ESGインテグレーションは、特定の倫理的な原則または規範に左右されるのではなく、投資リターンに影響を及ぼしかねない環境、社会およびガバナンス(「ESG」)リスクを考慮することにより行われる。重大なサステナビリティ/ESG問題の分析には、多くの異なる側面(カーボン・フットプリント、従業員の健康および福利厚生、サプライ・チェーンの管理、顧客の公平な取扱いならびに企業のガバナンスのプロセス等)が含まれることがある。

ポジティブ・ティルト

ポートフォリオ・マネージャーは投資プロセスの一環として、各投資対象の環境、社会およびガバナンス(「ESG」)特性を検討し、力強いESG慣行を有し、かつ参照ベンチマーク指標の水準を下回るカーボン・インテンシティ(CO2排出原単位)を目標としていると自身が判断する発行体に投資するよう努める。ポートフォリオ・マネージャーは、同業他社と比べて力強いESG慣行を有する企業の投資対象を高い比率で組み入れることを目指している。

ポートフォリオ・マネージャーは、環境および/または社会に直接役立つプロジェクトに充当する、発行代金の明確な資金用途またはサステナビリティ・パフォーマンス目標を定めている確定利付商品(グリーン・ボンド、ソーシャル・ボンドまたは科学的根拠に基づく目標イニシアチブ(SBTi)の基準を満たしている債券等)に投資することもある。

ポートフォリオ・マネージャーは、様々な自社の独立したツールおよびデータ・ソース(エンゲージメントを検討するため、および投資選択プロセスにおける自社の独立したファンダメンタルズ・リサーチおよび独立した格付を含むが、これらに限られない。)を利用する。

投資戦略とは、投資目的およびリスク許容度等の要素に基づく投資判断の指針となるものである。



ポートフォリオ・マネージャーは、潜在的な投資対象を分析および検証する上で様々な情報源(ESGリサーチ・プロバイダー、金融専門誌およびマスコミの報道、他の金融機関のアナリストおよびブローカーならびに信用格付サービスを含む。)を頼りにしている。除外事項は、定評のある第三者のリサーチ・プロバイダーから集めた情報ソースに基づいている。

除外事項(エクスクルージョン)

当サブ・ファンドはリサーチおよび投資意思決定プロセスを通じて、最も重大なマイナスの社会リスクおよび環境リスクの存在が明らかになる商品の製造または事業活動を行っている発行体またはセクターを除外する。当サブ・ファンドはタバコの製造、風俗産業、原子力発電または燃料炭から売上げのかなりの部分を得ている企業にも、石炭発電を利用して売上げのかなりの部分を得ている企業にも直接的に投資しない。さらに、当サブ・ファンドの専門ポートフォリオは非人道的兵器および軍需資材に関わっている発行体のエクスポージャーを除外するものとする。

● この金融商品により促進される環境的または社会的特性それぞれを実現するための投資対象を選定するために用いられる投資戦略の結合要素はどのようなものか？

当サブ・ファンドが推進する特性を実現するための投資対象の選別のために、投資戦略の以下の一または複数の結合要素が利用される。

当サブ・ファンドの参照ベンチマーク指数のサステナビリティ・プロファイルが加重平均されたサステナビリティ・プロファイルを上回る部分。

加重平均されたサステナビリティ・プロファイルの算出において現金、デリバティブおよび無格付の投資対象を考慮しない。

● 当該投資戦略を適用する前に考慮される、投資範囲を縮小するための確約された最低比率はどのくらいか？

投資戦略を適用する前に考慮される、投資範囲を縮小するための確約された最低比率はない。

● 投資先企業の良好なガバナンス慣行を評価するための方針とはどのようなものか？

良好なガバナンスの評価には、コーポレート・ガバナンス、透明性、環境フットプリントおよび業務の生産性、雇用基準ならびにサプライチェーンのモニタリング、取締役会のダイバーシティ、および不正防止と腐敗防止のガイドラインなどの分野が含まれるが、これらに限定されない。

調査および投資決定プロセスにおいて、各発行体は、魅力的なリターン機会を提供すると同時に強力なガバナンス慣行を促進する発行体を特定するために外部のデータプロバイダーの評価およびポートフォリオ・マネージャーの社内調査を組み合わせ、優れたガバナンス基準に照らして系統的に評価される。ここには一般的に、発行体が持続可能な活動から得る収益(「何を実行するか」)の評価に加えて当該事業のサステナビリティおよびガバナンス(「どのように実行するか」)の評価の両方が含まれる。

良好なガバナンス慣行には、健全な経営体質、従業員関係、スタッフの報酬および税務コンプライアンスが含まれる。



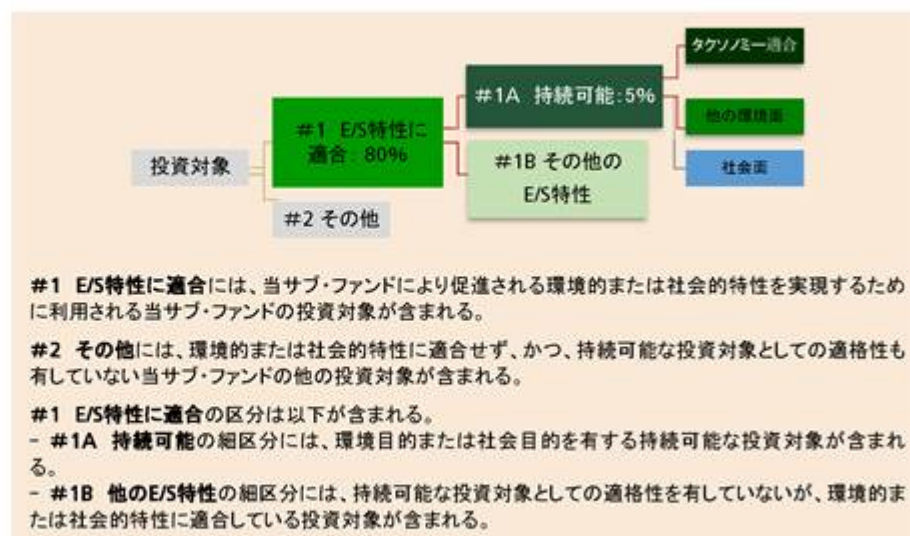
資産配分とは、特定の資産への投資の割合を説明するものである。

タクソミー適合活動は、以下のものに占める割合として表される。

- 投資先企業のグリーン活動による収益の割合を反映した**売上高**
- 投資先企業が行うグリーン投資(例えば、グリーン経済への移行のためのもの)を示す**資本的支出(CapEx)**
- 投資先企業のグリーン事業活動を反映した**事業運営費(OpEx)**

この金融商品について予定されている資産配分はどのようなものか？

当サブ・ファンドが推進する環境的および/または社会的特性を満たすために利用される投資対象の比率の下限は80%である。当サブ・ファンドの持続可能な投資対象の比率の下限は5%である。



● この金融商品により促進される環境的または社会的特性はデリバティブの利用によりどのように実現されるか？

当サブ・ファンドが推進する特性の実現のためにデリバティブは利用されない。デリバティブは、主としてヘッジ目的および流動性管理目的のために利用される。



環境目的を有する持続可能な投資は少なくともどの程度EUタクソミーに適合しているか？

タクソミー規則第9条が定める一または複数の環境目的に関するデータならびに当サブ・ファンドが行う投資がタクソミー規則第3条に基づき環境的に持続可能なものとしての適格性を有する経済活動に対してどのようおよびどの程度行われているか(以下「タクソミー適合投資」という。)に関するデータを収集できていない。これに基づき、当サブ・ファンドのタクソミー適合投資は0%である。

イネープリング活動とは、環境目的に多大な貢献をすることが直接的に可能になる他の活動をいう。

トランジショナル活動とは、二酸化炭素の削減のための代替手段を未だに利用できないものの、特にベスト・パフォーマンスに応じた温室効果ガス排出量の水準を定めている活動をいう。

以下の2つのグラフは、EUタクソミーに適合している投資対象の最低割合を線(本書に該当箇所はない。)で示している。ソブリン債*のタクソミー適合性を判断する適切な方法がないため、1つ目のグラフは、この金融商品のソブリン債を含むすべての投資対象に関してタクソミー適合性を示しているが、2つ目のグラフは、この金融商品のソブリン債以外の投資対象に関してのみタクソミー適合性を示している。



*これらのグラフの解釈上、「ソブリン債」はすべてのソブリン・エクスポージャーで構成される。

トランジショナル活動およびイネープリング活動への投資の最低割合はどのくらいか？

トランジショナル活動およびイネープリング活動への投資の最低割合は確約されていない。



は、EUタクソミーに基づく環境的に持続可能な経済活動の基準を考慮していない、環境目的を有する持続可能な投資である



EUタクソミーに適合していない、環境目的を有する持続可能な投資の最低割合はどのくらいか？

当サブ・ファンドは、環境的に持続可能であるがEUタクソミーに適合していない経済活動に投資するが、これは必要とされる施行法規がないことならびに特に投資先企業が提供する必要なタクソミー関連データおよび明確に規定された計算方法がないことに因る。当サブ・ファンドは、EUタクソミーに適合していない環境面の目的を有する持続可能な投資の最低割合を0%より高くすることを目指している。



社会的に持続可能な投資の最低割合はどのくらいか？

当サブ・ファンドは、社会的に持続可能な投資の最低割合を0%より高くすることを目指している。

どのような投資対象が「#2 その他」に含まれるのか、かかる投資対象の目的は何か、また最低限の環境セーフガードまたは社会セーフガードはあるのか？

流動性、効率的なポートフォリオ・リスク運用およびヘッジを目的とする現金および無格付商品が「#2 その他」に含まれる。無格付商品には、環境的または社会的特性の実現度の測定に必要とされるデータを入手することができない有価証券が含まれることもある。



この金融商品がこの金融商品の促進する環境的および／または社会的特性に適合しているかを判断するための参照ベンチマークとして特定の指数が指定されるのか？

当サブ・ファンドが推進する特性に当サブ・ファンドが適合しているかを判断することを目的として指定されているESG参照ベンチマークはない。

- **参照ベンチマークは、この金融商品により促進される環境的または社会的特性それぞれとどのように継続的に適合するのか？**

該当なし。

- **投資戦略と指数の手法の適合性はどのように継続的に確保されるのか？**

該当なし。

- **指定指数は、関連する広範な市場指数とどのように異なるのか？**

該当なし。

- **指定指数の算出のために用いられる方法を探す場合、どこを参照すればよいのか？**

該当なし。

参照ベンチマークとは、金融商品が当該金融商品の促進する環境的または社会的特性を実現するかを測定するための指数である。



より詳細な商品特有の情報をオンラインで探す場合、どこを参照すればよいのか？

より詳細な商品特有の情報は、ウェブサイト(<https://www.fundinfo.com/>)で参照することができる。

交付目論見書の概要

<訂正前>

- 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

本概要は、交付目論見書本文の証券情報、ファンドの状況等を要約したもので、交付目論見書の一部です。

詳細につきましては、交付目論見書本文の該当ページをご覧ください。

形態	ルクセンブルグ籍オープンエンド会社型外国投資証券
投資方針 投資目的	<p>- エマージング・マーケット・デッドはアクティブな運用を行い、投資方針は長期的な実質利益を追求することです。ポートフォリオ・マネージャーは、エマージング市場における債券戦略を行う専用ポートフォリオを通じて米ドル建ての債券に主として投資することにより、エマージング・マーケット・デッドの投資方針の達成に努めます。</p> <p>- US マルチ・クレジット・サステナブルはアクティブな運用を行い、投資方針は専用ポートフォリオを通じて主に米ドル建ての債券に主として投資することにより、長期的な実質利益を追求することです。 <u>投資プロセスの一部として、投資運用会社は各証券の発行体の環境、社会およびガバナンス(「ESG」)の特性を検討し、力強いESGの慣行を有していると考えられる企業または発行体への投資に努めます。</u></p> <p>- ハイ・イールドはアクティブな運用を行い、投資方針は長期的な実質利益を追求することです。ポートフォリオ・マネージャーは、専用ポートフォリオを通じてハイ・イールド債券に主として投資することにより、ハイ・イールドの投資方針の達成に努めます。</p>
リスク要因	価格変動リスク/金利変動リスク/信用リスク/カントリー・リスク/為替変動リスク/先物取引に関するリスク/派生商品の利用に伴うリスク/新興国市場への投資に関するリスク 等
お申込単位	原則として1口以上0.001口単位。また金額単位の申込みも受け付けますが、かかる申込みについては、日本における販売会社が定めます。詳細については日本における販売会社にご照会下さい。
お申込受付日	原則として、ファンド営業日かつ日本における販売会社および販売取扱会社の営業日かつ日本の通常の銀行の営業日。ただし、営業日であってもお申込みいただけない場合がありますので、詳しくは、販売会社および販売取扱会社にお問合せ下さい。
お申込価格	各申込日の翌ファンド営業日に計算される投資証券1口当たりの純資産価格です。
お申込手数料	お申込手数料はございません。
お買戻価格	ファンドが買戻請求を受領した日の翌ファンド営業日に決定される投資証券1口当たりの純資産価格
受渡し	約定日から起算して約定日を含む日本における4営業日目
存続期間	無制限

報酬	<p>エマージング・マーケット・デッド 純資産額の上限年率1.25%</p> <p>US マルチ・クレジット・サステナブル 純資産額の上限年率0.85%</p> <p>ハイ・イールド 純資産額の上限年率1.25%</p>
その他の費用・手数料	<p>- ファンドは、あらゆる運用費用および管理事務費用、ならびに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、特にルクセンブルグの年次税(0.01%)を負担します。</p> <p>- 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ます。</p> <p>- 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、またはファンド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ます。</p> <p>その他の費用については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。</p>
課税関係	<p>ファンドの投資証券への投資に対する課税については、他の上場外国株式において受領する所得に対するものと同じ取扱いとなります。</p>
日本における販売会社	<p>UBS SuMi TRUSTウェルス・マネジメント株式会社</p>

投資主の皆様におかれましては、本交付目論見書をよくお読みいただき、商品の内容およびリスクを十分ご理解のうえ、お申込くださいますようお願い申し上げます。

<訂正後>

別紙 C

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

本概要は、交付目論見書本文の証券情報、ファンドの状況等を要約したもので、交付目論見書の一部です。

詳細につきましては、交付目論見書本文の該当ページをご覧ください。

形態	ルクセンブルグ籍オープンエンド会社型外国投資証券	
投資方針 投資目的	<ul style="list-style-type: none"> - エマージング・マーケット・デッドはアクティブな運用を行い、投資方針は長期的な実質利益を追求することです。ポートフォリオ・マネージャーは、エマージング市場における債券戦略を行う専用ポートフォリオを通じて米ドル建ての債券に主として投資することにより、エマージング・マーケット・デッドの投資方針の達成に努めます。 - US マルチ・クレジット・サステナブルはアクティブな運用を行い、投資方針は専用ポートフォリオを通じて主に米ドル建ての債券に主として投資することにより、長期的な実質利益を追求することです。 - ハイ・イールドはアクティブな運用を行い、投資方針は長期的な実質利益を追求することです。ポートフォリオ・マネージャーは、専用ポートフォリオを通じてハイ・イールド債券に主として投資することにより、ハイ・イールドの投資方針の達成に努めます。 	
リスク要因	価格変動リスク/金利変動リスク/信用リスク/カントリー・リスク/為替変動リスク/先物取引に関するリスク/派生商品の利用に伴うリスク/新興国市場への投資に関するリスク 等	
お申込単位	原則として1口以上0.001口単位。また金額単位の申込みも受け付けますが、かかる申込みについては、日本における販売会社が定めます。詳細については日本における販売会社にご照会下さい。	
お申込受付日	原則として、ファンド営業日かつ日本における販売会社および販売取扱会社の営業日かつ日本の通常の銀行の営業日。ただし、営業日であってもお申込みいただけない場合がありますので、詳しくは、販売会社および販売取扱会社にお問合せ下さい。	
お申込価格	各申込日の翌ファンド営業日に計算される投資証券1口当たりの純資産価格です。	
お申込手数料	お申込手数料はございません。	
お買戻価格	ファンドが買戻請求を受領した日の翌ファンド営業日に決定される投資証券1口当たりの純資産価格	
受渡し	約定日から起算して約定日を含む日本における4営業日目	
存続期間	無制限	
報酬	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	純資産額の上限年率1.25% 純資産額の上限年率0.85% 純資産額の上限年率1.25%

その他の費用・ 手数料	<ul style="list-style-type: none">- ファンドは、あらゆる運用費用および管理事務費用、ならびに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、特にルクセンブルグの年次税(0.01%)を負担します。- 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ます。- 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、またはファンド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ます。 <p>その他の費用については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。</p>
課税関係	ファンドの投資証券への投資に対する課税については、他の上場外国株式において受領する所得に対するものと同じ取扱いとなります。
日本における 販売会社	UBS SuMi TRUSTウェルス・マネジメント株式会社

投資主の皆様におかれましては、本交付目論見書をよくお読みいただき、商品の内容およびリスクを十分ご理解のうえ、お申込くださいますようお願い申し上げます。